

浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金招募说明书摘要 (更新)

2018年第2号

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
内容截止日:2018年7月11日

重要提示

本基金的募集申请已于2016年6月7日经中国证监会证监许可(2016)1243号文准予注册。

基金合同生效日期:2016年7月11日
基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益;因基金价格可升可跌,亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前,需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持份额享受基金的收益,但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括:因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,基金管理人及其在基金投资管理过程中产生的基金管理人、基金投资托管人的信用风险,本基金投资策略所特有的风险等。

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。

本基金为定期开放基金,设置受限开放期及自开放期。本基金封闭期内不办理申购赎回业务。除法律法规或《浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金基金合同》另有约定外,自每个受限开放运作周期结束后第一个工作日(含该日),本基金进入受限开放期或自开放期,开始办理申购、赎回等业务。每个受限开放期为上一封闭期结束后的第一个工作日,每个自开放期为上一个运作周期结束后的95至20个工作日。基金份额持有人可在自开放期前自由申购、赎回基金份额,但本基金的每个受限开放期仅为1个工作日,且在受限开放期,本基金仅有限度地确认申购、赎回申请。因而,基金份额持有人可能面临因不能全部赎回基金份额而产生的流动性风险。

投资者在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同,全面了解本基金的基金的风险收益特征及产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会注册。本摘要约定为基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人。其持有基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受,并按《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本次更新的招募说明书已经基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年7月11日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:浦银安盛基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区浦东大道981号3幢316室
办公地址:中国上海市淮海中路381号中环广场38楼
成立时间:2007年8月5日
法定代表人:谢伟
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字[2007]1207号

注册资本:人民币191,000万元
股权结构:上海浦东发展银行股份有限公司持有51%的股权;法国安盛投资管理有限公司持有39%的股权;上海国盛集团资产管理有限公司持有10%的股权。

电话:(021)23212888
传真:(021)23212800
客服电话:400-8828-999;(021)33079999
网址:www.py-axa.com
联系人:徐薇
(二)主要人员情况
1.董事会成员
谢伟先生,董事长,硕士研究生,高级经济师。曾任中国建设银行郑州分行金水支行副行长,河南省分行公司业务部总经理,许昌市分行党委书记、行长;上海浦东发展银行公司及投资银行总部发展管理部总经理、公司及投资银行总部副经理及投资业务部、发展管理部、大客户部总经理,上海浦东发展银行福州分行党委书记、行长,上海浦东发展银行资金总部总经理,资产管理部总经理。现任上海浦东发展银行党委委员、副行长、董事会秘书,兼任金融市场业务总监、金融市场部总经理。自2017年3月起兼任本公司董事,自2017年4月起兼任本公司董事长。

Bruno Guilloton先生,副董事长,法国国籍,毕业于国立巴黎工艺美术学院。于1999年加盟安盛投资管理(巴黎)公司,担任股票部门主管,2000年至2002年,担任安盛投资管理(东京)公司首席执行官。2002年,任安盛罗斯蒙特公司和安盛投资管理公司的亚洲区联席董事。2005年起,担任安盛投资管理公司和内部审计全球主管。2009年起任安盛投资管理公司亚洲区代表。现任安盛投资管理公司亚太区CEO。自2015年2月起兼任安盛罗斯蒙特投资管理公司亚太区董事。现另兼任Foch Saint Cloud Versailles, Sci et Pujol Oak Hills公司董事。自2009年3月起兼任本公司董事。2016年12月起兼任安盛投资管理(上海)有限公司董事长。

刘长江先生,董事,1998年至2003年担任中国工商银行总行基金托管部副处长、处长,2003年至2005年担任上海浦东发展银行总行基金托管部总经理,2005年至2008年担任上海浦东发展银行总行公司及投资银行总部资产管理部总经理、期货结算部总经理,2008年起担任上海浦东发展银行总行公司及投资银行总部副总经理,2008年至2012年11月兼任上海浦东发展银行总行公司及投资银行总部资产管理部总经理,现任上海浦东发展银行总行金融机构部总经理。自2011年3月起兼任本公司董事。

