

# 浦银安盛双债增强债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 日

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

报告送出日期：2024 年 1 月 22 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 1 月 19 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 2023 年 10 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛双债增强债券	
基金主代码	006466	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 21 日	
报告期末基金份额总额	1,474,646,489.47 份	
投资目标	在严格控制投资风险、保持资产流动性的前提下，采取自上而下的资产配置策略和自下而上的个券选择策略，通过积极主动的投资管理，充分把握信用债和可转债的投资机会，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金一方面按照自上而下的方法对基金的资产配置、久期管理、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，通过流动性考察和信用分析策略进行筛选，重点投资于信用债与可转换债券。整体投资通过对风险的严格控制，运用多种积极的资产管理增值策略，实现本基金的投资目标。	
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率*40%+中证综合债券指数收益率*50%+沪深 300 指数收益率*10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其风险收益预期高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛双债增强债券 A	浦银安盛双债增强债券 C
下属分级基金的交易代码	006466	006467

报告期末下属分级基金的份额总额	802,318,051.63 份	672,328,437.84 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（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日）	
	浦银安盛双债增强债券 A	浦银安盛双债增强债券 C
1. 本期已实现收益	-5,213,115.99	-4,395,816.60
2. 本期利润	-9,580,691.73	-6,279,409.53
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0102	-0.0093
4. 期末基金资产净值	943,302,382.32	777,859,024.72
5. 期末基金份额净值	1.1757	1.1570

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额。

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

浦银安盛双债增强债券 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	-0.70%	0.12%	-1.34%	0.24%	0.64%	-0.12%
过去六个月	-0.78%	0.11%	-1.58%	0.22%	0.80%	-0.11%
过去一年	0.88%	0.12%	1.06%	0.22%	-0.18%	-0.10%
过去三年	7.74%	0.13%	5.40%	0.31%	2.34%	-0.18%
自基金合同生效起至今	17.57%	0.12%	20.24%	0.33%	-2.67%	-0.21%

