

**浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金2015年半年度报告**

**2015年06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**

**送出日期：2015年08月25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。本半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2015年8月21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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

§1	重要提示及目录	2
§2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6	半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1	资产负债表	15
6.2	利润表	16
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4	报表附注	19
§7	投资组合报告	41
7.1	期末基金资产组合情况	42
7.2	期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.6	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	43
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	43
7.8	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	43
7.9	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	43
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12	投资组合报告附注	44
§8	基金份额持有人信息	45
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	45
8.3	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	46
§9	开放式基金份额变动	46
§10	重大事件揭示	47
10.1	基金份额持有人大会决议	47
10.2	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	47
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4	基金投资策略的改变	47

10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
10.6	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 .....	47
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8	其他重大事件 .....	49
§11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	50
§12	备查文件目录 .....	50
12.1	备查文件目录 .....	50
12.2	存放地点 .....	51
12.3	查阅方式 .....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	浦银安盛幸福回报定开债券	
基金主代码	519118	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年09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	848,209,494.24	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛幸福回报定开债券A	浦银安盛幸福回报定开债券B
下属分级基金的基金代码	519118	519119
报告期末下属分级基金的份额总额	780,262,932.65	67,946,561.59

### 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	汤嵩彦
	联系电话	021-23212888	95559
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95559
传真		021-23212985	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区浦东大道981号3幢316室	上海市浦东新区银城中路188号
办公地址		上海市淮海中路381号中环广场38楼	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码		200020	200120
法定代表人		姜明生	牛锡明

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

	报告期（2015年01月01日-2015年06月30日）
--	------------------------------

3.1.1 期间数据和指标	浦银安盛幸福回报定开债券A	浦银安盛幸福回报定开债券B
本期已实现收益	31,794,944.36	2,633,727.49
本期利润	47,004,574.39	3,952,392.47
加权平均基金份额本期利润	0.0602	0.0582
本期基金加权平均净值利润率	5.77%	5.60%
本期基金份额净值增长率	5.92%	5.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年06月30日)	
期末可供分配利润	56,607,260.27	4,542,516.62
期末可供分配基金份额利润	0.0725	0.0669
期末基金资产净值	837,292,886.03	72,521,413.52
期末基金份额净值	1.0730	1.0670
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	22.35%	21.12%

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。

4、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

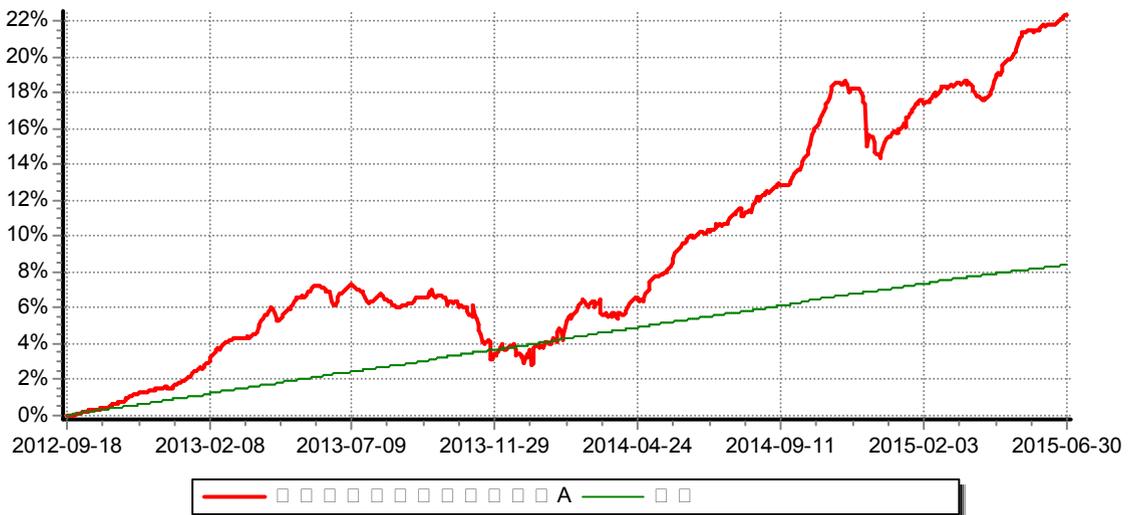
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

