# 浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金

## 2015 第二季度 报告

2015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:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月18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。
基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015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2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 浦银安盛基本面400指数 |
| 场内简称 | - |
| 基金主代码 | 519117 |
| 交易代码 | 519117 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年5月14日 |
| 报告期末基金份额总额 | 44,779,636.26份 |
| 投资目标 | 本基金采取指数化投资策略,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,追求对标的指数的有效跟踪。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日平均跟踪误差的绝对值不超过0.35%,且年化跟踪误差不超过4%,以实现对业绩比较基准的有效跟踪。 |
| 投资策略 | 本基金采取完全复制方法进行指数化投资,依据中证锐联基本面400指数成份股及其权重配比,合理设置个股投资权重,构建股票组合,使股票组合能有效跟踪中证锐联基本面400指数的表现,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日平均跟踪误差的绝对值不超过0.35%,且年化跟踪误差不超过4%。 |
| 业绩比较基准 | 中证锐联基本面400指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。 |
| 基金管理人 | 浦银安盛基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 |

§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(2015年4月1日-2015年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 18,715,129.65 |
| 2.本期利润 | 6,993,338.45 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1833 |
| 4.期末基金资产净值 | 96,387,568.98 |
| 5.期末基金份额净值 | 2.152 |

注:1、上述基金业绩指标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。

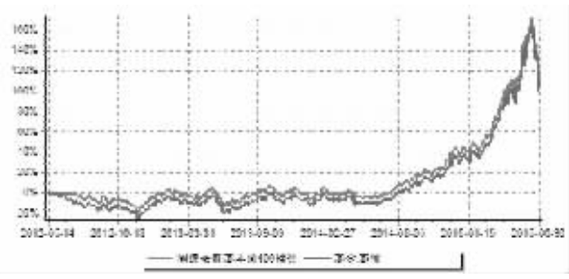
3.2 基金净值表现

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 | 19.49% | 2.77% | 22.13% | 2.80% | -2.64% | -0.03% |

3.2.2 自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

浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年5月14日-2015年6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 | | |
| 陈士俊 | 本公司基础投资部总监,公司旗下监事,公司旗下浦银安盛沪深300指数基金、浦银安盛中证锐联基本面400指数基金基金经理 | 2012年5月14日 | - | 14 | 陈士俊先生,清华大学博士学历。2001年至2003年间曾在国泰君安证券有限公司研究所担任金融工程研究员2年;2003年至2007年10月在银河基金管理有限公司工作4年,先后担任金融工程部研究员、研究部主管。2007年10月加入浦银安盛基金管理有限公司,任本公司金融工程部总监,并于2010年12月起兼任浦银安盛沪深300指数基金基金经理。2012年3月兼任本公司职工监事。2012年5月起,兼任浦银安盛中证锐联基本面400指数基金基金经理。 |

注:1、陈士俊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规定,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

本基金管理人根据《公平交易管理规定》,建立并健全了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日和10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或交轧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运作分析

2015年2季度股票市场总体呈现资金推动性的普涨状态,一方面国内货币流动性宽裕,央行多次降息降准,银行间回购利率保持在低位,即便是巨额打新资金的冻结也难以大幅提升利率水平;另一方面,券商融资等杠杆工具的余额不断攀升,新进投资者不断增加带来增量资金。实体经济方面,投资增速较为疲弱,而消费增速较为平稳,也符合国家经济结构转型的预期。

基于以上的判断,本基金在2季度前期保持了信息服务、通信等行业的超配,对传统周期性行业保持了低配。在二季度中后期,鉴于市场整体估值较高,因此阶段性参与了新股的中签。

4.5 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34.54%,基准收益率为10.40%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

