

浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券
投资基金
2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 2 月 7 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	49
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	52
§9 开放式基金份额变动	53
§10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息	57

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	浦银安盛经济带崛起混合
基金主代码	519175
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 2 月 7 日
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	694,422,406.18 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对股票、固定收益证券、现金等资产的积极灵活配置，并通过重点关注受益于经济带发展带来的投资机会，在严格控制风险并保证充分流动性的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	资产配置策略采用浦银安盛资产配置模型，通过宏观经济、估值水平、流动性和市场政策等四个因素的分析框架，动态把握不同资产类别的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化，进行股票、固定收益证券和现金等大类资产的合理配置，在严格控制投资风险的基础上追求基金资产的长期持续稳定增长。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*55%+中证全债指数收益率*45%
风险收益特征	本基金为混合型基金，本基金属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浦银安盛基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	张志永
	联系电话	021-23212888	021-52629999-212004
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	zhangzhy@cib.com.cn

客户服务电话	021-33079999 或 400-8828-999	95561
传真	021-23212985	021-62159217
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 981 号 3 幢 316 室	福州市湖东路 154 号
办公地址	上海市淮海中路 381 号中 环广场 38 楼	上海市江宁路 168 号兴业大厦 20 楼
邮政编码	200020	200041
法定代表人	谢伟	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年2月7日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	4,872,552.05
本期利润	5,940,326.40
加权平均基金份额本期利润	0.0085
本期加权平均净值利润率	0.85%
本期基金份额净值增长率	0.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	4,942,990.92
期末可供分配基金份额利润	0.0071
期末基金资产净值	700,349,400.93
期末基金份额净值	1.009
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	0.90%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

5、本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，上述财务指标的实际期间为 2017 年 2 月 7 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日。

3.2 基金净值表现

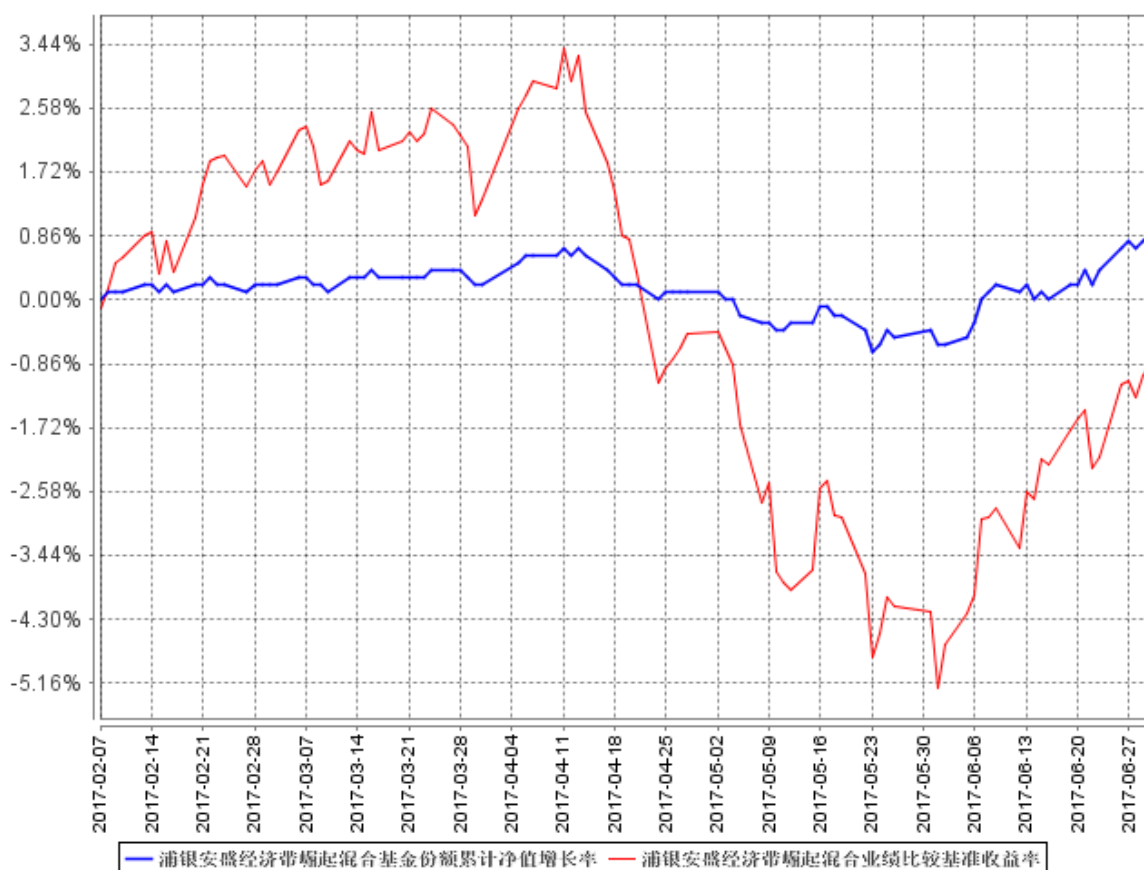
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.31%	0.15%	3.51%	0.52%	-2.20%	-0.37%
过去三个月	0.70%	0.14%	-2.16%	0.58%	2.86%	-0.44%

