浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金

2015 年度报告摘要

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
送出日期:2016年3月30日

§1 重要提示

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月28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。

本年度报告摘要载自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	浦银安盛新经济结构混合
基金主代码	519126
交易代码	519126
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月20日
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	70,162,385.09份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过在股票、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中国经济结构转型趋势、以及新的经济结构变化包括新城乡结构、新需求结构、新产业结构带来的投资机会,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	本基金在股票投资方面主要采用主题投资策略,通过重点投资受益于中国经济结构转型趋势、新的经济结构包括新城乡结构、新需求结构、新产业结构的相关行业股票,并保持对中国经济结构调整的趋势以及经济结构调整对相关行业及上市公司影响的密切跟踪和研究分析,对属于新经济结构投资主题范畴的上市公司进行重点投资。
业绩比较基准	55%×中证500指数(000905)+45%×中证全债指数
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。

注:1.自2015年10月11日起,本基金业绩比较基准由原"中信标普全债指数"变更为"中证全债指数"。其体内容详见基金管理人于2015年11月13日发布的《关于变更旗下基金业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	汤翼彦
	联系电话	021-23212888	95559
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	tangyy@bankcomm.com
客户服务电话		021-33079999或400-8828-999	95559
传真		021-23212985	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2015年	2014年5月20日(基金合同生效日)-2014年12月31日	2013年
本期已实现收益	-12,695,592.28	20,648,540.27	-
本期利润	-8,007,835.88	22,389,835.91	-
加权平均基金份额本期利润	-0.1294	0.0614	-
本期基金份额净值增长率	52.33%	9.50%	-
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0080	0.0919	-
期末基金资产净值	117,022,110.77	54,771,172.41	-
期末基金份额净值	1.668	1.095	-

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.本期已实现收益是基金本期利息收入、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.期末可供分配利润均为截至期末可供分配的利润。期末资产负债表中未分配利润中已实现部分的孰低数。
5.本基金成立于2014年5月20日止效,以上财务指标中"上年度可比期间"为2014年5月20日(基金成立日)至2014年12月31日止期间。

3.2 基金净值表现

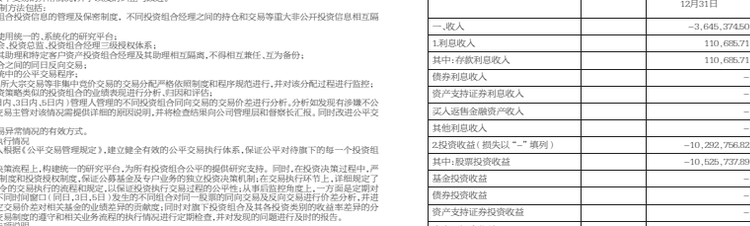
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	52.06%	2.57%	14.51%	1.12%	37.54%	1.45%
过去六个月	-11.46%	3.36%	-4.80%	1.78%	-6.66%	1.58%
过去一年	52.33%	3.04%	28.39%	1.55%	23.94%	1.49%
自基金合同生效起至今	66.80%	2.43%	61.72%	1.28%	5.08%	1.15%

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

注:自2015年10月1日起,本基金基准"55%×中证500 指数+45%×中信标普全债指数"变更为"55%×中证500指数+ 45%×中证全债指数"。具体内容详见发布于2015年11月13日的《浦银安盛基金管理有限公司关于变更旗下基金业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每个净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同于2014年5月20日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未进行过利润分配。

§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、资产管理和证监会许可的其他业务。

截至2015年12月31日止,浦银安盛旗下共管理19只基金,组成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、浦银安盛精选生活风尚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)、浦银安盛中证银联基本面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、浦银安盛稳健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、浦银安盛日日益货币市场基金、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及浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金。

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证券业务、财务管理、投资管理、风险管理、客户关系管理、人力资源管理、行政管理、信息门户、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统等。随着业务的发展,这些系统也在不断进行更新、升级和扩展。

国际经济形势比较复杂,美国处于自身经济复苏考虑future加息,而日本采取负利率,欧洲延续宽松的货币政策刺激经济。期油、基本金属、煤炭价格持续低迷,具有通胀属性的商品属涨多跌少呈现关注。新兴经济体表现分不多。