1、本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形;
2、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§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 | 90,887,023.91 | 86.52 |
| | 其中:股票 | 90,887,023.91 | 86.52 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 9,319,563.63 | 8.87 |
| 8 | 其他资产 | 4,845,155.59 | 4.61 |
| 9 | 合计 | 105,051,743.13 | 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 | 343,599.92 | 0.36 |
| B | 采矿业 | 3,221,560.69 | 3.34 |
| C | 制造业 | 49,681,820.64 | 51.54 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,929,210.48 | 4.08 |
| E | 建筑业 | 2,718,029.67 | 2.82 |
| F | 批发和零售业 | 8,245,419.49 | 8.55 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 5,946,252.18 | 6.17 |
| H | 住宿和餐饮业 | 117,024.60 | 0.12 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,795,555.28 | 2.90 |
| J | 金融业 | 2,669,468.90 | 2.77 |
| K | 房地产业 | 6,602,857.72 | 6.85 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,254,433.80 | 2.34 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 414,312.75 | 0.43 |
| 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 | 1,214,319.96 | 1.26 |
| S | 综合 | 733,157.83 | 0.76 |
| | 合计 | 90,887,023.91 | 94.29 |

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 | 000016 | 深康佳A | 27,360 | 825,451.20 | 0.86 |
| 2 | 000422 | 湖北宜化 | 84,300 | 778,089.00 | 0.81 |
| 3 | 000012 | 南 玻A | 43,572 | 581,250.48 | 0.60 |
| 4 | 000488 | 晨鸣纸业 | 62,327 | 559,073.19 | 0.58 |
| 5 | 601377 | 兴业证券 | 39,626 | 542,479.94 | 0.56 |
| 6 | 000423 | 东阿阿胶 | 9,830 | 535,735.00 | 0.56 |
| 7 | 000528 | 柳 工 | 44,500 | 525,990.00 | 0.55 |
| 8 | 600881 | 亚泰集团 | 41,287 | 524,757.77 | 0.54 |
| 9 | 600655 | 豫园商城 | 31,107 | 499,267.35 | 0.52 |
| 10 | 000690 | 宝新能源 | 39,004 | 493,400.60 | 0.51 |

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序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序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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 9,319,563.63 |
| 2 | 应收证券清算款 | 9,319,563.63 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,537.10 |
| 5 | 应收申购款 | 362,577.69 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,845,155.59 |

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000016 | 深康佳A | 825,451.20 | 0.86 | 停牌或网下申购锁定期 |

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 34,109,046.31 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 46,786,238.86 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 36,115,648.91 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 44,779,636.26 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2015年4月22日发布《浦银安盛基金管理有限公司关于股东变更的公告》,公告披露:根据上海市政府的要求,经上海国盛(集团)有限公司批准,本基金管理人原股东上海盛融投资有限公司(以下简称"上海盛融")由其母公司上海国盛集团资产有限公司(以下简称"上海国盛")吸收合并,上海盛融持有的本基金管理人10%的股权由上海国盛承继,本基金管理人股东因此由上海盛融变更为上海国盛。相关工商变更登记手续已办理完毕并已报中国证监会备案。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、 中国证监会批准浦银安盛中证锐联基本面400指数型证券投资基金设立的文件
2、 浦银安盛中证锐联基本面400指数型证券投资基金合同
3、 浦银安盛中证锐联基本面400指数型证券投资基金招募说明书
4、 浦银安盛中证锐联基本面400指数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

9.2 存放地点
上海市浦海中路381号中环广场38楼基金管理人办公场所。

9.3 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
二〇一五年七月十八日

# 浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金

## 2015 第二季度 报告

2015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:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年07月18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2015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2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 浦银安盛月月盈定期支付债券 | |
| 场内简称 | - | |
| 基金主代码 | 519128 | |
| 基金运作方式 | 契约型定期开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2014年12月05日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 294,318,520.20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,寻找各类资产的最在良好投资机会,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 | 中债综合全价指数 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 浦银安盛月月盈定期支付债券A | 浦银安盛月月盈定期支付债券C |
| 下属分级基金的交易代码 | 519128 | 519129 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 276,359,946.66份 | 17,958,573.54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(2015年04月01日-2015年06月30日) | |
|---|---|---|
| | 浦银安盛月月盈定期支付债券A | 浦银安盛月月盈定期支付债券C |
| 1.本期已实现收益 | 2,290,731.80 | 132,242.36 |
| 2.本期利润 | 4,855,477.52 | 298,731.48 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0174 | 0.0165 |
| 4.期末基金资产净值 | 282,266,882.26 | 18,306,056.51 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.021 | 1.019 |

