浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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	浦银安盛基本面 400 指数
基金主代码	519117
交易代码	519117
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年 5 月 14 日
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	37, 492, 027.81 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对标的指数的有效跟踪。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日平均跟踪误差的绝对值不超过 0.35%，且年化跟踪误差不超过 4%，以实现对业绩比较基准的有效跟踪。
投资策略	本基金采取完全复制方法进行指数化投资，依据中证锐联基本面 400 指数成份股及其权重配比，合理设置个股投资权重，构建股票组合，使股票组合能有效跟踪中证锐联基本面 400 指数的表现，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日平均跟踪误差的绝对值不超过 0.35%，且年化跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	中证锐联基本面 400 指数收益率× 95%＋银行活期存款利率(税后)× 5%。
风险收益特征	本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	田东辉
	联系电话	021- 23212888	010- 68858113
	电子邮箱	compliance@py- axa.com	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		021- 33079999 或 400- 8828- 999	95580
传真		021- 23212985	010- 68858120

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	- 4, 072, 572.92	20, 753, 095.33	6, 661, 736.88
本期利润	- 10, 282, 173.52	3, 959, 876.74	21, 769, 702.41
加权平均基金份额本期利润	- 0.2599	0.0988	0.3259
本期基金份额净值增长率	- 13.72%	29.04%	41.48%
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	0.5296	0.6318	0.1347
期末基金资产净值	58, 940, 155.34	74, 794, 224.93	59, 340, 317.69
期末基金份额净值	1.572	1.822	1.412

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。

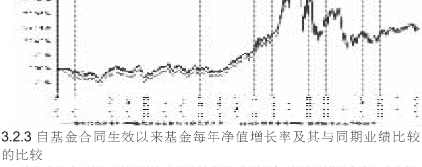
4、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

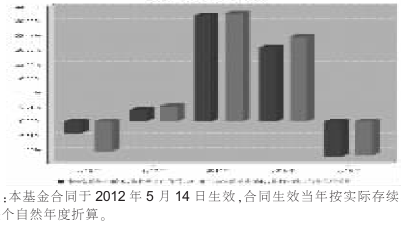
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.29%	0.77%	1.67%	0.79%	- 0.38%	- 0.02%
过去六个月	6.72%	0.84%	7.44%	0.87%	- 0.72%	- 0.03%
过去一年	- 13.72%	1.71%	- 13.21%	1.73%	- 0.51%	- 0.02%
过去三年	57.52%	2.00%	64.82%	2.01%	- 7.30%	- 0.01%
自基金合同生效起至今	57.20%	1.78%	54.45%	1.80%	2.75%	- 0.02%

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



3.2.3 自基金合同生效以来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 2012 年 5 月 14 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度折算。

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		
陈士俊	本公司金融工程部总监，公司职工监事，公司旗下浦银安盛沪深 300 指数基金、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数基金基金经理	2012 年 5 月 14 日	-	15	陈士俊先生，清华大学管理学博士。2001 年至 2003 年间曾在国泰君安证券有限公司研究所担任金融工程研究员 2 年；2003 年至 2007 年 10 月在银河基金管理有限公司工作 4 年，先后担任金融工程部研究员、研究部主管。2007 年 10 月加入浦银安盛基金管理有限公司，任本公司金融工程部总监，并于 2010 年 12 月起兼任浦银安盛沪深 300 指数基金基金经理。2012 年 3 月兼任本公司职工监事。2012 年 5 月起，兼任浦银安盛中证锐联基本面 400 指数基金基金经理。
罗雯	本基金基金经理助理兼浦银安盛沪深 300 指数基金基金经理助理	2012 年 5 月 14 日	-	9	罗雯女士，浙江大学金融数学专业硕士。曾先后任职于长江证券、银河基金管理公司。2007 年 10 月起加盟浦银安盛基金管理有限公司金融工程部，担任金融分析师。2011 年 7 月起，担任本基金基金经理助理。2012 年 5 月起兼任浦银安盛中证锐联基本面 400 指数基金基金经理助理。