自基金合同生效起至今	0.90%	0.12%	-0.83%	0.50%	1.73%	-0.38%
------------	-------	-------	--------	-------	-------	--------

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛经济带崛起混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2017 年 2 月 7 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未滿 1 年。

2、根据基金合同第十二部分第四条规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为 2017 年 2 月 7 日至 2017 年 9 月 6 日。截止本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浦银安盛基金管理有限公司（以下简称“浦银安盛”）成立于 2007 年 8 月，股东为上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A. 及上海国盛集团资产有限公司，公司总部设在上海，注册资本为人民币 2.8 亿元，股东持股比例分别为 51%、39%和 10%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理、境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务。

截至 2017 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 33 只基金，即浦银安盛价值成长混合型证券投资基金、浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛红利精选混合型证券投资基金、浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金、浦银安盛 6 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛日日盈货币市场基金、浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金、浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛幸福聚益 18 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金、浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金、浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金及浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金(LOF)。

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统，这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成，之后日常的维护管理由公司负责，但与第三方服务公司签订有技术服务合同，由其

提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户子系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统等。这些系统也主要是在公司筹建之初采购专业系统提供商的产品建设而成，建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级，升级由系统提供商负责完成，升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。业务应用系统日常的维护管理由公司负责，但与系统提供商签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外，我公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

另外，本公司可以根据自身发展战略的需要，委托资质良好的基金服务机构代为办理基金份额登记、估值核算等业务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
褚艳辉	公司旗下浦银安盛新经济结构混合基金、浦银安盛盛世精选混合基金基金经理、浦银安盛经济带崛起混合基金、浦银安盛安和回报定期开放混合基金基金经理。	2017年2月7日	-	9	褚艳辉先生，南京理工大学经济学硕士。2004年至2010年，先后就职于上海信息中心、爱建证券公司从事宏观经济、政策以及制造与消费行业研究工作，后在上海汽车财务公司担任投资经理助理之职。2011年4月加盟我司担任高级行业研究员。2013年2月至2014年6月，担任本公司权益类基金基金经理助理。2014年6月起，担任公司旗下浦银安盛盛世精选混合基金基金经理。2014年7月起，兼任公司旗下浦银安盛新经济结构混合基金基金经理。2017年2月起，兼任公司旗下浦银安盛经济带崛起混合基金基金经理。2017年3月起，兼任公司旗下浦银安盛安和回报定期开放混合基金基金经

					理。
--	--	--	--	--	----

注：1、述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，以及公司的规章制度，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《公平交易管理规定》，建立健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在具体执行中，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平的提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度，保证公募基金及专户业务的独立投资决策机制；在交易执行环节上，详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规定，以保证投资执行交易过程的公平性；从事后监控角度上，一方面是定期对股票交易情况进行分析，对不同时间窗口（同日，3日，5日）发生的不同组合对同一股票的同向交易及反向交易进行价差分析，并进行统计显著性的检验，以确定交易价差对相关基金的业绩差异的贡献度；同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异的分析；另一方面是公司公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查，并对发现的问题进行及时的报告。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在违反法律、法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件认定的异常交易行为。报告期内未发生旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，股票市场演绎了风格上的“冷热分明”，结构上呈现出“越大越美”、“越便宜越好”的特征。我们认为，这其中既体现沪港通、深港通等增量资金的偏好，也有市场风险情绪的原因，但最终可能反映了中观产业结构上的改变。