相比其他经济体,中国的经济增速虽然处于较高的水平,改革也为市场注入新的活力,因此,我们对资本市场并不悲观。长期看,人民币资产走向国际化、居民资产配置变化、注册制推出、新兴产业成长等,都需要一个稳定的资本市场。短期看,部分利空因素正在消化,市场预心逐渐恢复,股价空间最少已经消耗了近半。

产业结构的深层次变化催生结构性机会与主题性机会,云计算与大数据、先进制造、新教育医疗概念、新能源汽车等值得关注。投资策略上,"自下而上"精选优质成长股是我们的投资主线之一。

4.6 管理人内部有关本基金的监管棱镜长工作情况

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》等有关法规或实守信、勤勉尽责,依法履行基金管理人职责,强化风险及合规管理,确保基金管理业务运作的安全、规范,保护基金份额持有人的合法权益。2015年,合规风控工作仍然是社会同进行全面风险管理,通过了制度内控、法律合规、信息披露、风险监测、绩效评估、内部稽核及反洗钱等工作,积极配合公司前台业务的完善一线风险管理工作,并协调、监督全公司投资组合的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险及内部控制工作。合规法律方面,在公司全体同仁的共同努力下,公司合规及信息披记录良好,为公司各项业务的开展打下了坚实基础;风险管理方面,进一步开发并在量化风险评估模型、利润数字化、专业化管理模块上取得长足进展,并提升风险化解及处置能力;稽核方面,根据监管要求及行业热议风险点,有针对的开展了计划外专项稽核,及时查找和发现的潜在风险,提出了完善制度流程及加强执行的有效建议。

1.进一步健全合规风控团队,提高团队的专业素养

2015年,随着公司管理投资组合专业化程度大幅提升、业务类型的不断拓展,合规风控团队也补充了较多的相关专业的投资风险管理人才,进一步强化了团队人员配置,并不断加强自身专业素质的提升,全面提高专业素质,强独和支持合规风控人员参与相关的专业考试和学习。目前合规风控团队内部形成了良好的学习和业务研讨氛围,团队成员各自发挥自身优势,相互取长补短,专业素质得到明显提升,在内部形成了互帮互学、互相协同、勤奋上进的良好局面。

内部管理上,合规风控团队进一步健全合规风控工作的各项规章制度和工作流程,进一步明确各岗位人员的工作职责,强化自觉、客观的工作态度和高度的工作责任感,培养团队协作精神。

对外沟通上,持续与监管机构、交易所、目律协会、外服律师、外部会计师及双方股东对口部门保持密切良好的沟通,同时与公司其他部门保持良好协作,配合和支持部门间需求接洽。

2.进一步健全风险控制体系

(1)对投资组合进行定期业绩归因分析和风险评估

合规风控部进一步完善了每日、每周、每月的风险评估,初步建立了较为完整、及时的量化的预警风险评估体系。同时,2015年对流动性风险监控体系进行了进一步完善,通过日常流动性监测及评估、压力测试,对流动性风险进行有效的防范。

(2)对投资组合的公平交易及异常交易进行事前控制和事后分析

合规风控部继续着力于对公平交易、异常交易相关工作的提高,对公平交易及异常交易事后分析进行了进一步的完善,以进一步确保投资组合的合法合规。

(3)对公司新产品提供高效、有力的支持

2015年,公司新发行了65专户产品(25为委托公司管理)、25公募基金,合规风控部与投资团队、产品团队、运营团队合作,就各产品的流动性风险、市场风险、信用风险等方面进行分析,制定相应的风险控制措施和投资控制指标。

(4)进一步完善子公司内部控制体系

2015年,子公司内部控制体系得到进一步完善:

公司"一线风险控制",子公司设金融机构部、运营管理部、投资管理部、资金管理部,财富管理中心等业务部门,对其管理负责的业务进行检查、监督和控制,保证业务的开展符合国家法律、法规、监管规定及子公司的规章制度,并对部门的内部控制和风险管理负直接责任;

子公司设独立的风险管理部,负责对子公司内部控制和风险控制的充分性、合理性和有效性实施独立客观的风险管控、检查和评价;

管理层的控制:子公司在总经理领导下设立执行委员会,并在管理层下设项目评审及决策委员会以及风险控制委员会,采取集体决策制,管理和监督各个部门和各项业务进行,以确保子公司运作在有效的管理下。管理层对内部控制制度的有效执行承担责任;

