基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年三月二十七日

浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月26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2013年5月16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6个月定期债券
基金主代码	519121
交易代码	519121
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月16日
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	626,292,622.92份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的基础上,追求超过业绩比较基准的当期收入和投资总回报,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。
投资策略	本基金利用定期开放、定期封闭的运作特性,秉承主动投资管理理念,在有效流动性管理和控制风险的前提下,优化组合、稳健投资,实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	6个月定期存款利率(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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	张燕
	联系电话	021-23212888	0755-8319 9084
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95555
传真		021-23212985	0755-8319 5201

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	2013年5月16日至2013年12月31日		2012年		2011年	
	浦银安盛6个月定期债券A	浦银安盛6个月定期债券C	浦银安盛6个月定期债券A	浦银安盛6个月定期债券C	浦银安盛6个月定期债券A	浦银安盛6个月定期债券C
本期已实现收益	-126,924,464.17	-18,331,625.62	-	-	-	-
本期利润	-157,790,594.38	-21,989,996.74	-	-	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0396	-0.0418	-	-	-	-
本期基金份额净值增长率	-4.90%	-5.10%	-	-	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2013年末		2012年末		2011年末	
	浦银安盛6个月定期债券A	浦银安盛6个月定期债券C	浦银安盛6个月定期债券A	浦银安盛6个月定期债券C	浦银安盛6个月定期债券A	浦银安盛6个月定期债券C
期末可供分配基金份额利润	-0.0612	-0.0633	-	-	-	-
期末基金资产净值	513,478,796.01	81,991,060.96	-	-	-	-
期末基金份额净值	0.951	0.949	-	-	-	-

注:1.本基金《基金合同》2013年5月16日生效。以上财务指标中“本期”指2013 年5月16日(基金成立日)至2013年12月31日止期间。

2.所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。

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6个月定期债券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	-3.94%	0.44%	0.70%	0.01%	-4.64%	0.43%
过去六个月	-4.04%	0.32%	1.41%	0.01%	-5.45%	0.31%
自基金合同生效起至今	-4.90%	0.30%	1.76%	0.01%	-6.66%	0.29%

浦银安盛6个月定期债券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	-4.04%	0.46%	0.70%	0.01%	-4.74%	0.45%
过去六个月	-4.24%	0.33%	1.41%	0.01%	-5.65%	0.32%
自基金合同生效起至今	-5.10%	0.30%	1.76%	0.01%	-6.86%	0.29%

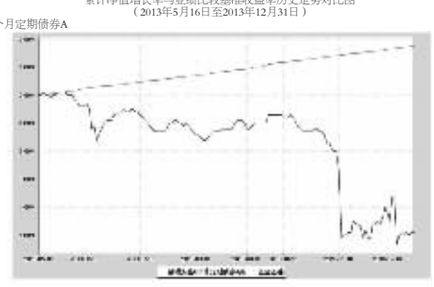
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

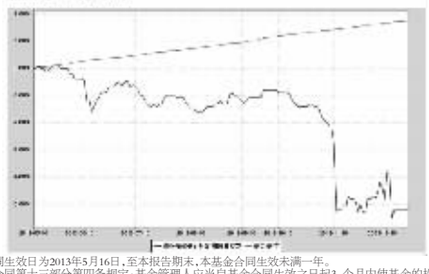
浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年5月16日至2013年12月31日)

浦银安盛6个月定期债券A





1.本基金合同生效日为2013年5月16日,至本报告期末,本基金合同生效未满一年。

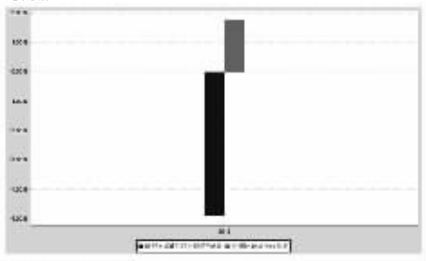
2.根据基金合同第十三部分第四条规定:基金管理人应当自基金合同生效之日起3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为2013年5月16日至2013年8月15日,建仓期结束时本基金投资组合比例符合本基金基金合同约定。

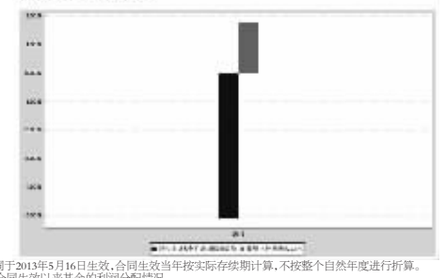
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浦银安盛6个月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6个月定期债券A





