

# 浦银安盛优化收益债券型证券投资基金 2017 年半年度报告 摘要

2017 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

## § 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金简称            | 浦银安盛优化收益债券       |                 |
| 基金主代码           | 519111           |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                 |
| 基金合同生效日         | 2008 年 12 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           | 中国工商银行股份有限公司     |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 31,688,760.82 份  |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                 |
| 下属分级基金的基金简称:    | 浦银安盛优化收益债券 A     | 浦银安盛优化收益债券 C    |
| 下属分级基金的交易代码:    | 519111           | 519112          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 19,536,524.96 份  | 12,152,235.86 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金通过对宏观经济运行状况、金融市场的运行趋势进行自上而下的分析,通过信用分析为基础进行自下而上的精选个券,在严格控制投资风险的基础上,主要对固定收益市场各种资产定价不合理产生的投资机会进行充分挖掘,力争实现基金资产的长期稳定增值。                    |
| 投资策略   | 本基金在宏观经济和债券市场自上而下和自下而上分析的基础上,把握市场利率的趋势性变化与不同债券的价值差异,通过久期配置、收益率曲线策略等方法,实施积极的债券投资策略。同时,在比较债券类资产与权益类资产投资价值的基础上,通过大类资产配置的调整以获得超越业绩比较基准的投资收益。 |
| 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收益、较低风险品种。一般情形下,其风险和收益低于股票型基金、混合型基金,高于货币型基金。本基金力争在科学的风险管理的前提下,谋求实现基金资产的安全和增值。                                  |

### 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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名           | 顾佳           |
|         | 联系电话         | 021-23212888 |
|         |              | 郭明           |
|         |              | 010-66105799 |

|        |      |                             |                     |
|--------|------|-----------------------------|---------------------|
|        | 电子邮箱 | compliance@py-axa.com       | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 |      | 021-33079999 或 400-8828-999 | 95588               |
| 传真     |      | 021-23212985                | 010-66105798        |

## 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          | 浦银安盛优化收益债券 A                        | 浦银安盛优化收益债券 C                          |
|---------------|-------------------------------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2017 年 1 月 1 日-2017 年 6 月 30 日) | 报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | 420,686.75                          | 150,425.83                            |
| 本期利润          | 648,085.75                          | 258,015.48                            |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0284                              | 0.0260                                |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.93%                               | 1.72%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017 年 6 月 30 日)               |                                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.4973                              | 0.4479                                |
| 期末基金资产净值      | 30,995,127.60                       | 18,676,195.82                         |
| 期末基金份额净值      | 1.587                               | 1.537                                 |

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。

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、本基金自 2009 年 9 月 22 日起增加 C 类收费模式。

