

浦银安盛增利分级债券型证券投资基金

2013 年年度报告摘要

2013 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

报告送出日期：二〇一四年三月二十七日

§ 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。

基金托管人上海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 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	浦银安盛增利分级债券（场内简称：浦银增利）	
基金主代码	166401	
交易代码	166401	
基金运作方式	契约型(创新封闭式). 本基金基金封闭期为三年(含三年), 封闭期届满后转为上市开放式基金(LOF).	
基金合同生效日	2011年12月13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	905,860,918.69 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2012-03-09	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛增利分级债券 A （场内简称：浦银增 A）	浦银安盛增利分级债券 B （场内简称：浦银增 B）
下属分级基金的交易代码	150062	150063
报告期末下属分级基金的份额	634,102,654.37 份	271,758,264.32 份

总额		
----	--	--

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资风险的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。	
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	中信标普全债指数	
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，属于证券投资基金中的较低风险品种。一般情形下，其风险收益预期低于股票型基金、混合型基金，高于货币型基金。	
下属两级基金的风险收益特征	从本基金所分成的两类基金份额来看，由于本基金资产及收益的分配安排，A 类份额为预期风险低、预期收益相对稳定的基金份额。	从本基金所分成的两类基金份额来看，由于本基金资产及收益的分配安排，B 类份额为预期风险较高、预期收益较高的基金份额。

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	2013 年	2012 年	2011 年 12 月 13 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	65,321,416.33	67,813,943.29	1,170,669.16
本期利润	-14,047,619.12	108,960,902.03	1,938,975.97
加权平均基金份额本期利润	-0.0155	0.1203	0.0021
本期基金份额净值增长率	-1.34%	11.98%	0.20%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1069	0.0762	0.0013
期末基金资产净值	1,002,713,177.57	1,016,760,796.69	907,799,894.66
期末基金份额净值	1.107	1.122	1.002

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

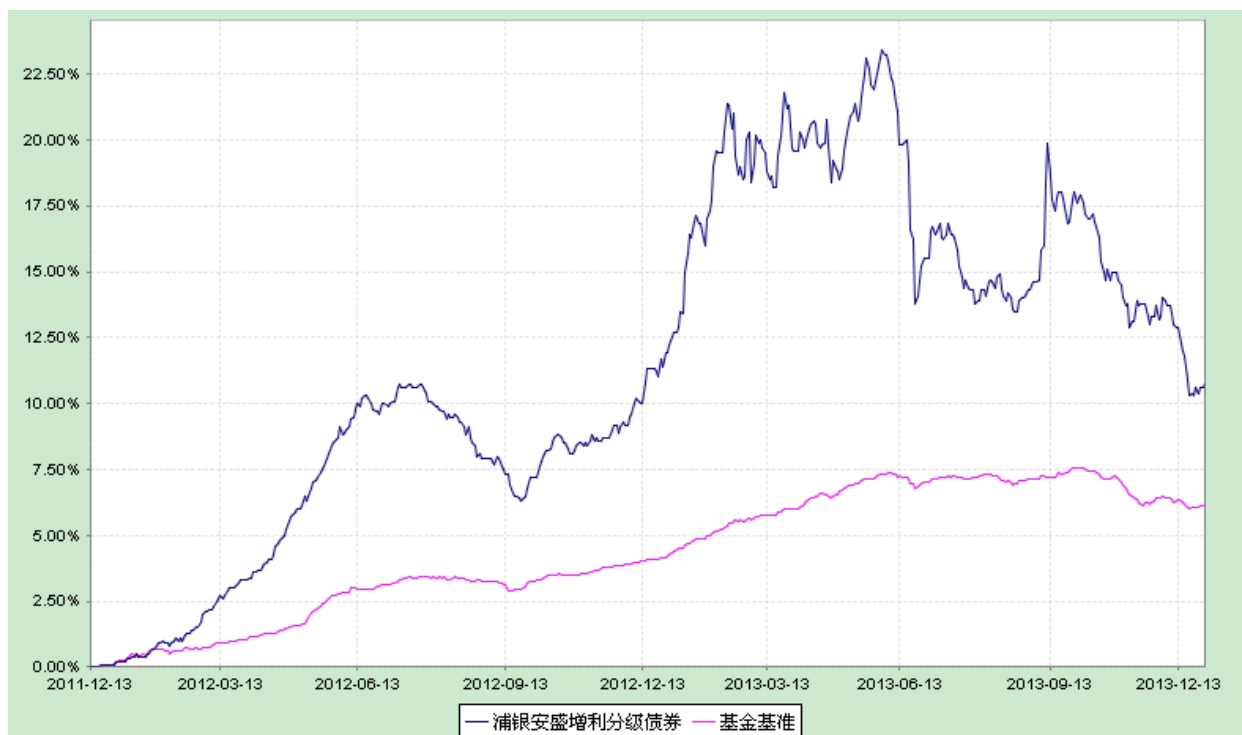
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-5.30%	0.32%	-1.20%	0.06%	-4.10%	0.26%
过去六个月	-4.16%	0.39%	-0.82%	0.05%	-3.34%	0.34%
过去一年	-1.34%	0.50%	1.78%	0.05%	-3.12%	0.45%
自基金合同生效起至今	10.70%	0.36%	6.15%	0.04%	4.55%	0.32%