执行董事及监事的监控和指导:所有员工应自觉接受并配合执行董事及监事对各项业务和工作行为的检查监督,合理的风险分析和管理建议应予采纳。执行董事对内部控制负最终责任;

母公司以及其董事会通过稽核检查、审阅报告,参与会议等方式监督子公司内部控制和风险控制情况。2015年,母公司对子公司的内控管理正在从事前评审和事中审核,逐步向事前咨询及讨论以及事后稽核,力争在保持子公司独立性、实现母子公司风险隔离的基础上,有效发挥母公司对子公司风险内控方面的监督管理作用。

(5)协助人力资源部完善了合理风险考核体系

2015年,人力资源部根据《证券业从业人员行为管理》,各岗位的风险事件考核力度,制定下发了《加强日常风险考核管理办法》,依照不同等级风险事件,同时结合是否自动及时上报,是否受外界因素影响等因素进行考核,责任明确,激实到人,并根据中风险及以上事件对责任人员实现扣除部分季度工资的惩处,有力地督促了相关人员对公司制度的执行,有效地推动了公司全体员工合规意识的提高。

3.稽核工作

根据相关法规要求,公司的实际运作情况及稽核计划,合规风控团队有重点、分步骤、有针对性地对公司的业务和业务流程,以及执行法规和制度的情况进行稽核,并在稽核后督促整改和跟踪检查。在有效控制公司的风险以及推动公司内控监管第二道和第三道防线方面发挥了系统的作用。

稽核工作主要采取定期稽核与不定期稽核相结合,常规稽核与专项稽核相结合的方式。定期稽核的结果主要体现在月度合规报告及季度监察稽核报告中,不定期稽核主要是就定期稽核中发现的问题,与业务部门进行沟通,帮助各部门及时完善和改进工作。不定期稽核的结果主要体现在合规报告及整改反馈表中。

此外,合规风控团队还负责与负责公司内控评价的会计师事务所联系和沟通,配合公司的业务开展。

2015年实施的专项稽核包括:

(1)完成对上年度反洗钱工作的内部稽核和反洗钱评估工作;

(2)根据监管部门统一部署,对公司进行"两加强、两遏制"全面专项自查;

(3)根据监管部门要求,对公司特定客户资产管理业务专用账户使用情况、是否涉及配资等进行了自查;

(4)对一定时间段部分产品投资情况、投资建议书进行了检查。

总体来说,2015年度由于人员配置有限,稽核工作的深度及广度还有待进一步提高。2016年,合规风控部将在公司预算内进一步完善人员配置,不断深化和提高稽核工作的开展质量。

4.实施合规性审核

依据法律法规和公司制度对以下材料进行了审核:

(1)对基金宣传推介材料、公司宣传品、网站资料、客户服务资料、渠道用信息、以公司名义对外发布的新闻等进行了合规性审核,力求公司对外材料的合法合规性。

(2)2015年,与公司专业法律顾问一起,对公司发行的基金和专户产品法律文件的合法合规性进行了全面审核;

(3)对一段时间数百个证券的申购,从天获交易角度进行合法合规性审核,未出现在一级市场投资与公司存在禁止关联交易的关联关系公司发行证券的情形。

5.信息披露和文件规范

由于公司信息披露的负责人设在合规风控部,因此,合规风控部制定与人负责并协调公司的信息披露工作,督促长对信息披露工作进行指导、督促、监督、检查。信息披露工作包括拟定披露的文件格式、收集相关部门填写的内容并进行统稿和审核,对定稿的信息披露文件排版、制作成PDF文件向监管机关报备等。

信息披露工作是一项繁杂的事物性工作,需要信息披露负责人耐心、细致、认真的工作态度和较强的协调能力,不仅涉及到披露的格式,还涉及披露的内容,以及数据、审阅和报送等。该项工作虽然占新了合规风控团队很多时间,但由于团队成员的工作认真、仔细,所有的披露均做到了及时、准确、基本未出现重大差错、漏报、延报、错报的情形。

2015年,按时按质完成基金定期报告(月报、季报、半年报、年报、监察稽核报告)和招募说明书更新的提示及合规审核工作,并协助业务部门对重大事件临时报告、临时公告进行编制,及时进行合规审核,并安排公告的披露及上报事宜。2015年全年共审核并安排披露、上报公告及报告、未出现重大迟、漏等现象。

