浦银安盛红利精选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规定,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	浦银安盛红利精选股票
基金主代码	519115
交易代码	519115
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月3日
报告期末基金份额总额	125,151,657.94份
投资目标	本基金在严格执行投资风险管理的前提下,通过投资于盈利能力较高、分红稳定或分红潜力大的上市公司和国内依法公开发行上市的各类债券,力争为投资者提供稳定的当期收益和长期的资本增值。
投资策略	本基金坚持关注稳健收益、长期价值的投资理念,根据宏观经济周期性波动规律,动态把握不同资产类别的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化,进行股票、固定收益证券和现金等大类资产的合理配置,在资产动态配置过程中始终坚持以风险预算理念进行合理控制,在严格控制投资风险的基础上追求基金资产的长期持续稳定增长。 本基金所指的红利型股票是基本面健康的、盈利能力较高、分红稳定或分红潜力大的快速及长期稳定增长的上市公司。本基金将采取基础库初选、核心库精选个股的策略,对拟投资的红利型上市公司加以甄别。
业绩比较基准	中证红利指数×75%+中信标普国债指数×25%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,属于证券投资基金中的高收益、高风险品种。一般情形下,其风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币型基金。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	中国工商银行股份有限公司

§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(2013年10月1日–2013年12月31日)
1.本期已实现收益	–8,898,662.12
2.本期利润	–28,490,453.63
3.加权平均基金份额本期利润	–0.2116
4.期末基金资产净值	114,514,003.79
5.期末基金份额净值	0.915

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。

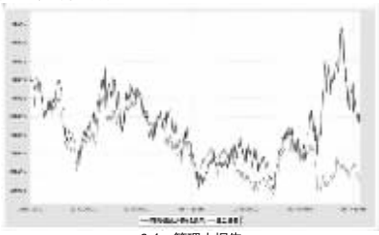
3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	–17.86%	1.93%	–3.27%	0.82%	–14.59%	1.11%

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
浦银安盛红利精选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
(2009年12月3日至2013年12月31日)



§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
吴勇	本公司权益投资部总监,本基金基金经理兼浦银安盛精致生活混合型基金基金经理、浦银战略新兴产业混合基金基金经理以及浦银安盛消费升级混合基金基金经理	2010–4–14	–	6	吴勇,上海交通大学工商管理硕士,上海交通大学材料工程系学士,CPA、CFA,中国注册造价师。1993年8月至2002年12月在上海电力建设有限责任公司任预算主管,2003年1月至2007年8月在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任职研究员,2009年8月起担任浦银安盛精致生活混合型证券投资基金基金经理助理。2010年2月至4月,担任本基金的基金经理助理。2010年4月起,担任本基金基金经理之职。2011年5月起,兼任浦银安盛精致生活混合型证券投资基金基金经理。2012年11月起,担任本公司权益投资部总监。自2013年3月25日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4日起兼任浦银安盛消费升级灵活配置混合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

本基金管理人已制定了《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)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。

4.3.2 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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在资金利率持续维持高位、宏观经济表现相对疲弱等因素的综合作用下,A股在四季度表现较为疲弱,市场整体缺乏系统性机会。政府债务统计的结果表明过往的经济增长中粗放型占比较高,未来经济结构转型的步伐应会加快。因此总体来说,看淡银行、房地产、煤炭、建材等传统周期性板块的表现,还是需要在新兴产业和消费相关行业中寻找估值合理,未来成长性较好的公司。

红利基金在四季度保持了对传媒、信息服务、园林等板块的超配,在房地产、银行、煤炭等板块保持低配。

4.4.2 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–17.86%,基准收益率为–3.27%。

§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	107,269,051.81	89.93
	其中:股票	107,269,051.81	89.93
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	7,604,713.49	6.38
6	其他资产	4,404,213.86	3.69
7	合计	119,277,979.16	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	7,917.00	0.01
B	采矿业	350,836.00	0.31
C	制造业	67,080,782.89	58.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	11,187,162.89	9.77
F	批发和零售业	1,084,895.34	0.95
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	21,486,323.45	18.76
J	金融业	8,490.00	0.01
K	房地产业	607,483.23	0.53
L	租赁和商务服务业	2,504,962.77	2.19
M	科学研究和技术服务业	796,400.00	0.70
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	2,865.70	0.00
S	综合	2,150,932.54	1.88
	合计	107,269,051.81	93.67

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	002431	棕榈园林	253,654	5,240,491.64	4.58
2	600315	上海家化	122,182	5,159,745.86	4.51
3	600845	宝信软件	191,106	4,777,650.00	4.17
4	300197	铁汉生态	165,137	4,499,983.25	3.93
5	300074	华平股份	198,474	4,453,756.56	3.89
6	002242	九阳股份	423,365	4,182,846.20	3.65
7	300136	信维通信	188,813	3,568,565.70	3.12
8	002570	贝因美	112,993	3,468,885.10	3.03
9	000418	小天鹅A	338,303	3,410,094.24	2.98
10	600594	益佰制药	104,400	3,405,528.00	2.97