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

浦银安盛增利分级债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

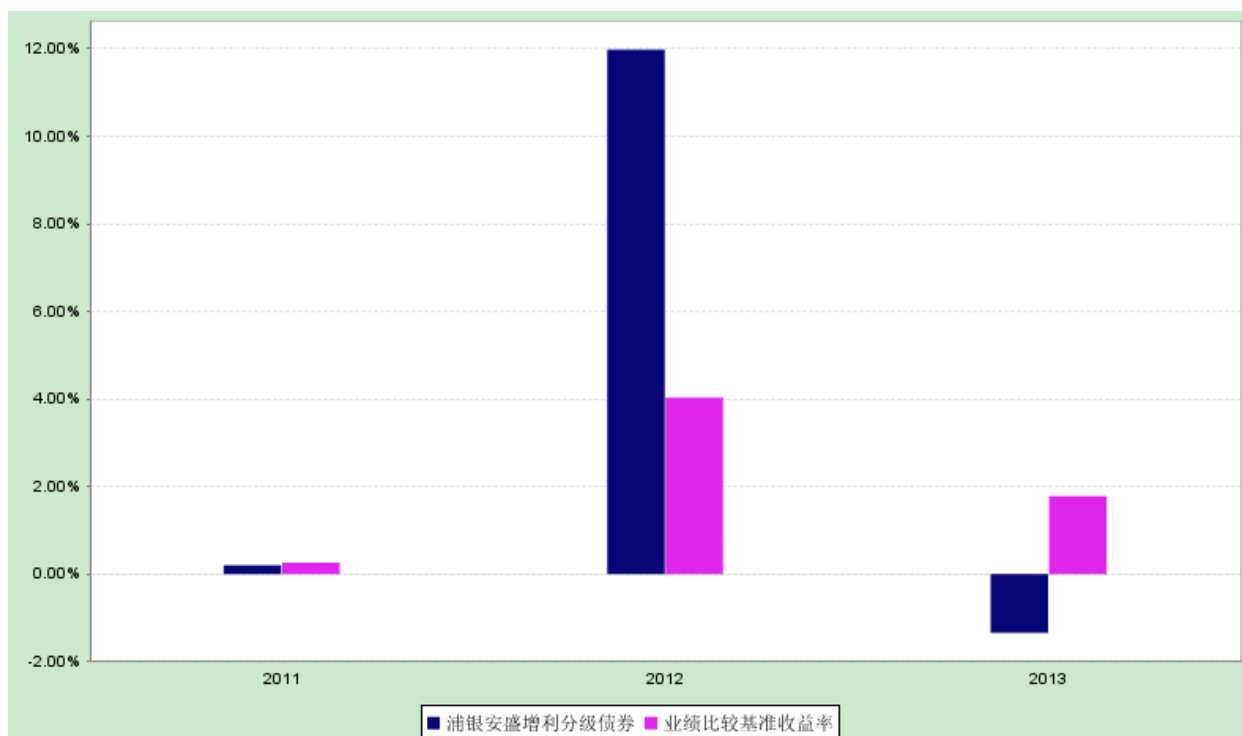
(2011 年 12 月 13 日至 2013 年 12 月 31 日)



