浦银安盛基金管理有限公司浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）招募说明书摘要（更新）

（由浦银安盛增利分级债券型证券投资基金封闭期届满转换而来）

2019年第1号

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
内容截止日:2019年6月13日

重要提示

浦银安盛增利分级债券型证券投资基金经2011年10月25日中国证券监督管理委员会证监许可[2011]1704号文核准募集。《浦银安盛增利分级债券型证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")于2011年12月13日生效,根据《基金合同》的有关规定,浦银安盛增利分级债券型证券投资基金封闭期届满后,无需召开持有人大会,已于2014年12月16日转换为上市开放式基金(LOF),基金名称已变更为"浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)",基金代码为:"166401",基金简称为"浦银安盛稳健增利债券(LOF)",浦银增A、浦银增B的基金份额已转换为上市开放式基金(LOF)份额,浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)已于2015年1月8日起在深圳证券交易所上市交易。

本招募说明书是对原《浦银安盛增利分级债券型证券投资基金招募说明书》的定期更新,原招募说明书与本招募说明书不一致的,以本招募说明书为准。

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核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金(以下简称"基金")是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资者购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

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。投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书,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,对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者在获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,可能包括:证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定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基金合同的承认和接受,并按照《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本基金托管人复核。如无特别说明,本招募说明书所载内容截止日为2019年6月13日,有关财务数据和净值表现截止日2019年3月31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]207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总经理兼投行业务部、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,金融市场部总经理。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。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技术学院。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,任职安盛罗森堡公司和安盛投资管理公司的亚洲区域董事。2005年起,担任安盛投资管理公司内部审计全球主管。2009年起任安盛投资管理公司亚洲股东代表。现任安盛投资管理公司亚太区CEO。自2015年2月起兼任安盛罗森堡投资管理公司亚太区董事。现另兼任Foch Saint Cloud Versailles Sci及Fuji Oak Hills公司董事。自2009年3月起兼任本公司副董事长。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,硕士研究生。曾任中国工商银行总行基金托管部副处长、处长;上海浦东发展银行总行基金托管部总经理,总行公司及投资银行总部资产托管部、企业年金部、期货结算部总经理,总行公司及投资银行总部副总经理兼任资产托管部、企业年金部、期货结算部总经理,总行资产托管部总经理。现任上海浦东发展银行总行金融机构部总经理、总行金融市场业务工作党委副书记。自2011年3月起兼任本公司董事。

廖正旭先生,董事,斯坦福大学理学硕士和纽约科技大学理学硕士。1999年加盟安盛罗森堡投资管理公司,先后担任亚太区CIO和CEO,安盛罗森堡日本公司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有限公司监事。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)。

刘显峰先生,董事,硕士研究生,高级经济师。曾任中国工商银行北京市分行办公室副主任、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党委委员、纪委书记、副行长,上海浦东发展银行信用卡中心党委副书记(主持工作)、副总经理(主持工作),总行零售业务管理部总经理。现任上海浦东发展银行零售业务总监,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。

陈颖先生,复旦大学公共管理硕士,律师、经济师。1994年7月参加工作。1994年7月至2013年10月期间,陈颖同志先后就职于上海市国有资产管理办公室历任科员、副主任科员、主任科员,上海久事公司法律顾问,上海盛融投资有限公司市场部副总经理,上海国盛(集团)有限公司资产管理部副总经理、执行总经理,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有限公司,现任上海国盛集团资产有限公司党委书记、执行董事、总裁。2018年3月起兼任本公司董事。

郁蓓华女士,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有限公司总经理。2017年2月起兼任上海浦银安盛资产管理有限公司执行董事。

王家祥女士,独立董事。1980年至1985年担任上海侨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部副经理,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。1995年4月加盟基德律师事务所担任律师。2001年起在基德律师事务所担任本地合伙人。2004年起担任基德律师事务所上海首席代表。2006年1月至2011年9月,担任基德律师事务所全球合伙人。2011年11月起至今,任上海启恒律师事务所合伙人。自2013年2月起兼任本公司独立董事。

