浦银安盛6个月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:招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。

基金托管人招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6个月定期债券	
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	5,441,572,900.08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	本基金利用定期开放、定期封闭的运作特性,秉承主动投资管理理念,在有效流动性管理和控制风险的前提下,优化组合、稳健投资,实现基金资产的长期稳健增值。	
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	
下属两级基金的基金简称	浦银安盛6个月定期债券A	浦银安盛6个月定期债券C
下属两级基金的交易代码	519121	519122
报告期末下属两级基金的份额总额	4,810,323,453.85份	631,249,446.23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	32,139,541.64	3,821,531.00
2.本期利润	-4,118,492.03	-934,008.41
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0009	-0.0015
4.期末基金资产净值	4,764,127,297.37	624,600,797.08
5.期末基金份额净值	0.990	0.989

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	-0.10%	0.09%	0.70%	0.01%	-0.80%	0.08%

2、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	-0.20%	0.10%	0.70%	0.01%	-0.90%	0.09%

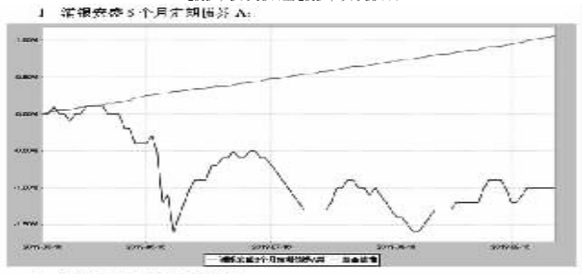
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金

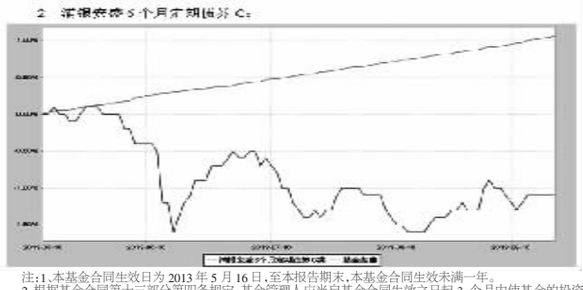
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年5月16日至2013年9月30日)

1、浦银安盛6个月定期债券A:



2、浦银安盛6个月定期债券C:



注:1、本基金合同生效日为2013年5月16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四条规定:基金管理人应当自基金合同生效之日起3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5月16日至2013年8月15日,建仓期结束时本基金投资组合比例符合本基金基金合同约定。

§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经理,浦银安盛幸福回报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经理	2013-5-16	-	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,担任浦银安盛增利分级债券型证券投资基金基金经理。2012年9月起兼任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理。2012年2月至2013年5月兼任浦银安盛增利分级债券型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,兼本基金基金经理。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

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季度面临债市调整以持有为主,择机波段操作,净值小幅下跌。

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-0.1%,C类净值收益率-0.2%,同期业绩比较基准收益率为0.70%,本基金的业绩比较基准为6个月定期存款利率(税后)。

§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	6,888,821,275.24	96.29
	其中:债券	6,888,821,275.24	96.29
	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	136,804,066.52	1.91
6	其他各项资产	128,774,585.17	1.80
7	合计	7,154,399,926.93	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	296,285,526.00	5.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	507,651,000.00	9.42
	其中:政策性金融债	507,651,000.00	9.42
4	企业债券	4,352,537,529.99	80.77
5	企业短期融资券	369,040,000.00	6.85
6	中期票据	693,909,000.00	12.88
7	可转债	669,398,219.25	12.42
8	其他	-	-
9	合计	6,888,821,275.24	127.84

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	113001	中行转债	3,050,000	305,091,500.00	5.66
2	130240	13国开40	2,600,000	257,374,000.00	4.78
3	010107	21国债(7)	1,765,460	182,018,926.00	3.38
4	110015	石化转债	1,800,000	176,202,000.00	3.27
5	130231	13国开31	1,800,000	170,586,000.00	3.17

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

本基金为债券型基金,不参与股指期货交易。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为债券型基金,不参与股指期货交易。

