浦银安盛盛跃纯债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:广州农村商业银行股份有限公司

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。

基金托管人广州农村商业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	浦银安盛盛跃纯债债券	
基金主代码	519330	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年3月21日	
报告期末基金份额总额	3,988,142,557.85份	
投资目标	在严格控制投资风险的前提下,力争长期内实现超越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,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于较低风险/收益的产品。	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司	
基金托管人	广州农村商业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛盛跃纯债债券A	浦银安盛盛跃纯债债券C
下属分级基金的交易代码	519330	519331
报告期末下属分级基金的份额总额	3,988,055,071.89份	87,485.96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)	
	浦银安盛盛跃纯债债券A	浦银安盛盛跃纯债债券C
1. 本期已实现收益	43,014,908.48	890.80
2. 本期利润	44,084,187.79	898.92
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0111	0.0100
4. 期末基金资产净值	4,029,682,449.54	88,361.39
5. 期末基金份额净值	1.0104	1.0100

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

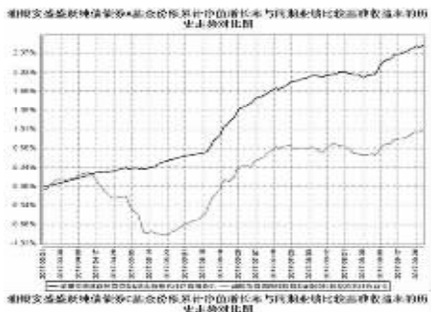
浦银安盛盛跃纯债债券A

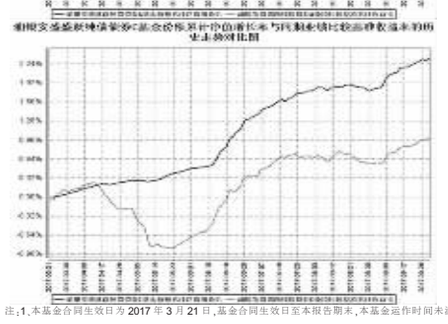
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.10%	0.02%	0.63%	0.03%	0.47%	-0.01%

浦银安盛盛跃纯债债券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	1.02%	0.02%	0.63%	0.03%	0.39%	-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21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21日至2017年9月20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		
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、浦银安盛跃债券基金经理	2017年6月8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的基金经理。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的基金经理。

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盛跃纯债债券A基金份额净值为1.0104元,本报告期基金份额净值增长率为1.10%;截至本报告期末浦银安盛盛跃纯债债券C基金份额净值为1.0100元,本报告期基金份额净值增长率为1.02%;同期业绩比较基准收益率为0.63%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,306,830,000.00	98.07
	其中:债券	4,167,190,000.00	94.89
	资产支持证券	139,640,000.00	3.18
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	9,269,983.57	0.21
8	其他资产	75,395,552.46	1.72
9	合计	4,391,495,536.03	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	1,906,856,000.00	47.32
	其中:政策性金融债	1,057,279,000.00	26.24
4	企业债券	410,111,000.00	10.18
5	企业短期融资券	481,224,000.00	11.94
6	中期票据	787,592,000.00	19.54
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	581,407,000.00	14.43
9	其他	-	-
10	合计	4,167,190,000.00	103.41

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	170409	17农发09	4,200,000	417,270,000.00	10.35
2	1528002	15民生银行二级	3,500,000	355,145,000.00	8.81
3	101754011	17绿城房产MTN001	3,000,000	304,440,000.00	7.55
4	1520009	15北京银行二级	2,000,000	203,240,000.00	5.04
5	101759015	17远洋集团MTN001A	2,000,000	200,700,000.00	4.98

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1789110	17丰耀1A	1,000,000	65,590,000.00	1.63
2	1689242	16速利银丰2A	2,000,000	59,500,000.00	1.48
3	1789119	17融腾2A1	500,000	14,550,000.00	0.36

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	51,921.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	75,343,630.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	75,395,552.46

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	浦银安盛盛跃纯债债券A	浦银安盛盛跃纯债债券C
报告期期初基金份额总额	3,988,052,927.13	86,708.08
报告期期间基金总申购份额	4,624.79	21,685.25
减:报告期期间基金总赎回份额	2,480.03	20,907.37
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	3,988,055,071.89	87,485.96

§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	3,988,035,473.08	0.00	0.00	3,988,035,473.08	100.00%
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、浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金基金合同

