浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014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:上海银行股份有限公司
送出日期:2015年03月26日

§1 重要提示及目录

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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月24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2014年1月1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	浦银安盛季季添利债券	
基金主代码	519123	
场内简称	-	
交易代码	519123	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年06月14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	
报告期末基金份额总额	929,530,351.86份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛季季添利债券A	浦银安盛季季添利债券C
下属分级基金场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	519123	519124
报告期末下属分级基金的份额总额	902,679,647.02份	26,850,704.84份

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,实现投资目标。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的三个月定期存款基准利率(税后)*1.1。
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。

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	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	夏虹
	联系电话	021-23212888	021-68475682
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	xiahong@bankofshanghai.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95594
传真		021-23212985	021-68475623

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文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	浦银安盛季季添利债券A	
	2014年	2013年06月14日-2013年12月31日
本期已实现收益	137,039,057.66	39,745,690.38
本期利润	222,925,287.50	-16,116,801.54
加权平均基金份额本期利润	0.1733	-0.0008
本期基金份额净值增长率	18.79%	-1.00%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.1411	-0.0099
期末基金资产净值	1,061,279,748.44	1,599,889,249.23
期末基金份额净值	1.1760	0.9900
3.1.3 期间数据和指标	浦银安盛季季添利债券C	
	2014年	2013年06月14日-2013年12月31日
本期已实现收益	6,094,353.52	4,141,728.07
本期利润	12,676,580.89	-1,872,499.60
加权平均基金份额本期利润	0.1394	-0.0079
本期基金份额净值增长率	18.42%	-1.20%
3.1.4 期末数据和指标	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.1353	-0.0121
期末基金资产净值	31,408,077.17	162,801,388.64
期末基金份额净值	1.1700	0.9880

注:1、本基金《基金合同》2013年6月14日生效。以上财务指标中"上年度可比期间"为2013 年6月14日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间。

2、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。

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。

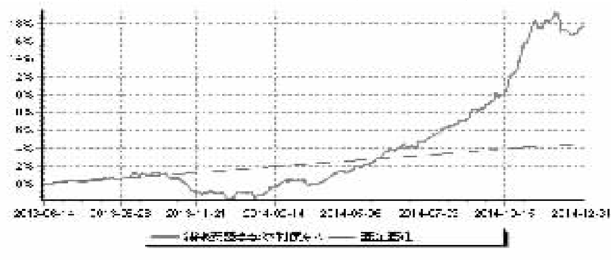
3.2 基金净值表现

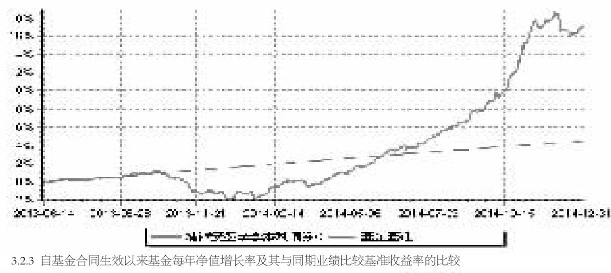
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 (浦银安盛季季添利债券A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	6.62%	0.37%	0.69%	0.01%	5.93%	0.36%
过去六个月	12.54%	0.28%	1.42%	0.01%	11.12%	0.27%
过去一年	18.79%	0.22%	2.87%	0.01%	15.92%	0.21%
自基金合同生效起至今	17.60%	0.19%	4.50%	0.01%	13.10%	0.18%