本基金合同于2013年5月16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

本基金自基金合同生效以来未进行过利润分配。

§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2.8亿元,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2013年12月31日止,浦银安盛旗下共管理13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、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金、浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金和浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金。

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统,这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成,之后日常的维护管理由公司负责,但与第三方服务公司签订有技术服务合同,由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户子系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统等,这些系统也主要是在公司筹建之初采购专业系统提供商的产品建设而成,建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级,升级由系统提供商负责完成。升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统,业务应用系统日常的维护管理由公司负责,但与系统提供商签订有技术服务合同,由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外,我公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

另外,本公司可以根据自身发展战略的需要,委托资质良好的基金服务机构代为办理基金份额登记、估值核算等业务。

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	本基金基金经理、本公司固定收益投资部总监、浦银安盛增利分级债券基金基金经理、浦银安盛幸福回报定期开放债券基金基金经理以及浦银安盛季季添利债券基金基金经理	2013-05-16	-	7	薛铮先生,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基金基金经理。2011年12月起,担任浦银安盛增利分级债券基金基金经理。2012年2月至2013年5月担任浦银安盛货币市场基金基金经理。2012年9月起担任浦银安盛幸福回报定期开放债券基金基金经理。2012年11月起,担任本公司固定收益投资部总监。2013年5月起,担任本基金基金经理。2013年6起,担任浦银安盛季季添利定期开放债券基金基金经理。
丁进	本公司固定收益基金基金经理助理	2013-05-16	-	8	丁进先生,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.作为本基金的首任基金经理和首任基金经理助理,此处的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,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、投资监监、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。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,本基金管理人根据《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

2013年中国经济呈现稳健增长的发展态势,消费平稳增长、投资增长较快、进出口结构优化;消费价格涨幅和就业基本稳定。全年实现国内生产总值同比增长7.7%,居民消费价格CPI同比上涨2.6%,远低于年初监管目标。尽管认传统基本面有利于债市,但是新一阶段央行偏紧的货币政策导向,以及利率市场化下商业银行资产负债结构的调整,使得债市迎来一轮大熊市。央行的惩罚性货币政策举措,使得商业银行提高超储率,季度末和年末时点资金价格波动巨大,各类机构均大幅提高流动性风险应对准备。全年债市收益率曲线平行上移100-150BP,10年期国债最高突破4.7%。年中大批量信用评级下调使得民企公司债券大幅下跌,加大了投资机构对于民营企业信用风险的担心。2013年外围发达经济体经济好转,美国正式分阶段退出QE,新兴市场对于资金流动冲击均提高警惕。

2013年本基金年中建立后以配置信用债和转债为主,后续随市场波动及组合赎回应对调整部分结构。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

全年浦银6个月定期开放A净值增长率为-4.9%,浦银6个月定期开放C净值增长率为-5.1%,业绩比较基准收益率为1.76%。

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2014年,中国经济增长面临外需疲弱动性冲击,内需改革深化的双重挑战,消费增长模式的内生拉动乏力,投资规模的进一步扩大,又面临高企的融资环境,经济波动在所难免。全球经济体对于流动性的回收,使得风险资产偏好有所降低;国内利率市场化下货币基金等互联网金融的兴起使得资金价格居高不下,对于信用风险和流动性的担心,使得债市投资机构整体缩短久期,个人投资人也将更加关注流动性和收益率结合优势凸显的类货币产品。银行理财和信托随着这几年的飞速发展,规模已十分巨大,2014年其刚性兑付面纱终将逐步脱落,这使得债券类资产定价更加合理。预计1季度会出现小幅反弹行情,大的反转趋势需要观察货币政策转向情况。中高评级久期适中的信用债品种仍是债券基金的重点投资标的。可转债品种注重波段投资机会,也需要防患周期类转债品种受到经济增速回落的不利影响。

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。估值委员会成员均具有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。

本基金管理人已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》第十七部分第二条约定,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%;若《基金合同》生效不满3 个月可不进行收益分配;基金收益分配比例应当以截止收益分配日的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部分较低值。

本基金自2013年5月16日(基金合同生效日)至2013年12月31日期间未进行收益分配,符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