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。

- 其他能够防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，中国经济在房地产销售和基建投资的有力支撑下，GDP 增速企稳并回升到四季度的 6.8%。供给侧改革的效应逐步显现，PPI 生产价格指数摆脱长期的负增长，12 月同比增速达到 5.5%，以钢铁、煤炭为代表的周期类行业盈利显著改善。但同时，国际政治经济环境更加复杂，人民币汇率波动加大，给中国证券市场带来了很大的冲击，股票市场年初出现罕见熔断，债券市场年尾再现流动性紧张。在不确定增加的情况下，投资者将资金更多地配置在有稳定预期回报的品种上，高股息、大盘蓝筹股票的表现引人注目。2016 年，中证锐联基本面 400 指数下跌 14.05%。

本报告期内，本基金采取完全复制方法密切跟踪标的指数的表现，组合表现基本与同期业绩比较基准相同。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内基金净值增长率为 -13.72%，同期业绩比较基准收益率为 -13.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，世界进入后全球化时代，国家之间贸易争端和利益冲突将会加剧，全球经济在缺乏强大创新科技引领的情况下又添阴影。随着股票市场 IPO、再融资等改革措施出台，投资者也需要适应新的市场环境。中国经济正在结构调整中找到新的平衡点，基本面改善将引导资金回流到实体经济，回哺优质企业更好地成长。我们对 2017 年的中国股票市场持谨慎乐观的判断，高股息的蓝筹股和有真实业绩支撑的成长股都可能有良好的表现。

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、合规风控部负责人、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。

本基金管理人已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 12 次，每次基金收益分配比例不低于可供分配收益的 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。

4.9 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

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告，投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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(2017)第 21529 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	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数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中证锐联基本面 400 指数证券投资基金(以下简称"浦银安盛中证 400 指数型基金")的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 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中证 400 指数型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")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。	
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。	
审计意见段	我们认为，上述浦银安盛中证 400 指数型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中证 400 指数型基金 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。	
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	2017年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金

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		4, 369, 034.30	5, 571, 571.58
结算备付金		-	-
存出保证金		4, 655.50	64, 364.30
交易性金融资产		55, 879, 980.05	69, 694, 534.71
其中：股票投资		55, 879, 980.05	69, 694, 534.71
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		-	-
应收利息		890.91	1, 060.12
应收股利		-	-
应收申购款		2, 075.33	69, 681.68
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		60, 256, 636.09	75, 401, 212.39
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		948, 294.17	-
应付赎回款		1, 743.99	222, 860.57
应付管理人报酬		50, 778.00	62, 543.89
应付托管费		7, 616.74	9, 381.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		3, 260.68	4, 865.69
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		304, 787.17	307, 335.71
负债合计		1, 316, 480.75	606, 987.46
所有者权益：			
实收基金		37, 492, 027.81	41, 056, 477.44
未分配利润		21, 448, 127.53	33, 737, 747.49
所有者权益合计		58, 940, 155.34	74, 794, 224.93
负债和所有者权益总计		60, 256, 636.09	75, 401, 212.39

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.572 元，基金份额总额 37,492,027.81 份。

7.2 利润表

会计主体：浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金

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		- 9, 017, 994.40	5, 893, 120.76
1.利息收入		30, 052.74	41, 872.42
其中：存款利息收入		30, 052.74	41, 872.42
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)		- 2, 852, 754.43	22, 479, 876.18
其中：股票投资收益		- 3, 456, 826.00	21, 936, 086.25
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		604, 071.57	543, 789.93
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		- 6, 209, 600.60	- 16, 793, 218.59
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		14, 307.89	164, 590.75
减：二、费用		1, 264, 179.12	1, 933, 244.02
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	599, 119.26	723, 557.25
2. 托管费	7.4.8.2.2	89, 867.99	108, 533.54
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		50, 904.35	259, 566.74
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		524, 287.52	841, 586.49
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		- 10, 282, 173.52	3, 959, 876.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		- 10, 282, 173.52	3, 959, 876.74

