# 浦银安盛日日盈货币市场基金

## 【2015】第一季度报告

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04月21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4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2015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03月25日 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,596,919,997.29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<br>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。<br>(2)久期控制策略<br>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。<br>(3)套利策略<br>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子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,在满足基金日身流动性、安全性需要的基础上寻求更高的收益率。<br>(4)时机选择策略<br>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 | 35,765,435.86 | 1,080,056,142.15 | 2,481,098,419.28 |

### §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01月01日-2015年03月31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 | 337,894.75 | 12,144,351.95 | 24,149,240.70 |
| 2.本期利润 | 337,894.75 | 12,144,351.95 | 24,149,240.70 |
| 3.期末基金资产净值 | 35,765,435.86 | 1,080,056,142.15 | 2,481,098,419.28 |

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、本基金收益分配按日结转份额。
4、浦银安盛日日盈货币市场基金于2014年5月28日刊登公告,自2014年5月30日起为指定的特定销售渠道增加浦银安盛日日盈货币市场基金D类份额,该类份额仅能通过特定的销售渠道办理申购、赎回等业务。

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、浦银安盛日日盈货币A

| 主要财务指标 | 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 | 1.0745% | 0.0019% | 0.0863% | 0.0000% | 0.9882% | 0.0019% |

2、浦银安盛日日盈货币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 | 1.1343% | 0.0019% | 0.0863% | 0.0000% | 1.0480% | 0.0019% |

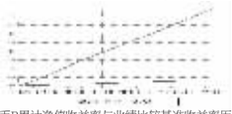
3、浦银安盛日日盈货币D

| 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 | 1.0746% | 0.0019% | 0.0863% | 0.0000% | 0.9883% | 0.0019% |

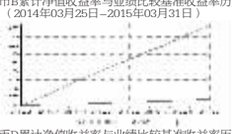
注:1、本基金收益分配按日结转份额。
2、本基金于2014年5月30日开始分为A、B、D三类。

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

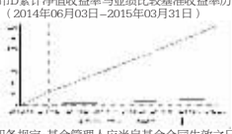
浦银安盛日日盈货币A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2014年03月25日-2015年03月31日)



浦银安盛日日盈货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2014年03月25日-2015年03月31日)



浦银安盛日日盈货币D累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2014年06月03日-2015年03月31日)



注:1、根据基金合同第十二部分第四条规定:基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为2014年3月25日至2014年9月24日,建仓期结束时本基金投资组合比例符合本基金基金合同约定。
2、本基金于2014年5月30日开始分为A、B、D三类,具体内容详见本基金管理人于2014年5月28日刊登的《关于浦银安盛日日盈货币市场基金增加基金份额类别的公告》。

### §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 任职日期 | 离任日期 | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 康佳燕 | 公司旗下浦银安盛货币基金以及浦银安盛日日盈货币基金基金经理 | 2014年07月21日 | - | 9 | 康佳燕女士,香港大学工商管理硕士。2007年6月加盟浦银安盛基金管理有限公司,先后在基金会计部、交易部、固定收益部从事基金估值、债券交易、固定收益投资工作。2013年12月起在专户管理部担任固定收益投资经理。2014年6月起担任浦银安盛货币基金基金经理。2014年7月起,兼任浦银安盛日日盈货币基金基金经理。 |
| 吕栋 | 公司旗下浦银安盛优化收益债券基金、浦银安盛货币基金以及浦银安盛日日盈货币基金前任基金经理 | 2014年03月25日 | 2015年02月09日 | 9 | 吕栋先生,复旦大学理学学士、麻省理工大学-斯隆商学院金融学硕士学位。2006年8月到2010年6月,先后在瑞银集团(UBS)旗下Dillon Read对冲基金及瑞银集团(UBS)固定收益部任分析员。2011年6月,加盟宏旗集团(香港)任投资银行部分析员。2011年11月起加盟浦银安盛基金管理公司担任专户投资经理助理。2013年7月起,调任至公司固定收益投资部工作。2014年3月25日起兼任浦银安盛日日盈货币基金基金经理。2014年5月09日起兼任浦银安盛货币基金基金经理。 |

