

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:中国工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

基金管理人的董事及董事会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、完整性承担责任及连带责任。

基金托管人:中国工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。投资者有风险,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:浦银安盛优化收益债券

基金代码:519111

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2008年12月30日

报告期末基金份额总额:33,526,699.78份

投资目标:本基金通过对宏观经济形势及行业走势进行深入分析,在严格控制风险的前提下,通过资产配置,力争实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略:本基金主要投资于债券类资产,包括国债、地方政府债、企业债、公司债、可转债、央行票据、政策性金融债、短期融资券、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、权证、股票、权证、股票型基金、混合型基金、商品基金、货币型基金、债券型基金、高收益货币基金。

基金经理人:浦银安盛基金管理有限公司

基金管理人:中国工商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称:浦银安盛优化收益债券 A 浦银安盛优化收益债券 C

下属分级基金的交易代码:519111 519112

报告期末下属分级基金的份额总额:19,980,004.34份 13,540,695.44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

浦银安盛优化收益债券 A 浦银安盛优化收益债券 C

1.本期已实现收益 87,644.31 36,140.81

2.本期利润 352,558.04 192,915.66

3.加权平均基金份额利润 0.0173 0.0110

4.期末基金份额净值 32,057,588.76 21,028,550.71

5.期末基金份额总额 1,804 1,553

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将低于所列数字。

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 本基金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

浦银安盛优化收益债券 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

过去三个月 1.07% 0.12% 0.56% 0.04% 0.51% 0.08%

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.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将低于所列数字。

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。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1.1 本基金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

浦银安盛优化收益债券 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

过去三个月 1.04% 0.12% 0.56% 0.04% 0.48% 0.08%

3.2.2.2 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.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将低于所列数字。

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。

3.2.3.2 基金净值表现

3.2.1.2 本基金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

浦银安盛优化收益债券 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

过去三个月 -2.40% 0.68% -0.96% 0.36% -1.44% 0.32%

3.2.2.3 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.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将低于所列数字。

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。

3.2.3.3 基金净值表现

3.2.1.3 本基金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

浦银安盛优化收益债券 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

过去三个月 0.88% 0.63% 0.03% 0.25% 0.00%

3.2.2.4 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.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将低于所列数字。

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。

3.2.3.4 基金净值表现

3.2.1.4 本基金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

浦银安盛优化收益债券 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

过去三个月 1.02% 1.01%

3.2.2.5 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.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将低于所列数字。

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。

3.2.3.5 基金净值表现

3.2.1.5 本基金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

浦银安盛优化收益债券 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

过去三个月 0.79% 0.63% 0.03% 0.25% 0.00%

3.2.2.6 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.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将低于所列数字。

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。

3.2.3.6 基金净值表现

3.2.1.6 本基金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

浦银安盛优化收益债券 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

过去三个月 0.77% 0.62% 0.03% 0.25% 0.00%

3.2.2.7 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.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将低于所列数字。

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。

3.2.3.7 基金净值表现

3.2.1.7 本基金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

浦银安盛优化收益债券 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

过去三个月 0.77% 0.63% 0.03% 0.25% 0.00%

3.2.2.8 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.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将低于所列数字。

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。

3.2.3.8 基金净值表现

3.2.1.8 本基金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

浦银安盛优化收益债券 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

过去三个月 1.01% 1.01% 0.03% 0.25% 0.00%

3.2.2.9 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.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将低于所列数字。

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。

3.2.3.9 基金净值表现

3.2.1.9 本基金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

浦银安盛优化收益债券 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

过去三个月 1.01% 1.01% 0.03% 0.25% 0.00%

3.2.2.10 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.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将低于所列数字。

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。

3.2.3.10 基金净值表现

3.2.1.10 本基金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

浦银安盛优化收益债券 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

过去三个月 1.01% 1.01% 0.03% 0.25% 0.00%

3.2.2.11 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.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将低于所列数字。

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。

3.2.3.12 基金净值表现

3.2.1.12 本基金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

浦银安盛优化收益债券 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