报告期内，本基金的权益类资产占比处于逐步增加的阶段。虽然有“雄安新区”、“一带一路”、粤港澳大湾区等主题性机会，但股价体现为过山车行情。基金重点挖掘受益于经济带建设的相关机会，如设计规划、建材与基建、生态园林等。考虑到基金处于建仓期，因此操作上相对稳健。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0090 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.90%，业绩比较基准收益率为-0.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，基建投资的托底、制造业投资的修复、进出口的改善，特别是消费内需的提升，国内经济有望展现其韧性一面。金融去杠杆和供给侧结构性改革为经济增长质量保驾护航。货币政策不太会出现方向性的变化，利率进一步提升的空间不大。

证券市场改革效果将逐步体现，包括 IPO、再融资、减持新规等。国际投资者通过沪港通、深港通，以及新近的 MSCI 指数，可能对 A 股的投资理念、市场格局、估值体系等产生影响。

中观的行业层面上，随着钢铁、煤炭、有色、化工等行业供给侧改革的推进，行业格局得到改善。新能源汽车、消费电子、可选消费品等仍是亮点，值得关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了浦银安盛基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由公司分管高管、金融工程部负责人、研究部负责人、风险管理部和监察稽核部负责人、基金运营部负责人组成。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验、胜任能力和独立性。估值委员会的职

责主要包括：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金基金经理未参与或决定基金的估值。

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签订了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

本基金管理人与中证指数有限公司签订了《债券估值数据服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》第十六部分第三条约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

- 1、本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
- 2、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	66,646,168.48	-
结算备付金		1,639,183.84	-
存出保证金		63,241.72	-
交易性金融资产	6.4.7.2	183,091,774.81	-
其中：股票投资		123,677,774.81	-
基金投资		-	-
债券投资		59,414,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	410,933,354.88	-
应收证券清算款		40,058,937.47	-
应收利息	6.4.7.5	988,069.22	-
应收股利		-	-
应收申购款		4,138.52	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		703,424,868.94	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		421,727.64	-
应付赎回款		1,303,947.60	-
应付管理人报酬		878,184.59	-
应付托管费		146,364.09	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	159,536.10	-

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	165,707.99	-
负债合计		3,075,468.01	-
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	694,422,406.18	-
未分配利润	6.4.7.10	5,926,994.75	-
所有者权益合计		700,349,400.93	-
负债和所有者权益总计		703,424,868.94	-

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0090 元，基金份额总额 694,422,406.18 份。

6.2 利润表

会计主体：浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年2月7日(基金 合同生效日)至2017 年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年6月30日
一、收入		11,238,346.99	-
1.利息收入		10,059,824.95	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,902,472.03	-
债券利息收入		1,333,398.00	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,823,954.92	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-52,022.88	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-759,696.13	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-254,677.72	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	962,350.97	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,067,774.35	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	162,770.57	-

减：二、费用		5,298,020.59	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,123,251.06	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	687,208.52	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	313,154.00	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	174,407.01	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,940,326.40	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,940,326.40	-

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	694,558,884.11	-	694,558,884.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,940,326.40	5,940,326.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-136,477.93	-13,331.65	-149,809.58
其中：1.基金申购款	63,683,816.14	-68,983.57	63,614,832.57
2.基金赎回款	-63,820,294.07	55,651.92	-63,764,642.15
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基	694,422,406.18	5,926,994.75	700,349,400.93

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益(基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	-	-	-

注：本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

 郁蓓华 郁蓓华 钱琨
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1518号《关于准予浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和机构部函[2016]2717号《关于浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》核准，由浦银安盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 694,558,884.11 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 114 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 2 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 695,151,366.12 份基金份额，其中认购资金利息折合 592,482.01 份基金份额。本基金的基金管理人为浦银安盛基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为：具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债）、货币市场工具（含中期票据）、权证、资产支持证券、股指期货、银行存款、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 0%-95%；现金、债券资产、资产支持证券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*55%+中证全债指数收益率*45%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《浦银安盛经济带崛起混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、

