浦银安盛价值成长股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:二〇一三年十月二十五日

§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10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛价值成长股票
基金主代码	519110
交易代码	519110
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年4月16日
报告期末基金份额总额	629,546,602.58份
投资目标	以追求长期资本增值为目的,通过投资于被市场低估的具有价值属性或可预期的具有持续成长属性的股票,在充分控制风险的前提下,分享中国经济快速增长的成果,进而实现基金资产的长期稳定增值。
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,在投资策略上充分体现"价值"和"成长"的主导思想。在基本面分析的基础上,结合深入的实地调研和估值研究,对于符合本基金理念的标的股票进行精选投资。 "价值"是指甄别公司的核心价值,通过自下而上的研究,以基本面研究为核心,力求卓有远见地挖掘出被市场忽视的价值低估型公司。价值因素主要表现在相对市场股价比较高的自由现金流、比较高的每股收益和净资产。 "成长"主要表现在可持续性、可预见性的增长。寻找成长型公司重点在于对公司成长性的客观评价和比较上,不仅仅需要关注成长的数量,同时还要关注成长的质量,希望上市公司的成长能给上市公司股东带来实际收益的增长,而非简单粗放的规模增长。此外我们还要关注上市公司成长的可持续性和可预见性。
业绩比较基准	沪深300指数×75%+中信标普国债指数×25%。
风险收益特征	本基金为主动操作的股票型证券投资基金,坚持长期和基于基本面研究的投资理念,属于证券投资基金中的高收益、高风险品种。一般情形下,其风险和收益均高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。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 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7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	18,615,860.55
2.本期利润	99,282,819.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.1511
4.期末基金资产净值	603,016,777.02
5.期末基金份额净值	0.958

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

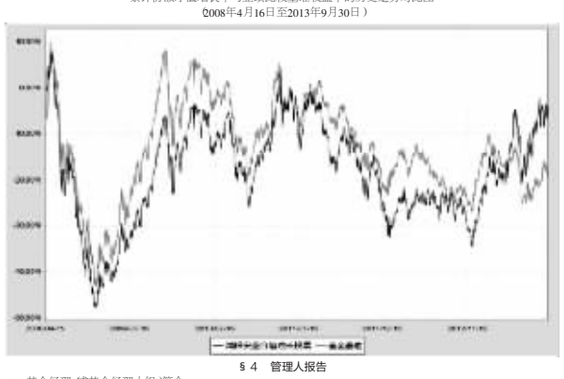
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	18.42%	1.70%	7.27%	1.07%	11.15%	0.63%

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

浦银安盛价值成长股票型证券投资基金

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4月16日至2013年9月30日)



§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	2010-7-21	-	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,担任本基金基金经理。2012年6月至2013年9月兼任浦银安盛优化收益债券基金基金经理。

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 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

3季度在稳增长政策的作用下,经济有所回升,环比二季度提高0.2个百分点左右;8月份工业增加值达到10.4%,9月份预计将稳定在9.8%以上,均处于去年以来的较高水平,基建投资继续高位运行,同时出口边际得到改善,经济整体呈现弱改善格局,但是随着需求的减弱、企业库存回补接近尾声。流动性方面,央行在6月钱荒之后维持略紧的平衡局面,资金价格中枢相对于之前有明显提升,提高了整体债市融资成本,外汇占款局部有所改善。债市在8月份受央行锁长放短政策影响较大,利率债一级市场供给连续带动整体债市估值上升,债券价格下跌幅度较大,仅有短期品种具相对防御性。

本基金3季度在一级市场相对高位积极配置,净值小幅增长。

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0.80%,C类净值收益率0.70%,同期业绩比较基准收益率为0.72%,本基金的业绩比较基准为三个月定期存款基准利率(税后)×1.1。

§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	571,972,587.92	93.91
	其中:股票	571,972,587.92	93.91
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	36,613,261.28	6.01
6	其他各项资产	467,415.65	0.08
7	合计	609,053,264.85	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	11,654,885.31	1.93
B	采矿业	194,700.59	0.03
C	制造业	302,586,941.26	50.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	35,403,437.93	5.87
F	批发和零售业	16,421,013.55	2.72
G	交通运输、仓储和邮政业	33,399.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	164,737,746.30	27.32
J	金融业	-	-
K	房地产业	17,155,032.42	2.84
L	租赁和商务服务业	23,293,124.00	3.86
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	492,307.56	0.08
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	571,972,587.92	94.85

