

浦银安盛 6 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书更新

(摘要) 2016 年第 2 号

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

内容截止日：2016 年 11 月 16 日

重要提示

基金募集申请核准文件名称：《关于核准浦银安盛 6 个月定期开放债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2012]1764 号）

核准日期：2012 年 12 月 28 日

成立日期：2013 年 05 月 16 日

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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

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。投资者在投资本基金前，需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，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

本基金以定期开放方式运作，其封闭期为自《基金合同》生效之日起（包括《基金合同》生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）6 个月的期间。封闭期结束之后第一个工作日起进入为期 5 个工作日的开放期，投资者可以办理本基金的申购业务，在本基金的开放期的第 1 个工作日和第 2 个工作日，投资者可以进行赎回业务的办理。

投资有风险，投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

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。本招募说明书所载内容截止日为2016年11月16日，有关财务数据和净值表现截止日2016年9月30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	12
四、基金的名称	27
五、基金的类型	27
六、基金的投资目标	27
七、基金的投资范围	27
八、基金的投资策略	28
九、投资决策依据和决策程序	30
十、业绩比较基准	33
十一、风险收益特征	33
十二、基金的投资组合报告	33
十三、基金业绩	37
十四、基金的费用与税收	39
十五、对招募说明书更新部分的说明	41

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：姜明生

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

联系人：徐薇

（二）主要人员情况

1、董事会成员

姜明生先生，董事长，本科学历。历任中国工商银行总行信托投资公司业务一部副总经理；招商银行总行信托投资部副总经理；招商银行北京分行行长助理；招商银行广州分行副行长（主持工作）；招商银行总行公司银行部总经理；招商银行上海分行党委书记、副行长（主持工作）；招商银行上海分行党委书记、行长。2007 年 4 月加入上海浦东发展银行，任总行党委委员。2007 年 9 月起任上海浦东发展银行总行副行长，2007 年 10 月至 2013 年 3 月兼任上海浦东发展银行上海分行党委书记、行长，现兼任中国银联董事。2016 年 6 月起兼任上海浦东发展银行董事。自 2009 年 11 月起兼任本公司董事长。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执行董事。

Bruno Guilloton 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 Foch Saint Cloud Versailles Sci 及 Fuji Oak Hills 公司董事。自 2009 年 3 月起兼任本公司副董事长。

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。

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。

郁蓓华女士，董事，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总经理。

汪素南先生，董事。浙江大学计算机专业博士，高级工程师、国际注册内审师。1996年10月加盟浦发银行宁波分行，历任发展研究部、电脑部、分行营业部总经理。2003年10月调任至浦发银行总行，历任审计部执行审计官、首席审计官助理、中小企业业务经营中心总经理。2014年1月至今担任浦发银行总行零售业务总监。2014年3月起兼任浦发银行总行小企业金融服务中心总经理。自2014年4月起兼任本公司董事。

金杰先生，董事。上海财经大学工商管理硕士。曾先后就职于上海三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，现任上海国盛集团资产管理有限公司资产管理部总经理。自2014年9月起兼任本公司董事。

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，担任本公司独立董事。

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。

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。现任同济大学经济与管理学院教授、院长，同济大学中德学院教席教授。自 2014 年 4 月起兼任本公司独立董事。

2、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 增强型指数证券投资基金基金经理，2012 年 5 月 14 日起兼任浦银安盛中证锐联基

本面 400 指数证券投资基金基金经理。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，现任本公司市场策划部经理。自 2013 年 3 月起，兼任本公司职工监事。

3、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总经理。

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。

4、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 月起担任公司旗下浦银安盛稳健增利（LOF）债券基金、浦银安盛季季添利债券基金及本基金的基金经理。

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 月起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 月起兼任浦银安盛幸福回报债券基金基金经理。2012 年 11 月起，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 月起，兼任浦银安盛优化收益债券基金基金经理。2014 年 12 月起，兼任浦银安盛月月盈债券基金基金经理。2016 年 5 月起，兼任浦银安盛幸福聚利债券基金基金经理。2016 年 7 月起，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 月起，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。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。

