

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 2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 10 月 28 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 27 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 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛上清所优选短融	
基金主代码	007064	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 7 月 18 日	
报告期末基金份额总额	486,179,577.34 份	
投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。	
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用抽样复制法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建投资组合，并根据本基金资产规模、日常申赎情况、市场流动性以及债券特性、交易惯例等情况，进行优化，选择合适的债券进行投资，以实现对标的指数的有效跟踪。	
业绩比较基准	上海清算所高等级优选短期融资券指数收益率 $\times 95\%$ + 银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$	
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛上清所优选短融 A	浦银安盛上清所优选短融 C
下属分级基金的交易代码	007064	007065
报告期末下属分级基金的份额总额	481,889,862.61 份	4,289,714.73 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（2020年7月1日—2020年9月30日）	
	浦银安盛上清所优选短融 A	浦银安盛上清所优选短融 C
1. 本期已实现收益	1,566,961.10	357.01
2. 本期利润	2,112,221.53	1,311.44
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0044	0.0180
4. 期末基金资产净值	496,653,552.49	4,409,509.40
5. 期末基金份额净值	1.0306	1.0279

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

浦银安盛上清所优选短融 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	0.43%	0.01%	-0.01%	0.01%	0.44%	0.00%
过去六个月	0.74%	0.02%	-0.24%	0.01%	0.98%	0.01%
过去一年	2.54%	0.02%	0.04%	0.02%	2.50%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.06%	0.02%	0.01%	0.02%	3.05%	0.00%