8.法律事务

对公司签署的上百份协议、合同等进行了法律审核,在合理范围内最大限度地防范由合同产生的违约风险及侵权风险,同时,根据《中国证监会发布的关于职责履用及反洗钱等相关法律法规,对基金代销协议模板进行了更新;参与起草、审阅并修改董事会、股东会会议通知、决议等会议材料。此外,合规风控团队还负责与公司法律和基金产品律师联系和沟通,配合公司的业务开展。

全年的法务工作基本做到了有所而高效,积极协助了公司业务的正常开展,公司未发生诉讼或仲裁现象,较好地控制了法律风险。

7.组织开展合规培训

根据工作安排,合规风控团队负责公司的合规培训工作,合规培训包括新员工入司培训、重大新法规培训、从业人员投资限制培训、新股发行法制改革培训、证券机制改革培训、合规风控团队会商最有效培训的议题和内容,并准备书面培训材料;培训中,采取讲实例的互动培训方式,培训后,积极听取员工的建议,以期不断改进培训效果。

(1)由于中国证券业协会每年会安排15小时左右的远程在线合规培训,为避免占用业务人员过多工作时间以及培训内容过多重复,2015全年为业务人员组织了几场(不含反洗钱合规培训)的专项合规培训;

(2)对反洗钱相关人员开展了一场反洗钱合规培训,共计25个小时14人次。

合规培训部分程度上提高和增强了员工的合规守法意识,促进了公司业务的合规运作。

8.督导和推动公司的制度建设和完善

督导和推动公司的制度建设和完善是合规风控团队的重要工作之一。合规风控团队全年推动公司所有新订、修订制度、流程的工作。

9.组织进行反洗钱工作

公司反洗钱工作由合规风控团队组织和牵头。全年开展的反洗钱工作包括:(1)完善反洗钱相关制度;(2)客户识别和客户风险等级划分;(3)利用反洗钱监控系统从T+A数据中心自动抓取数据,对可疑交易进行适时监控;(4)向中国人民银行定期报送可疑交易;(5)定期根据监管要求向黄岛及人民银行报送反洗钱报表等各项材料;(6)进行反洗钱合规培训;(7)进行反洗钱的专项审计及评估。

10.落实监管效策和要求,配合和协助监管机关的现场调研

与监管机关的沟通和交流主要由督察长和合规风控部负责,总体来说,在落实监管机关的监管政策和要求方面的工作包括:

(1)收发监管机关的所有文件,传达监管机关的政策,从收文和执法环节进行协调和督促;

(2)组织、协调和督导公司的专项自查;

(3)代表公司参与上海基金协同业公会的相关会议。

11.督导处理投资人的投诉

公司已经建立了投资人投诉的处理机制,合规风控团队负责指导,督促有服中心妥善处理投资人的重大投诉,包括商量投诉处理的区域内容、形式和解决方法等,避免了因投资人投诉致使公司品牌和声誉受损的情形发生。

12.向董事会报告公司经营的合法合规情况

根据《公司章程》的要求,定期向董事会报告公司经营的合法合规情况。报告的形式包括:(1)书面报告:通过季度和年度监察稽核报告的形式;(2)当面报告:通过在董事会会议以及合规与审计委员会会议汇报的形式;(3)电邮或电话:当重事想了解公司的合规经营情况或提出一些问题时,通过电子邮件或电话的形式进行沟通和汇报。

13.与中介机构的协调

合规风控团队负责与律师事务所和审计师事务所的日常工作协调,包括:

(1)与律师事务所:就国大制度修订事项、基金产品募集、与户产品审核、高管和董事的任免出具法律意见书。

(2)与审计师事务所:就公司的内控评价工作建立了与普华永道会计师事务所日常沟通和协调的机制。

回顾过去的2015年,从董事会、管理层到员工,对合规风控工作都比以前有了更多的重视和理解、支持,合规风控团队与公司各部门就联系日趋紧密和协调,这为公司的合规风控工作的开展进一步奠定了良好基石。

4.7 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、合规风控部负责人、基金运营部负责人组成。估委员会成员均具有5以上专业工作经历,具备良好的专业经验、责任心强、责任感强。估值委员会成员均为兼职,但由于团队成员的工作认真、仔细,所有的披露均做到了及时、准确、基本未出现重大差错、漏报、延报、错报的情形。