注:1、吕栋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、康佳燕的任职日期为公司决定的聘任日期。
3、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)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运作分析

一季度债券市场的行情可谓一波三折,一月份收益率快速下行,二月份收益率维持低位盘整,三月份收益率则出现明显反弹。尽管央行货币政策延续了之前的宽松态势,在一季度先后进行了一次降准和一次降息操作。但债券市场在经历了2014年全年的牛市后,货币政策宽松的确认更像是利多出尽,市场因此出现调整也在所难免。近期股票市场走牛分流债市资金、地方政府债务置换导致利率债供给超预期等多种因素也加剧了此次债券市场的调整。但随着收益率的反弹,债券市场的配置价值正在加大,并且决定债券市场走牛的因素依然存在,所以我们认为此次债券市场的调整只是暂时的,后续走牛可以期待。一季度内,本基金均衡配置了信用债和同业存款,信用债以中高等级为主,同业存款注重期限匹配,在保持组合流动性的基础上实现了较好的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期A类净值收益率为1.0745%,B类净值收益率为1.1343%,D类净值收益率为1.0746%,同期业绩比较基准收益率为0.0863%。

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

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 固定收益投资 | 1,618,066,621.57 | 44.34 |
| | 其中:债券 | 1,618,066,621.57 | 44.34 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 127,424,016.09 | 3.49 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | 20,172,975.21 | 0.55 |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,764,560,506.22 | 48.35 |
| 4 | 其他资产 | 139,536,364.19 | 3.82 |
| 5 | 合计 | 3,649,587,508.07 | 100.00 |

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 0.55 |
| | 其中:买断式回购融资 | - |

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 49,979,855.01 | 1.39 |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本基金未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 93 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 116 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 88 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120天。本基金基金合同约定投资组合的平均剩余期限不超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 26.55 | 1.39 |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)-60天 | 16.21 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)-90天 | 20.11 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)-180天 | 20.19 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天(含)-397天(含) | 14.53 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 97.58 | 1.39 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 215,026,401.55 | 5.98 |
| | 其中:政策性金融债 | 200,028,256.09 | 5.56 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 1,403,040,220.02 | 39.01 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 1,618,066,621.57 | 44.98 |
| 9 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | - | - |

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 140207 | 14国开07 | 1,500,000 | 150,014,753.70 | 4.17 |
| 2 | 011481004 | 14淮南矿SCP004 | 1,100,000 | 110,015,522.92 | 3.06 |
| 3 | 041458082 | 14鲁宏桥CP004 | 1,000,000 | 99,899,824.83 | 2.78 |
| 4 | 041456031 | 14陕交建CP001 | 500,000 | 50,201,579.57 | 1.40 |
| 5 | 041456043 | 14川高速CP001 | 500,000 | 50,075,744.74 | 1.39 |
| 6 | 140430 | 14农发30 | 500,000 | 50,013,502.39 | 1.39 |
| 7 | 041451043 | 14大族CP001 | 500,000 | 50,002,452.36 | 1.39 |
| 8 | 011481006 | 14淮南矿SCP006 | 500,000 | 49,992,195.17 | 1.39 |
| 9 | 011471005 | 14皖高速SCP005 | 500,000 | 49,990,652.46 | 1.39 |
| 10 | 011474004 | 14陕煤化SCP004 | 500,000 | 49,989,481.35 | 1.39 |

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|---|---|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | 0 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.1810% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0260% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1450% |

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明。

本基金所持有的债券(包括票据)采用摊余成本法进行估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。

5.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券说明

本报告期内本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

5.8.3 本基金投资的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本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.4 其他资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 47,633,631.12 |
| 4 | 应收申购款 | 91,902,733.07 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 合计 | 139,536,364.19 |

