浦银安盛增利分级债券型证券投资基金之浦银增A和浦银增B上市交易公告书

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
注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2012年03月09日
公告日期:2012年03月06日

一、重要声明与提示

《浦银安盛增利分级债券型证券投资基金之浦银增A与浦银增B基金份额上市交易公告书》(以下简称"本公告书")依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,浦银安盛增利分级债券型证券投资基金(以下简称"本基金")管理人的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。本基金托管人保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金份额上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅2011年11月2日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》以及本公司网站(www.py-axa.com.cn)的《浦银安盛增利分级债券型证券投资基金招募说明书》(以下简称招募说明书)。

二、基金概览

1、基金名称:浦银安盛增利分级债券型证券投资基金(简称"浦银安盛增利分级债券")

2、基金类型:债券型

3、基金运作方式:

契约型基金。本基金基金合同生效后,在封闭期内不开放申购、赎回业务。但可在本基金上市交易后通过证券交易所转让基金份额。封闭期届满后,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。

4、本基金基金合同生效后,在封闭期内,基金份额持有人的总认购份额自动按7:3的比例分成预期收益与预期风险不同的两个份额类别,即A类份额(基金份额简称"浦银增A")和B类份额(基金份额简称"浦银增B"),两类基金份额的基金资产合并运作。

5、本基金的存续期限为不定期。

本基金基金合同生效后,封闭期为三年(含三年),封闭期届满后转为上市开放式基金(LOF)。本基金封闭期自基金合同生效之日起至三年后对应日止。如该对应日为非工作日,则封闭期到期日顺延到下一个工作日。

6、基金份额的上市交易:

本基金基金合同生效后,在三年封闭期内,由初始基金份额所分成的两类份额,浦银增A与浦银增B将同时申请在深圳证券交易所上市交易。在封闭期结束后,浦银增A与浦银增B将分别以各自份额净值为基础,按照本基金的基金份额净值(NAV)转换为同一上市开放式基金(LOF),并继续在深圳证券交易所上市交易。

7、基金份额总额:

截至2012年3月2日基金份额总额:本基金场内总份额39,841,028份,其中,浦银增A基金份额27,889,025份,浦银增B基金份额11,952,003份。本基金场外总份额866,019,890.69份,其中,浦银增A基金份额606,213,629.37份,浦银增B基金份额259,806,261.32份。

8、浦银增A的基金份额参考净值为1.0120元(截止2012年3月2日),

浦银增B的基金份额参考净值为1.0420元(截止2012年3月2日)。

9、本次上市交易的基金份额简称及交易代码:

简称:浦银增A　代码 150062

简称:浦银增B　代码 150063

10、本次上市交易的两类基金份额总额:

浦银增A　634,102,654.37份;

浦银增B　271,758,264.32份;

11、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所

12、上市交易日期:2011年03月09日

13、基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司

14、基金托管人:上海银行股份有限公司

15、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

三、基金份额的募集与上市交易

(一)上市前基金募集情况

1、本基金募集申请的核准机构和核准文号:

中国证券监督管理委员会2011年10月25日证监许可[2011]1704号文

2、基金合同生效日:2011年12月13日

3、基金运作方式:契约型基金。本基金基金合同生效后,在封闭期内不开放申购、赎回业务。但可在本基金上市交易后通过证券交易所转让基金份额。封闭期届满后,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。

4、基金合同期限:不定期

5、本基金发售日期:2011年11月7日至2011年12月7日

6、发售价格:1.00元人民币

7、份额发售方式:本基金通过场外、场内两种方式公开发售

8、发售机构

(1)直销机构:浦银安盛基金管理有限公司

(2)场外认购的销售机构:

上海银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中银万国证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、天相投资顾问有限公司、中信建投证券有限责任公司、中航证券有限公司、国泰君安证券股份有限公司和华福证券

(3)场内认购的销售机构:

本基金通过场内发售的机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位,具体名单可在深交所网站查询。

9、验资机构名称:安永华明会计师事务所

10、募集资金总额及入账情况:

本次募集的净认购金额为905,197,332.55元人民币,认购资金在募集期间产生的银行利息共计663,586.14元人民币,已折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金账户,归基金份额持有人所有。

