

浦银安盛红利精选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:中国工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法律责任。

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信信用、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先仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期为2015年10月1日起至12月31止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛红利精选混合
基金代码	519115
交易代码	519115
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2008年12月10日
报告期末基金份额总额	67,357,403.62份
投资目标	本基金在严格控制投资风险的前提下,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的上市的外资债券,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“自上而下”与“自下而上”相结合的投资策略,通过大类资产配置,动态调整股票、个股和债券选择能力,力求在风险可控的前提下,实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证红利指数×70%+中证全债指数×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金产品,基金资产中股票的预期收益和风险均高于债券,属于中等风险、中等收益的基金品种。本基金力争在科学的风险管理的前提下,谋求实现基金资产的安全和增值。
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

3.1 主要财务指标

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	16,383,170.60
2.本期利润	34,492,360.67
3.加权平均基金份额本期利润	0.0806
4.期末基金资产净值	126,430,431.22
5.期末基金份额净值	1.8628

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。

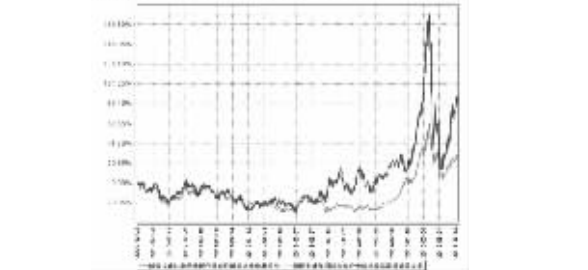
3.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	48.09%	2.77%	16.94%	1.30%	31.15%	1.47%

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:自2015年9月4日起,本基金类型由股票型变更为红利,本基金基金名称变更为“浦银安盛红利精选混合型证券投资基金”。具体内容详见基金管理人于2015年8月4日发布的《关于浦银安盛红利精选混合型证券投资基金变更基金名称、基金类型及业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理期限	证券从业年限	说明
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型证券投资基金、浦银安盛新兴产业混合型证券投资基金、浦银安盛消费升级混合型证券投资基金的基金经理	2010年4月14日	8	吴勇先生,上海交通大学材料工程学士学位,上海交通大学工学工商管理硕士, CFA, CFAA, 曾任嘉实基金, 2003年8月至2007年8月历任嘉实上海电力基金助理, 2007年8月起担任嘉实新兴产业证券投资基金、嘉实新兴产业混合型证券投资基金、嘉实新兴产业混合型证券投资基金、嘉实新兴产业混合型证券投资基金的基金经理, 2012年11月起兼任浦银安盛红利精选混合型证券投资基金基金经理, 2012年11月起兼任浦银安盛新兴产业混合型证券投资基金基金经理, 2012年11月起兼任浦银安盛消费升级混合型证券投资基金基金经理, 2012年11月起兼任浦银安盛红利精选混合型证券投资基金基金经理。

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

在本报告期内,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,以保证投资决策执行的公平性;在事后监控环节上,一方面是对对交易情况进行分析,对同一时间窗口(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差异的分析;另一方面是公司公平交易制度的遵守和相关业务流程的严格执行情况进行定期检验,并对发现的问题进行及时的报告。

在本报告期内,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的认定的异常交易行为。报告期内未发生旗下所有投资组合存在公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易金额超过该当日成交金额5%的情形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾三季度由于去杠杆等因素持续发酵后,我们判断市场应该到了阶段性底部区域——中国经济基本面在这几个月并没有太大的变化,货币政策依然宽松;当去杠杆的影响减弱以后,市场应该会回到原有的轨道上。与此同时,很多前期看好的成长股已经跌到估值合理甚至低估的价格。基于中长期的判断,我们增加了前期看好的军工、传媒、信息服务、通信等板块,从而在四季度获得了比较好的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本季度净值表现高于比较基准,报告期内基金净值增长率为48.09%,基准收益率为16.94%。

4.6 报告期内基金持有人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人数不满二百人的情形。

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元的情形。

§ 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	120,169,476.56	93.36
1.1	其中:股票	120,169,476.56	93.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
3.2	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	-	-
6.1	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	7,662,671.28	6.06
8	其他资产	883,507.98	0.69
9	合计	128,714,655.82	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	70,329,947.21	56.11
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	5,843,156.00	4.62
F	批发和零售业	5,310,620.00	4.20
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息、软件和信息技术服务业	22,611,763.00	17.88
J	金融业	-	-
K	房地产业	264,393.00	0.21
L	租赁和商务服务业	6,524,140.00	5.24
M	科学研究和技术服务业	3,327,360.00	2.64
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	3,441,696.40	2.72
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	91,126.00	0.78
S	综合	1,053,742.95	0.83
合计	合计	120,169,476.56	96.04

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	000528	招商发展	338,200	5,843,156.00	4.62
2	300248	新开普	150,900	5,606,958.00	4.43
3	300354	东华测试	121,900	5,277,051.00	4.17
4	300065	海兰信	131,947	5,040,374.40	3.97
5	002712	思创医展	38,262	4,886,266.00	3.89
6	601599	鹿港科技	188,000	4,654,880.00	3.68
7	000209	美科科技	181,000	4,548,320.00	3.61
8	300235	红宇新材	228,601	4,459,946.05	3.58
9	002296	双钱股份	140,132	4,442,412.80	3.51
10	300306	鼎利华	71,200	3,481,680.00	2.76