霍佳震先生,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,同济大学研究生院培养处处长、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师、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学士。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年投资行业经历,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投委会委员,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、南通联亚药业有限公司等公司董事长。董叶顺先生有着汽车、电子等产业近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有限公司总经理、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

檀静女士,监事长,澳大利亚悉尼大学人力资源管理和劳资关系硕士研究生,加拿大不列颠哥伦比亚大学国际工商管理硕士。2010年4月至2014年6月就职于上海盛融投资有限公司,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有限公司任政人事部总经理。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。现任安盛投资管理有限公司亚太区首席运营官。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,任银河基金管理有限公司金融工程部研究员、研究部主管。2007年10月至今,任浦银安盛基金管理有限公司指数与量化投资部总监,2010年12月10日起兼任浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金基金经理,2012年5月14日起兼任浦银安盛中证锐联基本面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锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)基金经理,2018年9月5日起兼任浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年1月29日起兼任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金基金经理。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主管。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,现任本公司市场部总监兼互联网金融部副总监。自2013年3月起,兼任本公司职工监事。

3、公司总经理及其他高级管理人员

郁蓓华女士,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23日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有限公司总经理。2017年2月起兼任上海浦银安盛资产管理有限公司执行董事。

喻庆先生,中国政法大学经济法专业硕士和法务会计专业研究生学历,中国人民大学应用金融学硕士研究生学历。历任中银万国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)投资银行部副总经理;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联行结算、产品开发以及基金研究和投资工作。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。

汪献华先生,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;兴业银行资金营运中心高级副理;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总经理。2018年5月起,担任本公司副总经理。2019年2月起,兼任本公司固定收益投资部总监。

4、本基金基金经理

章潇枫先生,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、浦银安盛盛达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(LOF)及浦银安盛幸福聚益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月至2019年1月担任公司旗下浦银安盛盛勤纯债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元定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2018年9月起担任公司旗下浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2018年11月起担任公司旗下浦银安盛普益纯债债券型证券投资基金基金经理。2019年3月起担任公司旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金和浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金基金经理。

历任基金经理:薛铮,任职时间2017年1月23日至2017年6月8日;刘大巍,任职时间2017年1月23日至2018年7月5日。

5、投资决策委员会成员

(1)权益投资决策委员会

郁蓓华女士,本公司总经理,董事,全资子公司上海浦银安盛资产管理有限公司执行董事。
李宏宇先生,本公司副总经理兼首席市场营销官。
汪献华先生,本公司副总经理兼固定收益投资部总监。
吴勇先生,本公司投资总监兼权益投资部总监,基金经理。
蒋建伟先生,本公司权益投资部副总监,基金经理。
陈士俊先生,本公司指数与量化投资部总监,基金经理,本公司职工监事。
蒋佳良先生,本公司研究部副总监,基金经理。

(2)固定收益投资决策委员会

郁蓓华女士,本公司总经理,董事,全资子公司上海浦银安盛资产管理有限公司执行董事。
李宏宇先生,本公司副总经理兼首席市场营销官。
汪献华先生,本公司副总经理兼固定收益投资部总监。
钟明女士,本公司固定收益投资部副总监,基金经理。
涂妍妍女士,本公司信用研究部副总监。

督察长、风险管理部负责人、其他基金经理及基金经理助理列席投资决策委员会会议。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基本情况

名称:上海银行股份有限公司(以下简称"上海银行")
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路168号
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路168号
法定代表人:金煜
成立时间:1995年12月29日
组织形式:股份有限公司(中外合资、上市)
注册资本:人民币109.28099亿元
存续期间:持续经营
基金托管业务批准文号:中国证监会 证监许可[2009]814号
托管部门联系人:闻怡
电话:021-68475888
传真:021-68476936

上海银行成立于1995年12月29日,是一家由国有股份、中资法人股份、外资股份及个人股份共同组成的股份制商业银行,总行位于上海,是上海证券交易所主板上市公司,股票代码601229。

