

# 浦银安盛基金管理有限公司浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 (LOF) (由浦银安盛增利分级债券型证券投资基金封闭期届满转换 而来) 招募说明书摘要 (更新)

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

内容截止日: 2017 年 6 月 13 日

重要提示

浦银安盛增利分级债券型证券投资基金经 2011 年 10 月 25 日中国证券监督管理委员会证监许可[2011]1704 号文核准募集。《浦银安盛增利分级债券型证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)于 2011 年 12 月 13 日生效,根据《基金合同》的有关规定,浦银安盛增利分级债券型证券投资基金封闭期届满后,无需召开持有人大会,已于 2014 年 12 月 16 日转换为上市开放式基金(LOF),基金名称已变更为浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF),基金代码为:166401,基金简称为浦银安盛稳健增利债券(LOF),浦银增 A、浦银增 B 的基金份额已转换为上市开放式基金(LOF)份额,浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)已于 2015 年 1 月 8 日起在深圳证券交易所上市交易。

本招募说明书是对原《浦银安盛增利分级债券型证券投资基金招募说明书》的定期更新,原招募说明书与本招募说明书不一致的,以本招募说明书为准。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金(以下简称基金)是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资者购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者在获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,可能包括:证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的买者自负原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本次更新的招募说明书已经本基金托管人复核。如无特别说明,本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 6 月 13 日,有关财务数据和净值表现截止日 2017 年 3 月 31 日(财务数据未经审计)。

目录

一、基金管理人	4
二、基金托管人	10
三、相关服务机构	11
四、基金的名称	24
五、基金的类型	24
六、基金的投资目标	24
七、基金的投资范围	24
八、基金的投资策略	25
九、业绩比较基准	27
十、风险收益特征	28
十一、基金投资组合报告	28
十二、基金业绩	31
十三、费用概览	35
十四、对招募说明书更新部分的说明	38

## 一、基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：浦银安盛基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 981 号 3 幢 316 室

办公地址：中国上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼

成立时间：2007 年 8 月 5 日

法定代表人：谢伟

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2007]207 号

注册资本：2.8 亿元人民币

股权结构：上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称浦发银行）持有 51% 的股权；法国安盛投资管理有限公司（以下简称安盛投资）持有 39% 的股权；上海国盛集团资产管理有限公司（以下简称国盛资产）持有 10% 的股权。

电话：（021）23212888

传真：（021）23212800

客服电话：400-8828-999；（021）33079999

网址：[www.py-axa.com](http://www.py-axa.com)

联系人：徐薇

### 二、主要人员情况

#### （一）董事会成员

谢伟先生，董事长，硕士研究生，高级经济师。曾任中国建设银行郑州分行金水支行副行长，河南省分行公司业务部总经理，许昌市分行党委书记、行长；上海浦东发展银行公司及投资银行总部发展管理部总经理，公司及投资银行总部副总经理兼投行业务部、发展管理部、大客户部总经理，上海浦东发展银行福州分行党委书记、行长，上海浦东发展银行资金总部总经理，资产管理部总经理。现任上海浦东发展银行党委委员、副行长，兼任金融市场业务总监、金融市场部总经理。自 2017 年 4 月起兼任本公司董事长。

BrunoGuilloton 先生，副董事长，法国国籍，毕业于国立巴黎工艺美术学院。于 1999 年加盟安盛投资管理（巴黎）公司，担任股票部门主管。2000 年至 2002 年，担任安盛投资管理（东京）公司首席执行官。2002 年，任职安盛罗森堡公司和安盛投资管理公司的亚洲区域董事。2005 年起，担任安盛投资管理公司内部审计全球主管。2009 年起任安盛投资管理公司亚洲股东代表。现任安盛投资管理公司亚太区 CEO。自 2015 年 2 月起兼任安盛罗森堡投资管理公司亚太区董事。现另兼任 FochSaintCloudVersaillesSci 及 FujiOakHills 公司董事。自 2009 年 3 月起兼任本公司副董事长。2016 年 12 月起兼任安盛投资管理（上海）

有限公司董事长。

金杰先生，董事。上海财经大学工商管理硕士。曾先后就职于上海上菱电气股份有限公司、上海神光科技有限公司、上海（医药）集团有限公司等公司。2011年5月进入上海国盛集团资产管理有限公司任资产管理部总经理。2016年3月起至今担任上海产权集团有限公司总裁。自2014年9月起兼任本公司董事。