廖正旭先生,董事,斯坦福大学物理学士和纽约科技物理学理学硕士。1999年加盟安盛罗斯蒙特投资管理公司,先后担任亚太区CIO和CEO,安盛罗斯蒙特日本公司CIO,2010年任命为安盛-Kyobo投资管理公司CEO。2012年起担任安盛投资管理公司亚洲业务发展主管。自2012年3月起兼任本公司董事。2013年12月起兼任本公司旗下子公司——上海浦银安盛资产管理(香港)有限公司董事。2016年12月起兼任安盛投资管理(上海)有限公司总经理(法定代表人)。

刘雪峰先生,董事,硕士研究生,高级经济师。曾任中国工商银行北京总行办公室副主任、副主任(主持工作)、主任兼党办主任,北京分行王府井支行党委书记、行长,上海浦东发展银行北京分行干卡部、北京分行党委委员、纪委书记、副行长,上海浦东发展银行总行中台党委组织部主任(主持工作),副总经理(主持工作),信用卡中心党委书记、总经理。现任上海浦东发展银行零售业务总监、零售业务管理部总经理,信用卡中心党委书记、总经理。自2017年3月起兼任本公司董事。

陈颀先生,复旦大学工商管理硕士,律师、经济师,1994年7月参加工作。1994年7月至2013年10月期间,陈颀同志先就职于上海市国有资产监督管理委员会历任科员、副主任科员、主任科员,上海外事(集团)有限公司,上海盛融投资管理有限公司市场部副经理,上海国盛(集团)有限公司资产管理部副经理、执行董事,上海国盛集团地产有限公司总裁助理。2013年10月起就职于上海国盛集团资产管理有限公司,现任上海国盛集团资产管理有限公司党委副书记、执行董事(法定代表人)、总裁。2018年3月起兼任本公司董事。

邵富华女士,董事,总经理,复旦大学工商管理硕士。自1994年7月起,在招商银行上海分行工作,历任银行职员,招商银行宝山支行副行长,招商银行上海分行会计部总经理、计财部总经理,招商银行上海分行行长助理、副行长,招商银行信用卡中心副总经理。自2012年7月起担任本公司总经理。自2013年3月起兼任本公司董事。2013年12月至2017年2月兼任本公司旗下子公司——上海浦银安盛资产管理(香港)有限公司总经理。2017年2月起兼任上海浦银安盛资产管理(香港)有限公司董事。

王祥洋先生,独立董事,1980年至1985年担任上海外办华建公司投资项目部项目经理,1985年至1989年担任上海外办国际交流服务有限公司综合管理部经理,1989年至1991年担任上海国际信托投资有限公司建设部副经理,1991年至2000年担任正信银行股份有限公司(原正大财务有限公司)总裁助理,2000年至2002年担任上海实业药业有限公司总经理助理,2002年至2006年担任上海实业集团有限公司顾问。自2011年3月起担任本公司独立董事。

韩启蒙先生,独立董事,法国岗城大学法学博士,1996年4月加盟德勤律师事务所担任律师。2001年起在德勤律师事务所担任本地合伙人。2004年起担任德勤律师事务所上海首席代表。2006年1月至2011年9月,担任德勤律师事务所全球合伙人。2011年11月至今,任上海启胜律师事务所合伙人。自2013年2月起兼任本公司独立董事。

崔佳康先生,独立董事,同济大学管理学博士。1987年进入同济大学工作,历任同济大学经济与管理学院讲师、副教授、教授,同济大学经济管理学院院长、副院长、同济大学经济与管理学院院长,现任同济大学经济与管理学院教授、BOSCH讲席教授。自2014年4月起兼任本公司独立董事。

