浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金

【2015】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:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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	浦银安盛季季添利债券	
基金主代码	519123	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年6月14日	
报告期末基金份额总额	762,057,308.21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收益水平。	
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、类属配置进行动态管理,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,实现投资目标。	
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的三个月定期存款基准利率(税后)*1.1	
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	上海银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛季季添利债券A	浦银安盛季季添利债券C
下属分级基金的交易代码	519123	519124
报告期末下属分级基金的份额总额	749,253,812.37份	12,803,495.84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(2015年10月1日 - 2015年12月31日)	
	浦银安盛季季添利债券A	浦银安盛季季添利债券C
1. 本期已实现收益	21,547,397.19	373,146.69
2. 本期利润	20,982,983.33	359,066.12
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0276	0.0262
4. 期末基金资产净值	923,384,288.51	15,644,776.25
5. 期末基金份额净值	1.232	1.222

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

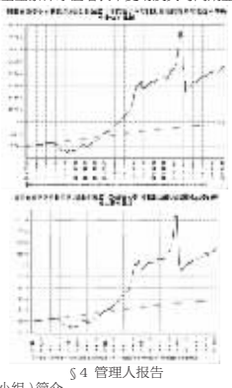
浦银安盛季季添利债券A

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	2.24%	0.13%	0.32%	0.00%	1.92%	0.13%

浦银安盛季季添利债券C

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	2.17%	0.15%	0.32%	0.00%	1.85%	0.15%

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		
薛铮	本公司固定收益投资部总监,公司旗下浦银安盛优化收益债券基金、浦银安盛幸福回报债券基金、浦银安盛稳健增利债券基金、浦银安盛6个月债券基金、浦银安盛季季添利债券基金以及浦银安盛月月盈债券基金经理	2013年6月14日	-	9	薛铮先生,上海财经大学数量经济学硕士,2006年3月至2009年6月,先后就职于红顶金融研究中心,上海证券有限公司从事固定收益研究工作。2009年7月进入浦银安盛基金管理公司,历任固定收益研究员、固定收益基金经理助理、货币基金基金经理等职务。2011年12月起担任浦银安盛稳健增利债券基金(原增利分级债券基金)基金经理。2012年9月起兼任浦银安盛幸福回报债券基金基金经理。2012年11月起,担任本公司固定收益投资部总监。2013年5月起,兼任浦银安盛6个月定期开放债券基金基金经理。2013年6月起,兼任浦银安盛季季添利债券基金基金经理。2014年7月起,兼任浦银安盛优化收益债券基金基金经理。2014年12月起,兼任浦银安盛月月盈债券基金基金经理。

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。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

4季度债券收益率快速下行,在"资产荒"的背景下,各类债券收益率均下行至历史低点附近。回顾4季度,货币宽松节奏开始放缓,货币政策存在边际转向的迹象,预计明年财政政策将接棒货币政策,发挥更大的作用。在经济下行叠加去产能的大环境下,各类信用事件频发,信用风险显著加大。在货币政策转向和信用风险频发的共同作用下,债券市场预计会出现一定的调整。在报告期内,本基金维持了较高的信用债仓位和中性的组合久期,并择机进行了部分个券的波段操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期A类净值增长率为2.24%,C类净值增长率为2.17%,同期业绩比较基准收益率为0.32%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,297,832,880.30	91.78
	其中:债券	1,297,832,880.30	91.78
	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	39,812,187.93	2.82
8	其他资产	76,458,730.85	5.41
9	合计	1,414,103,799.08	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注: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

注: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

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	20,280,000.00	2.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,431,000.00	1.11
	其中:政策性金融债	10,431,000.00	1.11
4	企业债券	1,196,356,400.30	127.40
5	企业短期融资券	30,348,000.00	3.23
6	中期票据	-	-
7	可转债	40,417,480.00	4.30
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,297,832,880.30	138.21

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	124318	13滨城投	1,000,000	105,130,000.00	11.20
2	124323	13新天治	922,740	95,162,176.20	10.13
3	1380240	13商洛债01	700,000	75,327,000.00	8.02
4	122266	13中信03	599,000	60,762,560.00	6.47
5	124349	13福东海	500,000	53,745,000.00	5.72

