目录全部展开 目录全部收拢
- 重要提示
- 基金产品概况
  - 基金基本情况
- 主要财务指标和基金净值表现
  - 主要财务指标
  - 基金净值表现
    - 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
    - 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
  - 其他指标
- 管理人报告
  - 基金经理（或基金经理小组）简介
  - 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
  - 公平交易专项说明
    - 公平交易制度的执行情况
    - 异常交易行为的专项说明
  - 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
    - 报告期内基金的投资策略和运作分析
    - 报告期内基金的业绩表现
  - 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
- 投资组合报告
  - 报告期末基金资产组合情况
  - 报告期末按行业分类的股票投资组合

浦银安盛中短债债券型证券投资基金2019年第3季度报告

2019-09-30

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：2019-10-25

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2019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2019年7月1日起至9月30日止。

基金基本情况

项目	数值	
基金简称	浦银中短债	
场内简称		
基金主代码	006436	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018-10-25	
报告期末基金份额总额		71,672,155.59
投资目标	本基金重点投资中短期债券，在严格控制投资风险的前提下，力争长期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	中债总财富（1-3 年）指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%。	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。	
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2级基金的基金简称	浦银中短债A	浦银中短债C
下属2级基金的场内简称		
下属2级基金的交易代码	006436	006437
报告期末下属2级基金的份额总额	61,102,403.97	10,569,751.62
下属2级基金的风险收益特征		

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	主基金(元)	浦银中短债A(元) 2019-07-01 - 2019-09-30	浦银中短债C(元) 2019-07-01 - 2019-09-30
本期已实现收益		1,076,682.21	166,154.66
本期利润		901,633.92	139,025.51
加权平均基金份额本期利润		0.0099	0.0094
期末基金资产净值		63,360,735.79	10,940,142.28
期末基金份额净值		1.0370	1.0350

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。

基金净值表现

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

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

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	0.93 %	0.02 %	0.94 %	0.01 %	-0.01 %	0.01 %

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B

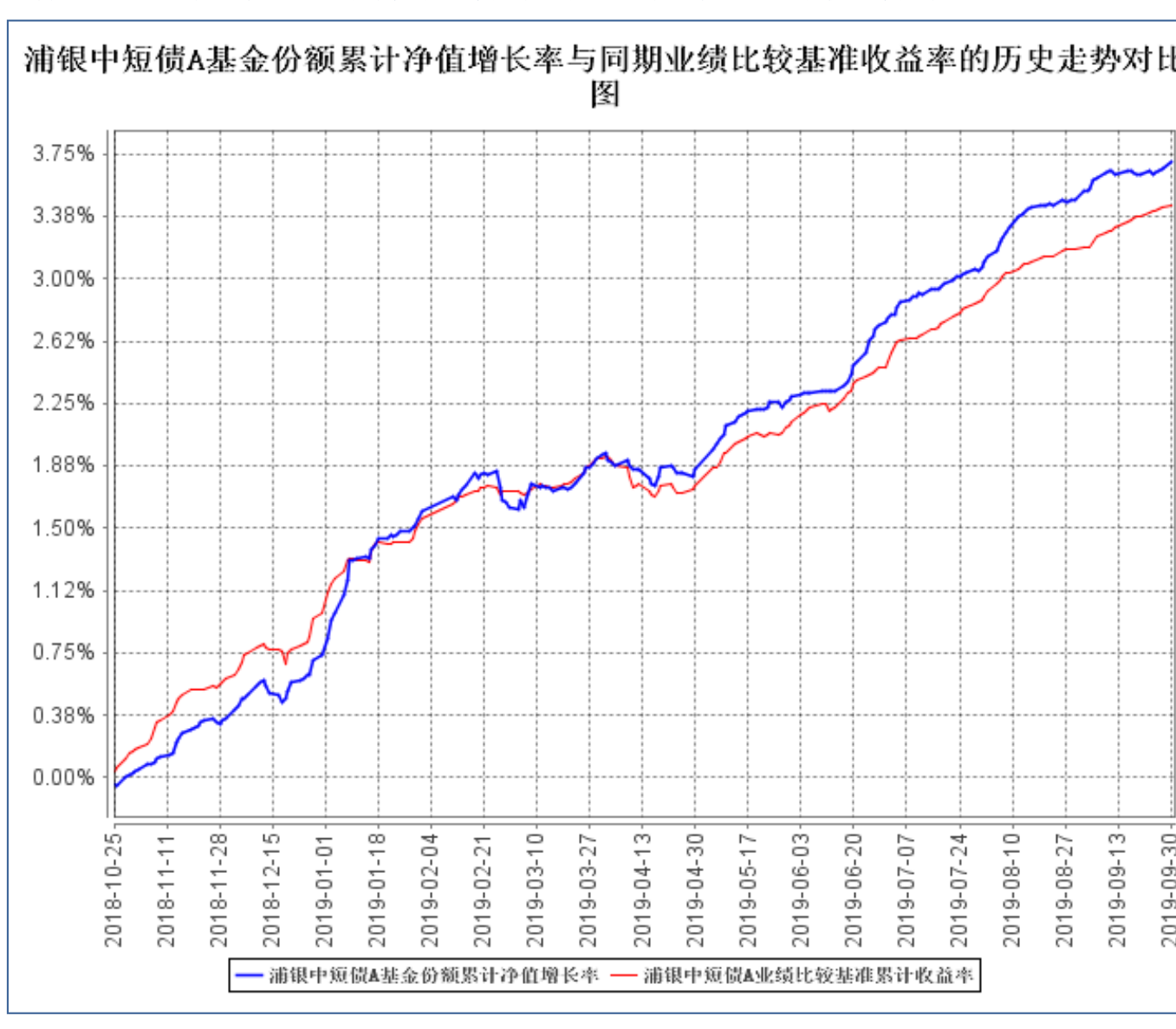
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.88 %	0.02 %	0.94 %	0.01 %	-0.06 %	0.01 %

