浦银安盛消费升级灵活配置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: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	浦银安盛消费升级混合
基金主代码	519125
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年 12 月 4 日
报告期末基金份额总额	71,352,629.01 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可持续增长、经济结构转型趋势和消费升级驱动的大消费行业及其相关行业的投资机会,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	(1)资产配置策略 资产配置策略采用浦银安盛资产配置模型,通过宏观经济、估值水平、流动性和市场政策等四个因素的分析框架,动态把握不同资产类别的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化,进行股票、固定收益证券和现金等大类资产的合理配置,在严格控制投资风险的基础上追求基金资产的长期持续稳定增长。 (2)股票投资策略 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可持续增长、经济结构转型趋势和消费升级驱动的大消费行业及其相关行业,结合对大消费行业及其相关行业的发展趋势的研究分析,上市公司发展战略、商业模式、技术、工艺的分析,对属于消费升级投资主题范畴的上市公司进行重点投资。 (3)债券投资组合策略 另外,本基金债券投资将适当运用杠杆策略,通过债券回购融入资金,然后买入收益率更高的债券以获得收益。
业绩比较基准	55%× 中证内地消费主题指数 +45%× 中证全债指数
风险收益特征	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	交通银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	浦银安盛消费升级混合 A / 浦银安盛消费升级混合 C
下属分级基金的交易代码	519125 / 519176
报告期末下属分级基金的份额总额	70,203,064.98 份 / 1,149,564.03 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)	
	浦银安盛消费升级混合 A	浦银安盛消费升级混合 C
1. 本期已实现收益	13,135,443.58	185,595.82
2. 本期利润	19,906,542.83	242,300.58
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2653	0.2350
4. 期末基金资产净值	123,952,311.33	2,023,948.28
5. 期末基金份额净值	1.766	1.761

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。

4.自 2016 年 1 月 21 日起,本基金增加 C 级基金份额类别,2016 年 1 月 22 日,确认 C 级基金份额。

5.本基金增加 C 类基金份额类别后,本基金分设 A 类和 C 类两类基金份额,分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。原有的基金份额全部自动转换为浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额。

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

浦银安盛消费升级混合 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	17.26%	1.30%	2.65%	0.44%	14.61%	0.86%

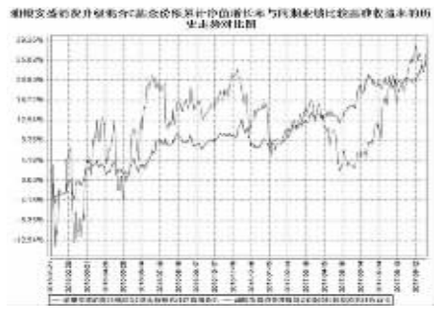
浦银安盛消费升级混合 C

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	17.56%	1.30%	2.65%	0.44%	14.91%	0.86%

注:

1.自 2015 年 10 月 1 日起,本基金比较基准由"55%× 中证内地消费主题指数 +45%× 中信标普全债指数"变更为"55%× 中证内地消费主题指数 +45%× 中证全债指数"。具体内容详见基金管理人于 2015 年 11 月 13 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司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》。

3.2.2 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 2016 年 1 月 21 日分为 A、C 两类。具体内容详见本基金管理人于 2016 年 1 月 21 日刊登的《关于浦银安盛消费升级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		
吴勇	本公司投资总监、权益投资部总监、公司旗下浦银安盛精致生活混合基金、浦银安盛新兴产业混合基金、浦银安盛消费升级混合基金、浦银安盛睿智精选混合基金基金经理	2013 年 12 月 4 日	-	10	吴勇先生,上海交通大学材料工程系学士,上海交通大学工商管理硕士,CPA、CFA、中国注册造价师。1993 年 8 月至 2007 年 8 月先后就职于上海电力建设有限责任公司任预算主管、国家开发银行上海市分行任评审经理。2007 年 9 月起加盟浦银安盛基金管理有限公司先后担任行业研究员、基金经理助理。2010 年 4 月 - 2016 年 1 月起担任浦银安盛红利精选混合基金基金经理。2011 年 5 月起兼任浦银安盛精致生活混合基金基金经理。2013 年 3 月起,兼任浦银安盛战略新兴产业混合基金基金经理。2013 年 12 月起兼任浦银安盛消费升级混合基金基金经理。2016 年 2 月起兼任浦银安盛睿智精选混合基金基金经理。2012 年 11 月起兼任本公司权益投资部总监。2016 年 4 月起兼任本公司投资总监。

