浦银安盛价值成长混合型证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期: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。

基金托管人中国工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	浦银安盛价值成长混合
场内简称	-
基金主代码	519110
交易代码	519110
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年4月16日
报告期末基金份额总额	1,665,284,253.87份
投资目标	以追求长期资本增值为目的,通过投资于被市场低估的具有价值属性或可预期的具有持续成长属性的股票,在充分控制风险的前提下,分享中国经济快速增长的成果,进而实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金坚持自上而下与自下而上相结合的投资策略,在投资策略上充分体现"价值"和"成长"的主导思想。在基本面分析的基础上,结合深入的实地调研和估值研究,对于符合本基金理念的标的股票进行精选投资。 "价值"是指甄别公司的核心价值,通过自下而上的研究,以基本面研究为核心,力求卓有远见地挖掘出被市场忽视的价值低估型公司。价值因素主要表现在相对市场股价比较高的自由现金流、比较高的每股收益和净资产。 "成长"主要表现在可持续性、可预见性的增长。寻找成长型公司重点在于对公司成长性的客观评价和比较上,不仅仅需要关注成长的数量,同时还要关注成长的质量,希望上市公司的成长能给上市公司股东带来实际收益的增长,而非简单粗放的规模增长。此外我们还要关注上市公司成长的可持续性和可预见性。
业绩比较基准	沪深300指数×75%+中证全债指数×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金产品,基金资产整体的预期收益和预期风险均较高,属于较高风险、较高收益的基金品种。本基金力争在科学的风险管理的前提下,谋求实现基金财产的安全和增值。
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

注:自2015年8月4日起,本基金类型由股票型变更为混合型,本基金的基金名称变更为"浦银安盛价值成长混合型证券投资基金",本基金业绩比较基准由"沪深300指数×75%+中信标普国债指数×25%"变更为"沪深300指数×75%+中证全债指数×25%"。具体内容详见基金管理人于2015年8月4日发布的《关于浦银安盛价值成长股票型证券投资基金变更基金名称、基金类型及业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》。

§3 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	-918,431,834.39
2.本期利润	-2,420,423,216.23
3.加权平均基金份额本期利润	-1.2216
4.期末基金资产净值	2,606,183,900.88
5.期末基金份额净值	1.565

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。

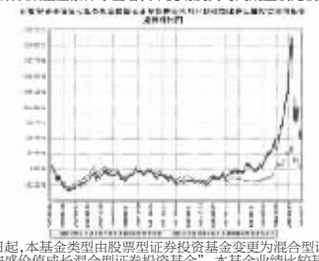
3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-42.14%	3.42%	-21.65%	2.51%	-20.49%	0.91%

3.2.2 目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:自2015年8月4日起,本基金类型由股票型证券投资基金变更为混合型证券投资基金,本基金的基金名称变更为"浦银安盛价值成长混合型证券投资基金",本基金业绩比较基准由"沪深300指数×75%+中信标普国债指数×25%"变更为"沪深300指数×75%+中证全债指数×25%"。具体内容详见基金管理人于2015年8月4日发布的《关于浦银安盛价值成长股票型证券投资基金变更基金名称、基金类型及业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》。

§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		
蒋建伟	公司旗下浦银安盛价值成长混合基金、浦银安盛新经济结构混合基金、浦银安盛增长动力混合基金基金经理	2010年7月21日	-	14	蒋建伟先生,毕业于上海财经大学。2001年至2007年就职于上海东新国际投资管理有限公司担任研究员、投资经理助理。2007年加盟浦银安盛基金管理有限公司先后担任行业研究员、股票基金经理助理。2010年7月起,担任浦银安盛价值成长混合基金基金经理。2012年6月至2013年9月兼任浦银安盛优化收益债券基金基金经理。2014年5月起兼任浦银安盛新经济结构混合基金基金经理。2015年3月起兼任浦银安盛增长动力混合基金基金经理。

注:1、此处的"任职日期"指公司决定确定的聘任日期。

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

三季度,中国股票市场经历了前所未有的流动性危机,伴随着场外配资的清理,股票出现了无量快速下跌,幅度和速度都超出了大家的预期。其中,沪深300下跌28%,创业板指数下跌27%。