### 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

浦银安盛优化收益债券 A

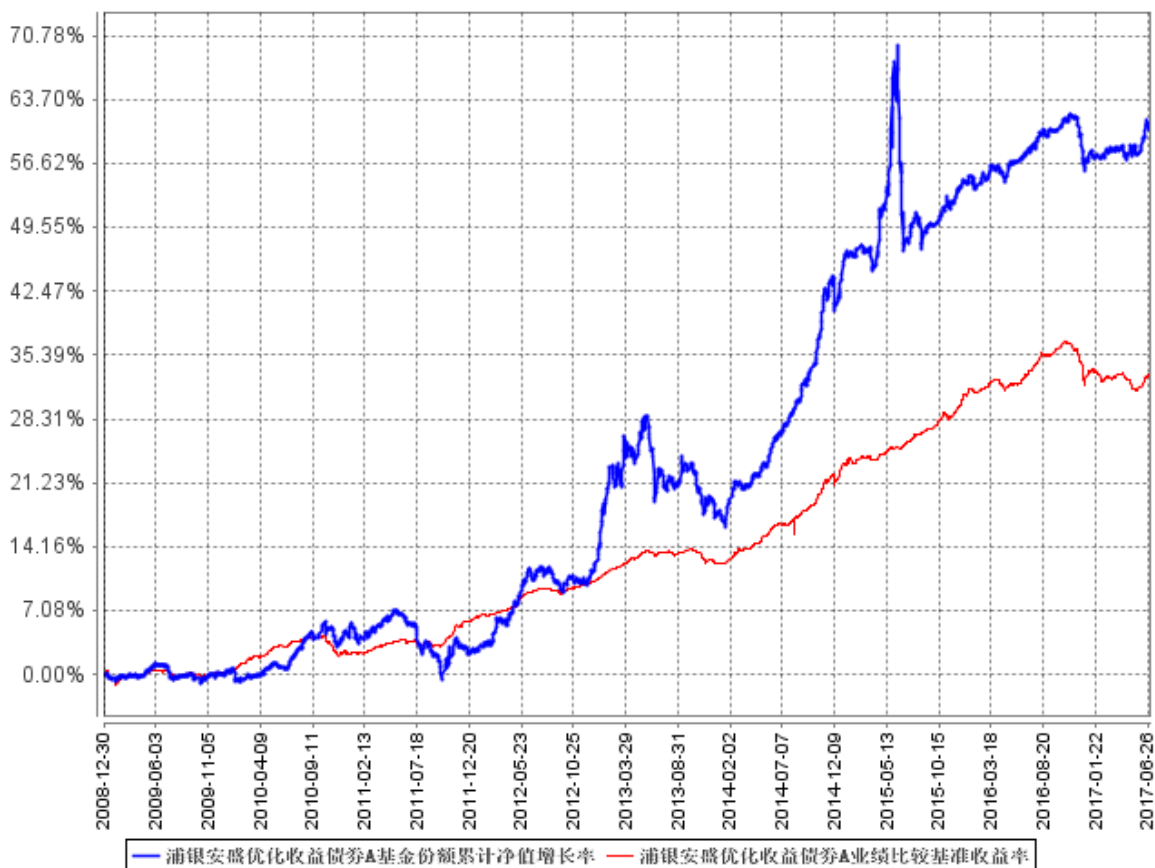
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 1.47%    | 0.20%       | 1.20%      | 0.05%         | 0.27%  | 0.15% |
| 过去三个月      | 1.34%    | 0.20%       | 0.13%      | 0.07%         | 1.21%  | 0.13% |
| 过去六个月      | 1.93%    | 0.17%       | -0.20%     | 0.07%         | 2.13%  | 0.10% |
| 过去一年       | 1.54%    | 0.17%       | 0.17%      | 0.09%         | 1.37%  | 0.08% |
| 过去三年       | 26.25%   | 0.41%       | 14.21%     | 0.12%         | 12.04% | 0.29% |
| 自基金合同生效起至今 | 60.23%   | 0.32%       | 33.36%     | 0.08%         | 26.87% | 0.24% |