5、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。

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及浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金基金经理并兼任本公司职工监事。

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、浦银安盛战略新兴产业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以及浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

薛铮先生，本公司固定收益投资部总监，公司旗下浦银安盛优化收益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）、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金、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。

黄列先生，本公司研究部总监。

蒋建伟先生，本公司权益投资部副总监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。

顾佳女士，本公司合规风控部总经理。

督察长、其他基金经理及基金经理助理列席投资决策委员会会议。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2016年6月30日，本集团总资产5.5373万亿元人民币，高级法下资本充足率13.91%，权重法下资本充足率13.90%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室，现有员工60人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管

银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

经过十四年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2016 年招商银行加大高收益托管产品营销力度，截至 9 月末新增托管公募开放式基金 62 只，新增首发公募开放式基金托管规模 456.94 亿元。克服国内证券市场震荡的不利形势，托管费收入、托管资产均创出历史新高，实现托管费收入 36.29 亿元，同比增长 30.06%，托管资产余额 9.42 万亿元，同比增长 59.41%。作为公益慈善基金的首个独立第三方托管人，成功签约“壹基金”公益资金托管，为我国公益慈善资金监管、信息披露进行有益探索，该项目荣获 2012 中国金融品牌「金象奖」“十大公益项目”奖；四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016 年 6 月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获奖项国内托管银行，该行“托管通”获得国内《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7 月荣膺 2016 年中国资产管理【金贝奖】“最佳资产托管银行”。

（三）主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014 年 7 月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013 年 5 月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于 2003 年 7 月至 2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

丁伟先生，本行副行长。大学本科毕业，副研究员。1996 年 12 月加入本行，历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理，杭州分行行长助理、副行长，南昌支行行长，南昌分行行长，总行人力资源部总经理，总行行长助理，2008 年 4 月起任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

（四）基金托管业务经营情况

截至2016年9月30日，招商银行股份有限公司累计托管213只开放式基金及其它托管资产，托管资产为9.42万亿元人民币。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

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：徐薇

网址：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

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、场外代销机构

（1）招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

客户服务热线：95555

网址：www.cmbchina.com

(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：吉晓辉

客户服务热线：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

(3) 交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

客服电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

(4) 中信银行股份有限公司

住所：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

(5) 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

(6) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

客服电话：95523 或 4008895523

网址: www.swhysc.com

(7) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区商城路 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

客服电话: 400-8888-666

网址: www.gtja.com

(8) 海通证券股份有限公司

注册地址: 上海市广东路 689 号海通证券大厦

办公地址: 上海市广东路 689 号 1001A 室

法定代表人: 翟秋平

客户服务电话: 021-95553 或 4008888001

网址: www.htsec.com

(9) 兴业证券股份有限公司

注册地址: 福州市湖东路 268 号

法定代表人: 兰荣

客户服务电话: 95562

网址: www.xyzq.com.cn

(10) 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

客户服务电话: 95597

网址: www.htsc.com.cn

(11) 中信证券股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址: 北京市朝阳区亮马桥 48 号中信证券大厦