本次募集有效认购总户数为10,758户,按照每份基金份额面值1.00元人民币计算,募集期募集资金及其利息结转的基金份额共计905,860,918.69份。其中本基金管理人基金从业人员认购持有的基金份额总额为1,000.22(含募集期利息结转的份额),占本基金总份额的比例为0.00011%。

本基金募集结束后,按照基金合同约定基金份额按7:3的比率确认为浦银增A份额与浦银增B份额。其中,浦银增A的基金份额为634,102,654.37份,浦银增B的基金份额271,758,264.32份。

募集资金已于2011年12月13日划入本基金在基金托管人上海银行股份有限公司开立的基金托管专户。

11、基金备案情况

本基金已于2011年12月13日验资完毕,当日向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于2011年12月13日获书面确认,本基金《基金合同》自该日起正式生效。

12、基金合同生效日:2011年12月13日

13、基金合同生效日的基金份额总额:905,860,918.69份

(二)本基金上市交易的主要内容

1、浦银增A与浦银增B上市交易的核准机构和核准文号:

深圳证券交易所深证上[2012]39号

2、上市交易日期:2012年03月09日

3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所

4、上市交易份额简称:浦银增A、浦银增B

5、交易代码:浦银增A为150062、浦银增B为150063

6、本次上市交易份额:

浦银增A为27,889,025份(数据截止2012年3月2日)

浦银增B为11,952,003份(数据截止2012年3月2日)

7、基金资产净值的披露:

每个工作日的次日公布本基金的基金份额净值和两类基金份额浦银增A和浦银增B的份额参考净值,并在深交所行情发布系统揭示浦银增A和浦银增B的份额参考净值。

8、未上市交易份额的流通规定:

未上市交易的份额托管在场外,基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

(一)持有人户数

截至2012年3月2日,浦银增A场内基金份额持有人户数为282户,平均每户持有的浦银增A场内基金份额98,897.25份。浦银增B场内基金份额持有人户数为281户,平均每户持有的浦银增B场内基金份额42,533.82份。

(二)持有人结构

截至2012年3月2日,基金份额持有情况:机构投资者持有的本次上市交易的浦银增A与浦银增B的基金份额分别为18,551,765份和7,950,757份,分别占本次浦银增A与浦银增B上市交易基金份额比例为66.52%和66.52%;个人投资者持有的本次上市交易的浦银增A与浦银增B的基金份额分别为9,337,260份和4,001,246份,分别占本次浦银增A与浦银增B上市交易基金份额比例为33.48%和33.48%。

(三)截至2012年3月2日,本次上市交易的浦银增A前十名持有人情况:

序号	持有人名称	证券账户号	持有基金份额	占场内基金份额的比例
1	上海证券有限责任公司	0899005272	14,000,971	50.20%
2	关欣信	0507295606	7,001,890	25.11%
3	安信证券-广发-安信证券基金宝集合资产管理计划	0899056096	3,500,243	12.55%
4	宁波贝尔斯能源科技有限公司	0511574575	700,441	2.51%
5	刘炯辉	0017353953	490,242	1.76%
6	南京申恩汽车配件有限公司	0511594535	350,110	1.26%
7	魏丽倩	0511503454	280,277	1.00%
8	陆金向	0511624865	231,041	0.83%
9	陆良军	0510159820	210,198	0.75%
10	葛美琴	0073786417	140,009	0.50%

截至2012年3月2日,本次上市交易的浦银增B前十名持有人情况:

序号	持有人名称	证券账户号	持有基金份额	占场内基金份额的比例
1	上海证券有限责任公司	0899005272	6,000,417	50.20%
2	关欣信	0507295606	3,000,810	25.11%
3	安信证券-广发-安信证券基金宝集合资产管理计划	0899056096	1,500,104	12.55%
4	宁波贝尔斯能源科技有限公司	0511574575	300,189	2.51%
5	刘炯辉	0017353953	210,103	1.76%
6	南京申恩汽车配件有限公司	0511594535	150,047	1.26%
7	魏丽倩	0511503454	120,118	1.01%
8	陆金向	0511624865	99,017	0.83%
9	陆良军	0510159820	90,085	0.75%
10	葛美琴	0073786417	60,004	0.50%