浦银安盛优化收益债券 C

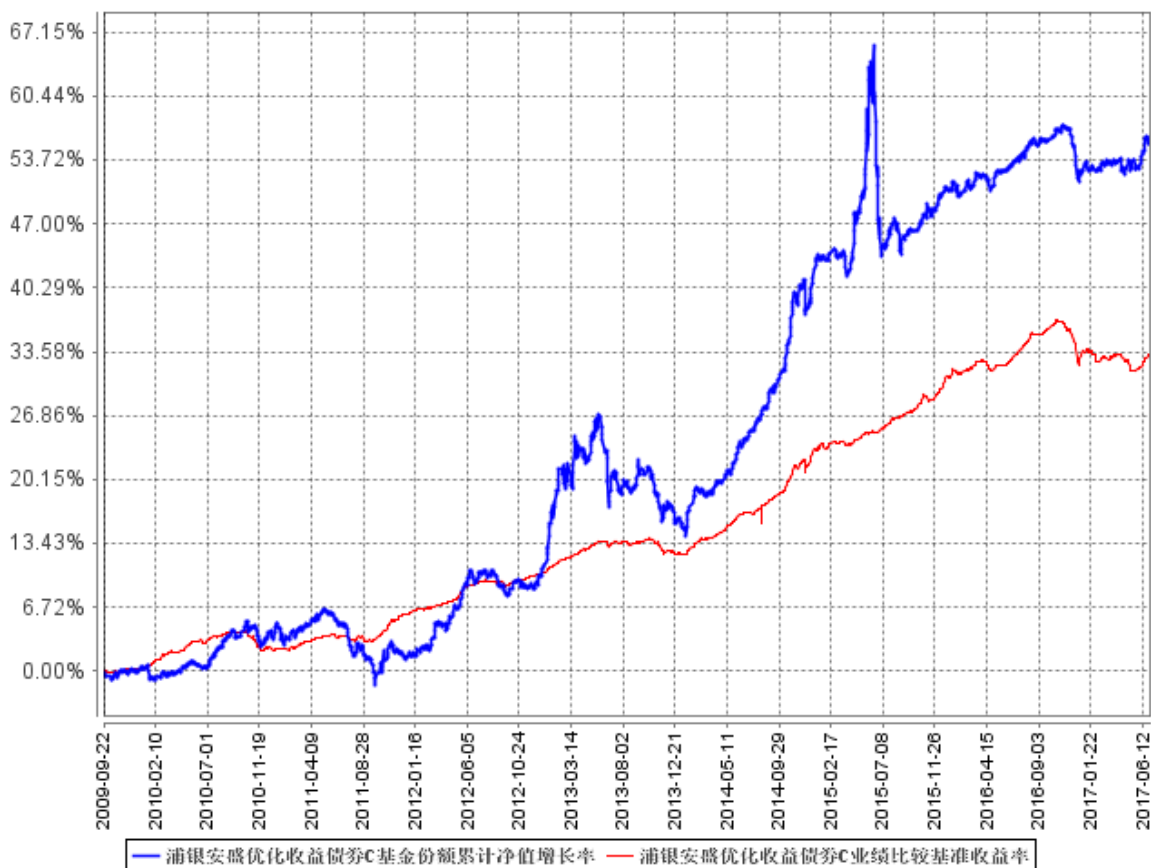
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 1.45%    | 0.19%       | 1.20%      | 0.05%         | 0.25%  | 0.14% |
| 过去三个月      | 1.25%    | 0.20%       | 0.13%      | 0.07%         | 1.12%  | 0.13% |
| 过去六个月      | 1.72%    | 0.16%       | -0.20%     | 0.07%         | 1.92%  | 0.09% |
| 过去一年       | 1.12%    | 0.17%       | 0.17%      | 0.09%         | 0.95%  | 0.08% |
| 过去三年       | 24.66%   | 0.41%       | 14.21%     | 0.12%         | 10.45% | 0.29% |
| 自基金合同生效起至今 | 55.19%   | 0.33%       | 33.36%     | 0.08%         | 21.83% | 0.25% |

### 3.2.2 自基金合同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

### 浦银安盛优化收益债券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



## 浦银安盛优化收益债券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：经中国证监会批准，本基金于 2009 年 9 月 22 日分为 A、C 两类。具体内容详见本基金管理人于 2009 年 9 月 18 日刊登的《关于浦银安盛优化收益债券型证券投资基金增加 C 类收费模式并修改基金合同的公告》。

## § 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 2.8 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 2017 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 33 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（LOF）、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、浦银安盛月月盈安心养老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、浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛幸福聚益 18 个月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、浦银安盛盛勤纯债债券型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）。

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           |    |  |
|-----|---|-----------------|----------------|----|--|
| 薛铮  | 原本公司固定收益投资部总监，原公司旗下债券基金基金经理。  | 2014 年 7 月 28 日 | 2017 年 6 月 8 日 | 11 | 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、固定收益基金基金经理、固定收益投资部总监等职务。薛铮于 2017 年 6 月 8 日离职。   |
| 章潇枫 | 公司旗下浦银安盛盛鑫债券基金、浦银安盛盛泰债券基金、浦银安盛盛达债券基金、浦银安盛幸福聚益 18 个月债券基金、浦银安盛稳健增利债券基金（LOF）、浦银安盛幸福回报债券基金、浦银安盛优化收益债券基金、浦银安盛盛元债券基金以及浦银安盛盛勤债券基金基金经理。 | 2017 年 6 月 8 日  | -              | 6  | 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 15 日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 8 日起担任公司旗下浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛盛元债券型证券投资基金及浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金的基金经理。 |

|     |                |                    |                    |   |  |
|-----|----------------|--------------------|--------------------|---|--|
| 章潇枫 | 原固定收益投资部基金经理助理 | 2016 年 6 月<br>14 日 | 2017 年 5 月<br>15 日 | 6 | 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 15 日起任基金经理之职。 |
|-----|----------------|--------------------|--------------------|---|--|

注：1、述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《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合规守信情况的说明

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

2017 年一季度，国内经济温和复苏，工业品价格同比保持高增速，企业主动补库存，基建开工旺盛，房地产销售好于预期，周期行业景气度处于相对高位，工业企业利润持续改善。二季度受地产调控、金融去杠杆对经济的影响，经济弱于一季度，基建有所放缓。但受益于消费升级，三、四线城市需求强劲，同时外需继续改善也对经济形成支撑，总体来说经济下行的速度非常缓慢。

