浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年 9 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:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2018 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于 2018 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛盛世精选混合	
基金主代码	519127	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年 6 月 26 日	
报告期末基金份额总额	159,980,959.22 份	
投资目标	本基金通过在股票、固定收益证券、现金等资产的积极灵活配置,并通过重点关注受益于中国经济结构转型带来的投资机会, 在严格控制风险并保证充分流动性的前提下,谋求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金在股票投资方面主要采用主题投资策略,通过重点投资受益于中国经济结构转型相关行业股票,并保持对中国经济结构调整和趋势以及投资结构调整时相关行业及上市公司影响的密切跟踪和研究分析,对属于精选投资主题范畴的上市公司进行重点投资。	
业绩比较基准	55%×沪深 300 指数 +45%×中证全债指数	
风险收益特征	本基金为混合型基金,本基金属于中高风险、中高收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	浦银盛世 A	浦银盛世 C
下属分级基金的交易代码	519127	519177
报告期末下属分级基金的份额总额	158,619,458.15 份	1,361,501.07 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 2018年7月1日 - 2018年9月30日)	
	浦银盛世 A	浦银盛世 C
1. 本期已实现收益	-1,119,248.01	-12,160.34
2. 本期利润	-3,994,075.40	-26,019.74
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0219	-0.0159
4. 期末基金资产净值	230,504,221.04	1,635,639.22
5. 期末基金份额净值	1.453	1.201

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

浦银盛世 A

阶段	净值增长率①	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	-1.16%	0.39%	-0.39%	0.74%	-0.77%	-0.35%

浦银盛世 C

阶段	净值增长率①	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	-1.15%	0.39%	-0.39%	0.74%	-0.76%	-0.35%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

注:经中国证监会批准,本基金于 2015 年 11 月 20 日分为 A、C 两类。具体内容详见本基金管理人于 2015 年 11 月 20 日刊登的《浦银安盛基金管理有限公司关于浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并相应修订基金合同部分条款的公告》。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
杨晓辉	公司旗下浦银安盛新经济结构混合基金、浦银安盛稳健增益混合基金、浦银安盛经济新驱动混合基金、浦银安盛积极精选混合基金、浦银安盛安享和睦定期开放混合基金、浦银安盛安享回报定期开放混合基金、浦银安盛安享无忧定期开放混合基金、浦银安盛稳健回报混合基金、浦银安盛稳健增益债券基金、浦银安盛稳健增利债券基金、浦银安盛稳健添利债券基金、浦银安盛稳健添益定期开放债券型发起式基金基金经理。	2014年6月26日	-	10	杨晓辉先生,南京理工大学经济学硕士,2004年至2010年,先后就职于上海巨世半导体公司、爱建证券公司从事宏观经济、政策以及制造与消费行业研究工作,后在上海汽车财务公司担任投资经理助理之职,2011年4月加盟我司担任高级行业研究员,2013年2月至2014年6月,担任我公司权益类基金基金经理助理,2014年6月起,担任公司旗下浦银安盛盛世精选混合基金基金经理,2014年7月起,兼任公司旗下浦银安盛新经济结构混合基金基金经理,2017年2月起,兼任公司旗下浦银安盛经济新驱动混合基金基金经理,2017年3月起,兼任公司旗下浦银安盛安享和睦定期开放混合基金基金经理,2018年4月起兼任浦银安盛安享回报定期开放混合基金基金经理,2018年8月起兼任浦银安盛安享无忧定期开放混合基金基金经理。

注:1、本基金基金经理的任职日期为公司决定的聘任日期。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《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,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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《公平交易管理规定》,建立并健全了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。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度,经济稳中有降,土地市场初现疲态,外围贸易战升温,进出口的波动加大,不确定性上升。流动性方面,央行货币政策委员会和中共中央政治局会议先后提出"坚持实施稳健的货币政策,把好货币供给总闸门,保持流动性合理充裕",资金面持续宽松。在合理充裕的基础上,为了解决合理充裕难以合理传导的问题,除了实施定向降准等解决小微企业融资难问题的货币政策以外,宏观政策的重点逐步转向积极的财政政策,"宽信用"成为三季度债券投资的主线。海外方面,美联储 9 月如期加息,同时释放强烈的缩表和加息预期,推升十年期美债收益率突破 3.20%, 全球债券市场承压, 新兴市场国家国债收益率飙升, 中美利差收窄至 40bp。

报告期内,本基金整体上保持较高的杠杆水平,适当拉长了组合久期。大类资产方面,增持中高等级信用债,在宽信用带来的信用利差收窄行情中取得了一定的超额收益。未来,本基金将继续秉承稳健专业的投资理念,谨慎操作、严格风控,力争为基金份额持有人带来长期稳定回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛盛世精选灵活配置混合基金份额净值为 1.453 元,本报告期基金份额净值增长率为 -1.16%;截至本报告期末浦银盛世 C 基金份额净值为 1.201 元,本报告期基金份额净值增长率为 -1.15%;同期业绩比较基准收益率为 -0.39%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	61,991,000.64	26.59
	其中:股票	61,991,000.64	26.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	118,250,600.00	50.72
	其中:债券	118,250,600.00	50.72
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	41,000,255.50	17.59
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,371,698.37	3.59
8	其他资产	3,518,090.40	1.51
9	合计	233,131,644.91	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,560,000.00	1.53
C	制造业	36,156,324.04	15.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	982,800.00	0.42
E	建筑业	713,700.00	0.31
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	5,317,180.00	2.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	12,966,336.60	5.59
K	房地产业	730,200.00	0.31
L	租赁和商务服务业	1,564,460.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	61,991,000.64	26.70

