浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

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:二〇一三年七月十七日

§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2013年7月16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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛幸福回报债券	
基金主代码	519118	
基金运作方式	契约型定期开放式	
基金合同生效日	2012年9月18日	
报告期末基金份额总额	2,015,420,376.52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当期收入和投资总回报。	
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,实现本基金的投资目标。	
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(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	交通银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	浦银安盛幸福回报债券A类	浦银安盛幸福回报债券B类
下属两级基金的交易代码	519118	519119
报告期末下属两级基金的份额总额	1,617,733,471.53份	397,686,904.99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4月1日-2013年6月30日)	
	浦银安盛幸福回报债券A类	浦银安盛幸福回报债券B类
1.本期已实现收益	34,321,345.27	8,062,685.91
2.本期利润	34,811,777.58	8,185,089.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0215	0.0206
4.期末基金资产净值	1,704,897,145.96	418,380,871.87
5.期末基金份额净值	1.054	1.052

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

1、浦银安盛幸福回报债券A类:

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	2.13%	0.13%	0.75%	0.01%	1.38%	0.12%

2、浦银安盛幸福回报债券B类:

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	2.04%	0.12%	0.75%	0.01%	1.29%	0.11%

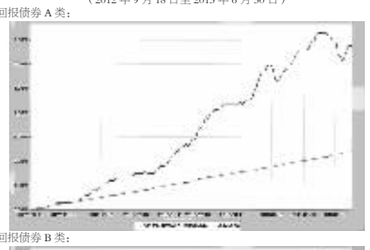
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金

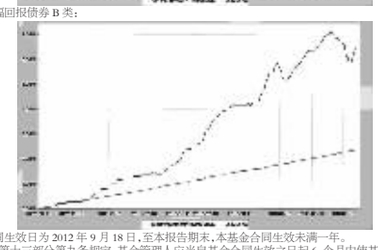
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年9月18日至2013年6月30日)

1. 浦银安盛幸福回报债券A类:



2. 浦银安盛幸福回报债券B类:



注:1、本基金合同生效日为2012年9月18日,至本报告期末,本基金合同生效未满一年。

2、根据基金合同第十三部分第九条规定: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。至本报告期末本基金投资组合比例符合上述规定。

§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		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,本基金基金经理、浦银安盛增利分级债券型基金基金经理,浦银安盛6个月定期开放债券型基金基金经理以及浦银安盛季季添利定期开放债券型基金基金经理	2012-9-18	-	7	薛铮,上海财经大学数量经济学硕士。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月至2012年6月,担任浦银安盛优化收益债券型证券投资基金基金经理。2011年12月起担任浦银安盛增利分级债券型证券投资基金基金经理。2012年9月起兼任本基金基金经理。2012年2月至2013年5月兼任浦银安盛货币市场证券投资基金基金经理。2012年11月起,担任本公司固定收益投资部总监。自2013年5月16日起,兼任浦银安盛6个月定期债券开放型证券投资基金基金经理。2013年6月14日起,兼任浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注:1、薛铮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 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

二季度经济进一步回落,房地产产业链的景气度有所下降,而出口高增长的水分也由于对热钱的严格监管被挤出。美联储表态将逐步退出量化宽松政策,资金流出新兴市场;再加上中国央行审慎的流动性管理态度,导致季末银行间市场流动性极度紧张。季度末对股票和债券市场均有较大冲击。

2013年二季度债券市场收益率出现了两次较大幅度的波动,4月份的债券监管事件和6月中下旬的流动性冲击。整体上这两次波动时间区间较短,收益率波动幅度在30-50BP范围,在流动性缓解之后,收益率回落速度较快。10年期国债重新回到3.50%一线,但城投债同中票同信用利差进一步缩小。在经济走势不明朗的情况下,长期收益率中枢将随着资本回报下行而进一步下移,这也是二季度债券市场在冲击下显得较为坚挺的根本原因。随着宏观经济增速回落,信用风险有显著上升趋势。权益类市场在二季度受到资金面冲击出现较大幅度下跌,在指数回落超过10%下可转债品种表现较差。

本基金依据对市场走势判断,在二季度以中高资质信用债为主,获取了相对良好的收益。

4.4.2 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2.13%,B类净值收益率2.04%,同期业绩比较基准收益率为0.75%,本基金的业绩比较基准为一年期银行定期存款利率。

§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	固定收益投资	2,918,310,076.40	94.20
	其中:债券	2,918,310,076.40	94.20
	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	99,605,263.24	3.22
6	其他各项资产	80,161,617.86	2.59
7	合计	3,098,076,957.50	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

无。

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

无。

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	25,851,376.40	1.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,964,000.00	0.94
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,227,847,700.00	104.92
5	企业短期融资券	327,842,000.00	15.44
6	中期票据	316,805,000.00	14.92
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,918,310,076.40	137.44

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

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	1182218	11伊泰MTN1	1,200,000	125,544,000.00	5.91
2	1280343	12沪闵行债	1,200,000	124,740,000.00	5.87
3	1380140	13漳州开发债	1,100,000	112,398,000.00	5.29
4	1380141	13龙岗区投债	1,000,000	100,750,000.00	4.75
5	122567	12小清河	900,000	95,400,000.00	4.49