2017 年上半年，货币政策保持总量上稳健中性，央行逐渐把价格调控放到更重要的位置，春节和 3 月美国加息后，两次上调 OMO+SLF+MLF 利率，6 月美国再次加息后央行按兵不动。受到表外转表内和债券直接融资负增长的影响，上半年社融和信贷数据超市场预期，但 M2 增速明显下滑：上半年社融增量 11.17 万亿，新增人民币贷款 7.97 万亿，新增人民币存款 9.07 万亿，M2 同比仅增 9.4%。

2017 年二季度开始，金融监管趋严，银监会接连发布制度直指“三套利、四不当”，银行需上报自查方案。金融监管的趋严使得委外产品赎回或到期不续作的现象增多。5 月中下旬，中央要求监管机构加强金融监管协调，央行一季度政策执行报告指出要把握好去杠杆和维护流动性基本稳定的平衡，监管步调趋缓。

回顾 2017 年上半年，债券市场走势偏弱，同时叠加了利率走廊上升和监管冲击，市场波动明显加大。1 月延续去年债灾后的反弹，2 月受 OMO+SLF+MLF 上调影响下跌，3 月受经济预期转弱和 PPI 见顶影响走强，4、5 月受监管政策集中出台影响下跌，5 月下旬开始央行呵护流动性、监管放缓，市场转暖。

报告期内，本基金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。本基金均衡配置资质较好的信用债，适当增加了有转股预期的可转债配置，期间精选个券和利率债等进行波段操作，并把握机会进行调仓，提高了组合的安全性和流动性，取得了较好的回报。

#### 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优化收益债券 A 基金份额净值为 1.5870 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.93%；截至本报告期末浦银安盛优化收益债券 C 基金份额净值为 1.5370 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.72%；同期业绩比较基准收益率为-0.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，6 月地产投资开始有较明显的回落，基建投资增速 1-6 月份为 16.8%超过全年目标的 16%，随着 PPP 逐渐降温下半年增速也将下滑，整体上看经济小周期见顶，下半年向 L 型底部回归。食品价格持续疲软，预计 CPI 全年在 1.7%左右。原油熊市拖累国际再通胀预期，美国核心通胀短期难以提振，欧元区通胀受下半年原油同比下跌影响也面临回落压力。

美元走弱和外汇占款改善的情况下，货币政策的操作空间有所加大，更多以安抚市场对冲监管政策、保持金融体系稳健中性流动性为操作重点，整体相比 2 季度将更加灵活，甚至略显宽松。金融去杠杆在金融维稳的前提下稳步推进，不会仓促行事，预计下半年的短端利率将回落，修复过度平坦的收益率曲线，OMO 等中枢利率保持平稳。

信用方面，今年以来山东民企爆发互保危机，部分对外投资规模较大的民企遭大行排查，民企发信用债的信用利差普遍走扩。金融工作会议强调控总量，上半年信贷规模约占全年 60-70%，下半年企业间接融资空间有限，而上半年信用债发行净融资为-3873.61 万，下半年如果直接融资不能有所突破，民企信用风险可能有更多的暴露。

未来市场更多以区间震荡为主，金融维稳与灵活的货币投放管控决定了收益率上行有顶，美债、欧债等国际债券收益率趋势性上行决定了国内债市收益率下行有底，主要风险包括：欧央行 9 月是否会开始着手逐步退出 QE，3 季度特别国债到期和地方债加大供给对市场供求的冲击，民企信用风险集中爆发的风险。

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。下半年将进一步提高组合的流动性，上浮组合持仓资质，维持目前的久期水平，在操作上将更多的围绕收益率曲线陡峭化形态修复做波段交易，择机参与可转债交易，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分管高管、金融工程部负责人、研究部负责人、风险管理部和监察稽核部负责人、基金运营部负责人组成。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签订了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

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》第十五部分第三条约定，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，每次基金收益分配比例不得低于可供分配收益的 50%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

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。

### § 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

本报告期内，本基金托管人在对浦银安盛优化收益债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，浦银安盛优化收益债券型证券投资基金的管理人——浦银安盛基金管理有限公司在浦银安盛优化收益债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，浦银安盛优化收益债券型证券投资基金未进行利润分配。

