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:二〇一三年三月三十日

浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金

2012年度报告摘要

2012年12月31日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2012年9月18日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	浦银安盛幸福回报债券
基金主代码	519118
交易代码	519118
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2012年9月18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
报告期末基金份额总额	2,015,420,376.52份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浦银安盛基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	裘学敏
	联系电话	021-23212888	021-32169999
	电子邮箱	gsj@py-axa.com	zh_jjb@bankcomm.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95559
传真		021-23212985	021-62701262

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012年9月18日至2012年12月31日		2011年		2010年	
	浦银安盛幸福回报债券A类	浦银安盛幸福回报债券B类	浦银安盛幸福回报债券A类	浦银安盛幸福回报债券B类	浦银安盛幸福回报债券A类	浦银安盛幸福回报债券B类
本期已实现收益	22,097,887.34	5,030,979.90	-	-	-	-
本期利润	24,456,405.58	5,610,872.87	-	-	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0151	0.0141	-	-	-	-
本期基金份额净值增长率	1.50%	1.40%	-	-	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2012年末		2011年末		2010年末	
	浦银安盛幸福回报债券A类	浦银安盛幸福回报债券B类	浦银安盛幸福回报债券A类	浦银安盛幸福回报债券B类	浦银安盛幸福回报债券A类	浦银安盛幸福回报债券B类
期末可供分配基金份额利润	0.0137	0.0127	-	-	-	-
期末基金资产净值	1,642,189,877.11	403,297,777.86	-	-	-	-
期末基金份额净值	1.015	1.014	-	-	-	-

注:1、本基金合同生效日为2012年9月18日,至本报告期末,本基金合同生效未满一年。
2、所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。
3、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。
4、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
5、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1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

浦银安盛幸福回报债券A类:

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	1.40%	0.05%	0.76%	0.01%	0.64%	0.04%
自基金合同生效起至今	1.50%	0.04%	0.87%	0.01%	0.63%	0.03%

浦银安盛幸福回报债券B类:

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	1.30%	0.05%	0.76%	0.01%	0.54%	0.04%
自基金合同生效起至今	1.40%	0.05%	0.87%	0.01%	0.53%	0.04%

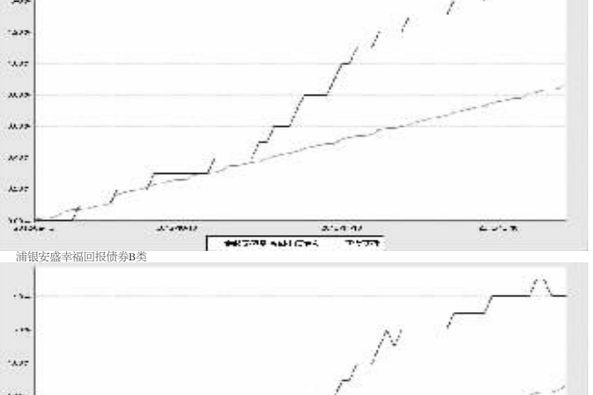
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金

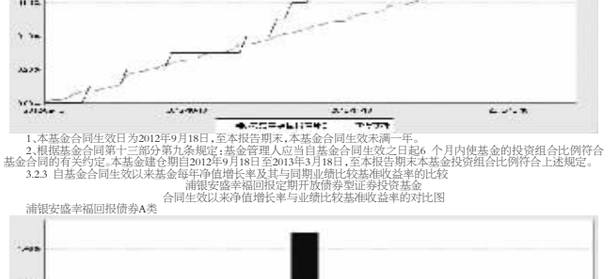
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年9月18日至2012年12月31日)

浦银安盛幸福回报债券A类



浦银安盛幸福回报债券B类



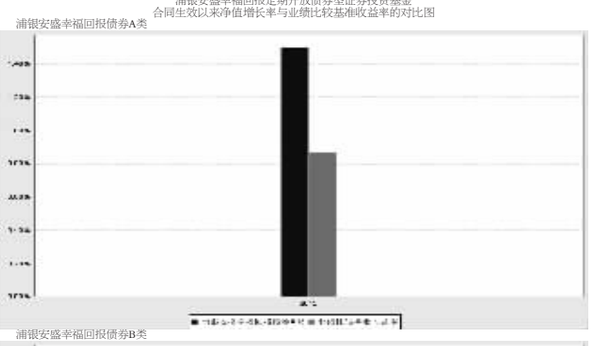
1、本基金合同生效日为2012年9月18日,至本报告期末,本基金合同生效未满一年。
2、根据基金合同第十三部分第九条规定:基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期自2012年9月18日至2013年3月18日,至本报告期末本基金投资组合比例符合上述规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