完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 2 月 7 日（合同成立日）至 2017 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

人民币

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申

购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

（3）在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允

价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	36,646,168.48
定期存款	30,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	66,646,168.48

注：本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	122,679,510.46	123,677,774.81	998,264.35	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	59,344,490.00	59,414,000.00	69,510.00
	合计	59,344,490.00	59,414,000.00	69,510.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	182,024,000.46	183,091,774.81	1,067,774.35	

注：本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	209,923,354.88	-
买入返售证券_固定平台	201,010,000.00	-
合计	410,933,354.88	-

注：本基金在上年度末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金在本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	31,480.65
应收定期存款利息	36,749.97
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	737.60
应收债券利息	220,335.58
应收买入返售证券利息	698,737.02
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	28.40
合计	988,069.22

注：此处其他列示的是基金存于上交所与深交所的结算保证金的期末应收利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金在本报告期末未持有其他资产。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上

年度可比期间。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	142,840.42
银行间市场应付交易费用	16,695.68
合计	159,536.10

注：本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,268.79
预提费用	162,439.20
合计	165,707.99

注：本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年2月7日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	695,151,366.12	695,151,366.12
本期申购	63,091,334.13	63,091,334.13
本期赎回(以“-”号填列)	-63,820,294.07	-63,820,294.07
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	694,422,406.18	694,422,406.18

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-

本期利润	4,872,552.05	1,067,774.35	5,940,326.40
本期基金份额交易产生的变动数	70,438.87	-83,770.52	-13,331.65
其中：基金申购款	456,095.60	-525,079.17	-68,983.57
基金赎回款	-385,656.73	441,308.65	55,651.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,942,990.92	984,003.83	5,926,994.75

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年2月7日(基金合同生效日)至2017年6月30日
活期存款利息收入	-
定期存款利息收入	5,387,597.20
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,960.54
其他	508,914.29
合计	5,902,472.03

注：此处其他列示的是基金上交所与深交所结算保证金利息以及基金申购款滞留利息。本基金《基金合同》生效日为2017年2月7日，无上年度可比期间。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年2月7日(基金合同生效日)至2017年6月30日
卖出股票成交总额	60,825,945.75
减：卖出股票成本总额	61,585,641.88
买卖股票差价收入	-759,696.13

注：本基金《基金合同》生效日为2017年2月7日，无上年度可比期间。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年2月7日(基金合同生效日)至2017年6月30日
----	-------------------------------------

	月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-254,677.72
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-254,677.72

注：本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年2月7日(基金合同生效日)至2017年6 月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	580,395,987.02
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	579,407,607.54
减：应收利息总额	1,243,057.20
买卖债券差价收入	-254,677.72

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	962,350.97
基金投资产生的股利收益	-
合计	962,350.97

注：本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2017
------	-------------------------------------

	年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,067,774.35
——股票投资	998,264.35
——债券投资	69,510.00
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	1,067,774.35

注：本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	160,285.81
转换费收入	2,484.76
合计	162,770.57

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

3. 本基金本报告期内无其他收入。

4. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	309,554.00
银行间市场交易费用	3,600.00
合计	313,154.00

注：本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	30,731.04
信息披露费	131,708.16
银行汇划费用	8,867.81
债券帐户维护费	3,000.00
其他费用	100.00
合计	174,407.01

注：本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
浦银安盛基金管理有限公司	基金管理人、基金代销机构
兴业银行股份有限公司“兴业银行”	基金托管人、基金代销机构
上海浦东发展银行股份有限公司“上海浦东发展银行”	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金在本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金在本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期无应支付关联方的佣金。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 2 月 7 日(基金合同生效 日)至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,123,251.06	-
其中：支付销售机构的客户维护费	2,017,635.03	-

注：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年2月7日(基金合同生效日) 至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	687,208.52	-

注：在通常情况下，基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人在本报告期内未持有本基金。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 2 月 7 日，无上年度可比期间。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年2月7日(基金合同生效日)至 2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	36,646,168.48	31,480.65	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。本基金《基金合同》生效日为2017年2月7日，无上年度可比期间。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

