浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）2019年半年度报告摘要

2019年6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

送出日期：2019年8月23日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2019 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	
交易代码	166401	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2011 年 12 月 13 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	
报告期末基金份额总额	734,733,708.59 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2015 年 1 月 8 日	
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	708,804,050.18 份	25,929,658.41 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，转型前曾于 2012 年 3 月 9 日至 2014 年 12 月 15 日在深圳证券交易所上市。

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》

2.2 基金产品说明

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。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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浦银安盛基金管理有限公司	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	闻怡
	联系电话	021-23212888	021-68475888
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	custody@bosc.cn
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95594
传真		021-23212985	021-68476936

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	浦银安盛稳健增利债券（LOF）A	浦银安盛稳健增利债券（LOF）C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	17,631,843.79	596,484.22
本期利润	17,541,009.59	618,369.21
加权平均基金份额本期利润	0.0242	0.0228
本期基金份额净值增长率	2.28%	2.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1098	0.1008
期末基金资产净值	794,018,259.29	28,855,008.29
期末基金份额净值	1.120	1.113

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

5、自 2017 年 1 月 23 日起，本基金增加 A 级基金份额类别。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.54%	0.04%	0.57%	0.03%	-0.03%	0.01%
过去三个月	0.90%	0.06%	0.63%	0.06%	0.27%	0.00%
过去六个月	2.28%	0.06%	2.07%	0.06%	0.21%	0.00%
过去一年	6.16%	0.06%	6.46%	0.06%	-0.30%	0.00%
自基金合同生效起至今	8.95%	0.07%	10.78%	0.07%	-1.83%	0.00%

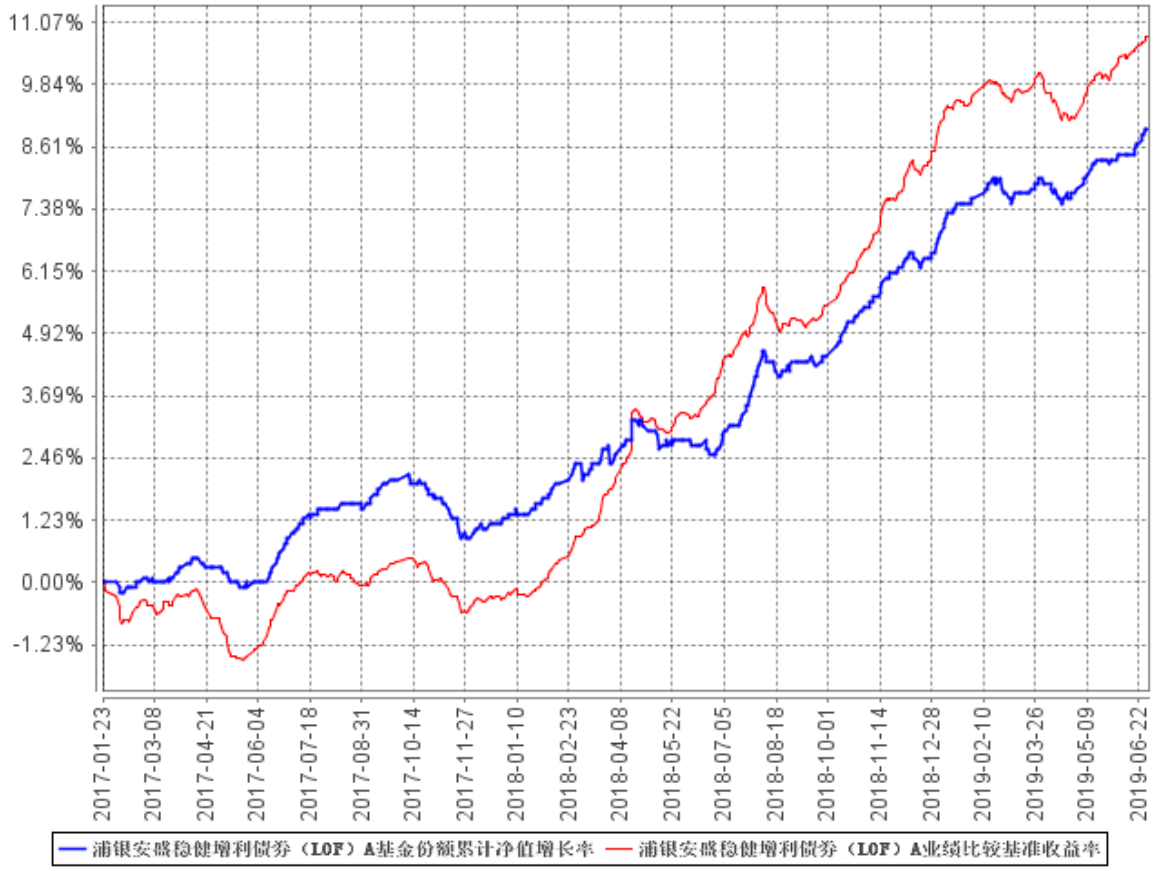
浦银安盛稳健增利债券（LOF）C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.54%	0.04%	0.57%	0.03%	-0.03%	0.01%
过去三个月	0.82%	0.05%	0.63%	0.06%	0.19%	-0.01%
过去六个月	2.11%	0.06%	2.07%	0.06%	0.04%	0.00%
过去一年	5.80%	0.06%	6.46%	0.06%	-0.66%	0.00%
过去三年	10.05%	0.07%	11.13%	0.08%	-1.08%	-0.01%
自基金合同生效起至今	15.12%	0.22%	21.85%	0.08%	-6.73%	0.14%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