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

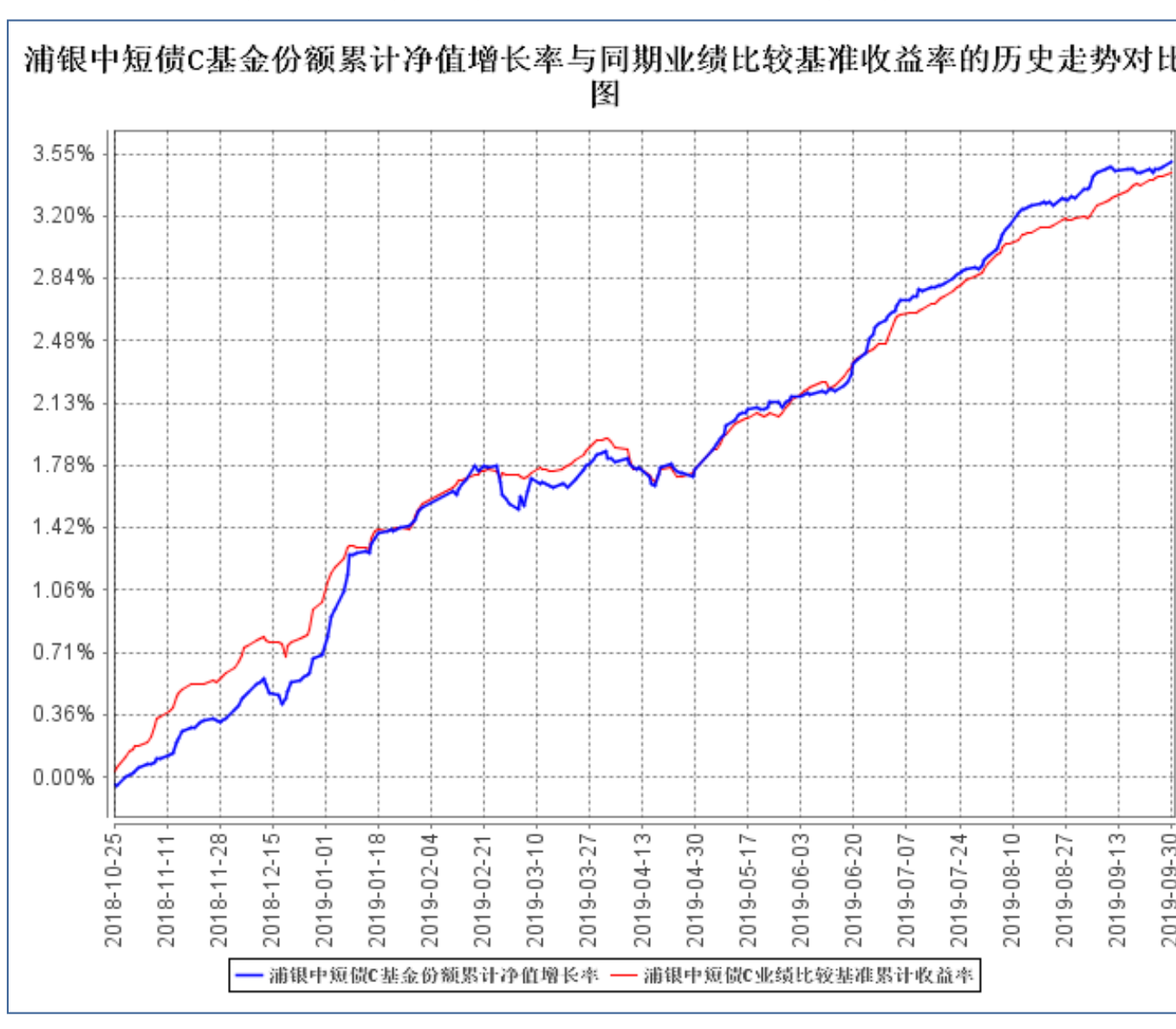
注：注：1、本基金合同生效日为2018年10月25日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满1年。