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

注: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

注: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

注: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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围尚未包含国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金投资范围尚未包含国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围尚未包含国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金投资的前十名证券的发行主体除中信证券股份有限公司以外不存在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。本基金投资的前十名证券中中信证券于1月19日因存在为到期融资融券合约展期、向不符合条件的客户融资融券等问题,被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。中信证券于11月26日因涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定,收到中国证券会《调查通知书》。本基金管理人的研究部门对中信证券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

报告期内,本基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定备选股票库投资的情况。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	487,537.24
2	应收证券清算款	52,915,807.47
3	应收股利	-
4	应收利息	23,055,361.14
5	应收申购款	-
6	其他应收款	25.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	76,458,730.85

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	歌尔转债	39,893,480.00	4.25

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	浦银安盛季季添利债券A	浦银安盛季季添利债券C
报告期期初基金份额总额	761,930,910.01	13,902,437.47
报告期期间基金总申购份额	1,093,845.09	32,921.81
减:报告期期间基金总赎回份额	13,770,942.73	1,131,863.44
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	749,253,812.37	12,803,495.84

§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

注: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

注: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、 浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金基金合同

3、 浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金招募说明书

4、 浦银安盛季季添利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

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
2016年1月21日

浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金

【2015】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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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6个月定期债券	
基金主代码	519121	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年5月16日	
报告期末基金份额总额	109,639,193.96份	
投资目标	在控制风险的基础上,追求超过业绩比较基准的当期收入和投资总回报,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。	
投资策略	本基金不从二级市场买入股票或权证,也不参与一级市场新股申购或股票增发。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。	
业绩比较基准	6个月定期存款利率(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	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛6个月定期债券A	浦银安盛6个月定期债券C
下属分级基金的交易代码	519121	519122
报告期末下属分级基金的份额总额	98,542,157.60份	11,097,036.36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(2015年10月1日 - 2015年12月31日)	
	浦银安盛6个月定期债券A	浦银安盛6个月定期债券C
1. 本期已实现收益	2,585,871.48	268,502.84
2. 本期利润	2,452,959.13	257,987.84
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0264	0.0253
4. 期末基金资产净值	112,673,170.96	12,608,302.06
5. 期末基金份额净值	1.143	1.136

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

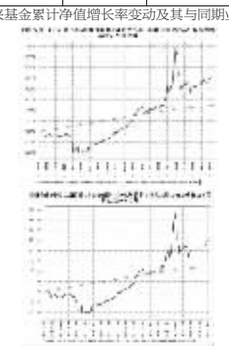
浦银安盛6个月定期债券A

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	2.33%	0.14%	0.34%	0.00%	1.99%	0.14%

浦银安盛6个月定期债券C

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	2.25%	0.15%	0.34%	0.00%	1.91%	0.15%

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		
薛铮	本公司固定收益投资部总监,公司旗下浦银安盛优化收益债券基金、浦银安盛幸福回报债券基金、浦银安盛稳健增利债券基金、浦银安盛6个月债券基金、浦银安盛季季添利债券基金以及浦银安盛月月盈债券基金经理	2013年5月16日	-	9	薛铮先生,上海财经大学数量经济学硕士,2006年3月至2009年6月,先后就职于红顶金融研究中心,上海证券有限公司从事固定收益研究工作。2009年7月进入浦银安盛基金管理公司,历任固定收益研究员、固定收益基金经理助理、货币基金基金经理等职务。2011年12月起担任浦银安盛稳健增利债券基金(原增利分级债券基金)基金经理。2012年9月起兼任浦银安盛幸福回报债券基金基金经理。2012年11月起,担任本公司固定收益投资部总监。2013年5月起,兼任浦银安盛6个月定期开放债券基金基金经理。2013年6月起,兼任浦银安盛季季添利债券基金基金经理。2014年7月起,兼任浦银安盛优化收益债券基金基金经理。2014年12月起,兼任浦银安盛月月盈债券基金基金经理。

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。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