## 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

本托管人依法对浦银安盛基金管理有限公司编制和披露的浦银安盛优化收益债券型证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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：浦银安盛优化收益债券型证券投资基金  
报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号 | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|------------|-----|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |     |                        |                          |
| 银行存款       |     | 370,623.23             | 120,974.27               |
| 结算备付金      |     | 203,898.91             | 398,153.52               |
| 存出保证金      |     | 2,126.49               | 2,774.63                 |
| 交易性金融资产    |     | 52,440,750.00          | 47,680,384.90            |
| 其中：股票投资    |     | -                      | -                        |
| 基金投资       |     | -                      | -                        |
| 债券投资       |     | 52,440,750.00          | 47,680,384.90            |
| 资产支持证券投资   |     | -                      | -                        |
| 贵金属投资      |     | -                      | -                        |
| 衍生金融资产     |     | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产   |     | 6,700,000.00           | 3,500,000.00             |

|                 |            |                           |                             |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 应收证券清算款         |            | -                         | 301,031.86                  |
| 应收利息            |            | 908,106.13                | 701,211.20                  |
| 应收股利            |            | -                         | -                           |
| 应收申购款           |            | 13,909.53                 | 541,123.28                  |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            |            | -                         | -                           |
| 资产总计            |            | 60,639,414.29             | 53,245,653.66               |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2016年12月31日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                           |                             |
| 短期借款            |            | -                         | -                           |
| 交易性金融负债         |            | -                         | -                           |
| 衍生金融负债          |            | -                         | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | 10,500,000.00             | -                           |
| 应付证券清算款         |            | 201,166.79                | -                           |
| 应付赎回款           |            | 87,648.63                 | 106,157.07                  |
| 应付管理人报酬         |            | 26,820.72                 | 30,416.20                   |
| 应付托管费           |            | 8,252.55                  | 9,358.83                    |
| 应付销售服务费         |            | 6,228.06                  | 3,881.55                    |
| 应付交易费用          |            | 3,586.92                  | -                           |
| 应交税费            |            | -                         | -                           |
| 应付利息            |            | 359.54                    | -                           |
| 应付利润            |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                         | -                           |
| 其他负债            |            | 134,027.66                | 301,575.62                  |
| 负债合计            |            | 10,968,090.87             | 451,389.27                  |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金            |            | 31,688,760.82             | 34,115,674.85               |
| 未分配利润           |            | 17,982,562.60             | 18,678,589.54               |
| 所有者权益合计         |            | 49,671,323.42             | 52,794,264.39               |
| 负债和所有者权益总计      |            | 60,639,414.29             | 53,245,653.66               |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.567 元，基金份额总额为 31,688,760.82 份。其中 A 类基金份额净值为 1.587 元，基金份额为 19,536,524.96 份；C 类基金份额净值为 1.537 元，基金份额为 12,152,235.86 份。

## 6.2 利润表

会计主体：浦银安盛优化收益债券型证券投资基金  
本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至 |
|-----|-----|-----------------------|----------------------------|
|-----|-----|-----------------------|----------------------------|

|                            |           | 2017 年 6 月 30 日 | 2016 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|-----------|-----------------|-----------------|
| <b>一、收入</b>                |           | 1,326,106.91    | 2,122,101.97    |
| 1.利息收入                     |           | 1,084,543.20    | 2,622,430.94    |
| 其中：存款利息收入                  |           | 7,410.70        | 41,976.98       |
| 债券利息收入                     |           | 1,015,126.99    | 2,580,453.96    |
| 资产支持证券利息收入                 |           | -               | -               |
| 买入返售金融资产收入                 |           | 62,005.51       | -               |
| 其他利息收入                     |           | -               | -               |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |           | -95,177.78      | 1,147,942.09    |
| 其中：股票投资收益                  |           | 73,636.08       | -               |
| 基金投资收益                     |           | -               | -               |
| 债券投资收益                     |           | -172,931.18     | 1,147,942.09    |
| 资产支持证券投资收益                 |           | -               | -               |
| 贵金属投资收益                    |           | -               | -               |
| 衍生工具收益                     |           | -               | -               |
| 股利收益                       |           | 4,117.32        | -               |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      |           | 334,988.65      | -1,667,783.50   |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |           | -               | -               |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          |           | 1,752.84        | 19,512.44       |
| <b>减：二、费用</b>              |           | 420,005.68      | 819,981.39      |
| 1. 管理人报酬                   |           | 164,445.67      | 236,915.55      |
| 2. 托管费                     |           | 50,598.69       | 72,897.05       |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.8.2.3 | 29,910.11       | 30,481.81       |
| 4. 交易费用                    |           | 7,709.13        | 2,011.75        |
| 5. 利息支出                    |           | 14,196.24       | 308,294.83      |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |           | 14,196.24       | 308,294.83      |
| 6. 其他费用                    |           | 153,145.84      | 169,380.40      |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |           | 906,101.23      | 1,302,120.58    |
| 减：所得税费用                    |           | -               | -               |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |           | 906,101.23      | 1,302,120.58    |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛优化收益债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元