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,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

2017 年 3 季度,国内经济总体发展较为良好,在货币政策保持中性偏紧的情况下,GDP 保持了稳定的增速,受益于供给侧改革和环保督查,传统周期性和高污染行业的集中度大幅提升,龙头公司和行业内具有比较优势的公司盈利能力大幅改善。预计政府未来还是会延续当前的宏观和货币政策,在保持经济适度增长的基础上提升经济发展的质量。

本基金在三季度增配了业绩大幅改善的化工、造纸、钢铁等行业。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛消费升级混合 A 基金份额净值为 1.7660 元,本报告期基金份额净值增长率为 17.26%;截至本报告期末浦银安盛消费升级混合 C 基金份额净值为 1.7610 元,本报告期基金份额净值增长率为 17.56%;同期业绩比较基准收益率为 2.65%。

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	118,302,331.35	92.82
	其中:股票	118,302,331.35	92.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	8,773,550.29	6.88
8	其他资产	372,381.12	0.29
9	合计	127,448,262.76	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按代码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	2,709,372.23	2.15
C	制造业	103,335,196.20	82.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,265,700.00	3.39
F	批发和零售业	1,563,800.00	1.24
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	94,891.38	0.08
J	金融业	2,417,905.00	1.92
K	房地产业	3,588,699.00	2.85
L	租赁和商务服务业	79,324.72	0.06
M	科学研究和技术服务业	81,588.27	0.06
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	115,299.99	0.09
R	文化、体育和娱乐业	24,982.65	0.02
S	综合	-	-
	合计	118,302,331.35	93.91

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	600260	凯乐科技	290,900	9,340,799.00	7.41
2	603589	口子窖	146,400	7,156,032.00	5.68
3	603369	今世缘	431,500	6,904,000.00	5.48
4	600966	博汇纸业	939,700	6,794,031.00	5.39
5	600230	沧州大化	95,100	5,159,175.00	4.10
6	300100	双林股份	186,317	5,153,528.22	4.09
7	600183	生益科技	329,000	5,043,570.00	4.00
8	600581	八一钢铁	310,000	4,522,900.00	3.59
9	002717	岭南园林	144,600	4,265,700.00	3.39
10	300618	寒锐钴业	21,200	4,105,592.00	3.26

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体除凯乐科技,今世缘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。湖北凯乐科技股份有限公司(以下简称"公司")于 2016 年 12 月 26 日收到了中国证券监督管理委员会湖北证监局对公司下达的《湖北证监局关于对湖北凯乐科技股份有限公司采取出具警示函措施的决定》。今世缘公司副总经理严汉忠先生于2016 年 10 月 18 日起通过上海证券交易所竞价交易系统累计减持公司股票 40,000 股,存在违规减持公司股票行为。本基金管理人的研究部门对凯乐科技、今世缘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。

5.11.2

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	136,188.35
2	应收证券清算款	146,393.40
3	应收股利	-
4	应收利息	2,033.16
5	应收申购款	87,766.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	372,381.12

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	300100	双林股份	5,153,528.22	4.09	临时停牌
2	600581	八一钢铁	4,522,900.00	3.59	临时停牌

注:本基金报告期末前十名股票中除双林股份和八一钢铁外不存在其他流通受限股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	浦银安盛消费升级混合 A	浦银安盛消费升级混合 C
报告期期初基金份额总额	80,918,512.22	901,082.07
报告期期间基金总申购份额	9,772,398.56	1,302,582.90
减:报告期期间基金总赎回份额	20,487,845.80	1,054,100.94
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	70,203,064.98	1,149,564.03

§ 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。

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、浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金基金合同

3、浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

4、浦银安盛消费升级灵活配置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

浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)

