英大灵活配置混合型发起式证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:英大基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	英大灵活配置	
基金主代码	001270	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年05月07日	
报告期末基金份额总额	3,884,208,349.28份	
投资目标	本基金通过把握宏观经济转折点,灵活配置权益类资产和固定收益类资产,并在严格控制下行风险的基础上,力争实现基金资产较高的长期稳健回报。	
投资策略	1、大类资产配置策略;2、股票投资策略;3、固定收益品种投资策略;4、股指期货投资策略;5、权证投资策略。	
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:1年期银行定期存款利率(税后)+2%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金	
基金管理人	英大基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	英大灵活配置A	英大灵活配置B
下属分级基金的交易代码	001270	001271
报告期末下属分级基金的份额总额	1,491,917,727.30份	2,392,290,621.98份
下属分级基金的风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。	本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年07月01日-2015年09月30日)	
	英大灵活配置A	英大灵活配置B
1.本期已实现收益	5,693,435.40	16,099,765.95
2.本期利润	1,495,884.81	4,950,029.67
3.加权平均基金份额本期利润	0.0008	0.0016
4.期末基金资产净值	1,517,355,687.84	2,430,529,375.86
5.期末基金份额净值	1.017	1.016

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

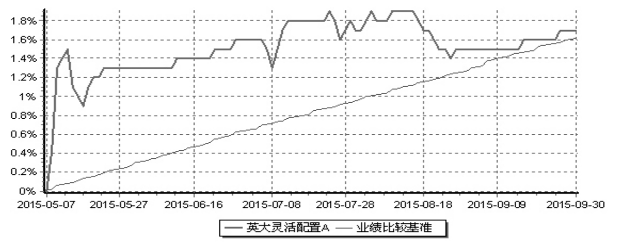
英大灵活配置A

阶段	净值增长率①	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	0.10%	0.07%	0.99%	0.01%	-0.89%	0.06%

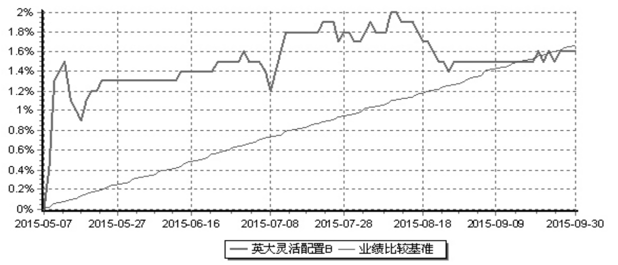
英大灵活配置B

阶段	净值增长率①	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	0.10%	0.08%	0.99%	0.01%	-0.89%	0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金基金合同生效日为2015年5月7日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。图示日期为2015年5月7日至2015年9月30日。



注:本基金基金合同生效日为2015年5月7日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。图示日期为2015年5月7日至2015年9月30日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
袁忠伟	本基金基金经理	2015年05月07日		15	曾任中国民族证券研究发展中心行业公司部经理,证券投资部总经理助理、执行总经理;华西证券股份有限公司资产管理总部投资管理部研究总监、投资主办人。
张琳娜	本基金基金经理	2015年07月15日		9	对外经济贸易大学金融学硕士,9年基金从业经历。先后任益民基金管理有限公司集中交易部交易员,副总经理等职务。2012年3月加入英大基金管理有限公司,曾任公司交易管理部副总经理(主持工作),现任固定收益部副总经理。

注:备注:本基金基金经理助理赵玲莹女士,澳洲昆士兰科技大学应用金融学硕士,曾任职于交通银行山西省分行,2013年加入英大基金管理有限公司,从事固定收益研究工作,具备3年金融业从业经历。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》、《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的约定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定,从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关,通过公司新上线的公平交易系统监测和人工复核等方式在各个环节严格控制交易公平执行,未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金不存在参与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%的情况,且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

股票市场:

三季度,在宏观经济增速放缓、上市公司整体业绩不及投资者预期的基本面背景下,股票市场遭遇杠杆资金平仓出局、违规配资清理等资金面压力,股票市场估值水平快速从高估状态向正常水平回归,这导致沪深300指数当季度下跌28.39%,中小板和创业板指数跌幅均在27%左右。