注:1、上述基金业绩指标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

3.1 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

浦银安盛月月盈定期支付债券A

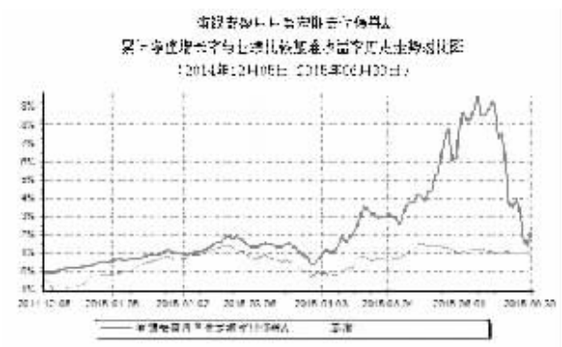
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.69% | 0.65% | 1.35% | 0.10% | 0.34% | 0.55% |

浦银安盛月月盈定期支付债券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 | 1.60% | 0.66% | 1.35% | 0.10% | 0.25% | 0.56% |

3.2.2 自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

浦银安盛月月盈定期支付债券A
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12月05日-2015年06月30日)



浦银安盛月月盈定期支付债券C
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12月05日-2015年06月30日)

注:1、本基金基金合同生效日为2014年12月5日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。
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。本基金建仓期为2014年12月5日至2015年6月4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,公司旗下浦银安盛优化收益债券基金、浦银安盛幸福回报债券基金、浦银安盛稳健增利债券基金、浦银安盛6个月债券基金、浦银安盛季季添利债券基金以及浦银安盛月月盈债券基金基金经理 | 2014年12月05日 | - | 9 | 薛铮先生,上海财经大学数量经济学硕士。2006年3月至2009年6月,先后就职于红顶金融研究中心、上海证券有限公司从事固定收益研究工作。2009年7月进入浦银安盛基金管理公司,历任固定收益研究员、固定收益基金经理助理、饰作基金基金经理等职务。2011年12月起担任浦银安盛稳健增利债券基金 份额转分级债券基金)基金经理。2012年9月起兼任浦银安盛幸福回报债券基金基金经理。2012年11月起,担任本公司固定收益投资部总监。2013年5月起,兼任浦银安盛6个月定期开放债券基金基金经理。2013年6月起,兼任浦银安盛季季添利债券基金基金经理。2014年7月起,兼任浦银安盛优化收益债券基金基金经理。2014年12月起,兼任浦银安盛月月盈债券基金基金经理。 |

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 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规定,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

本基金管理人根据《公平交易管理规定》,建立并健全了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日和10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或交轧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运作分析

2季度债券市场的总体向好,4、5月份收益率下行为主,6月份收益率则窄幅波动。央行货币政策延续了之前的宽松态势,在2季度先后进行了降准和降息操作。但债券市场在经历了2014年全年的牛市后,收益率总体水平较低,因此收益率的涨幅也较为有限。由于经济总体较为疲软,且股市近期下跌幅度较大,对债市的分流也在减弱。二季度内,本基金择机把握债券市场的波段机会,并对部分有价值的个券进行增持。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期A类净值增长率1.69%,C类净值增长率1.60%,同期业绩比较基准收益率为1.35%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