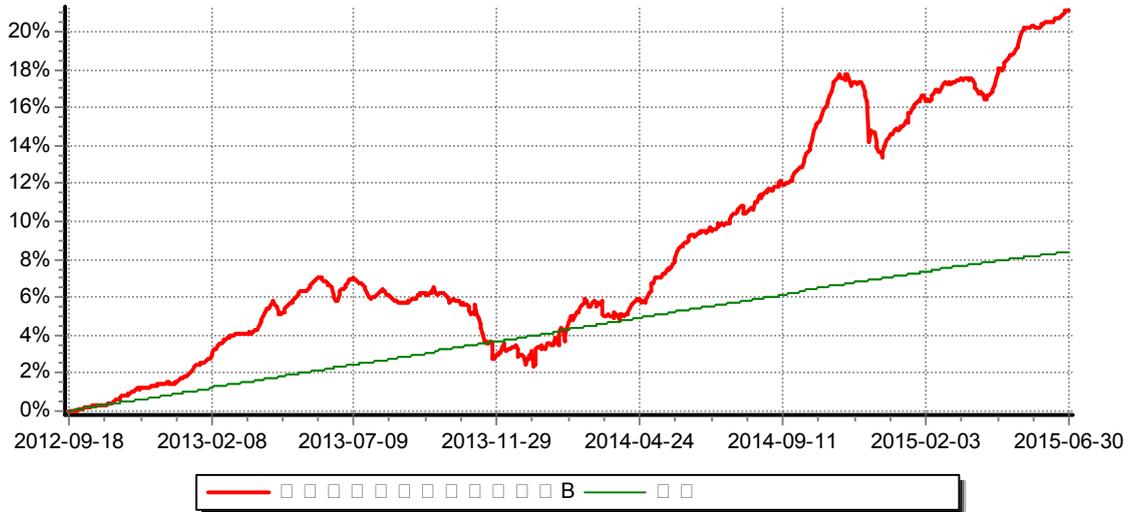
阶段 (浦银安盛幸福回报 定开债券A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.75%	0.06%	0.19%	0.01%	0.56%	0.05%
过去三个月	3.67%	0.10%	0.59%	0.01%	3.08%	0.09%
过去六个月	5.92%	0.11%	1.25%	0.01%	4.67%	0.10%
过去一年	11.08%	0.18%	2.76%	0.01%	8.32%	0.17%

自基金合同生效起至今	22.35%	0.17%	8.41%	0.01%	13.94%	0.16%
阶段 (浦银安盛幸福回报 定开债券B)	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
过去一个月	0.76%	0.05%	0.19%	0.01%	0.57%	0.04%
过去三个月	3.59%	0.10%	0.59%	0.01%	3.00%	0.09%
过去六个月	5.75%	0.11%	1.25%	0.01%	4.50%	0.10%
过去一年	10.59%	0.18%	2.76%	0.01%	7.83%	0.17%
自基金合同生效起至今	21.12%	0.16%	8.41%	0.01%	12.71%	0.15%

### 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09月18日-2015年06月30日)





## § 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管理有限公司，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2015年6月30日止，浦银安盛旗下共管理19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、浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金、浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金及浦银安盛医疗健康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		
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、	2012年09月18日	—	9	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。

	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。
姜锡峰	公司旗下固定收益基金经理助理	2015年06月01日	—	4	姜锡峰先生，上海财经大学企业管理专业硕士。曾就职于湘财证券研究所担任固定收益研究员。2014年3月加盟浦银安盛基金管理有限公司担任固定收益研究员之职。2015年6月起调至固定收益投资部任固定收益基金经理助理。
丁进	原固定收益类基金经理助理	2012年09月18日	2015年02月06日	10	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。丁进于2015年2月6日离职。
--	--	--	--	--	--

