浦银安盛优化收益债券型证券投资基金招募说明书摘要(更新)

2017年第1号

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
内容截止日:2017年6月30日

重要提示

基金募集申请核准文件名称:《关于核准浦银安盛优化收益债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2008]1186号)

核准日期:2008年10月15日

基金合同生效日期:2008年12月30日

投资有风险,投资者认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,基金管理人保证本摘要的内容真实、准确、完整,本摘要经中国证监会核准。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2017年6月30日,有关财务数据和净值表现截止日2017年3月31日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:浦银安盛基金管理有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区浦东大道981号3幢316室

办公地址:中国上海市淮海中路381号中环广场38楼

成立时间:2007年8月5日

法定代表人:谢伟

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字[2007]207号

注册资本:2.8亿元人民币

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

谢伟先生,董事长,硕士研究生,高级经济师。曾任中国建设银行郑州分行金水支行副行长,河南省分行公司业务部总经理,许昌市分行党委书记、行长;上海浦东发展银行公司及投资银行总部发展管理部总经理,公司及投资银行总部副总经理兼投行业务部、发展管理部、大客户部总经理,上海浦东发展银行福州分行党委书记、行长,上海浦东发展银行资金总部总经理,资产管理部总经理。现任上海浦东发展银行党委委员、副行长,兼任金融市场业务总监、金融市场部总经理。自2017年3月起兼任本公司董事,2017年4月起兼任本公司董事长。

Bruno Guilloton先生,副董事长,法国国籍,毕业于国立巴黎工艺技术学院。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。2016年12月起兼任安盛投资管理(上海)有限公司董事长。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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,2017年4月27日起兼任浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)基金经理。自2012年3月起兼任本公司职工监事。

朱敏奕女士,本科学历。2000年至2007年就职于上海东新投资管理有限公司资产管理部任客户主管。2007年4月加盟浦银安盛基金管理有限公司担任市场策划经理,现任本公司市场部副总监。自2013年3月起,兼任本公司职工监事。

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月至2017年2月兼任本公司旗下子公司——上海浦银安盛资产管理有限公司总经理。2017年2月起兼任上海浦银安盛资产管理有限公司执行董事。

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

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

章潇枫先生,复旦大学数学与应用数学专业本科学历。加盟浦银安盛基金前,曾任职于湘财证券股份有限公司,历任金融工程研究员、报价回购岗以及自营债券投资岗。2016年6月加盟浦银安盛基金公司,在固定收益投资部担任基金经理助理岗位。2017年5月起担任公司旗下浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)及浦银安盛幸福聚益18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017年6月起担任公司旗下浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金、浦银安盛幸福回报定期开放债券型基金及浦银安盛优化收益债券型基金基金经理。

历任基金经理薛铮先生,上海财经大学数量经济学硕士。2006年3月至2009年6月,先后就职于红顶金融研究中心,上海证券有限公司从事固定收益研究工作。2009年7月进入浦银安盛基金管理公司,历任固定收益研究员、固定收益基金经理助理、货币基金基金经理等职务。2011年12月至2017年6月担任浦银安盛稳健增利债券基金(原增利分级债券基金)基金经理。2012年9月至2017年6月兼任浦银安盛幸福回报债券基金基金经理。2012年11月至2017年6月,担任本公司固定收益投资部总监。2013年5月至2016年8月,兼任浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2013年6月至2016年8月,兼任浦银安盛季季添利债券基金基金经理。2014年7月至2017年6月,兼任浦银安盛优化收益债券基金基金经理。2014年12月至2017年4月,兼任浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金基金经理。2016年5月至2017年4月,兼任浦银安盛幸福聚利债券基金基金经理。2016年7月至2017年6月,兼任浦银安盛盛鑫定期开放债券基金及浦银安盛盛元纯债债券基金基金经理。2016年11月至2017年6月,兼任浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金及浦银安盛幸福聚益18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2016年12月至2017年6月,兼任浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年3月至2017年6月,兼任浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年4月至2017年6月,兼任浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金基金经理。薛铮先生拥有10年证券从业经验。薛铮先生从未被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施。