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	002310	东方园林	1,108,718	34,669,611.86	5.75
2	300226	上海钢联	665,167	28,203,080.80	4.68
3	002368	太极股份	593,004	24,170,843.04	4.01
4	600640	号百控股	1,030,000	23,288,300.00	3.86
5	002309	中利科技	1,309,968	20,239,005.60	3.36
6	002439	启明星辰	730,163	19,999,164.57	3.32
7	300074	华平股份	678,020	19,574,437.40	3.25
8	002566	益盛药业	829,174	19,502,172.48	3.23
9	600703	三安光电	929,839	18,866,433.31	3.13
10	000938	紫光股份	699,803	18,810,704.64	3.12

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名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

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

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 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	386,821.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,697.51
5	应收申购款	52,269.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	20,627.18
8	其他	-
9	合计	467,415.65

5.10.4 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。

5.10.5 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

本报告期期初基金份额总额	671,755,352.02
本报告期基金总申购份额	8,940,559.54
减:本报告期基金总赎回份额	51,149,308.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	629,546,602.58

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本公司管理基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、 中国证监会批准浦银安盛价值成长股票型证券投资基金设立的文件

2、 浦银安盛价值成长股票型证券投资基金基金合同

3、 浦银安盛价值成长股票型证券投资基金招募说明书

4、 浦银安盛价值成长股票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
二〇一三年十月二十五日

浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:上海银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十五日

§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2013年10月23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7月1日起至9月30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	2,095,006,379.93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	本基金的业绩比较基准为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,其预期风险与预期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	
下属两级基金的基金简称	浦银安盛季季添利债券A	浦银安盛季季添利债券C
下属两级基金的交易代码	519123	519124
报告期末下属两级基金的份额总额	1,890,311,327.99份	204,695,051.94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7月1日-2013年9月30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	19,197,360.72	2,082,491.21
2.本期利润	17,013,037.42	1,867,051.93
3.加权平均基金份额本期利润	0.0079	0.0070
4.期末基金资产净值	1,908,645,000.65	206,467,722.63
5.期末基金份额净值	1.010	1.009

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	0.80%	0.07%	0.72%	0.01%	0.08%	0.06%

2、浦银安盛季季添利债券C:

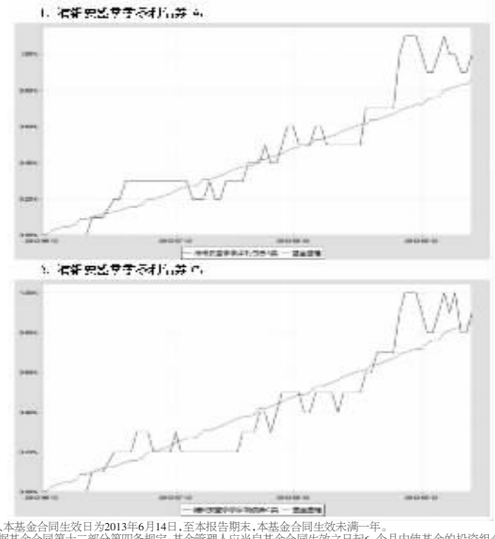
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.70%	0.07%	0.72%	0.01%	-0.02%	0.06%

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

浦银安盛季季添利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

(2013年6月14日至2013年9月30日)



注:1、本基金合同生效日为2013年6月14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。本基金建仓期为2013年6月14日至2013年12月13日,截止本报告期末,本基金尚处于建仓期。

§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
薛铮	本公司固定收益投资部总监,本基金基金经理,浦银安盛季福回报定期开放债券基金基金经理,浦银安盛增利分级债券基金基金经理,浦银安盛6个月定期开放债券基金基金经理	2013-6-14	-	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基金基金经理。2011年12月起担任浦银安盛增利分级债券基金基金经理。2012年9月起兼任浦银安盛季福回报定期开放债券基金基金经理。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个月定期开放债券基金基金经理。2013年6月14日起,兼任本基金基金经理。

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

经济数据有所回落,通胀仍在预期之内。宏观经济经历淡季不淡后,整体动能有所减弱。官方和汇丰PMI仅微升,回升幅度远弱于历年均值。9月以来大部分中观数据特别是电力、钢铁、挖掘机等也出现"悲潮"现象。PPI同比将回升至-1.4%附近,CPI将反弹至接近3%的水平,这正在市场预期之内,年内通胀走势对债市影响较小。