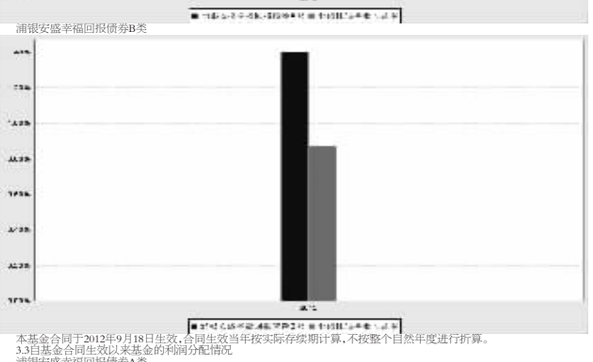
浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金

合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

浦银安盛幸福回报债券A类



浦银安盛幸福回报债券B类



本基金合同于2012年9月18日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3自基金合同生效以来基金的利润分配情况

浦银安盛幸福回报债券A类:
无。
浦银安盛幸福回报债券B类:
无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

浦银安盛基金管理有限公司(以下简称"浦银安盛")成立于2007年8月,由上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A.及上海盛融投资有限公司共同创建,公司总部设在上海,注册资本为人民币2.4亿元,股东持股比例分别为51%、39%和10%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和证监会许可的其他业务。

截至2012年12月31日止,浦银安盛旗下共管理9只基金,即浦银安盛价值成长股票型证券投资基金、浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛红利精选股票型证券投资基金、浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛增利分级债券型证券投资基金、浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金和浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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,浦银安盛货币市场基金基金经理以及浦银增利分级债券基金基金经理	2012-09-18	-	6	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型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型证券投资基金基金经理,2011年12月起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2月起兼任浦银安盛货币市场证券投资基金基金经理,2012年9月起兼任本基金基金经理,2012年11月起,担任本公司固定收益投资部总监。
丁进	本公司旗下固定收益基金基金经理助理	2012-09-18	-	7	丁进,北京化工大学应用数学专业理学硕士,2005年7月至2010年10月期间,先后在北京顺泽锋投资咨询公司、新华信国际信息咨询公司从事交易模型开发研究、企业信用分析等工作,2010年10月起,在光大证券担任固定收益分析师,从事债券研究、信用产品以及可转债研究,2012年8月加盟浦银安盛基金公司,担任固定收益基金基金经理助理。

注:1、薛铮作为本基金的首任基金经理,丁进作为本基金的首任基金经理助理,任职日期为本基金成立日期。
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,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,以及公司的规章制度,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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和控制方法

管理人于2009年颁布了《浦银安盛基金管理有限公司公平交易管理规定》(以下简称公平交易管理规定),并分别于2011年及2012年进行了两次修订,现行公平交易管理规定分为总则、实现公平交易的具体措施、公平交易监控与实施效果评估、公平交易的报告和信息披露、隔离及保密、附则等六部分。公平交易管理规定从投资决策、研究支持、交易实施、监控与评估、报告与披露等各个环节,预防和发现可能违反公平交易的异常情况,并予以及时纠正与改进。

管理人用于公平交易控制方法包括:

– 公司建立严格的投资组合投资信息的管理及保密制度,不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离;
– 相对所有组合建立并使用统一的、系统化的研究平台;
– 明确了投资决策委员会、投资总监、投资组合经理三级授权体系;
– 证券投资基金经理及其助理和特定客户资产投资组合经理及其助理相互隔离,不得相互兼任、互为备份;
– 严格控制不同投资组合之间的同日反向交易;
– 执行投资交易系统中的公平交易程序;
– 银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配严格依照制度和程序规范进行,并对该分配过程进行监控;
– 定期对投资目标和投资策略类似的投资组合的业绩表现进行分析、归因和评估;
– 对不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析,分析如发现有涉嫌不公平的交易,投资组合经理及交易主管对该情况需提供详细的原因说明,并将检查结果向公司管理层和督察长汇报。