§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

本报告期,招商银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对浦银安盛基金管理有限公司浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金证券投资基金2013年12月31日的资产负债表、2013年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告(普华永道中天审字(2014)第20576号),投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	761,571.95	-
结算备付金		32,403,090.90	-
存出保证金		271,942.14	-
交易性金融资产	7.4.7.2	796,037,377.20	-
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		796,037,377.20	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.7.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		679,376.53	-
应收利息	7.4.7.5	20,807,470.38	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	20,000.00	-
资产总计		850,980,829.10	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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		253,299,886.90	-
应付证券清算款		620,024.09	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		304,149.14	-
应付托管费		101,383.04	-
应付销售服务费		17,451.17	-
应付交易费用	7.4.7.7	35,550.59	-
应交税费		780,927.20	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	351,600.00	-
负债合计		255,510,972.13	-
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	626,292,622.92	-
未分配利润	7.4.7.10	-30,822,765.95	-
所有者权益合计		595,469,856.97	-
负债和所有者权益总计		850,980,829.10	-

注:1.本财务报表的实际编制期间自2013年5月16日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间。

2.报告截止日2013年12月31日,基金份额净值0.951元,基金份额总额626,292,622.92份,其中A类基金份额净值0.951元,份额总额539,889,989.86份;C类基金份额净值0.949元,份额总额86,402,633.06份。

3.本基金《基金合同》生效日为2013年5月16日,至报告期末,合同成立未满一年。

4.本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解相应附注的内容,应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

7.2 利润表

会计主体:浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2013年5月16日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年5月16日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一.收入		-135,703,070.07	-
1.利息收入		147,743,129.53	-
其中:存款利息收入	7.4.7.11	6,811,751.74	-
债券利息收入		126,413,539.67	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		14,517,838.12	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-248,943,535.12	-
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-763,625.26	0.00
债券投资收益	7.4.7.13	-248,223,017.70	-
基金投资收益		-	-
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	43,107.84	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	-34,524,501.33	-
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	21,836.85	-
减:二.费用		44,077,521.05	-
1.管理人报酬		16,998,137.33	-
2.托管费		5,666,045.75	-
3.销售服务费		824,913.34	-
4.交易费用	7.4.7.18	153,302.99	-
5.利息支出		20,026,956.53	-
其中:卖出回购金融资产支出		20,026,956.53	-
6.其他费用	7.4.7.19	408,165.11	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-179,780,591.12	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(亏损以“-”号填列)		-179,780,591.12	-

注:本基金《基金合同》生效日为2013年5月16日,至报告期末,合同成立未满一年。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2013年5月16日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年5月16日至2013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)	5,441,572,900.08	-	5,441,572,900.08
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-179,780,591.12	-179,780,591.12
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)	-4,815,280,277.16	148,957,825.17	-4,666,322,451.99
其中:1.基金申购款	456,189.84	-22,300.95	433,888.89
2.基金赎回款	-4,815,736,467.00	148,980,126.12	-4,666,756,340.88
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)	626,292,622.92	-30,822,765.95	595,469,856.97

项目	上年度可比期间 2012年1月1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)	-	-	-
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2013年5月16日,至报告期末,合同成立未满一年。

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:

基金管理公司负责人: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6个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)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]1764号《关于核准浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金募集的批复》核准,由浦银安盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集5,436,733,239.23元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第271号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2013年5月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为5,441,572,900.08份基金份额,其中认购资金利息折合4,839,660.85份基金份额。本基金的基金管理人为浦银安盛基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金合同》和《浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据认购、申购费用收取方式的不同,基金份额分为不同类别:在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用的为A类基金份额;不收取认购、申购费用,从本类别基金资产中计提销售服务费的为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。

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)6个月的期间。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日起6个月。本基金自封闭期结束之后第一个工作日起进入为期5个工作日的开放期。在本基金的开放期的5个工作日内,投资者可以办理本基金的申购业务,在本基金开放期的第1个工作日和第2个工作日,投资者可以进行赎回业务的办理。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、可转换债券、公司债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、可分离交易可转债、质押及买断式回购、协议存款、定期存款、通知存款、资产支持证券等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固定收益证券品种(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场的新股申购或增发新股。本基金可持有因可转债转股所形成的股票,以及因投资可分离债券而产生的权证。因上述原因持有的股票和权证等资产,其比例不得超过基金资产的20%。本基金各类资产的投资比例为:本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%,但在每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内,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的5%。本基金的业绩比较基准为:6个月定期存款利率(税后)。

7.4.2会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”),中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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2013年12月31日的财务状况以及2013年5月16日(基金合同生效日)至2013年12月31日止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

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度为公历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2013年5月16日(基金合同生效日)起至2013年12月31日止。

7.4.4.2记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金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;或者(3)该金融资产已转移,虽然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,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值:估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且3)交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现