

浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金

2012 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：交通银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一三年一月二十二日

§ 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2013年1月21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。
本报告自2012年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛幸福回报债券
基金主代码	519118
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2012年9月18日
报告期末基金份额总额	2,015,420,376.52份
投资目标	在严格控制投资风险的前提下,追求超过业绩比较基准的当期收入和投资总回报。
投资策略	本基金一方面按照自上而下的方法对基金的资产配置、久期管理、类别配置进行动态管理,寻找各类资产的潜在良好投资机会,一方面在个券选择上采用自下而上的方法,通过流动性考察和信用分析策略进行筛选。整体投资通过对风险的严格控制,运用多种积极的资产管理增值策略,实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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
下属二级基金的基金简称	浦银安盛幸福回报债券A类
下属二级基金的交易代码	519118
报告期末下属二级基金的份额总额	1,617,733,471.53份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)	2012年9月18日-2012年09月30日
1.本期已实现收益	20,850,538.71	1,247,348.63
2.本期利润	22,195,952.79	2,260,452.79
3.加权平均基金份额当期净收益	0.0137	0.0014
4.期末基金份额净值	1.642,189,877.11	1.619,993,924.32
5.期末基金资产净值	1,617,733,471.53	1,619,993,924.32
6.期末基金资产净值	1,617,733,471.53	1,619,993,924.32

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

1. 浦银安盛幸福回报债券A类：

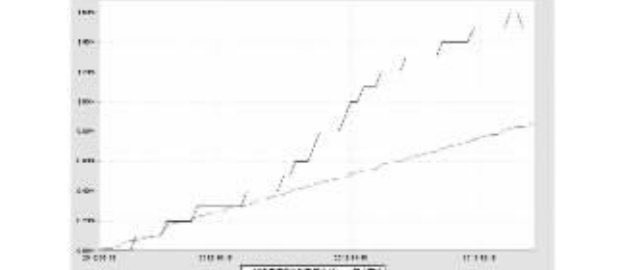
主要财务指标	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.40%	0.05%	0.76%	0.01%	0.64%	0.04%

2. 浦银安盛幸福回报债券B类：

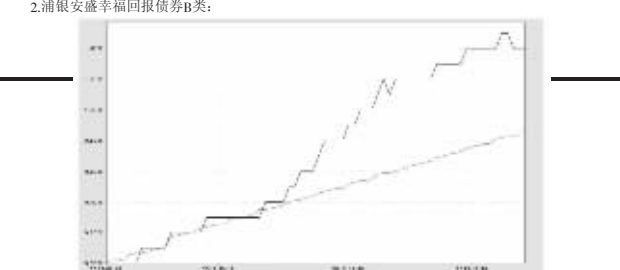
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.30%	0.05%	0.76%	0.01%	0.54%	0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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
浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
2012年9月18日至2012年12月31日

1. 浦银安盛幸福回报债券A类：



2. 浦银安盛幸福回报债券B类：



注：1、本基金合同生效日为2012年9月18日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。
2、根据基金合同第十三条第九款规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截至报告期末，本基金建仓尚未结束。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理 魏基经

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业资格	说明
魏基经	本公司固定收益投资部总监, 浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理, 浦银安盛增利分级债券基金基金经理	2012-9-18	6	魏基经, 上海财经大学数量经济学博士, 2006年3月至2008年5月, 在红瓦金融研究中心担任固定收益研究员, 2008年5月至2009年6月, 在上海证券有限公司固定收益部担任固定收益研究员, 2009年7月加入浦银安盛基金管理有限公司, 任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理助理, 2011年12月起任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2012年2月起兼任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2012年9月起兼任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2012年11月起, 兼任本公司固定收益部总监。

注：1、魏基经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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
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，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，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。