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

本基金为债券型基金,不参与股指期货交易。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 报告期内,本基金不存在超出基金合同规定备选股票库投资的情况。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,466.41
2	应收证券清算款	11,901,769.58
3	应收股利	-
4	应收利息	68,125,381.87
5	应收申购款	-
6	其他应收款	120,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	80,161,617.86

5.9.4 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可转换债券。

5.9.5 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	浦银安盛幸福回报债券A类	浦银安盛幸福回报债券B类
本报告期期初基金份额总额	1,617,733,471.53	397,686,904.99
本报告期基金总申购份额	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,617,733,471.53	397,686,904.99

§7 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人总经理郁蓓华女士经2013年第二次股东会会议审议批准,自2013年3月起出任公司第二届董事会董事。基金管理人于2季度就上述事项完成向监管机关的报备。

另外,朱敏奕女士自2013年3月起出任公司职工监事。

§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幸福回报定期开放式债券型证券投资基金设立的文件
2、 浦银安盛幸福回报定期开放式债券型证券投资基金基金合同
3、 浦银安盛幸福回报定期开放式债券型证券投资基金招募说明书
4、 浦银安盛幸福回报定期开放式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
二〇一三年七月十七日

浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

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:二〇一三年七月十七日

§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2013年7月16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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛新兴产业混合	
基金主代码	519120	
交易代码	519120	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年3月25日	
报告期末基金份额总额	318,487,044.84份	
投资目标	通过资产的积极灵活配置,并通过重点关注国家战略新兴产业发展过程中带来的投资机会,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	1、资产配置策略: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。2、股票投资策略:主要采用主题投资策略,通过对战略性新兴产业的及国家政策的持续跟踪研究,结合对战略性新兴产业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,对属于战略性新兴产业投资主题范畴的上市公司进行重点投资。3、通过研判债券市场风险收益特征的国际化趋势和国内宏观经济景气周期引发的债券市场收益率的变化趋势,采取自上而下的策略构造组合。	
业绩比较基准	55%×中证新兴产业指数+45%×中信标普全债指数	
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	

§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4月1日-2013年6月30日)	报告期(2013年3月25日-2013年03月31日)
1.本期已实现收益	33,949,337.05	207,989.20
2.本期利润	37,966,450.53	-18,151.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.0492	0.0000
4.期末基金资产净值	319,554,858.77	1,291,072,523.17
5.期末基金份额净值	1.0030	1.0000

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

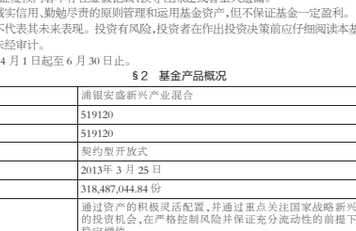
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.30%	1.60%	-1.40%	0.92%	1.70%	0.68%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年3月25日至2013年6月30日)



注:1、本基金合同生效日为2013年3月25日,至本报告期末,本基金合同生效未满一年。

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约定。至本报告期末本基金投资组合比例符合上述规定。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴勇	本基金基金经理,兼本公司权益投资部总监,兼浦银安盛红利精选股票基金基金经理以及浦银安盛精致生活混合型基金基金经理	2013-3-25	-	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,CIPA,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,担任浦银安盛红利精选股票基金基金经理助理。2010年4月起,担任浦银安盛红利精选股票基金基金经理。2011年5月起,兼任浦银安盛精致生活灵活配置混合型基金基金经理之职。2012年11月起,担任本公司权益投资部总监。自2013年3月25日起担任本基金基金经理。

注:1、吴勇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

二季度市场呈现两极分化的格局,传统周期性板块如金融、煤炭、钢铁、有色、水泥等板块大幅下跌,而传媒、TMT、医药等代表新兴产业与经济结构转型相关的板块则大幅上涨。上述市场表现反映了国内实体经济的状况和中央强调经济结构转型的决心。从宏观经济角度来看,传统的实体经济过剩产能的状况仍然十分严重,去产能是个艰巨、长期的任务,因此从中长期来看,传统板块缺乏基本面支持。而以传媒、医药、电子消费为代表的板块在经济结构转型的背景下具有比较好的发展前景和投资机会。二季度,战略新兴产业基金的仓位高于基准,保持了装饰园林、传媒、电子、信息服务等板块的超配

4.4.2 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0.30%,基准收益率为-1.40%。

§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	303,310,205.90	93.29
	其中:股票	303,310,205.90	93.29
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	19,542,646.43	6.01
6	其他各项资产	2,272,466.49	0.70
7	合计	325,125,318.82	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,874,562.10	1.21
B	采矿业	-	-
C	制造业	146,702,602.13	45.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	24,970,691.31	7.81
F	批发和零售业	7,875,956.09	2.46
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	64,793,289.83	20.28
J	金融业	-	-
K	房地产业	6,976,814.44	2.18
L	租赁和商务服务业	10,828,974.84	3.39
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,930,400.00	0.92
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	34,356,915.16	10.75
S	综合	-	-
	合计	303,310,205.90	94.92