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，他们的任职日期为本基金成立之日。

- 2、其余的任职日期和离职日期为公司决定的聘任日期和解聘日期。
- 3、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，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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已制定了《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 and 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。

##### 4.3.2 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 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

上半年的宏观经济走势可以概括为4个字，底部徘徊。在经历了多重刺激之后，各类经济数据没有明显的改善，只有房地产业呈现出复苏的迹象。受资金市场宽松和刺激政策影响，上半年债券市场各品种收益率均出现了一定的下行，债券市场经历了一轮小牛市。上半年资金面、基本面和政策面的利好因素已被市场反应，下半年市场走向将取决于资金面和新的政策催化剂。目前来看，政策仍有进一步放松的空间，预计债券市场行情仍将持续，后期仍有下行空间。在报告期内，基金借力较为宽松的资金面，获取稳定的息差，并择机参与了一些债券品种的资本利得机会。

##### 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5.92%，B类净值增长率5.75%，同期业绩比较基准收益率为1.25%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为宏观经济下半年继续向下寻底的可能性已然不大，但海外流动性收紧带来的资金外流对国内经济会产生一定的负面影响。我们预计接下来仍将陆续会有政策出台，货币政策宽松仍会延续。总的来说，下半年的GDP仍将处在走廊之中，预计走势会相对稳定。稳中偏弱的宏观经济和相对低位的资金利率将有助于下半年债券市场行情的开展。

#### 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》。

本基金管理人与中证指数有限公司签订了《债券估值数据服务协议》。

#### 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。

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

2015年上半年度，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投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2015年上半年度，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、基金份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。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2015年上半年度，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半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 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：2015年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年06月30日	上年度末 2014年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	114,638,935.03	1,020,436.51
结算备付金		58,308,669.74	17,426,380.14
存出保证金		40,157.36	171,016.16
交易性金融资产	6.4.7.2	1,349,259,195.04	1,359,663,201.10
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		1,349,259,195.04	1,339,721,201.10
资产支持证券投资		—	19,942,000.00
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	98,086.69
应收利息	6.4.7.5	34,650,891.94	26,969,442.48
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		1,556,897,849.11	1,405,348,563.08

负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年06月30日	上年度末 2014年12月31日
<b>负 债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债		—	—
卖出回购金融资产款		584,099,650.45	545,399,664.00
应付证券清算款		62,025,976.71	18,988.60
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		521,263.46	512,446.53
应付托管费		148,932.43	146,413.32
应付销售服务费		20,777.81	20,459.13
应付交易费用	6.4.7.7	3,853.45	5,528.60
应交税费		—	—
应付利息		14,573.14	37,730.21
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	248,522.11	350,000.00
负债合计		647,083,549.56	546,491,230.39
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	848,209,494.24	848,209,494.24
未分配利润	6.4.7.10	61,604,805.31	10,647,838.45
所有者权益合计		909,814,299.55	858,857,332.69
负债和所有者权益总计		1,556,897,849.11	1,405,348,563.08

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.073元，基金份额总额848,209,494.24份，其中A类基金份额净值1.073元，份额总额780,262,932.65份；B类基金份额净值1.067元，份额总额67,946,561.59份。

## 6.2 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：2015年01月01日-2015年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年01月01日- 2015年06月30日	上年度可比期间 2014年01月01日- 2014年06月30日
一、收入		62,943,280.02	62,485,627.17
1.利息收入		42,550,898.55	41,638,294.58
其中：存款利息收入	6.4.7 .11	483,161.07	629,718.47
债券利息收入		41,822,539.31	41,008,576.11
资产支持证券利息收入		220,931.50	—
买入返售金融资产收入		24,266.67	—
其他利息收入		—	—
2.投资收益		3,864,086.46	-4,530,683.45
其中：股票投资收益	6.4.7 .12	—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7 .13	3,820,820.71	-4,530,683.45
资产支持证券投资收益	6.4.7 .13.3	43,265.75	—
贵金属投资收益	6.4.7 .14	—	—
衍生工具收益	6.4.7 .15	—	—
股利收益	6.4.7 .16	—	—
3.公允价值变动收益	6.4.7 .17	16,528,295.01	25,378,016.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7 .18	—	—