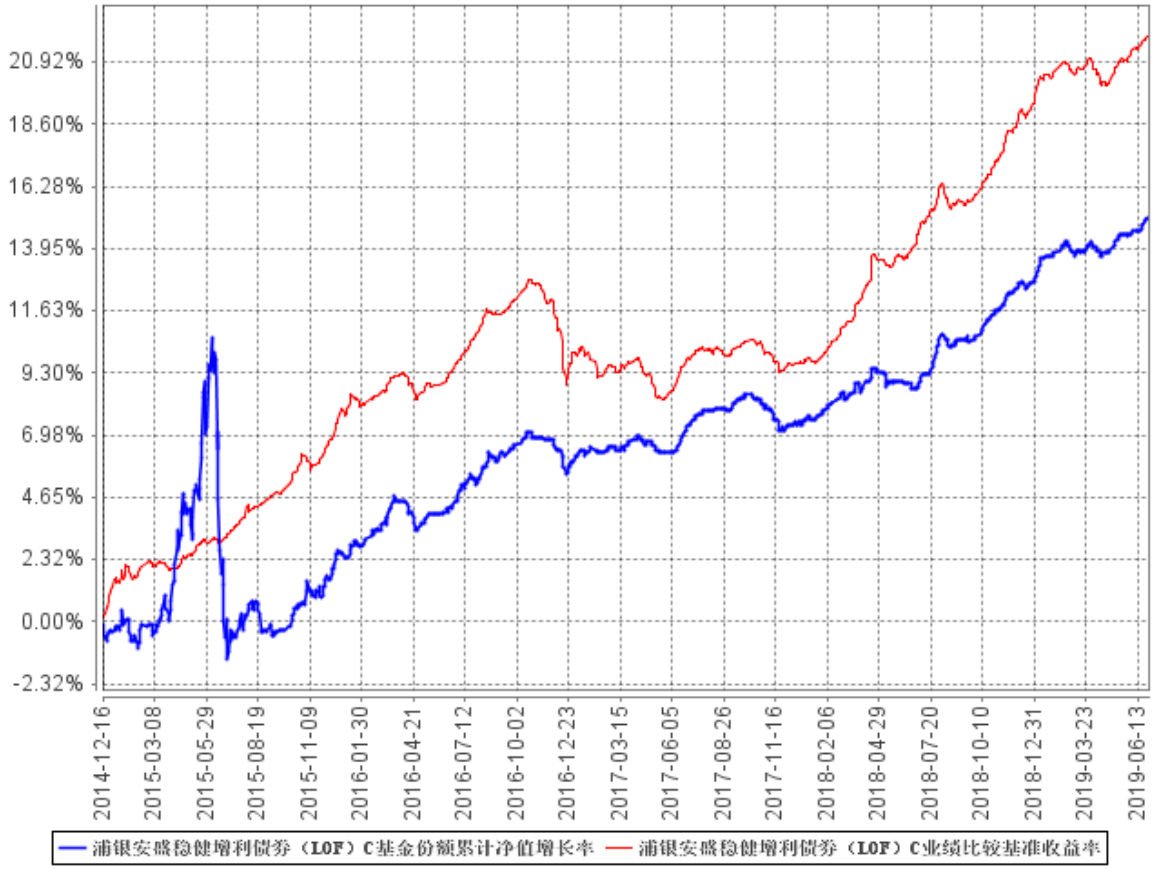
3.2.2 自基金转型生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛稳健增利债券（LOF）A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