董叶顺先生,独立董事,中欧国际工商学院EMBA,上海机械学院机械工程专业士,现任火山石投资管理有限公司创始合伙人。董叶顺先生拥有7年投资管理经验,曾任IDG资本投资顾问(北京)有限公司合伙人及和谐成长基金委员会成员,上海联和投资有限公司副总经理,上海联创创业投资有限公司、宏力半导体制造有限公司、MSN(中国)有限公司、南通亚药业有限公司等公司董事兼总裁。董叶顺先生有着汽车、电子产业近20多年的管理经验,曾任上海申雅密封件系统、中联汽车电子、联合汽车电子系统、延峰伟世通汽车内饰系统等系统总经理,党委书记职务。自2014年4月起兼任本公司独立董事。

2.监事会成员
魏静女士,监事长,澳大利亚悉尼大学人力资源管理学及劳动关系硕士,加拿大不列颠哥伦比亚大学工商管理硕士。2010年4月至

2014年6月就职于上海融融投资有限公司,曾先后担任人力资源部副总经理,监事。2011年1月起至今就职于上海国盛集团资产管理有限公司任行政人事部经理、本部党支部书记。自2015年3月起兼任本公司监事长。

Simon Lopez先生,澳大利亚/英国国籍,澳大利亚莫纳什大学法学学士、文学学士。2003年8月加盟安盛投资管理公司(英国伦敦),历任固定收益产品专家、固定收益产品经理,基金会计师和组合控制、首席运营官。现任安盛投资管理(香港)亚太区首席运营官。自2013年2月起兼任本公司监事。

陈士俊先生,清华大学管理学博士。2001年7月至2003年6月,任国泰君安证券有限公司研究所金融工程研究员。2003年7月至2007年9月,任银银基金管理有限公司金融工程部副总监。2007年10月至今,任浦银安盛基金管理有限公司金融工程部总监,2010年12月10日起兼任浦银安盛沪深300增强型指数证券投资基金基金经理,2012年6月14日起兼任浦银安盛中证悦联基本面400指数证券投资基金基金经理,2017年4月27日起兼任浦银安盛中证悦联沪深深基本面100指数证券投资基金(LOP)基金经理。自2012年3月起兼任本公司职工监事。

朱敏奕女士,本科学历。2000年至2007年就职于上海东新投资管理有限公司资产管理部任客户经理。2007年4月加盟浦银安盛基金管理有限公司担任市场策划经理,现任本公司市场副总监。自2013年3月起,兼任本公司职工监事。

3.公司副总经理及其他高级管理人员
邵富华女士,复旦大学工商管理硕士。自1994年7月起,在招商银行上海分行工作,历任银行职员,招商银行宝山支行副行长,招商银行上海分行行长助理、副行长,招商银行信用卡中心副总经理。自2012年7月起担任本公司总经理。自2013年3月起兼任本公司董事。2013年12月至2017年2月兼任本公司旗下子公司——上海浦银安盛资产管理(香港)有限公司总经理,2017年2月起兼任上海浦银安盛资产管理(香港)有限公司执行董事。

喻庆先生,中国政法大学经济法专业硕士和法学会计专业研究生学历,中国人民大学应用金融硕士研究生学历。历任中国银行证券有限公司国际业务总部高级经理;光大证券有限公司(上海)投资银行部副经理;光大保德信基金管理有限公司副督察长、董事会秘书和监察稽核总监。2007年8月起,担任本公司督察长。

李宏宇先生,西南财经大学经济学博士。1997年起曾先后就职于中国银行,道勤集团和上海东新国际投资管理有限公司分别从事银行结算、产品开发以及基金研究和营销工作。2007年3月起加盟本公司,历任公司产品开发部总监、市场营销部副总监、首席市场营销官。自2012年5月2日起,担任本公司副总经理兼首席市场营销官。