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	002570	贝因美	555,842	15,535,783.90	4.86
2	600880	博瑞传播	691,106	12,184,198.78	3.81
3	300071	华谊嘉信	677,658	10,828,974.84	3.39
4	002310	东方园林	255,657	9,789,106.53	3.06
5	002055	得润电子	927,359	9,505,429.75	2.97
6	300168	万达信息	340,454	9,188,853.46	2.88
7	300336	新文化	229,366	8,892,519.82	2.78
8	300155	安居宝	639,901	8,881,825.88	2.78
9	300074	华平股份	477,301	8,639,148.10	2.70
10	600498	烽火通信	489,900	8,073,552.00	2.53

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金不参与股指期货交易。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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内受到公开谴责、处罚的情况。

5.9.2 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。

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	202,235.86
2	应收证券清算款	1,834,065.54
3	应收股利	-
4	应收利息	8,520.18
5	应收申购款	227,644.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,272,466.49

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日基金份额总额	1,291,090,674.37
基金合同生效日起至本报告期期末基金总申购份额	22,516,889.11
减:基金合同生效日起至本报告期期末基金总赎回份额	995,120,518.64
基金合同生效日起至本报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	318,487,044.84

§7 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人总经理郁蓓华女士经2013年第二次股东会会议审议批准,自2013年3月起出任公司第二届董事会董事。基金管理人于2季度就上述事项完成向监管机关的报备。

另外,朱敏奕女士自2013年3月起出任公司职工监事。

§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战略新兴产业混合型证券投资基金设立的文件
2、 浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金基金合同
3、 浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金招募说明书
4、 浦银安盛战略新兴产业混合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
二〇一三年七月十七日

浦银安盛优化收益债券型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

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:二〇一三年七月十七日

§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2013年7月16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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛优化收益债券	
基金主代码	519111	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年12月30日	
报告期末基金份额总额	332,190,710.53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,通过信用分析为基础进行自下而上的精选个券,在严格控制投资风险的基础上,主要对固定收益市场各种资产定价不合理产生的投资机会进行充分挖掘,力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金在宏观经济和债券市场自上而下和自下而上分析的基础上,把握市场利率的趋势性变化与不同债券的价值差异,通过久期配置、收益率曲线策略等方法,实施积极的债券投资策略。同时,在比较债券类资产与权益类资产投资价值的基础上,通过大类资产配置的调整以获得超越业绩比较基准的投资收益。	
业绩比较基准	中信标普全债指数	
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较低收益、较低风险品种。一般情形下,其风险和收益低于股票型基金、混合型基金,高于货币型基金。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	
下属两级基金的基金简称	浦银安盛优化收益债券A	浦银安盛优化收益债券C
下属两级基金的交易代码	519111	519112
报告期末下属两级基金的份额总额	197,511,321.36份	134,679,389.17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4月1日-2013年6月30日)	
	浦银安盛优化收益债券A	浦银安盛优化收益债券C
1.本期已实现收益	-862,265.66	-1,324,405.39
2.本期利润	-8,951,717.64	-8,812,100.08
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0499	-0.0740
4.期末基金资产净值	236,472,614.97	158,826,308.39
5.期末基金份额净值	1.197	1.179

注:1、所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

1、浦银安盛优化收益债券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	-2.76%	0.58%	0.97%	0.05%	-3.73%	0.53%

注:本基金于2009年9月22日开始分为A、C两类。

2、浦银安盛优化收益债券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	-2.88%	0.57%	0.97%	0.05%	-3.85%	0.52%

注:本基金于2009年9月22日开始分为A、C两类。

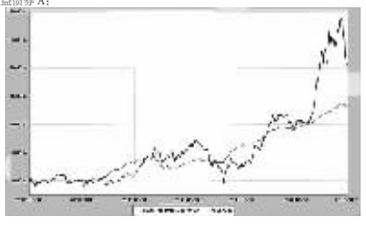
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛优化收益债券型证券投资基金

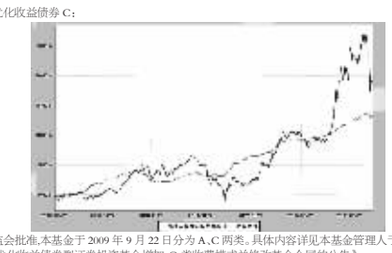
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2008年12月30日至2013年6月30日)

1. 浦银安盛优化收益债券A:



2. 浦银安盛优化收益债券C:



注:经中国证监会批准,本基金于2009年9月22日分为A、C两类。具体内容详见本基金管理人于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》。

§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		
蒋建伟	本基金基金经理兼浦银安盛价值成长股票基金基金经理	2012-6-15	-	12	蒋建伟先生,上海财经大学学士。2001年至2007年在上海东新国际投资管理有限公司担任研究员、投资经理助理。2007年加盟浦银安盛基金管理有限公司先后担任行业研究员,浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金及浦银安盛红利精选股票基金基金经理助理。2010年7月起,担任浦银安盛价值成长股票型证券投资基金基金经理。2012年6月起,兼任本基金基金经理。

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 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,