2015年,按时按质完成基金定期报告(月报、季报、半年报、年报、监察稽核报告)和招募说明书更新的提示及合规审核工作,并协助业务部门对重大事件临时报告、临时公告进行编制,及时进行合规审核,并安排公告的披露及上报事宜。2015年全年共审核并安排披露、上报公告及报告、未出现重大迟、漏等现象。

8.法律事务

对公司签署的上百份协议、合同等进行了法律审核,在合理范围内最大限度地防范由合同产生的违约风险及侵权风险,同时,根据《中国证监会发布的关于职责履用及反洗钱等相关法律法规,对基金代销协议模板进行了更新;参与起草、审阅并修改董事会、股东会会议通知、决议等会议材料。此外,合规风控团队还负责与公司法律和基金产品律师联系和沟通,配合公司的业务开展。

全年的法务工作基本做到了有所而高效,积极协助了公司业务的正常开展,公司未发生诉讼或仲裁现象,较好地控制了法律风险。

7.组织开展合规培训

根据工作安排,合规风控团队负责公司的合规培训工作,合规培训包括新员工入司培训、重大新法规培训、从业人员投资限制培训、新股发行法制改革培训、证券机制改革培训、合规风控团队会商最有效培训的议题和内容,并准备书面培训材料;培训中,采取讲实例的互动培训方式,培训后,积极听取员工的建议,以期不断改进培训效果。

(1)由于中国证券业协会每年会安排15小时左右的远程在线合规培训,为避免占用业务人员过多工作时间以及培训内容过多重复,2015全年为业务人员组织了几场(不含反洗钱合规培训)的专项合规培训;

(2)对反洗钱相关人员开展了一场反洗钱合规培训,共计25个小时14人次。

合规培训部分程度上提高和增强了员工的合规守法意识,促进了公司业务的合规运作。

8.督导和推动公司的制度建设和完善

督导和推动公司的制度建设和完善是合规风控团队的重要工作之一。合规风控团队全年推动公司所有新订、修订制度、流程的工作。

9.组织进行反洗钱工作

公司反洗钱工作由合规风控团队组织和牵头。全年开展的反洗钱工作包括:(1)完善反洗钱相关制度;(2)客户识别和客户风险等级划分;(3)利用反洗钱监控系统从T+A数据中心自动抓取数据,对可疑交易进行适时监控;(4)向中国人民银行定期报送可疑交易;(5)定期根据监管要求向黄岛及人民银行报送反洗钱报表等各项材料;(6)进行反洗钱合规培训;(7)进行反洗钱的专项审计及评估。

10.落实监管效策和要求,配合和协助监管机关的现场调研

与监管机关的沟通和交流主要由督察长和合规风控部负责,总体来说,在落实监管机关的监管政策和要求方面的工作包括:

(1)收发监管机关的所有文件,传达监管机关的政策,从收文和执法环节进行协调和督促;

(2)组织、协调和督导公司的专项自查;

(3)代表公司参与上海基金协同业公会的相关会议。

11.督导处理投资人的投诉

公司已经建立了投资人投诉的处理机制,合规风控团队负责指导,督促有服中心妥善处理投资人的重大投诉,包括商量投诉处理的区域内容、形式和解决方法等,避免了因投资人投诉致使公司品牌和声誉受损的情形发生。

12.向董事会报告公司经营的合法合规情况

根据《公司章程》的要求,定期向董事会报告公司经营的合法合规情况。报告的形式包括:(1)书面报告:通过季度和年度监察稽核报告的形式;(2)当面报告:通过在董事会会议以及合规与审计委员会会议汇报的形式;(3)电邮或电话:当重事想了解公司的合规经营情况或提出一些问题时,通过电子邮件或电话的形式进行沟通和汇报。

13.与中介机构的协调

合规风控团队负责与律师事务所和审计师事务所的日常工作协调,包括:

(1)与律师事务所:就国大制度修订事项、基金产品募集、与户产品审核、高管和董事的任免出具法律意见书。

(2)与审计师事务所:就公司的内控评价工作建立了与普华永道会计师事务所日常沟通和协调的机制。

回顾过去的2015年,从董事会、管理层到员工,对合规风控工作都比以前有了更多的重视和理解、支持,合规风控团队与公司各部门就联系日趋紧密和协调,这为公司的合规风控工作的开展进一步奠定了良好基石。