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

浦银安盛增利分级债券型证券投资基金

合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注：本基金合同于 2011 年 12 月 13 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

本基金过去三年未进行过利润分配，本基金基金合同生效日为 2011 年 12 月 13 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，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、浦银安盛幸福回报定期开放债券基金基金经理、浦银安盛6个月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	2011-12-13	-	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，担任本基金基金经理。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，担任浦银安盛6个月定期开放债券基金基金经理。2013年6月起，担任浦银安盛季季添利定期开放债券基金基金经理。
丁进	本公司旗下固定收益基金基金经理助理	2012-08-15	-	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、除作为本基金的首任基金经理，其任职日期为本基金成立之日外，本表所述“任职日期”和“离任日期”均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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。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。尽管从传统基本面有利于债市，但是新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 年基金重点配置信用债和可转债，下半年在应对冲击调整了部分结构，信用债久期适当降低。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

浦银增利分级全年净值增长率为-1.34%，业绩比较基准收益率为 1.78%。

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部流动性冲击、内部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热衷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、监察稽核部负责人、基金会计部负责人组成。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》第十七部分第三条约定，在封闭期内，本基金不对 A 类份额与 B 类份额进行收益分配。

本基金自 2013 年 1 月 1 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，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、《浦银安盛增利分级债券型证券投资基金基金合同》和《浦银安盛增利分级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关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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对浦银安盛基金管理有限公司浦银安盛幸福回报定期开

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(安永华明(2014)审字第 60951783_B01 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: 浦银安盛增利分级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	3,132,201.13	35,216,290.82
结算备付金		93,193,681.23	25,029,560.99
存出保证金		107,152.52	250,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	1,721,861,102.96	1,943,369,931.59
其中: 股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,721,861,102.96	1,943,369,931.59
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	-	-
应收证券清算款		-	21,813,373.45
应收利息	7.4.7.5	37,552,026.01	41,824,016.58
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		1,855,846,163.85	2,067,503,173.43
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		848,499,712.90	1,048,799,138.70
应付证券清算款		3,082,637.41	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		604,007.81	593,996.65
应付托管费		172,573.65	169,713.33
应付销售服务费		302,003.86	296,998.34
应付交易费用	7.4.7.7	2,050.65	6,857.70
应交税费		-	-
应付利息		-	235,672.02
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	470,000.00	640,000.00
负债合计		853,132,986.28	1,050,742,376.74
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	905,860,918.69	905,860,918.69
未分配利润	7.4.7.10	96,852,258.88	110,899,878.00
所有者权益合计		1,002,713,177.57	1,016,760,796.69
负债和所有者权益总计		1,855,846,163.85	2,067,503,173.43

注：1、报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.107 元，基金份额总额 905,860,918.69 份，其中 A 类基金份额参考净值 1.108 元，份额总额 634,102,654.37 份；B 类基金份额参考净值 1.105 元，份额总额 271,758,264.32 份。

2、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：浦银安盛增利分级债券型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日