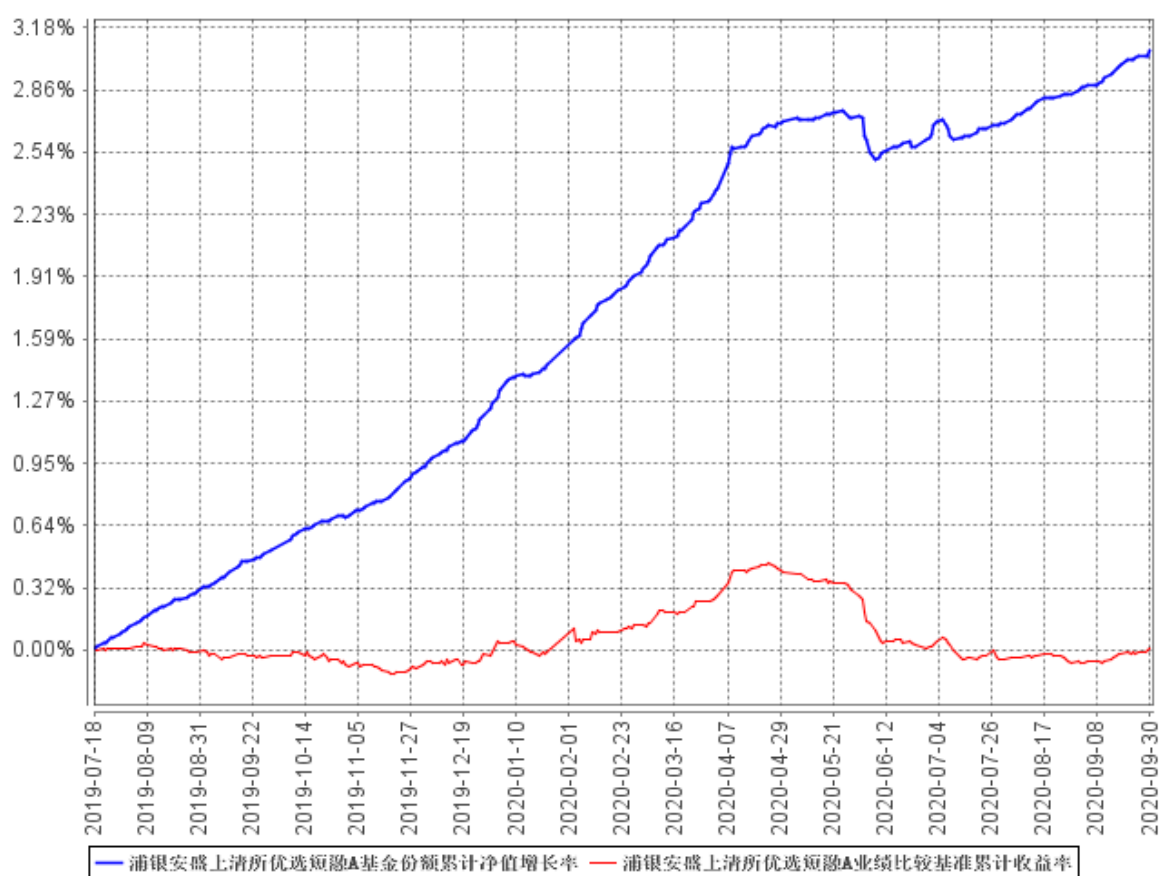
浦银安盛上清所优选短融 C

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
过去三个月	0.37%	0.01%	-0.01%	0.01%	0.38%	0.00%

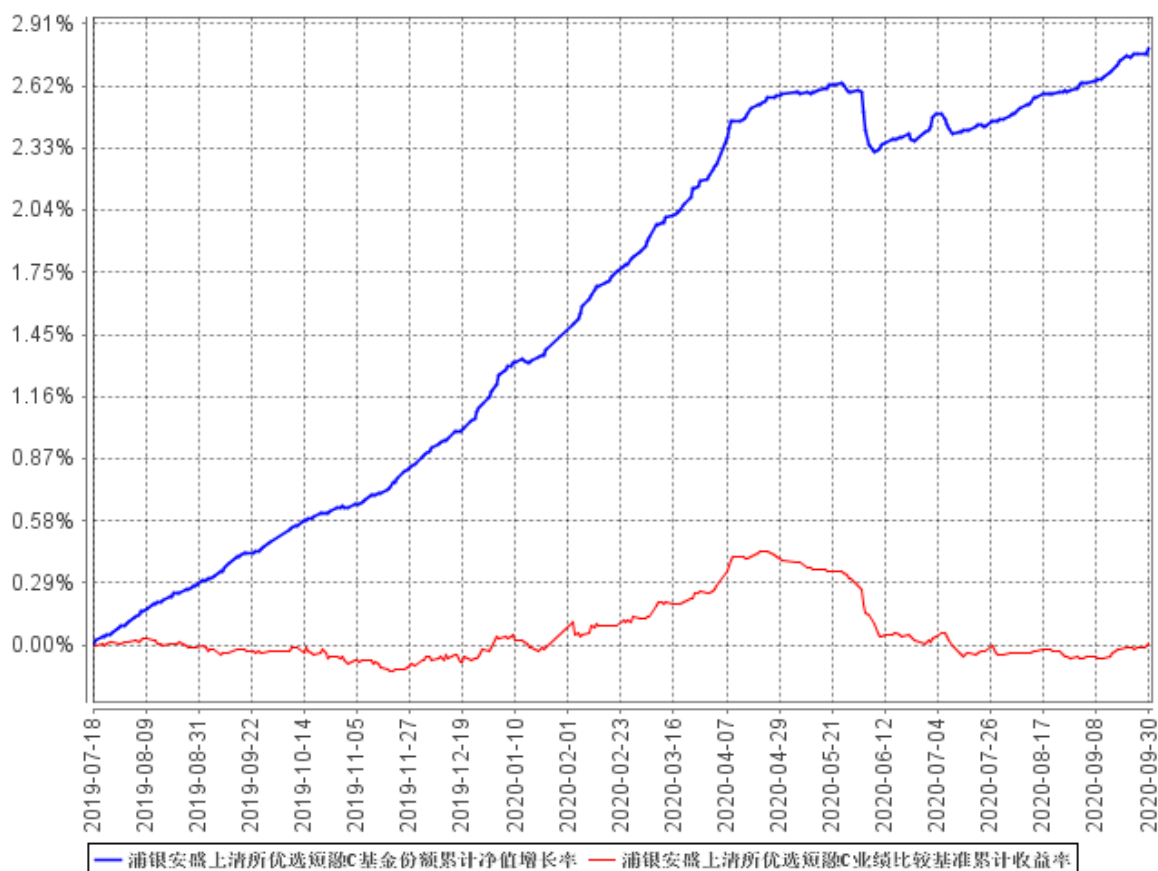
过去六个月	0.58%	0.02%	-0.24%	0.01%	0.82%	0.01%
过去一年	2.30%	0.02%	0.04%	0.02%	2.26%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.79%	0.02%	0.01%	0.02%	2.78%	0.00%