3、浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金招募说明书

4、浦银安盛盛跃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

浦银安盛盛元纯债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:兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	4,943,009,634.50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,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	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	4,942,183,677.15份	825,957.35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	57,539,182.75	8,743.91
2. 本期利润	54,552,996.92	8,162.18
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0110	0.0099
4. 期末基金资产净值	5,093,187,740.66	849,393.97
5. 期末基金份额净值	1.0306	1.0284

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

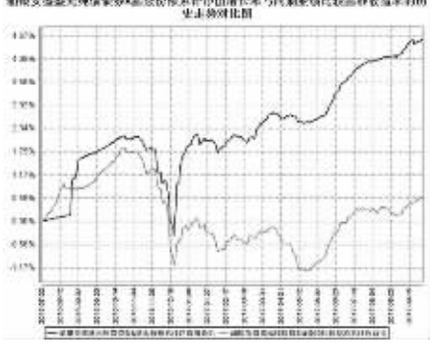
浦银安盛盛元纯债债券A

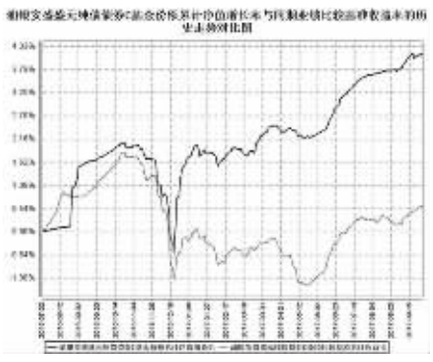
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.09%	0.03%	0.63%	0.03%	0.46%	0.00%

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	0.99%	0.03%	0.63%	0.03%	0.36%	0.00%

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2016年7月22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2016年7月22日至2017年1月21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		
章潇枫	公司旗下浦银安盛盛鑫债券基金、浦银安盛盛泰债券基金、浦银安盛盛达债券基金、浦银安盛盛稳健增利债券基金(LOF)、浦银安盛幸福回报债券基金、浦银安盛优化收益债券基金、浦银安盛盛元债券基金以及浦银安盛盛勤债券基金基金经理。	2017年6月8日	-	6	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15日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、浦银安盛幸福聚益18个月定期开放债券型证券投资基金及浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年6月8日起担任公司旗下浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛盛元债券型证券投资基金及浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金的基金经理。

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盛元纯债债券A基金份额净值为1.0306元,本报告期基金份额净值增长率为1.09%;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1.0284元,本报告期基金份额净值增长率为0.99%;同期业绩比较基准收益率为0.63%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,105,643,200.00	97.66
	其中:债券	4,952,036,100.00	94.72
	资产支持证券	153,607,100.00	2.94
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	34,200,000.00	0.65
	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	2,055,240.70	0.04
8	其他资产	86,009,940.92	1.65
9	合计	5,227,908,381.62	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	615,940,000.00	12.09
	其中:政策性金融债	615,940,000.00	12.09
4	企业债券	1,981,573,600.00	38.90
5	企业短期融资券	1,548,439,500.00	30.40
6	中期票据	777,133,000.00	15.26
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	28,950,000.00	0.57
9	其他	-	-
10	合计	4,952,036,100.00	97.21

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	122774	11滨海02	2,500,000	257,075,000.00	5.05
2	130142	14施信10	2,000,000	201,940,000.00	3.96
3	011764064	17广州金融SCP002	2,000,000	200,280,000.00	3.93
4	011760127	17中建材SCP014	2,000,000	200,140,000.00	3.93
5	160208	16国开08	2,000,000	195,980,000.00	3.85

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1689087	16永生1A2	1,000,000	85,090,000.00	1.67
2	1689124	16德宝天元1A2	1,500,000	26,730,000.00	0.52
3	1589305	15开元9A3	600,000	18,156,000.00	0.36
4	1689083	16福元1A	1,000,000	12,560,000.00	0.25
5	1589272	15中盈1A3	700,000	7,973,000.00	0.16
6	1689044	16旭越1A2	690,000	3,098,100.00	0.06

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	25,663.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	85,984,277.03
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	86,009,940.92

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	4,942,292,342.39	762,970.58
报告期期间基金总申购份额	10,665.84	203,218.10
减:报告期期间基金总赎回份额	119,331.08	140,231.33
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	4,942,183,677.15	825,957.35

§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	4,941,570,422.63	0.00	0.00	4,941,570,422.63	99.97%
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

浦银安盛盛泰纯债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:交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	浦银安盛盛泰纯债债券	
基金主代码	519328	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年11月11日	
报告期末基金份额总额	200,251,049.98份	
投资目标	在严格控制投资风险的前提下,力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。