一、收入		42,334,959.76	146,899,206.93
1. 利息收入		91,351,067.87	84,999,020.87
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,619,132.82	1,077,436.03
债券利息收入		89,731,935.05	83,869,976.09
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	51,608.75
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		30,347,341.55	20,753,227.32
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-14,125,157.83	13,845.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	43,752,499.38	20,739,382.32
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	720,000.00	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-79,369,035.45	41,146,958.74
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	5,585.79	-
减：二、费用		56,382,578.88	37,938,304.90
1. 管理人报酬		7,420,068.46	6,760,415.76
2. 托管费		2,120,019.62	1,931,547.38
3. 销售服务费		3,710,034.38	3,380,207.87
4. 交易费用	7.4.7.19	152,120.50	27,767.59
5. 利息支出		42,482,425.06	25,312,402.04
其中：卖出回购金融资产支出		42,482,425.06	25,312,402.04
6. 其他费用	7.4.7.20	497,910.86	525,964.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,047,619.12	108,960,902.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,047,619.12	108,960,902.03

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛增利分级债券型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1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）	905,860,918.69	110,899,878.00	1,016,760,796.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-14,047,619.12	-14,047,619.12
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）	-	-	-
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）	905,860,918.69	96,852,258.88	1,002,713,177.57
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）	905,860,918.69	1,938,975.97	907,799,894.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	108,960,902.03	108,960,902.03
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）	905,860,918.69	110,899,878.00	1,016,760,796.69

报告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：

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

浦银安盛增利分级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[2011]1704号文《关于核准浦银安盛增利分级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 2011 年 12 月 13 日正式生效，首次设立募集规模为 905,860,918.69 份基金份额。本基金为契约型。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

管人为上海银行股份有限公司。

本基金通过基金资产及收益的不同分配安排，将基金份额分成预期收益与预期风险不同的两个类别，即 A 类份额和 B 类份额。基金发售结束后，场外、场内认购的全部份额均将按照 7：3 的比例确认为 A 类份额和 B 类份额。本基金基金合同生效后进入封闭期，封闭期为 3 年。本基金在封闭期结束后进入折算期，折算期不超过 10 个工作日。在折算期，基金管理人将按照基金合同约定的折算规则，将 A 类份额和 B 类份额分别折算为浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）基金份额。本基金在 A 类份额与 B 类份额折算完成后，将转型为浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF），其存续期限为不定期。

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、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）。

本基金主要投资于国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券、短期融资券、可分离债券、资产支持证券、债券回购和银行存款等固定收益类证券品种。本基金也可投资于非固定收益类证券品种。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股或增发新股的申购，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他非固定收益类证券品种。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金将在其可交易之日起的 90 个交易日内卖出。

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，并可依据届时有有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金在封闭期间，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%。封闭期满转为上市交易开放式基金后，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%，其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金在转型为浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)后，其投资目标、投资范围等将保持不变。

本基金的业绩比较基准为：中信标普全债指数。

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。

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 年度的经营成果和净值变动情况。

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政策、会计估计与 2012 年度报告相一致。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 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、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

3. 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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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。

7.4.7 关联方关系

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
上海银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
上海盛融投资有限公司	基金管理人的股东
法国安盛投资管理有限公司	基金管理人的股东
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

注：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。

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可比期均未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可比期均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金在本报告期及上年度可比期均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期及上年度可比期均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期及上年度可比期均无应支付关联方的佣金。

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 2013年1月1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
当期发生的基金应支付的管理费	7,420,068.46	6,760,415.76
其中：支付销售机构的客户维护费	1,902,309.57	2,148,776.68

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

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 2 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、公休日等，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	上年度可比期间
----	----	---------

	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
	日	日
当期发生的基金应支付的托管费	2,120,019.62	1,931,547.38

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

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 2 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
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
上海银行股份有限公司	1,475,211.19
上海浦东发展银行股份有限公司	1,005,447.84
浦银安盛基金管理有限公司	1,043,890.85
合计	3,524,549.88
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
上海银行股份有限公司	1,465,128.80
上海浦东发展银行股份有限公司	1,267,930.89
浦银安盛基金管理有限公司	497,271.77
合计	3,230,331.46