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名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名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名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.8报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除上海家化联合股份有限公司和浙江贝因美科工贸股份有限公司以外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。

本基金投资的前十名证券之一上海家化于2013年11月21日公告,上海家化于2013年11月20日收到上海证监局下发的《关于对上海家化联合股份有限公司采取责令改正措施的决定》(沪证监决[2013]49号),指出公司与吴江市黎里沪江日用化学品厂发生采购销售、资金拆借等关联交易中存在未及时披露等问题,对公司提出相应的整改要求。上海家化于2013年12月18日公告,按照上海证监局整改要求已完成整改。上海家化于2013年11月21日公告,2013年11月20日收到中国证监会《调查通知书》(编号:沪调查通字2013–1–64号),因公司涉嫌未按照规定披露信息,决定对公司立案稽查。

本基金投资的前十名证券之一贝因美于2013年8月7日公告,贝因美于2013年8月6日收到国家发展和改革委员会《免除行政处罚决定书》(发改办监免[2013]1号),该决定书指出公司违反了《中华人民共和国反垄断法》第十四条第一项的规定,与交易相对人达成并实施了固定向第三人转售商品的价格的垄断协议,构成了价格垄断。鉴于公司主动向发改委报告达成垄断协议的有关情况并提供重要证据,发改委决定对公司免除行政处罚,公司应当立即停止实施所达成的垄断协议。公司将及时履行上述决定。

贝因美于2013年12月19日公告,财政部驻浙江省财政监察专员办事处(以下简称“专员办”)对浙江贝因美科工贸股份有限公司2012年度会计信息质量进行了检查。专员办于近日向公司送达了《关于公司2012年会计信息质量的检查结论和处理决定》(财驻浙监[2013]158号)。公司董事会根据本次检查情况审议通过了《关于根据财政部驻浙江省财政监察专员办事处对公司2012年会计信息质量的检查结论和处理决定进行整改的议案》。该议案认为,鉴于专员办的处理决定导致的调整事项涉及金额在净利润中占比较小,根据《企业会计准则》的要求,公司将在2013年度调整账务,及时认真整改。

本基金管理人的研究部门对上海家化和贝因美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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	271,680.25
2	应收证券清算款	4,059,741.60
3	应收股利	–
4	应收利息	2,850.03
5	应收申购款	69,941.98
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	4,404,213.86

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	138,523,825.91
本报告期基金总申购份额	36,966,119.25
减:本报告期基金总赎回份额	50,338,287.22
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	125,151,657.94

§7 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公司管理基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、 中国证监会批准浦银安盛红利精选股票型证券投资基金设立的文件
2、 浦银安盛红利精选股票型证券投资基金基金合同
3、 浦银安盛红利精选股票型证券投资基金招募说明书
4、 浦银安盛红利精选股票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
二〇一四年一月二十一日

浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金

【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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,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	浦银安盛沪深300指数增强
基金主代码	519116
交易代码	519116
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2010年12月10日
报告期末基金份额总额	197,989,856.12份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金,在力求对沪深300指数进行有效跟踪的基础上,主要通过数量化模型进行积极的指数组合管理与风险控制,力争获得超越业绩比较基准的投资收益,谋求基金资产的长期增值。 本基金对业绩比较基准的跟踪目标是:力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年化跟踪误差不超过7.75%。
投资策略	本基金以沪深300指数为目标指数,采用“指数化投资为主、增强型策略为辅”的投资策略。在有效复制目标指数的基础上,通过公司自有量化增强模型,优化股票组合配置结构,一方面严格控制投资组合的跟踪误差,避免大幅偏离目标指数,另一方面在跟踪目标指数的同时,力争获得超越业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+1% (1%指年收益率,评价时按期间累计天数折算)。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
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(2013年10月1日–2013年12月31日)
1.本期已实现收益	–2,467,507.80
2.本期利润	–7,487,885.74
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0377
4.期末基金资产净值	148,684,398.62
5.期末基金份额净值	0.751

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。

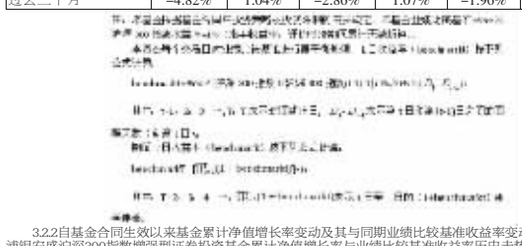
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

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。

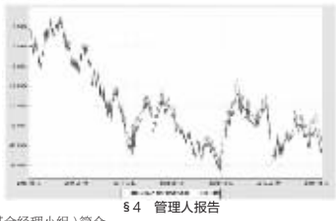
3.2 基金净值表现

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	–4.82%	1.04%	–2.86%	1.07%	–1.96%	–0.03%



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
浦银安盛沪深300指数增强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
(2010年12月10日至2013年12月31日)



