浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金

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：中国邮政储蓄银行股份有限公司
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。

基金托管人中国邮政储蓄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	浦银安盛基本面400指数
场内简称	–
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
报告期末基金份额总额	43,374,455.04份
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。
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

§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	–1,766,625.11
2.本期利润	–30,996,954.86
3.加权平均基金份额本期利润	–0.7095
4.期末基金资产净值	64,615,085.75
5.期末基金份额净值	1.490

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。

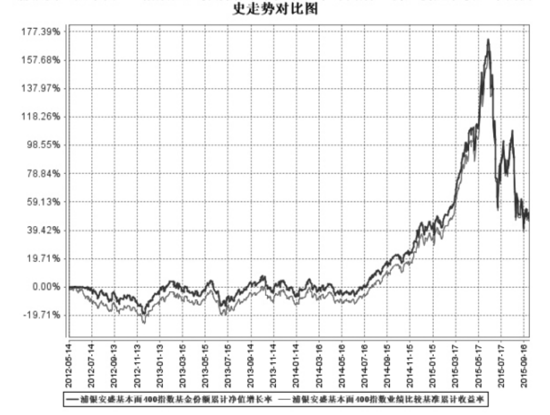
3.2 基金净值表现

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	–30.76%	4.09%	–30.54%	4.05%	–0.22%	0.04%

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

浦银安盛基本面400指数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



§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	–	14	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。

注：1、陈士俊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

2015年第3季度，在暂停新股发行、向市场注入资金等政府强力护市政策的支撑下，股市逐渐趋于稳定。但是，市场交易量持续低落，融资融券余额由2万多亿下降至1万亿以下，股指期货持仓大幅减少，表明市场投资者的情绪更加偏于谨慎。中国三季度各项经济数据仍无大的起色，人民币汇率在8月份出现大幅波动，加之对美联储年底前加息的预期，投资不确定性在加大。中证锐联基本面400指数风格偏向中小盘，期间收益回撤较大。

本报告期内，本基金采取完全复制方法，密切跟踪中证锐联基本面400指数表现，组合表现与同期业绩比较基准贴近。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金净值增长率为–30.76%，同期业绩比较基准收益率为–30.54%。

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	60,218,509.09	92.59
	其中：股票	60,218,509.09	92.59
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	4,657,955.51	7.16
7	其他资产	159,666.34	0.25
8	合计	65,036,130.94	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	301,086.81	0.47
B	采矿业	2,026,665.82	3.14
C	制造业	32,680,439.22	50.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,568,239.47	3.97
E	建筑业	1,540,498.78	2.38
F	批发和零售业	5,595,374.58	8.66
G	交通运输、仓储和邮政业	4,197,236.51	6.50
H	住宿和餐饮业	111,566.07	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,636,533.37	2.53
J	金融业	1,545,161.30	2.39
K	房地产业	4,511,583.99	6.98
L	租赁和商务服务业	1,607,980.75	2.49
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	347,357.50	0.54
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	1,063,958.46	1.65
S	综合	484,826.46	0.75
	合计	60,218,509.09	93.20

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

5.3.1 报告期末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

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	000422	湖北宜化	79,600	498,296.00	0.77
2	600655	豫园商城	27,807	430,730.43	0.67
3	000012	南 玻A	47,372	420,663.36	0.65
4	000423	东阿阿胶	9,830	409,714.40	0.63
5	600276	恒瑞医药	8,823	407,534.37	0.63
6	600729	重庆百货	11,978	387,967.42	0.60
7	000488	晨鸣纸业	59,727	377,474.64	0.58
8	600978	宜华木业	16,755	374,139.15	0.58
9	600026	中海发展	33,400	370,072.00	0.57
10	600160	巨化股份	29,887	367,311.23	0.57

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	57,654.30
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	1,230.56
5	应收申购款	100,781.48
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	159,666.34

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600729	重庆百货	387,967.42	0.60	临时停牌
2	600978	宜华木业	374,139.15	0.58	临时停牌
3	600026	中海发展	370,072.00	0.57	临时停牌

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	44,779,636.26
报告期期间基金总申购份额	27,134,547.08
减:报告期期间基金总赎回份额	28,539,728.30
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	43,374,455.04

§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、 浦银安盛中证锐联基本面400指数型证券投资基金基金合同
3、 浦银安盛中证锐联基本面400指数型证券投资基金招募说明书
4、 浦银安盛中证锐联基本面400指数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