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | 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 |
|---|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 35,380,704.66 | 1,063,879,978.23 | 1,988,313,210.27 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 53,278,936.96 | 40,092,264.43 | 3,684,575,985.34 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 52,894,205.76 | 23,916,100.51 | 3,191,790,776.33 |
| 报告期期末基金份额总额 | 35,765,435.86 | 1,080,056,142.15 | 2,481,098,419.28 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

1、本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。
2、截至本报告期末,本基金管理人的全资子公司上海浦银安盛资产管理有限公司持有本基金9,191,817.80份。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

根据上海市政府的要求,经上海国盛(集团)有限公司批准,本基金管理人原股东上海盛融投资有限公司("以下简称"上海盛融")由其母公司上海国盛集团资产有限公司("以下简称"上海国盛")吸收合并,上海盛融持有的本基金管理人10%的股权由上海国盛承继,本基金管理人股东因此由上海盛融变更为上海国盛。本基金管理人正在就此事项履行相关工商变更手续。

### §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盛世精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
2、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同
3、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
4、浦银安盛基金管理有限公司开放式基金业务规则
5、关于募集浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金的法律意见书
6、基金管理人业务资格批件和营业执照
7、基金托管人业务资格批件和营业执照
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
二〇一五年四月二十一日

# 浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金

## 【2015】第一季度报告

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:2015年4月21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2015年4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2015年1月1日起至3月31日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 浦银安盛盛世精选混合 |
| 场内简称 | - |
| 基金主代码 | 519127 |
| 交易代码 | 519127 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年6月26日 |
| 报告期末基金份额总额 | 146,631,518.26份 |
| 投资目标 | 本基金通过在股票、固定收益证券、现金等资产的积极灵活配置,并通过重点关注受益于中国经济结构转型带来的投资机会,在严格控制风险并保证充分流动性的前提下,谋求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金在股票投资方面主要采用主题投资策略,通过重点投资受益于中国经济结构转型相关行业股票,并保持对中国经济结构调整的趋势以及经济结构调整对相关行业及上市公司影响的密切跟踪和研究分析,对属于精选投资主题范畴的上市公司进行重点投资。 |
| 业绩比较基准 | 55%×沪深300指数+45%×中信标普全债指数 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,本基金属于中高风险、中高收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。 |
| 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 |

### §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1月1日-2015年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 12,724,149.49 |
| 2.本期利润 | 16,242,899.93 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0718 |
| 4.期末基金资产净值 | 164,083,839.48 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.119 |

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。

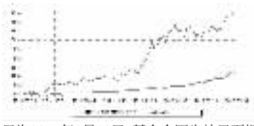
3.2 基金净值表现

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

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | | | |

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

浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2014年6月26日-2015年3月31日)



注:1、本基金基金合同生效日为2014年6月26日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。
2、根据基金合同第十二部分第四条规定:基金管理人应当自基金合同生效之日起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。本基金建仓期为2014年6月26日至2014年12月25日,建仓期结束时本基金投资组合比例符合本基金基金合同约定。

### §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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 褚艳辉 | 公司旗下浦银安盛新经济结构混合基金、浦银安盛盛世精选股票基金基金经理 | 2014年6月26日 | - | 11 | 褚艳辉先生,南京理工大学经济学硕士。2004年8月至2008年4月间曾在上海信息中心担任宏观经济、政策研究员。2008年5月到2010年9月在爱建证券公司担任制造与消费大类行业高级研究员,后在上海汽车财务公司担任投资经理助理之职。2011年4月起加盟我司担任高级行业研究员。2013年2月至2014年6月,担任本公司权益类基金基金经理助理。2014年6月起,担任浦银安盛盛世精选混合基金基金经理。2014年7月起,兼任浦银安盛新经济结构混合基金基金经理。 |

注:1、褚艳辉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、在基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4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2015年1月1日起至3月31日止。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本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。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。

