

# 浦银安盛双债增强债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 1 月 24 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 21 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 2021 年 10 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛双债增强债券	
基金主代码	006466	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 21 日	
报告期末基金份额总额	1,597,947,378.45 份	
投资目标	在严格控制投资风险、保持资产流动性的前提下，采取自上而下的资产配置策略和自下而上的个券选择策略，通过积极主动的投资管理，充分把握信用债和可转债的投资机会，力争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，重点投资于信用债与可转换债券。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	中证可转换债券指数收益率*40%+中证综合债券指数收益率*50%+沪深 300 指数收益率*10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其风险收益预期高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛双债增强债券 A	浦银安盛双债增强债券 C
下属分级基金的交易代码	006466	006467

报告期末下属分级基金的份额总额	805,482,036.56 份	792,465,341.89 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（2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日）	
	浦银安盛双债增强债券 A	浦银安盛双债增强债券 C
1. 本期已实现收益	6,643,912.44	2,013,126.96
2. 本期利润	18,541,998.13	7,484,122.95
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0315	0.0319
4. 期末基金资产净值	946,028,162.71	922,322,792.77
5. 期末基金份额净值	1.1745	1.1639

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。

#### 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

浦银安盛双债增强债券 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	①-③	②-④
过去三个月	2.72%	0.12%	3.59%	0.26%	-0.87%	-0.14%
过去六个月	5.54%	0.15%	6.40%	0.31%	-0.86%	-0.16%
过去一年	7.63%	0.14%	9.42%	0.31%	-1.79%	-0.17%
自基金合同生效起至今	17.45%	0.13%	24.82%	0.35%	-7.37%	-0.22%

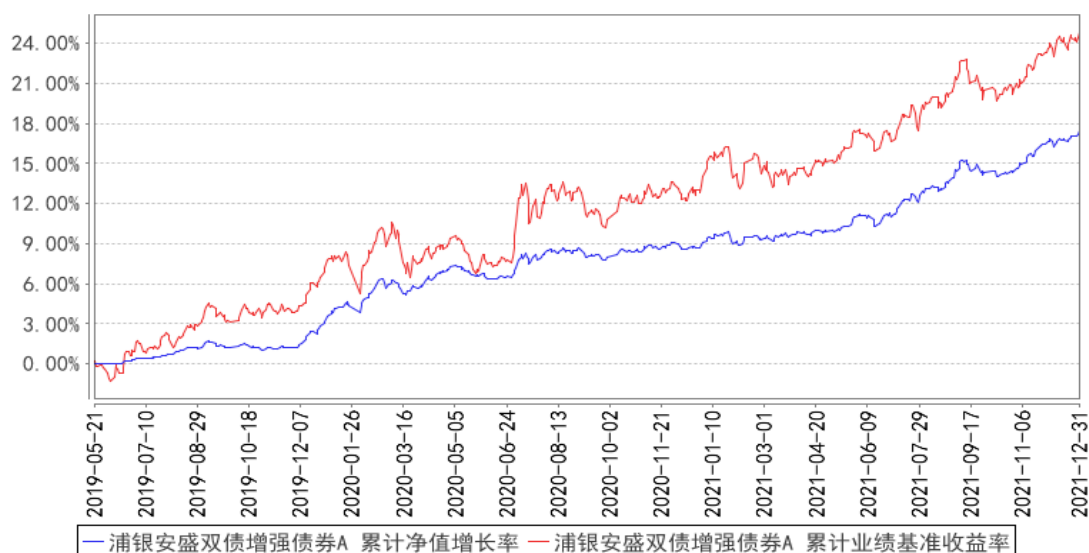
浦银安盛双债增强债券 C

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	①-③	②-④
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

				④		
过去三个月	2.63%	0.12%	3.59%	0.26%	-0.96%	-0.14%
过去六个月	5.36%	0.15%	6.40%	0.31%	-1.04%	-0.16%
过去一年	7.26%	0.14%	9.42%	0.31%	-2.16%	-0.17%
自基金合同生效起至今	16.39%	0.12%	24.82%	0.35%	-8.43%	-0.23%