浦银安盛稳健增利债券（LOF）C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浦银安盛基金管理有限公司（以下简称“浦银安盛”）成立于 2007 年 8 月，股东为上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A. 及上海国盛集团资产有限公司，公司总部设在上海，注册资本为人民币 19.1 亿元，股东持股比例分别为 51%、39%和 10%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理、境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务。

截至 2019 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 46 只基金，即浦银安盛价值成长混合型证券投资基金、浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛红利精选混合型证券投资基金、浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金、浦银安盛 6 个月定期开放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、浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛日日盈货币市场基金、浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金 、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金、浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛幸福聚益 18 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金、浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金、浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金(LOF)、浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安久回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金、

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

浦银安盛中短债债券型证券投资基金、浦银安盛普益纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛融定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金、浦银安盛全球智能科技股票型证券投资基金（ QDII）、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、浦银安盛双债增强债券型证券投资基金。

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，我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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	2017 年 5 月 15 日	-	8	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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	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、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金以及浦银安盛普益纯债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以及浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金基金经理。				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的基金经理。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证券投资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 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2018 年 9 月起兼任浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。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以及浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金基金经理。
郑双超	固定收益类基金基金经理助	2017 年 12 月 14 日	-	8	郑双超先生，清华大学计算数学专业硕士。2011 年 7 月至 2017 年 12 月，先

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	理				后就职于嘉实基金管理有限公司、东吴证券股份有限公司和天风证券股份有限公司，从事量化分析、固定收益分析、债券投资等工作。2017 年 12 月 14 日加盟浦银安盛基金管理有限公司担任固定收益类基金经理助理。
杜雪川	固定收益类基金基金经理助理	2018 年 4 月 4 日	-	6	杜雪川先生，上海交通大学应用经济学硕士。2013 年 7 月至 2016 年 4 月就职于德意志银行，先后从事分析师、公司评级及信用分析师等岗位。2016 年 4 月加盟浦银安盛基金管理有限公司，担任固定收益投资部信用研究员岗位。2018 年 4 月 4 日调岗担任固定收益类基金经理助理。

注：1、本基金基金经理的任职日期为公司决定的聘任日期。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《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，本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，以及公司的规章制度，本着诚实守信、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。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《公平交易管理规定》，建立健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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）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。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年经济基本面先扬后抑，债券收益率水平呈现宽幅震荡行情。一季度，信贷和社融超预期增长，建安投资增速转正拉动地产投资增速超预期，消费和大宗商品价格韧性仍强，经济基本面表现良好，与年初市场一致看空上半年经济的预期不符。全球风险偏好显著回升，国内股票市场快速上涨，债市收益率水平在年初快速下行后，整体以弱势震荡的走势消化风险偏好回升和基本面预期差。流动性方面，央行继续维持流动性合理充裕，先后落地了降准、TMLF 等宽松政策，资金利率整体维持在低位，中枢较去年四季度低约 15-20bp。一季度收益率曲线长端钝化，呈窄幅震荡行情，信用债受益于宽信用政策发力信用利差明显收窄。二季度初在一季度超预期信用扩张和经济数据冲击下，收益率曲线整体上移。但经济并没有维持以往周期中呈现的惯性上升态势，总需求在信用仍处于扩张初期就出现下滑，这与本轮经济周期的政策导向密切相关。4 月 19 日政治局会议重提“供给侧结构性改革”、“坚持结构性去杠杆”、“推动高质量发展中防范化解风险”显示出当前经济政策在稳增长与调结构、控制整体宏观杠杆率的天平上更倾向后者，在一定程度上抑制了政府加杠杆稳定经济增长的政策空间。5 月末受个别银行突发同业风险事件的影响，银行间货币市场出现了流动性分层现象，为避免事件进一步发酵，货币市场流动性趋于更加宽松。在中美贸易摩擦加剧、二季度基本面经济数据下滑以及银行间市场资金利率显著下行