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1、基本信息

名称:浦银安盛基金管理有限公司

注册地址:上海市浦东新区浦东大道981号3幢316室

办公地址:上海市卢湾区淮海中路381号中环广场38楼

法定代表人:姜明生

总经理:钱华

成立时间:2007年8月5日

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字[2007]207号

组织形式:有限责任公司

注册资本:2亿元

经营范围:证券投资基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

2、股权结构:

上海浦东发展银行(以下简称"浦发银行")持有51%的股权;法国安盛投资管理有限公司(以下简称"安盛投资")持有39%的股权;上海盛融投资有限公司(以下简称"上海盛融")持有10%的股权。

3、内部组织结构及职能

公司下设17个主要部门,包括投资部、研究部、金融工程部、集中交易部、基金销售部、市场营销部、客户服务部、产品开发部、专户资产管理部、信息技术部、基金会计部、注册结算部、风险管理部、公司财务部、行政管理部、人力资源部、监察部。

(1)投资部

投资部股票投资团队负责在投资委员会决定的资产配置和组合原则的基础上,集合研究部对股票的研究成果制定股票投资具体组合,进行对股票组合的日常投资管理。固定收益证券投资团队负责宏观经济与债券市场的研究分析及在投资决策委员会的授权内,负责债券组合的日常投资管理。投资部对首席投资官负责。

(2)研究部

研究部是公司投资管理体系中重要的投资决策支持部门。其主要职责包括负责开展宏观经济、行业和上市公司及各类金融衍生产品等方面的研究,建立和维护股票库,并对重点上市公司进行实地调研,为基金投资提供研究报告和投资建议。研究部对首席投资官负责。

(3)金融工程部

金融工程部负责建立与维护公司投资研究系统的内部数据库的建立、管理与维护,除对投研人员的数量化分析要求提供帮助之外,也对市场及基金运行风险进行第一线的分析。金融工程部对首席投资官负责。

(4)集中交易部

集中交易部统一负责公司旗下所管理基金涉及股票、权证、债券买卖、债券回购、定期存单等基金允许投资品种的交易活动,以及网络投票、新股申购、交易席位管理等业务工作。作为公司投资交易执行和投资风险监控的一线部门,集中交易部接受投资部的投资交易指令,进行审核并予以执行,同时与基金经理保持及时必要的沟通与反馈,并进行日常一线的风险监控。集中交易部对首席运营官负责。

(5)基金销售部

基金销售部主要负责公募基金的销售工作,具体包括:做好基金通过代销渠道及直销渠道的销售工作;做好银行、证券公司等分销渠道的开发、维护工作;负责公司发行管理的基金直接销售市场的开发以及直销客户的开拓和维护,为机构投资者和个人高端客户提供理财服务;根据公司总体营销方案,协助市场营销部进行营销方案的市场调查和可行性分析研究,制定并完善营销方案;建立渠道及直销数据管理系统,负责渠道及直销客户档案的建立、管理及分析。基金销售部对首席市场营销官负责。

(6)市场营销部

市场营销部主要负责公司与基金产品品牌建设、市场推广、公关宣传、基金产品包装与管理等工作。具体职责包括:对公司的金融产品制定具体的营销策略和营销方案,负责公司产品的营销推广、广告宣传等;负责制定公司的品牌战略及规划、实施,包括公司VI体系管理、代表公司对外发布必要信息,负责公司法定信息披露的公告发布等。市场营销部对首席市场营销官负责。

(7)客户服务部

客户服务部是负责公司已有客户日常维护以及对潜在客户提供持续服务的部门。具体职责包括:建立完善规范、有效的客户服务业务体系;制定并组织实施各类客户服务的方案与计划;根据公司发展战略、市场环境变化等因素,分析客户状况,制定具有广泛覆盖度的客户服务工作方案;负责公司直销柜台业务的具体开展等。客户服务部对首席市场营销官负责。

(8)产品开发部

产品开发部负责公司的产品开发和产品申报工作,具体职责:根据市场需求和公司产品开发规划开发设计公司差异化产品链,包括公募基金产品和特定账户理财产品等;负责制作新产品的发行申报材料,组织产品申报;组织产品培训,协助产品发行,对已发行或已运作产品进行长期跟踪评价。产品开发部对首席市场营销官负责。