4.7 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、合规风控部负责人、基金运营部负责人组成。估委员会成员均具有5以上专业工作经历,具备良好的专业经验、责任心强、责任感强。估值委员会成员均为兼职,但由于团队成员的工作认真、仔细,所有的披露均做到了及时、准确、基本未出现重大差错、漏报、延报、错报的情形。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内基金未实施利润分配。

4.9 管理人对报告期内基金产品风险收益情况的说明

本报告期内,本基金净值表现、利润分配、资产组合等方面的情况均在正常范围内,未发生重大偏离情况。

§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

2015年度,基金托管人在浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,本着诚信、勤勉、尽责的原则,履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2015年度,浦银安盛基金管理有限公司在浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2015年度,由浦银安盛基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告和关内投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第21604号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"浦银安盛新经济结构混合基金")的财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表、2015年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是浦银安盛新经济结构混合基金的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则和证券监督管理委员会会计规则的规定编制财务报表,并使其不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。
审计意见段	我们认为,上述浦银安盛新经济结构混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和证券监督管理委员会会计规则以及财务报表附注中所列示的编制基础,在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,公允反映了浦银安盛新经济结构混合基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛竞 胡逸嵘
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
审计报告日期	2016年3月25日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款		9,878,896.47	8,153,521.13
结算备付金		944,645.29	817,503.13
存出保证金		220,383.33	179,789.05
交易性金融资产		103,809,389.80	48,181,331.30
其中:股票投资		103,809,389.80	48,181,331.30
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		3,965,835.19	-
应收利息		2,898.84	1,706.54
应收股利		-	-
应收申购款		191,601.01	13,842.87
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		119,013,649.93	57,347,694.02

负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	972,134.85
应付赎回款		1,153,264.08	966,749.39
应付管理人报酬		148,214.75	82,738.63
应付托管费		24,702.48	13,789.76
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		463,569.73	237,467.28
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		201,798.12	303,641.70
负债合计		1,991,539.16	2,576,521.61
所有者权益:			
实收基金		70,162,385.09	50,019,212.92
未分配利润		46,859,725.68	4,751,959.49
所有者权益合计		117,022,110.77	54,771,172.41
负债和所有者权益总计		119,013,649.93	57,347,694.02

注:1.报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.668元,基金份额总额70,162,385.09份。
2.本基金(基金合同)2014年5月20日生效。以上财务指标中"上年度可比期间"为2014年5月20日(基金成立日)至2014年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体:浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年5月20日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入		-3,645,374.50	28,528,163.59
1.利息收入		110,685.71	6,665,596.27
其中:存款利息收入		110,685.71	1,256,739.92
债券利息收入		-	5,408,856.35
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-10,292,756.82	17,091,273.94
其中:股票投资收益		-10,525,737.89	15,958,301.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		232,981.07	1,132,972.13
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		4,687,756.40	1,711,296.64
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		1,848,940.21	3,059,998.74
减:二、费用		4,362,461.38	6,168,327.68
1. 管理人报酬	7.4.2.1	1,479,520.90	3,948,861.44
2. 托管费	7.4.2.2	246,586.92	658,143.51
3. 销售服务费	7.4.2.3	-	-
4. 交易费用		2,398,146.54	1,246,230.09
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		238,207.02	315,092.64
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-8,007,835.88	22,359,835.91
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-8,007,835.88	22,359,835.91

注:本基金(基金合同)2014年5月20日生效。以上财务指标中"上年度可比期间"为2014年5月20日(基金成立日)至2014年12月31日止期间。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31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)	50,019,212.92	4,751,959.49	54,771,172.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-8,007,835.88	-8,007,835.88
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)	20,143,172.17	50,115,602.07	70,258,774.24
其中:1.基金申购款	226,176,926.28	197,044,001.90	423,220,928.18
2.基金赎回款	-206,033,754.11	-146,928,399.83	-352,962,153.94
四、本期内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)	70,162,385.09	46,859,725.68	117,022,110.77

项目	上年度可比期间 2014年5月20日(基金合同生效日)至2014年12月31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)	910,