刘长江先生，董事。1998年至2003年担任中国工商银行总行基金托管部副处长、处长，2003年至2005年担任上海浦东发展银行总行基金托管部总经理，2005年至2008年担任上海浦东发展银行总行公司及投资银行总部资产托管部总经理、期货结算部总经理，2008年起担任上海浦东发展银行总行公司及投资银行总部副总经理，2008年至2012年11月兼任上海浦东发展银行总行公司及投资银行总部资产托管部总经理，现任上海浦东发展银行总行金融机构部总经理。自2011年3月起兼任本公司董事。

刘显峰先生，董事，硕士研究生，高级经济师。曾任中国工商银行北京市分行办公室副主任、副主任（主持工作）、主任兼党办主任，北京分行王府井支行党委书记、行长；上海浦东发展银行北京分行干部，北京分行党委委员、纪委书记、副行长，上海浦东发展银行信用卡中心党委副书记（主持工作）、副总经理（主持工作），信用卡中心党委书记、总经理。现任上海浦东发展银行零售业务总监，零售业务管理部总经理，信用卡中心党委书记、总经理。自2017年3月起兼任本公司董事。

廖正旭先生，董事，斯坦福大学理学硕士和纽约科技大学理学硕士。1999年加盟安盛罗森堡投资管理公司，先后担任亚太区 CIO 和 CEO,安盛罗森堡日本公司 CIO。2010年任命为安盛-Kyobo 投资管理公司 CEO。2012年起担任安盛投资管理公司亚洲业务发展主管。自2012年3月起兼任本公司董事。2013年12月起兼任本公司旗下子公司上海浦银安盛资产管理有限公司监事。2016年12月起兼任安盛投资管理（上海）有限公司总经理（法定代表人）。

郁蓓华女士，董事，总经理，复旦大学工商管理硕士。自1994年7月起，在招商银行上海分行工作，历任银行职员、招商银行宝山支行副行长、招商银行上海分行会计部总经理、计财部总经理，招商银行上海分行行长助理、副行长，招商银行信用卡中心副总经理。自2012年7月起担任本公司总经理。自2013年3月起兼任本公司董事。2013年12月至2017年2月兼任本公司旗下子公司上海浦银安盛资产管理有限公司总经理。2017年2月起兼任上海浦银安盛资产管理有限公司执行董事。

王家祥女士，独立董事。1980年至1985年担任上海侨办华建公司投资项目部项目经理，1985年至1989年担任上海外办国际交流服务有限公司综合部副经理，1989年至1991年担任上海国际信托投资有限公司建设部副经理，1991年至2000年担任正信银行有限公司（原正大财务有限公司）总裁助理，2000年至2002年担任上海实业药业有限公司总经理助理，2002年至2006年担任上海实业集团有限公司顾问。自2011年3月起担任本公司独立董事。

韩启蒙先生，独立董事。法国岗城大学法学博士。1995年4月加盟基德律师事务所担任律师。2001年起在基德律师事务所担任本地合伙人。2004年起担任基德律师事务所上海首席代表。2006年1月至2011年9月，担任基德律师事务所全球合伙人。2011年11月起至今，任上海启恒律师事务所合伙人。自2013年2月起兼任本公司独立董事。

霍佳震先生,独立董事。同济大学管理学博士。1987年进入同济大学工作，历任同济大学经济与管理学院讲师、副教授、教授，同济大学研究生院培养处处长、副院长、同济大学经济与管理学院院长，现任同济大学经济与管理学院教师、BOSCH 讲席教授。自2014年4月起兼任本公司独立董事。

董叶顺先生，独立董事。中欧国际工商学院 EMBA，上海机械学院机械工程学士。现任火山石投资管理有限公司创始合伙人。董叶顺先生拥有7年投资行业经历，曾任IDG资本投资顾问（北京）有限公司合伙人及和谐成长基金投委会成员，上海联和投资有限公司副总经理，上海联创创业投资有限公司、宏力半导体制造有限公司、MSN（中国）有限公司、南通联亚药业有限公司等公司董事长。董叶顺先生有着汽车、电子产业近20多年的管理经验，曾任上海申雅密封件系统、中联汽车电子、联合汽车电子系统、延峰伟世通汽车内饰系统等有限公司总经理、党委书记职务。自2014年4月起兼任本公司独立董事。

## （二）监事会成员

檀静女士，监事长，澳大利亚悉尼大学人力资源管理和劳资关系硕士研究生，加拿大不列颠哥伦比亚大学

国际工商管理硕士。2010年4月至2014年6月就职于上海盛融投资有限公司，曾先后担任人力资源部副总经理，监事。2011年1月起至今就职于上海国盛集团资产管理有限公司任行政人事部总经理、本部党支部书记。自2015年3月起兼任本公司监事长。

