

浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资 基金 2016 年第 4 季度报告

2016 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：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 1 月 19 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 2017 年 1 月 17 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 2016 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛盛世精选混合
基金主代码	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	776,118,591.03 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%×中证全债指数
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

下属分级基金的基金简称	浦银盛世 A	浦银盛世 C
下属分级基金的交易代码	519127	519177
报告期末下属分级基金的份额总额	514, 252, 912. 11 份	261, 865, 678. 92 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（2016年10月1日—2016年12月31日）	
	浦银盛世 A	浦银盛世 C
1. 本期已实现收益	7, 036, 916. 06	554, 711. 92
2. 本期利润	3, 351, 849. 22	-528, 246. 00
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0076	-0. 0100
4. 期末基金资产净值	709, 460, 452. 55	301, 069, 456. 11
5. 期末基金份额净值	1. 380	1. 150

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

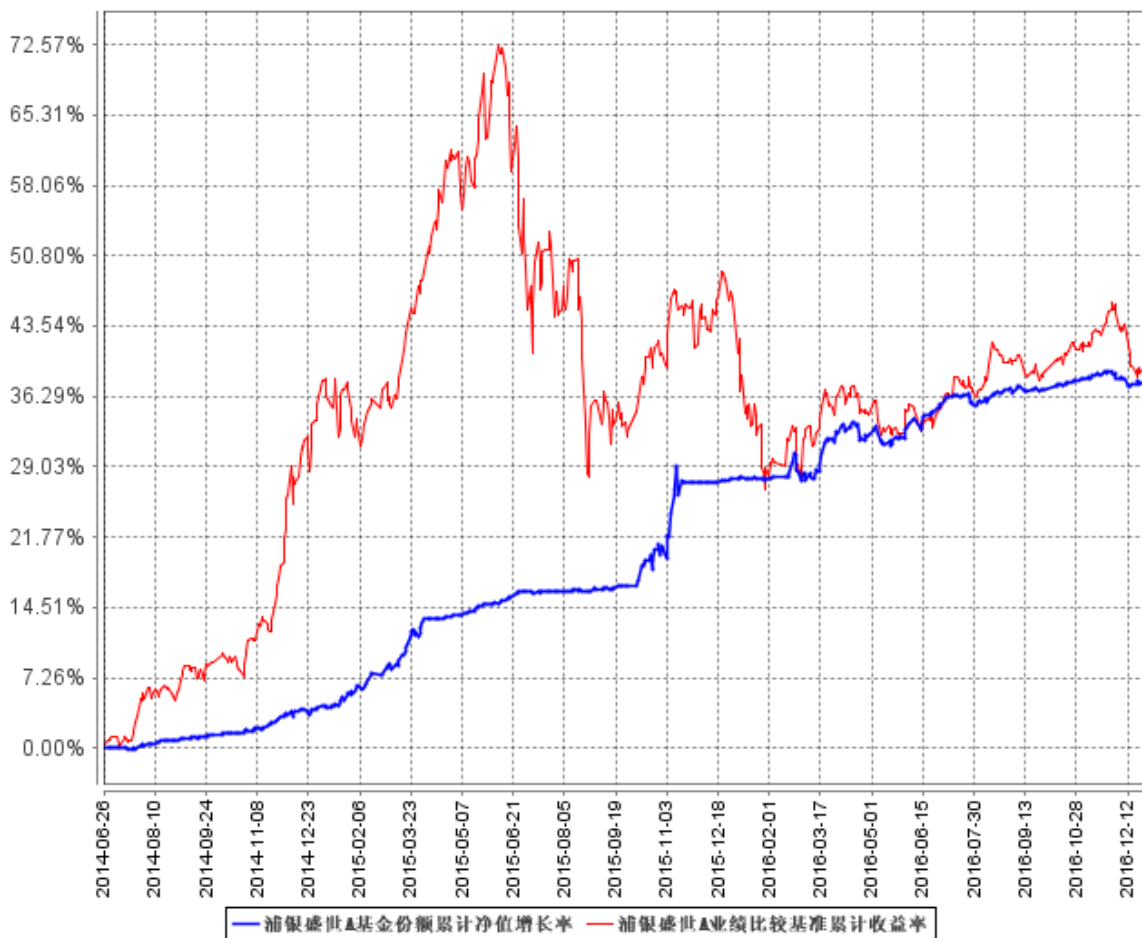
浦银盛世 A

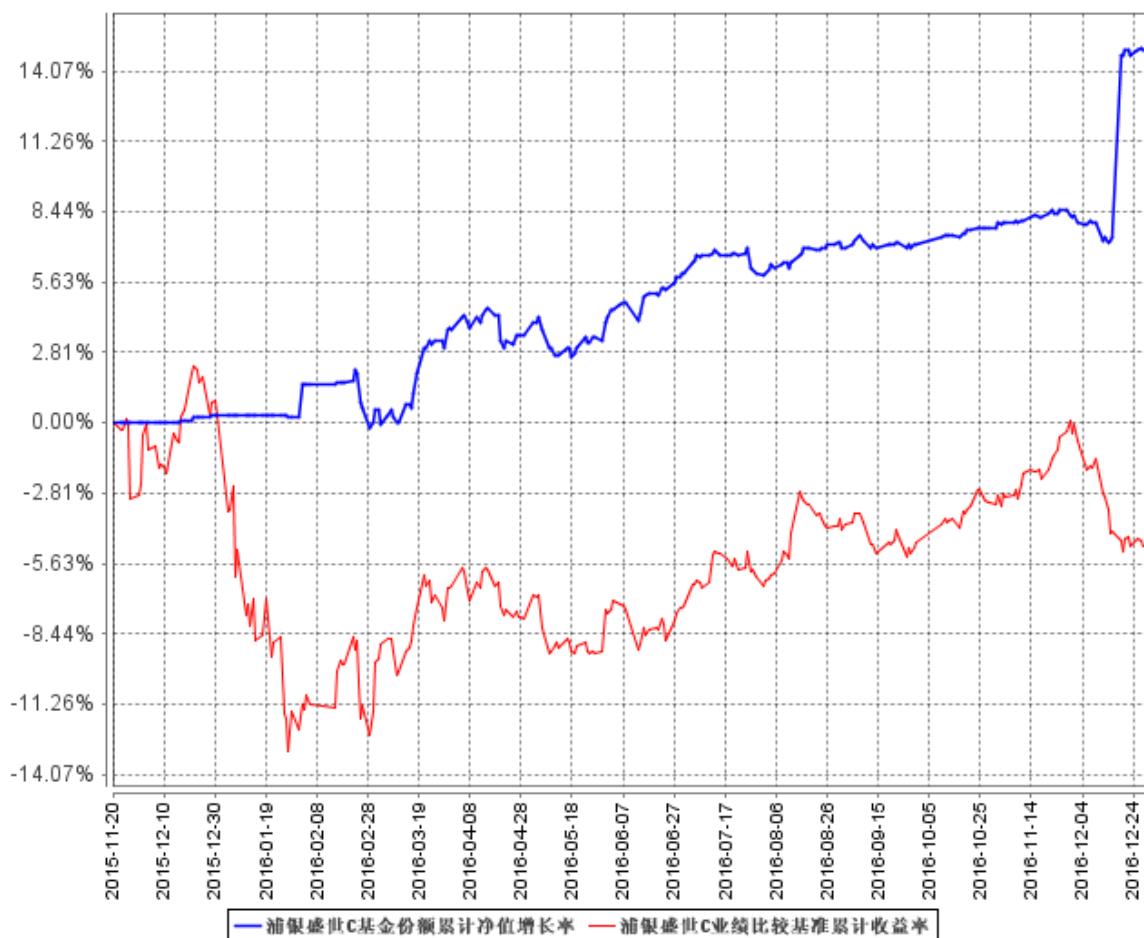
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0. 73%	0. 13%	0. 17%	0. 42%	0. 56%	-0. 29%

浦银盛世 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	7. 38%	0. 88%	0. 17%	0. 42%	7. 21%	0. 46%