| 项目                                     | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 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<br>(基金净值)                    | 34,115,674.85                              | 18,678,589.54  | 52,794,264.39  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)              | -  | 906,101.23     | 906,101.23     |
| 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)      | -2,426,914.03                              | -1,602,128.17  | -4,029,042.20  |
| 其中: 1.基金申购款                            | 10,058,996.75                              | 5,287,601.12   | 15,346,597.87  |
| 2.基金赎回款                                | -12,485,910.78                             | -6,889,729.29  | -19,375,640.07 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -  | -              | -              |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                    | 31,688,760.82                              | 17,982,562.60  | 49,671,323.42  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 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<br>(基金净值)                    | 47,704,944.51                              | 25,008,046.14  | 72,712,990.65  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)              | -  | 1,302,120.58   | 1,302,120.58   |
| 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)      | -6,054,370.36                              | -3,256,390.50  | -9,310,760.86  |
| 其中: 1.基金申购款                            | 55,436,174.45                              | 29,432,323.04  | 84,868,497.49  |
| 2.基金赎回款                                | -61,490,544.81                             | -32,688,713.54 | -94,179,258.35 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -  | -              | -              |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                    | 41,650,574.15                              | 23,053,776.22  | 64,704,350.37  |

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：

|                                |                                |                               |
|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|
| <u>          郁蓓华          </u> | <u>          郁蓓华          </u> | <u>          钱琨          </u> |
| 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

浦银安盛优化收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2008]1186 号《关于核准浦银安盛优化收益债券型证券投资基金募集的批复》核准,由浦银安盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛优化收益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 771,085,953.03 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司 普华永道中天验字(2008)第 197 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《浦银安盛优化收益债券型证券投资基金基金合同》于 2008 年 12 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 771,272,160.17 份基金份额,其中认购资金利息折合 186,207.14 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人发布的《关于浦银收益增加 C 类收费模式并修改基金合同的公告》、《浦银安盛优化收益债券型证券投资基金基金合同》和《浦银安盛优化收益债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,自 2009 年 9 月 22 日起,本基金根据申购费用、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用的,称为 A 类基金份额;新增不收取前端申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金类别,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛优化收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业(公司)债、可转换债券、资产支持证券等固定收益类金融产品,以及一级市场新股申购、持有可转债转股所得的股票、投资二级市场股票以及权证等中国证监会允许基金投资的非固定收益类金融产品。本基金的投资组合为:固定收益类金融产品占基金资产的比例大于 80%,非固定收益

类金融产品的投资比例合计不超过基金资产的 20%，现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。自基金合同生效日至 2015 年 9 月 16 日，本基金的业绩比较基准为：中信标普全债指数。根据本基金管理人于 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》，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，自 2015 年 9 月 17 日起，本基金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》、《浦银安盛优化收益债券型证券投资基金基金合同》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相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 2017 年 1 月 1 日至 2017 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 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[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

## 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           |
|----------------|-------------------|
| 浦银安盛基金管理有限公司   | 基金管理人、基金销售机构      |
| 中国工商银行股份有限公司   | 基金托管人、基金代销机构      |
| 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 |

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                   | 上年度可比期间              |
|-----------------|----------------------|----------------------|
|                 | 2017年1月1日至2017年6月30日 | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 164,445.67           | 236,915.55           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 47,668.22            | 73,232.72            |

注：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.65% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.65\% / \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2017年1月1日至2017年6月30日 | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 50,598.69            | 72,897.05            |

