浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月25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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月23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2017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6个月定期债券
基金主代码	519121
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月16日
报告期末基金份额总额	61,388,274.59份
投资目标	在控制风险的基础上,追求超过业绩比较基准的当期收入和投资总回报,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。
投资策略	本基金利用定期开放、定期封闭的运作特性,秉承主动投资管理理念,在有效流动性管理和控制风险的前提下,优化组合、稳健投资,实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	6个月定期存款利率(税后)
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,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	浦银安盛6个月定期债券A	浦银安盛6个月定期债券C
下属分级基金的交易代码	519121	519122
报告期末下属分级基金的份额总额	46,900,609.83份	14,487,664.76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(2017年7月1日-2017年9月30日)	
	浦银安盛6个月定期债券A	浦银安盛6个月定期债券C
1. 本期已实现收益	614,250.36	174,318.70
2. 本期利润	412,198.29	106,937.52
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0088	0.0075
4. 期末基金资产净值	50,090,820.89	15,439,915.56
5. 期末基金份额净值	1.068	1.066

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

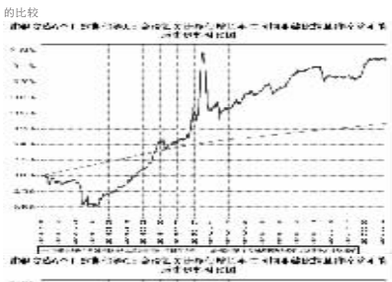
浦银安盛6个月定期债券A

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	0.85%	0.07%	0.33%	0.00%	0.52%	0.07%

浦银安盛6个月定期债券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	0.85%	0.07%	0.33%	0.00%	0.52%	0.07%

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		
刘大巍	公司旗下浦银安盛6个月债券基金、浦银安盛季季添利债券基金、浦银安盛稳健增利债券基金(LOF)、浦银安盛月月盈债券基金、浦银安盛幸福聚利债券基金、浦银安盛盛跃债券基金基金经理	2016年8月17日	-	7	刘大巍先生,上海财经大学经济学博士。加盟浦银安盛基金前,曾在万家基金、泰信基金工作,先后从事固定收益研究、基金经理助理、债券投资经理等工作。2014年4月加盟浦银安盛基金公司,从事固定收益专户产品的投资工作。2016年8月转岗至固定收益投资部,担任公司旗下浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)、浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金以及浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2017年4月起,担任公司旗下浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金及浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017年6月8日起,担任浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金基金经理。

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。
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。本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差异分析,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

三季度国内经济走势见顶回落,供给收缩的同时需求也在走弱,整个三季度GDP增速和平减指数大概率均低于前值。债券市场以震荡为主,一方面经济数据有所滑坡,另一方面货币政策中性偏紧而社会整体融资需求持续旺盛,配置力量难以主导出趋势性行情;市场仍处在收益率磨顶的状态,整个三季度收益率水平小幅下行。报告期内,本基金配置了中性仓位、中等久期的信用债,并择机进行了可转债和政策性金融债等的波段操作。本基金秉承稳健专业的投资理念,谨慎操作、严格风控,勤勉尽责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6个月定期债券A基金份额净值为1.0680元,本报告期基金份额净值增长率为0.85%;截至本报告期末浦银安盛6个月定期债券C基金份额净值为1.0660元,本报告期基金份额净值增长率为0.85%;同期业绩比较基准收益率为0.33%。

4.6 报告期内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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	68,623,336.61	97.22
	其中:债券	68,623,336.61	97.22
	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	212,383.80	0.30
8	其他资产	1,746,769.19	2.47
9	合计	70,582,489.60	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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	56,190,204.00	85.75
5	企业短期融资券	4,005,200.00	6.11
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	3,405,028.50	5.20
8	同业存单	-	-
9	其他	5,022,904.11	7.66
10	合计	68,623,336.61	104.72

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	1580009	15本溪债	50,000	5,048,000.00	7.70
2	125400	14铜水务	50,000	5,022,904.11	7.66
3	1580313	15泪罗城投债	50,000	4,964,000.00	7.58
4	122080	11康美债	40,000	4,031,200.00	6.15
5	011772016	17灵山SCP002	40,000	4,005,200.00	6.11