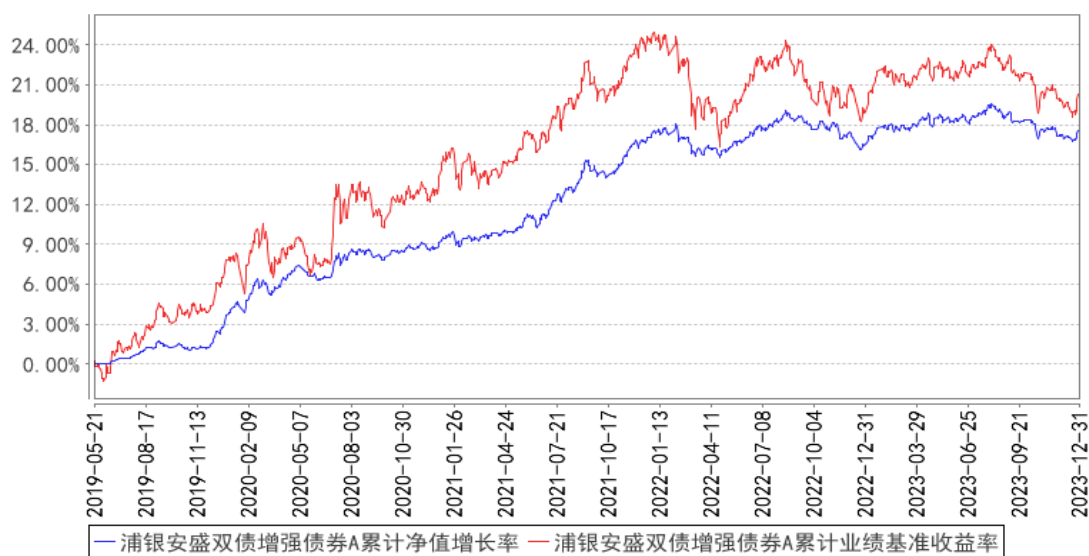
浦银安盛双债增强债券 C

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

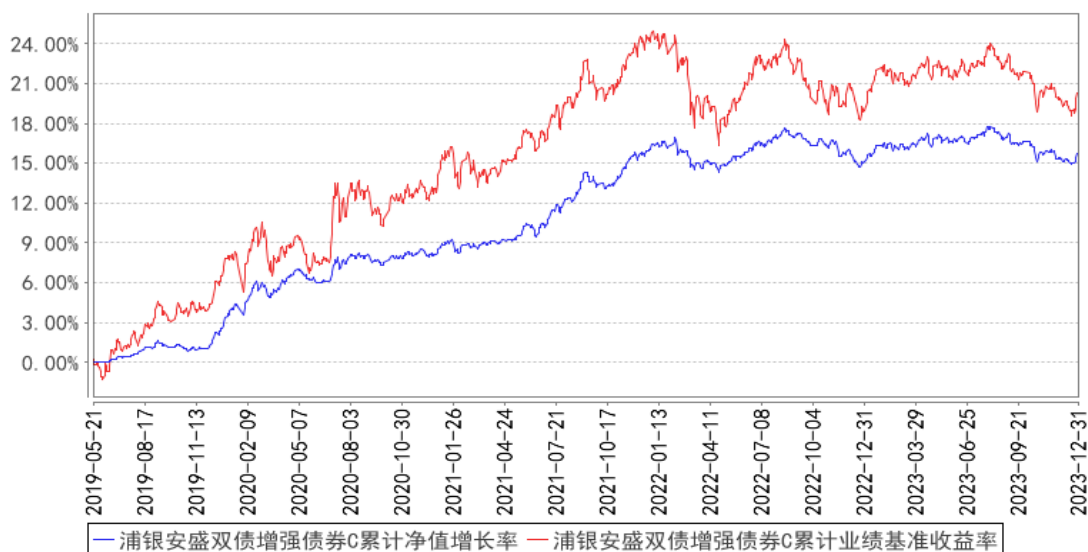
		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	-0.79%	0.12%	-1.34%	0.24%	0.55%	-0.12%
过去六个月	-0.95%	0.11%	-1.58%	0.22%	0.63%	-0.11%
过去一年	0.53%	0.12%	1.06%	0.22%	-0.53%	-0.10%
过去三年	6.63%	0.13%	5.40%	0.31%	1.23%	-0.18%
自基金合同 生效起至今	15.70%	0.12%	20.24%	0.33%	-4.54%	-0.21%

### 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率变动的比较

浦银安盛双债增强债券A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



浦银安盛双债增强债券C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



## § 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		
郑双超	本基金的基金经理	2023年1月5日	-	12年	郑双超先生，清华大学计算数学专业硕士。2011年7月至2017年12月，先后就职于嘉实基金管理有限公司、东吴证券股份有限公司和天风证券股份有限公司，从事量化分析、固定收益分析、债券投资等工作。2017年12月14日加盟浦银安盛基金管理有限公司，现在固定收益投资部担任固定收益类基金经理。2021年12月至2023年3月担任浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2021年12月起担任浦银安盛优化收益债券型证券投资基金的基金经理。2023年1月起担任浦银安盛双债增强债券型证券投资基金及浦银安盛稳健丰利债券型证券投资基金的基金经理。2023年2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及浦银安盛盛融定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2023年3月起担任浦银安盛6个月持有期债券型证券投资基金（原浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金）的基金经理。

李羿	公司固定收益投资部总监，公司旗下部分基金经理。	2019 年 7 月 15 日	-	14 年	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 月起担任浦银安盛普华 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的基金经理。2021 年 2 月起担任浦银安盛稳健丰利债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月起，担任浦银安盛普兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月起，担任浦银安盛稳健富利 180 天持有期债券型证券投资基金的基金经理。
----	-------------------------	-----------------	---	------	--