注：在通常情况下，基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

### 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                   |              |           |
|----------------|----------------------|--------------|-----------|
|                | 2017年1月1日至2017年6月30日 |              |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费     |              |           |
|                | 浦银安盛优化收益债券 A         | 浦银安盛优化收益债券 C | 合计        |
| 浦银安盛基金管理有限公司   | 0.00                 | 11,890.01    | 11,890.01 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 0.00                 | 1,957.25     | 1,957.25  |
| 中国工商银行股份有限公司   | 0.00                 | 3,255.85     | 3,255.85  |
| 合计             | 0.00                 | 17,103.11    | 17,103.11 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间              |              |           |
|                | 2016年1月1日至2016年6月30日 |              |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费     |              |           |
|                | 浦银安盛优化收益债券 A         | 浦银安盛优化收益债券 C | 合计        |
| 浦银安盛基金管理有限公司   | 0.00                 | 1,509.30     | 1,509.30  |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 0.00                 | 2,575.26     | 2,575.26  |
| 中国工商银行股份有限公司   | 0.00                 | 4,237.57     | 4,237.57  |
| 合计             | 0.00                 | 8,322.13     | 8,322.13  |

注：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 0.4% 年费率计提。

计算方法如下： $H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，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付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人分别支付给各基金销售机构。若遇法定节假日、休息日，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

注：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本基金。

#### 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<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |          | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016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    |
| 中国工商银行股份有限公司 | 370,623.23                 | 4,380.15 | 1,880,038.93                    | 10,641.63 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商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（2017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：本基金在本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

截止本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无因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。

##### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，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 10,500,000.00 元，于 2017 年 7 月 3 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 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | -             | -             |
|    | 其中：股票             | -             | -             |
| 2  | 固定收益投资            | 52,440,750.00 | 86.48         |
|    | 其中：债券             | 52,440,750.00 | 86.48         |
|    | 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          | 6,700,000.00  | 11.05         |
|    | 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      | 574,522.14    | 0.95          |
| 7  | 其他各项资产            | 924,142.15    | 1.52          |
| 8  | 合计                | 60,639,414.29 | 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。

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 002241 | 歌尔股份 | 3,603,369.42 | 6.82           |

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 002241 | 歌尔股份 | 3,677,005.50 | 6.96           |

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |              |
|--------------|--------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 3,603,369.42 |
|--------------|--------------|

|              |              |
|--------------|--------------|
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,677,005.50 |
|--------------|--------------|

注：“买入股票的成本”和“卖出股票的收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 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（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 2,497,400.00  | 5.03         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | 34,790,669.40 | 70.04        |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 10,207,180.60 | 20.55        |
| 8  | 同业存单      | 4,945,500.00  | 9.96         |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 52,440,750.00 | 105.58       |

## 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  | 111715184 | 17 民生银行 CD184 | 50,000 | 4,945,500.00 | 9.96         |
| 2  | 113009    | 广汽转债          | 30,000 | 3,709,500.00 | 7.47         |
| 3  | 136351    | 16 永泰 01      | 35,000 | 3,529,750.00 | 7.11         |
| 4  | 124393    | PR 连顺兴        | 40,000 | 3,300,000.00 | 6.64         |
| 5  | 122080    | 11 康美债        | 30,000 | 3,037,500.00 | 6.12         |

## 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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   | 2,126.49   |
| 2 | 应收证券清算款 | -          |
| 3 | 应收股利    | -          |
| 4 | 应收利息    | 908,106.13 |
| 5 | 应收申购款   | 13,909.53  |
| 6 | 其他应收款   | -          |
| 7 | 待摊费用    | -          |
| 8 | 其他      | -          |
| 9 | 合计      | 924,142.15 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|---------------|
| 1  | 113009 | 广汽转债 | 3,709,500.00 | 7.47          |
| 2  | 110032 | 三一转债 | 2,376,000.00 | 4.78          |
| 3  | 128011 | 汽模转债 | 1,806,140.00 | 3.64          |
| 4  | 110034 | 九州转债 | 1,645,150.00 | 3.31          |
| 5  | 128010 | 顺昌转债 | 585,750.00   | 1.18          |

#### 7.12.5 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。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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  |
| 浦银安盛优化 | 1,314    | 14,867.98 | 0.00  | 0.00%  | 19,536,524.96 | 100.00% |

|              |       |           |              |        |               |        |
|--------------|-------|-----------|--------------|--------|---------------|--------|
| 收益债券 A       |       |           |              |        |               |        |
| 浦银安盛优化收益债券 C | 323   | 37,623.02 | 6,578,947.37 | 54.14% | 5,573,288.49  | 45.86% |
| 合计           | 1,637 | 19,357.83 | 6,578,947.37 | 20.76% | 25,109,813.45 | 79.24% |