### 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率变动的比较

浦银安盛双债增强债券A 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



浦银安盛双债增强债券C 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



## § 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		
李羿	公司固定收益投资部副总监，公司旗下部分基金基金经理。	2019 年 7 月 15 日	-	12 年	李羿先生，上海交通大学金融学硕士。2009 年 4 月至 2010 年 6 月任上海浦东发展银行交易员；2010 年 6 月至 2013 年 7 月任交银康联人寿保险有限公司高级投资经理；之后于 2013 年 7 月起先后在汇丰晋信基金、富国基金工作，分别在汇丰晋信投资部任职投资经理、基金经理，在富国固定收益投资部任职基金经理。2019 年 3 月加盟浦银安盛基金公司，在固定收益投资部担任总监助理一职，现任固定收益投资部副总监。2019 年 7 月起担任浦银安盛盛勤 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金以及浦银安盛双债增强债券型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月起担任浦银安盛中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金及浦银安盛普嘉 87 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 8 月起担任浦银安盛普华 66 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 9 月起担任浦银安盛中债 3-5 年农发行债券指数证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月起担任浦银安盛稳健丰利债券型证券投资基金的基金经理。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期。

2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《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，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。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认定的异常交易行为。报告期内未发生本基金与旗下其他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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度，国内经济延续复苏，出口超预期、消费、投资均表现良好；国际经济预期亦开始回暖，主要受益于持续的疫情防控与政策刺激。国内货币政策继续逐步退出疫情宽松，收益率有所下行；但年末因部分大型企业债券发生违约，为防范金融风险货币政策略有放松。总体上，银行间 7 日回购利率季度均值由 3 季度的 2.28% 上行至 4 季度的 2.38%，交易所 GC007 回购利率均值由 2.40% 上行至 2.63%，两者均低于去年 4 季度的均值水平。信用方面，受机构抱团高资质城投和地产政策边际放松影响，信用利差略有收窄。四季度，中债新综合全价指数上涨 0.58%，沪深 300 指数上涨 1.52%，中证转债指数上涨 7.05%，我们维持了组合久期。转债方面，四季度受股市表现带动，整体表现较好，但结构性分化更加明显。四季度我们维持了权益和可转债仓位。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛双债增强债券 A 的基金份额净值为 1.1745 元，本报告期基金份额

净值增长率为 2.72%，同期业绩比较基准收益率为 3.59%，截至本报告期末浦银安盛双债增强债券 C 的基金份额净值为 1.1639 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.63%，同期业绩比较基准收益率为 3.59%。

#### 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	34,749,210.00	1.82
	其中：股票	34,749,210.00	1.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,496,541,429.02	78.18
	其中：债券	1,496,541,429.02	78.18
	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	280,090,365.05	14.63
	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	56,796,371.13	2.97
8	其他资产	45,996,878.30	2.40
9	合计	1,914,174,253.50	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

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	-	-
C	制造业	25,650,160.00	1.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	735,900.00	0.04
F	批发和零售业	636,400.00	0.03
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	621,500.00	0.03
J	金融业	4,059,500.00	0.22
K	房地产业	625,200.00	0.03
L	租赁和商务服务业	1,097,050.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	592,900.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	730,600.00	0.04
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	34,749,210.00	1.86

### 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 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	002142	宁波银行	60,000	2,296,800.00	0.12
2	600519	贵州茅台	1,000	2,050,000.00	0.11
3	300973	立高食品	15,000	1,981,200.00	0.11
4	600426	华鲁恒升	50,000	1,565,000.00	0.08
5	600600	青岛啤酒	15,000	1,485,000.00	0.08
6	300088	长信科技	100,000	1,328,000.00	0.07
7	600030	中信证券	50,000	1,320,500.00	0.07
8	603901	永创智能	70,000	1,127,000.00	0.06
9	000858	五粮液	5,000	1,113,300.00	0.06
10	000651	格力电器	30,000	1,110,900.00	0.06

### 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	16,067,300.00	0.86
2	央行票据	-	-
3	金融债券	615,314,200.00	32.93
	其中：政策性金融债	118,871,700.00	6.36
4	企业债券	34,264,800.00	1.83
5	企业短期融资券	130,034,000.00	6.96
6	中期票据	197,503,500.00	10.57
7	可转债（可交换债）	503,357,629.02	26.94