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

一季度,市场整体延续上涨行情,但结构与风格较去年末出现变化。指数表现上,沪深300上涨14.64%,中小板与创业板上涨46.60%,58.67%。总体看,成长股和新兴产业板块跑赢传统蓝筹股,其中,计算机、传媒、通信、电子等板块涨幅超过市场平均水平,而金融、煤炭采掘、钢铁有色、食品饮料、地产等板块涨幅相对较小。主题投资活跃,互联网相关、信息消费、一带一路、中国制造2025等受到市场关注,有较好的赚钱效应。如果将考察周期拉长至去年四季度,我们会发现市场总体呈现轮涨格局,牛市特征明显。

2015年,国内经济增长的预期目标为7%左右,继续实施"定向调控",而非采取短期强刺激措施,这有利于经济稳定并实施结构转型。央行继续实施稳健的货币政策,通胀水平比较温和,流动性维持偏宽松的状态。在货币市场上,由于央行自去年下半年以来多次实施MLF、SLF、降准、降息等政策,释放较多的基础货币,因此资金价格总体保持低位。

报告期内,本基金以追求稳定收益为投资目标,采取相对稳健的投资策略。在资产配置上,权益类资产维持相对较低的仓位,重点关注低估值板块,对于发展前景向好的成长股,结合估值水平进行配置。另一方面,本基金重点做好现金管理,关注新股与转债发行带来的投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,业绩比较基准上涨8.35%,基金净值上涨7.39%。

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 | 26,553,045.35 | 15.59 |
| | 其中:股票 | 26,553,045.35 | 15.59 |
| 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 | 124,000,330.00 | 72.82 |
| | 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 | 18,158,715.41 | 10.66 |
| 8 | 其他资产 | 1,579,476.20 | 0.93 |
| 9 | 合计 | 170,291,566.96 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 序号 | 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 | 9,881,508.63 | 6.02 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| 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 | 12,818,721.56 | 7.81 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 1,281,800.00 | 0.78 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,571,015.16 | 1.57 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 26,553,045.35 | 16.18 |

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 | 600446 | 金证股份 | 15,600 | 1,900,080.00 | 1.16 |
| 2 | 300065 | 海兰信 | 46,567 | 1,606,095.83 | 0.98 |
| 3 | 002331 | 皖通科技 | 87,120 | 1,489,752.00 | 0.91 |
| 4 | 600358 | 国旅联合 | 104,998 | 1,409,073.16 | 0.86 |
| 5 | 600290 | 华仪电气 | 108,000 | 1,345,680.00 | 0.82 |
| 6 | 600850 | 华东电脑 | 23,000 | 1,317,210.00 | 0.80 |
| 7 | 300188 | 美亚柏科 | 30,000 | 1,301,100.00 | 0.79 |
| 8 | 600571 | 信雅达 | 22,948 | 1,284,399.56 | 0.78 |
| 9 | 600767 | 运盛实业 | 68,000 | 1,281,800.00 | 0.78 |
| 10 | 300250 | 初灵信息 | 22,000 | 1,234,420.00 | 0.75 |

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

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 20,371.24 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 19,391.74 |
| 5 | 应收申购款 | 1,539,713.22 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,579,476.20 |

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

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300065 | 海兰信 | 1,606,095.83 | 0.98 | 停牌或网下申购锁定期 |

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 259,446,524.67 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 66,703,942.68 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 179,518,949.09 |
| 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 | 146,631,518.26 |

### §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

本报告期内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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

根据上海市政府的要求,经上海国盛(集团)有限公司批准,本基金管理人原股东上海盛融投资有限公司("以下简称"上海盛融")由其母公司上海国盛集团资产有限公司("以下简称"上海国盛")吸收合并,上海盛融持有的本基金管理人10%的股权由上海国盛承继,本基金管理人股东因此由上海盛融变更为上海国盛。本基金管理人正在就此事项履行相关工商变更手续。

### §9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、中国证监会核准浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
2、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同
3、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议
4、浦银安盛基金管理有限公司开放式基金业务规则
5、关于募集浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金的法律意见书
6、基金管理人业务资格批件和营业执照
7、基金托管人业务资格批件和营业执照
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 