本基金股票投资采取"以价值股为主要投资方向,仓位控制坚持高减低增,灵活调控。"的投资策略,努力从股市中获取绝对收益,在8月10日之前有效地提升基金单位净值。为控制基金资产下跌风险,股票资产超低配置,有效回避了随后的市场的大幅下跌风险。

债券市场:

三季度债市收益率震荡下行,十年国债季度末比季度初下行36BP,一年期存款利率下调25BP至1.75%,存款准备金率下调50基点。三季度大宗商品价格走弱及美联储加息预期的存在使得美元走强,人民币汇率贬值压力使得国内债券市场资金面受到了一定冲击,央行采用降准降息、公开市场操作和各种定向操作工具对冲人民币汇率贬值的影响,资金面经历了季度初的极度宽松至季度末稳定偏紧的过程。宏观经济继续下滑叠加美联储加息的延后,长端收益率从全年来看本季度下行较多。

因此本基金在三季度大幅增加了债券配置,以低风险短久期债券为主,小幅增加杠杆水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,英大灵活配置基金累计份额净值为1.016元。报告期内,基金份额净值增长率为0.1%,同期业绩比较基准增长率为1.01%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金属于发起式证券投资基金,合同生效三年内,不受基金持有人数或基金资产净值的限制。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入2015年四季度,国内的宏观经济一路走低,调结构的阵痛远未结束,市场对经济的企稳仍旧存有预期,股市和IPO以及外汇市场对资金面的冲击时好时坏,虽然不确定性在2015年一直左右着市场的走势,但是市场终究会回归基本面,GDP大概率不会高于7,CPI在2附近徘徊,宏观经济不起,资金面宽松不及上半年但宽松政策不会退出,四季度是全年资金波动的关键季度。

四季度,在IPO暂停的背景下,本基金将不增加股票投资,继续增持债券,小幅提高杠杆水平,以谨慎的心态持续关注全球和国内经济形势,保持稳健的风格,力争为持有人持续实现正收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	6,101,647.66	0.15
	其中:股票	6,101,647.66	0.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,363,640,940.00	80.36
	其中:债券	3,363,640,940.00	80.36
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	788,710,600.17	18.84
8	其他资产	27,105,106.13	0.65
9	合计	4,185,558,293.96	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,101,647.66	0.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,101,647.66	0.15

5.3 报告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

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	300488	恒锋工具	71,341	3,514,257.66	0.09
2	601877	正泰电器	84,500	2,587,390.00	0.07

5.4 报告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	373,788,000.00	9.47
	其中:政策性金融债	373,788,000.00	9.47
4	企业债券	102,940.00	-
5	企业短期融资券	2,949,366,000.00	74.71
6	中期票据	40,384,000.00	1.02
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,363,640,940.00	85.20

5.5 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	011567003	15神华能源SCP003	2,000,000	200,600,000.00	5.08
2	011522005	15神华SCP005	2,000,000	200,040,000.00	5.07
3	100415	10农发15	2,000,000	200,040,000.00	5.07
4	041553058	15华能CP002	2,000,000	199,960,000.00	5.06
5	071508003	15东方证券CP003	1,600,000	160,048,000.00	4.05

5.6 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本期内未发现本基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、批评的情况

5.11.2 本期内本基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定,也均在基金的备选股票池之内。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	364,674.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,740,431.89
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,105,106.13

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末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	601877	正泰电器	2,587,390.00	0.07	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	英大灵活配置A	英大灵活配置B
报告期期初基金份额总额	1,893,811,814.03	5,608,254,323.52
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	401,894,086.73	3,215,963,701.54
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	1,491,917,727.30	2,392,290,621.98

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

	英大灵活配置A	英大灵活配置B
报告期期初管理人持有的本基金份额	9,999,450.00	
报告期期间买入/申购总份额	-	
报告期期间卖出/赎回总份额	-	
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,999,450.00	
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.67	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	英大直销	2015年05月04日	9,999,450.00	10,000,000.00	-
合计			9,999,450.00	10,000,000.00	