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期。

2、证券从业含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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。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，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。在交易执行环节上，详细规定了面对多个投资组合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。公司严格控制主动投资组合的同日反向交易，非经特别控制流程审批同意，不得进行。从事后监控角度上，定期对组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1 日、3 日、5 日、10 日）的季度公平性交易分析评估，对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异进行分析。公司定期对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行检查，季度公平交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存。

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。报告期内未发生本基金与旗下其他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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度国内经济延续复苏，出口、投资、消费各方面经济数据均有不同程度好转；但受到市场之前对政策预期过高等影响，在年底各种政策落地后，资本市场表现较为平淡，之前市场对未来高胀的预期有所回落。

从具体数据看，出口同比数据逐月改善，11 月出口同比转正，12 月同比增速恢复至 2.3%。固定资产投资累计同比维持在 3% 左右，止住了原先的放缓趋势。其中，制造业投资增速维持在 6.2%-6.3%；基建投资有所趋缓，但四季度依旧可保持在 8% 以上；房地产开发投资仍是拖累项，四季度依旧在 -9% 以下。消费方面，社零数据在四季度不断逐月恢复，11 月社零同比达到 10.1%。

四季度各种国内经济逆周期调节政策不断出台。10 月 25 日，财政部公告增发 2023 年国债 1 万亿，作为特别国债管理，赤字率由 3% 提升至 3.8%。地产方面也有相应政策推出，12 月 14 日，北京、上海降低购房首付比例，并降低普通、非普住宅认定标准，降低了购房者的购置成本。

此外，四季度货币政策也保持合理充裕，继续为实体低融资成本。12 月 22 日，多家国有大行下调存款利率，覆盖各个期限，降幅 10-30bp 不等。

四季度市场资金成本平稳抬升，银行间 7 天回购利率在 10 月、11 月、12 月平均水平分别为 2.33%、2.35%、2.5%，季度平均值为 2.39%；较三季度上涨 38bp。

四季度利率债市场收益率先上后下，10 月、11 月，债市因为增发国债的供给扰动、金融监管等原因，利率整体承压；进入 12 月，随着银行存款利率的下调，利率持续下行，十年期国债收益率从三季度末的 2.67%下行至 2.55%，降幅 12bp。

四季度，权益市场波动较大。10 月资金面较为紧张，市场产生了过度的恐慌，上证指数一度跌破 3000 点；而后在中央汇金入市购买 ETF 等维稳操作下，市场大幅反弹，并在 11 月收复 3000 点。进入 12 月，在各种政策不断落地后，由于海外政治经济动荡、市场之前对政策预期过高等影响，权益市场下跌幅度较大，指数一度跌破 2900 点；而后指数在情绪有所修复后，上证指数又快速反弹至接近 3000 点的位置。

报告期内，本基金以配置高等级信用债和利率债为主，并在权益市场恐慌释放后参与反弹赚取了一定超额收益。债券部分维持了中性组合久期，取得了稳定的票息收入，获取了一定的资本利得；权益部分以配置高分红、大金融等板块为主。未来，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，力争为基金份额持有人带来长期稳定回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛双债增强债券 A 的基金份额净值为 1.1757 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.70%，同期业绩比较基准收益率为-1.34%，截至本报告期末浦银安盛双债增强债券 C 的基金份额净值为 1.1570 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-1.34%。

#### 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	60,322,399.90	3.40
	其中：股票	60,322,399.90	3.40



2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,688,778,889.57	95.25
	其中：债券	1,688,778,889.57	95.25
	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	2,500,000.00	0.14
	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	14,201,659.50	0.80
8	其他资产	7,105,770.44	0.40
9	合计	1,772,908,719.41	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,622,900.00	0.15
B	采矿业	12,382,200.00	0.72
C	制造业	27,619,000.00	1.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,097,600.00	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,704,400.00	0.27
J	金融业	7,896,299.90	0.46
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	60,322,399.90	3.50