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

本基金投资的前十名证券的发行主体除15中银债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。中银国际证券因违规开户,于2016年11月15日被全国股转公司处以公开谴责的纪律处分,本基金管理人的研究部门对15中银债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。

5.10.2

报告期内,本基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定备选股票库投资的情况。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,982.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,742,786.65
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,746,769.19

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110032	三一转债	944,480.00	1.44
2	110034	九州转债	616,900.00	0.94
3	113010	江南转债	528,400.00	0.81

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。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

截至本报告期末本基金持有中小企业私募债余额为5,022,904.11元,明细如下:

金额单位:元

债券代码	债券名称	票面利率(%)	数量(张)	期末估值总额
125400	14铜水务	9.50	50,000	5,022,904.11

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	浦银安盛6个月定期债券A	浦银安盛6个月定期债券C
报告期期初基金份额总额	56,581,976.42	10,590,350.51
报告期期间基金总申购份额	9,952,097.55	8,177,708.77
减:报告期期间基金总赎回份额	19,633,464.14	4,280,394.52
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	46,900,609.83	14,487,664.76

§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6个月定期开放债券型证券投资基金基金合同
3、浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书
4、浦银安盛6个月定期开放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
2017年10月25日

浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017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:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月25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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月23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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛安和回报定开混合
基金主代码	004276
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月23日
报告期末基金份额总额	458,050,183.97份
投资目标	在严格控制投资风险的前提下,力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,寻找各类资产的潜在良好投资机会。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,实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×20%+中证全债指数收益率×80%。
风险收益特征	本基金为债券投资为主的混合型基金,属于中等风险、中等收益预期的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金,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	中国民生银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	浦银安盛安和回报A	浦银安盛安和回报C
下属分级基金的交易代码	004276	004277
报告期末下属分级基金的份额总额	395,458,491.94份	62,591,692.03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(2017年7月1日-2017年9月30日)	
	浦银安盛安和回报A	浦银安盛安和回报C
1. 本期已实现收益	5,642,747.84	835,712.20
2. 本期利润	8,462,416.51	1,281,302.54
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0214	0.0205
4. 期末基金资产净值	407,635,016.50	64,400,906.19
5. 期末基金份额净值	1.0308	1.0289

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

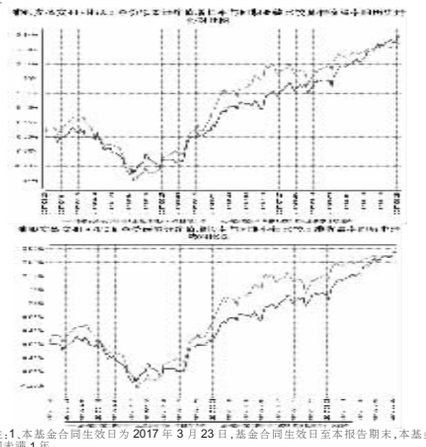
浦银安盛安和回报A

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	2.12%	0.11%	1.38%	0.12%	0.74%	-0.01%

浦银安盛安和回报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	2.03%	0.11%	1.38%	0.12%	0.65%	-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



注:1.本基金合同生效日为2017年3月23日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满1年。

2.根据基金合同第十二部分第四条规定:基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为2017年3月23日至2017年9月22日。建仓期结束后符合相关约定。

§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		
褚艳辉	公司旗下浦银安盛新经济结构混合基金、浦银安盛盛世精选混合基金基金经理、浦银安盛经济带崛起混合基金、浦银安盛和回报定期开放混合基金基金经理。	2017年3月23日	-	9	褚艳辉先生,南京理工大学经济学硕士。2004年至2010年,先后就职于上海信息中心、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,担任本公司权益类基金基金基金经理助理。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带崛起混合基金基金经理。2017年3月起,兼任公司旗下浦银安盛安和回报定期开放混合基金基金经理。