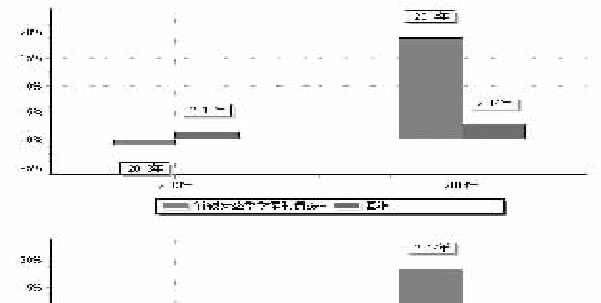
阶段 (浦银安盛季季添利债券C)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.56%	0.36%	0.69%	0.01%	5.87%	0.35%
过去六个月	12.39%	0.27%	1.42%	0.01%	10.97%	0.26%
过去一年	18.42%	0.22%	2.87%	0.01%	15.55%	0.21%
自基金合同生效起至今	17.00%	0.19%	4.50%	0.01%	12.50%	0.18%

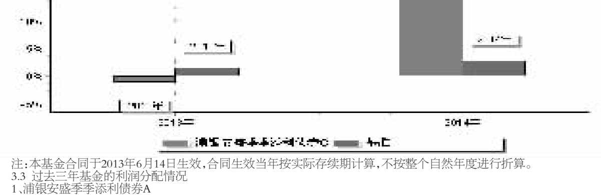
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





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





注:本基金合同于2013年6月14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 过去三年基金的利润分配情况

1、浦银安盛季季添利债券A

本基金自基金合同生效以来未进行过利润分配。

2、浦银安盛季季添利债券C

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,股东为上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A. 及上海国盛集团资产有限公司,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2014年12月31日止,浦银安盛旗下共管理17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、浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛日日盈货币市场证券投资基金、浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金及浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金。

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,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	2013年06月14日	-	8	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、货币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(原增利分级债券基金)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。
丁进	本公司固定收益基金基金经理助理	2013年06月14日	-	9	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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年中国经济保持低位运行,通胀长期维持在较低水平,疲软的基本面为2014年债券市场的走牛打下了基础。在基本面、资金面、政策面多重利好的刺激下,2014年债券市场走出了一轮大牛市,债券市场收益率大幅下行。利率债方面,政策性金融债长端收益率下行幅度接近170bp,短端政策性金融债收益率下行幅度接近150bp。信用债方面,城投债利率下行幅度大于200bp,加权5年期AA品种收益率从近8%回到6%附近。2014年债券市场稳步下行,鲜有波折,11月份受中登黑天鹅事件的影响,债券市场出现过短暂调整,随后又重归下行通道。2014年度,本基金全年均衡配置信用资质较好的中长期债券,波段操作转债以及短期低等级信用债券的投资策略,保持适度杠杆,取得了较好的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期A类净值增长率为18.79%,C类净值增长率为18.42%,同期业绩比较基准收益率为2.87%。

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2015年,中国经济难言乐观。从内部看,2015年中国经济增速继续保持低位,通缩压力开始出现,短时间内经济难有起色。从外部看,受美国货币政策调整影响,2015年中国面临资金外流压力,基础货币存在明显缺口,需要央行采用结构性货币工具进行对冲。我们认为2015年基本面将会是"低增长、低通胀、宽货币"的组合,这无疑有利于债券市场的继续走牛。而且从估值的角度来看,经过近段时间的调整,债券市场收益率再次回到了一个具有吸引力的水平。有利的基本面组合加上有吸引力的收益率水平将有助于延续债券市场的牛市行情。