减：二、费用		11,986,313.16	16,885,360.26
1. 管理人报酬		3,069,440.29	2,510,844.30
2. 托管费		876,982.92	717,384.18
3. 销售服务费		122,430.10	166,766.78
4. 交易费用	6.47 .19	3,051.07	10,104.66
5. 利息支出		7,713,966.67	13,334,408.85
其中：卖出回购金融资产支出		7,713,966.67	13,334,408.85
6. 其他费用	6.47 .20	200,442.11	145,851.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		50,956,966.86	45,600,266.91
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		50,956,966.86	45,600,266.91

### 6.3 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：2015年01月01日-2015年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年06月30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)	848,209,494.24	10,647,838.45	858,857,332.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	50,956,966.86	50,956,966.86
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）	848,209,494.24	61,604,805.31	909,814,299.55
项 目	上年度可比期间 2014年01月01日-2014年06月30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)	718,902,178.33	-15,447,422.91	703,454,755.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	45,600,266.91	45,600,266.91
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）	718,902,178.33	30,152,844.00	749,055,022.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

郁蓓华

郁蓓华

钱琨

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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,由基金管理人浦银安盛基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2012年9月18日正式生效,首次设立募集规模为2,015,420,376.52份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。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。封闭期结束之后第一个工作日起进入为期5至20个工作日的开放期,如此轮替。即一年的封闭期结束之后每次打开申购与赎回业务办理时间达到5至20个工作日,自由开放期的具体期间由基金管理人在上一个运作周期结束前公告说明。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。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)。

#### 6.4.2 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准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《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<年度报告和半年度报告>》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。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1至3月，财政部制定了《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》和《企业会计准则第41号--在其他主体中权益的披露》；修订了《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》和《企业会计准则第33号--合并财务报表》；上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月，财政部修订了《企业会计准则第37号--金融工具列报》，在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本基金的财务报表无重大影响。

#### 6.4.3 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2015年06月30日的财务状况以及2015年01月01日至6月30日的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 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政策、会计估计与最近一期年度报告相一致，除下述事项外，其他与前期一致。

（对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。）

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期改为采用中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定, 自2004年1月1日起, 对证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入, 继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定, 对证券投资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。

### 6.4.6.2 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定, 对基金取得的股票的股息、红利收入, 债券的利息收入、储蓄存款利息收入, 由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定, 自2008年10月9日起, 对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

项目	本期末 2015年06月30日
活期存款	114,638,935.03
定期存款	—

其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	114,638,935.03

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2015年06月30日			
	成本	公允价值	估值增值	
股票	—	—	—	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	
债券	交易所市场	1,015,975,815.80	1,015,439,505.04	-536,310.76
	银行间市场	331,609,978.52	333,819,690.00	2,209,711.48
	合计	1,347,585,794.32	1,349,259,195.04	1,673,400.72
资产支持证券	—	—	—	
其他	—	—	—	
合计	1,347,585,794.32	1,349,259,195.04	1,673,400.72	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金在本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末:2015年06月30日
应收活期存款利息	4,679.36
应收定期存款利息	—

应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	23,635.97
应收债券利息	34,622,560.32
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	16.29
合计	34,650,891.94

注：此处其他列示的是基金存于上交所与深交所的结算保证金的期末应收利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金在本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年06月30日
交易所市场应付交易费用	—
银行间市场应付交易费用	3,853.45
合计	3,853.45

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提审计费	109,671.58
预提信息披露费	138,850.53
合计	248,522.11

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年06月30日
----	----------------------------

(浦银安盛幸福回报定开债券 A)	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	780,262,932.65	780,262,932.65
本期申购	—	—
本期赎回	—	—
期末数	780,262,932.65	780,262,932.65
项目 (浦银安盛幸福回报定开债券 B)	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	67,946,561.59	67,946,561.59
本期申购	—	—
本期赎回	—	—
期末数	67,946,561.59	67,946,561.59