§ 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	其中:股票	-	-
3	固定收益投资	2,641,389,553.51	92.34
4	其中:债券	2,641,389,553.51	92.34
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	30,000,135.00	1.05
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	46,027,209.73	1.61
10	其他各项资产	143,132,795.40	5.00
11	合计	2,860,549,693.64	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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可转换债券。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.6 投资组合报告附注

5.6.1 本基金报告期内前十名证券的发行主体不存在本期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。

5.6.2 报告期内，本基金不存在超出基金合同规定备选股票库投资的情况。

5.6.3 其他各项资产构成

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	存出保证金	250,000.00	-
2	应收证券清算款	119,896,589.48	-
3	应收股利	-	-
4	应收利息	22,986,205.92	-
5	应收申购款	-	-
6	其他应收款	-	-
7	待摊费用	-	-
8	其他	-	-
9	合计	143,132,795.40	5.00

5.8 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可转换债券。

5.9 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 6 开放式基金业绩变动

项目	浦银安盛幸福回报债券A类	浦银安盛幸福回报债券B类
本报告期初基金份额总额	1,617,733,471.53	397,686,904.99
本报告期末基金份额总额	1,617,733,471.53	397,686,904.99
本报告期基金份额净增加额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,617,733,471.53	397,686,904.99

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金设立的文件

2. 浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金合同

3. 浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金招募说明书

4. 浦银安盛幸福回报定期开放债券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

7.2 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。

7.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站 www.py-asa.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

二〇一三年一月二十二日

浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金

2012 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一三年一月二十二日

§ 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2013年1月21日复核了本报告中的财务数据、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。
本报告自2012年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛基本面400指数
基金主代码	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	250,464,271.97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投资,依据中证锐联基本面400指数成份股及其权重,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x95%+银行活期存款利率(税后)x5%。
风险收益特征	本基金属于采用被动化指数操作的股票型产品,其预期的风险和收益高于货币市场基金,债券型基金,混合型产品,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

主要财务指标	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-1,698,517.11
2.本期利润	-8,247,403.17
3.加权平均基金份额本期利润	0.0321
4.期末基金份额净值	239,239,384.24
5.期末基金资产净值	0.9550

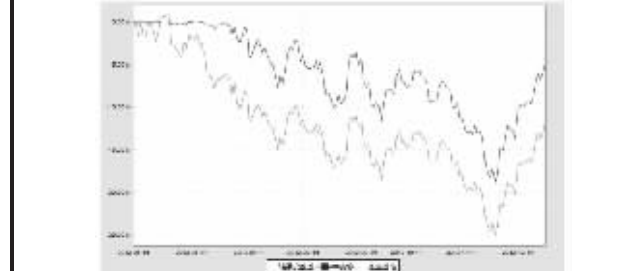
注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回基金等各项交易费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。
3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	3.69%	1.33%	3.98%	1.34%	-0.29%	-0.01%

3.2.2自基金合同生效以来基金基金份额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
浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
2012年5月14日至2012年12月31日



注：1、本基金合同生效日为2012年5月14日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。
2、根据基金合同第十三条第九款规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截至报告期末，本基金建仓尚未结束。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理 魏基经
魏基经, 上海财经大学数量经济学博士, 2006年3月至2008年5月, 在红瓦金融研究中心担任固定收益研究员, 2008年5月至2009年6月, 在上海证券有限公司固定收益部担任固定收益研究员, 2009年7月加入浦银安盛基金管理有限公司, 任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理助理, 2011年12月起任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2012年2月起兼任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2012年9月起兼任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2012年11月起, 兼任本公司固定收益部总监。

注：1、魏基经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 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，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，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。

§ 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	其中:股票	-	-
3	固定收益投资	1,943,369,931.59	94.00
4	其中:债券	1,943,369,931.59	94.00
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	60,245,851.81	2.91
10	其他各项资产	63,887,390.03	3.09
11	合计	2,067,503,173.43	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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可转换债券。