Simon Lopez 先生，澳大利亚/英国国籍。澳大利亚莫纳什大学法学学士、文学学士。2003年8月加盟安盛投资管理公司（英国伦敦），历任固定收益产品专家、固定收益产品经理、基金会计师和组合控制、首席运营官。现任安盛投资管理有限公司亚太区首席运营官。自2013年2月起兼任本公司监事。

陈士俊先生，清华大学管理学博士。2001年7月至2003年6月，任国泰君安证券有限公司研究所金融工程研究员。2003年7月至2007年9月，任银河基金管理有限公司金融工程部研究员、研究部主管。

2007年10月至今，任浦银安盛基金管理有限公司金融工程部总监，2010年12月10日起兼任浦银安盛沪深300增强型指数基金基金经理，2012年5月14日起兼任浦银安盛中证锐联基本面400指数基金基金经理，2017年4月27日起兼任浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金（LOF）基金经理。

自2012年3月起兼任本公司职工监事。

朱敏奕女士，本科学历。2000年至2007年就职于上海东新投资管理有限公司资产管理部任客户主管。

2007年4月加盟浦银安盛基金管理有限公司担任市场策划经理，现任本公司市场部副总监。自2013年3月起，兼任本公司职工监事。

### （三）公司总经理及其他高级管理人员

郁蓓华女士，复旦大学工商管理硕士。自1994年7月起，在招商银行上海分行工作，历任银行职员、招商银行宝山支行副行长、招商银行上海分行会计部总经理、计财部总经理，招商银行上海分行行长助理、副行长，招商银行信用卡中心副总经理。自2012年7月23日起担任本公司总经理。自2013年3月起，兼任本公司董事。2013年12月至2017年2月兼任本公司旗下子公司上海浦银安盛资产管理有限公司总经理。2017年2月起兼任上海浦银安盛资产管理有限公司执行董事。

喻庆先生，中国政法大学经济法专业硕士和法务会计专业研究生学历，中国人民大学应用金融学硕士研究生学历。历任申银万国证券有限公司国际业务总部高级经理；光大证券有限公司（上海）投资银行部副总经理；光大保德信基金管理有限公司副督察长、董事会秘书和监察稽核总监。2007年8月起，担任本公司督察长。

李宏宇先生，西南财经大学经济学博士。1997年起曾先后就职于中国银行、道勤集团和上海东新国际投资管理有限公司分别从事联行结算、产品开发以及基金研究和投资工作。2007年3月起加盟本公司，历任公司产品开发部总监、市场营销部总监、首席市场营销官。自2012年5月2日起，担任本公司副总经理兼首席市场营销官。

### （四）本基金基金经理

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、浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金及本基金基金经理。2017年4月起，兼任浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金及浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金基金经理。2017年6月起，兼任浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金基金经理。

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、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）及浦银安盛幸福聚益18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017年6月起担任公司旗下浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛元纯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基金及浦银安盛优化收益债券型基金基金经理。

历任基金经理薛铮先生，上海财经大学数量经济学硕士。2006年3月至2009年6月，先后就职于红顶金

融研究中心，上海证券有限公司从事固定收益研究工作。2009年7月进入浦银安盛基金管理公司，历任固定收益研究员、固定收益基金经理助理、货币基金基金经理等职务。2011年12月至2017年6月担任浦银安盛稳健增利债券基金（原增利分级债券基金）基金经理。2012年9月至2017年6月兼任浦银安盛幸福回报债券基金基金经理。2012年11月至2017年6月，担任本公司固定收益投资部总监。2013年5月至2016年8月，兼任浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2013年6月至2016年8月，兼任浦银安盛季季添利债券基金基金经理。2014年7月至2017年6月，兼任浦银安盛优化收益债券基金基金经理。2014年12月至2017年4月，兼任浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金基金经理。2016年5月至2017年4月，兼任浦银安盛幸福聚利债券基金基金经理。2016年7月至2017年6月，兼任浦银安盛盛鑫定期开放债券基金及浦银安盛盛元纯债债券基金基金经理。2016年11月至2017年6月，兼任浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金及浦银安盛幸福聚益18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2016年12月至2017年6月，兼任浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年3月至2017年6月，兼任浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年4月至2017年6月，兼任浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金基金经理。薛铮先生拥有10年证券从业经验。薛铮先生从未被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施。

