

## 浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金

### 2014 第四季度 报告

2014年12月31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:2015年01月22日**

**1.1 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2015年1月20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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者在投资前应认真阅读本基金的风险揭示书。  
 本报告所载数据截至2014年12月31日止。

**1.2 基金产品概况**

基金名称	浦银安盛盛世精选混合
场内简称	-
基金代码	519127
交易场所	上海证券交易所
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年11月26日
报告期末基金份额总额	209,468,524.01份
投资目标	本基金投资于具有良好成长性的股票、债券等资产,通过积极主动的股票投资,力争实现超越业绩比较基准的投资收益,在严格控制风险和保持资产流动性的前提下,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在管理中将主要采用自上而下和自下而上相结合的策略,通过宏观经济形势和周期分析,并通过对中国经济和全球宏观经济及行业及上市公司基本面和估值水平的分析,自上而下地确定和调整资产配置和持仓,自下而上地精选个股。
业绩比较基准	55%*沪深300指数+45%*中债综合指数
风险收益特征	本基金为混合型基金,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货币型基金和债券型基金,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

**3.1 主要财务指标**

主要财务指标	报告期(2014年10月1日至2014年12月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	11,237,938.28	
2.本期利润	10,567,245.24	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0279	
4.期末基金份额净值	270.497,410.67	
5.期末基金资产净值	1,842	

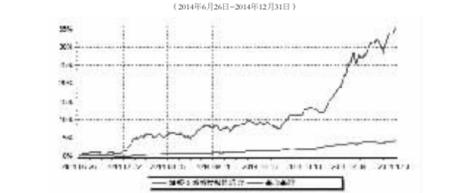
注:1、本基金基金利润不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平低于所列数字。  
 2、本基金本期收益按基金本期利息收入、股息收入、公允价值变动收益、投资收益和其他收入扣除相关费用后的余额。  
 3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。  
 3.2 基金业绩指标

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	2.86%	0.12%	2.50%	0.95%	-2.14%	-0.8%

3.2.2 本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

浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2014年10月26日至2014年12月31日)



注:1、本基金基金合同生效日为2014年10月26日,基金合同生效日至报告期期末,本基金业绩未达预期。  
 2、本基金合同第十二部分风险提示,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规定,本基金投资标的为2014年4月23日至2014年12月28日,建仓期符合本基金投资组合比例符合本基金基金合同约定。

**4.1 基金经理(或基金经理小组)简介**

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
褚晓群	公司旗下浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2014年6月26日	-	10	褚晓群先生,毕业于复旦大学经济学硕士,2001年7月至2004年7月担任在上证所中,担任交易部,政策研究员,2008年5月至2010年9月担任浦银安盛公司研究员,2010年9月至2011年4月担任浦银安盛公司研究员,2011年4月至2014年6月担任浦银安盛公司研究员,2014年6月,担任浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2014年7月,兼任浦银安盛积极成长混合型证券投资基金基金经理。

注:1、褚晓群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 管理人报告期内未发生重大诉讼、仲裁事项

本报告期内,本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,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(公平交易管理制度),建立并健全了有效的公平交易执行体系,保证公平对待下的每一个投资组合。在严格执行上,构建统一的研究平台,为所有投资组合公平的研究提供支持,同时在投资决策上,严格遵守公司的各项投资决策制度和授权制度,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,详细制定了多个投资组合的公平交易执行的执行流程和风控措施,以保证投资决策执行的公平性,一方面是从投资决策上,一方面是从交易执行上,对不公平交易行为(同日、同日、同日)发生的不同组合在同一股票的交易及反向交易价差分析,并进一步统计显著性的检验,以确定交易对相对基金份额净值变化的影响,同时统计了投资组合及其各投资组合的收益率差异分析,另一方面是公司公平交易制度的遵守和执行,本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,报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

**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异常交易行为,未发现中国证监和证券交易所颁布的相关法规文件中规定的异常交易行为,报告期内未发生下列异常交易行为中的交易和异常交易行为:同日反向交易及反向交易价差分析等当日成交或9%的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度,从宏观经济指标来看,整体经济平稳,市场对于经济增速下一个阶段已有充分认识,中央经济工作会议为来年经济走向指引,从宏观政策来看,稳增长政策持续,二三季度经济增速,沪深两市成交量增加,本基金管理人积极把握市场机遇,11月10日沪深两市成交量创历史新高,市场情绪高涨,引导市场利率下行,对于中期利率和通胀预期产生积极影响。

从市场来看,10月10日起,市场成交量增加,以金融、地产、地产等板块为代表的权重股领涨,带动新增资金入场,市场情绪高涨,11月10日,成交量创历史新高,市场情绪高涨,引导市场利率下行,对于中期利率和通胀预期产生积极影响。

我们认为,此轮行情是政策驱动下的反弹,而非经济基本面驱动下的反转,本基金管理人积极把握市场机遇,11月10日,成交量创历史新高,市场情绪高涨,引导市场利率下行,对于中期利率和通胀预期产生积极影响。

报告期内,本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,报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

**4.5 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	27,431,955.72	10.03
2	其中:股票	27,431,955.72	10.03
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	-	-
5	其中:债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	金融衍生品投资	-	-
9	买入返售金融资产	210,000,000.00	76.75
10	银行存款和拆借金融资产	7,716,473.37	2.80
11	其他资产	4,967,170.74	1.84
12	其他	-	-
13	合计	273,115,599.19	10.03

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、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,845,767.87	2.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,090,440.00	1.14
F	批发和零售业	-	-
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	3,795,285.45	1.40
J	金融业	4,851,420.00	1.79
K	房地产业	5,683,690.00	2.21
L	租赁和商务服务业	859,088.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	5,095.00	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,039,500.00	0.38
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公事业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	其他	-	-
T	合计	27,431,955.72	10.14

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	00001	平安银行	116,600	1,846,944.00	0.68
2	000024	招商地产	66,000	1,741,740.00	0.64
3	000090	天富集团	121,000	1,669,800.00	0.62
4	000017	信达地产	188,000	1,520,980.00	0.57
5	000042	金融街	116,600	1,477,670.00	0.55
6	002511	中汇地产	52,000	1,428,640.00	0.53
7	601788	光大证券	46,000	1,375,670.00	0.49
8	000712	华鲁集团	78,000	1,298,200.00	0.46
9	600702	沧州铺业	65,000	1,227,710.00	0.45
10	600711	广信股份	42,500	1,151,122.85	0.43

5.4 报告期末按基金品种分类的股票投资组合

5.4.1 报告期末按基金品种分类的股票投资组合

5.4.2 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债券投资明细

5.4.3 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资产支持证券投资明细

5.4.4 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贵金属投资明细

5.4.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

5.4.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.33 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.35 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.36 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.37 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.38 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.39 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.40 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.41 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.42 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.43 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.44 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.45 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.46 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.47 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.48 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.49 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.50 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.51 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.52 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.53 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.54 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.55 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.56 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.57 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.58 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.59 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.60 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.61 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.62 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.63 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.64 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.65 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.66 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.67 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.68 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.69 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.70 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.71 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.72 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.73 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.74 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.75 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.76 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.77 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.78 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.79 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.80 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.81 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.82 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.83 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.84 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.85 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.86 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.87 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.88 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.89 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.90 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.91 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.92 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.93 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.94 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.95 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.96 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.97 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.98 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.99 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.100 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.101 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.102 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.103 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.104 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.105 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.106 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.107 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.108 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细

5.4.109 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产投资明细