法定代表人: 张佑君

客户服务热线: 95548

网址: www.cs.ecitic.com

(12) 中信建投证券有限责任公司

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

客户服务电话：400-8888-108

公司网址：www.csc108.com

（13）上海证券有限责任公司

地址：上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼法定代表人：龚德雄

客户服务电话：962518

网址：www.962518.com

（14）安信证券股份有限公司

地址：深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

客服电话：4008001001

网址：www.essence.com.cn

（15）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

客服电话：95525

网址：www.ebscn.com

（16）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

客服热线：95321

网址：www.cindasc.com

（17）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

客服热线：0591-96326 或 400-88-96326

网址：www.hfzq.com.cn

（18）天相投资顾问有限公司

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

客户咨询电话：010-66045678

网址：www.txsec.com

天相基金网网址：www.jjm.com.cn

（19）中航证券有限公司

办公地址：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

客服电话：400-8866-567

网址：www.avicsec.com

（20）渤海证券股份有限公司

住所：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：杜庆平

客服电话：4006515988

网址：www.bhzq.com

（21）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 室

法定代表人：李玮

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

（22）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

（23）中信证券（山东）有限责任公司

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 20 层

法定代表人：杨宝林

客户服务电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

（24）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发展大楼 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

（25）国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：广西南宁市湖滨路 46 号国海大厦

法定代表人：张雅锋

客户服务电话：95563

公司网址：www.ghzq.com.cn

(26) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：4000-766-123

网址：www.fund123.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：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

(28) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

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

(29) 招商证券股份有限公司

地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

客户服务热线：95565

公司网址：www.newone.com.cn

(30) 北京展恒基金销售股份有限公司

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

服务热线：400-888-6661

网址：www.myfp.cn

(31) 上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

服务热线：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

（32）众升财富（北京）基金销售有限公司

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 04-08 法定代表人：李招弟

服务热线：400-059-8888

网址：www.zscffund.com

（33）北京增财基金销售有限公司

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

法定代表人：罗细安

服务热线：400-001-8811

网址：www.zcvc.com.cn

（34）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

（35）和讯信息科技有限公司

办公地址：上海市浦东新区东方路 18 号保利大厦 18 楼

法定代表人：王莉

服务热线：400-920-0022

网址：licaik.hexun.com

（36）东北证券股份有限公司

地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：李福春

服务热线：400-600-0686

网址：www.nesc.cn

（37）广州证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：邱三发

服务热线：020-961303

网址：www.gzs.com.cn

(38) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址: 北京市经济技术开发区宏达北路 10 号 5 层 5122 室

办公地址: 北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人: 梁越

服务热线: 4008-980-618

网址: www.chtfund.com

(39) 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

(40) 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

(41) 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

(42) 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

(43) 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

（44）中国国际金融有限公司

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

（45）兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

法定代表人：高建平

服务热线：95561

网址：www.cib.com.cn

（46）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

（47）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：冯修敏

客服电话：400-820-2819

公司网站：<https://tty.chinapnr.com>

（48）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：沈继伟

客服电话：400-067-6266

公司网站：www.leadbank.com.cn

（49）大泰金石投资管理有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室

办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

客服电话：021-22267995

公司网站：www.dtfunds.com

50) 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

(51) 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

(52) 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

(53) 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：郭坚

客服电话：4008219031

公司网站：www.lufunds.com

(54) 北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼1603

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：董浩

客服电话：400-068-1176

公司网站：www.jimufund.com

(55) 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.cn www.jjmmw.com

(56) 深圳富济财富管理有限公司

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

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：齐小贺

客服电话：0755-83999907

公司网站：www.jinqianwo.cn

(57) 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（入驻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：TAN YIK KUAN

客服电话：400-684-0500

公司网站：www.ifastps.com.cn

(58) 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：4000-466-788

公司网站：www.66zichan.com

(59) 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：杨懿

客服电话：400-166-1188

公司网站：8.jrj.com.cn

(60) 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

(61) 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

(62) 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/>

(63) 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：谢永林
客服电话：95511-8
公司网站：www.stock.pingan.com

(64) 上海银行股份有限公司

地址：上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人：金煜
客服电话：95594
网址：www.bankofshanghai.com

3、场内代销机构

投资者可通过“上证基金通”办理本基金A类份额（基金代码：519121）和C类份额（基金代码：519122）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。

(五) 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

(六) 出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：国浩律师（上海）事务所

办公地址：上海市静安区北京西路 968 号嘉地中心 23-25 层

负责人：黄宁宁

电话：021-52341668

传真：021-52341670

联系人：孙芳尘

经办律师：宣伟华、孙芳尘

(七) 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：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

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

(八) 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

供应商的产品建设而成，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

浦银安盛 6 个月定期开放债券型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

在控制风险的基础上，追求超过业绩比较基准的当期收入和投资总回报，为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、可转换债券、公司债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、可分离交易可转债、质押及买断式回购、协议存款、定期存款、通知存款、资产支持证券等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购或增发新股。本基金可持有因可转债转股所形成的股票、以及因投资可分离债券而产生的权证。因上述原因持有的股票和权证等资产，其比例不得超过基金资产的 20%。本基金各类资产的投资比例为：本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，但在每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产的 5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

八、基金的投资策略

（一）资产配置策略

在封闭期内，本基金采取灵活的券种配置策略，兼顾产品流动性，追求稳健收益。本基金主要投资于银行定期存款及大额存单、债券回购和短期债券（包括短期融资券、即将到期的中期票据等）。每个封闭期初，将根据收益率、市场流动性、信用风险利差等因素，对回购利率与短债收益率、协议存款利率等进行比较，并在对封闭期资金面进行判断的基础上，判断是否存在利差套利空间，以确定是否进行杠杆操作；确定优先配置的资产类别，并结合各类货币市场工具的市场容量，确定配置比例。

（九）久期匹配策略

买入并持有策略是对所投资固定收益品种的剩余期限与基金的剩余封闭期进行期限匹配，主要投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具。

（十）杠杆投资策略

本基金将在考虑债券投资的风险收益情况，以及回购成本等因素的情况下，在风险可控以及法律法规允许的范围内，通过债券回购，放大杠杆进行投资操作。

为控制风险，本基金的杠杆比例会结合市场环境有所调整，在回购利率过高、流动性不足、或者市场状况不宜采用放大策略等情况下，基金管理人可以调整杠杆比例或者不进行杠杆放大。

本基金将在封闭期内进行杠杆投资，杠杆放大部分仍主要投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，并采取买入并持有到期的策略。同时采取滚动回购的方式来维持杠杆，因此负债的资金成本存在一定的波动性。

（十一）银行定期存款及大额存单投资策略

封闭期初，本基金综合考虑各种因素，可以对银行进行银行定期存款和大额存单的投资。

（十二）债券回购投资策略

首先，基于对封闭运作期内资金面走势的判断，确定回购期限的选择。在组合进行杠杆操作时，若判断资金面趋于宽松，则在运作初期进行短期限正回购操作；反之，则进行长期限正回购操作，锁定融资成本。若期初资产配置有逆回购比例，则在判断资金面趋于宽松的情况下，优先进行长期限逆回购配置；反之，则进行短期限逆回购操作。其次，本基金在每个封闭运作期内，根据资金头寸，安排相应期限的回购操作。

（十三）短期信用债券投资策略

基金管理人将对市场公开发行的所有短期融资券、中期票据等信用债券进行深入

的研究和分析，在每个基金封闭运作期，基金管理人根据剩余期限、信用评级进行筛选，形成本基金的债券库；根据各短期信用债的到期收益率、剩余期限与运作周期的匹配程度，挑选适当的债券进行配置。

（十四）流动性管理策略

将持有债券的组合久期与封闭期进行适当的匹配。

（十五）中小企业私募债投资策略

中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。中小企业私募债不强制第三方评级。基金管理人通过内部信用分析系统，分析发债主体的信用水平及个债增信措施，量化比较判断估值，精选个债，谋求避险增收。信用分析系统分为行业、企业盈利水平、负债水平、担保增信四大子模块，对中小企业私募债的发行人所处行业，所在行业地位，持续盈利能力，未来负债偿债能力，债券增信措施进行量化评价，同时结合企业实地调研，上下游尽职调查等基本面考察，对债券风险收益进行综合评定。

（十六）基金开放期投资策略

本基金在每次开放日面临的主要问题是大规模的赎回或者申购，对基金的影响分别为高流动性风险和收益率摊薄，本基金将结合开放日前的流动性预评估方案来应对其影响，平稳度过开放日：在基金规模减少、现金流出增多的情况下，通过正回购、卖出债券、支取定期存款等方式增加现金比例，主动提升组合的流动性；在基金规模上升、现金流入增多的情况下，通过逆回购、投资债券等多种积极的资产增值方式，力求使投资人获得相对稳定的收益。

（十七）可转债投资策略

本基金投资于可转债，主要目标是降低基金净值的下行风险，基金投资的可转债可以转股，以保留分享股票升值的收益潜力。

（1）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。本基金将采取积极管理策略，重视对可转债对应股票的分析与研究，选择那些公司行业景气趋势回升、成长性好、估值水平偏低或合理的转债进行投资，以获取收益。

（2）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。

九、投资决策依据和决策程序

为了保证整个投资组合计划的顺利贯彻实施，本基金遵循以下投资决策依据以及具体的决策程序：

（一）投资决策依据

- 1、国家有关法律法规和本《基金合同》的有关规定；
- 2、宏观经济发展态势、资本市场运行环境和走势，固定收益品种发展趋势以及上市公司的基本面，本基金将在对上述方面进行深入研究的基础上进行投资；
- 3、投资对象的预期收益和预期风险的匹配关系，本基金将在承担适度风险的范围内，选择收益风险配比最佳的品种进行投资。

（二）决策程序

本基金采用以基金经理为核心的投资决策和协调机制。投资决策委员会定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、研究员、交易员在投资管理过程中既密切合作，又责任明确，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。投资管理流程分为投资研究、投资决策、投资执行、投资跟踪与反馈、投资核对与监督、风险控制六个环节，具体如下：

1、投资研究

为保障基金持有人的权益，在投资研究过程中，将定期召开投资决策委员会会议、投资研究联席会议、基金经理会议等会议，为投资决策提供准确的依据。

投资决策委员会会议每月召开一次（如市场波动剧烈及其它特殊情况下可开特例会）。主要就目前宏观经济、金融形势与展望、货币政策方向及利率水准等总体经济数据现状进行分析讨论，对债券市场未来的趋势进行判断，作为拟订投资策略之参考；就基金经理提交的《债券投资策略报告》进行讨论，审定基金在一段时期内的资产配置和久期配置方案。

基金经理和研究部、金融工程部定期召开的投资研究联席会议，对宏观经济、证券市场、债券、上市公司及权证等研究对象进行交流讨论，并提出近期或重点研究计划。研究部根据自身研究计划，结合联席会议讨论结果制定《研究计划表》，开展系统性和针对性相结合的研究；金融工程部对基金投资风险及业绩进行定时分析，向基金经理和首席投资官汇报。

2、投资决策

基金经理根据国内外经济形势、市场走势及投资研究联席会议的讨论结果拟定《债券投资策略报告》，阐述基金的投资策略，并明确下一阶段资产配置、久期配置与类属配置。《债券投资策略报告》报投资决策委员会讨论。

对于超出基金经理投资权限的投资项目，基金经理按照公司投资授权方案的规定报首席投资官审批。需由投资决策委员会审批的项目，基金经理需制订《重大投

投资项目建议书》，并附有关研究报告，提交投资决策委员会讨论。

投资决策委员会审议基金经理提交的《债券投资策略报告》、《重大投资项目建议书》，经投资决策委员会成员讨论修改，并签字确认后形成投资决议。其它一般投资决定，由基金经理在授权范围内制作投资决定书，作为操作指令的基础，并作为书面备案。

基金经理对其所管理的基金进行投资组合管理，并对其投资组合负责。

3、投资执行

基金所有的交易行为都通过集中交易室统一执行。在首席运营官的领导下，一切交易在交易资讯保密的前提下，依公司程序运作。

基金经理根据《债券投资策略报告》和投资组合方案制定《债券投资决定书》，在其权限范围内向集中交易部下达交易命令；集中交易部交易主管复核交易指令无误后，分解交易指令并下达到集中交易部分配给交易员执行；集中交易部交易员执行交易指令并就交易状况进行反馈。

4、投资跟踪与反馈

首席投资官负责定期召开基金经理会议。各基金经理相互交流研究成果，对市场资金面状况、各类属债券的趋势以及基金表现进行充分的交流和沟通，金融工程部参与并提供量化分析数据，及为投资部提供优化建议。

投资部、研究部和金融工程部定期召开投资研究联席会议，以及月度、季度和年度投资总结会议。

基金经理每月向首席投资官提交所管理基金的《债券投资总结报告》。并在相关会议上根据金融工程人员提供的数据对其投资组合的近期表现和市场表现进行分析，对基金表现与业绩基准、相类似基金的表现差异说明原因，并对投资过程中的不足提出改进意见。

基金经理根据市场情况的变化，认为有必要修改资产配置方案、久期配置方案和重大投资项目方案的，应先起草《债券投资策略报告》或《重大投资项目建议书》，经批准后报投资决策委员会讨论决定。

5、投资核对与监督

基金交易清算员通过交易数据的核对，对当日交易操作进行复核，如发现违反《证券法》、《基金法》、《基金合同》、公司相关管理制度的交易操作，须立刻向首席投资官和首席运营官汇报，并同时通报合规风控部、相关基金经理、集中交易部。集中交易部负责对基金投资的日常交易行为进行实时监控。

6、风险控制

基金投资管理过程中的风险控制包括两个层次，一个层面是由部门内部金融工程

人员，通过对基金组合进行初步的合规合法分析，并对投资绩效与业绩基准及市场相类似基金比较，提出投资风险评估分析报告；另一个层面是外部独立的风险管理机构（包括风险控制委员会、督察长、合规风控部）对投资管理过程的风险监控。

十、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：6 个月定期存款利率（税后）。

本基金的业绩比较基准将在每一封闭期的第一个工作日，根据中国人民银行公布的金融机构人民币利率进行最新调整。

本基金作为 6 个月定期开放债券基金，自基金合同成立后每隔 6 个月开放一次。因此，本基金业绩比较基准设置为 6 个月定期存款利率（税后）是合乎本基金的运作特征的。

如果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比较基准时，本基金管理人可以在与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后变更本基金业绩比较基准并及时公告，而无需基金份额持有人大会审议。

十一、风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

十二、基金的投资组合报告

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——招商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 2016 年 09 月 30 日（财务数据未经审计）。

（一）报告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 基金投资 --

3 固定收益投资 75,299,217.76 96.03

其中：债券 75,299,217.76 96.03

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 --

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 1,198,455.25 1.53

8 其他资产 1,915,435.99 2.44

9 合计 78,413,109.00 100.00

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

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。

(三) 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。

(四) 报告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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 1,410,370.00 2.07

2 央行票据 --

3 金融债券 8,408,400.00 12.34

其中：政策性金融债 --

4 企业债券 50,761,592.25 74.50

5 企业短期融资券 5,001,000.00 7.34

6 中期票据 --

7 可转债(可交换债) 4,694,951.40 6.89

8 同业存单 --

9 其他 5,022,904.11 7.37

10 合计 75,299,217.76 110.51

(五) 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

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 136139 16 国美 01 60,000 6,078,000.00 8.92
- 2 1580009 15 本溪债 50,000 5,387,500.00 7.91
- 3 122355 14 齐鲁债 50,000 5,290,500.00 7.76
- 4 1580313 15 汨罗城投债 50,000 5,289,500.00 7.76
- 5 122702 PR 海安债 100,000 5,274,000.00 7.74

(六) 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七) 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。

(八) 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。

(九) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

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。

(十) 投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券的发行主体不存在本期被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

2、报告期内，本基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定备选股票库投资的情况。

3、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 3,436.85

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 1,911,999.14

- 5 应收申购款 -
- 6 其他应收款 -
- 7 待摊费用 -
- 8 其他 -
- 9 合计 1,915,435.99

4、报告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	128009	歌尔转债	2,534,016.00	3.72
2	113009	广汽转债	1,542,110.40	2.26
3	128011	汽模转债	417,060.00	0.61
4	128010	顺昌转债	201,765.00	0.30

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

截至本报告期末本基金持有中小企业私募债余额为 5,022,904.11 元，明细如下：

金额单位：元

债券代码 债券名称 票面利率(%) 数量(张) 期末估值总额

125400	14 铜水务	9.50	50,000	5,022,904.11
--------	--------	------	--------	--------------

十三、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。

（一）浦银 6 个月 A 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 净值增长率值① 净值增长率标准差率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

2013/05/16-2013/12/31 -4.90% 0.30% 1.76% 0.01% -6.66% 0.29%

2014/01/01-2014/12/31 10.62% 0.16% 2.81% 0.01% 7.81% 0.15%
2015/01/01-2015/12/31 8.65% 0.46% 1.94% 0.01% 6.71% 0.45%
2016/01/01-2016/09/30 3.74% 0.09% 0.98% 0.00% 2.76% 0.09%
2013/05/16-2016/09/30 18.58% 0.30% 7.71% 0.01% 10.87% 0.29%

浦银6个月C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 净值增长率值① 净值增长率标准差率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 -④

2013/05/16-2013/12/31 -5.10% 0.30% 1.76% 0.01% -6.86% 0.29%
2014/01/01-2014/12/31 10.43% 0.15% 2.81% 0.01% 7.62% 0.14%
2015/01/01-2015/12/31 8.40% 0.46% 1.94% 0.01% 6.46% 0.45%
2016/01/01-2016/09/30 3.56% 0.09% 0.98% 0.00% 2.58% 0.09%
2013/05/16-2016/09/30 17.65% 0.30% 7.71% 0.01% 9.94% 0.29%

(二) 浦银6个月A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

2013年5月16日至2016年9月30日

浦银6个月C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日

2013年5月16日至2016年9月30日

十四、基金的费用与税收

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；

9、基金开户费和银行账户维护费；

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

(十八) 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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6%年费率计提。

$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人复核后于次月前 5 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、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的基金托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20 %的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$

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，基金托管人复核后于次月前 5 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、基金销售服务费

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年费率为 0.25%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25%年费率计提。

计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

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

销售服务费每日计提，按月支付。

由基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中划出，由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

4、上述“一、基金费用的种类”中第4—10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或摊入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

(十九) 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》生效前的律师费、会计师费和信息披露费用等相关费用；
- 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。

(二十) 基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费、基金托管费和销售服务费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施前依照《信息披露办法》的相关规定在至少一家指定媒体上公告。

(二十一) 基金税收

基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务根据国家税收法律、法规执行。

十五、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、在“重要提示”部分，更新了部分内容；
- 2、在“第三部分 基金管理人”部分，对主要人员情况进行了更新；
- 3、在“第四部分基金托管人”部分，对基金托管人概况和基金托管业务经营情况进行了更新；
- 4、在“第五部分 相关服务机构”部分，对基金份额发售机构、注册登记机构、出具法律意见书的律师事务所和经办律师及审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师部分内容进行了更新；
- 5、在“第九部分 基金份额的申购与赎回”部分，对基金的转换部分内容进行了更新；
- 6、在“第十部分 基金的投资”部分，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截至2016年9月30日的投资业绩；
- 7、在“第二十一部分 对基金份额持有人的服务”部分，更新了电子化服务部分

内容：

8、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 5 月 17 日至 2016 年 11 月 16 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

二〇一六年十二月二十九日