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变动的比较

浦银安盛上清所优选短融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



浦银安盛上清所优选短融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：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 2019 年 7 月 18 日至 2020 年 1 月 17 日。建仓期结束时符合相关规定。

§ 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		
刘大巍	公司旗下部分基金的基金经理。	2019年7月18日	-	10	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

				<p>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 11 月至 2019 年 11 月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。2019 年 3 月至 2020 年 6 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 (原浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金) 的基金经理。2019 年 5 月至 2020 年 6 月担任浦银安盛双债增强债券型证券投资基金基金经理。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 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以及浦银安盛中短债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。</p>
--	--	--	--	--

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。

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，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，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 报告期内基金投资策略和运作分析

7 月开始，我们认为本次基本面好转的趋势还会延续至少 2 个季度，前期过于宽松的货币政策还有调整的空间，整体上仍不利于债券市场，因此 7 月开始就逐步降低了组合的相对仓位和久

期，该策略贯穿了整个三季度，期间由于各期限债券均有较大幅度调整，组合净值随市场调整先跌后涨，整体受市场冲击不大。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛上清所优选短融 A 基金份额净值为 1.0306 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.43%；截至本报告期末浦银安盛上清所优选短融 C 基金份额净值为 1.0279 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.37%；同期业绩比较基准收益率为-0.01%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	541,950,700.00	97.89
	其中：债券	541,950,700.00	97.89
	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	9,300,133.95	1.68
	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	75,363.45	0.01
8	其他资产	2,283,665.12	0.41
9	合计	553,609,862.52	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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,982,000.00	5.98
	其中：政策性金融债	29,982,000.00	5.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	511,968,700.00	102.18
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	541,950,700.00	108.16

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	012003187	20 浙能源 SCP013	400,000	40,020,000.00	7.99
2	012002271	20 粤海 SCP003	400,000	39,928,000.00	7.97
3	012002104	20 越秀集团 SCP005	400,000	39,924,000.00	7.97
4	042000239	20 长电 CP001	400,000	39,696,000.00	7.92
5	042000262	20 电网 CP005	400,000	39,612,000.00	7.91

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受到调查以及处罚的情况的说明**

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除国家开发银行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。

2020 年 4 月 24 日，国家开发银行公告，因未依法履行其他职责，分支行高管王庆丰被中国银行保险监督管理委员会海南监管局于 2020-04-20 依据相关法规给予：公开批评处分决定。

本基金管理人的研究部门对国家开发银行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。

5.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中不存在超出基金合同规定的备选股票库范围的情况。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,283,665.12

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,283,665.12

5.10.4 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。

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：本基金本报告期末未持有股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银安盛上清所优选短融 A	浦银安盛上清所优选短融 C
报告期期初基金份额总额	517,590,978.37	14,586.29
报告期期间基金总申购份额	63,184,419.10	4,480,470.02
减：报告期期间基金总赎回份额	98,885,534.86	205,341.58
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	481,889,862.61	4,289,714.73

§ 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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	48,704,948.61
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	48,704,948.61
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	10.02

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：1、截至本报告期末，本基金管理人持有浦银上清所优选短融 A 48,704,461.33 份，持有浦银上清所优选短融 C 487.28 份。

2、基金管理人固有资金投资本基金费用按照本基金法律文件约定收取。

§ 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	2020 年 07 月 01 日-2020 年 09 月 30 日	249,999,000.00	0.00	0.00	249,999,000.00	51.42%
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。							

§ 9 备查文件目录

9.1 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合同
- 3、 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招募说明书
- 4、 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报刊上披露的各项公告
- 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）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

2020 年 10 月 28 日