上海银行以"精品银行"为战略愿景,以"精诚至上,信义立行"为核心价值观,近年来通过推进专业化经营和精细化管理,着力在中小企业、财富管理和养老金融、金融市场、跨境金融、在线金融等领域培育和塑造经营特色,不断增强可持续发展能力。

上海银行目前在上海、北京、深圳、天津、成都、宁波、南京、杭州、苏州、无锡、绍兴、南通、常州、盐城等城市设立分支机构,形成长三角、环渤海、珠三角和中西部重点城市的布局框架;发起设立四家村镇银行、上银基金管理有限公司、上海尚诚消费金融股份有限公司,设立上海银行(香港)有限公司,并与全球120多个国家和地区近1500多家境内外银行及其分支机构建立了代理行关系。

上海银行自成立以来市场影响力不断提升。2018年,上海银行被首批纳入MSCI指数,并被纳入上证公司治理、上证180公司治理、上证社会责任指数。在英国《银行家》杂志2018年度发布的"全球银行1000强"榜单中,按照一级资本排名,上海银行位居第76位,较上一年度上升9位,位列中资银行第16名;按照总资产排名,上海银行位列第88位,较上一年度上升1位。穆迪投资者服务公司授予上海银行的长期发行人和长期存款评级从"Baa3"上调至"Baa2",短期发行人和短期存款评级从"Prime-3"上调至"Prime-2",评级展望稳定。反映出上海银行资本实力不断增强,盈利能力稳步提高,资产质量同业领先。

2018年,上海银行荣获中国银行业协会"2018年银团贷款业务最佳发展奖"、上海市人民政府颁发的"上海金融创新成果奖三等奖"以及重要媒体机构颁发的"最佳一带一路境内银行"、"中国最佳私人财富慈善服务奖"、"年度卓越影响力金融品牌"、"2018杰出价值机构"等奖项。

截至2018年末,上海银行资产总额20,277.72亿元,客户存款余额为10,424.90亿元,较上年末增长12.87%;客户贷款和垫款总额为8,506.96亿元,较上年末增长28.11%;净利润180.68亿元,资本充足率为13.00%;拨备覆盖率332.95%,较上年末提高 60.43 个百分点。

(二)主要人员情况

上海银行总行下设资产托管部,是从事资产托管业务的职能部门,内设托管产品部、托管运作部、行管运作部、稽核监督部、系统管理部,平均年龄30岁左右,100%员工拥有大学本科以上学历,业务岗位人员均具有基金从业资格。

(三)基金托管业务经营情况

上海银行于2009年8月18日获得中国证监会、中国银监会核准开办证券投资基金托管业务,批准文号:中国证监会证监许可[2009]814号。

截至2019年3月末,上海银行已托管27只证券投资基金,分别为天治新消费灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)、中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数增强型证券投资基金、鹏华双债增利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、鹏华双债保利债券型证券投资基金、前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、中银安心回报半年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金、华安添颐混合型发起式证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金、博时裕荣纯债债券型证券投资基金、博时悦楚纯债债券型证券投资基金、浙商惠盈纯债债券型证券投资基金、兴业福益债券型证券投资基金、大成慧成货币市场证券投资基金、嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金、嘉实稳祥纯债债券型证券投资基金、博时裕弘纯债债券型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、永赢荣益债券型证券投资基金、长江可转债债券型证券投资基金和平安惠聚纯债债券型证券投资基金,托管基金的资产净值合计264.06亿元。

三、相关服务机构

(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(AXASPDB-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

A. 银行、证券、期货公司

(1)上海银行股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路168号
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路168号
法定代表人:金煜
服务热线:95594
网址:www.bosc.cn

(2)交通银行股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
法定代表人:彭纯
服务热线:95559
网址:www.bankcomm.com

(3)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东一路12号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:高国富
服务热线:95528
网址:www.spdb.com.cn

(4)招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人:李建红
服务热线:95555
网址:www.cmbchina.com

(5)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
服务热线:95558
网址:bank.ecitic.com