历任基金经理吕栋先生,复旦大学理学学士、麻省理工大学-斯隆商学院金融学硕士学位。2006年8月到2010年6月,先后在瑞银集团(UBS)旗下Dillon Read 对冲基金及瑞银集团(UBS)固定收益部任分析员, 承担相对价值交易策略、资产抵押证券等数量化模型的研发工作。2011年6月,加盟花旗集团(香港)任投资银行部分析员,承担新债定价、公司基本面分析和债务结构分析工作。2011年11月起加盟浦银安盛基金管理公司担任专户投资经理助理。2013年7月起,调任至公司固定收益投资部工作。2013年9月至2015年2月担任本基金基金经理。2014年1月至2015年2月担任浦银安盛货币市场证券投资基金基金经理。2014年3月至2015年2月担任浦银安盛日日盈货币市场基金基金经理。

历任基金经理蒋建伟先生,毕业于上海财经大学。2001年至2007年在上海东新国际投资管理有限公司担任研究员、投资经理助理。2007年加盟浦银安盛基金管理有限公司,先后担任行业研究员,基金经理助理等岗位。2010年7月起,担任本基金基金经理。2012年6月至2013年9月,兼任本基金基金经理。2014年5月至2016年1月,兼任浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年3月起,兼任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。2016年4月起兼任公司权益投资部副总监。蒋建伟先生拥有15年证券从业经验。蒋建伟先生从未被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施。

历任基金周文稠先生 (Alex Zhou),2010年6月至2011年6月期间为本基金基金经理。周文稠先生从未被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施。

历任基金经理段福印先生,2007年加盟浦银安盛基金管理公司, 自2008年12月至2010年6月,担任本基金基金经理。段福印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。

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。

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

钟明女士,本公司固定收益投资部副总监。

黄列先生,本公司研究部总监。

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

督察长、风险管理部负责人、基金经理及基金经理助理列席投资决策委员会会议。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人的基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间:1984年1月1日

法定代表人:易会满

注册资本:人民币35,640,625.71万元

联系电话:010-66105799

联系人:郭明

(二)主要人员情况

截至2017年3月末,中国工商银行资产托管部共有员工205人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三)基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2017年3月,中国工商银行共托管证券投资基金709只。自2003 年以来,本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的53项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

(1)浦银安盛基金管理有限公司上海直销中心

住所:中国(上海)自由贸易试验区浦东大道981号3幢316室

办公地址:中国上海市淮海中路381号中环广场38楼

电话:(021)23212899

传真:(021)23212890

客服电话:400-8828-999;(021)33079999

联系人:徐薇

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

2、场外代销机构

A. 银行、券商

(1)中国工商银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:易会满
客户服务热线:95588
公司网址:www.icbc.com.cn

(2)上海浦东发展银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:高国富
客户服务热线:95528
公司网址:www.spdb.com.cn

(3)中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼长安兴融中心
法定代表人:王洪章
客户服务电话: 95533
网址:www.ccb.com

(4)交通银行股份有限公司
地址:上海市银城中路188号
法定代表人:牛锡明
客服电话:95559
网址:www.bankcomm.com

(5)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
咨询电话:95594
网址:www.bosc.cn

(6)中国光大银行股份有限公司
地址:北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
法定代表人:唐双宁
客服电话:95595
网址:www.cebbank.com

(7)中信银行股份有限公司
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

(8)招商银行股份有限公司
地址:深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人:李建红
客户服务热线: 95555
网址:www.cmbchina.com

(9)中国邮政储蓄银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区宣武门西大街131号
办公地址:北京市西城区金融大街3号金鼎大厦A座
法人代表:李国华
客户服务热线: 95580
网址:www.psbc.com

(10)光大证券股份有限公司
地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
客服电话:95525
网址:www.ebscn.com

(11)申万宏源证券有限公司
地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
客服电话:95523
网址:www.swhysc.com

