浦银安盛红利精选混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

2016年 12 月 31 日
基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2017 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2017 年 3 月 27 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 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	浦银安盛红利精选混合
基金主代码	519115
交易代码	519115
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年 12 月 3 日
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	65,773,839.71 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格执行投资风险管理的前提下,通过投资于盈利能力较高、分红稳定或分红潜力大的上市公司和国内依法公开发行上市的各类债券,力争为投资者提供稳定的当期收益和长期的资本增值。
投资策略	本基金坚持关注稳健收益、长期价值的投资理念,根据宏观经济周期性波动规律,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,在资产动态配置过程中始终坚持以风险预算理念进行合理控制,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。 本基金所指的红利型股票是基本面健康的、盈利能力较高、分红稳定或分红潜力大的快速及长期稳定增长的上市公司。本基金将采取基础库初选、核心库精选个股的策略,对拟投资的红利型上市公司加以甄别。
业绩比较基准	中证红利指数× 75%+中证全债指数× 25%
风险收益特征	本基金为混合型基金产品,基金资产整体的预期收益和预期风险均较高,属于较高风险、较高收益的基金品种。本基金力争在科学的风险管理的前提下,谋求实现基金财产的安全和增值。

注:自 2015 年 8 月 4 日起,本基金类型由股票型变更为混合型,本基金的基金名称变更为"浦银安盛红利精选混合型证券投资基金",本基金业绩比较基准由"中证红利指数× 75%+ 中信标普国债指数× 25%"变更为"中证红利指数× 75%+ 中证全债指数× 25%"。具体内容详见基金管理人于 2015 年 8 月 4 日发布的《关于浦银安盛红利精选股票型证券投资基金变更基金名称、基金类型及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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	郭明
	联系电话	021- 23212888	010- 66105799
	电子邮箱	compliance@py- axa.com	custody@cbc.com.cn
客户服务电话		021- 33079999 或 400- 8828- 999	95588
传真		021- 23212985	010- 66105798

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	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	- 2,801,021.29	25,583,083.91	38,031,181.28
本期利润	- 24,339,588.27	37,014,432.11	41,292,074.92
加权平均基金份额本期利润	- 0.3356	0.5690	0.1852
本期基金份额净值增长率	- 19.65%	66.19%	22.51%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.4453	0.4788	0.1215
期末基金资产净值	98,456,746.39	126,438,012.26	106,676,717.43
期末基金份额净值	1.497	1.863	1.121

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。

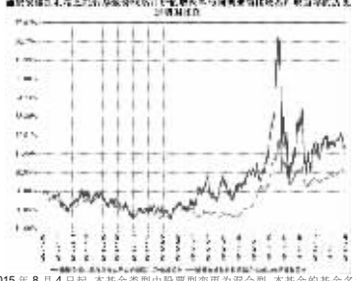
4、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

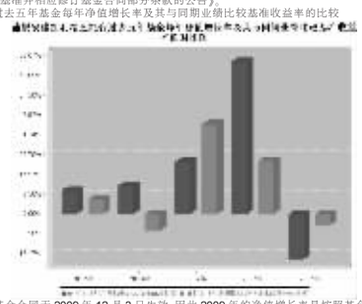
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	- 1.45%	1.10%	1.77%	0.55%	- 3.22%	0.55%
过去六个月	- 5.85%	1.15%	6.92%	0.58%	- 12.77%	0.57%
过去一年	- 19.65%	2.34%	- 4.87%	1.07%	- 14.78%	1.27%
过去三年	63.61%	2.44%	62.82%	1.39%	0.79%	1.05%
过去五年	102.30%	2.15%	61.14%	1.26%	41.16%	0.89%
自基金合同生效起至今	49.70%	1.94%	19.96%	1.20%	29.74%	0.74%

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 8 月 4 日起,本基金类型由股票型变更为混合型,本基金的基金名称变更为"浦银安盛红利精选混合型证券投资基金",本基金业绩比较基准由"中证红利指数× 75%+ 中信标普国债指数× 25%"变更为"中证红利指数× 75%+ 中证全债指数× 25%"。具体内容详见基金管理人于 2015 年 8 月 4 日发布的《关于浦银安盛红利精选股票型证券投资基金变更基金名称、基金类型及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 过去五年基金每年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 2009 年 12 月 3 日生效,因此 2009 年的净值增长率是按照基金合同生效后的实际存续期计算的。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注: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 2.8 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 2016 年 12 月 31 日止,浦银安盛旗下共管理 28 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、浦银安盛日益悦市市场基金、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、浦银安盛幸福累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、浦银安盛日丰货币市场基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛幸福聚益 18 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金以及浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金。