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金

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)	41, 056, 477.44	33, 737, 747.49	74, 794, 224.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	- 10, 282, 173.52	- 10, 282, 173.52
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)	- 3, 564, 449.63	- 2, 007, 446.44	- 5, 571, 896.07
其中：1.基金申购款	6, 448, 820.31	3, 308, 305.92	9, 757, 126.23
2.基金赎回款	- 10, 013, 269.94	- 5, 315, 752.36	- 15, 329, 022.30
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)	37, 492, 027.81	21, 448, 127.53	58, 940, 155.34
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)	42, 034, 074.00	17, 306, 243.69	59, 340, 317.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	3, 959, 876.74	3, 959, 876.74
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)	- 977, 596.56	12, 471, 627.06	11, 494, 030.50
其中：1.基金申购款	85, 736, 554.50	90, 359, 187.58	176, 095, 742.08
2.基金赎回款	- 86, 714, 151.06	- 77, 887, 560.52	- 164, 601, 711.58
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)	41, 056, 477.44	33, 737, 747.49	74, 794, 224.93

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金(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[2011]2033 号文《关于核准浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金募集的批复》的核准，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《浦银安盛中证锐联基本面 400 指数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 413,196,469.55 元，经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2012)验字第 60951783_B01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 413,537,496.16 份基金份额，其中认购资金利息折合 341,026.61 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，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金资产投资于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、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票资产占基金资产的比例不低于 90%-95%，投资于中证锐联基本面 400 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于股票资产的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日平均跟踪误差的绝对值不超过 0.35%，且年化跟踪误差不超过 4%，以实现对业绩比较基准的有效跟踪。本基金业绩比较基准为中证锐联基本面 400 指数收益率× 95%+ 银行活期存款利率(税后)× 5%。

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》、《浦银安盛中证锐联基本面 400 指数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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.5 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。

7.4.5.1 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。

7.4.7 关联方关系

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、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
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、基金销售机构
法国安盛投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海国盛集团资产有限公司	基金管理人的股东
上海浦银安盛资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的管理费	599, 119.26	723, 557.25
其中：支付销售机构的客户维护费	238, 799.85	285, 686.63

注：支付基金管理人 浦银安盛基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.00% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	89, 867.99	108, 533.54

注：支付基金托管人 中国邮政储蓄银行 的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，

逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

注：本基金无销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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与上年度可比期间均未持有本基金。

7.4.8.4.2 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及上年度末均未持有本基金。

7.4.8.5 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
关联方	4, 369, 034.30	29, 736.97	5, 571, 571.58	39, 784.89