1、2017年02月08日兴业银行上海分行定期存款1笔，金额13000万元，到期日2017年05月05日。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600657	信达地产	2017年6月19日	临时停牌	5.76	-	-	250,000	1,482,500.00	1,440,000.00	-
600653	中华控股	2017年5月8日	临时停牌	3.26	-	-	360,000	1,429,200.00	1,173,600.00	-
600643	爱建集团	2017年4月17日	临时停牌	14.98	-	-	38,000	529,720.00	569,240.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截止本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，本基金属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债）、货币市场工具（含中期票据）、权证、资产支持证券、股指期货、银

行存款、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。本基金的股票投资比例为基金资产的 0%-95%；现金、债券资产、资产支持证券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金一方面按照自上而下的方法对基金的资产配置、久期管理、类属配置进行动态管理，寻找各类资产的潜在良好投资机会，一方面在个券选择上采用自下而上的方法，通过流动性考察和信用分析策略进行筛选。整体投资通过对风险的严格控制，运用多种积极的资产管理增值策略，实现投资目标。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理，设立了三层次的风险控制体系：第一层次为各业务部门对各自部门潜在风险的自我管理和检查；第二层次为公司总经理领导的管理层、风险控制委员会、风险管理部的风险管理；第三层次为董事会层面对公司的风险管理，包括董事会、合规及审计委员会、督察长。

本基金管理人下设的各业务部门是公司第一线风险控制的实施者，均备有符合法律法规、公司政策的业务流程，其中包含与其业务相关的风险控制措施、风险管理计划、工作流程和管理责任。这些流程均得到公司管理层的批准。

本基金管理人设立的风险控制委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权利机构，主要负责制定公司的风险管理政策，并监督实施，确保公司整体风险暴露得到有效的识别、评估、监控和控制。公司设立风险管理部与监察稽核部监控公司面临的各类风险。风险管理部建立了定性和数量化分析模型进行基金投资风险和绩效评估，根据基金相关法律法规、公司基本制度及业务流程，对信息披露、法律文件等进行事中审核，并对基金管理人经营活动及各职能部门履职情况的合法合规性进行监督和检查。

董事会下属的合规及审计委员会，负责对公司整体风险管理和内部控制的有效性进行审议和评估。同时，督察长及合规及审计委员会负责检查、评价公司风险控制的充分性和有效性，并向董事会报告。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险可能产生的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风

险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行兴业银行和其他资质较好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的含国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 8.48%(本基金成立于 2017 年 2 月 7 日)。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的含国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 8.48%(本基金成立于 2017 年 2 月 7 日)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变

现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	66,646,168.48	-	-	-	66,646,168.48
结算备付金	1,639,183.84	-	-	-	1,639,183.84
存出保证金	63,241.72	-	-	-	63,241.72
交易性金融资产	59,414,000.00	-	-	123,677,774.81	183,091,774.81
买入返售金融资产	410,933,354.88	-	-	-	410,933,354.88
应收证券清算款	-	-	-	40,058,937.47	40,058,937.47

应收利息	-	-	-	988,069.22	988,069.22
应收申购款	-	-	-	4,138.52	4,138.52
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	538,695,948.92	-	-	164,728,920.02	703,424,868.94
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	421,727.64	421,727.64
应付赎回款	-	-	-	1,303,947.60	1,303,947.60
应付管理人报酬	-	-	-	878,184.59	878,184.59
应付托管费	-	-	-	146,364.09	146,364.09
应付交易费用	-	-	-	159,536.10	159,536.10
其他负债	-	-	-	165,707.99	165,707.99
负债总计	-	-	-	3,075,468.01	3,075,468.01
利率敏感度缺口	538,695,948.92	-	-	-161,653,452.01	700,349,400.93
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
负债					

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的含国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 8.48%（本基金成立于 2017 年 2 月 7 日）。因此市场利率的变动对于本基金资产净值影响很小。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；同时采用“自下而上”的策略通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种