8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,496,541,429.02	80.10

#### 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	132009	17 中油 EB	660,050	68,962,024.00	3.69
2	132015	18 中油 EB	630,000	65,475,900.00	3.50
3	2128042	21 兴业银行 二级 02	600,000	60,594,000.00	3.24
4	2028033	20 建设银行 二级	500,000	51,870,000.00	2.78
5	1928004	19 农业银行 二级 02	500,000	51,790,000.00	2.77

#### 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

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

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局福建省分局、中国人民银行等监管机构的处罚；中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚；中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚；中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。本基金投资的前十名证券中，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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、处罚的情形。

### 5.10.2 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

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	36,297.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,120,549.13
5	应收申购款	32,840,031.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,996,878.30

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	132009	17 中油 EB	68,962,024.00	3.69
2	132015	18 中油 EB	65,475,900.00	3.50
3	113042	上银转债	34,851,035.40	1.87
4	113044	大秦转债	21,888,000.00	1.17
5	132018	G 三峡 EB1	19,586,000.00	1.05
6	113021	中信转债	18,465,400.00	0.99
7	123111	东财转 3	11,772,600.00	0.63
8	113026	核能转债	8,693,400.00	0.47
9	110061	川投转债	7,762,500.00	0.42
10	110052	贵广转债	5,497,878.40	0.29
11	113620	傲农转债	5,288,275.00	0.28
12	127027	靖远转债	5,117,600.00	0.27

13	113050	南银转债	4,732,800.00	0.25
14	113605	大参转债	4,704,400.00	0.25
15	128107	交科转债	4,390,502.40	0.23
16	132008	17 山高 EB	4,227,200.00	0.23
17	123110	九典转债	4,132,520.00	0.22
18	110075	南航转债	4,111,500.00	0.22
19	128136	立讯转债	3,822,244.40	0.20
20	113516	苏农转债	3,807,360.00	0.20
21	110079	杭银转债	3,736,200.00	0.20
22	110057	现代转债	3,725,100.00	0.20
23	128048	张行转债	3,709,500.00	0.20
24	128105	长集转债	3,349,500.00	0.18
25	123105	拓尔转债	3,313,700.00	0.18
26	113046	金田转债	3,248,862.40	0.17
27	128141	旺能转债	3,237,000.00	0.17
28	128142	新乳转债	3,132,334.08	0.17
29	123078	飞凯转债	3,077,100.00	0.16
30	113549	白电转债	2,841,200.00	0.15
31	128132	交建转债	2,721,500.00	0.15
32	123104	卫宁转债	2,636,200.00	0.14
33	128135	洽洽转债	2,630,000.00	0.14
34	113024	核建转债	2,618,934.30	0.14
35	113047	旗滨转债	2,557,200.00	0.14
36	128021	兄弟转债	2,516,400.00	0.13
37	123113	仙乐转债	2,395,400.00	0.13
38	110053	苏银转债	2,367,200.00	0.13
39	123103	震安转债	2,356,680.00	0.13
40	123049	维尔转债	2,326,400.00	0.12
41	123063	大禹转债	2,267,290.00	0.12
42	128129	青农转债	2,197,800.00	0.12
43	113502	嘉澳转债	2,167,160.00	0.12
44	128133	奇正转债	2,146,420.00	0.11
45	123091	长海转债	2,047,350.00	0.11
46	127016	鲁泰转债	2,018,632.00	0.11
47	113570	百达转债	2,007,810.00	0.11
48	132014	18 中化 EB	1,971,884.00	0.11
49	113563	柳药转债	1,953,458.10	0.10
50	113610	灵康转债	1,928,884.80	0.10
51	113606	荣泰转债	1,919,250.00	0.10
52	113588	润达转债	1,889,850.00	0.10
53	127035	濮耐转债	1,875,467.49	0.10
54	123075	贝斯转债	1,800,760.00	0.10