### 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 | 浦银安盛优化收益债券 A | 322.19    | 0.00%    |
|                  | 浦银安盛优化收益债券 C | 29,526.30 | 0.24%    |
|                  | 合计           | 29,848.49 | 0.09%    |

### 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 | 浦银安盛优化收益债券 A | 0                 |
|                                | 浦银安盛优化收益债券 C | 0                 |
|                                | 合计           | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 浦银安盛优化收益债券 A | 0                 |
|                                | 浦银安盛优化收益债券 C | 0                 |
|                                | 合计           | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                              | 浦银安盛优化收益债券 A      | 浦银安盛优化收益债券 C     |
|---------------------------------|-------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2008 年 12 月 30 日）基金份额总额 | 771, 272, 160. 17 | -                |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 27, 210, 036. 84  | 6, 905, 638. 01  |
| 本报告期基金总申购份额                     | 1, 082, 647. 80   | 8, 976, 348. 95  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 8, 756, 159. 68   | 3, 729, 751. 10  |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）        | -                 | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 19, 536, 524. 96  | 12, 152, 235. 86 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 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、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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

### 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      | 3,677,005.50 | 100.00%      | 3,424.42  | 100.00%    | -  |
| 中国银河证券   | 1      | -            | -            | -         | -          | -  |
| 兴业证券     | 1      | -            | -            | -         | -          | -  |
| 国金证券     | 2      | -            | -            | -         | -          | -  |
| 浙商证券     | 1      | -            | -            | -         | -          | -  |
| 方正证券     | 2      | -            | -            | -         | -          | -  |
| 德邦证券     | 1      | -            | -            | -         | -          | -  |
| 中国中投     | 1      | -            | -            | -         | -          | -  |
| 招商证券     | 1      | -            | -            | -         | -          | -  |
| 民族证券     | 1      | -            | -            | -         | -          | -  |
| 民生证券     | 1      | -            | -            | -         | -          | -  |
| 光大证券     | 1      | -            | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券     | 2      | -            | -            | -         | -          | -  |
| 国信证券     | 1      | -            | -            | -         | -          | -  |
| 中信建投     | 1      | -            | -            | -         | -          | -  |
| 安信证券     | 2      | -            | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券（山东） | 1      | -            | -            | -         | -          | -  |
| 申万宏源     | 1      | -            | -            | -         | -          | -  |
| 中泰证券     | 2      | -            | -            | -         | -          | -  |
| 东方证券     | 1      | -            | -            | -         | -          | -  |
| 国泰君安     | 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   | 4,809,333.42 | 15.91%       | -      | -              | -    | -            |
| 中国银河证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 兴业证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国金证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 浙商证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 方正证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 德邦证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中国中投   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 招商证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 民族证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 民生证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 光大证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中信证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国信证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中信建投   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |



|          |               |        |                |         |   |   |
|----------|---------------|--------|----------------|---------|---|---|
| 安信证券     | -             | -      | -              | -       | - | - |
| 中信证券（山东） | -             | -      | -              | -       | - | - |
| 申万宏源     | -             | -      | -              | -       | - | - |
| 中泰证券     | -             | -      | -              | -       | - | - |
| 东方证券     | -             | -      | -              | -       | - | - |
| 国泰君安     | 25,411,968.36 | 84.09% | 304,600,000.00 | 100.00% | - | - |

## § 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              | 20170426-20170518, 20170525-20170630 | 0.00 | 6,578,947.37 | 0.00 | 6,578,947.37 | 20.76% |
| 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、因浦银安盛基金管理有限公司（以下简称“公司”）第三届董事会任期届满，根据《公司章程》的规定，经公司 2017 年第一次股东会会议审议通过，选举产生公司第四届董

事会成员，共 11 名董事。详见本基金管理人于 2017 年 3 月 23 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于董事会换届的公告》。

2、2017 年 4 月 26 日，谢伟先生担任浦银安盛基金管理有限公司董事长，详见本公司于 2017 年 4 月 28 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》。

浦银安盛基金管理有限公司  
2017 年 8 月 28 日