5.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 6 基金业绩变动

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	存出保证金	250,000.00	-
2	应收证券清算款	21,813,373.45	-
3	应收股利	-	-
4	应收利息	41,824,016.58	-
5	应收申购款	-	-
6	其他应收款	-	-
7	待摊费用	-	-
8	其他	-	-
9	合计	63,887,390.03	3.09

5.8 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可转换债券。

5.9 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金设立的文件

2. 浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金合同

3. 浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金招募说明书

4. 浦银安盛幸福回报定期开放债券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

7.2 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。

7.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站 www.py-asa.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。

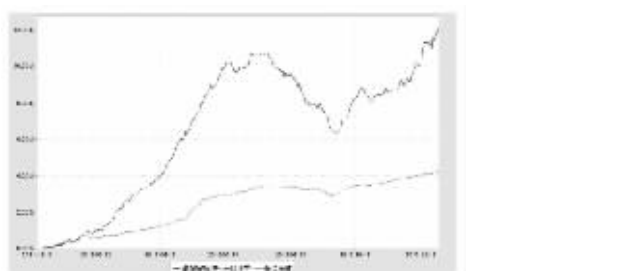
客户服务中心电话:400-8828-999 或 021-33079999

浦银安盛基金管理有限公司

二〇一三年一月二十二日

浦银安盛增利分级债券型证券投资基金

2012 第四季度报告



注：根据基金合同第十三条第九款规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截至报告期末，本基金建仓尚未结束。

3.3 其他指标

项目	浦银安盛增利分级债券A类	浦银安盛增利分级债券B类
本报告期初基金份额总额	1,617,733,471.53	397,686,904.99
本报告期末基金份额总额	1,617,733,471.53	397,686,904.99
本报告期基金份额净增加额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,617,733,471.53	397,686,904.99

4.1 基金经理 魏基经
魏基经, 上海财经大学数量经济学博士, 2006年3月至2008年5月, 在红瓦金融研究中心担任固定收益研究员, 2008年5月至2009年6月, 在上海证券有限公司固定收益部担任固定收益研究员, 2009年7月加入浦银安盛基金管理有限公司, 任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理助理, 2011年12月起任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2012年2月起兼任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2012年9月起兼任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2012年11月起, 兼任本公司固定收益部总监。

注：1、魏基经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 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，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，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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易专项说明
4.3.2 异常交易行为的专项说明
4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.3.4 异常交易行为的专项说明
4.3.5 异常交易行为的专项说明

4.3.6 异常交易行为的专项说明
4.3.7 异常交易行为的专项说明

4.3.8 异常交易行为的专项说明
4.3.9 异常交易行为的专项说明

4.3.10 异常交易行为的专项说明
4.3.11 异常交易行为的专项说明

4.3.12 异常交易行为的专项说明
4.3.13 异常交易行为的专项说明

4.3.14 异常交易行为的专项说明
4.3.15 异常交易行为的专项说明

4.3.16 异常交易行为的专项说明
4.3.17 异常交易行为的专项说明

4.3.18 异常交易行为的专项说明
4.3.19 异常交易行为的专项说明

4.3.20 异常交易行为的专项说明
4.3.21 异常交易行为的专项说明

4.3.22 异常交易行为的专项说明
4.3.23 异常交易行为的专项说明

4.3.24 异常交易行为的专项说明
4.3.25 异常交易行为的专项说明

4.3.26 异常交易行为的专项说明
4.3.27 异常交易行为的专项说明

4.3.28 异常交易行为的专项说明
4.3.29 异常交易行为的专项说明

4.3.30 异常交易行为的专项说明
4.3.31 异常交易行为的专项说明

4.3.32 异常交易行为的专项说明
4.3.33 异常交易行为的专项说明

4.3.34 异常交易行为的专项说明
4.3.35 异常交易行为的专项说明

4.3.36 异常交易行为的专项说明
4.3.37 异常交易行为的专项说明

4.3.38 异常交易行为的专项说明
4.3.39 异常交易行为的专项说明

4.3.40 异常交易行为的专项说明