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

的影响下，收益率曲线震荡下行，曲线整体陡峭化。

报告期内，本基金维持高杠杆和中等以上久期，高配中高等级信用债，整体仓位保持偏进攻的状态。

4.4.2 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 1.120 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.28%；截至本报告期末浦银安盛稳健增利债券（LOF）C 基金份额净值为 1.113 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.11%；同期业绩比较基准收益率为 2.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，考虑消费贡献了 6 成经济增长的动能，地产在因城施策之下出现结构性分化整体温和下行，周期变化的幅度减弱，经济基本面短期仍以窄幅波动为主。银行间流动性分层的情况预计仍将持续，金融机构的信用风险面临再定价，中小银行金融机构负债的难度增大、稳定性减弱，中低等级发行人主体的信用利差有走扩风险。财政支出一季度节奏较快，二季度趋于平稳，近期财政政策托底经济的积极性较强，下半年财政政策变化依然是市场面临的较大不确定性之一。总的来说，考虑流动性风险也依然没有完全消除，货币政策或继续维持较为宽松的状态，无风险利率大幅上行的风险不大，同时基本面窄幅波动、通胀水平仍高的情况下利率也缺乏大幅下行的想象空间，预计一段时间内仍以震荡为主，等待新的变量出现。

本基金将继续秉承稳健专业的投资理念，谨慎操作、严格风控，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。三季度初将以震荡市的思维操作，以 Carry 为主，逢高择机参与中长端利率债交易，力争获取稳定的票息收入和一定的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了浦银安盛基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由公司副总经理暨首席运营官、风险管理部负责人、指数与量化投资部负责人、研究部负责人、产品估值部和注册登记部负责人组成。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验、胜任能力和独立性。估值委员会的职责主要包括：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金基金经理未参与或决定基金的估值。

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司以及中债金融估值中心有限公司签订了《中债信息产品服务三方协议》。

本基金管理人与中证指数有限公司签订了《债券估值数据服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，本基金不进行收益分配；本基金《基金合同》生效后 3 年期届满，转换为上市开放式基金（LOF）后，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于截至该次收益分配基准日基金可供分配利润的 30%。

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）基金合同》 和 《浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）托管协议》的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）

报告截止日： 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	130,093.35	727,353.51
结算备付金		7,167,614.02	2,569,913.14
存出保证金		46,578.46	41,815.57
交易性金融资产	6.4.7.2	1,109,910,247.60	903,421,091.90
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,109,910,247.60	903,421,091.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	70,932,426.40
应收证券清算款		-	50,573.26
应收利息	6.4.7.5	23,065,555.63	13,322,811.87
应收股利		-	-
应收申购款		110.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,140,320,199.06	991,065,985.65
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2019 年 6 月 30 日**	**上年度末 2018 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		316,699,551.49	238,424,729.46
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2.02	503.44
应付管理人报酬		210,664.88	179,900.56
应付托管费		70,221.62	59,966.87
应付销售服务费		8,411.03	9,169.46
应付交易费用	6.4.7.7	8,421.91	5,784.12

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

应交税费		61,180.97	59,899.84
应付利息		180,621.43	13,028.41
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	207,856.13	377,833.68
负债合计		317,446,931.48	239,130,815.84
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	556,642,437.76	520,177,666.62
未分配利润	6.4.7.10	266,230,829.82	231,757,503.19
所有者权益合计		822,873,267.58	751,935,169.81
负债和所有者权益总计		1,140,320,199.06	991,065,985.65

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.120 元，基金份额总额 734,733,708.59 份，其中 A 类基金份额净值 1.120 元，份额总额 708,804,050.18 份；C 类基金份额净值 1.113 元，份额总额 25,929,658.41 份。