§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陈士俊	本基金基金经理、浦银安盛中证锐联基本面400指数基金基金经理、公司金融工程部总监兼公司职工监事	2010–12–10	–	12	陈士俊,清华大学博士学历。2001年至2003年间曾在国泰君安证券有限公司研究所担任金融工程研究员2年;2003年至2007年10月在银河基金管理有限公司工作4年,先后担任金融工程部研究员、研究部主管。2007年10月至今,任本公司金融工程部总监,并于2010年12月起兼任本基金基金经理。2012年3月兼任本公司职工监事。2012年5月起,兼任浦银安盛中证锐联基本面400指数基金基金经理。

注:1、陈士俊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 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

本基金管理人已制定了《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)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。

4.3.2 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业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2013年第四季度,适值党的十八大三中全会召开,全面深化改革的政策方向指引着股票市场的投资偏好变化和资金流动,受政策利好影响的行业板块如军工概念股等大幅上涨,金融地产股受监管政策升级的预期影响而继续走弱。12月份“钱荒”重现,新股发行重启也引发市场对资金分流和创业板股票估值水平较高的担忧,主板和创业板股价纷纷下挫。沪深300指数四季度下跌3.28%。从量化因子看,盈利动量因子和价值因子表现较好。本报告期内,本基金严格执行量化增强的投资策略,因市场短期受政策影响波动较大,量化因子表现相对较弱,以及基金赎回等影响,组合表现落后于同期业绩比较基准。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为–4.82%,同期业绩比较基准增长率为–2.86%。

§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	139,765,818.65	93.56
	其中:股票	139,765,818.65	93.56
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	9,609,743.58	6.43
6	其他资产	16,904.66	0.01
7	合计	149,392,466.89	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有积极投资股票。
5.2.2 指数投资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	7,093,718.34	4.77
C	制造业	45,384,517.97	30.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,225,191.42	2.84
E	建筑业	6,174,896.53	4.15
F	批发和零售业	2,658,720.13	1.79
G	交通运输、仓储和邮政业	2,839,297.21	1.91
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,388,315.63	1.61
J	金融业	58,094,458.92	39.07
K	房地产业	7,401,720.49	4.98
L	租赁和商务服务业	1,310,282.90	0.88
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	857,010.00	0.58
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	1,337,689.11	0.90
	合计	139,765,818.65	94.00

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股票投资明细
5.3.1报告期末指数投资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	600036	招商银行	598,223	6,514,648.47	4.38
2	600016	民生银行	604,823	4,669,233.56	3.14
3	601318	中国平安	103,293	4,310,416.89	2.90
4	601288	农业银行	1,706,346	4,231,738.08	2.85
5	600837	海通证券	328,847	3,722,548.04	2.50
6	600030	中信证券	287,720	3,668,430.00	2.47
7	000651	格力电器	98,950	3,231,707.00	2.17
8	601988	中国银行	1,230,378	3,223,590.36	2.17
9	601601	中国太保	167,979	3,112,650.87	2.09
10	601166	兴业银行	305,310	3,095,843.40	2.08

5.3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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名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名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名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.8报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除中国平安保险(集团)股份有限公司以外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。本基金投资的前十名证券之一中国平安于2013年5月22日公告,中国平安保险(集团)股份有限公司控股子公司平安证券有限责任公司(以下简称“平安证券”)收到中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《行政处罚和市场禁入事先告知书》。中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司(以下简称“万福生科”)发行上市项目中的业务收入人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐机构资格3个月。本基金管理人的研究部门对中国平安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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	10,803.24
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	2,148.87
5	应收申购款	3,952.55
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	16,904.66

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1期末指数投资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不存在流通受限情况。

5.10.5.2 期末积极投资前五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积极投资股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	205,144,193.52
本报告期基金总申购份额	6,589,257.01
减:本报告期基金总赎回份额	13,743,594.41
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	197,989,856.12

§7 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公司管理基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人2013年12月5日发布任免通知,聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、 中国证监会批准浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金设立的文件
2、 浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金基金合同
3、 浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书
4、 浦银安盛沪深300指数增强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

9.2 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。

9.3 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
二〇一四年一月二十一日

浦银安盛货币市场证券投资基金

【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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,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	浦银安盛货币
基金主代码	519509
基金运作方式	开放式契约型
基金合同生效日	2011年3月9日
报告期末基金份额总额	1,098,615,771.60份
投资目标	力求在保持基金资产安全性和良好流动性的基础上,获得超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	根据对短期利率变动的预测,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略,利用基本分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保证流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	浦银安盛货币A　浦银安盛货币B
下属两级基金的交易代码	519509　519510
报告期末下属两级基金的份额总额	365,107,032.07份　733,508,739.53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(2013年10月1日–2013年12月31日)	
	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B
1.本期已实现收益	5,736,608.97	6,854,567.22
2.本期利润	5,736,608.97	6,854,567.22
3.期末基金资产净值	365,107,032.07	733,508,739.53

注:1、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。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金收益分配按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 浦银安盛货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.2130%	0.0035%	0.0883%	0.0000%	1.1247%	0.0035%

注:本基金收益分配按月结转份额。

2. 浦银安盛货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.2739%	0.0035%	0.0883%	0.0000%	1.1856%	0.0035%

注:本基金收益分配按月结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
浦银安盛货币市场证券投资基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011年3月9日至2013年12月31日)

1、