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注: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

注: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

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

注: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

注: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

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资政策

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 报告期内本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本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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	154,870.03
2	应收证券清算款	241,580.07
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	484,914.79
7	待摊费用	-
8	其他资产	-
9	合计	883,507.98

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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 报告期末本基金持有的流通受限证券的情况

注:本基金本报告期末未持有流通受限证券。

5.12 开放式基金份额变动

报告期初基金份额总额	66,276,004.56
报告期间基金份额净增加额	41,487,389.75
报告期末基金份额总额	107,763,394.31
报告期间基金份额净变动额(份额减少以“-”填列)	29,388,482.48
报告期末基金份额总额	67,357,403.62

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

8. 中国证监会规定的其他事项

8.1 存放地点

上海市淮海中路381号中环路48楼基金管理人办公场所。

8.2 查询方式

投资者可登录基金管理人网站(www.py-axa.com)查询,或在营业时间内至基金管理人办公场所查询。

8.3 查询时间

投资者对本报告如有任何疑问,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

浦银安盛优化收益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:中国工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法律责任。

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信信用、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先仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期为2015年10月1日起至12月31止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛优化收益债券
基金代码	519111
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2008年12月10日
报告期末基金份额总额	67,474,984.01份
投资目标	本基金通过对宏观经济运行状况、金融市场的运行趋势进行自上而下的分析,通过组合分析为基础进行自上而下的精选,在严格控制投资风险的前提下,主要投资于固定收益类资产,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过“自上而下”的资产配置、久期调整、类属配置和“自下而上”的个股选择,运用多种数量化资产管理增值模型,实现投资目标。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金,属于证券投资基金中的低风险收益、较低风险品种。一般情况下,其风险收益低于股票型基金、混合型基金,高于货币型基金。
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	浦银安盛优化收益债券A
下属分级基金的代码	519111
报告期末基金份额总额	37,679,112.30份

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。

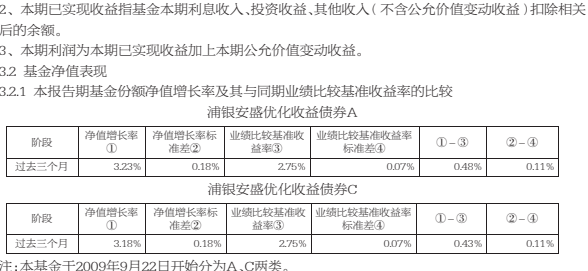
3.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	3.23%	0.18%	2.76%	0.07%	0.46%	0.11%

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



注:自2009年9月22日开始为A、C两类。具体内容详见基金管理人于2009年9月18日刊登的《关于浦银安盛优化收益债券型证券投资基金增加C类收费模式并修改基金合同的公告》。

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: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法律责任。

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信信用、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先仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期为2015年10月1日起至12月31止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛优化收益债券
基金代码	519111
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2008年12月10日
报告期末基金份额总额	67,474,984.01份
投资目标	本基金通过对宏观经济运行状况、金融市场的运行趋势进行自上而下的分析,通过组合分析为基础进行自上而下的精选,在严格控制投资风险的前提下,主要投资于固定收益类资产,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过“自上而下”的资产配置、久期调整、类属配置和“自下而上”的个股选择,运用多种数量化资产管理增值模型,实现投资目标。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金,属于证券投资基金中的低风险收益、较低风险品种。一般情况下,其风险收益低于股票型基金、混合型基金,高于货币型基金。
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	浦银安盛优化收益债券A
下属分级基金的代码	519111
报告期末基金份额总额	37,679,112.30份

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。

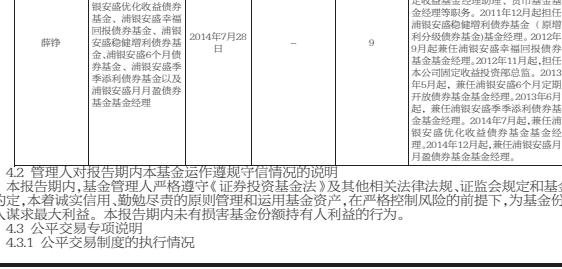
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

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。

3.2.1 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	3.23%	0.18%	2.76%	0.07%	0.46%	0.11%

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



注:自2009年9月22日开始为A、C两类。具体内容详见基金管理人于2009年9月18日刊登的《关于浦银安盛优化收益债券型证券投资基金增加C类收费模式并修改基金合同的公告》。

5.1 报告期末基金资产组合情况

报告发布日期:2016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。

基金托管人中国建设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,基金过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险,投资者存在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

基金名称 鹏华互联网+大数据灵活配置混合
基金管理人 鹏华基金管理有限公司
基金托管人 中国建设银行股份有限公司
基金类型 混合型证券投资基金