### 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600547	山东黄金	260,000	5,946,200.00	0.35
2	600519	贵州茅台	3,000	5,178,000.00	0.30
3	000768	中航西飞	200,000	4,474,000.00	0.26
4	601881	中国银河	359,278	4,329,299.90	0.25
5	600941	中国移动	40,000	3,979,200.00	0.23
6	603939	益丰药房	90,000	3,603,600.00	0.21
7	601601	中国太保	150,000	3,567,000.00	0.21
8	601088	中国神华	100,000	3,135,000.00	0.18
9	600309	万华化学	40,000	3,072,800.00	0.18
10	603901	永创智能	250,000	2,975,000.00	0.17

#### 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	20,019,715.85	1.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	738,948,015.79	42.93
	其中：政策性金融债	134,748,101.46	7.83
4	企业债券	10,231,049.18	0.59
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	409,321,502.44	23.78
7	可转债（可交换债）	510,258,606.31	29.65
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,688,778,889.57	98.12

#### 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	113042	上银转债	820,000	90,291,098.63	5.25
2	210207	21 国开 07	800,000	81,602,360.66	4.74
3	113052	兴业转债	516,850	52,672,679.11	3.06
4	1928011	19 工商银行二级 03	500,000	51,767,185.79	3.01
5	1928033	19 中国银行二级 03	500,000	50,810,300.55	2.95

#### 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股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，徽商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局安徽省分局、中国人民银行合肥中心支行的处罚；交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行间市场交易商协会的处罚；上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局上海监管局、国家外汇管理局上海市分局的处罚；兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行间市场交易商协会的处罚；中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会的处罚。本基金投资的前十名证券中，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	84,958.35
2	应收证券清算款	1,775,306.52
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,245,505.57
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,105,770.44

### 5.11.4 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	113042	上银转债	90,291,098.63	5.25
2	113052	兴业转债	52,672,679.11	3.06
3	132026	G 三峡 EB2	48,924,498.03	2.84
4	113044	大秦转债	33,227,627.44	1.93
5	113021	中信转债	11,443,290.06	0.66
6	113516	苏农转债	10,660,125.13	0.62
7	113062	常银转债	10,049,200.70	0.58
8	110067	华安转债	9,097,380.82	0.53
9	127027	能化转债	7,008,739.73	0.41
10	128136	立讯转债	6,594,238.36	0.38
11	113647	禾丰转债	6,299,743.94	0.37
12	113060	浙 22 转债	5,629,779.86	0.33
13	127012	招路转债	5,567,606.93	0.32
14	123150	九强转债	5,240,109.59	0.30
15	113054	绿动转债	5,220,089.04	0.30
16	127056	中特转债	5,165,089.04	0.30
17	113061	拓普转债	5,148,396.71	0.30
18	113643	风语转债	5,060,361.64	0.29
19	113602	景 20 转债	4,929,495.89	0.29
20	127069	小熊转债	4,831,497.18	0.28
21	123161	强联转债	4,668,394.52	0.27
22	118014	高测转债	4,364,387.31	0.25
23	110085	通 22 转债	4,336,906.30	0.25