注：在通常情况下，本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，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销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中划出，由基金管理人按相关合同规定支付给基金销售机构。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

本基金在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****浦银安盛增利分级债券 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增利分级债券 A。

浦银安盛增利分级债券 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增利分级债券 B。

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**浦银安盛增利分级债券 A**

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

浦银安盛增利分级债券 B

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

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 2013年1月1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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海银行-活期存款	3,132,201.13	98,183.20	35,216,290.82	343,953.71
上海银行-定期存款	-	-	-	249,750.00

注：本基金的活期银行存款及定期银行存款由基金托管人上海银行保管，按约定利率计息。

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无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2013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**

本基金在本报告期末未持有因认购新发/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 2013 年 12 月 31 日止，本基金无因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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 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 848,499,712.90 元，于 2014 年 1 月 2 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。

§ 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	1,721,861,102.96	92.78
	其中：债券	1,721,861,102.96	92.78
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	96,325,882.36	5.19
6	其他各项资产	37,659,178.53	2.03
7	合计	1,855,846,163.85	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所有股票投资明细

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	000731	四川美丰	53,015,058.18	5.21
2	600886	国投电力	16,058,863.17	1.58
3	002031	巨轮股份	13,523,293.44	1.33

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（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	000731	四川美丰	41,095,563.91	4.04
2	600886	国投电力	16,603,711.68	1.63
3	002031	巨轮股份	10,772,781.37	1.06

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	82,597,214.79
卖出股票的收入（成交）总额	68,472,056.96

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	51,065,917.20	5.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,018,902,680.19	101.61
5	企业短期融资券	39,894,000.00	3.98
6	中期票据	126,780,000.00	12.64

7	可转债	485,218,505.57	48.39
8	其他	-	-
9	合计	1,721,861,102.96	171.72

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	113001	中行转债	1,070,000	103,073,100.00	10.28
2	113003	重工转债	721,000	84,018,130.00	8.38
3	110020	南山转债	861,100	78,472,043.00	7.83
4	113002	工行转债	548,430	55,583,380.50	5.54
5	122112	11 沪大众	500,010	51,451,029.00	5.13

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.10.2 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。

8.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 报告期内，本基金不存在超出基金合同规定备选股票库投资的情况。

8.11.3 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	107,152.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	37,552,026.01
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,659,178.53

8.11.4 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	113001	中行转债	103,073,100.00	10.28
2	113003	重工转债	84,018,130.00	8.38
3	110020	南山转债	78,472,043.00	7.83
4	113002	工行转债	55,583,380.50	5.54
5	110015	石化转债	45,772,800.00	4.56
6	110023	民生转债	35,443,885.40	3.53
7	110016	川投转债	17,278,311.60	1.72
8	110022	同仁转债	16,739,461.20	1.67
9	127001	海直转债	14,996,640.00	1.50
10	125887	中鼎转债	6,606,284.67	0.66
11	110018	国电转债	5,178,130.00	0.52
12	110007	博汇转债	3,685,566.40	0.37
13	110012	海运转债	3,128,100.00	0.31
14	128001	泰尔转债	3,104,970.00	0.31

15	110019	恒丰转债	2,174,920.00	0.22
16	110017	中海转债	364,680.00	0.04

8.11.5 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。

§ 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
浦银安盛增 利分级债券 A	11,029	57,494.12	198,716,995.87	31.34%	435,385,658.50	68.66%
浦银安盛增 利分级债券 B	11,107	24,467.30	82,700,851.73	30.43%	189,057,412.59	69.57%
合计	22,136	40,922.52	281,417,847.60	31.07%	624,443,071.09	68.93%