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目 (浦银安盛幸福回报定开债券 A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	24,812,315.91	- 14,786,936. 92	10,025,378.99
本期利润	31,794,944.36	15,209,630. 03	47,004,574.39
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	—	—	—
本期末	56,607,260.27	422,693.11	57,029,953.38

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

(浦银安盛幸福回报定开债券 B)			
上年度末	1,908,789.13	1,286,329.67	622,459.46
本期利润	2,633,727.49	1,318,664.98	3,952,392.47
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	—	—	—
本期末	4,542,516.62	32,335.31	4,574,851.93

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年06月30日
活期存款利息收入	45,937.85
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	436,343.91
其他	879.31
合计	483,161.07

注：此处其他列示的是基金上交所与深交所结算保证金利息。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2015年01月01日-2015年06月30日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	3,820,820.71
债券投资收益——赎回差价 收入	—
债券投资收益——申购差价 收入	—
合计	3,820,820.71

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年01月01日-2015年06月30日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	295,540,285.21
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	284,882,916.13
减：应收利息总额	6,836,548.37
买卖债券差价收入	3,820,820.71

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015年01月01日-2015年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	20,207,123.28
减：卖出资产支持证券成本 总额	20,000,000.00
减：应收利息总额	163,857.53
资产支持证券投资收益	43,265.75

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015年01月01日-2015年06月30日
1.交易性金融资产	16,528,295.01
——股票投资	—
——债券投资	16,470,295.01
——资产支持证券投资	58,000.00
——贵金属投资	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	16,528,295.01

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金在本报告期末无其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年06月30日
交易所市场交易费用	426.07
银行间市场交易费用	2,625.00
合计	3,051.07

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年06月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	138,850.53
银行汇划费用	3,120.00
债券帐户维护费	18,000.00
其他费用	800.00
沪深股东帐户开户费	—
合计	200,442.11

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
上海浦东发展银行股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金代销机构

浦银安盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期与上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.1.4 债券交易

本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.5 债券回购交易

本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年01月01日- 2015年06月30日	上年度可比期间 2014年01月01日- 2014年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,069,440.29	2,510,844.30
其中：支付销售机构的客户维护费	1,429,928.03	1,024,034.97

注：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.7%的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% / \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年01月01日- 2015年06月30日	上年度可比期间 2014年01月01日- 2014年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	876,982.92	717,384.18

注：在通常情况下，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.10.2.3 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 2015年01月01日-2015年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浦银安盛幸福回报 定开债券A	浦银安盛幸福回报 定开债券B	合计
交通银行股份有限公司	—	22,421.57	22,421.57
上海浦东发展银行股份有限公司	—	64,794.27	64,794.27
浦银安盛基金管理有 限公司	—	644.14	644.14
合计	—	87859.98	87859.98
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	浦银安盛幸福回报 定开债券A	浦银安盛幸福回报 定开债券B	合计
交通银行股份有限公司	—	10,788.09	10,788.09
上海浦东发展银行股份有限公司	—	101,152.81	101,152.81
浦银安盛基金管理有 限公司	—	392.55	392.55
合计	—	112333.45	112333.45

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，B类基金份额的销售服务费年费率为0.35%。

本基金B类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H=E \times 0.35\% / \text{当年天数}$$

H为B类基金份额每日应计提的销售服务费

E为B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销售服务费划付指令，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，由注册登记机构代收，注册登记机构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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期和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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

浦银安盛幸福回报债券A

基金管理人在本报告期与上年度可比期间均未持有浦银安盛幸福回报债券A。

**浦银安盛幸福回报债券B**

基金管理人在本报告期与上年度可比期间均未持有浦银安盛幸福回报债券B。

**6.4.10.4.2 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****浦银安盛幸福回报债券A类**

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有幸福回报债券A。

**浦银安盛幸福回报债券B类**

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有幸福回报债券B。

**6.4.10.5 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 2015年01月01日-2015年06月 30日		上年度可比期间 2014年01月01日-2014年06月 30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份 有限公司	114,638,935.03	45,937.85	64,925.43	30,518.25

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金在本报告期和上年度可比期间的承销期内均未参与关联方承销的证券。