(6)宁波银行股份有限公司
注册地址:浙江省宁波市鄞州区宁东路345号
办公地址:浙江省宁波市鄞州区宁东路345号
法定代表人:陆华裕
服务热线:95574
网址:www.nbcb.com.cn

(7)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
服务热线:95525
网址:www.ebscn.com

(8)申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
服务热线:021-33389888
网址:www.swhysc.com

(9)申万宏源西部证券有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人:韩志谦
服务热线:4008000562
网址:www.hysec.com

(10)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:杨德红
服务热线:95521或400-8888-666
网址:www.gtja.com

(11)中泰证券股份有限公司
注册地址:山东省济南市市中区经七路86号
办公地址:山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人:李玮
服务热线:95538
网址:www.zts.com.cn

(12)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2-6层
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2-6层
法定代表人:陈共炎
服务热线:4008-888-888或95551
网址:www.chinastock.com.cn

(13)招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38至45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38至45层
法定代表人:霍达
服务热线:95565
网址:www.newone.com.cn

(14)广发证券股份有限公司
注册地址: 广东省广州市天河北路183-187号大都会广场43楼广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址: 广东省广州市天河区天河北路183-187号大都会广场40楼5楼,7楼,8楼,18楼,19楼,38-44楼.
法定代表人:孙树明
服务热线:95575
网址:www.gf.com.cn

(15)华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市江东中路228号
办公地址:南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦18楼
法定代表人:周易
服务热线:95597
网址:www.htsc.com.cn

(16)兴业证券股份有限公司
注册地址:福建省福州市湖东路268号
办公地址:福建省福州市湖东路268号
法定代表人:兰荣
服务热线:95562
网址:www.xyzq.com.cn

(17)渤海证券股份有限公司
注册地址:天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址:天津市南开区宾水西道8号
法定代表人:王春峰
服务热线:4006515988
网址:www.bhzq.com

(18)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
服务热线:95587或4008888108
网址:www.csc108.com

(19)中航证券有限公司
注册地址:南昌市红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层
办公地址:南昌市红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层
法定代表人:王宜四
服务热线:95335
网址:www.avicsec.com

(20)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
服务热线:95321
网址:www.cindasc.com

(21)华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7-8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7-10层
法定代表人:黄金琳
服务热线:96326
网址:www.hfzq.com.cn

(22)中国国际金融股份有限公司
注册地址:北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
办公地址:北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
法定代表人:丁学东
服务热线:4109101166
网址:www.cicc.com.cn

(23)平安证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:广东省深圳市福田区金田路4306号荣超大厦18楼
法定代表人:刘世安
服务热线:95511-8
网址:www.stock.pingan.com

(24)德邦证券股份有限公司
注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人:武晓春
服务热线:4008888128
网址:www.tebon.com.cn

(25)中山证券有限责任公司
注册地址:广东省深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层,8层
办公地址:广东省深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层,8层
法定代表人:黄扬录
服务热线:95329
网址:www.zszq.com

(26)爱建证券有限责任公司
注册地址:上海市世纪大道1600号32楼
办公地址:上海市世纪大道1600号32楼
法定代表人:祝健
服务热线:4001962502
网址:www.ajzq.com

(27)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市广东路689号海通证券大厦
办公地址:上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人:周杰
客服电话:95553或4008888001
公司网址:www.htsec.com.cn

B. 第三方销售

(1)天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座505
法定代表人:林义相
服务热线:010-66045555
网址:www.txsec.com

(2)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司(原数米基金)
注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
服务热线:4000766123
网址:www.fund123.cn

(3)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室
法定代表人:杨文斌
服务热线:4007009665
网址:www.ehowbuy.com

(4)上海长量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人:张跃伟
服务热线:4008202899
网址:www.erichfund.com

(5)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:杭州市文二西路1号903室
办公地址:杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大厦
法定代表人:凌顺平
服务热线:4008773772
网址:www.5ifund.com

(6)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号金座
法定代表人:其实
服务热线:4001818188
网址:www.1234567.com.cn

(7)北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室
法定代表人:周斌
服务热线:4008980618
网址:www.chtfund.com