(9)专户资产管理部

专户资产管理部主要负责特定理财产品的销售推广工作和投资咨询工作,进行对潜在成为特定账户客户的机构客户及个人大客户的挖掘、储备、需求研究、投资咨询和法律法规允许下的相关专业服务。专户资产管理部对总经理负责。

(10)信息技术部

信息技术部负责确保公司各项计算机信息技术系统能够安全、稳定、高效的运行,为公司在基金发行、投资运作、风险控制及防范、业务创新和发展等多方面提供全面的技术支持与实现保障。信息技术部对首席运营官负责。

(11)基金会计部

基金会计部负责完成公司所管理基金的会计核算工作,保障基金资产安全,真实、完整地对外提供基金的会计信息。基金会计部对首席运营官负责。

(12)注册结算部

注册结算部负责与中国证券登记结算有限责任公司等第三方机构合作,保证公司旗下基金投资者的开户和交易资料的真实、准确、完整,及时完成开户和交易信息的业务处理,确保投资者基金份额登记和过户的及时准确,更好地为公司旗下基金投资和销售做好运营支持。注册结算部对首席运营官负责。

(13)风险管理部

风险管理部负责独立地评估公司面临的投资风险和运营风险,并作为内部控制第二层次履行基金控制职责。工作职责涵盖投资风险管理、运营风险管理、基金控制以及基金业绩分析等四个领域。风险管理部对首席运营官负责。

(14)公司财务部

公司财务部负责公司的财务管理和会计核算工作,并配合会计事务所的审计。公司财务部对首席运营官负责。

(15)行政管理部

行政管理部负责对公司日常运营事务进行计划、组织、协调等管理工作,为公司各部门提供相关配套服务。行政管理部对首席运营官负责。

(16)人力资源部

人力资源部负责制定公司人力资源管理战略计划和机制体系,并统一管理公司人员招聘、培训发展、绩效考核、薪资福利、员工关系以及企业文化建设等方面工作。人力资源部对总经理负责。

(17)监察部

监察部负责对公司基金投资运作、内部管理、系统实施和合法合规情况独立地履行检查、评估、报告、建议职能。现阶段,监察部还承担了公司法务及内部审计工作,包括为公司经营活动和经营决策提供法律建议和支持,审核所有公司对外法律文书,配合外部律师事务所处理公司相关法律事务等;对公司内控制度有效性、风险管理有效性、管理流程有效性的评价与报告,并开展完善和优化公司运作成效的咨询工作。监察部对总经理和督察长负责。

4、人员情况

截至2011年12月31日,公司共有员工64人,其中博士学位5人、硕士学位27人和学士学位29人。94%的公司员工具有基金从业资格。

5、信息披露负责人及咨询电话:

顾佳:021-23212812

6、基金管理业务情况

截至2011年12月31日,基金管理人共管理七只基金,公募基金管理资产规模约23.42亿元。本基金管理人管理的七只证券投资基金如下:浦银安盛价值成长股票型证券投资基金、浦银安盛精致生活混合型证券投资基金、浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛红利精选股票型证券投资基金、浦银安盛沪深300增强型证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛增利分级债券型证券投资基金。同时,公司已具备特定客户资产管理资格。

7、本基金基金经理

薛铮先生,上海财经大学数量经济学专业硕士。2006年3月至2008年5月,在红顶金融研究中心担任固定收益研究员。2008年6月至2009年6月,在上海证券有限公司固定收益部担任投资经理助理之职。2009年7月进入浦银安盛基金管理公司,任浦银安盛优化收益债券型基金基金经理助理兼固定收益研究员。2011年6月起,担任浦银安盛优化收益债券基金经理。2011年12月起,兼任本基金基金经理之职。2012年2月起,兼任浦银安盛货币市场基金基金经理。拥有6年证券从业经历。