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2018年10月25日至2019年4月24日。建仓期结束时符合相关规定。

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A



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B



其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2019-07-01至2019-09-30）
其他指标	报告期（2019-09-30）

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		
钟明	公司固定收益投资部副总监，公司旗下浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金、浦银安盛中短债债券型证券投资基金、浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金以及浦银安盛双债增强债券型证券投资基金基金经理。	2018-10-25	-	14	钟明女士，复旦大学MBA。2005年至2017年就职于兴全基金管理有限公司，先后从事基金会计岗位、债券交易员岗位、基金经理助理岗位和基金经理岗位。2017年5月加盟浦银安盛基金管理有限公司，担任固定收益投资部副总监之职。2017年11月起，担任公司旗下浦银安盛货币市场证券投资基金以及浦银安盛日日鑫货币市场基金基金经理。2017年11月至2019年7月，担任浦银安盛盛勤3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2017年11月至2019年9月，担任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。2018年10月起担任浦银安盛中短债债券型证券投资基金的基金经理。2018年12月起担任浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金的基金经理。2019年5月起，担任浦银安盛双债增强债券型证券投资基金基金经理。
刘大巍	公司旗下浦银安盛 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、浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金、浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金、浦银安盛日日盈货币市场基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛融定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛中短债债券型证券投资基金、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、浦银安盛双债增强债券型证券投资基金、浦银安盛上海清算所高等级优选短期融资券指数证券投资基金以及浦银安盛盛诺3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。	2019-03-06	-	9	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 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。2016年8月至2018年7月担任浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2017年4月起，担任公司旗下浦银安盛月月盈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月起，担任浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年11月起，担任浦银安盛日日盈货币市场基金及浦银安盛日日丰货币市场基金基金经理。2017年12月起，担任浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2018年12月起，担任浦银安盛盛融定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2019年3月起，担任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤3个月定期开放债券型发起式证券投资基金以及浦银安盛中短债债券型证券投资基金基金经理。2019年5月起，担任浦银安盛双债增强债券型证券投资基金基金经理。2019年7月起，担任浦银安盛上海清算所高等级优选短期融资券指数证券投资基金基金经理。2019年9月起，担任浦银安盛盛诺3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。