(8)北京钱景基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人:赵荣春
服务热线:4008936885
网址:www.qianjing.com

(9)一路财富(北京)基金销售股份有限公司
注册地址:北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室
办公地址:北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室
法定代表人:吴雪秀
服务热线:4000011566
网址:www.yilucaifu.com

(10)深圳宜投基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市福田区金田路2028 号皇岗商务中心2405
法定代表人:郭海霞
服务热线:4008955811
网址:www.yitfund.com

(11)上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475 号1033 室
办公地址:上海浦东新区峨山路91 弄61 号10 号楼12 楼
法定代表人:李兴春
服务热线:95733
网址:www.leadbank.com.cn

(12)诺亚正行基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360 弄9 号3724 室
办公地址:上海市杨浦区昆明路508 号北美广场B 座12 楼
法定代表人:汪静波
服务热线:4008215399
网址:www.noah-fund.com

(13)上海陆金所基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333 号14 楼09 单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333 号14 楼
法定代表人:王之光
服务热线:4008219031
网址:www.lufunds.com

(14)上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人:陈继武
服务热线:4006433389
网址:www.vstonefund.com

(15)上海汇付基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区中山南路100号19层
办公地址:上海市宜山路700号普天信息产业园2期C5栋汇付天下总部大楼2楼
法定代表人:金佶
服务热线:021-34013999
网址:www.hotjijin.com

(16)大泰金石基金销售有限公司
注册地址:南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
办公地址:上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼
法定代表人:袁顾明
服务热线:021-22267995
网址:www.dtfunds.com

(17)北京虹点基金销售有限公司(原乐融多源)
注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
办公地址:北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层
法定代表人:胡伟
服务热线:4006180707
网址:www.hongdianfund.com

(18)珠海盈米基金销售有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6 号105 室-3491
办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东1 号保利国际广场南塔12 楼B1201-1203
法定代表人:肖雯
服务热线:020-89629066
网址:www.yingmi.cn

(19)深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801室
办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801室
法定代表人:薛峰
服务热线:4006788887
网址:www.zlfund.cn

(20)深圳富济基金销售有限公司
注册地址: 深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元
办公地址: 深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元
法定代表人:刘鹏宇
服务热线:0755-83999907
网址:www.fujifund.cn

(21)奕丰基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区千湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TAN YIK KUAN
服务热线:4006840500
网址:www.ifastps.com.cn

(22)上海联泰基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易实验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人:燕斌
服务热线:4001666788
网址:www.66zichan.com

(23)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层
法定代表人:张彦
服务热线:4001661188
网址:8.jrj.com.cn

(24)北京创金启富基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区民生胡同31号5号楼51A
办公地址:北京市西城区白纸坊东街2号经济日报社综合楼A座712室
法定代表人:梁蓉
服务热线:4006262818
网址:www.5irich.com

(25)中证金牛(北京)投资咨询有限公司
注册地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层
法定代表人:钱昊旻
服务热线:4008909998
网址:www.jnlc.com

(26)北京晟视天下投资管理有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735 号03 室
办公地址:北京市朝阳区万通中心D 座21 层
法定代表人:蒋煜
服务热线:4008188866
网址:fund.shengshiview.com

(27)北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座1108号
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座1108号
法定代表人:王伟刚
服务热线:4006199059
网址:www.hcjijin.com

(28)上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人:毛淮平
服务热线:4008175666
网址:www.amcfortune.com

(29)万家财富基金销售(天津)有限公司
注册地址: 天津自贸区(中心商务区) 迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址:北京市西城区太平桥大街丰盛胡同28号太平洋保险大厦
法定代表人:李修辞
服务热线:01059013895
网址:www.wanjiawealth.com

(30)上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市昆明路518号北美广场A1002-A1003室
法定代表人:王翔
服务热线:4008205369
网址:www.jiyufund.com.cn

(31)上海有鱼基金销售有限公司
注册地址:上海自由贸易试验区浦东大道2123号3层3E-2655室
办公地址:上海徐汇区桂平路391号B座19层
法定代表人:林琼
服务热线:021-60907378
网址:www.youyufund.com