#### （五）投资决策委员会成员

郁蓓华女士，本公司总经理，董事，并任投资决策委员会主席。

李宏宇先生，本公司副总经理兼首席市场营销官。

吴勇先生，本公司投资总监兼权益投资部总监，公司旗下浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛消费升级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以及浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理。

陈士俊先生，本公司金融工程部总监，公司旗下浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金以及浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金及浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金（LOF）基金经理并兼任本公司职工监事。

蒋建伟先生，本公司权益投资部副总监兼旗下浦银安盛价值成长混合型证券投资基金及浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

钟明女士，本公司固定收益投资部副总监。

黄列先生，本公司研究部总监。

督察长、风险管理部负责人、基金经理及基金经理助理列席投资决策委员会会议。

#### （六）上述人员之间均不存在近亲属关系

### 二、基金托管人

#### 一、基本情况

名称：上海银行股份有限公司（以下简称上海银行）

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号

法定代表人：金煜

成立时间：1995年12月29日

组织形式：股份有限公司（中外合资、上市）

注册资本：人民币60.0445亿元

存续期间：持续经营

基金托管业务批准文号：中国证监会证监许可[2009]814号

托管部门联系人：闻怡

电话：021-68475888

传真：021-68476936

#### 二、主要人员情况

上海银行总行下设资产托管部，是从事资产托管业务的职能部门，内设产品管理部、托管运作部（下设托管运作团队和运行保障团队）、稽核监督部，平均年龄 30 岁左右，100%员工拥有大学本科以上学历，业务岗位人员均具有基金从业资格。

### 三、基金托管业务经营情况

上海银行于 2009 年 8 月 18 日获得中国证监会、中国银监会核准开办证券投资基金托管业务，批准文号：中国证监会证监许可[2009]814 号。

截至 2017 年 3 月 31 日，上海银行已托管 27 只证券投资基金，分别为天治成长精选混合型证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）、中证财通中国可持续发展 100（ECPIESG）指数增强型证券投资基金、鹏华双债增利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、鹏华双债保利债券型证券投资基金、鹏华丰信分级债券型证券投资基金、前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、中银安心回报半年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、华安添颐养老混合型发起式证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金、博时裕荣纯债债券型证券投资基金、浙商惠盈纯债债券型证券投资基金、兴业福益债券型证券投资基金、大成慧成货币市场证券投资基金、嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金、嘉实稳祥纯债债券型证券投资基金、博时裕弘纯债债券型证券投资基金、鹏华兴益定期开放灵活配置混合型基金、博时悦楚纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金以及博时富海纯债债券型证券投资基金，托管基金的资产净值合计 532.59 亿元。

### 三、相关服务机构

#### 一、基金份额发售机构

##### （一）直销机构

##### 1、浦银安盛基金管理有限公司上海直销中心

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 981 号 3 幢 316 室

办公地址：中国上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼

电话：（021）23212899

传真：（021）23212890

客服电话：400-8828-999；（021）33079999

联系人：徐徐薇

网址：[www.py-axa.com](http://www.py-axa.com)

##### 2、电子直销

浦银安盛基金管理有限公司电子直销（目前支持上海浦东发展银行借记卡、中国建设银行借记卡、中国农业银行借记卡、兴业银行借记卡、中信银行借记卡、广发银行借记卡、上海农商银行借记卡、中国工商银行借记卡、交通银行借记卡、中国银行借记卡、光大银行借记卡、民生银行借记卡、平安银行借记卡、邮政储蓄银行借记卡、上海银行借记卡、华夏银行借记卡、招商银行借记卡）

交易网站：[www.py-axa.com](http://www.py-axa.com)

微信服务号：浦银安盛微理财（AXASPDB-E）

客服电话：400-8828-999；（021）33079999

##### （二）代销机构

##### 1、场外代销机构

##### （1）上海银行股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号

法定代表人：金煜

咨询电话：95594

网址：[www.bosc.cn](http://www.bosc.cn)

(2) 上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

客户服务热线：95528

公司网址：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

(3) 招商银行股份有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

客服电话：95555

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

(4) 交通银行股份有限公司：

地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

客服电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(5) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：李庆萍

客服电话：95558

网址：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

(6) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

客服电话：95523

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(7) 华泰证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：周易

咨询电话：95597

公司网站：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

(8) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号 1001A1001B 室

法定代表人：周杰

客服电话：95553

公司网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(9) 兴业证券股份有限公司

地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：兰荣

客服电话：95562

公司网站：[www.xyq.com.cn](http://www.xyq.com.cn)