浦银安盛战略新兴产业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：交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	浦银安盛新兴产业混合
场内简称	–
基金主代码	519120
交易代码	519120
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月25日
报告期末基金份额总额	86,037,067.22份
投资目标	通过资产的积极灵活配置，并通过重点关注国家战略新兴产业发展过程中带来的投资机会，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	1、资产配置策略：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。2、股票投资策略：主要采用主题投资策略，通过对战略性新兴产业的及国家政策的持续跟踪研究，结合对战略性新兴产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，对属于战略性新兴产业投资主题范畴的上市公司进行重点投资。3、通过研判债券市场风险收益特征的国际化趋势和国内宏观经济景气周期引发的债券市场收益率的变化趋势，采取自上而下的策略构造组合。
业绩比较基准	55%×中证新兴产业指数+ 45%×中信标普全债指数
风险收益特征	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	交通银行股份有限公司

§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	–77,687,378.36
2.本期利润	–59,259,583.33
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0765
4.期末基金资产净值	170,602,822.99
5.期末基金份额净值	1.983

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。

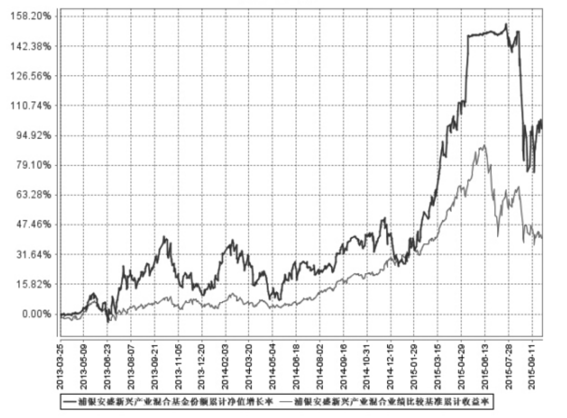
3.2 基金净值表现

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	–20.58%	3.06%	–15.13%	2.28%	–5.45%	0.78%

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

浦银安盛新兴产业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



§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		
吴勇	本公司权益投资部总监，公司旗下浦银安盛红利精选混合基金、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基金经理	2013年3月25日	–	8	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。2012年11月起兼任本公司权益投资部总监。

注：1、吴勇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

2015年三季度国内实体经济较为平稳，GDP增速的下降并没有带来经济的大幅震荡，政府关注的重点还是在改革与创新，货币政策也延续了年初以来较宽松的状态，而最大的变量在于A股市场的去杠杆。监管机构为控制风险，对场外配资等不合规资金进行清理，间接导致市场资金面大幅承压，个股在短期内全线快速下跌，下跌幅度远超预期。经过7、8月份的下跌后，市场的悲观情绪依旧浓厚，但从公司基本面来看，很多个股已具有比较好的长期投资价值，因此，本基金继续延续了超配成长股的配置，超配的行业主要有TMT，医药，国企改革等。

4.5报告期内基金的业绩表现

本季度净值表现低于比较基准，报告期内基金净值增长率为–20.58%，基准收益率为–15.13%。

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	161,248,356.00	89.20
	其中：股票	161,248,356.00	89.20
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	–	–
	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	14,671,908.26	8.12
8	其他资产	4,856,179.20	2.69
9	合计	180,776,443.46	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	1,695,000.00	0.99
C	制造业	90,862,439.10	53.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	3,460,353.00	2.03
F	批发和零售业	17,082,412.46	10.01
G	交通运输、仓储和邮政业	74,970.00	0.04
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,897,770.00	8.15
J	金融业	–	–
K	房地产业	11,605,296.00	6.80
L	租赁和商务服务业	10,013,180.00	5.87
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	517,296.00	0.30
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	8,017,036.44	4.70
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	4,022,603.00	2.36
S	综合	–	–
	合计	161,248,356.00	94.52

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	300065	海兰信	533,579	11,834,782.22	6.94
2	300038	梅泰诺	359,989	10,360,483.42	6.07
3	002712	思美传媒	150,800	8,940,932.00	5.24
4	002383	合众思壮	289,466	8,215,045.08	4.82
5	600661	新南洋	290,262	8,017,036.44	4.70
6	300063	天龙集团	225,200	7,994,600.00	4.69
7	603939	益丰药房	123,919	7,516,926.54	4.41
8	600730	中国高科	301,400	6,130,476.00	3.59
9	600562	国睿科技	137,000	5,727,970.00	3.36
10	603222	济民制药	225,000	5,049,000.00	2.96

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

本基金投资的前十名证券的发行主体除中国高科集团股份有限公司以外不存在被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。本基金投资的前十名证券之一中国高科因公司涉嫌未披露关联方交易等信息披露违法违规事项，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，被立案调查。本基金管理人的研究部门对中国高科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。

5.11.2

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	299,432.81
2	应收证券清算款	4,236,718.46
3	应收股利	–
4	应收利息	7,154.06
5	应收申购款	312,873.87
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	4,856,179.20