(32)上海万得基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人:王廷富
服务热线:400-799-1888
网址:www.520fund.com.cn

(33)南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:刘汉青
服务热线:95177
网址:www.snjijin.com

(34)上海挖财基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人:冷飞
服务热线:021-50810673
网址:www.wacaijijin.com

(35)和耕传承基金销售有限公司
注册地址:郑州市郑东新区东风东路东、康宁街北6号楼6楼602、603房间
办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路6号院国际电子城b座
法定代表人:李淑慧
服务热线:4000-555-671
网址:www.hgccpb.com

(36)通华财富(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海虹口区同丰路667弄107号201室
办公地址:上海市浦东新区金沪路55号通华科技大厦7楼
法定代表人:马刚
服务热线:95193
网址:www.tonghuafund.com

(37)民商基金销售(上海)有限公司
注册地址:上海黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼A3
办公地址:上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼
法定代表人:贲惠琴
服务热线:021-50206003
网址:www.msftec.com

(38)北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人:钟斐斐
服务热线:400-159-9288
网址:www.danjuanapp.com

(39)嘉实财富管理有限公司
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元
办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法定代表人:赵学军
服务热线:400-021-8850
网址:www.harvestwm.cn

(40)腾安基金销售(深圳)有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15楼
法定代表人:刘明军
服务热线:95017
网址:www.tenganxinxi.com

(41)北京百度百盈基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区上地十街10号1幢1层101
办公地址:北京市海淀区上地信息路甲9号奎科科技大厦
法定代表人:张旭阳
服务热线:95055-9
网址:www.baiyingfund.com

(42)浦领基金销售有限公司(原众升财富)
注册地址:北京市朝阳区望京东园四区A座9层908室
办公地址:北京市朝阳区望京浦项中心A座04-08
法定代表人:李招弟
服务热线:4000598888
网址:www.zscffund.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)50938782
传真:(010)50938991

(三)出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称:盈科(上海)律师事务所
住所:上海市闸北区裕通路100号洲际中心15,16层
办公地址:上海市闸北区裕通路100号洲际中心15,16层
负责人:董冬冬
电话:(021)60561288
传真:(021)60561299
联系人:董冬冬
经办律师:董冬冬、耿海霞

(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:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:张振波
经办注册会计师:张振波、罗佳

(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,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。

四、基金的名称

本基金名称:浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)

本基金由浦银安盛增利分级债券型证券投资基金三年封闭期届满转换而来。

五、基金的类型

债券型证券投资基金

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资范围

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,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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。

(一)资产配置

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、经济周期等要素的定性与定量的考察,预测各大类资产未来收益率变化情况,在不同的大类资产之间进行动态调整和优化,以规避市场风险,提高基金收益率。

(二)固定收益类证券投资策略

1、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、哑铃型策略或梯形策略,在长期、中期和短期债券间进行合理配置,以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

2、类属配置策略

在保证流动性的基础上,本基金将通过国债、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、回购和银行存款等资产的合理组合实现稳定的投资收益。

类属配置主要策略包括研究国债与金融债之间的利差、交易所与银行间的市场利差、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。

3、个券选择策略

(1)流动性策略

本基金将通过对各类流动性指标的设置与监控,管理由于基金的申购、赎回或个券的交易难易程度而引致的潜在损失风险。

(2)信用分析策略

为了确保本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券进行信用分析。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研究模型的内部评价。该模型在信用评价方面的主要作用在于通过对部分关键的财务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。主要关键的指标包括:NET DEBT/EBITDA、EBIT/I、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债务水平与结构,其他的指标主要分析企业经营效益对未来偿债能力的支持能力。

4、回购策略

该策略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,同时选择适宜期限的交易所和银行间品种进行投资以获取骑乘及短期债券与货币市场利率的利差。

5、可转债投资策略

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债内含选择权的价值。

①积极管理策略

可转债内含选择权定价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进行深入分析研究的基础上,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,以增强本金投资的安全性;利用可转债转换价值相对于纯债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,可转债均采取定价发行,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。

