浦银安盛盛融定期开放债券型发起式证券投资基金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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2019-10-28

§1 重要提示
§2 基金产品概况
§3 主要财务指标和基金净值表现
§4 管理人报告
§5 托管人报告
§6 审计报告
§7 财务报表
§8 投资组合明细
§9 开放式基金份额变动
§10 重大事件揭示
§11 影响投资者决策的其他重要信息
§12 备查文件目录

重要提示

基金管理人的董事会及董事会成员保证本季度报告所不存在虚假记载、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。

基金托管人对本季度报告所载资料不存在异议。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，但对投资中国证券市场的风险，投资者应当有所了解并谨慎投资。

本季度报告财务资料未经审计。

本报告期自2019年7月1日至2019年9月30日。

§2 基金产品概况

项目	内容
基金简称	浦银安盛盛融定期开放
交易代码	000400
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018-12-12
报告期末基金份额总额	15,933,996,000.00
投资目标	在严格控制投资风险的前提下，力争长期稳健地获取比较高的收益。
投资策略	本基金一方面利用以上对宏观经济基本面的严密研究，从利率期限、信用风险等方面进行主动管理，力求在各类资产的潜在收益预期基础上，一方面进行市场选择大类资产配置，以期获取超额收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：中债综合财富指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于较低风险、较低收益的品种，其预期风险和预期收益低于股票、混合型基金，属于较高风险、较高收益的品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019-07-01 至 2019-09-30）
本期已实现利息	91,894,995.35
本期利润	94,771,145.45
期末基金资产净值	16,338,351,155.45
期末基金份额净值	1.0256

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、本期已实现利息指本期内利息收入、投资收益、公允价值变动、汇兑收益等项目的合计，扣除本期费用后的余额。

3、本期利润为本期已实现利息加上本期公允价值变动损益。

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
过去三个月	0.93 %	0.03 %	1.19 %	0.04 %	-0.26 %	-0.01 %

自基金合同生效日起至最近一个会计年度末或其认作资产组合以来的净值增长率变动的比较

注：1、2、3、本基金合同生效日为2018年12月12日，基金合同生效日不满一个完整会计年度。

2、根据基金合同规定，基金管理人应当在基金合同生效之日起6个月内使基金投资组合比例符合基金合同的约定；在基金合同生效日的6个月内，基金投资组合比例符合基金合同规定。

§4 管理人报告

管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规，以诚信且勤奋尽责的原则管理和运用基金资产，严格控制风险的前提下，为基金持有人利益谋求最大回报。本报告期内未发现有违反法律法规的行为。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

本基金管理人在《公平交易管理制度》，建立健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待每个投资组合。

交易执行方式：投资决策通过投资组合经理（或授权人）作出，为确保投资组合公平的投资决策权，同时，在投资决策过程中，严格遵守公司内部管理制度和规定，保证公司内部信息不外泄，防止内幕交易的发生。

交易执行：公司设立集中交易室，集中交易室根据投资组合经理的投资决策，在公司内部交易系统上，以投资组合为单位，分别下达交易指令，保证公平交易。

交易分配：集中交易室根据投资决策，对同一证券品种的交易，采用公平合理原则进行分配。

异常交易的监控与报告

报告期内未发现违反公平交易管理制度的异常交易。

公平交易专项说明

报告期内未发现违反公平交易管理制度的异常交易。

投资策略及业绩表现说明

报告期内未发现本基金投资策略及业绩表现异常情况。

报告期内基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人在基金运作过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定，以诚信且勤奋尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人利益谋求最大回报。本报告期内未发现有违反法律法规的行为。

报告期内基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略未发生改变。

报告期内基金投资组合出现不合规情况的说明

报告期内，本基金投资组合出现不合规情况，系因市场波动、基金申购赎回等因素导致，本基金管理人在规定时间内调整完毕，未对基金产品造成实质性影响。

报告期内基金业绩表现

截至本期末本基金份额净值为1.0256元，本报告期内基金份额净值增长率为0.93%，业绩比较基准收益率为1.19%。

报告期内基金持有人数或基金份额持有人结构的变动情况

报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规，以诚信且勤奋尽责的原则管理和运用基金资产，严格控制风险的前提下，为基金持有人利益谋求最大回报。本报告期内未发现有违反法律法规的行为。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

本基金管理人在《公平交易管理制度》，建立健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待每个投资组合。

交易执行方式：投资决策通过投资组合经理（或授权人）作出，为确保投资组合公平的投资决策权，同时，在投资决策过程中，严格遵守公司内部管理制度和规定，保证公司内部信息不外泄，防止内幕交易的发生。

交易执行：公司设立集中交易室，集中交易室根据投资决策，在公司内部交易系统上，以投资组合为单位，分别下达交易指令，保证公平交易。

交易分配：集中交易室根据投资决策，对同一证券品种的交易，采用公平合理原则进行分配。

异常交易的监控与报告

报告期内未发现违反公平交易管理制度的异常交易。

报告期内基金投资情况

报告期内未发现本基金投资过程中出现违反法律法规的情况。

报告期内基金参与关联方银行间同业市场交易情况说明

报告期内，本基金参与关联方银行间同业市场交易，交易对方为兴业银行，交易品种为债券，交易方式为现券买卖，交易价格为市场公允价值，交易金额为人民币1,986,096,000.00元，交易佣金为人民币0.00元。

报告期内基金投资组合出现不合规情况的说明

报告期内，本基金投资组合出现不合规情况，系因市场波动、基金申购赎回等因素导致，本基金管理人在规定时间内调整完毕，未对基金产品造成实质性影响。

报告期内基金参与关联方银行间同业市场交易情况说明

报告期内，本基金参与关联方银行间同业市场交易，交易对方为兴业银行，交易品种为债券，交易方式为现券买卖，交易价格为市场公允价值，交易金额为人民币1,986,096,000.00元，交易佣金为人民币0.00元。

§5 托管人报告

报告期内基金管理人在运作基金过程中存在无违反《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、其他有关法律法规的情况的说明

报告期内，浦银安盛基金管理有限公司在投资运作、基金销售、基金清算、资产估值、信息披露、基金份额登记等方面，按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金销售机构内部控制指引（试行）》、《证券投资基金销售机构内部控制指引（试行）》、《证券投资基金销售机构内部控制指引（试行）