(12)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:杨德红
客户服务热线:4008888666
公司网址:www.gtja.com

(13)中国银河证券股份有限公司
地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈有安
客服电话:4008-888-888
公司网站:www.chinastock.com.cn

(14)海通证券股份有限公司
地址:上海市广东路689号1001A 1001B室
法定代表人:周杰
客服电话:400-8888-001、021-95553
公司网址:www.htsec.com

(15)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

(16)广发证券股份有限公司
地址:广州市天河北路183-187号大都会广场43楼
法定代表人:孙树明
客户服务热线:95575
公司网站:www.gf.com.cn

(17)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:吴万善
客户服务热线:95597
公司网站:www.htsc.com.cn

(18)东方证券股份有限公司
地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人:潘鑫军
客户服务热线: 95503
公司网站:www.dfzq.com.cn

(19)渤海证券股份有限公司
注册地址: 天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址: 天津市南开区宾水西道8号
法定代表人: 杜庆平
客服电话:400-651-5988
公司网址:www.bhzq.com

(20)兴业证券股份有限公司
地址:福州市湖东路268号
法定代表人:兰荣
客户服务热线:95562
公司网站:www.xyzq.com.cn

(21)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
咨询电话:4008888108
公司网站:www.csc108.com

(22)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:4008-001-001
网址:www.essence.com.cn

(23)上海证券有限责任公司
办公地址:上海市四川中路213号久事商务大厦7楼
法定代表人:李俊杰
客户服务热线:021-962518
网址:www.962518.com

(24)中航证券有限公司(A类)
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
客户服务电话:400—8866—567
网址:www.avicsec.com

(25)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
客服电话:95321
网址:www.cindasc.com

(26)华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人:黄金琳
客户服务热线: 0591-96326
网址:www.hfzq.com.cn

(27)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
法定代表人:韩志谦
客服电话:4008—000—562
网址:www.hysec.com

(28)中泰证券股份有限公司
办公地址:山东济南市经七路86号证券大厦2001
法定代表人:李玮
客户服务热线:95538
网址:www.zts.com.cn

(29)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:王东明
客户服务热线: 95548
网址: www.cs.ecitic.com

(30)中国民族证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼40层-43层
法定代表人:何亚刚
客户服务热线:40088—95618
网址:www.e5618.com

(31)华夏银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人:吴建
客户服务热线: 95577
网址: www.hxb.com.cn

(32)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
客服电话:95548
公司网址:www.citicssd.com

(33)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

(34)宁波银行股份有限公司
注册地址:宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人:陆华裕
客服电话:95574
公司网址:www.nbcb.com.cn

(35)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

(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:杨树财
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)中国国际金融股份有限公司
注册地址:北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
法定代表人:丁学东
客服电话:410-910-1166
公司网址:www.cicc.com.cn

(39)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

(40)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:曹实凡
客服电话:95511-8
公司网站:www.stock.pingan.com

(41)中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号民生银行大厦
法定代表人:洪崎
客服电话:95568
公司网站:www.cmbc.com.cn

(42)上海农村商业银行股份有限公司
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号中融碧玉蓝天大厦15-20、22-27层
法定代表人:冀光恒
客服电话:021-962999
公司网址: www.srcb.com

(43)方正证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段200号华侨国际大厦22-24层
办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段200号华侨国际大厦22-24层
法定代表人:高利
客户服务热线:95571
公司网站:www.foundersc.com

B. 第三方销售机构

(1)天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
法定代表人:林义相
客户服务热线: 010-66045678
天相投顾网址: www.txsec.com
天相基金网网址:www.jjm.com.cn

(2)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

(3)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人:张跃伟
客户服务电话:400-820-2899
网址:www.erichfund.com

(4)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
客户服务电话:400-700-9665
网址:www.ehowbuy.com

(5)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:4008188000
网址:www.myfp.cn

(6)上海天天基金销售有限公司
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号26楼
法定代表人:其实
服务热线:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn

(7)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
客户服务热线: 400-059-8888
网址:www.zscffund.com

(8)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

(9)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

(10)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:licaike.hexun.com

(11)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:400-786-88685
网址:www.chtfund.com

(12)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:400-893-688
网址:www.qianjing.com

(13)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

(14)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

(15)上海汇付金融服务有限公司
办公地址:上海市中山南路100 号金外滩国际广场19 楼
法定代表人:金信
客服电话:400-820-2819
公司网站:https://tty.chinapnr.com

(16)上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475 号1033 室
办公地址:上海浦东新区峨山路91 弄61 号10 号楼12 楼
法定代表人:李兴春
客服电话:400-921-7755
公司网站:www.leadfund.com.cn

(17)大泰金石基金销售有限公司
注册地址:南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105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

(18)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

(19)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

(20)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

(21)上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333 号14 楼09 单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333 号14 楼
法定代表人:鲍东华
客服电话:4008219031
公司网站:www.lufunds.com

(22)北京虹点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
办公地址:北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层
法定代表人:胡伟
客服电话:4006180707
公司网站:www. hongdianfund.com

(23)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

(24)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:刘鹏宇
客服电话:0755-83999907
公司网站: www.jinqianwo.cn

(25)奕丰金融服务(深圳)有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1 号A 栋201 室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115 室,1116 室及1307 室
法定代表人:TAN YIK KUAN
客服电话:400-684-0500
公司网站: www.ifastps.com.cn

(26)上海联泰资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277 号3 层310 室
办公地址:上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层
法定代表人:燕斌
客服电话:400-166-6788
公司网站:www.66zichan.com

(27)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4 栋10 层1006#
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28 号富卓大厦A 座7 层
法定代表人:张彦
客服电话:400-166-1188
公司网站:8.jrj.com.cn

(28)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

(29)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

(30)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/

(31)乾道金融信息服务(北京)有限公司
注册地址: 北京市海淀区东北旺村南1 号楼7 层7117 室
办公地址: 北京市西城区德外大街合生财富广场1302 室
法定代表人: 王兴吉
客服电话:400-0888-080
公司网站: www.qiandaojr.com

(32)北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
法定代表人:李昭琛
客服电话:010-62675369
公司网站:www.xincai.com

(33)北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11 号11 层1108
办公地址:北京市海淀区中关村大街11 号11 层1108
法定代表人:王伟刚
客服电话:400-619-9059
公司网站:http://www.hcjijin.com

(34)北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村东路66 号1 号楼22 层2603-06
办公地址:北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街18 号院A 座17 层
法定代表人:陈超
客服电话:95118
公司网站:fund.jd.com

3、场内代销机构

名单详见基金份额发售公告。

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和《基金合同》等的规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时履行信息披露义务。

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
联系人:赵亦清
电话:(010)50938782
传真:(010)50938991

(三)出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称:上海源泰律师事务所
住所:上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室
办公地址:上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人:廖海
电话:(021)61638452
传真:(021)51150398
联系人:吴军娥
经办律师:吕红、安冬

(四)审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

公司全称: 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:张振波
经办注册会计师:薛竞、张振波

(五)其他服务机构及委托办理业务的有关情况

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统,这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成,之后日常的维护管理由公司负责,但与第三方服务公司签订有技术服务合同,由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户子系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统等。这些系统也主要是在公司筹建之初采购专业系统提供商的产品建设而成,建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级,升级由系统提供商负责完成,升级后的系统也是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

浦银安盛优化收益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

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。

七、基金的投资范围

本基金主要投资于固定收益类金融产品,包括国内依法发行、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。本基金80%以上的基金资产投资于固定收益类金融产品;本基金还可投资于一级市场新股申购、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,但上述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%。基金持有现金以及到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