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

本基金为债券型基金,不参与国债期货交易。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金为债券型基金,不参与国债期货交易。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金为债券型基金,不参与国债期货交易。

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	506,109.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	128,248,475.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	20,000.22
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	128,774,585.17

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	113001	中行转债	305,091,500.00	5.66
2	110015	石化转债	176,202,000.00	3.27
3	110020	南山转债	81,729,000.00	1.52
4	110023	民生转债	42,324,000.00	0.79
5	110016	川投转债	16,320,051.80	0.30
6	127001	海直转债	15,299,180.00	0.28
7	110018	国电转债	13,790,384.80	0.26
8	113002	工行转债	8,866,400.00	0.16
9	110019	恒丰转债	5,805,788.80	0.11
10	110011	歌华转债	2,014,200.00	0.04
11	125089	深机转债	1,060,258.85	0.02
12	110022	同仁转债	895,455.00	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6个月定期债券A	浦银安盛6个月定期债券C
本报告期期初基金份额总额	4,810,323,453.85	631,249,446.23
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	4,810,323,453.85	631,249,446.23

§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6个月定期开放债券型证券投资基金设立的文件

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
二〇一三年十月二十五日

浦银安盛货币市场证券投资基金

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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信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	浦银安盛货币	
基金主代码	519509	
基金运作方式	开放式契约型	
基金合同生效日	2011年3月9日	
报告期末基金份额总额	927,085,033.47份	
投资目标	力求在保持基金资产安全性和良好流动性的基础上,获得超越业绩比较基准的稳定收益。	
投资策略	根据对短期利率变动的预测,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略,利用基本分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保证流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。	
业绩比较基准	银行活期存款利率(税后)	
风险收益特征	属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B
下属两级基金的交易代码	519509	519510
报告期末下属两级基金的份额总额	252,618,554.57份	674,466,478.9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)	
	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B
1.本期已实现收益	2,321,105.46	6,981,909.85
2.本期利润	2,321,105.46	6,981,909.85
3.期末基金资产净值	252,618,554.57	674,466,478.90

注:1、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。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金收益分配按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.浦银安盛货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.1191%	0.0023%	0.0883%	0.0000%	1.0308%	0.0023%

注:本基金收益分配按月结转份额。

2.浦银安盛货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.1796%	0.0023%	0.0883%	0.0000%	1.0913%	0.0023%

注:本基金收益分配按月结转份额。

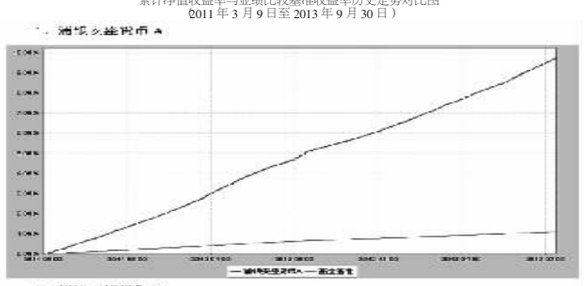
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛货币市场证券投资基金

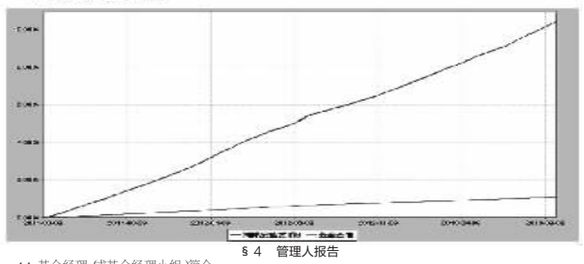
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011年3月9日至2013年9月30日)

1、浦银安盛货币A



2、浦银安盛货币B



§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		
蒋文玲	本基金基金经理	2012-11-30	-	7	蒋文玲,上海财经大学数量经济学硕士。2006年5月至2009年9月,在汇添富基金管理有限公司任债券交易员。2009年10月至2012年10月,在汇添富基金管理有限公司从事债券风控研究员工作并兼任交易员。2012年10月加盟浦银安盛基金管理有限公司固定收益投资部工作。2012年11月30日起,担任本基金基经理。