24	118012	微芯转债	4,224,152.53	0.25
25	113616	韦尔转债	4,212,022.99	0.24
26	127039	北港转债	4,069,671.66	0.24
27	118023	广大转债	3,967,106.85	0.23
28	110079	杭银转债	3,951,397.00	0.23
29	123149	通裕转债	3,936,618.83	0.23
30	118006	阿拉转债	3,761,233.52	0.22
31	127086	恒邦转债	3,609,569.59	0.21
32	123154	火星转债	3,482,031.49	0.20
33	118027	宏图转债	3,420,141.37	0.20
34	113644	艾迪转债	3,291,480.82	0.19
35	123144	裕兴转债	3,264,912.33	0.19
36	128048	张行转债	3,245,975.34	0.19
37	111010	立昂转债	3,197,478.08	0.19
38	113623	凤 21 转债	3,188,046.24	0.19
39	113631	皖天转债	3,098,491.50	0.18
40	118034	晶能转债	3,088,566.58	0.18
41	110088	淮 22 转债	3,038,757.04	0.18
42	123153	英力转债	2,898,872.98	0.17
43	118031	天 23 转债	2,869,116.67	0.17
44	113670	金 23 转债	2,818,333.11	0.16
45	113629	泉峰转债	2,794,722.60	0.16
46	118013	道通转债	2,737,159.47	0.16
47	118028	会通转债	2,573,769.86	0.15
48	123170	南电转债	2,537,798.43	0.15
49	113663	新化转债	2,497,545.21	0.15
50	127043	川恒转债	2,442,624.66	0.14
51	123063	大禹转债	2,439,987.95	0.14
52	128133	奇正转债	2,429,041.10	0.14
53	123082	北陆转债	2,339,572.60	0.14
54	123169	正海转债	2,329,568.63	0.14
55	113666	爱玛转债	2,288,022.75	0.13
56	110062	烽火转债	2,234,967.12	0.13
57	127066	科利转债	2,154,079.45	0.13
58	118032	建龙转债	2,135,132.05	0.12
59	118009	华锐转债	2,112,082.67	0.12
60	113641	华友转债	2,078,653.15	0.12
61	110087	天业转债	2,047,166.58	0.12
62	113056	重银转债	2,045,979.73	0.12
63	111004	明新转债	1,968,592.52	0.11
64	123131	奥飞转债	1,948,294.11	0.11
65	123130	设研转债	1,851,326.71	0.11

66	123048	应急转债	1,799,767.81	0.10
67	118011	银微转债	1,795,020.41	0.10
68	127031	洋丰转债	1,672,321.23	0.10
69	123163	金沃转债	1,643,215.67	0.10
70	128142	新乳转债	1,638,090.41	0.10
71	113654	永 02 转债	1,552,869.59	0.09
72	123192	科思转债	1,403,729.32	0.08
73	128121	宏川转债	1,237,723.29	0.07
74	127071	天箭转债	1,205,467.95	0.07
75	127020	中金转债	1,189,916.44	0.07
76	123142	申昊转债	1,183,967.12	0.07
77	123119	康泰转 2	1,172,526.03	0.07
78	127070	大中转债	1,171,601.37	0.07
79	113058	友发转债	1,168,935.62	0.07
80	113050	南银转债	1,161,944.67	0.07
81	128135	洽洽转债	1,145,600.00	0.07
82	127052	西子转债	1,074,475.34	0.06
83	113024	核建转债	1,069,373.15	0.06
84	111009	盛泰转债	1,066,602.74	0.06
85	110089	兴发转债	1,061,606.85	0.06
86	128134	鸿路转债	1,053,084.01	0.06
87	113053	隆 22 转债	1,028,764.93	0.06
88	123184	天阳转债	599,283.70	0.03
89	127076	中宠转 2	597,948.08	0.03
90	113648	巨星转债	453,090.25	0.03

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银安盛双债增强债券 A	浦银安盛双债增强债券 C
报告期期初基金份额总额	1,129,244,697.52	701,271,967.15
报告期期间基金总申购份额	130,060,512.34	142,557,888.93
减：报告期期间基金总赎回份额	456,987,158.23	171,501,418.24
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	802,318,051.63	672,328,437.84

## § 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自有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

## § 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

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、 中国证监会批准浦银安盛双债增强债券型证券投资基金募集的文件
- 2、 浦银安盛双债增强债券型证券投资基金基金合同
- 3、 浦银安盛双债增强债券型证券投资基金招募说明书
- 4、 浦银安盛双债增强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媒介上披露的各项公告
- 8、 中国证监会要求的其他文件

### 9.2 存放地点

上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层 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

2024 年 1 月 22 日