

浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

下半年压力明显,我们预计接下来仍将陆续会有政策出台,政策宽松的力度仍有加大的可能。总的来说,下半年的GDP仍将在走稳之中,预计走势会相对稳定。稳中偏调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的行情开展。

4.6 管理人对于报告期内基金投资程序等事项的说明
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,有效维护投资者的利益,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《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年以上专业工作经历,具备良好的专业素养,能胜任工作和理性。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会计师事务所和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及会计核算履行复核责任,当存有异议时,托管银行有责任要求基金管理人作出合理解释,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。

本基金基金估值采用公允价值进行估值,符合相关法律法规的规定及基金合同约定的。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 管理人对于报告期内基金资产净值变动情况的说明
本基金报告期内资产净值变动情况如下:截至2014年6月30日,本基金资产净值为1,232.17亿元,较期初增长1.04%。

4.9 管理人对于报告期内基金投资业绩情况的说明
本基金报告期内投资业绩情况如下:截至2014年6月30日,本基金累计净值增长率为1.04%,同期业绩比较基准收益率为0.82%。

4.10 管理人对于报告期内基金流动性情况的说明
本基金报告期内流动性情况良好,不存在任何重大流动性风险。

4.11 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.12 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.13 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.14 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.15 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.16 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.17 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.18 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.19 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.20 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.21 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.22 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.23 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.24 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.25 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.26 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.27 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.28 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.29 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.30 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.31 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.32 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.33 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.34 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.35 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.36 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.37 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.38 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.39 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.40 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.41 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.42 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.43 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.44 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.45 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.46 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.47 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.48 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.49 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.50 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.51 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.52 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.53 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.54 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.55 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.56 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.57 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.58 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.59 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.60 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.61 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.62 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.63 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.64 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.65 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.66 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.67 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.68 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.69 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.70 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.71 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.72 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.73 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.74 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.75 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.76 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.77 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.78 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

4.79 管理人对于报告期内基金其他事项的说明
本基金报告期内无其他重大事项。

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、央行票据、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和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。本基金不投资于二级市场上市公司股票或权证,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;开放期前或开放期后在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产的5%。本基金的投资业绩比较基准为:本基金的投资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)X1.1。

6.4.2 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、中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告>》、中国证监会颁布的《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》和在财务报表附注中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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的说明
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2014年06月30日的财务状况以及2014年01月01日至2014年06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、会计估计与上一会计年度保持一致的说明
本报告期所采用的会计政策、会计估计与上一会计年度保持一致。

6.4.5 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。

6.4.6 附注
根据财政部、国家税务总局财税[2012]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》及其他相关税法规定列示如下:

(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。基金买卖债券的差价收入不征收营业税。

(2) 托管人从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的债券利息收入,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。

6.4.7 关联方关系
6.4.7.1 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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易
本基金在本报告期内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。本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。

6.4.8.1.2 权证交易
本基金在本报告期内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。本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。

6.4.8.1.3 应支付关联方的款项
本基金在本报告期内与上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。

6.4.8.1.4 债券交易
本基金在本报告期内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。本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。

6.4.8.1.5 债券回购交易
本基金在本报告期内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。本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。

6.4.8.2 关联方报酬
6.4.8.2.1 基金管理费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金管理费前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费率的计算方法如下:

H = E × 0.7% × 当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.2 基金托管费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金托管费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 × 0.2% × 当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.3 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.4 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.5 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.6 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.7 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.8 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.9 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.10 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.11 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.12 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.13 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.14 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.15 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.16 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.17 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.18 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.19 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.20 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.21 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.22 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.23 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.24 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.25 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.26 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.27 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.28 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.29 销售服务费
注:1.本基金合同生效日为2013年6月14日,上年度可比期间为2013年6月14日至2013年6月30日。2.本基金的基金销售服务费前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

7.2 报告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
本基金本报告期内未持有股票。

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
本基金本报告期内未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额
本基金本报告期内未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合