进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的股票投资比例为基金资产的 0%-95%；现金、债券资产、资产支持证券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	123,677,774.81	17.66	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	59,414,000.00	8.48	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	183,091,774.81	26.14	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 17.66%（本基金成立于 2017 年 2 月 7 日），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（本基金成立于 2017 年 2 月 7 日）。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	123,677,774.81	17.58
	其中：股票	123,677,774.81	17.58
2	固定收益投资	59,414,000.00	8.45
	其中：债券	59,414,000.00	8.45
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	410,933,354.88	58.42
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	68,285,352.32	9.71
7	其他各项资产	41,114,386.93	5.84
8	合计	703,424,868.94	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	53,658,059.01	7.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,132,000.00	0.45
E	建筑业	12,504,280.96	1.79
F	批发和零售业	6,019,600.00	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	9,110,697.20	1.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,594,101.40	0.51
J	金融业	12,814,855.24	1.83
K	房地产业	12,508,260.00	1.79

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	978,400.00	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	8,556,305.00	1.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	801,216.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	123,677,774.81	17.66

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	100,000	4,117,000.00	0.59
2	600048	保利地产	318,000	3,170,460.00	0.45
3	601668	中国建筑	300,000	2,904,000.00	0.41
4	000402	金融街	240,000	2,812,800.00	0.40
5	000786	北新建材	170,000	2,692,800.00	0.38
6	002146	荣盛发展	260,000	2,566,200.00	0.37
7	000063	中兴通讯	108,000	2,563,920.00	0.37
8	601009	南京银行	219,000	2,454,990.00	0.35
9	600004	白云机场	130,000	2,399,800.00	0.34
10	600068	葛洲坝	206,000	2,315,440.00	0.33
11	600066	宇通客车	100,000	2,197,000.00	0.31
12	600486	扬农化工	51,800	2,186,478.00	0.31
13	600029	南方航空	250,000	2,175,000.00	0.31
14	600036	招商银行	90,000	2,151,900.00	0.31
15	600309	万华化学	75,000	2,148,000.00	0.31
16	002142	宁波银行	100,000	1,930,000.00	0.28
17	002241	歌尔股份	100,000	1,928,000.00	0.28
18	002573	清新环境	100,000	1,882,000.00	0.27
19	000001	平安银行	200,000	1,878,000.00	0.27

20	600500	中化国际	196,000	1,873,760.00	0.27
21	000089	深圳机场	199,912	1,869,177.20	0.27
22	300070	碧水源	100,000	1,865,000.00	0.27
23	002236	大华股份	80,000	1,824,800.00	0.26
24	000915	山大华特	49,288	1,817,248.56	0.26
25	300166	东方国信	127,980	1,718,771.40	0.25
26	300355	蒙草生态	160,000	1,718,400.00	0.25
27	600054	黄山旅游	99,950	1,709,145.00	0.24
28	600535	天士力	40,000	1,661,600.00	0.24
29	000967	盈峰环境	149,784	1,623,658.56	0.23
30	600507	方大特钢	188,000	1,603,640.00	0.23
31	300197	铁汉生态	119,982	1,593,360.96	0.23
32	601231	环旭电子	100,000	1,571,000.00	0.22
33	600176	中国巨石	141,600	1,554,768.00	0.22
34	601186	中国铁建	128,000	1,539,840.00	0.22
35	000568	泸州老窖	30,000	1,517,400.00	0.22
36	300142	沃森生物	120,000	1,483,200.00	0.21
37	600155	宝硕股份	97,958	1,447,819.24	0.21
38	000039	中集集团	80,000	1,442,400.00	0.21
39	600657	信达地产	250,000	1,440,000.00	0.21
40	600686	金龙汽车	107,976	1,436,080.80	0.21
41	600502	安徽水利	186,000	1,430,340.00	0.20
42	600992	贵绳股份	90,000	1,427,400.00	0.20
43	000090	天健集团	128,000	1,420,800.00	0.20
44	600322	天房发展	280,000	1,414,000.00	0.20
45	300203	聚光科技	50,000	1,406,000.00	0.20
46	000888	峨眉山 A	108,800	1,381,760.00	0.20
47	600703	三安光电	70,000	1,379,000.00	0.20
48	002456	欧菲光	75,000	1,362,750.00	0.19
49	002008	大族激光	39,000	1,350,960.00	0.19
50	601601	中国太保	39,800	1,348,026.00	0.19
51	603128	华贸物流	156,000	1,335,360.00	0.19
52	600834	申通地铁	106,000	1,331,360.00	0.19
53	601390	中国中铁	150,000	1,300,500.00	0.19
54	600153	建发股份	100,000	1,293,000.00	0.18
55	002094	青岛金王	60,000	1,279,800.00	0.18
56	002589	瑞康医药	80,000	1,232,000.00	0.18
56	600693	东百集团	100,000	1,232,000.00	0.18
57	600436	片仔癀	20,000	1,220,800.00	0.17