注：本基金的银行存款由基金托管人邮储银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间承销期内均未参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2016 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发 / 增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发 / 增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 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
600655	豫园商城	2016年12月20日	临时停牌	11.42	-	-	27, 507	394, 188.22	314, 129.94	-
600406	国电南瑞	2016年12月29日	临时停牌	16.63	-	-	15, 683	299, 447.19	260, 808.29	-
600859	王府井	2016年9月27日	临时停牌	16.28	-	-	13, 489	310, 417.59	219, 600.92	-
002440	闰土股份	2016年10月24日	临时停牌	16.34	2017年1月12日	15.22	10, 146	202, 568.68	165, 785.64	-
000829	天音控股	2016年9月29日	临时停牌	11.28	-	-	14, 187	202, 841.03	160, 029.36	-
600673	东阳光科	2016年11月15日	临时停牌	7.29	-	-	15, 868	128, 221.58	115, 677.72	-
600626	申达股份	2016年12月15日	临时停牌	13.69	2017年1月12日	13.70	8, 345	100, 031.00	114, 243.05	-
000050	深天马A	2016年9月12日	临时停牌	18.82	2017年3月23日	20.70	5, 600	156, 593.24	105, 392.00	-
600480	凌云股份	2016年7月22日	临时停牌	15.01	2017年1月13日	16.51	7, 000	92, 070.00	105, 070.00	-
000750	国海证券	2016年12月15日	临时停牌	6.97	2017年1月20日	6.27	14, 428	155, 594.34	100, 563.16	-
000042	中洲控股	2016年10月27日	临时停牌	20.24	-	-	4, 500	124, 284.17	91, 080.00	-
000887	中鼎股份	2016年11月18日	临时停牌	25.94	2017年2月15日	23.99	3, 433	68, 826.01	89, 052.02	-
600973	宝胜股份	2016年11月28日	临时停牌	8.05	2017年2月22日	8.86	10, 174	76, 273.96	81, 900.70	-
002075	沙钢股份	2016年9月19日	临时停牌	16.12	-	-	4, 340	90, 702.13	69, 960.80	-
600551	时代出版	2016年11月28日	临时停牌	20.32	-	-	3, 199	68, 113.23	65, 003.68	-
600577	精达股份	2016年5月3日	临时停牌	4.18	2017年3月2日	4.60	15, 306	85, 251.32	63, 979.08	-
600485	信威集团	2016年12月26日	临时停牌	14.60	-	-	4, 300	107, 074.00	62, 780.00	-
601005	重庆钢铁	2016年6月2日	临时停牌	2.52	-	-	16, 900	109, 905.99	42, 588.00	-
002129	中环股份	2016年4月25日	临时停牌	8.27	-	-	4, 000	110, 554.23	33, 080.00	-
000987	越秀金控	2016年8月29日	临时停牌	14.49	2017年1月9日	15.94	1, 734	23, 106.84	25, 125.66	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 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。7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 53,594,130.03 元，属于第二层次的余额为 2,285,850.02 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 63,745,771.94 元，第二层次 5,948,762.77 元，无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	55, 879, 980.05	92.74
	其中：股票	55, 879, 980.05	92.74
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	4, 369, 034.30	7.25
7	其他各项资产	7, 621.74	0.01
8	合计	60, 256, 636.09	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	159, 427.18	0.27
B	采矿业	2, 365, 006.66	4.01
C	制造业	29, 937, 003.00	50.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2, 404, 829.45	4.08
E	建筑业	1, 965, 094.96	3.33
F	批发和零售业	4, 708, 418.72	7.99
G	交通运输、仓储和邮政业	3, 385, 515.80	5.74
H	住宿和餐饮业	44, 985.42	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1, 905, 704.23	3.23
J	金融业	2, 293, 790.17	3.89
K	房地产业	3, 690, 245.61	6.26
L	租赁和商务服务业	1, 146, 655.51	1.95
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	355, 621.26	0.60
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	1, 072, 722.70	1.82
S	综合	444, 959.38	0.75
	合计	55, 879, 980.05	94.81

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

8.3.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000656	金科股份	103, 056	540, 013.44	0.92
2	000422	湖北宜化	63, 800	507, 210.00	0.86
3	600143	金发科技	49, 600	385, 888.00	0.65
4	600739	辽宁成大	20, 033	359, 792.68	0.61
5	000623	吉林敖东	11, 568	358, 492.32	0.61
6	000423	东阿阿胶	6, 530	351, 771.10	0.60
7	002092	中泰化学	28, 682	347, 052.20	0.59
8	000488	晨鸣纸业	31, 027	321, 439.72	0.55
9	600729	重庆百货	13, 678	320, 475.54	0.54
10	600655	豫园商城	27, 507	314, 129.94	0.53

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	000656	金科股份	330, 771.00	0.44
2	000728	国元证券	293, 780.00	0.39
3	600970	中材国际	284, 960.00	0.38
4	600123	兰花科创	264, 744.00	0.35
5	000401	冀东水泥	206, 800.00	0.28
6	000550	江铃汽车	203, 689.00	0.27
7	601718	际华集团	189, 432.00	0.25
8	000708	大冶特钢	186, 656.00	0.25
9	002128	露天煤业	186, 369.00	0.25
10	601099	太平洋	183, 876.00	0.25
11	600277	亿利洁能	177, 270.00	0.24
12	601001	大同煤业	174, 334.00	0.23
13	600637	东方明珠	166, 176.00	0.22
14	601555	东吴证券	147, 991.12	0.20
15	601866	中远海发	144, 483.00	0.19
16	000959	首钢股份	141, 939.00	0.19
17	000917	电广传媒	136, 003.00	0.18
18	601958	金钼股份	135, 024.00	0.18
19	600525	长园集团	125, 879.00	0.17
20	601010	文峰股份	124, 724.00	0.17