4季度债券收益率快速下行,在"资产荒"的背景下,各类债券收益率均下行至历史低点附近。回顾4季度,货币宽松节奏开始放缓,货币政策存在边际转向的迹象,预计明年财政政策将接棒货币政策,发挥更大的作用。在经济下行叠加去产能的大环境下,各类信用事件频发,信用风险显著加大。在货币政策转向和信用风险频发的共同作用下,债券市场预计会出现一定的调整。在报告期内,本基金维持了较高的信用债仓位和中性的组合久期,并择机进行了部分个券的波段操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期A类净值增长率为2.33%,C类净值增长率为2.25%,同期业绩比较基准收益率为0.34%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	146,682,983.72	95.68
	其中:债券	146,682,983.72	95.68
	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	3,918,162.80	2.56
8	其他资产	2,707,096.78	1.77
9	合计	153,308,243.30	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注: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

注: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

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	18,856,400.00	15.05
	其中:政策性金融债	10,495,000.00	8.38
4	企业债券	120,374,530.22	96.08
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	3,078,600.00	2.46
7	可转债	4,373,453.50	3.49
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	146,682,983.72	117.08

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1580041	15黔南投资债	100,000	10,740,000.00	8.57
2	150314	15进出14	100,000	10,495,000.00	8.38
3	1080105	10铁道01	100,000	10,310,000.00	8.23
4	1580309	15无锡创投债	100,000	10,047,000.00	8.02
5	136120	15鲁能债	100,000	10,000,000.00	7.98

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

注: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

注: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

注: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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金投资的前十名证券的发行主体不存在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。

5.10.2

报告期内,本基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定备选股票库投资的情况。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	42,562.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,664,534.31
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,707,096.78

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	歌尔转债	3,528,606.40	2.82
2	113008	电气转债	430,907.10	0.34
3	110030	格力转债	413,940.00	0.33

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

截至本报告期末本基金持有中小企业私募债余额为5,022,904.11元,明细如下:

金额单位:元

债券代码	债券名称	票面利率(%)	数量(张)	期末估值总额
125400	14铜水务	9.50	50,000	5,022,904.11

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	浦银安盛6个月定期债券A	浦银安盛6个月定期债券C
报告期期初基金份额总额	92,604,519.49	10,215,049.40
报告期期间基金总申购份额	21,077,171.48	4,269,813.58
减:报告期期间基金总赎回份额	15,139,533.37	3,387,826.62
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	98,542,157.60	11,097,036.36

§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

注: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

注: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6个月定期开放债券型证券投资基金基金合同

3、 浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书

4、 浦银安盛6个月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

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
2016年1月21日

浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金

【2015】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:2016年1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2016年1月19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	浦银安盛消费升级混合
基金主代码	519125
交易代码	519125
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月4日
报告期末基金份额总额	73,573,806.82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可持续增长、经济结构转型趋势和消费升级驱动的大消费行业及其相关行业的投资机会,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可持续增长、经济结构转型趋势和消费升级驱动的大消费行业及其相关行业,结合对大消费行业及其相关行业的发展趋势的研究分析,上市公司发展战略、商业模式、技术、工艺的分析,对属于消费升级投资主题范畴的上市公司进行重点投资。
业绩比较基准	55%×中证内地消费主题指数+45%×中证全债指数
风险收益特征	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	交通银行股份有限公司

注:自2015年10月1日起,本基金业绩比较基准由原"中信标普全债指数"变更为"中证全债指数"。具体内容详见基金管理人于2015年11月13日发布的《关于变更旗下基金业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》。

§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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	19,127,743.03
2.本期利润	40,972,661.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.6277
4.期末基金资产净值	139,832,833.20
5.期末基金份额净值	1.901

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。

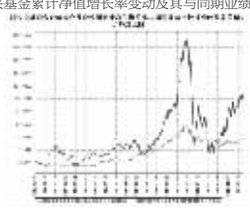
3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	50.51%	2.77%	9.54%	0.89%	40.97%	1.88%

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



注:

1.自2015年10月1日起,本基金比较基准由"55%×中证内地消费主题指数+45%×中信标普全债指数"变更为"55%×中证内地消费主题指数+45%×中证全债指数"。具体内容详见基金管理人于2015年11月13日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于变更旗下基金业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴勇	本公司权益投资部总监,公司旗下浦银安盛红利精选混合基金、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基金经理	2013年12月4日	-	8	吴勇先生,上海交通大学材料工程系学士,上海交通大学工商管理硕士,CFA,CPA,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。2012年11月起兼任本公司权益投资部总监。

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。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,