浦银安盛日日盈货币市场基金

2015 第三季度 报告

2015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:2015年10月27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	浦银安盛日日盈货币		
场内简称	-		
基金主代码	519566		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年3月25日		
报告期末基金份额总额	5,375,926,156.49份		
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。		
投资策略	(1)滚动配置策略 本基金将根据具体投资品种的市场特性采用持续投资的方法,既能提高基金资产变现能力的稳定性,又能保证基金资产收益率与市场利率的基本一致。 (2)久期控制策略 本基金将根据对货币市场利率趋势的判断来配置基金资产的久期,在预期利率上升时,缩短基金资产的久期,以规避资本损失或获得较高的再投资收益;在预期利率下降时,延长基金资产的久期,以获取较本利得或锁定较高的收益率。 (3)套利策略 套利策略包括跨市场套利和跨品种套利,跨市场套利是利用同一金融工具在各个子市场的不同表现进行套利,跨品种套利是利用不同金融工具的收益率差别,在满足基金日身流动性、安全性需要的基础上寻求更高的收益率。 (4)时机选择策略 股票、债券发行以及年末效应等因素可能会使市场资金供求情况发生暂时失衡,从而推高市场利率,充分利用这种失衡就能提高基金资产的收益率。		
业绩比较基准	活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种,本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。		
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		
下属分级基金的基金简称	浦银安盛日日盈货币A	浦银安盛日日盈货币B	浦银安盛日日盈货币D
下属分级基金的交易代码	519566	519567	519568
报告期末下属分级基金的份额总额	63,341,325.55份	2,161,090,412.36份	3,151,494,418.58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7月1日-2015年9月30日)		
	浦银安盛日日盈货币A	浦银安盛日日盈货币B	浦银安盛日日盈货币D
1.本期已实现收益	541,974.65	13,226,247.54	25,280,810.04
2.本期利润	541,974.65	13,226,247.54	25,280,810.04
3.期末基金资产净值	63,341,325.55	2,161,090,412.36	3,151,494,418.58

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、本基金收益分配按日结转份额。

4、浦银安盛日日盈货币市场基金于2014年5月28日刊登公告,自2014年5月30日起为指定的特定销售渠道增加浦银安盛日日盈货币市场基金D类份额,该类份额仅能通过特定的销售渠道办理申购、赎回等业务。

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

浦银安盛日日盈货币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	0.8346%	0.0032%	0.0883%	0.0000%	0.7463%	0.0032%

浦银安盛日日盈货币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	0.8956%	0.0032%	0.0883%	0.0000%	0.8073%	0.0032%

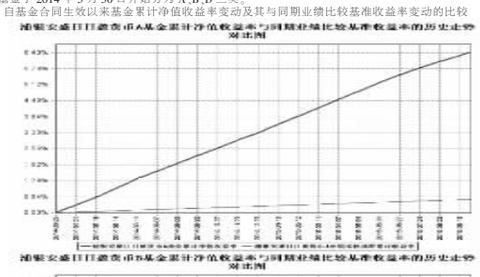
浦银安盛日日盈货币D

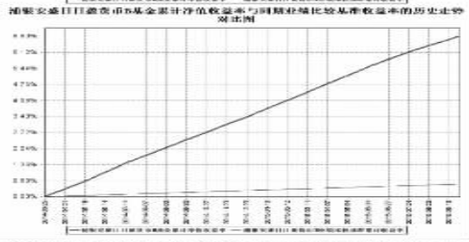
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8347%	0.0032%	0.0883%	0.0000%	0.7464%	0.0032%

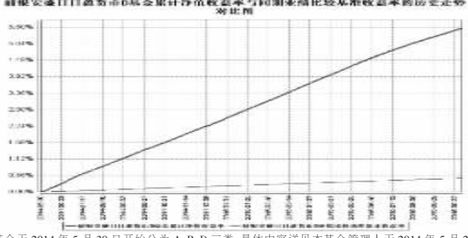
注:1、本基金收益分配按日结转份额。

2、本基金于2014年5月30日开始分为A、B、D三类。

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







注:本基金于2014年5月30日开始分为A、B、D三类,具体内容详见本基金管理人于2014年5月28日刊登的《关于浦银安盛日日盈货币市场基金增加基金份额类别的公告》。

§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		
唐佳燕	公司旗下浦银安盛货币基金以及浦银安盛日日盈货币基金基金经理	2014年7月21日	-	9	唐佳燕女士,香港大学工商管理硕士,2005年6月至2007年5月,先后就职于金盛人寿保险公司,泰信基金管理公司从事基金会计工作,2007年6月加盟浦银安盛基金管理有限公司,先后在基金会计部、交易部、固定收益部从事基金估值、债券交易、固定收益投资工作,2013年12月起在专户管理部担任固定收益投资经理,2014年6月起担任浦银安盛货币基金基金经理,2014年7月起,兼任浦银安盛日日盈货币基金基金经理。

注:1、唐佳燕的任职日期为公司决定的聘任日期。

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)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。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。