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。
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。本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差异分析,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,工业企业效益提升,PMI指标继续小幅上行,经济维持稳健增长。供给侧改革推动相关产业集中度提升,企业盈利明显恢复。在蓝筹股与周期股带动下,股票市场有所反弹,但中小创相对低迷。受供给侧改革、环保趋严等影响,部分产品价格上涨,如钢铁、煤炭、电解铝、稀土、化工品等。

报告期内,本基金的固定收益占比相对较高,采取了绝对收益的投资思路。在权益类资产配置上,重点考虑估值的因素,稳健增长的消费品是选股主线之一。择机对固定收益类品种进行波段操作,留意资金市场价格变动带来的确定性收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛安和回报A基金份额净值为1.0308元,本报告期基金份额净值增长率为2.12%;截至本报告期末浦银安盛安和回报C基金份额净值为1.0289元,本报告期基金份额净值增长率为2.03%;同期业绩比较基准收益率为1.38%。

4.6 报告期内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	73,355,868.82	15.52
	其中:股票	73,355,868.82	15.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	343,940,500.00	72.75
	其中:债券	343,940,500.00	72.75
	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	40,150,380.23	8.49
	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	9,990,480.42	2.11
8	其他资产	5,360,322.52	1.13
9	合计	472,797,551.99	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	39,793.60	0.01
C	制造业	39,480,105.38	8.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,463,880.00	1.37
F	批发和零售业	1,424,385.45	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	5,067,371.91	1.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,401,968.03	0.30
J	金融业	17,101,640.00	3.62
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,151,000.00	0.24
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	1,225,724.45	0.26
S	综合	-	-
	合计	73,355,868.82	15.54

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	601166	兴业银行	200,000	3,458,000.00	0.73
2	600779	水井坊	80,000	3,345,600.00	0.71
3	600809	山西汾酒	59,800	3,291,990.00	0.70
4	000568	泸州老窖	50,000	2,805,000.00	0.59
5	601009	南京银行	344,000	2,721,040.00	0.58
6	600522	中天科技	180,000	2,572,200.00	0.54
7	600036	招商银行	100,000	2,555,000.00	0.54
8	601328	交通银行	400,000	2,528,000.00	0.54
9	600104	上汽集团	80,000	2,415,200.00	0.51
10	600643	爱建集团	160,000	2,236,800.00	0.47

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	25,094,500.00	5.32
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	318,846,000.00	67.55
9	其他	-	-
10	合计	343,940,500.00	72.86

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	111713047	17浙商银行CD047	300,000	28,974,000.00	6.14
2	011778003	17幸福基业SCP002	200,000	20,088,000.00	4.26
3	111784794	17盛京银行CD245	200,000	19,552,000.00	4.14
4	111796486	17长城华西银行CD053	200,000	19,538,000.00	4.14
5	111780097	17富滇银行CD166	200,000	19,306,000.00	4.09

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	65,752.82
2	应收证券清算款	172,092.17
3	应收股利	-
4	应收利息	5,122,477.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,360,322.52

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

注:本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	浦银安盛安和回报A	浦银安盛安和回报C
报告期期初基金份额总额	395,458,491.94	62,591,692.03
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	395,458,491.94	62,591,692.03

§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	20170701-20170930	119,999,000.00	0.00	0.00	119,999,000.00	26.20%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

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仓位调整的困难,产生冲击成本的风险,并造成基金净值的波动;同时,该等大额赎回将可能产生:1)单位净值尾差风险;2)基金净值大幅波动的风险;3)因引发基金本身的巨额赎回而导致中小投资者无法及时赎回的风险;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、浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金基金合同
3、浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金招募说明书
4、浦银安盛安和回报定期开放混合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
2017年10月25日

浦银安盛货币市场证券投资基金

2017年第三季度报告

2017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:2017年10月25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2017年10月23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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛货币
基金主代码	519509
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月9日
报告期末基金份额总额	31,712,595,526.35份
投资目标	力求在保持基金资产安全性和良好流动性的基础上,获得超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	根据对短期利率变动的预测,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略,利用基本分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保证流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。
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	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B	浦银安盛货币E
下属分级基金的交易代码	519509