(10) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 3845 层

法定代表人：宫少林

客户服务热线：95565

公司网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(11) 信达证券股份有限公司

地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

客户服务热线：95321

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

(12) 光大证券股份有限公司

地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：薛峰

客服电话：95525

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(13) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

客服电话：95551

公司网站：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(14) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人：杜庆平

客服电话：4006515988

公司网址：[www.bhjq.com](http://www.bhjq.com)

(15) 中泰证券股份有限公司

办公地址：山东济南市经七路 86 号证券大厦 2001

法定代表人：李玮

客户服务热线：95538

网址：[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

(16) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505

法定代表人：林义相

客户服务热线：010-66045678

天相投顾网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)

天相基金网网址：[www.jjm.com.cn](http://www.jjm.com.cn)

(17) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

咨询电话：95587

公司网站：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)



(18) 中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

法定代表人：王宜四

咨询电话：4008866567

公司网站：www.avicsec.com

(19) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

法定代表人：黄金琳

客户服务热线：0591-96326 或 400-88-96326

网址：www.hfzq.com.cn

(20) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

客户服务热线：95521 或 400-8888-666

公司网址：www.gtja.com

(21) 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

法定代表人：孙树明

客服电话：95575

公司网站：www.gf.com.cn

(22) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室（邮编：830002）

法定代表人：韩志谦

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

(23) 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702

办公地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号万通新世界广场 A 座 22 层

法定代表人：吴雪秀

客服电话：400-001-1566

公司网站：www.yilucaifu.com

(24) 深圳宜投基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街 1 号深港合作区管理局综合办公楼 A 栋 201

办公地址：深圳市福田区金田路 2028 号皇岗商务中心 2405

法定代表人：华建强

客服电话：4008-955-811

公司网站：www.yitfund.com

(25) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

客服电话：410-910-1166

公司网站：www.cicc.com.cn

(26) 上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号 26 楼

法定代表人：其实

客户服务电话：400-1818-188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(27) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：400-820-2899

网址：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(28) 上海汇付金融服务有限公司

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：金佶

客服电话：400-820-2819

公司网站：<https://tty.chinapnr.com>

(29) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

客服电话：400-921-7755

公司网站：[www.leadfund.com.cn](http://www.leadfund.com.cn)

(30) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

公司网站：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(31) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

客服电话：4006433389

公司网站：[www.lingxianfund.com](http://www.lingxianfund.com)

(32) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

公司网站：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(33) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：鲍东华

客服电话：4008219031

公司网站：www.lufunds.com

(34) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

客服电话：95574

公司网址：www.nbcb.com.cn

(35) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7 层、8 层

法定代表人：黄扬录

客服电话：4001022011

公司网站：www.zszq.com.cn

(36) 爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 层

法定代表人：钱华

客服电话：4001962502

公司网站：www.ajzq.com

(37) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

(38) 浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址：杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

服务热线：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

(39) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层

法定代表人：胡伟

客服电话：4006180707

公司网站：www.hongdianfund.com

(40) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

公司网站：www.zlfund.cnwww.jjmmw.com

(41) 深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层 01B、02、03、04 单位

办公地址：深圳市南山区科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室

法定代表人：刘鹏宇

客服电话：0755-83999907

公司网站：[www.jinqianwo.cn](http://www.jinqianwo.cn)

(42) 奕丰金融服务(深圳)有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室，1116室及1307室

法定代表人：TANYIKKUAN

客服电话：400-684-0500

公司网站：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

(43) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层

法定代表人：燕斌

客服电话：400-166-6788

公司网站：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(44) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层

法定代表人：张彦

客服电话：400-166-1188

公司网站：[8.jrj.com.cn](http://8.jrj.com.cn)

(45) 平安证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层

办公地址：广东省深圳市福田区金田路4306号荣超大厦18楼

法定代表人：詹露阳

客服电话：95511-8

公司网站：[www.stock.pingan.com](http://www.stock.pingan.com)

(46) 北京钱景财富投资管理有限公司

办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人：赵荣春

客服电话：400-893-6885

网址：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

(47) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

法定代表人：钱昊旻

客服电话：4008909998

公司网站：[www.jnlc.com](http://www.jnlc.com)

(48) 北京创金启富投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同31号中水大厦215A

办公地址：北京市西城区白纸坊东街2号经济日报社A综合楼712室

法定代表人：梁蓉

客服电话：400-6262-818

公司网站：[www.5irich.com](http://www.5irich.com)

