浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信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2015年5月25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	浦银安盛医疗健康混合
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
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
报告期末基金份额总额	2,534,356,596.97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。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	方韡
	联系电话	021-23212888	010-89936330
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95558
传真		021-23212985	010-85230024

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5月25日(基金合同生效日)-2015年12月31日	2014年	2013年
本期已实现收益	-276,075,681.77	–	–
本期利润	-286,034,077.76	–	–
加权平均基金份额本期利润	-0.1019	–	–
本期基金份额净值增长率	-6.30%	–	–
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	-0.0956	–	–
期末基金资产净值	2,375,759,836.15	–	–
期末基金份额净值	0.937	–	–

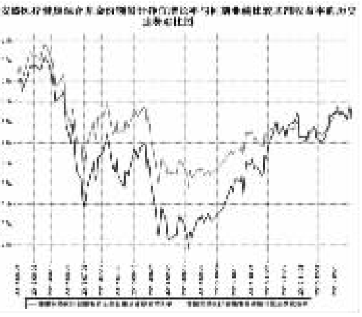
注:1、本基金《基金合同》2015年5月25日生效。以上财务指标中"本期"指2015 年5月25日(基金成立日)至2015年12月31日止期间。
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。
4、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
5、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
6、本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,至报告期末,合同成立未满一年。

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

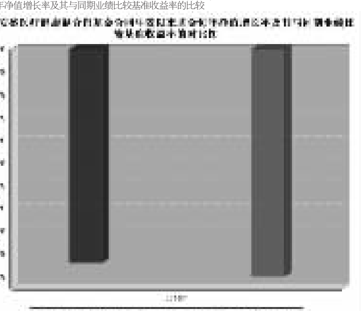
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	25.27%	1.67%	12.14%	1.04%	13.13%	0.63%
过去六个月	1.63%	2.24%	-1.97%	1.61%	3.60%	0.63%
自基金合同生效起至今	-6.30%	2.17%	-6.70%	1.67%	0.40%	0.50%

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:
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,建仓期结束时,本基金投资组合比例符合本基金基金合同约定。

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2015年5月25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2.8亿元,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,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。
李芳	公司旗下权益类基金经理助理	2015年12月1日	–	4.5	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。

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、其余人员的任职日期和离职日期为公司决定的聘任日期和解聘日期。
3、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,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

医疗基金于5月底开始建仓,而市场从6月中旬开始受到清理场外配资,汇率贬值等因素影响先后出现两波迅速而幅度较大的下跌,千股跌停的局面屡次出现,基金虽然仓位中等,但是净值也出现较大幅度回撤。9月之后主要风险因素开始消退,市场情绪趋于稳定,个股开始表现活跃,医疗基金顺应市场趋势,在4季度逐步提升仓位,并且从技术进步和医疗体制改革两条主线上精选个股优化持仓结构,取得较好的效果

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,基金净值下跌6.3%,好于业绩比较基准

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年国内国际宏观形势将是复杂的一年。国际经济方面,欧日复苏缓慢,地缘政治危机对全球经济的复苏构成威胁,经济下行风险仍然不小。欧日央行货币政策进一步放松的可能性较大,而美联储的货币政策不确定性较大。国内经济大概率会是L型走势,供给侧改革是政策的着力点,财政政策将配合供给侧改革的推进,而货币政策预计也会保持宽松,但是受到汇率等因素制约,宽松的方式和程度可能与过去两年有所不同。

总体而言,我们仍然相信中国经济会保持相对较快的增速,结构调整将在财政政策和货币政策配合下逐步进行,证券市场中长期发展趋势向上。不过美联储的货币政策,汇率、供给侧改革,注册制推进等的不确定性将会加大市场的波动性,提升操作的难度。医药行业预计将保持快于GDP增速的增长,不过在医改的大背景下也存在结构性调整的问题,符合调整方向的细分行业将取得更高的增速。

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。2015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

2015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,合规风控团队也补充了较有经验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,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)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定期、不定期的压力测试,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6只专户产品(2只为委托公司管理),2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。