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	68,000	4,658,000.00	2.01
2	600009	上海机场	70,000	4,113,900.00	1.77
3	600028	中国石化	500,000	3,580,000.00	1.53
4	600276	恒瑞医药	52,000	3,302,000.00	1.42
5	600519	贵州茅台	4,500	3,285,000.00	1.42
6	601398	工商银行	550,000	3,173,500.00	1.37
7	600036	招商银行	100,000	3,069,000.00	1.32
8	603156	养元饮品	52,804	2,644,952.36	1.14
9	600104	上汽集团	74,600	2,482,688.00	1.07
10	600019	宝钢股份	308,000	2,417,800.00	1.04

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,874,000.00	8.56
	其中:政策性金融债	19,874,000.00	8.56
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	58,439,800.00	25.17
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	38,934,500.00	16.77
9	其他	1,002,300.00	0.43
10	合计	118,250,600.00	50.94

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120224	12国开24	200,000	19,874,000.00	8.56
2	011801211	18陕西国投SCP002	130,000	13,092,300.00	5.64
3	041800073	18韵达股份CP001	100,000	10,119,000.00	4.36
4	011800409	18雅高速SCP002	100,000	10,087,000.00	4.35
5	011800776	18长金投SCP004	100,000	10,072,000.00	4.34

5.6 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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库的范围。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	37,588.81
2	应收证券清算款	2,048,683.35
3	应收股利	-
4	应收利息	1,429,034.50
5	应收申购款	2,823.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,518,090.40

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603156	养元饮品	2,644,952.36	1.14	流通受限

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	浦银盛世 A	浦银盛世 C
报告期期初基金份额总额	191,080,273.01	3,652,697.07
报告期期间基金总申购份额	889,257.61	257,494.51
减:报告期期间基金总赎回份额	33,330,072.47	2,548,690.51
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	158,619,458.15	1,361,501.07

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

注: 本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准基金募集的文件

2、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同

3、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议

4、浦银安盛基金管理有限公司开放式基金业务规则

5、关于募集浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金的法律意见书

6、基金管理人业务资格批件和营业执照

7、基金托管人业务资格批件和营业执照

8、中国证监会要求的其他文件

9.2 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。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(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

2018 年 10 月 26 日

浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年 9 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:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2018 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于 2018 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛盛元纯债债券	
基金主代码	519322	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年7月22日	
报告期末基金份额总额	4,942,423,437.35 份	
投资目标	在严格控制投资风险的前提下,为争实现超过业绩比较基准的投资回报。	
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,寻找各类资产的最在良好投资机会。一方面在个券选择上采用自下而上的方法,通过高给力等策略自用分析策略进行筛选,整体投资通过对风险的严格控制,追回多种新颖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	中证综合债指数收益率。	
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,低于股票型基金。	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛盛元纯债债券 A	浦银安盛盛元纯债债券 C
下属分级基金的交易代码	519322	519323
报告期末下属分级基金的份额总额	4,941,903,245.55 份	520,191.80 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 2018年7月1日 - 2018年9月30日)	
	浦银安盛盛元纯债债券 A	浦银安盛盛元纯债债券 C
1. 本期已实现收益	5,788,737.17	5,322.18
2. 本期利润	106,981,877.57	10,879.22
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0216	0.0208
4. 期末基金资产净值	5,063,992,049.24	533,081.38
5. 期末基金份额净值	1.0247	1.0248

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

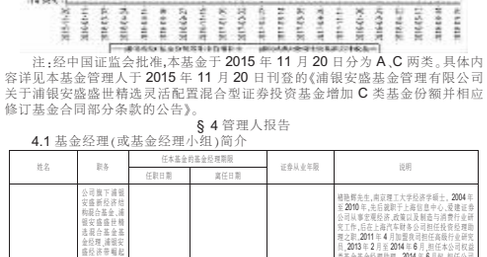
浦银安盛盛元纯债债券 A

阶段	净值增长率①	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	2.13%	0.05%	1.32%	0.06%	0.81%	-0.01%