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运作分析

3季度经济运行和货币政策相对平稳,债券市场的问题主要集中于两点:一是权益市场的走势;二是人民币汇率的走势。3季度股市的大幅下挫及人民币汇率的意外波动使国内的风险偏好出现系统性下降,债券市场收益率受此影响开始快速下行。目前而言,宽松的货币政策仍未结束,而权益市场短期内也难有趋势性的上行机会,债券市场收益率仍然具有一定的下行空间。在报告期内,本基金均衡配置了短融和同业存款,并借力较为宽松的资金面,获取稳定的息差,并择机进行了部分个券的波段操作。

4.5 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0.8346%,B类净值收益率为0.8956%,D类净值收益率为0.8347%,同期业绩比较基准收益率为0.0883%。

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	固定收益投资	1,623,921,216.42	30.19
	其中:债券	1,593,921,216.42	29.63
	资产支持证券	30,000,000.00	0.56
2	买入返售金融资产	680,002,660.00	12.64
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,957,823,258.36	54.99
4	其他资产	117,548,199.48	2.19
5	合计	5,379,295,334.26	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.97	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本报告期内本基金未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	76
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	103
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	55

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。本基金基金合同约定投资组合的平均剩余期限不超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	24.04	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	24.45	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	31.25	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	8.65	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	9.48	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		97.88	-

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	330,654,168.63	6.15
	其中:政策性金融债	330,654,168.63	6.15
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,263,267,047.79	23.50
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,593,921,216.42	29.65
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130424	13农发24	1,000,000	100,101,931.62	1.86
2	041560053	15贵州高速CP001	900,000	90,030,847.98	1.67
3	130202	13国开02	800,000	80,273,848.42	1.49
4	140230	14国开30	800,000	80,180,949.36	1.49
5	041560052	15湘高速CP001	700,000	69,977,420.15	1.30
6	041460100	14亚泰CP002	600,000	60,115,791.60	1.12
7	041458082	14鲁宏桥CP004	600,000	59,990,018.17	1.12
8	041464070	14鄂联投CP002	500,000	50,324,416.00	0.94
9	041575002	15宝塔石化CP001	500,000	50,214,253.53	0.93
10	130333	13进出33	500,000	50,078,505.39	0.93

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	30
报告期内偏离度的最高值	0.2945%
报告期内偏离度的最低值	0.1874%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2456%

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十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	SZZ003	畅融1号ABS(总份)	300,000.00	30,000,000.00	0.56

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金所持有的债券(包括票据)采用摊余成本法进行估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。

5.8.2

本报告期内本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

5.8.3 本基金投资前十名证券的发行主体没有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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	46,651,160.25
4	应收申购款	70,897,039.23
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	117,548,199.48

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	浦银安盛日日盈货币A	浦银安盛日日盈货币B	浦银安盛日日盈货币D
报告期期初基金份额总额	65,085,580.36	1,087,690,000.01	2,821,431,745.12
报告期期间基金总申购份额	149,249,271.24	1,226,848,611.90	4,657,988,310.89
报告期期间基金总赎回份额	150,993,526.05	153,448,199.55	4,327,925,637.43
报告期期末基金份额总额	63,341,325.55	2,161,090,412.36	3,151,494,418.58

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:1、本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

2、截至本报告期末,本基金管理人的全资子公司上海浦银安盛资产管理有限公司持有本基金浦银日日盈B 12,437,048.49份。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、 中国证监会批准基金募集的文件

2、浦银安盛日日盈货币市场基金基金合同

3、浦银安盛日日盈货币市场基金招募说明书

4、浦银安盛日日盈货币市场基金托管协议

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
2015年10月27日

浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015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:2015年10月27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2015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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛盛世精选混合
场内简称	-
基金主代码	519127
交易代码	519127
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月26日
报告期末基金份额总额	2,890,759,326.00份
投资目标	本基金通过在股票、固定收益证券、现金等资产的积极灵活配置,并通过重点关注受益于中国经济结构转型带来的投资机会,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	本基金在股票投资方面主要采用主题投资策略,通过重点投资受益于中国经济结构转型相关行业股票,并保持对中国经济结构调整的趋势以及经济结构调整对相关行业及上市公司影响的密切跟踪和研究分析,对属于精选投资主题范畴的上市公司进行重点投资。
业绩比较基准	55%×沪深300指数+45%×中信标普全债指数
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	中信银行股份有限公司

§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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	30,655,904.28
2.本期利润	22,503,673.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.0038
4.期末基金资产净值	3,374,933,359.65
5.期末基金份额净值	1.167

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。

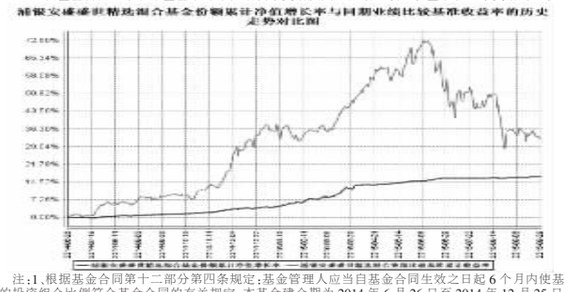
3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	0.52%	0.06%	-15.34%	1.84%	15.86%	-1.78%