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,999,450.00	0.26%	9,999,450.00	0.26%	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	3年
基金经理等人员	1,100.04	-	1,100.04	-	3年
基金管理人股东	-	-	-	-	3年
其他	4,960.32	-	4,960.32	-	3年
合计	10,005,510.36	0.26%	10,005,510.36	0.26%	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

无

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

中国证监会批准英大灵活配置混合型发起式证券投资基金设立的文件

10.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所

10.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

英大基金管理有限公司
二〇一五年十月二十七日

浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛6个月定期债券	
场内简称	-	
基金主代码	519121	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年5月16日	
报告期末基金份额总额	102,819,568.89份	
投资目标	在控制风险的基础上,追求超过业绩比较基准的当期收入和投资总回报,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。	
投资策略	本基金利用定期开放、定期封闭的运作特性,秉承主动投资管理理念,在有效流动性管理和控制风险的前提下,优化组合、稳健投资,实现基金资产的长期稳健增值。	
业绩比较基准	6个月定期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛6个月定期债券A	浦银安盛6个月定期债券C
下属分级基金的交易代码	519121	519122
报告期末下属分级基金的份额总额	92,604,519.49份	10,215,049.40份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)	
	浦银安盛6个月定期债券A	浦银安盛6个月定期债券C
1.本期已实现收益	-1,457,704.54	-167,136.18
2.本期利润	-767,374.84	-91,387.99
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0083	-0.0089
4.期末基金资产净值	103,407,539.06	11,344,163.95
5.期末基金份额净值	1.117	1.111

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

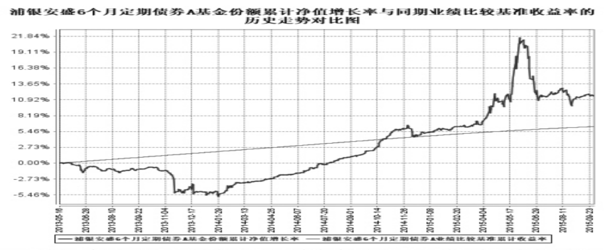
浦银安盛6个月定期债券A

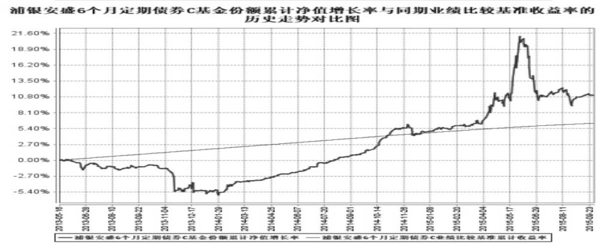
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.71%	0.29%	0.43%	0.00%	-1.14%	0.29%

浦银安盛6个月定期债券C

阶段	净值增长率①	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	-0.71%	0.29%	0.43%	0.00%	-1.14%	0.29%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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





§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
薛铮	本公司固定收益投资部总监,公司旗下浦银安盛优化收益债券基金、浦银安盛幸福回报债券基金、浦银安盛稳健增利债券基金、浦银安盛6个月债券基金、浦银安盛季季添利债券基金以及浦银安盛月月盈债券基金基金经理	2013年5月16日	-	9	薛铮先生,上海财经大学数量经济学硕士。2006年3月至2009年6月,先后就职于红顶金融研究中心,上海证券有限公司从事固定收益研究工作。2009年7月进入浦银安盛基金管理公司,历任固定收益研究员、固定收益基金经理助理、货币基金基金经理等职务。2011年12月起担任浦银安盛稳健增利债券基金(原增利分级债券基金)基金经理。2012年9月起兼任浦银安盛幸福回报债券基金基金经理。2012年11月起,担任本公司固定收益投资总监。2013年5月起,兼任浦银安盛6个月定期开放债券基金基金经理。2013年6月起,兼任浦银安盛季季添利债券基金基金经理。2014年7月起,兼任浦银安盛优化收益债券基金基金经理。2014年12月起,兼任浦银安盛月月盈债券基金基金经理。