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)及基金投资决策委员会成员情况

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		
陈蔚丰	公司旗下浦银安盛医疗健康混合基金基金经理、浦银安盛红利精选混合型证券投资基金	2016年 1 月 14 日	-	8	陈蔚丰女士,南京大学环境科学硕士。2008 年 2 月至 2010 年 11 月在江苏瑞华投资发展有限公司担任行业研究员。2010 年 11 月加盟浦银安盛基金管理有限公司担任行业研究员之职。2013 年 2 月,提拔至高级研究员,先后负责过医药、煤炭、旅游、计算机等行业及上市公司的研究。2014 年 7 月,陈蔚丰女士调转至权益投资部,担任公司旗下股票基金经理助理。2015 年 5 月起,担任浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 1 月起,兼任浦银安盛红利精选混合型证券投资基金基金经理。
吴勇	本公司投资总监、权益投资部总监,公司旗下浦银安盛精致生活混合基金、浦银安盛新兴产业混合基金、浦银安盛消费升级混合基金、浦银安盛睿智精选混合基金基金经理	2010年 4 月 14 日	2016年 1 月 14 日	9	吴勇先生,上海交通大学材料工程系学士,上海交通大学工商管理硕士,CPA、CFA,中国注册造价师。1993 年 8 月至 2007 年 8 月先后就职于上海电力建设有限责任公司任预算主管、国家开发银行上海市分行任评审经理。2007 年 9 月起加盟浦银安盛基金管理有限公司先后担任行业研究员、基金经理助理。2010 年 4 月 - 2016 年 1 月起担任浦银安盛红利精选混合基金基金经理。2011 年 5 月起兼任浦银安盛精致生活混合基金基金经理。2013 年 3 月起,兼任浦银安盛战略新兴产业混合基金基金经理。2013 年 12 月起兼任浦银安盛消费升级混合基金基金经理。2016 年 3 月起兼任浦银安盛睿智精选混合基金基金经理。2012 年 11 月起兼任公司权益投资部总监。2016 年 4 月起兼任本公司投资总监。
李芳	原权益类基金经理助理	2015年 12 月 1 日	2016年 4 月 18 日	5	李芳女士,同济大学技术经济及管理专业博士。2011 年 5 月加盟浦银安盛基金管理公司研究部担任行业研究员,2015 年 12 月调岗至权益投资部担任公司旗下权益基金基金经理助理,2016 年 4 月调岗至专户管理部担任投资经理。

注:①上述任职日期、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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

管理人于 2009 年颁布了《浦银安盛基金管理有限公司公平交易管理规定》(以下简称公平交易管理规定),并分别于 2011 年及 2012 年进行了两次修订。现行公平交易管理规定分为总则、实现公平交易的具体措施、公平交易监控与实施效果评估、公平交易的报告和信息披露、隔离及保密、附则等六部分。公平交易管理规定从投资决策、研究支持、交易实施、监控与评估、报告与披露等各个环节,预防和发现可能违反公平交易的异常情况,并予以及时纠正与改进。

管理人用于公平交易控制方法包括:

- 公司建立严格的投资组合投资信息的管理及保密制度,不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离;
- 相对所有组合建立并使用统一的、系统化的研究平台;
- 明确了投资决策委员会、投资总监、投资组合经理三级授权体系;
- 证券投资基金经理及其助理和特定客户资产投资组合经理及其助理相互隔离,不得相互兼任、互为备份;
- 严格控制不同投资组合之间的同日反向交易;
- 执行投资交易交易系统中的公平交易程序;
- 银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配严格依照制度和程序规范进行,并对该分配过程进行监控;
- 定期对投资目标和投资策略类似的投资组合的业绩表现进行分析,归因和评估;
- 对不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。分析如发现有涉嫌不公平的交易,投资组合经理及交易主管对该情况需提供详细的原因说明,并将检查结果向公司管理层和督察长汇报。同时改进公平交易管理方法及流程。
- 其他能够助范公平交易异常情况的有效方式。

4.3.2 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;另一方面是公司对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。