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	601377	兴业证券	343, 546.10	0.46
2	000012	南玻 A	276, 262.00	0.37
3	601933	永辉超市	254, 484.00	0.34
4	601888	中国国旅	249, 098.30	0.33
5	601918	*ST新集	240, 416.00	0.32
6	600096	云天化	239, 710.00	0.32
7	600997	开滦股份	213, 100.00	0.28
8	600216	浙江医药	202, 863.00	0.27
9	000488	晨鸣纸业	193, 179.00	0.26
10	600497	驰宏锌锗	192, 894.00	0.26
11	000951	中国重汽	182, 945.40	0.24
12	600246	万通地产	178, 802.27	0.24
13	000703	恒逸石化	167, 832.00	0.22
14	600276	恒瑞医药	167, 560.00	0.22
15	600122	宏图高科	166, 733.00	0.22
16	000708	大冶特钢	164, 891.00	0.22
17	000501	鄂武商 A	161, 162.04	0.22
18	600398	海澜之家	159, 445.98	0.21
19	600675	*ST中企	153, 394.56	0.21
20	002106	莱宝高科	149, 106.87	0.20

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

8.4.3 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	13, 901, 541.02
卖出股票收入(成交)总额	18, 179, 281.36

注：“买入股票的成本”“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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2

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。

8.12.3 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	4, 655.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	890.91
5	应收申购款	2, 075.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7, 621.74

8.12.4 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债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600655	豫园商城	314, 129.94	0.53	临时停牌

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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, 733	7, 921.41	565, 760.15	1.51%	36, 926, 267.66	98.49%

9.3 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	282, 385.02	0.75%

9.4 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2012 年 5 月 14 日)基金份额总额	413, 537, 496.16
本报告期期初基金份额总额	41, 056, 477.44
本报告期基金总申购份额	6, 448, 820.31
减：本报告期基金总赎回份额	10, 013, 269.94
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	37, 492, 027.81

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 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)。本报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 60, 000 元，截止本报告期末，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已提供审计服务的连续年限为 2 年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	32, 080, 822.38	100.00%	29, 876.89	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：

本基金本报告期无新增交易单元。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于 2016 年 4 月 26 日发布浦银安盛基金管理有限公司关于变更公司经营范围及修订《公司章程》的公告，根据浦银安盛基金管理有限公司(以下简称“本公司”)股东会有关决议，本公司经营范围由“基金募集、基金销售、资产管理和证监会许可的其他业务”变更为“基金募集、基金销售、资产管理，境外证券投资管理和证监会许可的其他业务”。 根据相关法规及规范性文件的规定，公司结合变更经营范围等事项修改了《公司章程》中的有关内容。 2、本基金管理人于 2016 年 7 月 29 日发布《关于浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金变更指数许可使用费及修订基金合同的公告》，将相关内容修改为： “在基金成立之后的前两年(即基金合同生效日起至第二个周年日止)，指数许可使用费按前一日的基金资产净值的万分之九的年费率计提。从基金成立的第三年起，如果前一日的基金资产规模净值超过或等于 40 亿元，计费当日的指数许可使用费按照万分之九的年费率计提；如果不足 40 亿元，则计费当日的指数许可使用费按照万分之十的年费率计提。 每季度指数许可使用费下限为人民币伍万元(5 万元)。基金合同生效后的指数许可使用费的支付方式为每季支付一次，于每年 1 月，4 月，7 月，10 月的前十个工作日前从基金财产中一次性支付。基金成立当年，不足 3 个月的，按照 3 个月收费。”

浦银安盛基金管理有限公司

2017 年 3 月 30 日