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

在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为4次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配,基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即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金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配,符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 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,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金托管协议》的有关约定,诚实、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,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,认为复核内容真实、准确、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季季添利定期开放债券型证券投资基金2014年12月31日的资产负债表,2014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(普华永道中天审字(2015)第20449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:浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金
报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	328,255.53	97,710.22
结算备付金		66,530,815.12	93,760,374.84
存出保证金		263,181.71	143,446.45
交易性金融资产	7.4.7.2	1,953,268,088.48	2,701,336,797.17
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,892,996,088.48	2,701,336,797.17
资产支持证券投资		60,272,000.00	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		32,226,553.24	76,480.75
应收利息	7.4.7.5	33,485,296.28	43,829,581.84
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		2,086,102,190.36	2,839,244,391.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013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		959,448,897.47	1,074,679,657.48
应付证券清算款		32,319,340.35	13,212.82
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		709,311.60	1,147,085.88
应付托管费		202,660.46	327,738.83
应付销售服务费		11,553.75	54,731.42
应付交易费用	7.4.7.7	13,959.81	6,832.03
应交税费		-	-
应付利息		368,641.31	24,494.94
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	340,000.00	300,000.00
负债合计		993,414,364.75	1,076,553,753.40
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	929,530,351.86	1,780,755,422.87
未分配利润	7.4.7.10	163,157,473.75	-18,064,785.00
所有者权益合计		1,092,687,825.61	1,762,690,637.87
负债和所有者权益总计		2,086,102,190.36	2,839,244,391.27

注:1、报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.176元,基金份额总额929,530,351.86份,其中A类基金份额参考净值1.176元,份额总额902,679,647.02份;C类基金份额参考净值1.170元,份额总额26,850,704.84份。2、本基金《基金合同》2013年6月14日生效。以上财务指标中"上年度可比期间"为2013年6月14日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体:浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金
本报告期:2014年01月01日至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2014年01月01日至2014年12月31日	上年度可比期间2013年06月14日至2013年12月31日
一、收入		298,424,785.86	5,858,282.05
1.利息收入		152,213,211.79	74,586,437.20
其中:存款利息收入	7.4.7.11	1,999,232.47	867,113.89
债券利息收入		147,436,475.78	55,820,909.81
资产支持证券利息收入		2,777,503.54	-
买入返售金融资产收入		-	17,898,413.50
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		53,624,832.97	-7,149,451.26
其中:股票投资收益	7.4.7.12	177,812.22	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	53,367,216.96	-7,149,451.26
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	79,803.79	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	92,468,457.21	-61,876,719.59
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	118,283.89	298,015.70
减:二、费用		62,822,917.47	23,847,583.19
1.管理人报酬		10,156,958.37	8,641,838.33
2.托管费		2,901,988.09	2,469,096.69
3.销售服务费		331,113.49	451,104.06
4.交易费用	7.4.7.19	30,251.56	15,957.39
5.利息支出		49,007,948.43	11,950,933.84
其中:卖出回购金融资产支出		49,007,948.43	11,950,933.84
6.其他费用	7.4.7.20	394,657.53	318,652.88
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		235,601,868.39	-17,989,301.14
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		235,601,868.39	-17,989,301.14

注:本基金《基金合同》2013年6月14日生效。以上财务指标中"上年度可比期间"为2013年6月14日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金
本报告期:2014年01月01日至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2014年01月01日至2014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)	1,780,755,422.87	-18,064,785.00	1,762,690,637.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		235,601,868.39	235,601,868.39
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)	-851,225,071.01	-54,379,609.64	-905,604,680.65
其中:1.基金申购款	581,164,535.61	23,689,411.02	604,853,946.63
2.基金赎回款	-1,432,389,606.62	-78,069,020.66	-1,510,458,627.28
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)	929,530,351.86	163,157,473.75	1,092,687,825.61
项 目	上年度可比期间2013年06月14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)	2,464,713,386.91	-	2,464,713,386.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-17,989,301.14	-17,989,301.14
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)	-683,957,964.04	-75,483.86	-684,033,447.90
其中:1.基金申购款	391,940.74	3,289.02	395,229.76
2.基金赎回款	-684,349,904.78	-78,772.88	-684,428,677.66
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)	1,780,755,422.87	-18,064,785.00	1,762,690,637.87

注:本基金《基金合同》2013年6月14日生效。以上财务指标中"上年度可比期间"为2013年6月14日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间。

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。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

郁蓓华	郁蓓华	钱珉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

浦银安盛季季添利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【2013】304号《关于核准浦银安盛季季添利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《浦银安盛季季添利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2,463,119,529.89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349号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2013年6月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,464,713,386.91份基金份额,其中认购资金利息折合1,593,857.02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,基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金基金招募说明书》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。

