

# 浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资 基金 2016 年第 1 季度报告

2016 年 3 月 31 日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 4 月 20 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 2016 年 4 月 18 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 2016 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛精致生活混合
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	308,150,473.49 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

	<p>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。</p> <p>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。</p>
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

### § 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（2016年1月1日—2016年3月31日）
1. 本期已实现收益	-73,780,995.03
2. 本期利润	-129,101,650.85
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.4574
4. 期末基金资产净值	628,337,721.42
5. 期末基金份额净值	2.039

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。

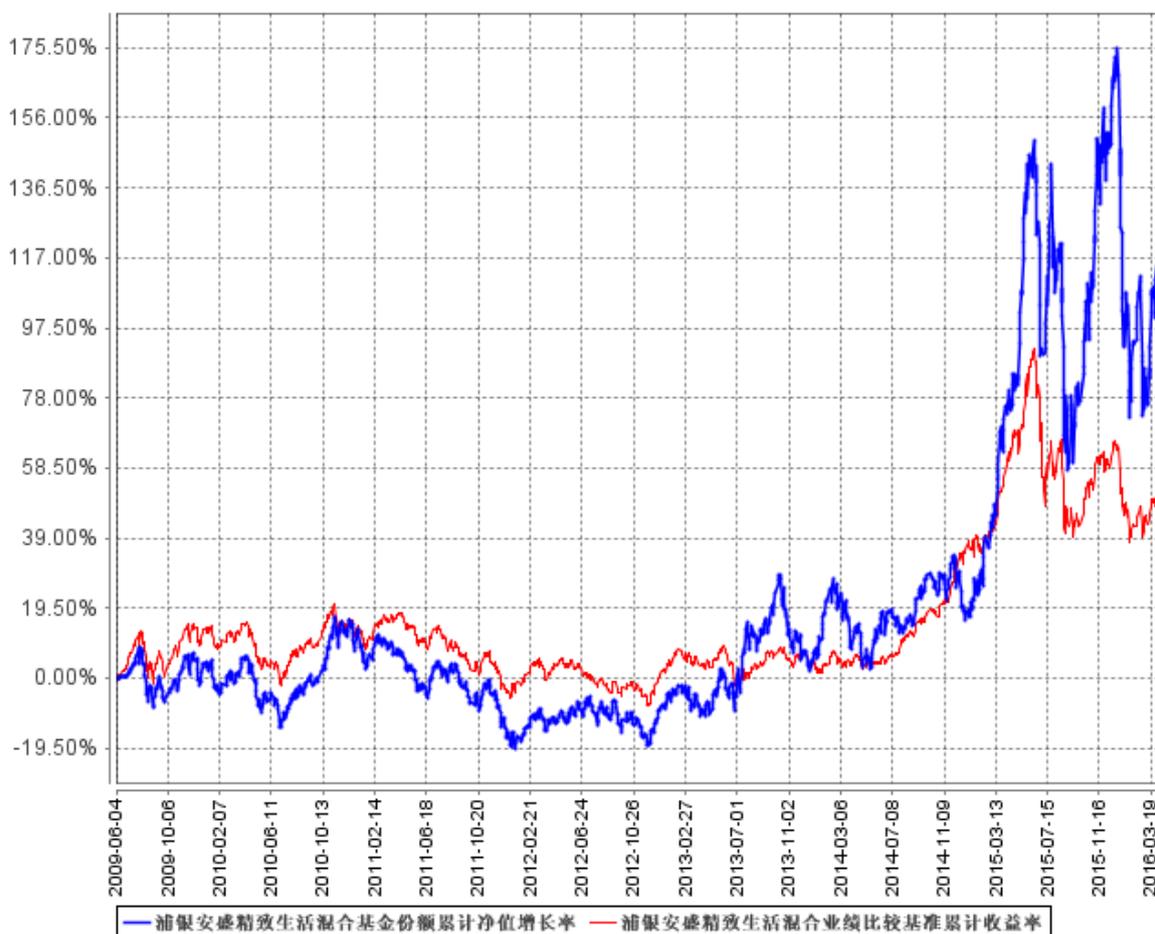
3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

## 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	-19.66%	3.93%	-8.22%	1.53%	-11.44%	2.40%

### 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		
吴勇	本公司权益投资部	2011年5月5日	-	9	吴勇先生，上海交通大学材料工程系学

	总监，公司旗下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、浦银安盛睿智精选混合基金基金经理			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 月至 2016 年 1 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。2016 年 3 月起兼任浦银安盛睿智精选混合基金基金经理。2012 年 11 月起兼任本公司权益投资部总监。
--	--	--	--	--

注：1. 此处的任职日期为公司决定的聘任日期。

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合规守信情况的说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

年初因熔断等因素，市场快速下跌。人民币贬值、注册制等诸多利空因素加重了市场的恐慌情绪。随着两会的召开，诸多政策的明确，有关股市大扩容的担忧已经减弱；人民币汇率在央行的主动性管理措施下逐渐稳定，有理由相信 A 股市场将重新回到正常的轨道上来。因此，虽然基金组合在年初遭遇了大跌，我们对市场并没有失去信心，相信有较好成长预期的公司在中长期能战胜市场。

基于中长期的判断，在保持前期看好的军工、传媒、信息服务等板块基础上，增加了一些积极转型成功的投资标的。

#### 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-19.66%，基准收益率为-8.22%。

#### 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	594,489,771.46	93.76
	其中：股票	594,489,771.46	93.76
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	36,356,863.49	5.73
8	其他资产	3,227,880.41	0.51
9	合计	634,074,515.36	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	441,387,589.25	70.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,339,034.48	1.33
F	批发和零售业	8,509,926.68	1.35
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	64,608,816.15	10.28
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,023,353.96	1.75
M	科学研究和技术服务业	34,002,442.50	5.41
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	690,711.00	0.11
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	18,739,707.24	2.98
S	综合	7,188,190.20	1.14
	合计	594,489,771.46	94.61

### 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	002247	帝龙新材	1,831,337	57,449,041.69	9.14
2	000779	三毛派神	1,107,084	34,928,500.20	5.56
3	002776	柏堡龙	818,350	34,002,442.50	5.41
4	300065	海兰信	1,003,958	31,433,924.98	5.00
5	300494	盛天网络	353,000	29,687,300.00	4.72
6	300322	硕贝德	1,820,486	27,198,060.84	4.33
7	603006	黎明股份	681,793	26,746,739.39	4.26
8	300279	和晶科技	811,585	26,295,354.00	4.18
9	002189	利达光电	609,977	21,562,686.95	3.43
10	300304	云意电气	876,301	21,469,374.50	3.42

### 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。

### 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

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	254,259.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,254.80
5	应收申购款	2,965,365.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,227,880.41

### 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	300304	云意电气	21,469,374.50	3.42	临时停牌

注：本基金本报告期末前十名股票中除云意电气（300304）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	240,107,498.50
报告期期间基金总申购份额	202,420,125.18
减：报告期期间基金总赎回份额	134,377,150.19
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	308,150,473.49

## § 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

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

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](http://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  
2016 年 4 月 20 日