(二)基金托管人

1、基本情况

名称:上海银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区银城东路168号

办公地址:上海市浦东新区银城东路168号

法定代表人:宁黎明

注册日期:1995年12月29日

注册资本:42.34亿元人民币

基金托管业务批准文号:中国证监会　中国银监会　证监许可[2009]814号。

托管部门负责人:廖海燕

托管部门联系人:帅芳

电话:021-58351512

传真:021-58354379

2、人员情况

上海银行总行下设资产托管部,是从事资产托管业务的职能部门,内设托管运作科、稽核监督科、运行保障科和市场拓展科,平均年龄32岁,100%员工拥有大学本科以上学历,所有岗位人员均具有基金从业资格。

3、发展概况

1995年12月29日,上海银行在中国经济金融改革大潮中应运而生。坚持服务地方经济、服务中小企业,服务市民的经营特色,秉承"点滴用心、相伴成长"为服务理念,上海银行稳健经营,规范管理,获得了良好的社会效益和经济效益,实现了持续快速稳健发展,成为我国银行体系中最具生机和活力的商业银行之一。

1999年9月和2001年12月,上海银行分别吸收国际金融公司和香港上海汇丰银行、上海商业银行等外资金融机构的参股投资,不仅对自身快速、稳健、开放式发展起到了积极的促进作用,同时也为我国商业银行及其他金融机构实现吸引外资投资多元化开创了成功的先例。

2005年11月,上海银行获准在城市商业银行系统中率先实现跨区域发展。如今,总部扎根上海浦东陆家嘴金融圈的上海银行,已经发展成为一家具有良好品牌形象、迈向全国的中等规模商业银行,分支机构延伸至长三角、珠三角、环渤海以及中西部地区,初步构建起了全国布局的战略框架,并与世界70个国家及地区近600家境内外银行的总行,建立了代理行网络关系。

自成立以来,上海银行充分发挥自身特点和优势,市场竞争力和影响力不断提高:在英国《银行家》公布的"全球前1000家银行"中,连年跻身500强;多次被《亚洲银行家》杂志评为中国地区"中国最佳城市零售银行";先后荣获"上海市著名商标"、"最具价值的上海服务商标"、"全国小企业贷款工作先进单位"、"小企业优秀客户服务银行"、"全国再就业先进单位","全国银行间市场优秀交易成员"等称号;连续四年在上海市银行业窗口服务质量大检查评比中名列第一。此外,在2010年上海世博会金融服务中,上海银行以良好的企业形象和优质的金融服务获得"上海世博会金融服务工作先进集体"、"中国银行业世博金融服务组织奖"、"中国银行业世博金融服务创新奖"等荣誉。

截至2010年底,上海银行总资产超5600亿元;存、贷款总额分别达到4095亿元和2984亿元;其中,人民币储蓄存款余额突破1000亿元;全年实现利润总额57.39亿元。目前,上海银行注册资本42.34亿元;拥有250余家营业网点和150余家自助银行,布放自助服务类终端设备(ATM、CDS、ASM、XDM等)近2000台。

(三)上市推荐人:本基金无上市推荐人。

(四)验资机构

名称:安永华明会计师事务所

住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼(东三办公楼)16层

办公地址:上海市世纪大道100号环球金融中心50楼

法定代表人:葛明

电话:(021)24052000

传真:(021)54075507

联系人:徐艳

经办注册会计师:徐艳、蒋燕华

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要请见附件

七、基金财务状况

深圳证券交易所在浦银安盛增利分级债券型证券投资基金募集期间未收取任何费用,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

浦银安盛增利分级债券型证券投资基金2012年3月2日资产负债表如下:

资　产	本报告期末
资　产:	
银行存款	15,716,679.13
结算备付金	14,033,377.76
存出保证金	250,000.00
交易性金融资产	1,070,166,384.85
其中:股票投资	
基金投资	
债券投资	1,070,166,384.85
资产支持证券投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	
应收证券清算款	166,892,913.74
应收利息	10,171,165.01
应收股利	
应收申购款	
其他资产	
资产总计	1,277,230,520.49
负债和所有者权益	
负　债:	
短期借款	
交易性金融负债	
衍生金融负债	
卖出回购金融资产款	319,999,770.00
应付证券清算款	32,306,149.1
应付赎回款	
应付管理人报酬	35,300.57
应付托管费	10,085.88
应付销售服务费	17,650.28
应付交易费用	6,488.12
应交税费	
应付利息	3,649.28
应付利润	
其他负债	316,065.34
负债合计	352,695,158.57
所有者权益:	
实收基金	905,860,918.69
未分配利润	18,674,443.23
所有者权益合计	924,535,361.92
负债和所有者权益总计	1,277,230,520.49