6.2 利润表

会计主体：浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		24,095,402.75	14,599,924.41
1.利息收入		21,998,103.35	24,357,878.90
其中：存款利息收入	6.4.7.11	65,723.79	113,414.69
债券利息收入		21,865,464.10	23,366,708.90
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		66,915.46	877,755.11
其他利息收入		-	0.20
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,166,011.00	-34,463,273.24
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,166,011.00	-34,463,273.24
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-68,949.21	24,704,778.22
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

列）			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	237.61	540.53
减：二、费用		5,936,023.95	3,172,319.79
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	1,239,563.29	1,306,617.53
2．托管费	6.4.10.2.2	413,187.76	435,539.18
3．销售服务费	6.4.10.2.3	51,944.31	59,725.23
4．交易费用	6.4.7.19	5,833.34	12,749.33
5．利息支出		4,036,586.62	1,086,290.50
其中：卖出回购金融资产支出		4,036,586.62	1,086,290.50
6．税金及附加		36,239.23	66,457.82
7．其他费用	6.4.7.20	152,669.40	204,940.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,159,378.80	11,427,604.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,159,378.80	11,427,604.62

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	520,177,666.62	231,757,503.19	751,935,169.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,159,378.80	18,159,378.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	36,464,771.14	16,313,947.83	52,778,718.97
其中：1.基金申购款	73,312,883.41	33,718,148.10	107,031,031.51
2.基金赎回款	-36,848,112.27	-17,404,200.27	-54,252,312.54

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

五、期末所有者权益（基金净值）	556,642,437.76	266,230,829.82	822,873,267.58
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	637,086,081.35	238,144,807.42	875,230,888.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,427,604.62	11,427,604.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-254,750,130.18	-99,619,983.96	-354,370,114.14
其中：1.基金申购款	359,424,642.76	140,634,983.45	500,059,626.21
2.基金赎回款	-614,174,772.94	-240,254,967.41	-854,429,740.35
五、期末所有者权益（基金净值）	382,335,951.17	149,952,428.08	532,288,379.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

郁蓓华	郁蓓华	钱琨
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）是根据《浦银安盛增利分级债券型证券投资基金基金合同》和《浦银安盛增利分级债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，由原浦银安盛增利分级债券型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。

原基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]1704 号文《关于核准浦银安盛增利分级债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由浦银安盛基金管理有限公

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛增利分级债券型证券投资基金基金合同》向社会公开发行募集。本基金为契约型基金，本基金在基金合同生效之日起三年(含三年)为基金封闭期，在封闭期内不开放申购、赎回业务，可在本基金上市交易后通过证券交易所转让基金份额。封闭期届满后转换为上市开放式基金(LOF)，存续期不定。本基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 905,197,332.55 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2011)验字第 60951783_B01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《浦银安盛增利分级债券型证券投资基金基金合同》于 2011 年 12 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 905,860,918.69 份基金份额，其中认购资金利息折合 663,586.14 份基金份额。本基金的基金管理人为浦银安盛基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

本基金于 2017 年 1 月 23 日增加 A 类份额。

根据《浦银安盛增利分级债券型证券投资基金基金合同》和《浦银安盛增利分级债券型证券投资基金招募说明书》的规定，原基金通过基金资产及收益的不同分配安排，将基金份额分成预期收益与预期风险不同的两个类别，即浦银安盛增利分级债券型证券投资基金之 A 类份额(以下简称“浦银增 A”)和浦银安盛增利分级债券型证券投资基金之 B 类份额(以下简称“浦银增 B”)。浦银增 A 的年目标收益率为三年期银行定期存款利率+0.25%，扣除浦银增 A 的应计收益后的全部剩余收益归浦银增 B 享有，亏损以浦银增 B 的资产净值为限由浦银增 B 承担。基金发售结束后，场外、场内认购的全部份额均按照 7∶3 的比例确认为浦银增 A 份额和浦银增 B 份额，两类基金份额的基金资产合并运作。

在基金封闭期内，基金管理人在基金资产净值计算的基础上，按照基金合同的规定采用“虚拟清算”原则计算并公告浦银增 A 和浦银增 B 的基金份额参考净值。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2012]第 39 号文审核同意，原基金于 2012 年 3 月 9 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《浦银安盛增利分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，自封闭期截止日(2014 年 12 月 15 日)后，原基金无需召开基金份额持有人大会，即转换为上市开放式基金(LOF)，基金