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,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季度面临开放实施稳健操作策略,以持有为主,择机降低仓位,净值小幅下跌。

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-0.19%,B类净值收益率-0.29%,同期业绩比较基准收益率为0.76%,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	1,322,900,646.01	90.41
	其中:债券	1,322,900,646.01	90.41
	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	95,332,171.16	6.51
6	其他各项资产	45,048,407.07	3.08
7	合计	1,463,281,224.24	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	22,540,984.40	4.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,210,888,661.61	216.42
5	企业短期融资券	9,947,000.00	1.78
6	中期票据	79,524,000.00	14.21
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,322,900,646.01	236.44

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	122536	12巡国控	800,000	82,680,000.00	14.78
2	122204	12双良节	800,000	80,800,000.00	14.44
3	122503	12井龙城	760,000	78,204,000.00	13.98
4	124151	13长兴岛	600,000	60,222,000.00	10.76
5	1380168	13邯郸交投债	600,000	58,896,000.00	10.53

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

本基金为债券型基金,不参与股指期货交易。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为债券型基金,不参与股指期货交易。

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	20,117.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	38,364,878.34
5	应收申购款	6,583,411.58
6	其他应收款	80,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,048,407.07

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

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B
本报告期期初基金份额总额	124,860,033.12	362,817,301.49
本报告期基金总申购份额	584,163,674.40	1,728,846,203.46
减:本报告期基金总赎回份额	456,405,152.95	1,417,197,026.05
本报告期期末基金份额总额	252,618,554.57	674,466,478.90

§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货币市场证券投资基金设立的文件

2、浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同

3、浦银安盛货币市场证券投资基金招募说明书

4、浦银安盛货币市场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

浦银安盛幸福回报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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	浦银安盛幸福回报定开债券	
基金主代码	519118	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年9月18日	
报告期末基金份额总额	555,279,594.32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	浦银安盛幸福回报定开债券A	浦银安盛幸福回报定开债券B
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	446,660,255.57份	108,619,338.75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)	
	浦银安盛幸福回报定开债券A	浦银安盛幸福回报定开债券B
1.本期已实现收益	19,071,233.33	4,290,439.14
2.本期利润	-1,819,747.79	-832,438.55
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0012	-0.0022
4.期末基金资产净值	450,146,975.18	109,352,357.92
5.期末基金份额净值	1.008	1.007

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、浦银安盛幸福回报定开债券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	-0.19%	0.11%	0.76%	0.01%	-0.95%	0.10%

2、浦银安盛幸福回报定开债券B:

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	-0.29%	0.10%	0.76%	0.01%	-1.05%	0.09%

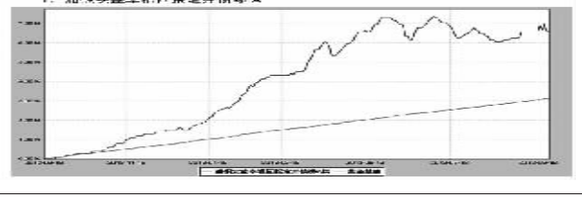
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金

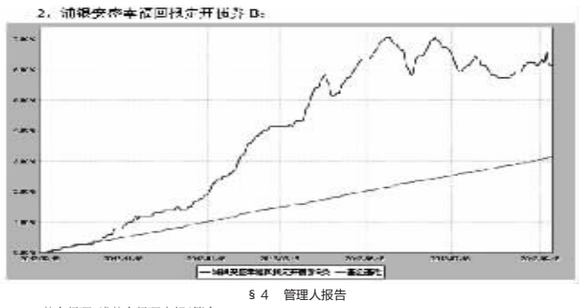
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年9月18日至2013年9月30日)

1、浦银安盛幸福回报定开债券A



2、浦银安盛幸福回报定开债券B



§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以及浦银安盛季季添利定期开放债券基金基金经理	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,兼本基金基金经理。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