八、基金的投资策略

本基金将通过“自上而下”的资产配置、久期配置、类属配置和“自下而上”的个券选择,运用多种积极的资产管理增值策略,实现投资目标。

(一)资产配置

本基金通过对宏观经济发展环境、宏观经济运行状况、货币政策和财政政策的变化、市场利率走势、经济周期、企业盈利状况等作出研判,从而确定整体资产配置,即债券、股票、现金及回购等的配置比例。在股票投资方面,作为债券型产品,本基金以稳健投资为立足点,在严格控制风险的基础上,把握固定收益品种之外的权益类低风险收益或充分利用价值低估的权益品种带来的投资机会以获得超额收益。本基金将在充分重视本金安全的前提下,为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报。

(二)固定收益类证券投资策略

1、期限结构策略

(1)久期调整策略

本基金通过对宏观经济状况和货币政策的分析,根据中长期的宏观经济走势和经济周期性特征,对债券市场走势作出判断,并形成对未来市场利率变动方向的预期,动态调整债券组合的久期。在预期利率下降时,增加组合久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益;在预期利率上升时,减小组合久期,以规避债券价格下降的风险。

(2)收益率曲线策略

在久期确定的基础上,根据对收益率曲线形状变化情景的分析,分别采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略,在长期、中期和短期债券间进行合理配置,以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

(3)骑乘策略

通过分析收益率曲线各期限段的利差情况,买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券,随着基金持有债券时间的延长,债券的剩余期限将缩短,到期收益率将下降,基金从而可获得资本利得收入。

2、类属配置策略

在保证流动性的基础上,本基金将通过国债、央行票据、金融债、企业(公司)债、可转换债、资产支持证券、回购等资产的合理组合实现稳定的投资收益。

(1)相对价值策略

相对价值策略包括研究国债与金融债之间的利差、交易所与银行间的市场利差,寻找价值相对低估的投资品种。金融债与国债的利差由税收、信用、流动性等因素决定,同时,利差的大小还受市场资金供给充裕程度的影响,资金供给越充分上述利差将越小。交易所与银行间的联动性随着市场改革势必逐渐加强,两市之间的利差能够提供一些增值机会。

(2)信用利差策略

企业债与国债的利差曲线理论上受经济波动与企业生命周期影响,相同资信等级的企业债券在利差期限结构上服从均值回归的规律。内外部评级的差别与信用等级的变动会造成相对利差的波动,另外在经济上升或下降的周期中企业债利差将缩小或扩大。管理人可以通过对内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断主动采用相对利差投资策略。

3、个券选择策略

(1)流动性策略

本债券型基金对流动性的要求比较高,因此将通过各类流动性监控指标对流动性做深入的针对性分析,通过保障个券的流动性而不至于带来额外损失。

(2)信用分析策略

为了确保本金安全的基础上获得稳定的收益,本基金对企业债、公司债、金融债、短期融资券等高信用债券进行信用分析。此分析主要通过三个角度完成:①独立第三方的外部评级结果;②第三方担保情况;③基于FFM模型的内部评价。FFM模型在信用评价方面的主要作用在于通过对部分关键的财务指标分析判断债券发行企业未来出现偿债风险的可能性,从而确定该企业发行债券的信用等级与利率水平。主要关键的指标包括:NET DEBT/EBITDA、EBIT/I、资产负债率、流动资产/流动负债、经营活动现金流/总负债。其中资产负债率、流动资产/流动负债主要分析企业债务水平与结构,其他的指标主要分析企业经营效益对未来偿债能力的支持能力。

4、其它策略

(1)回购策略

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

(2)可转债投资策略

可转换公司债券是一种介于股票和债券之间的固定收益类投资品种,投资者既可以获得债券投资的固定收益,也可以分享股票价格上涨所带来的投资回报。其理论价值等于作为普通债券的纯债券价值加上可转债内含选择权的价值。与直接投资股票相比,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。本基金在对可转换公司债券条款和发行公司基本面进行深入分析研究的基础上,利用可转债的纯债券价值和到期收益率来判断可转债的债性,以增强本金投资的安全性;利用可转债转换价值相对于纯债价值的溢价率来判断可转债的股性,在市场出现投资机会时,优先选择股性强的品种,获取超额收益。