(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:

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、合理性和有效性进行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控制下。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,逐步转向事前咨询及行讨论以及事后稽核,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规风控考核体系

2015年,公司进一步加大对各部门、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、落实到人,并根据中风险及以上事件对责任人员采取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合规运作,以及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管理第二道和第三道防线方面发挥了积极的作用。

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自评估工作;
(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)对公司投资指令、投资建议书进行了检查;
(5)对公司信息技术管理进行了检查。

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情况。

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)对一级市场数百个证券的申购,从关联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、信息披露和文件报送

为了公司信息披露的负责人设在合规风控部,因此,合规风控部指定专人负责并协调公司的信息披露工作,督察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,以及整理、审阅和报送等。该项工作虽然占据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,基本未出现重大迟披、漏披、延披、错披的情形。

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、上报数百份公告及报告,未出现重大迟、漏等现象。

6、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销售费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序而高效,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、新股发行体制改革培训、退市机制改革培训等。培训前,合规风控团队会商量每次培训的议题和内容,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全年为业务人员提供了共5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2.5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、督促和推动公司的制度建设和完善

督促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TA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贵局及人民银行报送报告报表等各项材料;(6)进行反洗钱合规培训;(7)进行反洗钱的专项审计及自评估。

10、落实监管政策和要求,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:

⑴收发监管机关的所有文件,传达监管机关的政策,从收文和报送环节进行协调和督促;
⑵组织、协调和督导公司的专项自查;
⑶代表公司参与上海基金业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、督促客服中心妥善处理投资人的重大投诉,包括商量投诉处理的反馈内容、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:当董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:就重大制度修订事项,基金产品募集、专户产品审核,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的联系日益紧密和协调,这为公司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》。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

据本基金《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6次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

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

2015年,本基金托管人在对浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2015年,本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求,对基金管理人浦银安盛基金管理有限公司在本基金投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对浦银安盛基金管理有限公司编制和披露的浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金2015年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、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(2016)第20835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	浦银安盛医疗健康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医疗健康灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"浦银安盛医疗健康基金")的财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表、2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间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医疗健康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。	
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,上述浦银安盛医疗健康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医疗健康基金2015年12月31日的财务状况以及2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间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:浦银安盛医疗健康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	7.4.7.1	552,065,527.58	–
结算备付金		11,422,558.27	–
存出保证金		1,351,883.71	–
交易性金融资产	7.4.7.2	1,819,126,556.77	–
其中:股票投资		1,819,126,556.77	–
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	7.4.7.3	–	–
买入返售金融资产	7.4.7.4	–	–
应收证券清算款		–	–
应收利息	7.4.7.5	130,909.06	–
应收股利		–	–
应收申购款		184,349.75	–
递延所得税资产		–	–
其他资产	7.4.7.6	–	–
资产总计		2,384,281,785.14	–
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	7.4.7.3	–	–
卖出回购金融资产款		–	–
应付证券清算款		–	–
应付赎回款		2,637,504.71	–
应付管理人报酬		3,007,682.11	–
应付托管费		501,280.34	–
应付销售服务费		–	–
应付交易费用	7.4.7.7	2,025,977.37	–
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债	7.4.7.8	349,504.46	–
负债合计		8,521,948.99	–
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,534,356,596.97	–
未分配利润	7.4.7.10	-158,596,760.82	–
所有者权益合计		2,375,759,836.15	–
负债和所有者权益总计		2,384,281,785.14	–

注:1、本财务报表的实际编制期间自2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间。
2、报告截止日2015年12月31日,基金份额净值0.937元,基金份额总额2,534,356,596.97份。
3、本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,至报告期末,合同成立未满一年。
4、本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.2 利润表