6、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,根据资产证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流支付,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。

(三)新股申购策略

在股票发行市场上,股票供求关系不平衡经常导致股票发行价格与二级市场价格之间存在一定的价差,从而使得新股申购成为一种风险较低的投资方式。本基金将研究首次发行(IPO)股票及增发新股的上市公司基本面,根据股票市场整体定价水平,估计新股上市交易的合理价格,同时参考一级市场资金供求关系,谨慎参与新股申购。本基金对于通过参与新股认购所获得的股票,在可上市交易后90个交易日内全部卖出。

(四)权证投资策略

本基金将因为所持股票以及投资可分离债券等原因而被动获得权证。本基金进行权证投资时,将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化期权定价模型,确定其合理内在价值,从而构建套利交易或避险交易组合以及持有价值出现较为显著的低估的权证品种。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中证全债指数

中证全债指数是中证指数公司编制的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。

中证全债指数涵盖了在上海证券交易所、深圳证券交易所和银行间市场上市的债券。中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标,为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价,能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。该指数具有广泛的市场代表性,能够全面反映债券市场总体走势;该指数编制方法、指数数据等相关指数信息透明度高,适合作为本基金的业绩比较基准。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称,或者今后法律法规发生变化,或者有更权威的、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的业绩基准的股票指数时,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、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。

十一、基金投资组合报告

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。

本基金的托管人——上海银行股份有限公司根据本基金合同规定,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。

本投资组合报告所载数据截至2019年3月31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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,110,245,098.00	97.56
	其中:债券	1,110,245,098.00	97.56
	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	4,461,953.81	0.39
8	其他资产	23,344,613.28	2.05
9	合计	1,138,051,665.09	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。

(四)报告期末按券种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	376,817,090.00	46.11
	其中:政策性金融债	40,920,090.00	5.01
4	企业债券	450,585,508.00	55.13
5	企业短期融资券	9,990,000.00	1.22
6	中期票据	234,116,500.00	28.65
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	38,736,000.00	4.74
9	其他	-	-
10	合计	1,110,245,098.00	135.85

(五)报告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

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	1720085	17北京银行绿色金融债	500,000	51,455,000.00	6.30
2	1822035	18工银租赁债01	500,000	50,720,000.00	6.21
2	101678004	16首钢MTN001	500,000	50,455,000.00	6.17
4	101800454	18越秀集团MTN002	400,000	41,400,000.00	5.07
5	1826003	18星展银行01	400,000	41,160,000.00	5.04

(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

(七)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。

(八)报告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。

(九)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

9.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围尚未包含国债期货

9.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金投资范围尚未包含国债期货

9.3本基金投资国债期货的投资评价

本基金投资范围尚未包含国债期货

(十)投资组合报告附注

10.1本基金投资的前十名证券的发行主体除兴业银行以外不存在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。

兴业银行于2018年4月19日因未依法履行其他职责受到中国银行保险监督管理委员会处罚。

本基金管理人的研究部门对兴业银行保持了及时的研究跟踪,投资决策符合本基金管理人的投资流程。

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。

10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	26,907.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,317,695.80
5	应收申购款	10.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,344,613.28

10.4报告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。

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。

10.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

-

十二、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

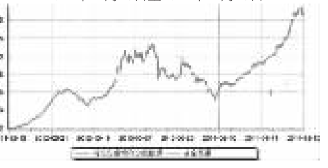
转型前

(一)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	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
2011/12/13-2011/12/31	0.20%	0.04%	0.26%	0.03%	-0.06%	0.01%
2012/01/01-2012/12/31	11.98%	0.16%	4.03%	0.04%	7.95%	0.12%
2013/01/01-2013/12/31	-1.34%	0.50%	1.78%	0.05%	-3.12%	0.45%
2014/01/01-2014/12/15	19.15%	0.27%	8.01%	0.16%	11.14%	0.11%
2011/12/13-2014/12/15	31.90%	0.34%	14.65%	0.10%	17.25%	0.24%