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:上海银行股份有限公司

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。

基金托管人上海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	浦银安盛稳健增利债券(LOF)
场内简称	增利 C
基金主代码	166401
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年 12 月 13 日
报告期末基金份额总额	1,224,549,872.55 份
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。
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。
业绩比较基准	中证全债指数
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。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	上海银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	浦银安盛稳健增利债券(LOF)A / 浦银安盛稳健增利债券(LOF)C
下属分级基金的场内简称	- / 增利 C
下属分级基金的交易代码	004126 / 166401
报告期末下属分级基金的份额总额	1,184,854,455.57 份 / 39,695,416.98 份

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.本基金于 2017 年 1 月 23 日增加 A 类份额,详见本基金管理人于 2017 年 1 月 23 日发布的《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》

§ 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)	
	浦银安盛稳健增利债券(LOF)A	浦银安盛稳健增利债券(LOF)C
1. 本期已实现收益	12,083,714.28	377,114.12
2. 本期利润	15,099,302.22	464,055.39
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0123	0.0111
4. 期末基金资产净值	1,243,095,261.10	41,625,472.66
5. 期末基金份额净值	1.049	1.049

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。

4.2017 年 1 月 23 日增加 A 类份额。

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

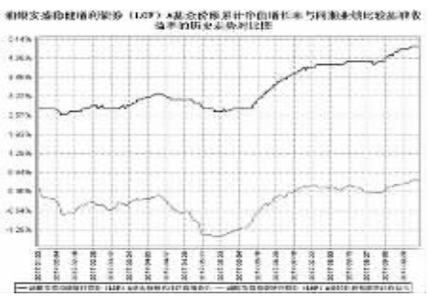
浦银安盛稳健增利债券(LOF)A

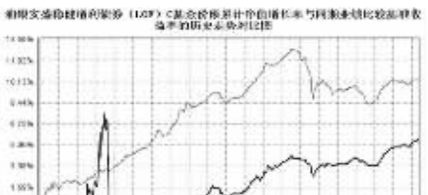
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.16%	0.04%	0.56%	0.04%	0.60%	0.00%

浦银安盛稳健增利债券(LOF)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	1.06%	0.05%	0.56%	0.04%	0.50%	0.01%

3.2.2 自基金转型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.本基金于 2017 年 1 月 23 日新增 A 类份额,具体内容详见本基金管理人于 2017 年 1 月 23 日发布的《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》。

2.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。

§ 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		
章潢枫	公司旗下浦银安盛鑫债券基金、浦银安盛盛泰债券基金、浦银安盛盛达债券基金、浦银安盛幸福聚益 18 个月债券基金、浦银安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 5 月 15 日	-	6	章潢枫先生,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、报价回购岗以及百丽债券投资岗。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。
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的基金经理。2017 年 6 月 8 日起,担任浦银安盛盛跃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滞坡,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稳健增利债券(LOF)A 基金份额净值为 1.049 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.16%,C 类净值增长率 1.06%,同期业绩比较基准收益率为 0.56%。

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	1,299,239,478.30	97.84
	其中:债券	1,299,239,478.30	97.84
	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	273,482.71	0.02
8	其他资产	28,421,297.60	2.14
9	合计	1,327,934,258.61	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	3,093,769.80	0.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	320,859,500.00	24.98
	其中:政策性金融债	320,859,500.00	24.98
4	企业债券	816,043,608.50	63.52
5	企业短期融资券	150,394,000.00	11.71
6	中期票据	8,848,600.00	0.69
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,299,239,478.30	101.13

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	170405	17农发 05	900,000	86,787,000.00	6.76
2	170415	17农发 15	850,000	85,518,500.00	6.66
3	143007	17东旭 01	700,000	70,623,000.00	5.50
4	011756035	17平安租赁 SCP006	700,000	70,077,000.00	5.45
5	1380320	13龙岩汇金债	800,000	66,584,000.00	5.18

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	123,254.24
2	应收证券清算款	410,642.71
3	应收股利	-
4	应收利息	27,887,400.65
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,421,297.60

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	浦银安盛稳健增利债券(LOF)A	浦银安盛稳健增利债券(LOF)C
报告期期初基金份额总额	1,569,832,682.57	43,751,027.64
报告期期间基金总申购份额	-	657,634.79
减:报告期期间基金总赎回份额	384,978,227.00	4,713,245.45
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	1,184,854,455.57	39,695,416.98

§ 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