(49) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区万通中心 D 座 21 层

法定代表人：蒋煜

客服电话：400-818-8866

公司网站：<https://fund.shengshiview.com/>

(50) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号 26 楼

法定代表人：姚文平

客户服务电话：4008888128

网址：[www.tebon.com.cn](http://www.tebon.com.cn)

## 2、场内代销机构

投资者可通过上证基金通办理本基金的上海证券交易所场内申购与赎回，可办理上证基金通业务的证券公司的具体名单可在上海证券交易所网站查询。如果上海证券交易所增加或减少具有上证基金通业务资格的证券公司，请以上海证券交易所的具体规定为准。

## 二、注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系人：赵亦清

电话：(010) 50938782

传真：(010) 50938991

## 三、出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：盈科（上海）律师事务所

住所：上海市闸北区裕通路 100 号洲际中心 15，16 层

办公地址：上海市闸北区裕通路 100 号洲际中心 15，16 层

负责人：董冬冬

电话：(021) 60561288

传真：(021) 60561299

联系人：董冬冬

经办律师：董冬冬、耿海霞

## 四、审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：(021) 23238888

联系人：张振波

经办注册会计师：薛竞、张振波

## 五、其他服务机构及委托办理业务的有关情况

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，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。

#### 四、基金的名称

本基金名称：浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）

本基金由浦银安盛增利分级债券型证券投资基金三年封闭期届满转换而来。

#### 五、基金的类型

债券型证券投资基金

#### 六、基金的投资目标

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。

#### 七、基金的投资范围

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。本基金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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

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%，其中，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%。

#### 八、基金的投资策略

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。

##### （一）资产配置

本基金将自上而下地实施整体资产配置策略，通过对宏观经济运行状况、货币政策变化、市场利率走势、市场资金供求情况、经济周期等要素的定性与定量的考察，预测各大类资产未来收益率变化情况，在不同的大类资产之间进行动态调整和优化，以规避市场风险，提高基金收益率。

##### （二）固定收益类证券投资策略

###### 1、久期与期限结构管理策略

利率风险是债券投资最主要的风险来源和收益来源之一，衡量债券利率风险的核心指标是久期。本基金通过对宏观经济状况和货币政策的分析，对债券市场走势作出判断，并形成对未来市场利率变动方向的预期，动态调整债券组合的久期。在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化情景的分析，分别采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行合理配置，以从长、中、短期债券的相

对价格变化中获利。

## 2、类属配置策略

在保证流动性的基础上，本基金将通过国债、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、回购和银行存款等资产的合理组合实现稳定的投资收益。

类属配置主要策略包括研究国债与金融债之间的利差、交易所与银行间的市场利差、企业债与国债的信用利差等，寻找价值相对低估的投资品种。

## 3、个券选择策略

### （1）流动性策略

本基金将通过对各类流动性指标的設置与监控，管理由于基金的申购、赎回或个券的交易难易程度而引致的潜在损失风险。

### （2）信用分析策略

为了确保本金安全的基础上获得稳定的收益，本基金对企业债、公司债、金融债、短期融资券等信用债券进行信用分析。此分析主要通过三个角度完成：独立第三方的外部评级结果；第三方担保情况；基于基金管理人自有的数量化公司财务研究模型的内部评价。该模型在信用评价方面的主要作用在于通过对部分关键的财务指标分析判断债券发行企业未来出现偿债风险的可能性，从而确定该企业发行债券的信用等级与利率水平。主要关键的指标包括：NETDEBT/EBITDA、EBIT/I、资产负债率、流动资产/流动负债、经营活动现金流/总负债。其中资产负债率、流动资产/流动负债主要分析企业债务水平与结构，其他的指标主要分析企业经营效益对未来偿债能力的支持能力。

## 4、回购策略

该策略是风险较低的投资策略。即在基础组合的基础上，使用基础组合持有的债券进行回购融入短期资金滚动操作，同时选择适宜期限的交易所和银行间品种进行投资以获取骑乘及短期债券与货币市场利率的利差。

## 5、可转债投资策略

可转换公司债券是一种介于股票和债券之间的固定收益类投资品种，其理论价值等于作为普通债券的纯债券价值加上可转债内含选择权的价值。

### 积极管理策略

可转债内含选择权定价是决定可转债投资价值的关键因素。本基金在对可转换公司债券条款和发行公司基本面进行深入分析研究的基础上，利用可转债的纯债券价值和到期收益率来判断可转债的债性，以增强本金投资的安全性；利用可转债转换价值相对于纯债券价值的溢价率来判断可转债的股性，在市场出现投资机会时，优先选择股性强的品种，获取超额收益。