**6.4.10.7 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无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况****6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2015年06月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金在本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金在本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30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金融资产款余额人民币66,099,700.85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
101456083	14凉山 国投 MTN00 2	2015-07-06	101.92	200,000	20,384,000.00
101569011	15京建 工 MTN00 1	2015-07-06	98.95	300,000	29,685,000.00
101569012	15舟山 海洋 MTN00 1	2015-07-06	99.49	200,000	19,898,000.00
合计				700,000	69,967,000.00

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30日止，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人民币517,999,949.60元，于2015年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

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。

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。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在科学的风险管理的前提下，实现基金财产的安全和增值。

#### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在科学的风险管理的前提下，实现基金财产的安全和增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理，设立了多层次的风险控制体系：第一层次为公司各业务部门对各自部门潜在风险的自我管理和检查；第二层次为公司总经理领导的管理层、风险控制委员会、合规风控部的风险管理；第三层次为公司董事会层面对公司的风险管理，包括董事会、合规及审计委员会、督察长和合规风控部。本基金的基金管理人下设的各业务部门是公司第一线风险控制的实施者，均备有符合法律法规、公司政策的业务流程，其中包含与其业务相关的风险控制措施、风险管理计划、工作流程和管理责任。这些流程均得到公司管理层的批准。本基金的基金管理人设立的风险控制委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权利机构，制定公司的风险管理政策，并监督实施，确保公司整体风险暴露得到有效的识别、评估、监控和控制。公司设立合规风控部，独立地监控公司面临的各类风险。

合规风控部建立了定性和数量化分析模型进行基金投资风险和绩效评估。合规风控部根据基金相关法律法规、公司基本制度及业务流程，对信息披露、法律文件等进行事中审核，并对基金管理人经营活动及各职能部门履职情况的合法合规性进行监督和检查。董事会下属的合规及审计委员会，负责对公司整体风险管理和内部控制的有效性

进行审议和评估。同时，督察长及合规风控部会负责检查、评价公司风险控制的充分性和有效性，并向董事会报告。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

##### 6.4.13.2.1按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015年06月30日	上年度末 2014年12月31日
A-1	—	—
A-1以下	—	—
未评级	—	19,942,000.00
合计	—	19,942,000.00

注：持有发行期限在一年以内的信用债按其债项的短期信用评级列示，持有的其他信用债以其债项评级作为长期信用评级进行披露。

##### 6.4.13.2.2按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2015年06月30日	2014年12月31日
AAA	208,018,568.10	144,912,738.00
AAA以下	1,141,240,626.94	1,194,808,463.10
未评级	—	—
合计	1,349,259,195.04	1,339,721,201.10

注：持有发行期限在一年以内的信用债按其债项的短期信用评级列示，持有的其他信用债以其债项评级作为长期信用评级进行披露。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于开放期内基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

由于本基金以定期开放方式运作，针对定期开放时兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人会在运作期保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金所持大部分证券可在证券交易所上市，其余亦在银行间同业市场交易，除在6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于2015年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有584,099,650.45元将在2015年7月1日到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险及其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资

组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年06月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	114,638,935.03	—	—	—	114,638,935.03
结算备付金	58,308,669.74	—	—	—	58,308,669.74
存出保证金	40,157.36	—	—	—	40,157.36
交易性金融资产	117,604,478.50	790,509,085.44	441,145,631.10	—	1,349,259,195.04
衍生金融资产	—	—	—	—	—
买入返售金融资产	—	—	—	—	—
应收证券清算款	—	—	—	—	—
应收利息	—	—	—	34,650,891.94	34,650,891.94
应收股利	—	—	—	—	—
应收申购款	—	—	—	—	—
其他资产	—	—	—	—	—
资产总计	290,592,240.63	790,509,085.44	441,145,631.10	34,650,891.94	1,556,897,849.11
负债					
卖出回购金融资产款	584,099,650.45	—	—	—	584,099,650.45
应付证券清算款	—	—	—	62,025,976.71	62,025,976.71
应付赎回款	—	—	—	—	—