9.2 期末上市基金前十名持有人

浦银安盛增利分级债券A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	全国社保基金二零一组合	9,157,303.00	4.25%
2	人保投资控股有限公司-委托证券投资户	8,524,130.00	3.96%
3	中国第一汽车集团公司企业年金计划-中国工商银行	8,376,089.00	3.89%
4	华西证券有限责任公司	7,714,716.00	3.58%
5	中信证券-中信-中信证券稳健回报集合资产管理计划	7,564,843.00	3.51%
6	中国交通建设集团有限公司企业年金计划-交通银行	7,382,809.00	3.43%
7	建信人寿保险有限公司-分红保险产品	7,184,625.00	3.33%
8	工银瑞信基金公司-中行-厦门信托鼎锋稳健1期集合资金信托	6,000,000.00	2.78%
9	国投信托有限公司-国投瑞兴证券投资资金信托	5,600,000.00	2.60%
10	太平人寿保险有限公司	5,254,484.00	2.44%

浦银安盛增利分级债券B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
----	-------	---------	----------

1	全国社保基金二零二组合	11,880,300.00	12.59%
2	全国社保基金一零零三组合	10,700,700.00	11.34%
3	中国大唐集团财务有限公司	8,545,139.00	9.06%
4	全国社保基金二一一组合	7,676,417.00	8.13%
5	安信证券—工行—安信证券瑞丰债券分级集合资产管理计划	7,672,597.00	8.13%
6	全国社保基金一零零七组合	4,935,937.00	5.23%
7	光大资管—工行—光大阳光双季赢集合资产管理计划	3,179,900.00	3.37%
8	海通资管—上海银行—海通月月财集合资产管理计划	2,744,500.00	2.91%
9	全国社保基金二零一组合	2,686,746.00	2.85%
10	齐鲁证券—工行—齐鲁金债基 1 号分级型集合资产管理计划	2,274,309.00	2.41%

9.3 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
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	浦银安盛增利分级债券 A	700.65	0.0001%
	浦银安盛增利分级债券 B	300.57	0.0001%
	合计	1001.22	0.0001%

注：1、本基金管理人高级管理人员、基金投资和部门负责人持有该只基金份额总量为 0；
2、本基金的基金经理持有该只基金份额总量为 0。

§ 10 基金份额变动

单位：份

项目	浦银安盛增利分级债券 A	浦银安盛增利分级债券 B
----	--------------	--------------

本报告期期初基金份额总额	634,102,654.37	271,758,264.32
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	634,102,654.37	271,758,264.32

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、基金管理人于 2013 年 2 月 6 日刊登《浦银安盛基金管理有限公司关于独立董事变更的公告》，披露原独立董事尹应能先生因个人原因申请辞去独立董事一职，由韩启蒙先生接替尹应能先生出任公司第二届董事会独立董事。

2、基金管理人原监事 James Young 先生因个人原因申请辞去公司监事一职，经 2013 年第一次股东会会议审议批准，自 2013 年 2 月 4 日起由 Simon Lopez 先生接替 James Young 先生出任本基金管理人第二届监事会监事。经员工选举，朱敏奕女士于 2013 年 3 月起出任公司职工监事。

3、基金管理人于 2013 年 6 月 25 日刊登《浦银安盛基金管理有限公司关于郁蓓华董事任职的公告》，披露增聘公司总经理郁蓓华女士担任公司第二届董事会董事。

4、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安永华明会计师事务所（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 70,000.00 元，截止本报告期末，安永华明会计师事务所（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稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	51,868,345.28	75.75%	45,898.31	75.23%	-
海通证券	1	16,603,711.68	24.25%	15,116.01	24.77%	-

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：

本基金本报告期内租用证券公司交易单元无变更。

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		回购交易		权证交易		股指期货交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期成交总额的比例
招商证券	486,151,982.68	31.80%	27,198,398,000.00	11.89%	-	-	-	-
海通证券	1,042,456,513.71	68.20%	201,548,800,000.00	88.11%	-	-	-	-

§ 12影响投资者决策的其他重要信息

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。基金管理人于 2013 年 12 月 6 日刊登《关于成立上海浦银安盛资产管理有限公司的公告》，披露子公司正式成立。

浦银安盛基金管理有限公司

二〇一四年三月二十七日