汪毓华先生,上海社会科学院政治经济学博士。曾任安徽经济管理干部学院经济管理系教师,大通证券资产管理部固定收益投资经理,兴业证券基金营运中心高级副经理;上海浦东发展银行货币市场及固定收益部总经理;交银康联保险人寿有限公司投资部总经理;上海浦东发展银行金融市场部副经理。2018年6月起,担任本公司副总经理。

4.本基金基金经理
章啸帆先生,复旦大学数学与应用数学专业本科学历。加盟浦银安盛基金公司,曾任任职于湘财证券股份有限公司,历任金融工程研究员、报价回购岗以及自营债券投资岗。2016年6月加盟浦银安盛基金公司,在固定收益投资部担任基金经理助理岗位。2017年5月起担任公司旗下浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛弘纯债债券型证券投资基金、浦银安盛幸福聚享18个月定期开放债券型证券投资基金(LOP)及浦银安盛幸福聚享18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017年6月至2018年7月担任公司旗下浦银安盛优化收益债券型基金及浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017年6月起担任公司旗下浦银安盛盛鑫纯债债券型证券投资基金及浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金基金经理。

5.投资决策委员会成员
邵富华女士,本公司总经理,董事,并任投资决策委员会主任。
李宏宇先生,本公司副总经理兼首席市场营销官。
汪毓华先生,本公司副总经理。

吴勇先生,本公司投资总监兼权益投资部总监,公司旗下下产业融合精准生活资产配置混合型证券投资基金及浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理。

蒋建伟先生,本公司权益投资部副总监兼旗下浦银安盛价值成长混合型证券投资基金及浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

陈士俊先生,本公司金融工程部总监,公司旗下浦银安盛沪深300增强型指数证券投资基金、浦银安盛中证悦联基本面400指数证券投资基金及浦银安盛中证悦联沪深深基本面100指数证券投资基金(LOP)基金经理并兼任本公司职工监事。

钟明女士,本公司固定收益投资部副总监兼旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛日百鑫货币市场基金、浦银安盛盛动纯债债券型证券投资基金以及浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理。

邵富华女士,本公司总经理,董事,并任投资决策委员会主任。
李宏宇先生,本公司副总经理兼首席市场营销官。
汪毓华先生,本公司副总经理。

吴勇先生,本公司投资总监兼权益投资部总监,公司旗下下产业融合精准生活资产配置混合型证券投资基金及浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理。

蒋建伟先生,本公司权益投资部副总监兼旗下浦银安盛价值成长混合型证券投资基金及浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

陈士俊先生,本公司金融工程部总监,公司旗下浦银安盛沪深300增强型指数证券投资基金、浦银安盛中证悦联基本面400指数证券投资基金及浦银安盛中证悦联沪深深基本面100指数证券投资基金(LOP)基金经理并兼任本公司职工监事。

钟明女士,本公司固定收益投资部副总监兼旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛日百鑫货币市场基金、浦银安盛盛动纯债债券型证券投资基金以及浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理。

邵富华女士,本公司总经理,董事,并任投资决策委员会主任。
李宏宇先生,本公司副总经理兼首席市场营销官。
汪毓华先生,本公司副总经理。

吴勇先生,本公司投资总监兼权益投资部总监,公司旗下下产业融合精准生活资产配置混合型证券投资基金及浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理。

蒋建伟先生,本公司权益投资部副总监兼旗下浦银安盛价值成长混合型证券投资基金及浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

陈士俊先生,本公司金融工程部总监,公司旗下浦银安盛沪深300增强型指数证券投资基金、浦银安盛中证悦联基本面400指数证券投资基金及浦银安盛中证悦联沪深深基本面100指数证券投资基金(LOP)基金经理并兼任本公司职工监事。

钟明女士,本公司固定收益投资部副总监兼旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛日百鑫货币市场基金、浦银安盛盛动纯债债券型证券投资基金以及浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理。

邵富华女士,本公司总经理,董事,并任投资决策委员会主任。
李宏宇先生,本公司副总经理兼首席市场营销官。
汪毓华先生,本公司副总经理。

吴勇先生,本公司投资总监兼权益投资部总监,公司旗下下产业融合精准生活资产配置混合型证券投资基金及浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理。