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



注:1、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规定。本基金建仓期为2014年6月26日至2014年12月25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		
褚艳辉	公司旗下浦银安盛新经济结构混合基金、浦银安盛盛世精选股票基金基金经理	2014年6月26日	-	11	褚艳辉先生,南京理工大学经济学硕士,2004年至2010年,先后就职于上海信息中心、爱建证券公司从事宏观经济、政策以及制造与消费行业研究工作,后在上海汽车财务公司担任投资经理助理之职。2011年4月加盟我司担任高级行业研究员,2013年2月至2014年6月,担任本公司权益类基金基金经理助理,2014年6月起,担任公司旗下浦银安盛盛世精选混合基金基金经理,2014年7月起,兼任公司旗下浦银安盛新经济结构混合基金基金经理。

注:1、褚艳辉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,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,本着诚实守信、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。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。

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运作分析

3季度经济运行和货币政策相对平稳,债券市场的问题主要集中于两点:一是权益市场的走势;二是人民币汇率的走势。3季度股市的大幅下挫及人民币汇率的意外波动使国内的风险偏好出现系统性下降,债券市场收益率受此影响开始快速下行。目前而言,宽松的货币政策仍未结束,而权益市场短期内也难有趋势性的上行机会,债券市场收益率仍然具有一定的下行空间。在报告期内,本基金维持了较高的信用债仓位和中性的组合久期,并择机进行了部分个券的波段操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期净值增长率为-0.40%,同期业绩比较基准收益率为1.80%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	70,894,185.50	85.88
	其中:债券	70,894,185.50	85.88
	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	10,098,471.61	12.23
8	其他资产	1,561,671.37	1.89
9	合计	82,554,328.48	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注: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

注: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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,036,400.00	5.20
	其中:政策性金融债	4,036,400.00	5.20
4	企业债券	60,427,355.50	77.87
5	企业短期融资券	4,999,000.00	6.44
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,431,430.00	1.84
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	70,894,185.50	91.36

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

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	122463	15花样年债	100,000	10,000,000.00	12.89
2	122220	12莱工01	80,000	8,036,800.00	10.36
3	124749	14二城投	60,810	6,383,225.70	8.23
4	112255	15旗舰01	50,000	5,000,000.00	6.44
5	041551048	15杭州宋城CP001	50,000	4,999,000.00	6.44

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

注: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

注: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

注: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

注: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

注: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,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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	88,187.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,821,418.99
5	应收申购款	165,035.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,074,642.33

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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在在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000858	五粮液	1,327,668.00	0.04	临时停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	9,122,061,619.32
报告期期间基金总申购份额	87,065,548.48
减:报告期期间基金总赎回份额	6,318,367,841.80
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	2,890,759,326.00

§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

注: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

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准基金募集的文件

2、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同

3、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议

4、浦银安盛基金管理有限公司开放式基金业务规则

5、关于募集浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金的法律意见书

6、基金管理人业务资格批件和营业执照

7、基金托管人业务资格批件和营业执照

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
2015年10月27日

浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)

2015 第三季度 报告

2015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:2015年10月27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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛稳健增利债券(LOF)
场内简称	浦银增利
基金主代码	166401
交易代码	166401
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月13日
报告期末基金份额总额	77,799,141.23份
投资目标	本基金在严格控制投资风险的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
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,寻找各类资产的最佳投资机会;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	中证全债指数
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风险品种,一般情形下,其风险收益预期低于股票型基金、混合型基金,高于货币型基金。
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

注:1、本基金由浦银安盛增利分级债券型证券投资基金于2014年12月16日转型而来。

2、自2015年9月17日起,本基金业绩比较基准由原"中信标普全债指数"变更为"中证全债指数"。具体内容详见基金管理人于2015年9月17日发布的《关于变更旗下基金业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》。

§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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-751,508.59
2.本期利润	-424,321.05
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0046
4.期末基金资产净值	77,596,835.12
5.期末基金份额净值	0.997

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。

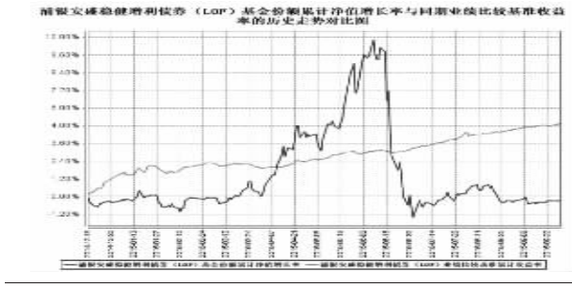
3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-0.40%	0.24%	1.80%	0.05%	-2.20%	0.19%

3.2.2 自基金转型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