本基金在期间进行了一定幅度的减仓以及结构调整,但是由于缺失的流动性以及大规模的赎回,使得所做调整的效果并不明显,损失巨大。

4.5报告期内基金的业绩表现

报告期内业绩比较基准下跌21.65%,基金净值下跌42.14%。

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	2,457,479,755.88	93.45
	其中:股票	2,457,479,755.88	93.45
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	151,192,683.22	5.75
8	其他资产	20,950,742.58	0.80
9	合计	2,629,623,181.68	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	5,191.70	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	991,222,418.27	38.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,685,933.12	0.37
E	建筑业	59,895,514.83	2.30
F	批发和零售业	97,839,426.65	3.75
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	848,377,073.38	32.55
J	金融业	560,535.40	0.02
K	房地产业	209,370,931.25	8.03
L	租赁和商务服务业	82,846.28	0.00
M	科学研究和技术服务业	32,031,309.10	1.23
N	水利、环境和公共设施管理业	1,648,236.64	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	42,614,953.24	1.64
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	164,145,386.02	6.30
S	综合	-	-
	合计	2,457,479,755.88	94.29

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	000782	美达股份	12,242,292	204,813,545.16	7.86
2	300287	飞利信	13,916,440	202,345,037.60	7.76
3	300096	易联众	5,099,911	201,701,480.05	7.74
4	600687	刚泰控股	10,043,815	134,285,806.55	5.15
5	300226	上海钢联	2,478,822	131,228,836.68	5.04
6	000673	当代东方	5,023,707	102,985,993.50	3.95
7	300207	欣旺达	4,008,168	100,124,036.64	3.84
8	300212	易华录	2,273,277	77,518,745.70	2.97
9	002008	大族激光	3,433,091	66,876,612.68	2.57
10	600399	抚顺特钢	7,904,500	66,793,025.00	2.56

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金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	2,849,566.03
2	应收证券清算款	16,320,326.85
3	应收股利	-
4	应收利息	36,287.02
5	应收申购款	1,744,562.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,950,742.58

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

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	300096	易联众	201,701,480.05	7.74	临时停牌
2	000673	当代东方	102,985,993.50	3.95	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	2,365,116,120.93
报告期期间基金总申购份额	782,460,120.51
减:报告期期间基金总赎回份额	1,482,291,987.57
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	1,665,284,253.87

§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、 浦银安盛价值成长混合型证券投资基金基金合同

3、 浦银安盛价值成长混合型证券投资基金招募说明书

4、 浦银安盛价值成长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

浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期: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。

基金托管人中国建设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	浦银安盛精致生活混合
场内简称	-
基金主代码	519113
交易代码	519113
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年6月4日
报告期末基金份额总额	114,627,268.64份
投资目标	在中国经济健康快速的可持续发展过程中,寻找由于经济结构优化、产业结构升级而涌现的那些最能够代表居民生活水平表征的以及满足居民生活需求升级的提供生活产品和服务的上市公司,分享其快速及长期稳定增长,并关注其他金融工具的投资机会,通过灵活配置资产,在严格控制风险的基础上,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金坚持"自上而下"与"自下而上"相结合的投资策略,通过灵活资产配置、行业发展趋势判断、个股精选选择代表居民生活水平表征的以及满足居民生活需求升级要求的快速及长期稳定增长的上市公司。 具体来说,在资产配置策略方面,本基金将根据宏观经济、市场政策、估值水平和市场情绪等因素对未来资本市场的发展做出趋势性判断,进而确定大类资产的配置比例。而在行业配置策略方面,本基金是重点关注居民生活的主题基金,因此将从行业覆盖范围和行业精选策略两个方面进行实施。在个股选择策略方面,本基金将采取精选个股的策略,并辅之以公司特有的数量化公司财务研究模型FFM对拟投资的上市公司加以甄别。 在债券投资策略方面,在资本市场国际化的背景下,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。在权证投资策略方面,本基金将按照法律法规相关规定进行权证投资。
业绩比较基准	中信标普A股综合指数×55%+中证全债指数×45%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,坚持长期和力争为基金持有人带来稳健回报的投资理念,属于证券投资基金中的中等收益、中等风险品种。一般情形下,其风险和收益低于股票型基金,高于货币型基金、债券型基金。本基金力争在科学的风险管理的前提下,谋求实现基金财产的安全和增值。
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

注:自2015年9月17日起,本基金业绩比较基准由原"中信标普A股综合指数×55%+中信标普全债指数×45%"变更为"中信标普A股综合指数×55%+中证全债指数×45%"。具体内容详见基金管理人于2015年9月17日发布的《关于变更旗下基金业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》。