55	113622	杭叉转债	1,792,200.00	0.10
56	113602	景 20 转债	1,791,875.00	0.10
57	110076	华海转债	1,770,233.40	0.09
58	123117	健帆转债	1,743,450.00	0.09
59	113519	长久转债	1,672,050.00	0.09
60	123097	美力转债	1,665,375.00	0.09
61	113037	紫银转债	1,628,850.00	0.09
62	128101	联创转债	1,533,600.00	0.08
63	113608	威派转债	1,533,375.00	0.08
64	123077	汉得转债	1,522,760.50	0.08
65	128014	永东转债	1,446,625.00	0.08
66	127012	招路转债	1,427,760.00	0.08
67	123050	聚飞转债	1,420,400.00	0.08
68	110038	济川转债	1,418,500.00	0.08
69	128144	利民转债	1,412,000.00	0.08
70	113619	世运转债	1,404,400.00	0.08
71	113567	君禾转债	1,280,700.00	0.07
72	127005	长证转债	1,275,900.00	0.07
73	127020	中金转债	1,240,900.00	0.07
74	113013	国君转债	1,236,700.00	0.07
75	127024	盈峰转债	1,225,400.00	0.07
76	113043	财通转债	1,214,900.00	0.07
77	110043	无锡转债	1,197,700.00	0.06
78	123106	正丹转债	1,193,100.00	0.06
79	123108	乐普转 2	1,182,200.00	0.06
80	127032	苏行转债	1,130,800.00	0.06
81	113011	光大转债	1,120,200.00	0.06
82	110080	东湖转债	1,118,800.00	0.06
83	123076	强力转债	1,102,400.00	0.06
84	127011	中鼎转 2	1,062,200.00	0.06
85	123116	万兴转债	936,740.00	0.05
86	110073	国投转债	926,880.00	0.05
87	113597	佳力转债	922,800.00	0.05
88	113048	晶科转债	900,300.00	0.05
89	128130	景兴转债	900,060.00	0.05
90	113033	利群转债	832,012.80	0.04
91	113615	金诚转债	780,925.20	0.04
92	128134	鸿路转债	749,550.00	0.04
93	113542	好客转债	733,590.00	0.04
94	123099	普利转债	723,550.00	0.04
95	127036	三花转债	723,275.28	0.04
96	128094	星帅转债	710,840.00	0.04

97	123039	开润转债	709,080.00	0.04
98	123115	捷捷转债	693,100.00	0.04
99	110077	洪城转债	691,750.00	0.04
100	113600	新星转债	683,600.00	0.04
101	113609	永安转债	677,150.00	0.04
102	123107	温氏转债	674,900.00	0.04
103	123087	明电转债	674,850.00	0.04
104	127026	超声转债	670,850.00	0.04
105	128023	亚太转债	657,200.00	0.04
106	113618	美诺转债	649,450.00	0.03
107	127013	创维转债	605,050.00	0.03
108	113561	正裕转债	603,250.00	0.03
109	128124	科华转债	546,650.00	0.03
110	113034	滨化转债	514,230.00	0.03
111	128096	奥瑞转债	495,390.00	0.03
112	123064	万孚转债	462,280.00	0.02
113	123059	银信转债	363,270.00	0.02
114	128123	国光转债	338,940.00	0.02
115	123112	万讯转债	331,940.00	0.02
116	123025	精测转债	320,780.00	0.02
117	128108	蓝帆转债	289,925.00	0.02
118	128121	宏川转债	274,020.00	0.01
119	123080	海波转债	254,080.00	0.01
120	110060	天路转债	239,360.00	0.01
121	123090	三诺转债	230,795.40	0.01
122	132021	19 中电 EB	87,200.00	0.00
123	128034	江银转债	35,568.00	0.00

### 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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银安盛双债增强债券 A	浦银安盛双债增强债券 C
报告期期初基金份额总额	451,768,708.83	81,627,735.72
报告期期间基金总申购份额	446,485,976.25	753,184,889.56
减：报告期期间基金总赎回份额	92,772,648.52	42,347,283.39
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	805,482,036.56	792,465,341.89

## § 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

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	20211001-20211107	126,305,772.19	0.00	10,000,000.00	116,305,772.19	7.28
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。							

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准浦银安盛双债增强债券型证券投资基金募集的文件
- 2、浦银安盛双债增强债券型证券投资基金基金合同
- 3、浦银安盛双债增强债券型证券投资基金招募说明书
- 4、浦银安盛双债增强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规定媒介上披露的各项公告
- 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](http://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

2022 年 1 月 24 日