4.3.3 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中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

2016 年初,受到人民币汇率贬值及熔断等因素影响,股票市场大跌,基金净值有大幅回撤。在市场逐步企稳之后,市场的风险偏好明显的下降,风格出现较大变化,低估值价值型个股更加受到市场的青睐,而高估值的个股出现了持续的下跌。红利基金的配置上高估值的成长型个股比例较高,虽然有进行结构调整,但是在调整时点,调仓比例上有所欠缺,所以全年业绩表现不佳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内基金净值下跌 19.65%,同期业绩比较基准下跌 4.87%,基金业绩明显跑输基准。

4.5 管理人对宏观经济的判断及延续 16 年平稳增长、一方面房地产市场受到调控,地产投资增速可能会有所下滑,另一方面国家的财政政策会比较积极,PPP 等基建项目会保持较好的增速,此外国企改革等因素也会释放一定的制度红利,因此判断经济仍会平稳。货币政策稳健中性,为了配合去杠杆的推进,预计货币政策会有所收紧。

证券市场走势估计会受到流动性预期影响较大,会随着预期的改变而起起伏伏,总体来说是一个震荡的结构性行情。行业格局好转,有价格提升预期的周期性行业以及内生增速较高而估值水平已经较低的成长型行业均值得重点关注。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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》等有关法规诚实守信、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。2016 年,合规风控工作仍然是对公司进行全面风险管理,涵盖了制度内控、法律合规、信息披露、风险监控、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控工作,并协调、监督全公司和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,进一步开发并优化量化风险评估模型,利用数字化、专业化管理提升风险评估、监测及预警效能,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

2016 年,随着公司管理投资组合的数量与规模大幅提升、业务类型的不断拓展,合规风控团队不断加强自身专业素质的提升,全面提高专业素质,鼓励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的氛围,团队成员各自发挥自身优势,相互取长补短,专业素质得到均衡提升,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、自律协会、外部律师、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、进一步建立健全风险控制体系

(1)引入独立买方信评机构,初步建立第二层级的信用风险防范机制

2016 年,债券市场信用风险事件频发,公司合规风控部严格执行投资级(AA 级以上)监控,并引入了中债资信(市场上唯一的买方评级机构)的信用风险关注债券三级预警名单,建立灰名单机制并每周向固收部发送监控周报;固收部根据自主评估,同时参考合规风控部固收监控周报,再次回顾持仓及债券库,发现存在信用风险隐患的债券,立即进行卖出及出库处理,在稳健管控信用风险的基础上追求积极回报。建立上述机制后,公司固收投资的信用风险得到良好的控制。

(2)对投资组合进行定期风险评估

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,2016 年公司发布实施了《流动性风险管理制度》及《流动性风险应急预案》,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定期、不定期的压力测试,对流动性风险进行有效的防范。

(3)建立健全业绩科因分析及评估模型,助力绩效考核及业绩持续改善

合规风控部位绩效考核委员会提供了量化绩效考核的数据支持,同时不断完善业绩归因模型,直观体现业绩和风险来源及风险调整后收益,帮助投研部门回顾投资成功经验及有待改善之处。

(4)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。

(5)对公司新产品提供高效、有力的支持

2016 年,公司新发行了 14 只专户产品、9 只公募基金。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。

(6)进一步完善子公司内部控制体系

2016 年,子公司内部控制体系得到进一步完善:

业务部门的一线风险控制。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;

管理层对财务报表的责任段

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红利精选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中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"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财务报表,并使其实现公允反映; (2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	224,475.74 428,390.77
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。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。	2,083,562.11 - 1,558,115.49 - 3,641,677.60
审计意见段	我们认为,上述浦银安盛红利精选基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会实布的有关规定及其允许的基金行业实务操作编制,公允反映了浦银安盛红利精选基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。	160,791,107.93 145,615,744.83 306,406,852.76 - 188,056,224.80 - 135,603,765.24 - 323,659,990.04
注册会计师的姓名	薛莹	张振波
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	2017年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:浦银安盛红利精选混合型证券投资基金