会计主体:浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金
本报告期: 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入		-252,845,294.72	–
1.利息收入		8,645,834.28	–
其中:存款利息收入	7.4.7.11	2,935,575.86	–
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		5,710,258.42	–
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		-253,529,592.06	–
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-257,038,067.98	–
基金投资收益		–	–
债券投资收益	7.4.7.13	–	–
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	–	–
贵金属投资收益	7.4.7.14	–	–
衍生工具收益	7.4.7.15	–	–
股利收益	7.4.7.16	3,508,475.92	–
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	-9,958,395.99	–
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	1,996,859.05	–
减:二、费用		33,188,783.04	–
1. 管理人报酬	7.4.9.2.1	21,964,601.37	–
2. 托管费	7.4.9.2.2	3,660,766.93	–
3. 销售服务费	7.4.9.2.3	–	–
4. 交易费用	7.4.7.19	7,213,222.84	–
5. 利息支出		–	–
其中:卖出回购金融资产支出		–	–
6. 其他费用	7.4.7.20	350,191.90	–
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-286,034,077.76	–
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-286,034,077.76	–

注:1、本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,至报告期末,合同成立未满一年。
2、本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年5月25日(基金合同生效日)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)	3,212,821,336.34	–	3,212,821,336.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	-286,034,077.76	-286,034,077.76
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)	-678,464,739.37	127,437,316.94	-551,027,422.43
其中:1.基金申购款	88,217,077.58	-13,829,770.49	74,387,307.09
2.基金赎回款	-766,681,816.95	141,267,087.43	-625,414,729.52
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)	2,534,356,596.97	-158,596,760.82	2,375,759,836.15
项目	上年度可比期间 2014年1月1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)	–	–	–
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	–	–
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)	–	–	–
其中:1.基金申购款	–	–	–
2.基金赎回款	–	–	–
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)	–	–	–

注:1、本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,至报告期末,合同成立未满一年。
2、本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

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

浦银安盛医疗健康灵活配置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")证监许可[2015]406号《关于核准浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》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《浦银安盛医疗健康灵活配置混合型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人民币3,211,053,585.02元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第427号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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》于2015年5月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,212,821,336.34份基金份额,其中认购资金利息折合1,767,751.32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 人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛医疗健康灵活配置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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含中小企业私募债)、货币市场工具(含中期票据)、权证、资产支持证券、股指期货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(但须符合中国证监会的相 关规定)。本基金的股票投资比例为基金资产的 0%-95%;现金、债券资产、资产支持证券及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%-100%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金以医疗健康行业上市公司为股票主要投资对象,投资于医疗健康行业上市公司证券的资产占非现金资产的比例不低于 80%。本基金的业绩比较基准为:中证医药卫生指数收益率*55%+中债综合指数收益率*45%。

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》、《浦银安盛医疗健康灵活配置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2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的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2015年12月31日的财务状况以及2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

人民币

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

⑴金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

⑵金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:⑴ 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;⑵ 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者⑶ 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

⑴存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

⑵存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

⑶当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值变动累计额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:⑴ 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;⑵ 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;⑶ 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

⑴ 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。
⑵ 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,股权的股息、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。
⑶ 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,于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额,自2015年9月8日起,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。
⑷ 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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
活期存款	552,065,527.58	–
定期存款	–	–
其中:存款期限1-3个月	–	–
其他存款	–	–
合计:	552,065,527.58	–

注:本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目		本期末 2015年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,829,084,952.76	1,819,126,556.77	-9,958,395.99
贵金属投资-金交所黄金合约		–	–	–
债券	交易所市场	–	–	–
	银行间市场	–	–	–
	合计	–	–	–
资产支持证券		–	–	–
基金		–	–	–
其他		–	–	–
合计		1,829,084,952.76	1,819,126,556.77	-9,958,395.99
项目		上年度末 2014年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		–	–	–
贵金属投资-金交所黄金合约		–	–	–
债券	交易所市场	–	–	–
	银行间市场	–	–	–
	合计	–	–	–
资产支持证券		–	–	–
基金		–	–	–
其他		–	–	–
合计		–	–	–