②一级市场申购策略

目前,可转债均采取定价发行,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。

(3)资产支持证券投资策略

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

(三)股票投资策略

1、新股申购策略

在股票发行市场上,股票供求关系不平衡经常导致股票发行价格与二级市场价格之间存在一定的价差,从而使得新股申购成为一种风险较低的投资方式。本基金将研究首次发行(IPO)股票及增发新股的上市公司基本面,根据股票市场整体定价水平,估计新股上市交易的合理价格,同时参考一级市场资金供求关系,制定相应的新股申购策略。本基金对于通过参与新股认购所获得的股票,将根据其市场价格相对于其合理内在价值的高低,确定继续持有或者卖出。

2、个股精选策略

本基金作为债券基金将以稳健回报为目标,因此,当本基金管理人判断市场出现明显的投资机会时,本基金可在授权范围内直接参与股票二级市场投资,并将把价值低估和股息收益率较高的股票作为投资重点。

股票投资部分将坚持“自下而上”的精选个股策略。主要通过公司特有的数量化的财务研究模型FFM中PEG、MV/Normalized NCF、EV/EBITDA等主要估值指标来考察和筛选出价值被低估的股票;通过股息收益率、历史分红频率和数量、未来分红潜力等指标筛选出红利收益率高的股票作为投资重点。股票投资中将以安全性、稳健性为首要考虑因素,在经过定量筛选后寻找那些具有核心竞争优势,在行业内处于领先地位;所处的行业景气度高,主营业务具有持续成长能力;分红派息能力和意愿较强;具有良好的治理结构和财务健康度的上市公司作为本基金的核心投资目标,进行重点投资。

(四)权证投资策略

本基金将因为上市公司进行股权分置改革、或增发、配售以及投资分离交易的可转换公司债券等原因被动获得权证,或者在进行套利交易、避险交易以及权证价值严重低估等情形下将投资权证。本基金进行权证投资时,将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化期权定价模型,确定其合理内在价值,从而构建套利交易或避险交易组合以及在合同许可投资比例范围内的投资于价值出现较为显著的低估的权证品种。

(五)其它创新或者衍生产品的投资策略

本基金将根据公募基金的特点和要求,结合创新或者衍生产品的特征,在进行充分风险控制和充分遵守法律法规的前提下,制定合适的投资策略进行该类产品的投资。

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室下达交易命令; 集中交易室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室分配给交易员执行;集中交易室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定量化分析数据,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, 如发现有违反《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,并同时通报监察部、风险管理部、相关基金经理、集中交易室。集中交易室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、内部审计部、监察部、风险管理部)对投资管理过程的风险监控。

十、业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中证全债指数

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,体现了指数编制的先进性;该指数涵盖了在上海证券交易所、深圳证券交易所和银行间市场上市的债券,具有广泛的市场代表性,能够全面反映债券市场总体走势;该指数编制方法、指数数据等相关指数信息透明度高,适合作为本基金的业绩比较基准。

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

十一、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,谋求实现基金财产的安全和增值。

十二、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人——中国工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2017年3月31日(财务数据未经审计)。

(一)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	46,192,041.20	85.21
	其中:债券	46,192,041.20	85.21
	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	6,600,000.00	12.18
	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	601,139.72	1.11
8	其他资产	815,489.51	1.50
9	合计	54,208,670.43	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

2.2报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

(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

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	2,996,400.00	5.60
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	29,270,681.20	54.73
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	13,924,960.00	26.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	46,192,041.20	86.37

(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

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	122905	10南昌债	40,000	4,004,400.00	7.49
2	113009	广汽转债	30,000	3,633,000.00	6.79
3	136351	16永泰01	35,000	3,545,150.00	6.63
4	128009	歌尔转债	27,000	3,492,180.00	6.53
5	124393	PR连顺兴	40,000	3,304,800.00	6.18