本基金以定期开放的方式运作,即本基金以运作周期和自由开放期相结合的方式运作。本基金以3年为一个运作周期,每个运作周期为自基金合同生效日(包括基金合同生效日)或每个自由开放期结束之日次日起(包括该日)至3年后的年度对日的前一日止。在每个运作周期结束后进入自由开放期。本基金的每个自由开放期为5至20个工作日。在首个运作周期中,本基金的受限开放期为本基金基金合同生效日的季度对日。在第二个及以后的运作周期中,本基金的受限开放期为该运作周期首日的季度对日。本基金的每个受限开放期为1个工作日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛季季添利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)。本基金不从二级市场买入股票或权证,也不参与一级市场新股申购或股票增发。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:本基金的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的三个月定期存款基准利率(税后)×1.1。

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日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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? 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》、《浦银安盛季季添利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

本基金2014年度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2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计估计与2013年度报告相一致;本报告期所采用的会计政策变更的说明在7.4.5.1会计政策变更的说明中披露。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》 和修订后的 《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海银行股份有限公司("上海银行")	基金托管人、基金代销机构
上海浦银安盛资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
上海浦东发展银行股份有限公司("上海浦东发展银行")	基金管理人的股东、基金代销机构
上海国盛集团资产有限公司	基金管理人的股东
浦银安盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
法国安盛投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海盛融投资有限公司	基金管理人的原股东

注:1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立,并以一般交易价格为定价基础。

2、本报告期内,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。本基金管理人正在就此事项履行相关工商变更手续。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金在本报告期及上年度期可比期间均无通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度期可比期间均无通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期及上年度期可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.1.4 债券交易

本基金在本报告期及上年度期可比期间均无通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.5 债券回购交易

本基金在本报告期及上年度期可比期间均无通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年01月01日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年06月14日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,156,958.37	8,641,838.33
其中:支付销售机构的客户维护费	3,359,048.31	3,812,009.73

注:1、本基金《基金合同》2013年6月14日生效。以上财务指标中"上年度可比期间"为2013年6月14日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间。

2、本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年01月01日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年06月14日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,901,988.09	2,469,096.69

注:1、本基金《基金合同》2013年6月14日生效。以上财务指标中"上年度可比期间"为2013年6月14日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间。

2、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014年01月01日至2014年12月31日		
	浦银安盛季季添利债券A	浦银安盛季季添利债券C	合计
浦银安盛基金管理有限公司	-	1,989.10	1,989.10
上海浦东发展银行股份有限公司	-	136,895.95	136,895.95
上海银行股份有限公司	-	148,165.38	148,165.38
合计	-	287,050.43	287,050.43
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2013年06月14日至2013年12月31日		
	浦银安盛季季添利债券A	浦银安盛季季添利债券C	合计
浦银安盛基金管理有限公司	-	1,512.95	1,512.95
上海浦东发展银行股份有限公司	-	206,445.02	206,445.02
上海银行股份有限公司	-	181,296.67	181,296.67
合计	-	389,254.64	389,254.64

注:1、本基金《基金合同》2013年6月14日生效。以上财务指标中"上年度可比期间"为2013年6月14日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间。

2、本基金A 类基金份额不收取销售服务费,C 类基金份额的销售服务费年费率为0.35 %。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

销售服务费按前一日C 类基金资产净值的 0.35 %年费率计提。

计算方法如下:

$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$

H 为C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令,由基金托管人复核后于次月首日起5 个工作日内从基金资产中划出,由基金管理人代收,基金管理人收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人在本报告期与上年度可比期间均未持有本基金。本基金《基金合同》生效日为2013年6月14日。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期与上年度可比期间均未持有本基金。本基金《基金合同》生效日为2013年6月14日。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年01月01日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年06月14日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海银行股份有限公司	328,255.53	198,802.92	97,710.22	379,955.36