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	4,129,268,471.45
报告期期间基金总申购份额	113,463,336.23
减:报告期期间基金总赎回份额	4,156,694,740.46
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	86,037,067.22

§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、 浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金基金合同
3、 浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金招募说明书
4、 浦银安盛战略新兴产业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

诺德成长优势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：诺德基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一五年十月二十七日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月26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。

根据2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及各相关基金合同的有关规定，经协商相关基金托管人同意，并报中国证监会备案，自2015年8月8日起“诺德成长优势股票型证券投资基金”变更为“诺德成长优势混合型证券投资基金”，并相应修订基金合同部分条款。此次变更基金名称并修订基金合同的事项对基金份额持有人的利益无重大实质影响，亦不涉及基金合同当事人的重大权利义务变化，依据法律法规和基金合同约定，无需召开基金份额持有人大会。就前述修改变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续及各项信息披露工作。详见诺德基金管理有限公司2015年8月8日披露的《关于诺德基金管理有限公司旗下股票型基金变更基金类别并修订基金合同的公告》。

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	诺德成长优势混合
场内简称	/
基金主代码	570005
交易代码	570005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年9月22日
报告期末基金份额总额	21,303,688.77份
投资目标	本基金重点关注具备高成长潜力的行业和个股，通过投资于具备充分成长空间的行业和拥有持续竞争优势的企业，分享中国经济和资本市场高速发展的成果。基于对世界和中国经济增长和产业结构变迁、全球技术创新和商业模式演化、上市公司争夺和把握成长机遇能力等因素的深入分析，在有效控制风险的前提下，为基金份额持有人创造风险收益比合理、超越业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金本着成长投资的理念，在构建投资组合时着重寻找成长性行业中的优势企业。本基金设计了“成长行业投资吸引力”模型，从“成长特性”和“安全边际”两个角度评估行业投资价值，通过定性和定量的指标体系以及管理层访谈、实地调研等方式对公司进入深入研究，评估企业的投资价值。本着“成长行业”和“优势企业”的两个选股维度，对最具吸引力的行业和个股进行更加深入的研究，找到最终投资标的，进行超额配置，完成投资组合的构建。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。
基金管理人	诺德基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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	2,315,613.17
2.本期利润	–6,943,036.45
3.加权平均基金份额本期利润	–0.3317
4.期末基金资产净值	40,879,967.80
5.期末基金份额净值	1.919

注：1.所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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

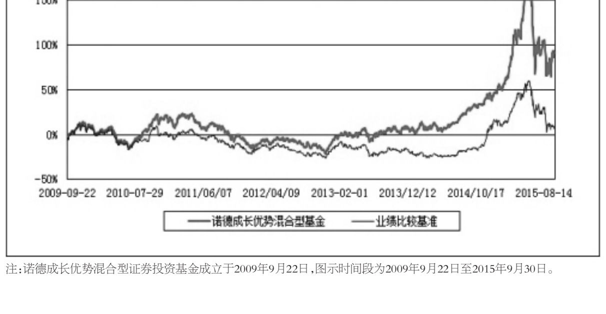
3.2 基金净值表现

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	–13.01%	3.42%	–22.79%	2.67%	9.78%	0.75%

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

诺德成长优势混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2009年9月22日至2015年9月30日)



注：诺德成长优势混合型证券投资基金成立于2009年9月22日，图示时间段为2009年9月22日至2015年9月30日。

本基金建仓期为2009年9月22日至2010年3月21日，报告期结束资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§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		
周勇	本基金基金经理、诺德中小盘股票型证券投资基金基金经理、研究副总监	2014-11-18	2015-07-11	11	复旦大学经济学硕士。2010 年5月加盟诺德基金管理有限公司，担任研究副总监。周勇先生曾先后任职于长江证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司从事投资策略研究工作。
郝旭东	本基金基金经理	2015-07-11	–	7	郝旭东先生于2011年1月起加入诺德基金管理有限公司，在投资研究部从事投资管理相关工作，担任行业研究员，曾任职于西部证券股份有限公司，担任高级研究员。

注：任职日期是指本公司总经理办公会作出决定并履行必要备案程序后对外公告的任职日期；证券从业的含义遵守行业协会《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基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋取最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。此外，本基金管理人还建立了公平交易制度，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司交易系统中使用公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行委托。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《诺德基金管理有限公司异常交易监控与报告管理办法》，明确公司对投资组合的同向与反向交易和其他日常交易行为进行监控，并对发现的异常交易行为进行报告。该办法覆盖异常交易的类型、界定标准、监控方法与识别程序、对异常交易的分析报告等内容并得到有效执行。本报告期内，本基金未有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5%的交易，也未发现存在不公平交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度A股市场总体上是下跌趋势。在经历了上半年的大幅上涨后，代表新兴经济转型的TMT类公司股价已经透支了未来较长时期的利润增长，同时，监管部门对资本市场配资清理的去杠杆，两者从基本面和资金面共同导致了市场的下跌。而政府的救市虽在一定程度上缓解了下跌的空间，但同时也干扰了市场的内在规律，7、8两月交织着千股涨停和千股跌停。三季度沪深300指数下跌–28.4%，中小板下跌–26.57%，创业板下跌–27.1%，但进入9月，由于短期内下跌幅度过大，并且一些成长股估值进入合理区间，市场持稳，创业板率先反弹+4.3%。