蒋建伟先生,本公司权益投资部副总监兼旗下浦银安盛价值成长混合型证券投资基金及浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

陈士俊先生,本公司金融工程部总监,公司旗下浦银安盛沪深300增强型指数证券投资基金、浦银安盛中证悦联基本面400指数证券投资基金及浦银安盛中证悦联沪深深基本面100指数证券投资基金(LOP)基金经理并兼任本公司职工监事。

钟明女士,本公司固定收益投资部副总监兼旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛日百鑫货币市场基金、浦银安盛盛动纯债债券型证券投资基金以及浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理。

邵富华女士,本公司总经理,董事,并任投资决策委员会主任。
李宏宇先生,本公司副总经理兼首席市场营销官。
汪毓华先生,本公司副总经理。

吴勇先生,本公司投资总监兼权益投资部总监,公司旗下下产业融合精准生活资产配置混合型证券投资基金及浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理。

蒋建伟先生,本公司权益投资部副总监兼旗下浦银安盛价值成长混合型证券投资基金及浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

陈士俊先生,本公司金融工程部总监,公司旗下浦银安盛沪深300增强型指数证券投资基金、浦银安盛中证悦联基本面400指数证券投资基金及浦银安盛中证悦联沪深深基本面100指数证券投资基金(LOP)基金经理并兼任本公司职工监事。

钟明女士,本公司固定收益投资部副总监兼旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛日百鑫货币市场基金、浦银安盛盛动纯债债券型证券投资基金以及浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理。

邵富华女士,本公司总经理,董事,并任投资决策委员会主任。
李宏宇先生,本公司副总经理兼首席市场营销官。
汪毓华先生,本公司副总经理。

吴勇先生,本公司投资总监兼权益投资部总监,公司旗下下产业融合精准生活资产配置混合型证券投资基金及浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理。

蒋建伟先生,本公司权益投资部副总监兼旗下浦银安盛价值成长混合型证券投资基金及浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

陈士俊先生,本公司金融工程部总监,公司旗下浦银安盛沪深300增强型指数证券投资基金、浦银安盛中证悦联基本面400指数证券投资基金及浦银安盛中证悦联沪深深基本面100指数证券投资基金(LOP)基金经理并兼任本公司职工监事。

钟明女士,本公司固定收益投资部副总监兼旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛日百鑫货币市场基金、浦银安盛盛动纯债债券型证券投资基金以及浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理。

邵富华女士,本公司总经理,董事,并任投资决策委员会主任。
李宏宇先生,本公司副总经理兼首席市场营销官。
汪毓华先生,本公司副总经理。

(一)基金份额发售机构
1.直销机构
(1)浦银安盛基金管理有限公司上海直销中心
住所:中国(上海)自由贸易试验区浦东大道981号3幢316室
办公地址:中国上海市淮海中路381号中环广场38楼
电话:(021)23212899
传真:(021)23212890
客服电话:400-8828-999;(021)33079999
联系人:徐薇
网址:www.py-axa.com
(2)电子直销
浦银安盛基金管理有限公司电子直销(目前支持上海浦东发展银行借记卡、中国建设银行借记卡、中国农业银行借记卡、兴业银行借记卡、中信银行借记卡、广发银行借记卡、平安银行借记卡、邮政储蓄银行借记卡、上海农商银行借记卡、上海银行借记卡、华夏银行借记卡、招商银行借记卡、中国工商银行借记卡、交通银行借记卡、中国银行借记卡、光大银行借记卡、民生银行借记卡)。

交易网站:www.py-axa.com
微信服务号:浦银安盛微理财(AXASDPDB-E)
客户端:“浦银安盛基金”APP
客服电话:400-8828-999;(021)33079999

2.代销机构
中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街9号
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街9号
法定代表人:李庆萍
客服电话:96558
网址:bank.ecitic.com
(二)注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
联系人:赵亦清
电话:(010)56938782
传真:(010)56938891

