

浦银安盛价值成长股票型证券投资基金

[2013] 第四季度报告

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：二〇一四年一月二十一日

§ 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的约定，于2014年1月17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，保证复核后的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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称：浦银安盛价值成长股票

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：562,730,300.45份

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

§ 3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

1.本期已实现收益 54,273,024.74

2.本期利润 8,919,517.84

3.报告平均基金份额本期利润 0.0155

4.期末基金份额净值 543,247,758.98

5.期末基金份额净值 0.965

注：1.上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回基金等各项交易费用，计入费用后实际收益水平将低于定期报告。

2.本期已实现收益指基金利润收入、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。

4.基金净值=报告期基金份额净值/报告期基金份额总额

5.报告期基金份额净值=报告期基金份额净值/报告期基金份额总额

注：2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛价值成长股票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

(2008年4月16日至2013年12月31日)

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（基金经理小组）简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

蒋建伟 本基金基金经理 2010-7-21 - 12 蒋建伟先生，上海交通大学学士，2001年7月在上海东吴国际资产管理有限公司担任研究员，2003年1月加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员，2005年1月加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员，2006年9月加入浦银安盛基金管理有限公司担任研究员，2010年3月起担任浦银安盛价值成长股票型证券投资基金基金经理。

注：1.此处的“任职日期”指公司决定确定的聘任日期。

2.证券从业人员的含义遵从行业协会《证券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的情况说明

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取最大利益。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 公平交易执行的情况

本基金管理人已制定了《公平交易管理制度》，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基金组合。

在具体执行上，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格执行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，一方面是对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规则，以保证投资执行的公平性；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，对不同的窗口期（同日、3日、6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，以确定交易价差相对基准基金的业绩差异的程度；同时对旗下投资组合及其投资类别的收益率进行分析；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定期进行评价，对发现的问题进行及时的报告。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发现有明显异常交易行为。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已制定了《公平交易管理制度》，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基金组合。

在具体执行上，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格执行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，一方面是对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规则，以保证投资执行的公平性；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，对不同的窗口期（同日、3日、6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，以确定交易价差相对基准基金的业绩差异的程度；同时对旗下投资组合及其投资类别的收益率进行分析；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定期进行评价，对发现的问题进行及时的报告。

4.3.4 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未发现有明显异常交易行为。

4.3.5 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已制定了《公平交易管理制度》，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基金组合。

在具体执行上，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格执行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，一方面是对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规则，以保证投资执行的公平性；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，对不同的窗口期（同日、3日、6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，以确定交易价差相对基准基金的业绩差异的程度；同时对旗下投资组合及其投资类别的收益率进行分析；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定期进行评价，对发现的问题进行及时的报告。

4.3.6 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未发现有明显异常交易行为。

4.3.7 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已制定了《公平交易管理制度》，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基金组合。

在具体执行上，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格执行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，一方面是对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规则，以保证投资执行的公平性；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，对不同的窗口期（同日、3日、6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，以确定交易价差相对基准基金的业绩差异的程度；同时对旗下投资组合及其投资类别的收益率进行分析；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定期进行评价，对发现的问题进行及时的报告。

4.3.8 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未发现有明显异常交易行为。

4.3.9 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已制定了《公平交易管理制度》，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基金组合。

在具体执行上，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格执行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，一方面是对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规则，以保证投资执行的公平性；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，对不同的窗口期（同日、3日、6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，以确定交易价差相对基准基金的业绩差异的程度；同时对旗下投资组合及其投资类别的收益率进行分析；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定期进行评价，对发现的问题进行及时的报告。

4.3.10 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未发现有明显异常交易行为。

4.3.11 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已制定了《公平交易管理制度》，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基金组合。

在具体执行上，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格执行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，一方面是对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规则，以保证投资执行的公平性；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，对不同的窗口期（同日、3日、6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，以确定交易价差相对基准基金的业绩差异的程度；同时对旗下投资组合及其投资类别的收益率进行分析；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定期进行评价，对发现的问题进行及时的报告。

4.3.12 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未发现有明显异常交易行为。

4.3.13 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已制定了《公平交易管理制度》，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基金组合。

在具体执行上，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格执行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，一方面是对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规则，以保证投资执行的公平性；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，对不同的窗口期（同日、3日、6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，以确定交易价差相对基准基金的业绩差异的程度；同时对旗下投资组合及其投资类别的收益率进行分析；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定期进行评价，对发现的问题进行及时的报告。

4.3.14 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未发现有明显异常交易行为。

4.3.15 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已制定了《公平交易管理制度》，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基金组合。

在具体执行上，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格执行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，一方面是对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规则，以保证投资执行的公平性；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，对不同的窗口期（同日、3日、6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，以确定交易价差相对基准基金的业绩差异的程度；同时对旗下投资组合及其投资类别的收益率进行分析；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定期进行评价，对发现的问题进行及时的报告。

4.3.16 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未发现有明显异常交易行为。

4.3.17 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已制定了《公平交易管理制度》，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基金组合。

在具体执行上，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格执行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，一方面是对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规则，以保证投资执行的公平性；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，对不同的窗口期（同日、3日、6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，以确定交易价差相对基准基金的业绩差异的程度；同时对旗下投资组合及其投资类别的收益率进行分析；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定期进行评价，对发现的问题进行及时的报告。

4.3.18 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未发现有明显异常交易行为。

4.3.19 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已制定了《公平交易管理制度》，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基金组合。

在具体执行上，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格执行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，一方面是对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规则，以保证投资执行的公平性；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，对不同的窗口期（同日、3日、6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，以确定交易价差相对基准基金的业绩差异的程度；同时对旗下投资组合及其投资类别的收益率进行分析；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定期进行评价，对发现的问题进行及时的报告。

4.3.20 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未发现有明显异常交易行为。

4.3.21 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已制定了《公平交易管理制度》，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基金组合。

在具体执行上，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格执行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，一方面是对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规则，以保证投资执行的公平性；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，对不同的窗口期（同日、3日、6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，以确定交易价差相对基准基金的业绩差异的程度；同时对旗下投资组合及其投资类别的收益率进行分析；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定期进行评价，对发现的问题进行及时的报告。

4.3.22 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未发现有明显异常交易行为。

4.3.23 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已制定了《公平交易管理制度》，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基金组合。

在具体执行上，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格执行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，一方面是对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规则，以保证投资执行的公平性；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，对不同的窗口期（同日、3日、6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，以确定交易价差相对基准基金的业绩差异的程度；同时对旗下投资组合及其投资类别的收益率进行分析；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定期进行评价，对发现的问题进行及时的报告。

4.3.24 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未发现有明显异常交易行为。

4.3.25 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已制定了《公平交易管理制度》，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基金组合。

在具体执行上，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格执行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，一方面是对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规则，以保证投资执行的公平性；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，对不同的窗口期（同日、3日、6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，以确定交易价差相对基准基金的业绩差异的程度；同时对旗下投资组合及其投资类别的收益率进行分析；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定期进行评价，对发现的问题进行及时的报告。

4.3.26 公平交易制度的执行情况