应付管理人报酬	—	—	—	521,263.46	521,263.46
应付托管费	—	—	—	148,932.43	148,932.43
应付销售服务费	—	—	—	20,777.81	20,777.81
应付交易费用	—	—	—	3,853.45	3,853.45
应交税费	—	—	—	—	—
应付利息	—	—	—	14,573.14	14,573.14
应付利润	—	—	—	—	—
其他负债	—	—	—	248,522.11	248,522.11
负债总计	584,099,650.45	—	—	62,983,899.11	647,083,549.56
利率敏感度缺口	-293,507,409.82	790,509,085.44	441,145,631.10	-28,333,007.17	909,814,299.55
上年度末 2014年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,020,436.51	—	—	—	1,020,436.51
结算备付金	17,426,380.14	—	—	—	17,426,380.14
存出保证金	171,016.16	—	—	—	171,016.16
交易性金融资产	174,465,830.50	648,717,096.60	536,480,274.00	—	1,359,663,201.10
衍生金融资产	—	—	—	—	—
买入返售金融资产	—	—	—	—	—
应收证券清算款	—	—	—	98,086.69	98,086.69
应收利息	—	—	—	26,969,442.48	26,969,442.48

应收股利	—	—	—	—	—
应收申购款	—	—	—	—	—
其他资产	—	—	—	—	—
资产总计	193,083,663.31	648,717,096.60	536,480,274.00	27,067,529.17	1,405,348,563.08
负债					
卖出回购金融资产款	545,399,664.00	—	—	—	545,399,664.00
应付证券清算款	—	—	—	18,988.60	18,988.60
应付赎回款	—	—	—	—	—
应付管理人报酬	—	—	—	512,446.53	512,446.53
应付托管费	—	—	—	146,413.32	146,413.32
应付销售服务费	—	—	—	20,459.13	20,459.13
应付交易费用	—	—	—	5,528.60	5,528.60
应交税费	—	—	—	—	—
应付利息	—	—	—	37,730.21	37,730.21
应付利润	—	—	—	—	—
其他负债	—	—	—	350,000.00	350,000.00
负债总计	545,399,664.00	—	—	1,091,566.39	546,491,230.39
利率敏感度缺口	352,316,000.69	648,717,096.60	536,480,274.00	25,975,962.78	858,857,332.69

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2015年06月30日	上年度末 2014年12月31日
	市场利率上升0.25%	-8,736,133.1000	-9,074,037.6100
	市场利率下降0.25%	8,831,625.7200	9,176,958.8000

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2015年06月30日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资	—	—	—	—

产-股票投资				
交易性金融资产-债券投资	1,349,259,195.04	148.30	1,359,663,201.10	158.31
交易性金融资产-贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,349,259,195.04	148.30	1,359,663,201.10	158.31

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于2015年6月30日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为0.00%（2014年12月31日同），因此2015年6月30日除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2014年12月31日同）。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	1,349,259,195.04	86.66
	其中：债券	1,349,259,195.04	86.66
	资产支持证券	—	—
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	172,947,604.77	11.11

7	其他资产	34,691,049.30	2.23
8	合计	1,556,897,849.11	100.00

## 7.2 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。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.5 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	1,197,763,195.04	131.65
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	151,496,000.00	16.65
7	可转债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	1,349,259,195.04	148.30

## 7.6 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

金额单位：人民币元

序	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净
---	------	------	-------	------	--------

号					值比例(%)
1	122781	11永州债	630,000	68,355,000.00	7.51
2	124487	14邵城投	600,000	64,656,000.00	7.11
3	124785	14青州债	500,000	53,220,000.00	5.85
4	122767	11盐城南	487,000	52,138,220.00	5.73
5	112232	14长证债	500,000	51,520,000.00	5.66

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 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。

#### 7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 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。

##### 7.10.2 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。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 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。

##### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 7.11.3 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。

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 报告期内，本基金投资前十名股票不存在超出基金合同规定备选股票库投资的情况。

### 7.12.3 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	40,157.36
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	34,650,891.94
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	34,691,049.30

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 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 基金份额持有人信息