58	002643	万润股份	80,000	1,180,800.00	0.17
59	600653	申华控股	360,000	1,173,600.00	0.17
60	300588	熙菱信息	33,000	1,148,070.00	0.16
61	600116	三峡水利	100,000	1,121,000.00	0.16
62	000615	京汉股份	80,000	1,104,800.00	0.16
63	600310	桂东电力	160,000	1,097,600.00	0.16
64	002007	华兰生物	30,000	1,095,000.00	0.16
65	600128	弘业股份	100,000	1,089,000.00	0.16
66	300433	蓝思科技	36,000	1,047,240.00	0.15
67	000049	德赛电池	20,000	1,036,200.00	0.15
68	601328	交通银行	168,000	1,034,880.00	0.15
69	002116	中国海诚	80,000	978,400.00	0.14
70	600452	涪陵电力	20,000	913,400.00	0.13
71	600977	中国电影	42,800	801,216.00	0.11
72	000581	威孚高科	30,000	777,000.00	0.11
73	300378	鼎捷软件	46,000	727,260.00	0.10
74	300327	中颖电子	20,000	634,000.00	0.09
75	600643	爱建集团	38,000	569,240.00	0.08
76	000523	广州浪奇	50,000	507,500.00	0.07
77	002353	杰瑞股份	30,800	487,256.00	0.07
78	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
79	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
80	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
81	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
82	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
83	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
84	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
85	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
86	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
87	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值
----	------	------	----------	-----------

				比例 (%)
1	000651	格力电器	3,365,745.20	0.48
2	600116	三峡水利	3,052,988.36	0.44
3	600048	保利地产	3,038,640.00	0.43
4	603085	天成自控	2,983,955.32	0.43
5	002142	宁波银行	2,960,280.00	0.42
6	601668	中国建筑	2,917,500.00	0.42
7	000402	金融街	2,805,641.00	0.40
8	002146	荣盛发展	2,699,298.00	0.39
9	000786	北新建材	2,552,221.00	0.36
10	601009	南京银行	2,437,840.00	0.35
11	600801	华新水泥	2,417,105.00	0.35
12	600500	中化国际	2,266,083.00	0.32
13	600184	光电股份	2,099,764.22	0.30
14	600004	白云机场	2,085,356.82	0.30
15	600068	葛洲坝	2,083,393.00	0.30
16	000063	中兴通讯	2,051,198.00	0.29
17	600318	新力金融	2,021,339.00	0.29
18	002573	清新环境	2,018,184.79	0.29
19	600066	宇通客车	1,996,597.00	0.29
20	600029	南方航空	1,976,875.00	0.28

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	603085	天成自控	3,333,903.00	0.48
2	600116	三峡水利	2,620,000.00	0.37
3	600801	华新水泥	2,349,549.00	0.34
4	600325	华发股份	2,214,263.00	0.32
5	600879	航天电子	2,040,964.00	0.29
6	600529	山东药玻	1,933,029.00	0.28
7	600566	济川药业	1,826,041.00	0.26
8	601336	新华保险	1,764,132.00	0.25
9	600184	光电股份	1,739,806.92	0.25

10	600777	新潮能源	1,736,627.00	0.25
11	600970	中材国际	1,711,840.00	0.24
12	600583	海油工程	1,701,576.00	0.24
13	002242	九阳股份	1,638,174.72	0.23
14	600318	新力金融	1,561,240.00	0.22
15	300450	先导智能	1,552,500.00	0.22
16	603808	歌力思	1,506,365.00	0.22
17	601600	中国铝业	1,488,000.00	0.21
18	600562	国睿科技	1,442,117.00	0.21
19	601688	华泰证券	1,435,090.00	0.20
20	600491	龙元建设	1,392,920.00	0.20