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

名称变更为“浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)”。本基金于 2014 年 12 月 16 日完成上述更名。

根据《浦银安盛增利分级债券型证券投资基金封闭期届满转型后基金名称变更的公告》及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金管理人以 2014 年 12 月 15 日作为份额转换日，于份额转换日日终根据浦银增 A 和浦银增 B 基金份额转换比例对原基金份额持有人基金份额转换日登记在册的基金份额实施转换。以份额转换后 1.000 元的基金份额净值为基准，浦银增 A、浦银增 B 的场内及场外份额分别按照各自的基金份额净值转换成本基金的场内及场外份额。转换后基金份额持有人持有的基金份额数将按照转换规则相应增加或减少。《浦银安盛增利分级债券型证券投资基金基金合同》中除仅适用于原基金的条款外，继续适用于转换后的本基金。本基金为契约型开放式，存续期不定。

根据深交所深证上[2014]456 号《终止上市同意书》，原基金于 2014 年 12 月 15 日终止上市权利登记。根据深交所深证上[2014]503 号文审核同意，本基金基金份额于 2015 年 1 月 8 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛增利分级债券型证券投资基金基金招募说明书》的有关规定，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，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。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%，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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

本基金原业绩比较基准为中信标普全债指数。根据本基金的基金管理人于 2015 年 9 月 17 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》和修改后的《浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金自 2015 年 9 月 17 日起业绩比较基准变更为中证全债指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海浦东发展银行股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金代销机构
浦银安盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
上海银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	1,239,563.29	1,306,617.53
其中：支付销售机构的客户维护费	19,169.97	573,959.15

注：支付基金管理人浦银安盛的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 × 0.30%/ 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	413,187.76	435,539.18

注：支付基金托管人上海银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 × 0.10%/ 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浦银安盛稳健增利债券（LOF）A	浦银安盛稳健增利债券（LOF）C	合计
上海银行股份有限公司	0.00	15,020.43	15,020.43
上海浦东发展银行股份有限公司	0.00	27,583.76	27,583.76
浦银安盛基金管理有限公司	0.00	6,357.21	6,357.21
合计	0.00	48,961.40	48,961.40
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浦银安盛稳健增利债券（LOF）A	浦银安盛稳健增利债券（LOF）C	合计
上海银行股份有限公司	0.00	18,233.64	18,233.64

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

上海浦东发展银行股份有限公司	0.00	31,336.93	31,336.93
浦银安盛基金管理有限公司	0.00	7,170.56	7,170.56
合计	0.00	56,741.13	56,741.13

注：在通常情况下，本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.35%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.35%/当年天数

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人在本报告期与上年度可比期间均未持有本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

浦银安盛稳健增利债券（LOF）A				
关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
上海浦东发展银行股份有限公司	474,382,352.94	66.93%	474,382,352.94	72.02%

注：1、除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有浦银安盛稳健增利债券（LOF）C。

2、除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

规定支付。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海银行股份有限公司	130,093.35	26,238.56	4,797,505.87	91,700.45

注：本基金的银行存款由基金托管人上海银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期与上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金在本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 58,999,551.49 元，是以如下债券作为抵押。

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1822035	18 工银租赁债 01	2019 年 7 月 3 日	101.49	206,000	20,906,940.00
1720085	17 北京银行绿色金	2019 年 7 月 3 日	102.81	919,000	94,482,390.00

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	融债				
101800370	18 河钢集 MTN003	2019 年 7 月 1 日	102.73	95,000	9,759,350.00
合计				1,220,000	125,148,680.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 257,700,000.00 元，于 2019 年 7 月 4 日前后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
3	固定收益投资	1,109,910,247.60	97.33
	其中：债券	1,109,910,247.60	97.33
7	银行存款和结算备付金合计	7,297,707.37	0.64
8	其他各项资产	23,112,244.09	2.03
9	合计	1,140,320,199.06	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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。

7.2.2 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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