### 一级市场申购策略

目前，可转债均采用定价发行，对于那些发行条款优惠、期权价值较高、公司基本面优良的可转债，因供求不平衡，会产生较大的一、二级市场价差。因此，为增加组合收益，本基金将在充分研究的基础上，参与可转换债券的一级市场申购，在严格控制风险的前提下获得稳定收益。

## 6、资产支持证券投资策略

本基金通过分析资产支持证券对应资产池的资产特征，来估计资产违约风险和提前偿付风险，根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流支付，并利用合理的收益率曲线对资产支持证券进行估值。同时还将充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性，控制资产支持证券投资的风险，以获取较高的投资收益。

### （三）新股申购策略

在股票发行市场上，股票供求关系不平衡经常导致股票发行价格与二级市场价格之间存在一定的价差，从而使得新股申购成为一种风险较低的投资方式。本基金将研究首次发行(IPO)股票及增发新股的上市公司基本面，根据股票市场整体定价水平，估计新股上市交易的合理价格，同时参考一级市场资金供求关系，谨慎参与新股申购。本基金对于通过参与新股认购所获得的股票，在可上市交易后 90 个交易日内全部卖出。

#### （四）权证投资策略

本基金将因为所持股票以及投资可分离债券等原因而被动获得权证。本基金进行权证投资时，将在对权证的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险交易组合以及持有价值出现较为显著的低估的权证品种。

#### 久、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中证全债指数

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。中证全债指数涵盖了在上海证券交易所、深圳证券交易所和银行间市场上交易的债券。中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标，为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价，能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。该指数具有广泛的市场代表性，能够全面反映债券市场总体走势；该指数编制方法、指数数据等相关指数信息透明度高，适合作为本基金的业绩比较基准。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

#### 十、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。

#### 十一、基金投资组合报告

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。

本基金的托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，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。

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

##### 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 --

其中：股票 --

2 基金投资 --

3 固定收益投资 4,363,335,814.10 88.72

其中：债券 4,341,107,814.10 88.27

资产支持证券 22,228,000.00 0.45

4 贵金属投资 --

5 金融衍生品投资 --

6 买入返售金融资产 440,961,901.44 8.97

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 21,586,064.30 0.44

8 其他资产 92,184,558.15 1.87

9 合计 4,918,068,337.99 100.00

##### 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

###### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

###### 2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合



本基金本报告期末未持有沪港通股票。

3 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

本基金本报告期末未持有股票。

4 报告期末按券种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 3,154,449.80 0.06

2 央行票据 --

3 金融债券 375,475,000.00 7.71

其中：政策性金融债 375,475,000.00 7.71

4 企业债券 2,363,949,130.30 48.52

5 企业短期融资券 164,696,500.00 3.38

6 中期票据 8,799,200.00 0.18

7 可转债（可交换债） 29,533,534.00 0.61

8 同业存单 1,395,500,000.00 28.65

9 其他 --

10 合计 4,341,107,814.10 89.11

5 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 111699530 16 重庆银行 CD047 2,000,000 196,520,000.00 4.03

2 111680858 16 重庆银行 CD062 2,000,000 196,200,000.00 4.03

3 111615323 16 民生 CD323 2,000,000 192,520,000.00 3.95

4 111610585 16 兴业 CD585 2,000,000 192,500,000.00 3.95

5 1480421 14 曲经开建投债 1,500,000 158,280,000.00 3.25

6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

序号 证券代码 证券名称 数量（份） 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 1689260 16 建元 2A1 400,000 22,228,000.00 0.46

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8 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

本基金本报告期末未持有权证。

9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

9.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围尚未包含国债期货

9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金投资范围尚未包含国债期货

9.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金投资范围尚未包含国债期货。

10 投资组合报告附注

10.1 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年受到公开谴责、处罚的情况。

10.2 报告期内，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。

10.3 其他各项资产构成

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 120,762.15

2 应收证券清算款 170,294.47  
 3 应收股利 -  
 4 应收利息 91,893,501.53  
 5 应收申购款 -  
 6 其他应收款 -  
 7 待摊费用 -  
 8 其他 -  
 9 合计 92,184,558.15

#### 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 128009 歌尔转债 14,408,476.00 0.30  
 2 110035 白云转债 5,146,400.00 0.11  
 3 113009 广汽转债 1,453,200.00 0.03  
 4 128011 汽模转债 597,688.00 0.01  
 5 128010 顺昌转债 349,770.00 0.01