浦银安盛盛元纯债债券 C

阶段	净值增长率①	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	2.04%	0.05%	1.32%	0.06%	0.72%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
常康辉	公司旗下浦银安盛鑫鼎稳健债券基金、浦银安盛鑫泰债券基金、浦银安盛鑫益债券基金、浦银安盛鑫利债券基金、浦银安盛鑫添益债券基金、浦银安盛鑫添利债券基金、浦银安盛稳健增利债券基金、浦银安盛稳健添利债券基金、浦银安盛稳健添益定期开放债券型发起式基金基金经理。	2017年6月8日	-	7	常康辉先生,复旦大学数学与应用数学专业本科学历,加盟浦银安盛基金前,曾任职于南财证券股份有限公司,历任金融工程研究员、股价回购风险及自营债券投资岗。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鑫益定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛鑫泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛鑫利纯债债券型证券投资基金、浦银安盛鑫添利纯债债券型证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金、浦银安盛稳健添利债券型证券投资基金、浦银安盛鑫添益纯债债券型证券投资基金、浦银安盛稳健添益纯债债券型证券投资基金、浦银安盛稳健添益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。

注:1、本基金基金经理的任职日期为公司决定的聘任日期。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《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,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,本着诚实信用、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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《公平交易管理规定》,建立并健全了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。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

经济总体呈现稳中承压趋势,紧信用环境使得社融增速有所回落,叠加外部贸易摩擦,使得宏观经济的不确定性进一步加大。国内经济动能虽维持 PMI 在 50 以上,但近月来小幅下行,9 月制造业 PMI 已由前期 51.5%回落至 50.8%,经济下行压力仍存在。为应对复杂的国内外经济形势,国内经济政策有所转向。央行货币政策边际放松,逐步转为合理充裕,并着重疏通信用传导机制。同时财政政策配合发力,各部委推出多项措施稳定经济,着力疏导中小企业融资难的现状。银行超储率由 3 月底的 1.3%升至 7 月份的 1.8%, 下半年以来银行间 R001 中枢 2.42%、R007 中枢 2.83%,呈逐渐下行的趋势,从利率曲线上看,中短期利率维持较低水平有利于疏通信用传导机制, 预期央行将继续维护市场流动性保持合理充裕水平,中短端收益率有望进一步下行。长端利率受制于中美利差收窄和通胀预期升温而缓慢下行,截至 10 月 9 日美国十年期国债收益率已突破 3.25,中美十年期国债利差仅 36BP,接近历史低位,利率曲线可能进一步陡峭化。基于上述判断,本基金在报告期内适度降低久期,保持中性杠杆水平维持流动性,减持了长端利率,并增持了 1-3Y 信用资产,提升持仓债券信用资质,避免信用分化对组合产生冲击。报告期内坚持谨慎投资原则、严控信用风险,增加高流动性资产占比,在保证季底流动性安全基础上,获取收益率下行带来的利差,提高组合整体收益回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛盛元纯债债券 A 基金份额净值为 1.0247 元, 本报告期基金份额净值增长率为 2.13%;截至本报告期末浦银安盛盛元纯债债券 C 基金份额净值为 1.0248 元,本报告期基金份额净值增长率为 2.04%;同期业绩比较基准收益率为 1.32%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,430,257,540.00	96.68
	其中:债券	6,430,257,540.00	96.68
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	83,421,588.87	1.25
8	其他资产	137,658,965.17	2.07
9	合计	6,651,338,114.04	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 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

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,050,190,000.00	20.74
	其中:政策性金融债	1,000,220,000.00	19.75
4	企业债券	2,473,910,040.00	48.85
5	企业短期融资券	977,546,000.00	19.30
6	中期票据	1,878,256,500.00	37.09
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	50,355,000.00	0.99
10	合计	6,430,257,540.00	126.97

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1880004	18附息01	4,000,000	415,680,000.00	8.21
2	180205	18国开05	3,000,000	313,770,000.00	6.20
3	180210	18国开10	3,000,000	296,190,000.00	5.85
4	122774	PR长投02	2,500,000	205,100,000.00	4.05
5	101800625	18江金M TN008BC	2,000,000	203,040,000.00	4.01

5.6 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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2

本基金本报告期末未持有股票,故不存在本基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	56,806.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	137,602,178.43
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	137,658,985.17

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	浦银安盛盛元纯债债券 A	浦银安盛盛元纯债债券 C
报告期期初基金份额总额	4,941,898,153.53	527,100.38
报告期期间基金总申购份额	48,052.98	133.83
减:报告期期间基金总赎回份额	42,960.96	7,042.41
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	4,941,903,245.55	520,191.80

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年7月1日-2018年9月30日	4,941,570,422.63	0.00	0.00	4,941,570,422.63	99.98%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品持有风险							
基金管理人提示投资者注意:当特定的机构投资者进行大额赎回操作时,基金管理人需通过对基金持有证券的快速变现以支付赎回款,该等操作可能会产生基金业位调整的因素,产生种去成本的风险,并造成基金净值的波动;同时,该等大额赎回时可能产生:1)单位净值风险及风险点;2)基金净值大幅波动的风险点;3)因引发基金本身的巨额赎回与投资中小投资者无法及时赎回的风险点;以及 4)因基金资产净值低于 5000 万元从而影响投资目标实现或造成基金终止等风险。						

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准基金募集的文件

2、浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金基金合同

3、浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金招募说明书

4、浦银安盛盛元纯债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

9.2 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

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.py-axa.com)查阅,或在营业时间内至基金管理人办公场所免