注:1、薛铮作为本基金的首任基金经理,其任职日期为本基金成立之日。

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,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,本着诚实信用、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。本报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《公平交易管理规定》,建立并健全了有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个基金组合。

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日和10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。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

3季度经济运行和货币政策相对平稳,债券市场的问题主要集中于两点:一是权益市场的走势;二是人民币汇率的走势。3季度股市的大幅下挫及人民币汇率的意外波动使国内的风险偏好出现系统性下降,债券市场收益率受此影响开始快速下行。目前而言,宽松的货币政策仍未结束,而权益市场短期内也难有趋势性的上行机会,债券市场收益率仍然具有一定的下行空间。在报告期内,本基金维持了较高的信用债仓位和中性的组合久期,并择机进行了部分个券的波段操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期A类净值增长率-0.71%,C类净值增长率-0.71%,同期业绩比较基准收益率为0.43%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	929,500.00	0.52
	其中:股票	929,500.00	0.52
2	固定收益投资	167,283,672.31	94.31
	其中:债券	167,283,672.31	94.31
	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	5,225,261.33	2.95
7	其他资产	3,944,570.73	2.22
8	合计	177,383,004.37	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	929,500.00	0.81
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	929,500.00	0.81

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	110,000	929,500.00	0.81

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,258,800.00	17.65
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	119,166,968.20	103.85
5	企业短期融资券	20,212,000.00	17.61
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,623,000.00	2.29
8	同业存单	-	-
9	其他	5,022,904.11	4.38
10	合计	167,283,672.31	145.78

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	124953	09宁城建	100,000	10,793,000.00	9.41
2	1280316	12惠安国投债	100,000	10,600,000.00	9.24
3	1580041	15黔南投资债	100,000	10,399,000.00	9.06
4	041460100	14亚泰CP002	100,000	10,107,000.00	8.81
5	041454065	14宝钢韶关CP001	100,000	10,105,000.00	8.81

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除中信证券外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。中信证券因存在为到期融资融券合约展期的违规行为(根据相关规定,融资融券合约期限最长为6个月),被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。本基金管理人的研究部门对中信证券保持了及时的研究跟踪,投资决策符合本基金管理人的投资流程。

5.10.2

报告期内,本基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定备选股票库投资的情况。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	58,633.38
2	应收证券清算款	53,872.83
3	应收股利	-
4	应收利息	3,832,064.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,944,570.73

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	2,623,000.00	2.29

5.10.5 报告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未存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

截至本报告期末本基金持有中小企业私募债余额为5,022,904.11元,明细如下:

金额单位:元

债券代码	债券名称	票面利率(%)	数量(张)	期末估值总额
125400	14铜水务	9.50	50,000	5,022,904.11

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	浦银安盛6个月定期债券A	浦银安盛6个月定期债券C
报告期期初基金份额总额	92,604,519.49	10,215,049.40
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	92,604,519.49	10,215,049.40

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准基金募集的文件
2、浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金基金合同
3、浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书
4、浦银安盛6个月定期开放债券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

8.2 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。

8.3 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
2015年10月27日

浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9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:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛医疗健康混合
场内简称	-
基金主代码	519171
交易代码	519171
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月25日
报告期末基金份额总额	2,693,054,074.63份
投资目标	本基金主要投资于医疗健康行业股票,通过自下而上精选个股和科学的风险控制,分享医疗健康产业发展所带来的投资机会,力争为投资者带来长期的超额收益。
投资策略	本基金在股票投资方面主要采用主题投资策略,通过对医疗健康行业的持续跟踪研究,依据对国家关于医疗健康行业的重大政策、中长期规划的跟踪,结合对医疗健康行业相关行业的发展趋势的研究分析,上市公司发展战略、商业模式、技术、工艺的分析,对属于医疗健康行业投资主题范畴的上市公司进行重点投资。
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率*55%+中债综合指数收益率*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。
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-298,307,103.49
2.本期利润	-537,777,279.88
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1904
4.期末基金资产净值	2,015,116,328.82
5.期末基金份额净值	0.748