2012年度报告摘要

2012年12月31日

同时改进公平交易管理方法及流程。

– 其他能够防范公平交易异常情况的有效方式。

4.3.2公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人修订了《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投资组合。

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。

4.3.3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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2012年国内经济总体呈现增速回落,底部企稳的局面。货币政策目标由控制通胀预期转为稳定经济增长,上半年两次下调存款准备金并且连续两次降息,下半年央行在公开市场上加大操作力度,较好的平抑了短期融资成本。通胀数据与经济增速相匹配,延续2011年下行趋势,全年平均水平不到3%,在10月份达到1.7%低点之后温和反弹。外围宏观经济状况有所好转,特别是美国经济多项指标呈示复苏迹象显著,新一轮全球政治换届平稳进行。国内债券市场在2012年走出一轮牛市行情,出现量价齐升良好格局,不仅企业债券发行额度创下新高,3月份以来随着银行对于地方融资平台信贷展期的利好推动,信用债收益率也出现了较大幅度的回落,全年债券投资组合平均收益接近8%-10%左右。在市场淡化信用风险和交易型机构市场占比急增下,高收益债券品种表现最好,而利率产品表现平平。

2012年本基金把握了较好的建仓时点,持有较高比例的信用债。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2012年12月31日,浦银幸福回报A净值1.015,浦银安盛幸福回报B净值1.014;全年浦银幸福回报A净值增长率为1.5%,浦银幸福回报B净值增长率为1.4%,业绩比较基准收益率为0.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年,中国GDP增长有望温和回升,而增长的模式更加强调通过内需拉动,强调环保、能效,实现更高质量的增长,基建投资拉动仍将对增长贡献相当大的比重,新一届政府强化的改革,创新中小企业增长增长奠定基础,但短期上也可能使得经济增长出现波动。外围经济环境预计进一步回好,但发达国家的持续量化宽松政策使得通胀上升预期更加强烈。随着利率市场化的加深,债券市场的波动幅度将降低,而市场容量的增大和投资者结构更加多元化,也使得交易空间变小,持有期的票息回报将成为后续主要的盈利来源,债市配置价值依然显著。同时本基金将高度重视自下而上的个券筛选以防范本知的可能信用风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益,设立了浦银安盛基金管理有限公司估值委员会(以下简称"估值委员会"),制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由公司分管高管、金融工程部负责人、研究部负责人、合规风控部负责人、基金运营部负责人组成。估值委员会成员五分之三以上具有5年以上专业工作经历,具备良好的专业经验、胜任能力和独立性。估值委员会的职责主要包括:保证基金估值的公平、合理;制订健全、有效的估值政策和程序;确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性;定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金基金经理未参与或决定基金的估值。

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签订了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金(基金合同)约定,在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益每年最少为1次,最多分配12次,每次分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的90%;基金收益分配比例应当以期末可供分配利润为基准计算。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数;基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配净额后不能低于面值。

截止至2012年12月31日,浦银幸福A可分配收益金额为22,097,887.34,浦银幸福A可分配收益金额为5,030,979.90。

本基金自2012年9月18日至2012年12月31日期间未进行收益分配,公司安排于2013年1月18日基金分红,收益分配基准日为2012年12月31日,按照合同约定,下属分级基金应分配金额分别为:浦银幸福A应分配金额为19,888,098.61,浦银幸福B应分配金额为4,527,881.91,符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2012年度,基金托管人在浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012年度,浦银安盛基金管理有限公司在浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金分额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2012年度,由浦银安盛基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

安永华明(2013)审字第60951783_B03号

浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金财务报表,包括2012年12月31日的资产负债表和2012年9月18日(基金合同生效日)至2012年12月31日期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人浦银安盛基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金2012年12月31日的财务状况以及2012年9月18日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) 注册会计师 徐 艳 魏晓达