1、本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满一百人的情形;
2、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 27,017,300.28 | 5.89 |
| | 其中:股票 | 27,017,300.28 | 5.89 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 384,558,273.76 | 83.80 |
| | 其中:债券 | 384,558,273.76 | 83.80 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 12,089,016.41 | 2.63 |
| 8 | 其他资产 | 35,210,245.86 | 7.67 |
| 9 | 合计 | 458,874,836.31 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 4,603,321.32 | 1.53 |
| C | 制造业 | 6,629,600.00 | 2.21 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| 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 | 5,844,378.96 | 1.94 |
| J | 金融业 | 9,940,000.00 | 3.31 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| 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 | 27,017,300.28 | 8.99 |

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

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600016 | 民生银行 | 1,000,000 | 9,940,000.00 | 3.31 |
| 2 | 601929 | 吉视传媒 | 386,533 | 5,844,378.96 | 1.94 |
| 3 | 603993 | 洛阳钼业 | 372,437 | 4,603,321.32 | 1.53 |
| 4 | 002408 | 齐翔腾达 | 200,000 | 3,428,000.00 | 1.14 |
| 5 | 002521 | 齐峰新材 | 230,000 | 3,201,600.00 | 1.07 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 10,013,000.00 | 3.33 |
| | 其中:政策性金融债 | 10,013,000.00 | 3.33 |
| 4 | 企业债券 | 321,849,873.76 | 107.08 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 51,301,000.00 | 17.07 |
| 7 | 可转债 | 1,394,400.00 | 0.46 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 384,558,273.76 | 127.94 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 1480411 | 14铁道07 | 200,000 | 21,590,000.00 | 7.18 |
| 2 | 1480140 | 14淄博城运债 | 200,000 | 21,178,000.00 | 7.05 |
| 3 | 1480451 | 14沪南汇债 | 200,000 | 20,884,000.00 | 6.95 |
| 4 | 101455027 | 14万华MTN001 | 200,000 | 20,446,000.00 | 6.80 |
| 5 | 124252 | 13邯交通 | 200,000 | 20,394,000.00 | 6.79 |

5.6 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

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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围尚未包含国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金投资范围尚未包含国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围尚未包含国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中不存在超出基金合同规定的备选股票库的范围的情况。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 71,599.12 |
| 2 | 应收证券清算款 | 24,148,934.16 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 10,989,712.58 |
| 5 | 应收申购款 | |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 35,210,245.86 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 113501 | 洛钼转债 | 1,394,400.00 | 0.46 |

5.11.5 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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

截至本报告期末本基金持有中小企业私募债余额为20,035,397.26元,明细如下:

金额单位:元

| 债券代码 | 债券名称 | 票面利率(%) | 数量(张) | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|
| 125400 | 14国水务 | 9.50 | 200,000 | 20,035,397.26 |

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | 浦银安盛月月盈定期支付债券A | 浦银安盛月月盈定期支付债券C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 280,528,391.52 | 18,222,087.33 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - | - |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 4,168,444.86 | 263,513.79 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 276,359,946.66 | 17,958,573.54 |

注:本基金按照基金合同的约定,每月定期通过自动赎回基金份额持有人支付一定现金。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2015年4月22日发布《浦银安盛基金管理有限公司关于股东变更的公告》,公告披露:根据上海市政府的要求,经上海国盛(集团)有限公司批准,本基金管理人原股东上海盛融投资有限公司(以下简称"上海盛融")由其母公司上海国盛集团资产有限公司(以下简称"上海国盛")吸收合并,上海盛融持有的本基金管理人10%的股权由上海国盛承继,本基金管理人股东因此由上海盛融变更为上海国盛。相关工商变更登记手续已办理完毕并已报中国证监会备案。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、 中国证监会批准浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金设立的文件
2、 浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金基金合同
3、 浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金招募说明书
4、 浦银安盛月月盈安心养老定期支付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

9.2 存放地点
上海市浦海中路381号中环广场38楼基金管理人办公场所。

9.3 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
二〇一五年七月十八日

# 浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金

## 2015 第二季度 报告

2015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:2015年7月18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2015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2015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 |
| 场内简称 | - |
| 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 | 4,129,268,471.45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