(三)出具法律意见书的律师事务所和经办律师
名称:国浩律师(上海)事务所
办公地址:上海市静安区北京西路968号嘉地中心23-25层
负责人:李昊
电话:021-52341688
传真:021-52341670
联系人:孙芳华
经办律师:宣伟华、孙芳华

(四)审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室
办公地址:上海市浦电路202号毕马华大道中11楼
执行事务合伙人:李丹
电话:(021)23238888
联系人:张振波
经办注册会计师:薛竟、张振波

(五)其他服务机构及委托办理业务的有关情况
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、网络构成系统,这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责承建,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成或购建,建成后在业务运作过程中根据公司业务的需求进行了相关的系统功能升级,升级后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,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、维护等事项。另外,本公司可以根据自身发展战略的需要,委托资质良好的金融服务机构代为办理基金份额发售、估值核算等业务。

四、基金名称
银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金

五、基金类型
债券型证券投资基金

六、基金的投资目标
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。

七、基金的投资范围
本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、中央银行票据、地方政府债、中小企业私募债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、债券回购、协议存款、通知存款、定期存款、同业存款、同业存单等金融工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益证券品种(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金不直接投资股票、权证等权益类资产,但可持有因可转债转股所形成的股票,因持有该股票所派发的股息以及因投资分离交易可转债而产生的权证等。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10个交易日內卖出。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资的其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入本基金投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的90%。因受限开放期及自开放期后的流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每个受限开放期的前10个工作日和后10个工作日、自开放期的前1个月和后1个月以及开放期间,不受前述投资组合比例的限制;受限开放期及自开放期內,本基金持有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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等,在封闭期內,本基金不受上述5%的限制。

八、基金的投资策略
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、类别配置上采用动态管理,寻找各类资产的潜在良好投资机会,一方面在个别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,整体基金投资对风险的严格控制,运用多种积极的资产管理增值策略,实现本基金的长期投资目标。

(一)资产配置策略
本基金将自上而下地实施整体资产配置策略,通过对宏观经济运行状况、货币政策变化、市场利率走势、市场资金供求情况、经济周期等因素的定性定量进行分析,预测未来大类资产未来收益率变化状况,在不同的资产配置方案之進行的动态调整和优化,以规避市场风险,提高基金收益。

(二)固定收益类证券投资策略
1.流动性管理策略
本基金通过合理组合并开放期的流动性风险,并满足每次开放期的流动性需求,本基金在投资管理中将持有债券的组合久期与运作周期进行适当的匹配。

2.久期与期限结构管理策略
利率风险是债券投资最主要的风险来源和收益来源之一,衡量债券利率风险的核心指标是久期。本基金通过对宏观经济状况和货币政策的分析,对债券市场走势作出判断,并形成对未来市场利率变动方向的预期,动态调整债券组合的久期。在久期确定的基础上,根据对收益率曲线形状变化情景的分析,分别采用子弹型策略、哑铃型策略或梯型策略,进行一定组合的期限结构,使本基金获得较好的收益。

3.类属配置策略
在保证流动性的基础上,本基金将通过运用、发行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可分离债券、资产支持证券、回购和银行存款等资产的合理组合实现预期的投资收益。

类属配置主要策略包括研究国债与金融债之间的利差、交易与银行间市场的市场利率、企业债与国债的信用利差等,寻找价值相对低估的投资品种。

4.个券选择策略
(1)流动性策略
在封闭期內,本基金对个券的流动性要求不高,在开放期內,将通过对各类流动性指标的监测与监控,管理由于基金的申购、赎回或个券的交易规模程度而引致的潜在损失风险。