(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

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。

9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

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。

(十)投资组合报告附注

10.1 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。

10.2 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。

10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,351.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	763,038.78
5	应收申购款	50,099.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	815,489.51

10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113009	广汽转债	3,633,000.00	6.79
2	128009	歌尔转债	3,492,180.00	6.53
3	110035	白云转债	2,959,180.00	5.53
4	128011	汽模转债	1,609,160.00	3.01
5	110034	九州转债	1,569,490.00	2.93
6	128010	顺昌转债	582,950.00	1.09

10.5 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。

10.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

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)浦银安盛优化收益债券型证券投资基金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

1、浦银安盛优化收益债券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
2017/01/01-2017/03/31	0.58%	0.12%	-0.33%	0.07%	0.91%	0.05%
2016/01/01-2016/12/31	1.63%	0.15%	2.00%	0.09%	-0.37%	0.06%
2015/01/01-2015/12/31	7.13%	0.63%	6.51%	0.07%	0.62%	0.56%
2014/01/01-2014/12/31	22.22%	0.27%	9.41%	0.16%	12.81%	0.11%
2013/01/01-2013/12/31	4.93%	0.48%	1.78%	0.05%	3.15%	0.43%
2012/01/01-2012/12/31	9.42%	0.20%	4.03%	0.04%	5.39%	0.16%
2011/01/01-2011/12/31	-2.21%	0.25%	3.79%	0.06%	-6.00%	0.19%
2010/01/01-2010/12/31	4.79%	0.16%	2.00%	0.07%	2.79%	0.09%
2008/12/30-2009/12/31	0.40%	0.09%	0.29%	0.06%	0.11%	0.03%
2008/12/30-2017/03/31	58.11%	0.32%	33.18%	0.08%	24.93%	0.24%

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
2017/01/01-2017/03/31	0.58%	0.12%	-0.33%	0.07%	0.91%	0.05%
2016/01/01-2016/12/31	1.63%	0.15%	2.00%	0.09%	-0.37%	0.06%
2015/01/01-2015/12/31	7.13%	0.63%	6.51%	0.07%	0.62%	0.56%
2014/01/01-2014/12/31	22.22%	0.27%	9.41%	0.16%	12.81%	0.11%
2013/01/01-2013/12/31	4.93%	0.48%	1.78%	0.05%	3.15%	0.43%
2012/01/01-2012/12/31	9.42%	0.20%	4.03%	0.04%	5.39%	0.16%
2011/01/01-2011/12/31	-2.21%	0.25%	3.79%	0.06%	-6.00%	0.19%
2010/01/01-2010/12/31	4.79%	0.16%	2.00%	0.07%	2.79%	0.09%
2008/12/30-2009/12/31	0.40%	0.09%	0.29%	0.06%	0.11%	0.03%
2008/12/30-2017/03/31	58.11%	0.32%	33.18%	0.08%	24.93%	0.24%

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
2017/01/01-2017/03/31	0.58%	0.12%	-0.33%	0.07%	0.91%	0.05%
2016/01/01-2016/12/31	1.63%	0.15%	2.00%	0.09%	-0.37%	0.06%
2015/01/01-2015/12/31	7.13%	0.63%	6.51%	0.07%	0.62%	0.56%
2014/01/01-2014/12/31	22.22%	0.27%	9.41%	0.16%	12.81%	0.11%
2013/01/01-2013/12/31	4.93%	0.48%	1.78%	0.05%	3.15%	0.43%
2012/01/01-2012/12/31	9.42%	0.20%	4.03%	0.04%	5.39%	0.16%
2011/01/01-2011/12/31	-2.21%	0.25%	3.79%	0.06%	-6.00%	0.19%
2010/01/01-2010/12/31	4.79%	0.16%	2.00%	0.07%	2.79%	0.09%
2008/12/30-2009/12/31	0.40%	0.09%	0.29%	0.06%	0.11%	0.03%
2008/12/30-2017/03/31	58.11%	0.32%	33.18%	0.08%	24.93%	0.24%

(下转B128版)