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。

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。

公平交易专项说明

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。

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。

报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度前半段，国内信贷和社融数据开始对此前的经济企稳预期有所修正，货币政策维持宽松局面，同时在中美贸易摩擦加剧和外围市场的降息预期不断升温背景下，长端利率大幅下行，在此期间，本组合维持了中性仓位并适当拉长了组合久期；但到了8月后，收益率曲线的期限利差和信用利差均被压缩到历史1/4分位数附近，利率风险开始累计，同时房地产、基建投资并未如预期显著回落，贸易摩擦的不断反复对市场的边际影响开始减弱，美国降息预期兑现，导致前期的大量获利盘开始兑现盈利，长端利率开始快速上行，在此期间，本组合回归了中性仓位和久期，提高组合流动性水平，为后续波段操作留出空间，整个三季度，本组合保证了净值的平稳增长。

报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银中短债A基金份额净值为1.0370元，本报告期基金份额净值增长率为0.93%；截至本报告期末浦银中短债C基金份额净值为1.0350元，本报告期基金份额净值增长率为0.88%；同期业绩比较基准收益率为0.94%。

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。

投资组合报告

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	权益类投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	89,758,372.40	94.53
	其中：债券	89,758,372.40	94.53
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,344,211.03	2.47
7	其他资产	2,848,091.03	3.00
8	合计	94,950,674.46	100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	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	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	-	-

注： 本期末本基金未持有境内股票。

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

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（%）

注：本基金本报告期末未持有股票。

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	8,960,500.00	12.06
	其中：政策性金融债	8,960,500.00	12.06
4	企业债券	40,639,672.40	54.70
5	企业短期融资券	10,015,000.00	13.48
6	中期票据	25,289,700.00	34.04
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	4,853,500.00	6.53
9	其他	-	-
10	合计	89,758,372.40	120.80

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	101900586	19中油股MTN005	70,000	7,100,100.00	9.56
2	136851	16华泰G1	70,770	7,085,492.40	9.54
3	112516	17国信01	70,000	7,046,900.00	9.48
4	101801146	18汇金MTN013	60,000	6,121,800.00	8.24
5	122384	15中信01	60,000	6,062,400.00	8.16

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。

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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
公允价值变动总额合计(元)			-		
股指期货投资本期收益(元)			-		
股指期货投资本期公允价值变动(元)			-		

本基金投资股指期货的投资政策

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)			-		
国债期货投资本期收益（元）			-		
国债期货投资本期公允价值变动(元)			-		

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

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。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除华泰证券和东方证券以外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。

2019年8月23日，因未依法履行其他职责，中国证券监督管理委员会江苏监管局依据相关法规给予华泰证券责令改正处分决定。

2018年11月17日，公司公告，东方证券子公司收到中国证监会行政处罚事先告知书。

本基金管理人的研究部门对华泰证券和东方证券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。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内，本基金投资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。

其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	24,939.27
2	应收证券清算款	1,482,858.17
3	应收股利	-
4	应收利息	1,339,795.58
5	应收申购款	498.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,848,091.03

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。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银中短债	浦银中短债A	浦银中短债C
报告期期初基金份额总额		119,721,431.71	19,521,217.03
报告期期间基金总申购份额		11,021,790.27	647,543.11
减：报告期期间基金总赎回份额		69,640,818.01	9,599,008.52
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	71,672,155.59	61,102,403.97	10,569,751.62

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	浦银中短债	浦银中短债A	浦银中短债C
报告期期初管理人持有的本基金份额			
报告期期间买入/申购总份额			
报告期期间卖出/赎回总份额			
报告期期末管理人持有的本基金份额			
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-	-	-

注： 本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
合计					

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金		-%		-%	
基金管理人高级管理人员		-%		-%	
基金经理等人员		-%		-%	
基金管理人股东		-%		-%	
其他		-%		-%	
合计		-%		-%	

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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

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。

影响投资者决策的其他重要信息

备查文件目录

1、 中国证监会批准基金募集的文件
2、 浦银安盛中短债债券型证券投资基金基金合同
3、 浦银安盛中短债债券型证券投资基金招募说明书
4、 浦银安盛中短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

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

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 。