本基金在2015年三季度坚持均衡配置、精选个股的总体策略，总体仓位在7成左右，行业配置以确定增长的低估值蓝筹和小票成长股为主。在8月末，市场大幅下跌时，对部分业绩高增长的小盘成长股进行了增持，上述灵活操作，在9月的成长股反弹中取得了一定收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日，本基金份额净值为1.919元，累计净值为1.919 元。本报告期份额净值增长率为–13.01%，同期业绩比较基准增长率为–22.79%。

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2015年四季度，我们讲充分考虑经济周期、政策预期以及周边市场环境影响三大因素。三季度以来，供需失衡下的国内宏观经济超预期低迷，叠加全球大宗商品熊市，国内政策尤其财政政策有进一步发力可能，小排量汽车税收优惠、公积金新政仅是开始，海绵城市、一带一路或进一步明确。去杠杆下，上半年资金驱动的市场格局将不会再现，投资者将更加关注经济周期、市场估值中枢以及企业核心竞争优势等要素。

2015年四季度，本基金仍将坚持均衡配置、精选个股的长期策略，并根据市场情况采取较为灵活的基金仓位。经历三季度的大幅下跌，我们认为四季度A股市场存在阶段反弹的可能，将主要关注两个方面，一是代表经济转型的优质优价的部分真成长股票，二是稳增长政策下可能受益的行业，重点有TMT、医药、环保、高端装备、汽车等板块。同时通过加大仓位控制，并精选个股的方式，以期达到相对稳定的投资回报，最终战胜比较基准。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人将积极与基金托管人协商解决方案，包括但不限于持续营销、转换运作方式、与其他基金合并等，并适时根据法律法规及基金合同约定的程序进行。

§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	31,494,421.18	76.27
	其中：股票	31,494,421.18	76.27
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	9,240,556.30	22.38
7	其他各项资产	559,115.41	1.35
8	合计	41,294,092.89	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	707,500.00	1.73
B	采矿业	–	–
C	制造业	17,271,030.26	42.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	546,000.00	1.34
F	批发和零售业	1,819,800.00	4.45
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	6,816,725.00	16.67
J	金融业	413,660.00	1.01
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	815,615.00	2.00
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	881,500.00	2.16
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	2,222,590.92	5.44
S	综合	–	–
	合计	31,494,421.18	77.04

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	300367	东方网力	34,000	1,916,580.00	4.69
2	600276	恒瑞医药	40,000	1,847,600.00	4.52
3	603939	益丰药房	30,000	1,819,800.00	4.45
4	300113	顺网科技	40,000	1,759,200.00	4.30
5	300166	东方国信	58,000	1,708,100.00	4.18
6	002184	海得控制	47,977	1,409,564.26	3.45
7	300145	南方泵业	40,000	1,381,200.00	3.38
8	002658	雪迪龙	67,000	1,310,520.00	3.21
9	300098	高新兴	52,500	1,247,925.00	3.05
10	300271	华宇软件	35,000	1,233,750.00	3.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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投资。

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

本基金未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

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

本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2本基金本报告期内投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	21,144.59
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	1,468.60
5	应收申购款	536,502.22
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	559,115.41

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300145	南方泵业	1,381,200.00	3.38	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	22,995,644.66
本报告期基金总申购份额	3,140,472.31
减：本报告期基金总赎回份额	4,832,428.20
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	21,303,688.77

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§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

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
本报告期买入/申购总份额	–
本报告期卖出/赎回总份额	–
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	46.94

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金申购和赎回本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会关于同意诺德成长优势股票型证券投资基金募集的批复。
2、《诺德成长优势混合型证券投资基金基金合同》。
3、《诺德成长优势混合型证券投资基金招募说明书》。
4、诺德基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
5、诺德成长优势混合型证券投资基金本季度报告原文。
6、诺德基金管理有限公司董事会决议。

9.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人网站：http://www.nuodefund.com。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人诺德基金管理有限公司，咨询电话400-888-0009、(021)68604888，或发电子邮件至：service@nuodefund.com。

诺德基金管理有限公司
二〇一五年十月二十七日