上海市世纪大道100号环球金融中心50楼

2013-03-27

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	41,027,209.73	-
结算备付金		5,000,000.00	-
存出保证金		250,000.00	-
交易性金融资产	7.4.7.2	2,641,389,553.51	-
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,641,389,553.51	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	30,000,135.00	-
应收证券清算款		119,896,589.48	-
应收利息	7.4.7.5	22,986,205.92	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,860,549,693.64	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		692,498,542.94	-
应付证券清算款		120,121,091.57	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬	7.4.10.2	1,211,708.73	-
应付托管费	7.4.10.2	346,202.49	-
应付销售服务费		119,467.73	-
应付交易费用	7.4.7.7	53,500.75	-
应交税费		-	-
应付利息		311,524.46	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	400,000.00	-
负债合计		815,062,038.67	-
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,015,420,376.52	-
未分配利润	7.4.7.10	30,067,278.45	-
所有者权益合计		2,045,487,654.97	-
负债和所有者权益总计		2,860,549,693.64	-

注:1 报告截止日2012年12月31日,基金份额总额2,015,420,376.52份,其中A类基金份额净值1.015元,份额总额1,617,733,471.53份;B类基金份额净值1.014元,份额总额397,686,904.99份。
2 本基金《基金合同》生效日为2012年9月18日,无上年度可比期间。

7.2 利润表

会计主体:浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2012年9月18日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2012年9月18日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入		37,862,688.76	-
1.利息收入		27,424,825.03	-
其中:存款利息收入	7.4.7.11	961,577.35	-
债券利息收入		23,057,778.81	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,405,468.87	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		7,497,604.33	-
其中:股票投资收益	7.4.7.12	0.00	0.00
债券投资收益		7,497,604.33	-
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	2,938,411.21	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	1,848.19	-
减:二、费用		7,795,410.31	-
1.管理人报酬	7.4.10.2	4,038,422.56	-
2.托管费	7.4.10.2	1,153,834.98	-
3.销售服务费		398,277.03	-
4.交易费用	7.4.7.18	37,315.00	-
5.利息支出		1,986,663.77	-
其中:卖出回购金融资产支出		1,986,663.77	-
6.其他费用	7.4.7.19	180,896.97	-
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		30,067,278.45	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		30,067,278.45	-

注:本基金《基金合同》生效日为2012年9月18日,无上年度可比期间。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2012年9月18日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年9月18日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,015,420,376.52	-	2,015,420,376.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	30,067,278.45	30,067,278.45
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,015,420,376.52	30,067,278.45	2,045,487,654.97

项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	-	-	-

注:本基金《基金合同》生效日为2012年9月18日,无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:郁蓓华,主管会计工作负责人:郁蓓华,会计机构负责人:赵迎华

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2012]879号文《关于核准浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金募集的批复》的核准,由浦银安盛基金管理有限公司作为管理人于2012年8月15日至2012年9月14日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2012)验字第60951783_B03号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2012年9月18日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币2,013,962,182.54元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币1,458,193.98元,以上实收基金(本息)合计为人民币2,015,420,376.52元,折合2,015,420,376.52份基金份额。本基金根据申购费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别:在投资者申购基金时收取申购费用的,称为A类基金份额;不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为B类基金份额。本基金以定期开放方式运作,其封闭期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)一年的期间。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日起一年。首个封闭期结束之后第一个工作日起进入为期5个工作日的首个开放期,如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的,开放期时间中止计算,在不可抗力或其他情形影响因素消除之日次日起,继续计算该开放期时间,直至满足基金合同关于开放期的时间要求,即每次打开申购与赎回业务办理时间达到5个工作日。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起的一年,以此类推。本基金的基金管理人为浦银安盛基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金为债券型基金,主要投资于固定收益类金融工具,具体包括企业债、公司债、国债、央行票据、金融债、地方政府债、次级债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类金融工具,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金不从二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新股增发。可转换债券仅投资于二级市场可分离交易可转债的纯债部分。

本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产净值的80%,但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内,基金投资不受上述比例限制;开放期内现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款利率(税后)。

7.4.2会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式表》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2012年12月31日的财务状况以及2012年9月18日(基金合同生效日)至2012年12月31日期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2012年9月18日(基金合同生效日)起至2012年12月31日止。

7.4.4.2记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

1 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括债券投资;

2 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债均分为其他金融负债。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的债券等,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

金融资产转移,是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方);本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债;

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

1 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算;

卖出债券于成交日确认债券投资收益,卖出债券的成本按移动加权平均法结转;

2 回购协议

基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次,第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的,以该报价为依据确定公允价值;第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价,或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的,以该报价为依据做必要调整确定公允价值;第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的,以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下:

1 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机