(2)信用分析策略
为了确保本基金安全的基础上获得稳定的收益,本基金对企业债、公司债、金融债、短期融资券等信用债进行信用分析。此分析主要通过三个角度完成:①独立第三方的外部评级结果;②第三方担保情况;③基于基金管理人自有的数量化公司财务分析模型的内部分级评价。该模型在信用评级评价方面主要用于通过对部分关键的内部分级指标分析判断债券发行企业未来出现偿债风险的可能性,从而确定该企业发行债券的信用等级与利率水平。主要关键指标包括:NET DEBT/EBITDA、EBIT/TA、资产负债率、流动资产/流动负债、经营活动现金流/总负债、其中资产负债率、流动资产/流动负债主要分析企业经营水平与结构,其他的指标主要用于分析企业偿债效益对未来偿债能力的支撑情况。

5.回购策略
该策略将本基金封闭期內是风险较低的投资策略,即在基础组合的基础上,使用基础组合持有的债券进行回购融入短期资金滚动操作,投资收益高于融资本金的其它获利机会,从而获得杠杆放大收益。

6.可转换债券策略
可转换公司债券是一种介于股票和债券之间的固定收益类投资品种,其理论价值等于作为普通债券的纯债券价值加上可转换內含选择权价值。

(1)积极管理策略
可转债內含选择权价值是决定可转债投资价值的关键因素。本基金在对可转换公司债券条款和发行公司基本面对进行深入分析的基础上,

上,利用可转债的纯债券价值和到期收益率来判断可转债的债性,以增强基金投资的安全性;利用可转债转换价值相对于纯债券价值的溢价率来判断可转债的股性,在市场出现投资机会时,优先选择股性强的品种,获取超额收益。

(2)一级市场申购策略
目前,可转债均采用定价发行,对于那些发行条款优惠、期权价值较高、公司基本面优良的可转债,因供求不平衡,会产生较大的一、二级市场价差。因此,为增加组合收益,本基金将在充分研究的基础上,参与可转换债券的一级市场申购,在严格控制风险的前提下获得稳定收益。

7、资产支持证券投资策略
本基金通过分析资产支持证券对应资产池的资产特征,来估计资产违约风险和提前偿付风险,根据资产池的现金流结构安排,模拟资产支持证券的本息偿还和利息收益的现金流分布,并利用合理的收益率曲线对资产支持证券进行估值。同时还将充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性,控制资产支持证券投资的风险,以获取较高的投资收益。

8、中小企业私募债投资策略
中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大,二级市场流动性较差。中小企业私募债不强制第三方评级。基金管理人通过内部信用评级系统,分析发行主体的信用水平及个债信用措施,量化比较判断估值,精选个债,谋求超额收益。信用评级系统分为行业、企业盈利水平、负债水平,担保信用等级四大子模块,对中小企业私募债的发行企业所处行业、所在行业地位、持续盈利能力、未来负债率的变化、债务管理措施进行量化评价,同时结合企业实地调研,上下游尽职调查等基本面对考察,对债券公允价值进行综合评定。

本基金可能投资的中小企业私募债,其信用风险一般情况下高于其他公司债券,其流动性一般情况下弱于其他公司债券。

9、中期票据投资策略
投资策略通过浦银安盛信用分析系统,遴选收益风险平衡或被市场错误定价的中期票据,兼顾流动性,以持有到期为主,波段操作结合的方式进行中期票据的投资。

九、业绩比较基准
1.业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证综合债指数收益率

2、本基金选择中证综合债指数收益率作为业绩比较基准的原因如下:
中证综合债指数由中证指数公司编制,样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债、企业债、央票及短期融资债,是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩的指数时,本基金管理人将在与基金托管人协商一致,并履行适当程序后调整或变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十、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。

十一、基金的投资组合报告
本投资组合报告所载数据截至2018年6月30日(财务数据未经审计)。

(一)报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	债券投资	452,136,761.80	96.79
	其中:国债	452,136,761.80	96.79
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,937,390.21	1.06
8	其他资产	10,063,202.80	2.15
9	合计	467,136,154.61	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合
2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有港股通股票。

(三)报告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。