注:本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金在本报告期末未持有买入返售金融资产。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	124,585.60	–
应收定期存款利息	–	–
应收其他存款利息	–	–
应收结算备付金利息	5,654.22	–
应收债券利息	–	–
应收买入返售证券利息	–	–
应收申购款利息	–	–
应收黄金合约拆借孳息	–	–
其他	669.24	–
合计	130,909.06	–

注:1、此处其他列示的是基金存于上交所与深交所的结算保证金的期末应收利息。
2、本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.6 其他资产

本基金在本报告期末未持有其他资产。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,025,977.37	–
银行间市场应付交易费用	–	–
合计	2,025,977.37	–

注:本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	–	–
应付赎回费	9,504.46	–
预提费用	340,000.00	–
合计	349,504.46	–

注:本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

项目	本期 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	3,212,821,336.34	3,212,821,336.34
本期申购	88,217,077.58	88,217,077.58
本期赎回(以"-"号填列)	-766,681,816.95	-766,681,816.95
- 基金拆分/份额折算前	–	–
基金拆分/份额折算变动份额	–	–
本期申购	–	–
本期赎回(以"-"号填列)	–	–
本期末	2,534,356,596.97	2,534,356,596.97

注:1. 申购含红利再投、转换入份额;赎回含转换出份额。
2. 本基金自2015年4月21日至2015年5月20日止期间公开发售,共募集有效净认购资金3,211,053,585.02元。根据《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》的规定,本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入1,767,751.32元在本基金成立后,折算为1,767,751.32份基金份额,划入基金份额持有人账户。
3. 根据《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》和《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》的相关规定,本基金于2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年7月6日期间暂不向投资人开放基金交易,申购、赎回、转换和定期定额投资业务自2015年7月7日起开始办理。

7.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	–	–	–
本期利润	-276,075,681.77	-9,958,395.99	-286,034,077.76
本期基金份额交易产生的变动数	33,892,148.80	93,545,168.14	127,437,316.94
其中:基金申购款	-5,621,224.10	-8,208,546.39	-13,829,770.49
基金赎回款	39,513,372.90	101,753,714.53	141,267,087.43
本期已分配利润	–	–	–
本期末	-242,183,532.97	83,586,772.15	-158,596,760.82

7.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
活期存款利息收入	2,808,258.49	–
定期存款利息收入	–	–
其他存款利息收入	–	–
结算备付金利息收入	121,545.45	–
其他	5,771.92	–
合计	2,935,575.86	–

注:1、此处其他列示的是基金上交所与深交所结算保证金利息以及基金申购款滞留利息。
2、本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
卖出股票成交总额	1,674,305,811.61	–
减:卖出股票成本总额	1,931,343,879.59	–
买卖股票差价收入	-257,038,067.98	–

注:本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1债券投资收益项目构成

本基金本报告期间无债券投资收益。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.13.2债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期间无债券投资收益。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.13.3债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期间无债券投资收益。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.13.4债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期间无债券投资收益。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.13.5资产支持证券投资收益

本基金本报告期间无资产支持证券投资收益。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.14贵金属投资收益

7.4.7.14.1贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期间无贵金属投资收益。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.14.2贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期间无贵金属投资收益。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.14.3贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期间无贵金属投资收益。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.14.4贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期间无贵金属投资收益。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.15衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

基金本报告期间无衍生工具收益--买卖权证差价收入。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.16 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,508,475.92	–
基金投资产生的股利收益	–	–
合计	3,508,475.92	–

注:本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.交易性金融资产	-9,958,395.99	–
——股票投资	-9,958,395.99	–
——债券投资	–	–
——资产支持证券投资	–	–
——贵金属投资	–	–
——其他	–	–
2.衍生工具	–	–
——权证投资	–	–
3.其他	–	–
合计	-9,958,395.99	–

注:本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
基金赎回费收入	1,956,294.21	–
转换费收入	40,564.84	–
合计	1,996,859.05	–

注:1. 本基金的赎回费率按持有期间递减,不低于赎回费总额的25%归入基金资产。
2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成,其中不低于赎回费部分的25%归入转出基金的基金资产。
3. 本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.19 交易费用