### 8.1 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
浦银安盛幸福回报定期开放债券A	5,640	138,344.49	93,403,844.81	11.97%	686,859,087.84	88.03%
浦银安盛幸福回报定期开放债券B	761	89,285.89	550,470.25	0.81%	67,396,091.34	99.19%
合计	6,401	132,512.03	93,954,315.06	11.08%	754,255,179.18	88.92%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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开放式基金	浦银安盛幸福回报定期开放债券A	—	—
	浦银安盛幸福回报定期开放债券B	100,067.50	0.147%
	合计	100,067.50	0.012%

## 8.3 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	浦银安盛幸福回报定期开放债券A	0
	浦银安盛幸福回报定期开放债券B	10~50

	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	浦银安盛幸福回报 定开债券A	0
	浦银安盛幸福回报 定开债券B	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	浦银安盛幸福回报定 开债券A	浦银安盛幸福回报定 开债券B
基金合同生效日(2012年09月18日) 基金份额总额	1,617,733,471.53	397,686,904.99
本报告期期初基金份额总额	780,262,932.65	67,946,561.59
本报告期基金总申购份额	—	—
减：本报告期基金总赎回份额	—	—
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	780,262,932.65	67,946,561.59

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

公司于2015年3月12日第三届董事会第五次会议中通过决议，为本基金提供审计的会计师事务所变更为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。公司已于2015年3月14日编制临时公告，披露于中国证券报、上海证券报和证券时报。

### 10.6 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

本报告期内基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	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	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	—	—	242,599,587.98	100.00%	66,752,900.00	100.00%	—	—	—	—	
东兴证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
中信建投	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
平安证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
广发证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
浙商证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
爱建证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
东北证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
宏源证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
长江证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	

中信 证券	1		-		-		-		-	-	-	
川财 证券	2		-		-		-		-	-	-	
光大 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：

本基金本报告期新增光大证券交易单元。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	关于旗下部分基金增加广发证券为代销机构并开通定投及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2015-01-08
2	关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2015-01-20
3	浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金2014年第4季度报告（全文）	报刊及公司网站	2015-01-22
4	浦银安盛关于旗下部分基金新增一路财富（北京）信息科技有限公司为代销机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2015-02-09

5	关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	报刊及公司网站	2015-03-14
6	浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金2014年年度报告(正文)	公司网站	2015-03-26
7	浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金2014年年度报告摘要	报刊及公司网站	2015-03-26
8	关于调整旗下基金所持交易所固定收益品种估值方法的公告	报刊及公司网站	2015-04-01
9	关于旗下部分基金新增宜投基金为代销机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2015-04-03
10	浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金2015年第1季度报告(全文)	报刊及公司网站	2015-04-21
11	浦银安盛基金管理有限公司关于股东变更的公告	报刊及公司网站	2015-04-22
12	关于旗下部分基金新增中金公司为代销机构的公告	报刊及公司网站	2015-04-24
13	浦银安盛幸福回报定期开放债券型基金招募说明书更新正文(2015年第1号)	公司网站	2015-04-30
14	浦银安盛幸福回报定期开放债券型基金招募说明书更新摘要(2015年第1号)	报刊及公司网站	2015-04-30
15	关于旗下部分基金新增中山证券为代销机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2015-06-24
16	浦银安盛基金管理有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2015-06-27
17	浦银安盛基金管理有限公司关于	报刊及公司网站	2015-06-30

	调整长期停牌股票估值方法的公告		
--	-----------------	--	--

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2015年4月22日发布《浦银安盛基金管理有限公司关于股东变更的公告》，公告披露：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。相关工商变更登记手续已办理完毕并已报中国证监会备案。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、 中国证监会批准浦银安盛幸福回报定期开放式债券型证券投资基金设立的文件
- 2、 浦银安盛幸福回报定期开放式债券型证券投资基金基金合同
- 3、 浦银安盛幸福回报定期开放式债券型证券投资基金招募说明书
- 4、 浦银安盛幸福回报定期开放式债券型证券投资基金托管协议
- 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

### 12.2 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。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（[www.py-axa.com](http://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

二〇一五年八月二十五日