公开市场操作稳定货币市场资金价格。9月份值三季度末,央行延续8月份投放额度,再度小幅净投放160亿,由于银行等商业机构提前较为充分的准备,使得资金价格波动幅度较小、稳定的逆回购频率和月末加大力度近1000亿的逆回购投放,显现了央行此前疏输给市场的稳定市场的政策预期。7天回购平均水平在3.5%-4%左右,还略低于8月份平均水平,相较于6月份平均6%以上回购利率处于相对低位。

外围流动性预期改善。美联储延迟了QE退出,市场对流动性的悲观预期并未发生。国内平稳的政治经济氛围延续。决策层言论上多次强调"稳结构"的重要性,但对于年度经济增长目标的完成也同样重视。

本基金三季度主要采用波段操作,并择时加仓的投资策略。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期A类净值收益率为1.50%,C类净值收益率为1.44%,同期业绩比较基准收益率为0.38% ,本基金的业绩比较基准为中信标普全债指数。

§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	533,802,302.17	96.27
	其中:债券	533,802,302.17	96.27
	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	12,403,566.66	2.24
6	其他各项资产	8,307,502.45	1.50
7	合计	554,513,371.28	100.00

5.2 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。

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

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	127,868,289.60	38.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,866,000.00	5.98
	其中:政策性金融债	19,866,000.00	5.98
4	企业债券	181,604,404.19	54.64
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	15,005,500.00	4.52
7	可转债	189,458,108.38	57.01
8	其他	-	-
9	合计	533,802,302.17	160.62

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	124321	13岳城投	1,800,000	180,000,000.00	8.51
2	110023	民生转债	1,046,670	110,748,152.70	5.24
3	124318	13滨城投	1,100,000	110,000,000.00	5.20
4	1280289	12锡建发债	1,000,000	100,660,000.00	4.76
5	1380240	13商洛债01	1,000,000	100,500,000.00	4.75

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

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	127,866.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	34,234,847.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,362,714.50

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	110023	民生转债	110,748,152.70	5.24
2	113001	中行转债	35,410,620.00	1.67
3	113002	工行转债	22,276,830.00	1.05
4	110015	石化转债	21,437,910.00	1.01
5	110022	同仁转债	21,116,700.00	1.00
6	110020	南山转债	20,280,900.00	0.96
7	127001	海直转债	11,138,979.90	0.53
8	110018	国电转债	10,028,183.20	0.47
9	110007	博汇转债	414,280.00	0.02

5.10.5 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	浦银安盛季季添利债券A	浦银安盛季季添利债券C
本报告期期初基金份额总额	2,190,552,433.42	274,160,953.49
本报告期基金总申购份额	263,039.25	122,869.44
减:本报告期基金总赎回份额	300,504,144.68	69,588,770.99
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,890,311,327.99	204,695,051.94

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本公司管理基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、 中国证监会批准浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金设立的文件

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
二〇一三年十月二十五日

浦银安盛优化收益债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:二〇一三年十月二十五日

§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10月23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7月1日起至9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	275,215,991.74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	
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	169,443,786.40份	105,772,205.34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7月1日-2013年9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	467,798.26	126,695.94
2.本期利润	3,315,932.98	1,974,122.18
3.加权平均基金份额本期利润	0.0179	0.0159
4.期末基金资产净值	205,883,030.88	126,457,726.22
5.期末基金份额净值	1.215	1.196

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	1.50%	0.32%	0.38%	0.04%	1.12%	0.28%

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	1.44%	0.31%	0.38%	0.04%	1.06%	0.27%

注:本基金于2009年9月22日开始分为A、C两类。

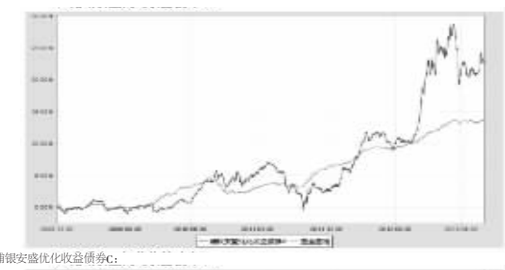
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛优化收益债券型证券投资基金

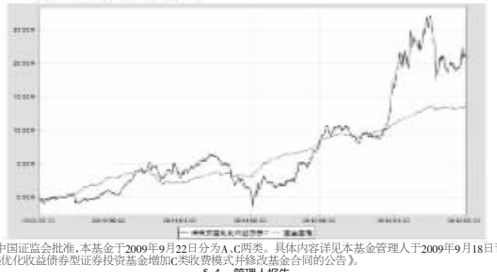
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2008年12月30日至2013年9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		
吕栋	本基金基金经理	2013-9-26	-	7	吕栋,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