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。

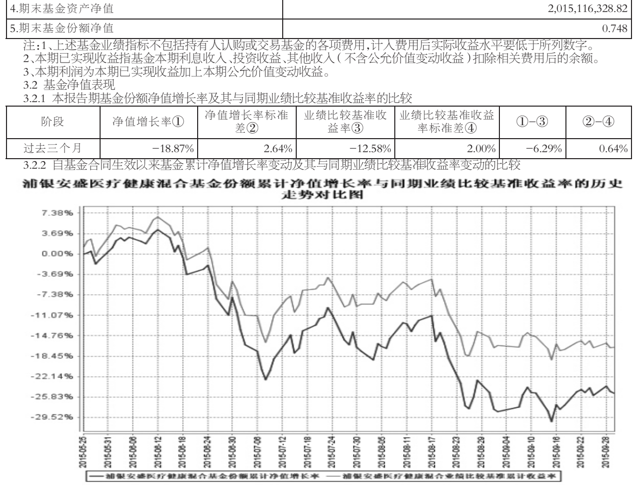
3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-18.87%	2.64%	-12.58%	2.00%	-6.29%	0.64%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:1:本基金基金合同生效日为2015年5月25日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。

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2015年5月25日至2015年11月24日,截至报告期末,本基金建仓期尚未结束。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2015年5月25日	-	7	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先后担任行业研究员、高级研究员、基金经理助理。2015年5月,担任浦银安盛医疗健康混合基金基金经理。

注:1、陈蔚丰作为本基金的首任基金经理,其任职日期为本基金成立之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《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,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,本着诚实信用、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。本报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《公平交易管理规定》,建立并健全了有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个基金组合。

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日和10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。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

3季度,宏观经济平稳运行,货币政策维持宽松的状态,政府继续托底经济,促进改革与创新的推进。而市场层面,监管机构对于场外配资等不合规资金的清理导致市场出现较大幅度回调,7月以来市场多次出现千股跌停千股涨停的局面,流动性风险急剧加大。在政府大力救市之下,市场逐步在8月底企稳,并于9月震荡回升。

医疗基金在5月底开始建仓,虽然仓位中等,也增加了蓝筹股配置但仍无法规避系统性的风险。对于去杠杆对市场的影响判断不足,教训深刻。随着市场在9月份逐步企稳,股票活跃度增加,医疗基金也在逐步提升仓位,增加优秀股票的配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,医疗基金净值下跌18.87%,同期比较基准下跌12.58%

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,152,122,130.17	57.01
	其中:股票	1,152,122,130.17	57.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	590,000,000.00	29.19
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	278,139,673.45	13.76
8	其他资产	799,568.14	0.04
9	合计	2,021,061,371.76	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	841,975,153.10	41.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,912,161.81	1.58
E	建筑业	24,030,858.48	1.19
F	批发和零售业	157,272,307.22	7.80
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	36,048,054.00	1.79
L	租赁和商务服务业	19,720,000.00	0.98
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	17,075,916.00	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	24,087,679.56	1.20
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,152,122,130.17	57.17

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600976	健民集团	2,251,700	60,728,349.00	3.01
2	600129	太极集团	3,559,850	56,316,827.00	2.79
3	600351	亚宝药业	5,059,902	56,063,714.16	2.78
4	600521	华海药业	2,270,000	50,167,000.00	2.49
5	002551	尚荣医疗	2,518,450	49,739,387.50	2.47
6	000919	金陵药业	3,199,938	42,303,180.36	2.10
7	600240	华业资本	3,387,975	36,048,054.00	1.79
8	300147	香雪制药	1,959,864	34,003,640.40	1.69
9	000070	特发信息	1,557,101	33,804,662.71	1.68
10	002727	一心堂	702,729	32,536,352.70	1.61

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	480,920.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	188,252.49
5	应收申购款	130,394.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	799,568.14

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	3,212,821,336.34
报告期期间基金总申购份额	58,058,971.99
减:报告期期间基金总赎回份额	577,826,233.70
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	2,693,054,074.63

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准基金募集的文件
2、浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金基金合同
3、浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
4、浦银安盛医疗健康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

8.2 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。

8.3 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
2015年10月27日