§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	-110,654,223.58
2.本期利润	-100,458,460.92
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4199
4.期末基金资产净值	192,456,496.38
5.期末基金份额净值	1.679

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	-7.70%	3.46%	-16.33%	1.94%	8.63%	1.51%

3.2.2 目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:自2015年9月17日起,本基金业绩比较基准由原"中信标普A股综合指数×55%+中信标普全债指数×45%"变更为"中信标普A股综合指数×55%+中证全债指数×45%"。具体内容详见基金管理人于2015年9月17日发布的《关于变更旗下基金业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》。

§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	2011年5月5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、此处的"任职日期"指公司决定确定的聘任日期。

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

本季度净值表现高于比较基准,报告期内基金净值增长率为-7.70%,基准收益率为-16.33%。

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	162,943,480.33	83.21
	其中:股票	162,943,480.33	83.21
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	25,598,994.84	13.07
8	其他资产	7,286,664.20	3.72
9	合计	195,829,139.37	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	1,356,000.00	0.70
C	制造业	80,874,868.31	42.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,629,376.00	3.44
F	批发和零售业	17,801,374.00	9.25
G	交通运输、仓储和邮政业	186,660.00	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,814,034.02	5.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	15,746,991.00	8.18
L	租赁和商务服务业	19,727,759.00	10.25
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	669,832.00	0.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,043,256.00	3.14
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,129,830.00	1.63
S	综合	963,500.00	0.50
	合计	162,943,480.33	84.67

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	002712	思美传媒	273,800	16,233,602.00	8.43
2	300065	海兰信	543,858	12,062,770.44	6.27
3	002383	合众思壮	358,542	10,175,421.96	5.29
4	603939	益丰药房	158,000	9,584,280.00	4.98
5	600730	中国高科	385,200	7,834,968.00	4.07
6	600562	国睿科技	159,000	6,647,790.00	3.45
7	000628	高新发展	614,400	6,629,376.00	3.44
8	000609	绵世股份	503,000	6,332,770.00	3.29
9	002502	骅威股份	282,279	6,263,771.01	3.25
10	300063	天龙集团	173,000	6,141,500.00	3.19

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按露关联方交易等信息按露违法违规事项,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	258,562.07
2	应收证券清算款	6,252,911.37
3	应收股利	-
4	应收利息	8,693.55
5	应收申购款	766,497.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,286,664.20

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

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	002502	骅威股份	6,263,771.01	3.25	临时停牌

注:本基金本报告期末前十名股票中除骅威股份外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	64,922,440.42
报告期期间基金总申购份额	1,759,070,853.35
减:报告期期间基金总赎回份额	1,709,366,025.13
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	114,627,268.64

§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、 浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同

3、 浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

4、 浦银安盛精致生活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

浦银安盛日日盈货币市场基金

【2015】第三季度报告

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	浦银安盛日日盈货币
场内简称	-
基金主代码	519566
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月25日
报告期末基金份额总额	5,375,926,156.49份
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	(1)滚动配置策略 本基金将根据具体投资品种的市场特性采用持续投资的方法,既能提高基金资产变现能力的稳定性,又能保证基金资产收益率与市场利率的基本一致。 (2)久期控制策略 本基金将根据对货币市场利率趋势的判断来配置基金资产的久期。在预期利率上升时,缩短基金资产的久期,以规避资本损失或获得较高的再投资收益;在预期利率下降时,延长基金资产的久期,以获取资本利得或锁定较高的收益率。 (3)套利策略 套利策略包括跨市场套利和跨品种套利。跨市场套利是利用同一金融工具在各个不同市场的不同表现进行套利。跨品种套利是利用不同金融工具的收益率差别,在满足基金自身流动性、安全性需要的基础上寻求更高的收益率。 (4)时机选择策略 股票、债券发行以及年末效应等因素可能会使市场资金供求情况发生暂时失衡,从而推高市场利率。充分利用这种失衡就能提高基金资产的收益率。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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
下属分级基金的基金简称	浦银安盛日日盈货币A / 浦银安盛日日盈货币B / 浦银安盛日日盈货币D
下属分级基金的交易代码	519566 / 519567 / 519568
报告期末下属分级基金的份额总额	63,341,325.55份 / 2,161,090,412.36份 / 3,151,494,418.58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)		
	浦银安盛日日盈货币A	浦银安盛日日盈货币B	浦银安盛日日盈货币D
1. 本期已实现收益	541,974.65	13,226,247.