单位:人民币元

项目	本期 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
交易所市场交易费用	7,213,222.84	–
银行间市场交易费用	–	–
合计	7,213,222.84	–

注:本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.20 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
审计费用	110,000.00	–
信息披露费	230,000.00	–
银行汇划费用	10,191.90	–
合计	350,191.90	–

注:本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.7.21 分部报告

–

7.4.8 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
基金管理人、基金销售机构	基金托管人、基金代销机构
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、基金代销机构
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。

7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.9.1.1 股票交易

本基金在本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.9.1.2 债券交易

本基金在本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.9.1.3 债券回购交易

本基金在本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.9.1.4 权证交易

本基金在本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期无应支付关联方的佣金。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.9.2 关联方报酬

7.4.9.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	21,964,601.37	–
其中:支付销售机构的客户维护费	9,232,910.46	–

注:1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×管理费率%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
2、本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.9.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,660,766.93	–

注:1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×托管费率%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
2、本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.9.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人在本报告期末未持有本基金。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.9.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.9.5 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 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
中信银行股份有限公司	552,065,527.58	2,808,258.49	–	–

注:1、本基金的银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。
2、本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期承销期内未参与关联方承销的证券。本基金《基金合同》生效日为2015年5月25日,无上年度可比期间。

7.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期无其他关联交易事项。

7.4.10 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

7.4.10.2 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
600771	广誉远	2015年11月17日	临时停牌	31.98	2016年3月9日	28.78	891,945	48,162,315.64	28,524,401.10	–
000153	丰原药业	2015年10月14日	临时停牌	10.44	–	–	1,799,900	32,395,721.05	18,790,956.00	–
600530	交大昂立	2015年8月4日	临时停牌	21.37	2016年1月21日	23.51	500,000	13,996,807.00	10,685,000.00	–

注:本基金截至2015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。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末2015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。

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末2015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。

7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

⑴公允价值

⒜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。

⒝持续的以公允价值计量的金融工具

⒤各层次金融工具公允价值

于2015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1,761,126,199.67 元, 属于第二层次的余额为58,000,357.10元,无属于第三层次的余额。

(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。

⒞非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015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。

⒟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。

⑵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	1,819,126,556.77	76.30
	其中:股票	1,819,126,556.77	76.30
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	563,488,085.85	23.63
7	其他各项资产	1,667,142.52	0.07
8	合计	2,384,281,785.14	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	1,151,354,145.13	48.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	65,404,694.97	2.75
E	建筑业	48,290,000.00	2.03
F	批发和零售业	282,808,617.59	11.90
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	151,696,891.76	6.39
J	金融业	–	–
K	房地产业	50,989,023.75	2.15
L	租赁和商务服务业	33,999,303.00	1.43
M	科学研究和技术服务业	34,583,880.57	1.46
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	1,819,126,556.77	76.57

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

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	002551	尚荣医疗	2,518,450	83,033,296.50	3.50
2	600351	亚宝药业	5,059,902	79,035,669.24	3.33
3	600976	健民集团	2,251,700	76,175,011.00	3.21
4	002462	嘉事堂	1,469,994	74,411,096.28	3.13
5	600129	太极集团	3,097,000	66,059,010.00	2.78
6	000722	湖南发展	3,510,719	65,404,694.97	2.75
7	600718	东软集团	2,000,000	62,100,000.00	2.61
8	600865	百大集团	2,605,600	55,942,232.00	2.35
9	002381	双箭股份	3,259,044	55,664,471.52	2.34
10	000919	金陵药业	3,199,938	55,038,933.60	2.32