注:截至2012年3月2日,基金份额净值1.021元,基金份额总额905,860,918.69份。

八、基金投资组合

截止到2012年3月2日,浦银安盛增利分级债券型证券投资基金的投资组合如下:

1.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	固定收益投资	1,070,166,384.85	83.79
	其中:债券	1,070,166,384.85	83.79
	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	29,750,056.89	2.33
6	其他各项资产	177,314,078.75	13.88
7	合计	1,277,230,520.49	100.00

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。

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。

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	13,785,200.00	1.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	772,205,134.85	83.52
5	企业短期融资券	161,494,000.00	17.47
6	中期票据	122,154,000.00	13.21
7	可转债	528,050.00	0.06
8	其他	-	-
9	合计	1,070,166,384.85	115.75

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

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	122880	10天业债	499,990	50,298,994.00	5.44
2	122115	11华晚01	500,000	50,250,000.00	5.44
3	122112	11沪大众	500,000	50,100,000.00	5.42
4	122921	10郴州债	435,710	43,396,716.00	4.69
5	1182402	11盘江MTN1	400,000	41,112,000.00	4.45

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。

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。

8 投资组合报告附注

8.1 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报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

8.2 本基金本报告期末未持有股票。

8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	166,892,913.74
3	应收股利	-
4	应收利息	10,171,165.01
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	177,314,078.75

8.4 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	110015	石化转债	528,050.00	0.06

8.5 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。

九、重大事件揭示

浦银安盛增利分级债券型证券投资基金基金合同已于2011年12月13日正式生效,基金管理人已于2011年12月14日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站等媒体上刊登了《浦银安盛增利分级债券型证券投资基金基金合同生效公告》。本基金自合同生效至本公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金份格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,督促基金管理人改正。

(四)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅。

(一)中国证监会核准浦银安盛增利分级债券型分级证券投资基金募集的文件;

(二)《浦银安盛增利分级债券型分级证券投资基金基金合同》;

(三)《浦银安盛增利分级债券型分级证券投资基金招募说明书》;

(四)《浦银安盛增利分级债券型分级证券投资基金托管协议》;

(五)《关于浦银安盛基金管理有限公司募集设立浦银安盛增利分级债券型分级证券投资基金之法律意见书》;

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(七)基金托管人业务资格批件、营业执照;

(八)中国证监会要求的其他文件。

浦银安盛基金管理有限公司
2012年3月2日

附录:基金合同的内容摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

(一)基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:

(1)依法募集基金;

(2)自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;

(3)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;

(4)销售基金份额;

(5)召集基金份额持有人大会;

(6)依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

(8)选择、委托、更换基金代销机构,对基金代销机构的相关行为进行监督和处理;

(9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用;

(10)依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;

(11)在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;

(12)在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下,制订和调整《业务规则》,决定和调整除调高管理费率和托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式;

(13)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

(14)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资融券;

(15)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

(16)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

(17)法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:

(1)依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(2)办理基金备案手续;

(3)自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

(6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

(7)依法接受基金托管人的监督;

(8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;

(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10)编制季度、半年度和年度基金报告;

(11)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

(13)按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;

(17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

(20)因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失,而基金管理人首先承担了责任的情况下,基金管理人有权向第三方追偿;

(23)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;

(25)执行生效的基金份额持有人大会的决定;

(26)建立并保存基金份额持有人名册,定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册;

(27)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二)基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:

(1)自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;

(2)依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;

(3)监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(4)以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户;

(5)以基金托管人名义开立证券交易资金账户,用于证券交易资金清算;

(6)以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户,负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算;

(7)提议召开或召集基金份额持有人大会;

(8)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;

(9)法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于:

(1)以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;

(2)设立专门的基金托管部门,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;

(3)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,确保基金财产的安全,保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立;对所托管的不同的基金分别设置账户,独立核算,分账管理,保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;

(4)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;

(5)保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;

(6)按规定开设基金财产的资金账户和证券账户,按照《基金合同》