报告截止日:2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2016年 12 月 31 日	上年度末 2015年 12 月 31 日
资产:			
银行存款		9,368,021.57	6,654,025.55
结算备付金		399,299.40	1,008,645.73
存出保证金		51,903.92	154,870.51
交易性金融资产		89,434,607.44	120,168,476.56
其中:股票投资		89,434,607.44	120,168,476.56
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		-	241,582.67
应收利息		1,750.93	2,140.01
应收股利		-	-
应收申购款		32,994.55	484,914.79
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		99,288,577.81	128,714,655.82
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年 12 月 31 日	上年度末 2015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		-	311,248.62
应付赎回款		219,997.18	1,051,989.54
应付管理人报酬		125,893.13	155,213.49
应付托管费		20,982.17	25,868.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		224,475.74	428,390.77
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		240,483.20	303,932.22
负债合计		831,831.42	2,276,643.56
所有者权益:			
实收基金		65,773,839.71	67,857,401.82
未分配利润		32,682,906.68	58,580,610.44
所有者权益合计		98,456,746.39	126,438,012.26
负债和所有者权益总计		99,288,577.81	128,714,655.82

注:报告截止日 2016 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.497 元,基金份额总额 65,773,839.71 份。

7.2 利润表

会计主体:浦银安盛红利精选混合型证券投资基金

本报告期:2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		- 20,868,650.77	43,118,513.79
1.利息收入		79,800.32	75,653.58
其中:存款利息收入		79,800.32	75,653.58
债券利息收入		-	-
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)		437,535.97	31,270,740.34
其中:股票投资收益		139,538.03	31,096,852.90
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		297,997.94	173,887.44
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		- 21,538,566.98	11,431,348.20
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		152,579.92	340,771.67
减:二、费用		3,470,937.50	6,104,081.68
1、管理人报酬	7.4.8.2.1	1,619,361.56	1,592,452.98
2、托管费	7.4.8.2.2	269,893.61	265,408.84
3、销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4、交易费用		1,334,964.33	3,927,345.86
5、利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6、其他费用		246,718.00	318,874.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		- 24,339,588.27	37,014,432.11
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		- 24,339,588.27	37,014,432.11

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:浦银安盛红利精选混合型证券投资基金

本报告期:2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2016年 1 月 1 日至 2016 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)	67,857,401.82	58,580,610.44	126,438,012.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	- 24,339,588.27	- 24,339,588.27
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)	- 2,083,562.11	- 1,558,115.49	- 3,641,677.60
其中:1.基金申购款	84,218,928.36	39,894,720.11	124,113,648.47
2.基金赎回款	- 86,302,490.47	- 41,452,835.60	- 127,755,326.07
四、本期向其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)	65,773,839.71	32,682,906.68	98,456,746.39

项目	上年度可比期间 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)	95,122,518.69	11,554,198.74	106,676,717.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	37,014,432.11	37,014,432.11
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)	- 27,265,116.87	10,011,979.59	- 17,253,137.28
其中:1.基金申购款	160,791,107.93	145,615,744.83	306,406,852.76
2.基金赎回款	- 188,056,224.80	- 135,603,765.24	- 323,659,990.04
四、本期向其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)	67,857,401.82	58,580,610.44	126,438,012.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

郁蓉华 郁蓉华 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

浦银安盛红利精选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")监监许可[2009]926 号文批准,由浦银安盛基金管理有限公司向中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国证监会")和《浦银安盛红利精选股票型证券投资基金基金合同》向券公开募集。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 370,097,644.65 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 260 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《浦银安盛红利精选股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 12 月 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 370,233,660.79 份基金份额,其中认购资金利息折合 136,016.14 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金管理人于 2015 年 8 月 4 日发布的《关于浦银安盛红利精选股票型证券投资基金变更基金名称、基金类型及业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》,经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,本基金管理人决定自 2015 年 8 月 4 日起将本基金变更为混合型证券投资基金,本基金的基金名称变更为"浦银安盛红利精选混合型证券投资基金",将业绩比较基准变更为"中证红利指数 X75%+中证全债指数 X25%",基金合同中的相关条款亦做相应修订。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛红利精选混合型证券投资基金基金合同》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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票的比例占基金资产的 60%-95%;债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%,其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;投资于权证的比例范围占基金资产净值的 0%-3%。自基金合同生效日至 2015 年 8 月 3 日止,本基金的业绩比较基准为:中证红利指数 X 75%+中信标普国债指数 X 25%。自 2015 年 8 月 4 日起,本基金业绩比较基准变更为:中证红利指数× 75%+中证全债指数× 25%。

7.4.2 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》、《浦银安盛红利精选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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