注:1、本基金的活期银行存款由基金托管人上海银行保管,按约定利率计息。

2、本基金《基金合同》2013年6月14日生效。以上财务指标中"上年度可比期间"为2013年6月14日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间承销期内均未参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金在本报告期内未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金在本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币264,748,922.87元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
101451050	14中色MTN001(3年期)	2015-01-08	99.20	50,000	4,960,000.00
1480549	14首创集团可续期债01	2015-01-07	98.65	10,000	986,500.00
101361011	13浙商集MTN001	2015-01-06	101.25	400,000	40,500,000.00
1380240	13商洛债01	2015-01-07	103.02	1,000,000	103,020,000.00
1380271	13乳山国资债	2015-01-08	101.89	630,000	64,190,700.00
1282238	12京热力MTN1	2015-01-07	99.89	300,000	29,967,000.00
1282158	12北排水MTN1	2015-01-07	100.47	300,000	30,141,000.00
合计				2,690,000	273,765,200.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 694,699,974.60元,于2015年1月5日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2014年12月31日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为1,122,074,109.70元,属于第二层次的余额为736,041,000.00元,属于第三层次的余额为95,152,978.78元(2013年12月31日:第一层次2,004,235,504.70元,第二层次617,197,000.00元,第三层次79,904,292.47元)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金本期净转入第三层次的金额为15,248,686.31元,无计入损益的第三层次金融工具公允价值变动 (2013年度:净转入第三层次79,904,292.47元,无计入损益的第三层次金融工具公允价值变动)。

上述第三层次资产变动如下:

	交易性金融资产		
	债券投资	权益工具投资	合计
2014年1月1日	79,904,292.47	-	79,904,292.47
购买	110,344,847.95	-	110,344,847.95
出售	85,123,861.64	-	85,123,861.64
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	1,553,965.03	-	1,553,965.03
计入损益的利得或损失	-	-	-
2014年12月31日	105,125,278.78	-	105,125,278.78

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下:

债券	2014年12月31日公允价值	估值技术	名称	不可观察输入值范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
13镇旅游02	50,004,821.92	现金流折现	折现率	8.80%	反向
13镇旅游	30,120,164.39	现金流折现	折现率	8.80%	反向
13瑞水01	15,027,992.47	现金流折现	折现率	8.10%	反向
12长公债	9,972,300.00	现金流折现	折现率	8.35%	反向
合计	105,125,278.78			8.66%	

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,953,268,088.48	93.63
	其中:债券	1,892,996,088.48	90.74
	资产支持证券	60,272,000.00	2.89
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	66,859,070.65	3.20
7	其他各项资产	65,975,031.23	3.16
8	合计	2,086,102,190.36	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

8.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300139	福星晓程	5,607,932.28	0.32

注:"买入金额"按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300139	福星晓程	5,785,744.50	0.33

注:"卖出金额"按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	5,607,932.28
卖出股票收入(成交)总额	5,785,744.50

注:"买入股票的成本"和"卖出股票的收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,730,244,456.48	158.35
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	141,189,000.00	12.92
7	可转债	21,562,632.00	1.97
8	其他	-	-
9	合计	1,892,996,088.48	173.24

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	1380240	13商洛债01	1,000,000	103,020,000.00	9.43
2	124318	13滨城投	1,000,000	103,000,000.00	9.43
3	124349	13福东海	900,000	95,580,000.00	8.75
4	124323	13新天治	922,740	93,658,110.00	8.57
5	124336	13渝地产	801,000	82,503,000.00	7.55

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1489014	14开元1A	400,000.00	40,228,000.00	3.68
2	1489036	14开元3A2	400,000.00	20,044,000.00	1.83