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：经中国证监会批准，本基金于 2015 年 11 月 20 日分为 A、C 两类。具体内容详见本基金管理人于 2015 年 11 月 20 日刊登的《浦银安盛基金管理有限公司关于浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并相应修订基金合同部分条款的公告》。

§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		
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

	理				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、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、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《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合规守信情况的说明

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）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 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度，宏观经济底部企稳的证据增多，稳增长的效果显现。财政政策的作用逐步加强，货币政策保持稳健，流动性有边际收紧迹象。

股票市场情绪相对平淡，指数小幅震荡。监管机构加强证券市场资金监管，有利于维护市场健康稳定运行。新股发行速度加快，再融资审查趋严，使资本市场更好的服务于实体经济。市场风格偏向于部分权重股，依靠政策推动的板块表现较好，如 PPP、一带一路、国企混改、各类供给侧改革等等，TMT 板块相对较弱。债券市场大幅调整，“去杠杆”的过程仍在继续。

报告期内，本基金的投资策略与前期保持基本稳定，通过大类资产的均衡配置，力争实现良好的风险收益比。对于资金价格的波动，本基金也抓住机会做好现金管理。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，基金的业绩比较基准为 0.17%，盛世基金 A 份额为 0.73%，C 份额为 7.38%。

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	108,681,131.26	10.69
	其中：股票	108,681,131.26	10.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	189,963,280.00	18.68
	其中：债券	189,963,280.00	18.68
	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	393,861,030.80	38.73
	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	319,674,104.15	31.44
8	其他资产	4,661,315.19	0.46
9	合计	1,016,840,861.40	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	3,481,320.00	0.34
B	采矿业	-	-
C	制造业	62,594,944.30	6.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,017,640.00	0.30
E	建筑业	2,978,824.23	0.29
F	批发和零售业	4,449,130.86	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	1,184,000.00	0.12
H	住宿和餐饮业	922,000.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,262,537.20	0.32
J	金融业	11,498,260.00	1.14
K	房地产业	9,977,550.00	0.99
L	租赁和商务服务业	964,730.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,424,694.67	0.14
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	2,925,500.00	0.29
S	综合	-	-
	合计	108,681,131.26	10.75

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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

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	000568	泸州老窖	96,000	3,168,000.00	0.31
2	000001	平安银行	288,000	2,620,800.00	0.26
3	601688	华泰证券	146,000	2,607,560.00	0.26
4	601336	新华保险	55,000	2,407,900.00	0.24
5	600562	国睿科技	76,000	2,311,920.00	0.23
6	000529	广弘控股	189,000	2,230,200.00	0.22
7	600128	弘业股份	138,766	2,110,630.86	0.21
8	002058	威尔泰	69,920	2,089,209.60	0.21
9	603085	天成自控	40,800	2,053,056.00	0.20

10	600318	新力金融	62,900	2,025,380.00	0.20
----	--------	------	--------	--------------	------

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	10,067,000.00	1.00
	其中：政策性金融债	10,067,000.00	1.00
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	69,765,000.00	6.90
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,940,280.00	0.19
8	同业存单	108,191,000.00	10.71
9	其他	-	-
10	合计	189,963,280.00	18.80

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	111681906	16 宁波银行 CD239	500,000	49,470,000.00	4.90
2	011698320	16 华电 SCP014	300,000	29,898,000.00	2.96
3	011698489	16 灵山 SCP003	200,000	19,914,000.00	1.97
4	111698760	16 杭州联合银行 CD184	200,000	19,602,000.00	1.94
5	111680086	16 河北银行 CD077	200,000	19,380,000.00	1.92

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

注：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

注：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

注：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	60,258.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,804,010.02
5	应收申购款	2,797,046.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	4,661,315.19
---	----	--------------

5.11.4 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	132005	15 国资 EB	1,940,280.00	0.19

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银盛世 A	浦银盛世 C
报告期期初基金份额总额	370,634,466.45	449,579.77
报告期期间基金总申购份额	184,909,428.08	372,778,134.67
减：报告期期间基金总赎回份额	41,290,982.42	111,362,035.52
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	514,252,912.11	261,865,678.92

§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浦银盛世。

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
2017 年 1 月 19 日