#### 10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 十二、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### 转型前

(一) 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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
2011/12/13-2011/12/31	0.20%	0.04%	0.26%	0.03%
2012/01/01-2012/12/31	11.98%	0.16%	4.03%	0.04%
2013/01/01-2013/12/31	-1.34%	0.50%	1.78%	0.05%
2014/01/01-2014/12/15	19.15%	0.27%	8.01%	0.16%
2011/12/13-2014/12/15	31.90%	0.34%	14.65%	0.10%

(二) 自基金合同生效以来基金累计份额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

浦银安盛增利分级债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2011年12月13日至2014年12月15日

### 转型后

(一) A类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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
2017/01/23-2017/3/31	0.29%	0.05%	-0.28%	0.08%

(二) C类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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
2014/12/16-2014/12/31	-0.40%	0.13%	1.30%	0.09%
2015/01/01-2015/12/31	2.91%	0.45%	6.51%	0.07%
2016/01/01-				
2016/12/31	3.43%	0.09%	2.00%	0.09%
2017/01/01-2017/03/31	0.68%	0.05%	-0.33%	0.07%

2014/12/16-2017/3/31 6.74% 0.30% 9.68% 0.08% -2.94% 0.22%

(三) 自基金转型以来基金累计份额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型证券投资基金 (LOF)

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

浦银安盛稳健增利债券 A:

2017 年 1 月 23 日至 2017 年 3 月 31 日

浦银安盛稳健增利债券 C:

2014 年 12 月 16 日至 2017 年 3 月 31 日

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。2、自 2015 年 9 月 17 日起, 本基金业绩比较基准由原中信标普全债指数变更为中证全债指数。具体内容详见基金管理人于 2015 年 9 月 17 日发布的《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》。

3、经向中国证监会备案, 本基金于 2017 年 1 月 23 日分为 A、C 两类。具体内容详见本基金管理人于 2017 年 1 月 23 日刊登的《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》。

十三、费用概览

一、与基金运作有关费用

二、

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、基金销售服务费;

4、基金上市费用;

5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费;

7、基金份额持有人大会费用;

8、基金的证券交易费用;

9、基金的银行汇划费用;

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定, 可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用, 按实际支出额从基金财产总值中扣除。

二、上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定, 法律法规另有规定时从其规定。

三、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

在通常情况下, 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.3% 年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H = E \times 0.3\% \times \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算, 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管理费划款指令, 基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等, 支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下, 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H = E \times 0.1\% \times \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，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托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \times \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额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。

上述一、基金费用的种类中第 4—9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 四、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 五、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等相关费率。

调高基金管理费率或基金托管费率或基金销售服务费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率或基金托管费率或基金销售服务费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定至少在一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

### 六、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集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》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、更新了重要提示的部分内容；
- 2、添加第一部分历史沿革内容；
- 3、在第三部分释义部分，对部分内容进行了更新；
- 4、在第四部分基金管理人部分，对部分内容进行了更新；
- 5、在第五部分基金托管人部分，对基金托管人情况进行了更新；
- 6、在第六部分相关服务机构中更新了基金份额发售机构、审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师的部分信息；
- 7、删除了原第六部分基金份额的分级；
- 8、在第九部分基金份额的申购与赎回部分，对部分内容进行了更新；
- 9、在第十部分基金的投资部分，对投资范围、投资策略、投资限制、风险收益特征进行了更新，并补充了本基金最近一期公开披露的投资组合报告的内容和投资业绩；

- 10、在第十二部分基金资产的估值部分，对部分内容进行了更新；
- 11、在第十三部分基金的费用与税收部分，对部分内容进行了更新；
- 12、在第十四部分基金的收益与分配部分，对部分内容进行了更新；
- 13、在第十六部分基金的信息披露部分，对部分内容进行了更新；
- 14、在第十七部分风险揭示部分，对部分内容进行了更新；
- 15、在第十八部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算部分，对部分内容进行了更新；
- 16、在第十九部分基金合同的内容摘要部分，对部分内容进行了更新；
- 17、在第二十部分基金托管协议的内容摘要部分，对部分内容进行了更新；
- 18、在第二十二部分其他应披露事项部分，更新了基金管理人 2016 年 12 月 14 日至 2017 年 6 月 13 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的与本基金相关的公告。

浦银安盛基金管理有限公司

二〇一七年七月二十六日