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金为债券型基金,不参与股指期货交易。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 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范围的情况。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	263,181.71
2	应收证券清算款	32,226,553.24
3	应收股利	-
4	应收利息	33,485,296.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,975,031.23

8.12.4 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	110022	同仁转债	21,363,000.00	1.96
2	113007	吉视转债	199,632.00	0.02

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

8.12.6 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105,125,278.78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
125160	13镇旅游02	8.80	500,000	50,004,821.92
125119	13镇旅游	8.80	300,000	30,120,164.39
125069	13瑞水01	8.10	150,000	15,027,992.47
118025	12长公债	8.35	100,000	9,972,300.00
合计			1,050,000	105,125,278.78

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
浦银安盛季季添利债券A	10,580	85,319.44	596,929,217.28	66.13%	305,750,429.74	33.87%
浦银安盛季季添利债券C	1,264	21,242.65	-	-	26,850,704.84	100.00%
合计	11,844	78,481.12	596,929,217.28	64.22%	332,601,134.58	35.78%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	浦银安盛季季添利债券A	-	-
	浦银安盛季季添利债券C	210,232.70	0.783000%
	合计	210,232.70	0.023000%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	浦银安盛季季添利债券A	0
	浦银安盛季季添利债券C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	浦银安盛季季添利债券A	0
	浦银安盛季季添利债券C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

	浦银安盛季季添利债券A	浦银安盛季季添利债券C
基金合同生效日(2013年06月14日)基金份额总额	2,190,552,433.42	274,160,953.49
本报告期期初基金份额总额	1,615,964,755.43	164,790,667.44
本报告期期间基金总申购份额	579,939,342.62	1,225,192.99
减:报告期期间基金总赎回份额	1,293,224,451.03	139,165,155.59
本报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	902,679,647.02	26,850,704.84

注:申购含红利再投、转换入份额;赎回含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、经基金管理人2014年第二次股东会会议审议通过,选举产生第三届董事会成员,相较第二届董事会成员,新增霍佳震先生、董叶顺先生为基金管理人独立董事,新增汪素南先生为基金管理人董事,原董事林道峰先生、独立董事谢百三先生不再连任。

2、经2014年度第三次股东会会议审议通过,章曦先生不再担任基金管理人董事职务,选举金杰先生接替章曦先生出任基金管理人第三届董事会董事。

3、报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内,为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙),未有改聘情况发生。本报告期内应支付给会计师事务所的报酬为100,000元,截止本报告期末,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已提供审计服务的连续年限为2年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内,管理人、托管人及其高级管理人员未受到有权机关调查、司法纪检部门采取强制措施、被移送司法机关或追究刑事责任、中国证监会稽查、中国证监会行政处罚、证券市场禁入、认定为不适当人选、被其他行政管理部门处罚及证券交易所公开谴责的情形。报告期内中国证监会上海监管局对公司进行了常规全面现场检查,并于报告期后提出相应整改意见及监管措施决定书。公司将以此次现场检查为契机,进一步提升公司整体内控水平,通过构建完善的风险管理和合规管理体系,推动公司向现代资产管理机构的转型。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	5,785,744.50	100.00%	5,267.39	100.00%	
海通证券	1	-	-	-	-	

注:1、证券经营机构交易单元选择的标准和程序:

(1)选择证券经营机构交易单元的标准:

财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格;

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;

具备较强的综合研究能力,能及时、全面地为基金提供研究服务支持;

佣金费率合理;

本基金管理人要求的其他条件。

(2)选择证券经营机构交易单元的程序:

本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构;

基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内无新增证券交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
招商证券	120,449,807.10	3.86%	1,929,980,000.00	0.75%	-	-
海通证券	3,007,201,786.32	96.14%	256,635,400,000.00	99.25%	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2014年1月4日发布《关于增加注册资本及修改公司章程的公告》,披露基金管理人注册资本增至28,000万元人民币并据此修改了公司章程。

浦银安盛基金管理有限公司
二〇一五年三月二十六日