(二)自基金合同生效以来基金累计份额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
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
2011年12月13日至2014年12月15日



转型后

(一)A类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:

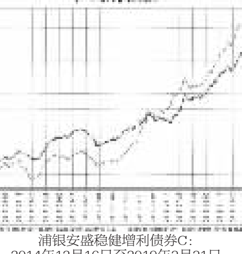
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2017/01/23-2017/12/31	1.26%	0.06%	-0.29%	0.06%	1.55%	0.00%
2018/01/01-2018/12/31	5.19%	0.07%	8.85%	0.07%	-3.66%	0.00%
2019/01/01-2019/03/31	1.37%	0.06%	1.42%	0.06%	-0.05%	0.00%
2017/01/23-2019/03/31	7.98%	0.07%	10.08%	0.07%	-2.10%	0.00%

(二)C类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:

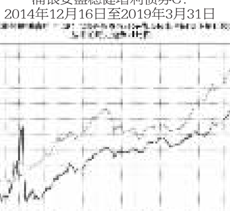
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2014/12/16-2014/12/31	-0.40%	0.13%	1.30%	0.09%	-1.70%	0.04%
2015/01/01-2015/12/31	2.91%	0.45%	6.51%	0.07%	-3.60%	0.38%
2016/01/01-2016/12/31	3.43%	0.09%	2.00%	0.09%	1.43%	0.00%
2017/01/01-2017/12/31	1.37%	0.06%	-0.34%	0.06%	1.71%	0.00%
2018/01/01-2018/12/31	4.91%	0.07%	8.85%	0.07%	-3.94%	0.00%
2019/01/01-2019/03/31	1.28%	0.06%	1.42%	0.06%	-0.14%	0.00%
2014/12/16-2019/03/31	14.18%	0.23%	21.08%	0.08%	-6.90%	0.15%

(三)自基金转型以来基金累计份额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

浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
浦银安盛稳健增利债券A:
2017年1月23日至2019年3月31日



浦银安盛稳健增利债券C:
2014年12月16日至2019年3月31日



注:1、本基金由浦银安盛增利分级债券型证券投资基金于2014年12月16日转型而来。

2、自2015年9月17日起,本基金业绩比较基准由原"中信标普全债指数"变更为"中证全债指数"。具体内容详见基金管理人于2015年9月17日发布的《关于变更旗下基金业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》。

3、经向中国证监会备案,本基金于2017年1月23日分为A、C两类。具体内容详见本基金管理人于2017年1月23日刊登的《关于浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)增加A类基金份额并修订基金合同部分条款的公告》。

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、基金销售服务费;
4、基金上市费用;
5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费;
7、基金份额持有人大会费用;
8、基金的证券交易费用;
9、基金的银行汇划费用;
10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

在通常情况下,本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下:

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。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下,本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.1%÷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。

3、C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.35%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.35%÷当年天数
H 为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费
E 为C类基金份额前一日的基金资产净值

C类基金份额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。

上述一、基金费用的种类中第4-9项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(四)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(五)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等相关费率。

调高基金管理费率或基金托管费率或基金销售服务费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率或基金托管费率或基金销售服务费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定至少在一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

(六)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在"重要提示"部分,更新了招募说明书所载内容截止日和有关财务数据和净值表现截止日;
2、在"第四部分 基金管理人"部分,对"主要人员情况"和"基金管理人的内部控制制度"进行了更新;
3、在"第五部分 基金托管人"部分,对"基金托管人情况"进行了更新;
4、在"第六部分 相关服务机构"部分,对"基金份额发售机构"部分内容进行了更新;
5、对"第九部分 基金份额的申购与赎回",对"定期定额投资计划"部分内容进行了更新;
6、在"第十部分 基金的投资"部分,补充了本基金投资组合报告的内容和截至2019年3月31日的投资业绩;
7、在"第二十二部分 其他应披露事项"部分,更新了本基金招募说明书更新期间,本基金及基金管理人的有关公告。

浦银安盛基金管理有限公司
二〇一九年七月二十七日