7.3 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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
3	金融债券	335,541,000.00	40.78
	其中：政策性金融债	49,975,000.00	6.07
4	企业债券	577,512,347.60	70.18
5	企业短期融资券	35,021,500.00	4.26
6	中期票据	161,835,400.00	19.67
10	合计	1,109,910,247.60	134.88

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1720085	17 北京银行绿色金融债	500,000	51,405,000.00	6.25
2	1822035	18 工银租赁债 01	500,000	50,745,000.00	6.17

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

3	101678004	16 首钢 MTN001	500,000	50,520,000.00	6.14
4	136852	16 华泰 G2	500,000	50,425,000.00	6.13
5	1826003	18 星展银行 01	400,000	41,060,000.00	4.99

7.7 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。

7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.2 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。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	46,578.46
4	应收利息	23,065,555.63
5	应收申购款	110.00
9	合计	23,112,244.09

7.11.4 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。

7.11.5 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。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金为债券型基金，不参与股指期货交易。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
浦银安盛稳健	11	64,436,731.83	708,578,445.24	99.97%	225,604.94	0.03%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

增利债券(LOF)A						
浦银安盛稳健增利债券(LOF)C	2,029	12,779.53	4,959,275.22	19.13%	20,970,383.19	80.87%
合计	2,040	360,163.58	713,537,720.46	97.12%	21,195,988.13	2.88%

8.2 期末上市基金前十名持有人

浦银安盛稳健增利债券（LOF）C

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	广东省交通集团有限公司企业年金计划－交通银行	1,145,425.00	25.78%
2	中国农业银行股份有限公司企业年金计划－中国银行股份有限公司	656,362.00	14.77%
3	中国国旅集团有限公司企业年金计划－中信银行股份有限公司	390,217.00	8.78%
4	上海梵丝内挺服装有限公司	319,799.00	7.20%
5	国网冀北电力有限公司企业年金计划－中国工商银行股份有限公司	187,924.00	4.23%
6	李义贵	183,570.00	4.13%
7	黄贤民	169,407.00	3.81%
8	北京德法利京彩科技有限公司	162,219.00	3.65%
9	王宇康	145,194.00	3.27%
10	孙士俊	131,996.00	2.97%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	浦银安盛稳健增利	215,663.41	0.03%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	债券（LOF）A		
	浦银安盛稳健增利债券（LOF）C	9,630.17	0.04%
	合计	225,293.58	0.03%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	浦银安盛稳健增利债券（LOF）A	0
	浦银安盛稳健增利债券（LOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	浦银安盛稳健增利债券（LOF）A	0
	浦银安盛稳健增利债券（LOF）C	0
	合计	0

§9 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
基金合同生效日（2011 年 12 月 13 日）基金份额总额	-	905,860,918.69
本报告期期初基金份额总额	658,639,223.28	27,950,308.12
本报告期期间基金总申购份额	95,934,770.48	857,288.28
减:本报告期期间基金总赎回份额	45,769,943.58	2,877,937.99
本报告期期末基金份额总额	708,804,050.18	25,929,658.41

注：1、总申购份额含转换入、强制调增份额；总赎回份额含转换出、强制调减份额。

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，转型生效日基金份额总额为 1,194,623,393.86 份。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

3、本基金于 2017 年 1 月 23 日增加 A 类份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人未发生重大人事变动。2019 年 4 月，王蕤女士不再担任上海银行股份有限公司资产托管部副总经理职务。上述人事变动已进行备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人、托管人的专门基金托管部门及其高级管理人员未受到有权机关调查、司法纪检部门采取强制措施、被移送司法机关或追究刑事责任、中国证监会稽查、中国证监会行政处罚、证券市场禁入、认定为不适当人选、被其他行政管理部门处罚及证券交易所公开谴责的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：1、证券经营机构交易单元选择的标准和程序：

（1）选择证券经营机构交易单元的标准

财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；

佣金费率合理；

本基金管理人要求的其他条件。

（2）选择证券经营机构交易单元的程序

本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构；

基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元的变更情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	240,689,963.44	86.98%	5,520,800,000.00	100.00%	-	-
招商证券	36,025,178.35	13.02%	-	-	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日	474,382,352.94	0.00	0.00	474,382,352.94	64.57%
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。							

浦银安盛基金管理有限公司

2019 年 8 月 23 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn