

浦银安盛普嘉 87 个月定期开放债券型证券  
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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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       | 浦银安盛普嘉 87 个月定开债券  |
| 基金主代码      | 009632  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2020 年 6 月 24 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 7,990,000,427.82 份  |
| 投资目标       | 本基金封闭期内采用买入持有到期策略，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，为基金份额持有人谋求资产的稳健增值。   |
| 投资策略       | <p>（一）封闭期投资策略</p> <p>本基金一方面按照自上而下的方法对基金的资产配置、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，运用多种资产管理增值策略，实现本基金投资和再投资资产风险收益的合理配比。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p> |
| 业绩比较基准     | 封闭期起始日公布的三年期定期存款利率（税后）+0.10%  |
| 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，但低于混合型基金和股票型基金。 |                     |
| 基金管理人           | 浦银安盛基金管理有限公司           |                     |
| 基金托管人           | 交通银行股份有限公司             |                     |
| 下属分级基金的基金简称     | 浦银安盛普嘉 87 个月定期开债券 A    | 浦银安盛普嘉 87 个月定期开债券 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 009632                 | 009633              |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 7,989,998,435.64 份     | 1,992.18 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） |                     |
|-----------------|---------------------------|---------------------|
|                 | 浦银安盛普嘉 87 个月定期开债券 A       | 浦银安盛普嘉 87 个月定期开债券 C |
| 1. 本期已实现收益      | 67,259,872.03             | 15.84               |
| 2. 本期利润         | 67,259,872.03             | 15.84               |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0084                    | 0.0080              |
| 4. 期末基金资产净值     | 8,059,104,054.81          | 2,008.41            |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0086                    | 1.0081              |

注：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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，所以，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

#### 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

浦银安盛普嘉 87 个月定期开债券 A

| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月      | 0.84%  | 0.01%     | 0.72%      | 0.01%         | 0.12% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.86%  | 0.01%     | 0.77%      | 0.01%         | 0.09% | 0.00% |

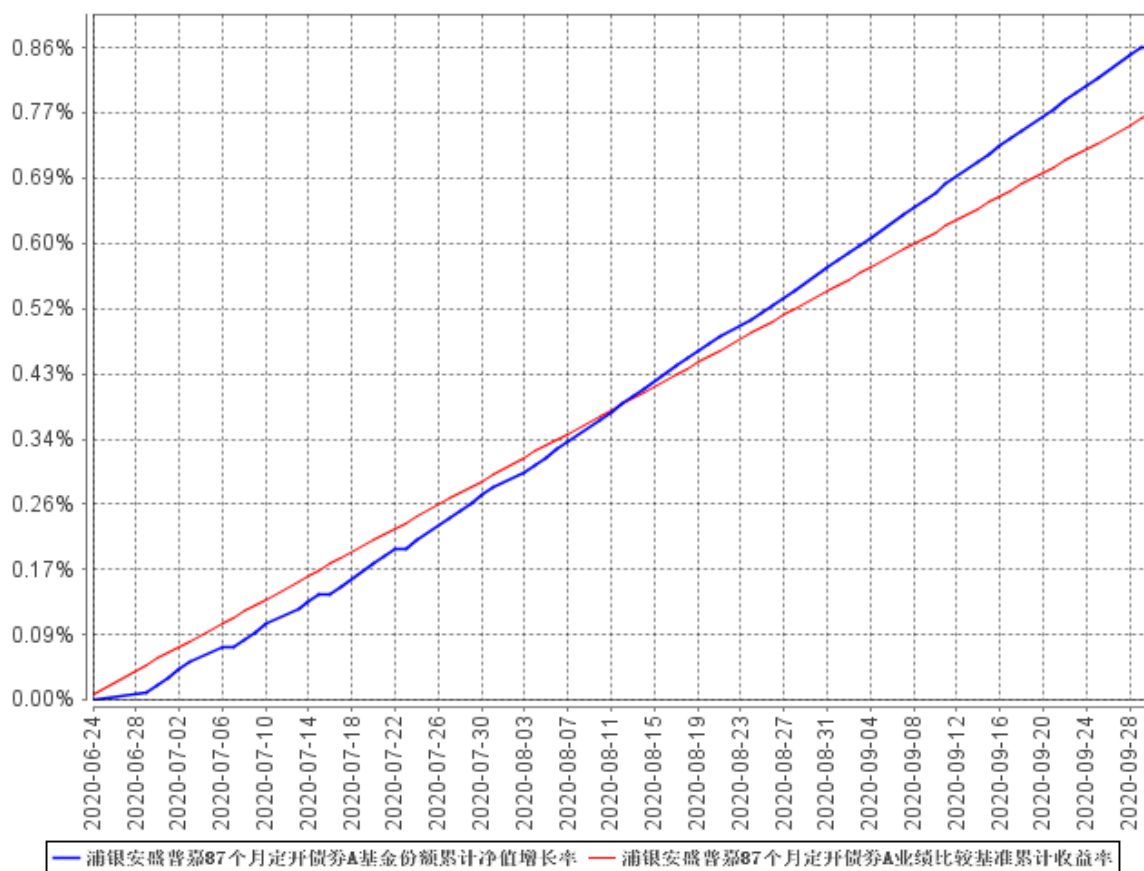
浦银安盛普嘉 87 个月定期开债券 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

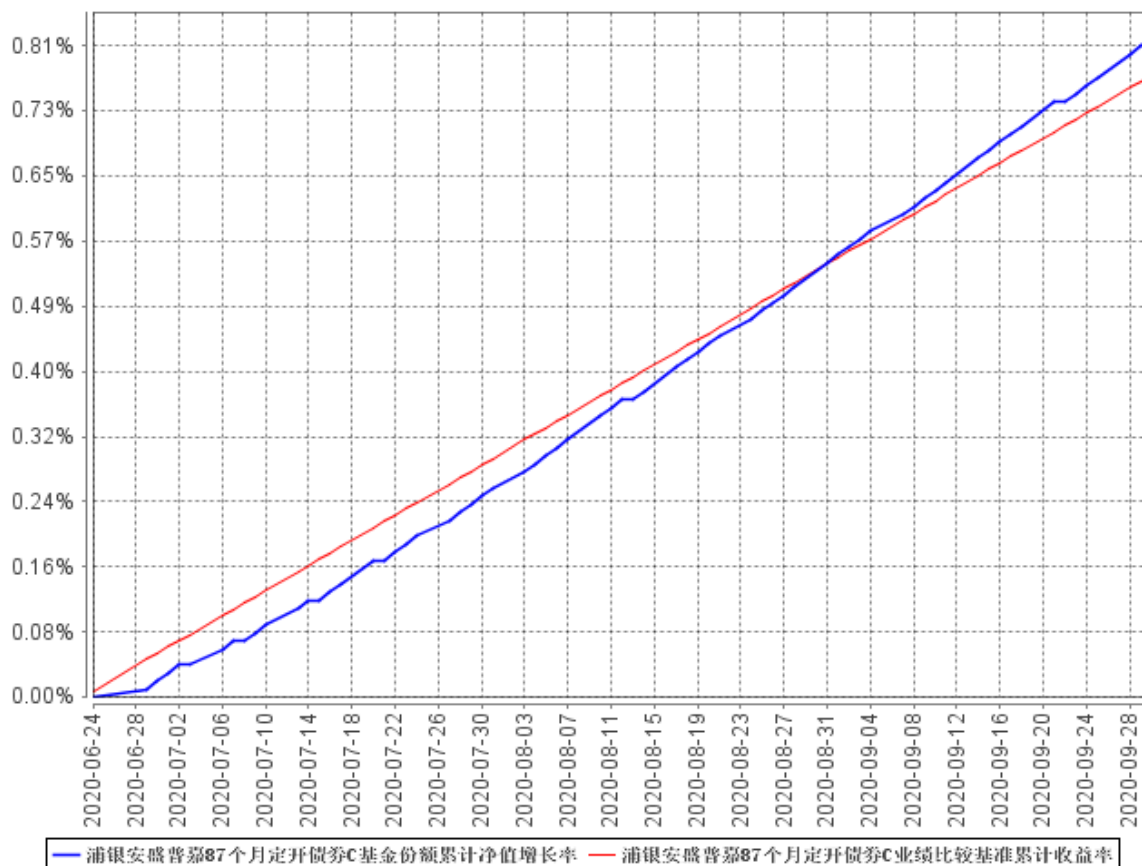
|            |       |       |       |       |       |       |
|------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 过去三个月      | 0.79% | 0.01% | 0.72% | 0.01% | 0.07% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.81% | 0.01% | 0.77% | 0.01% | 0.04% | 0.00% |

### 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

浦银安盛普嘉87个月定开债券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



浦银安盛普嘉87个月定开债券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：1、本基金合同生效日为 2020 年 6 月 24 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未滿 1 年。

2、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 2020 年 6 月 24 日至 2020 年 12 月 23 日。截止本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务              | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|-----------------|-------------|------|--------|--|
|    |                 | 任职日期        | 离任日期 |        |  |
| 李羿 | 公司固定收益投资部副总监，公司 | 2020年6月24日  | -    | 11     | 李羿先生，上海交通大学金融学硕士。2009年4月至2010年6月任上海浦东发展银行交易员；2010年6月至2013年7月任交 |

|  |             |  |  |   |
|--|-------------|--|--|---|
|  | 旗下部分基金基金经理。 |  |  | 银康联人寿保险有限公司高级投资经理;之后于 2013 年 7 月起先后在汇丰晋信基金、富国基金工作,分别在汇丰晋信投资部任职投资经理、基金经理,在富国固定收益投资部任职基金经理。2019 年 3 月加盟浦银安盛基金公司,在固定收益投资部担任总监助理一职,现任固定收益投资部副总监。2019 年 7 月起担任浦银安盛盛勤 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金以及浦银安盛双债增强债券型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月起担任浦银安盛中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金及浦银安盛普嘉 87 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 8 月起担任普华 66 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 9 月起担任浦银安盛中债 3-5 年农发行债券指数证券投资基金。 |
|--|-------------|--|--|---|

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

三季度，国内经济稳步复苏，消费、生产数据均表现良好，但全球依然笼罩在新冠疫情的阴影之下，中国表现可谓一枝独秀。随着国内疫情的控制，经济生活逐步常态化，国内货币政策也开始正常化，导致债券收益率持续回升。银行间 7 日回购利率季度均值由 2 季度的 1.76% 上行至 3 季度的 2.33%，交易所 GC007 回购利率均值由 1.86% 上行至 2.49%，两者均回到了今年 1 季度的均值水平，但相比去年 4 季度均值水平仍降低了 40bp。三季度，中债新综合全价指数下跌 2.40%，本季度处于建仓期。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛普嘉 87 个月定开债券 A 基金份额净值为 1.0086 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.84%；截至本报告期末浦银安盛普嘉 87 个月定开债券 C 基金份额净值为 1.0081 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.79%；同期业绩比较基准收益率为 0.72%。

#### 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            | 10,783,200,505.95 | 97.75        |
|    | 其中：债券             | 10,783,200,505.95 | 97.75        |
|    | 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          | 150,005,195.00    | 1.36         |
|    | 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      | 10,985,030.71     | 0.10         |
| 8  | 其他资产              | 86,810,932.93     | 0.79         |
| 9  | 合计                | 11,031,001,664.59 | 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      | 10,783,200,505.95 | 133.80       |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,783,200,505.95 | 133.80       |
| 4  | 企业债券      | -                 | -            |



|    |           |                   |        |
|----|-----------|-------------------|--------|
| 5  | 企业短期融资券   | -                 | -      |
| 6  | 中期票据      | -                 | -      |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                 | -      |
| 8  | 同业存单      | -                 | -      |
| 9  | 其他        | -                 | -      |
| 10 | 合计        | 10,783,200,505.95 | 133.80 |

### 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  | 092018002 | 20 农发清发 02 | 42,500,000 | 4,123,716,586.50 | 51.17        |
| 2  | 170415    | 17 农发 15   | 25,550,000 | 2,696,072,243.22 | 33.45        |
| 3  | 170215    | 17 国开 15   | 17,820,000 | 1,867,454,677.86 | 23.17        |
| 4  | 018014    | 国开 2005    | 11,689,840 | 1,167,357,092.04 | 14.48        |
| 5  | 200307    | 20 进出 07   | 8,000,000  | 799,011,867.32   | 9.91         |

### 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、处罚的情形。

### 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，没有超出基金合同规定的备选股票库的范围。

### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 48,960.76     |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 86,761,972.17 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 86,810,932.93 |

### 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                        | 浦银安盛普嘉 87 个月定开债券 A | 浦银安盛普嘉 87 个月定开债券 C |
|---------------------------|--------------------|--------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 7,989,998,435.64   | 1,992.18           |
| 报告期期间基金总申购份额              | -                  | -                  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | -                  | -                  |
| 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               | 7,989,998,435.64   | 1,992.18           |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                |                  |      |      | 报告期末持有基金情况       |        |
|-------|----------------|--------------------------------|------------------|------|------|------------------|--------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间        | 期初份额             | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额             | 份额占比   |
| 机构    | 1              | 2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日 | 3,989,999,500.00 | 0.00 | 0.00 | 3,989,999,500.00 | 49.94% |
| 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、 浦银安盛普嘉 87 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同
- 3、 浦银安盛普嘉 87 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书
- 4、 浦银安盛普嘉 87 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议
- 5、 基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 6、 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、 本报告期内在中国证监会规定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](http://www.py-axa.com)）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

客户服务中心电话：400-8828-999 或 021-33079999 。

浦银安盛基金管理有限公司

2020 年 10 月 28 日