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600129	太极集团	111,318,322.09	4.69
2	002551	尚荣医疗	103,589,300.18	4.36
3	600566	济川药业	91,748,046.50	3.86
4	600976	健民集团	90,572,761.11	3.81
5	600351	亚宝药业	88,103,096.88	3.71
6	300181	佐力药业	84,040,746.10	3.54
7	600535	天士力	80,721,944.17	3.40
8	000722	湖南发展	79,169,973.63	3.33
9	300018	中元华电	77,000,179.52	3.24
10	000919	金陵药业	72,946,793.56	3.07
11	600521	华海药业	70,599,897.53	2.97
12	002462	嘉事堂	66,942,827.56	2.82
13	300147	香雪制药	63,904,775.26	2.69
14	300406	九强生物	63,427,245.21	2.67
15	600511	国药股份	61,654,192.84	2.60
16	600557	康缘药业	60,988,176.07	2.57
17	000423	东阿阿胶	60,983,636.60	2.57
18	600718	东软集团	59,126,967.81	2.49
19	600358	国旅联合	58,253,569.45	2.45
20	300255	常山药业	56,607,906.99	2.38
21	600240	华业资本	56,475,260.80	2.38
22	002584	西陇科学	56,430,427.92	2.38
23	002381	双箭股份	53,973,035.04	2.27
24	600422	昆药集团	53,005,759.43	2.23
25	002366	台海核电	52,404,460.45	2.21
26	000821	京山轻机	52,252,526.80	2.20
27	300253	卫宁软件	51,126,174.00	2.15
28	600085	同仁堂	48,281,397.88	2.03
29	300015	爱尔眼科	48,210,560.46	2.03
30	600771	广誉远	48,162,315.64	2.03
31	000623	吉林敖东	47,661,548.09	2.01

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600566	济川药业	71,279,937.70	3.00
2	002584	西陇科学	62,258,149.25	2.62
3	000070	特发信息	61,034,467.02	2.57
4	600521	华海药业	58,983,140.70	2.48
5	600535	天士力	58,708,370.34	2.47
6	002366	台海核电	54,586,123.57	2.30
7	000423	东阿阿胶	51,447,141.51	2.17
8	300018	中元华电	46,672,507.38	1.96
9	600172	黄河旋风	46,123,416.15	1.94
10	600862	南通科技	45,503,473.07	1.92
11	600511	国药股份	43,159,721.81	1.82
12	300015	爱尔眼科	41,905,288.23	1.76
13	600422	昆药集团	39,660,626.51	1.67
14	600557	康缘药业	38,409,199.92	1.62
15	600358	国旅联合	38,330,195.53	1.61
16	300059	东方财富	36,103,020.51	1.52
17	600328	兰太实业	35,717,670.00	1.50
18	300406	九强生物	31,207,962.00	1.31
19	300453	三鑫医疗	30,114,030.40	1.27
20	600085	同仁堂	30,098,710.56	1.27

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	3,760,428,832.35
卖出股票收入(成交)总额	1,674,305,811.61

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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	1,351,883.71
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	130,909.06
5	应收申购款	184,349.75
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,667,142.52

8.12.4 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债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§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
32,702	77,498.52	1,984,126.98	0.08%	2,532,372,469.99	99.92%

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	751,661.82	0.03%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2015年5月25日)基金份额总额	3,212,821,336.34
本报告期期初基金份额总额	–
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	88,217,077.58
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	766,681,816.95
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
本报告期期末基金份额总额	2,534,356,596.97

注:总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§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),未有改聘情况发生。本报告期内应支付给会计师事务所的报酬为110,000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1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	
国泰君安	1	3,364,854,017.97	61.93%	3,108,327.47	62.00%	–
国信证券	1	2,068,831,756.29	38.07%	1,905,270.55	38.00%	–

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	11,260,600,000.00	100.00%	–	–

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2015年4月22日发布《浦银安盛基金管理有限公司关于股东变更的公告》,公告披露:根据上海市政府的要求,经上海国盛(集团)有限公司批准,本基金管理人原股东上海盛融投资有限公司(以下简称"上海盛融")由其母公司上海国盛集团资产有限公司(以下简称"上海国盛")吸收合并,上海盛融持有的本基金管理人10%的股权由上海国盛承继,本基金管理人股东因此由上海盛融变更为上海国盛。相关工商变更登记手续已办理完毕并已报中国证监会备案。

浦银安盛基金管理有限公司
2016年3月30日