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	184,265,152.34
卖出股票收入（成交）总额	60,825,945.75

注：“买入股票的成本”和“卖出股票的收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,992,000.00	1.43
	其中：政策性金融债	9,992,000.00	1.43
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	49,422,000.00	7.06
9	其他	-	-
10	合计	59,414,000.00	8.48

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111799138	17 桂林银行 CD085	200,000	19,770,000.00	2.82
1	111799179	17 青岛银行 CD075	200,000	19,770,000.00	2.82
2	170306	17 进出 06	100,000	9,992,000.00	1.43
3	111799099	17 嘉兴银行 CD050	100,000	9,882,000.00	1.41

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库的范围。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	63,241.72
2	应收证券清算款	40,058,937.47
3	应收股利	-
4	应收利息	988,069.22
5	应收申购款	4,138.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,114,386.93

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
4,222	164,477.12	59,058,058.06	8.50%	635,364,348.12	91.50%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	4,976.48	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年2月7日）基金份额总额	695,151,366.12
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	63,091,334.13
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	63,820,294.07
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	694,422,406.18

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，未有改聘情况发生。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人、托管人及其高级管理人员未受到有权机关调查、司法纪检部门采取强制措施、被移送司法机关或追究刑事责任、中国证监会稽查、中国证监会行政处罚、证券市场禁入、认定为不适当人选、被其他行政管理部门处罚及证券交易所公开谴责的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票	佣金	占当期佣金	

			成交总额的比 例		总量的比例	
招商证券	2	-	-	227,083.14	100.00%	-

注：1、证券经营机构交易单元选择的标准和程序：

(1) 选择证券经营机构交易单元的标准

财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；

佣金费率合理；

本基金管理人要求的其他条件。

(2) 选择证券经营机构交易单元的程序

本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构；

基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增两个招商证券公司交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增交通银行为浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告	报刊及公司网站	2017年1月3日
2	关于新增申万宏源西部证券为浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告	报刊及公司网站	2017年1月5日
3	关于新增国信证券为浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告	报刊及公司网站	2017年1月9日
4	关于新增上海农商银行为浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告	报刊及公司网站	2017年1月13日
5	浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	报刊及公司网站	2017年2月8日
6	关于旗下部分基金参加交通银行	报刊及公司网站	2017年2月22日

	手机银行基金申购及基金定投业务费率优惠活动的公告		
7	浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	报刊及公司网站	2017 年 3 月 23 日
8	关于董事会换届的公告	报刊及公司网站	2017 年 3 月 23 日
9	关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及基金定投业务费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2017 年 4 月 22 日
10	浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	报刊及公司网站	2017 年 4 月 28 日
11	浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	报刊及公司网站	2017 年 5 月 3 日
12	关于浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2017 年 5 月 4 日
13	关于浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金在部分代销机构开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2017 年 5 月 4 日
14	关于浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金在交通银行开通基金定投和基金转换业务及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2017 年 5 月 4 日
15	关于旗下部分基金在珠海盈米财富管理有限公司开通基金转换业务并参加费率优惠的公告	报刊及公司网站	2017 年 5 月 11 日
16	关于浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金在浦发银行开通基金转换业务的公告	报刊及公司网站	2017 年 6 月 27 日
17	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及基金定投业务费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2017 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、因浦银安盛基金管理有限公司（以下简称“公司”）第三届董事会任期届满，根据《公司章程》的规定，经公司 2017 年第一次股东会会议审议通过，选举产生公司第四届董事会成员，共 11 名董事。详见本基金管理人于 2017 年 3 月 23 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于董事会换届的公告》。

2、2017 年 4 月 26 日，谢伟先生担任浦银安盛基金管理有限公司董事长，详见本公司于 2017 年 4 月 28 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、 中国证监会批准浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 2、 浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 3、 浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 4、 浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 5、 基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 6、 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、 本报告期内在中国证监会指定报刊上披露的各项公告
- 8、 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼基金管理人办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（www.py-axa.com）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

客户服务中心电话：400-8828-999 或 021-33079999 。

浦银安盛基金管理有限公司

2017 年 8 月 28 日