# 浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
送出日期:2018年8月27日

## §1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 浦银安盛安和回报定开混合 | |
| 基金主代码 | 004276 | |
| 交易代码 | 004276 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017年3月23日 | |
| 基金管理人 | 浦银安盛基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 163,502,506.83份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 浦银安盛安和回报A | 浦银安盛安和回报C |
| 下属分级基金的交易代码: | 004276 | 004277 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 157,026,222.60份 | 6,476,284.23份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在严格控制投资风险的前提下,力争实现超过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,寻找各类资产的最在良好投资机会。整体投资通过对风险的严格控制,运用多种影响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 | 沪深300指数收益率×20%+中证全债指数收益率×80%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券投资为主的混合型基金,属于中等风险、中等收益预期的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 浦银安盛基金管理有限公司 | 中国民生银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 顾佳 | 罗菲菲 |
| | 联系电话 | 021-23212888 | 010-58560666 |
| | 电子邮箱 | compliance@py-axa.com | tgbfxjdzx@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 021-33079999 或 400-8828-999 | 95568 |
| 传真 | | 021-23212905 | 010-58560798 |

2.4信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.py-axa.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人的办公场所 |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 基金级别 | 浦银安盛安和回报A | 浦银安盛安和回报C |
|---|---|---|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2018年1月1日-2018年6月30日) | 报告期(2018年1月1日-2018年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 5,592,118.75 | 472,486.27 |
| 本期利润 | 773,434.43 | 6,284.67 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0029 | 0.0002 |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.32% | 0.10% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年6月30日) | |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0181 | 0.0159 |
| 期末基金资产净值 | 159,867,963.87 | 6,579,041.33 |
| 期末基金份额净值 | 1.0181 | 1.0159 |

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。

4、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

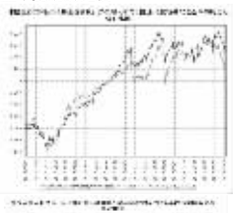
浦银安盛安和回报A

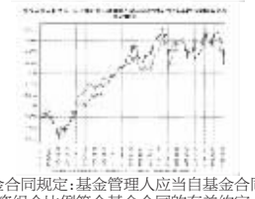
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -0.56% | 0.23% | -1.03% | 0.26% | 0.48% | -0.03% |
| 过去三个月 | 0.22% | 0.21% | -0.32% | 0.24% | 0.54% | -0.03% |
| 过去六个月 | 0.32% | 0.20% | 0.78% | 0.23% | -0.46% | -0.03% |
| 过去一年 | 4.02% | 0.17% | 2.65% | 0.19% | 1.37% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.00% | 0.16% | 4.17% | 0.18% | 0.83% | -0.02% |

浦银安盛安和回报C

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -0.58% | 0.23% | -1.03% | 0.26% | 0.45% | -0.03% |
| 过去三个月 | 0.14% | 0.21% | -0.32% | 0.24% | 0.46% | -0.03% |
| 过去六个月 | 0.10% | 0.20% | 0.78% | 0.23% | -0.68% | -0.03% |
| 过去一年 | 3.60% | 0.17% | 2.65% | 0.19% | 0.95% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.47% | 0.16% | 4.17% | 0.18% | 0.30% | -0.02% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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





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2017年3月23日至2017年9月22日。建仓期结束后符合相关规定。

## §4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浦银安盛基金管理有限公司(以下简称"浦银安盛")成立于2007年8月,股东为上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A.及上海国盛集团资产有限公司,公司总部设在上海,注册资本为人民币19.1亿元,股东持股比例分别为51%、39%和10%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理、境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务。

截至2018年6月30日止,浦银安盛旗下共管理36只基金,即浦银安盛价值成长混合型证券投资基金、浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛红利精选混合型证券投资基金、浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金、浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金、浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛日日盈货币市场基金、浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金 、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金、浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金、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、浦银安盛幸福聚益18个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金、浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金、浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金、浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)、浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安久回报定期开放混合型证券投资基金。

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,我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。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 褚艳辉 | 公司旗下浦银安盛新经济结构混合基金、浦银安盛盛世精选混合基金、浦银安盛安和回报定期开放混合基金、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金、浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛日日盈货币市场基金、浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金、浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金、浦银安盛幸福聚益18个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金、浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金、浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金、浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)、浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安久回报定期开放混合型证券投资基金。 | 2017年3月23日 | - | 10 | 褚艳辉先生,南京理工大学经济学硕士。2004年至2010年,先后就职于上海信息中心、爱建证券公司从事宏观经济、政策以及制造与消费行业研究工作,后在上海汽车财务公司担任投资经理助理之职。2011年4月加盟我司担任高级行业研究员。2013年2月至2014年4月,担任本公司权益类基金基金经理助理。2014年6月起,担任公司旗下浦银安盛盛世精选混合基金基金经理。2014年7月起,兼任公司旗下浦银安盛新经济结构混合基金基金经理。2017年2月起,兼任公司旗下浦银安盛经济带崛起混合基金基金经理。2017年3月起,兼任公司旗下浦银安盛安和回报定期开放混合基金基金经理。2018年4月起兼任浦银安盛安久回报定期开放混合基金基金经理。 |

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遵规守信情况的说明

本报告期内,本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,以及公司的规章制度,本着诚实守信、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。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人根据《公平交易管理规定》,建立健全有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个投资组合。

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)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;另一方面是公司对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。

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中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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年,股票市场在年初经历了一段短暂的冲高之后快速回落,2月和6月跌幅较大。从内部因素看,市场担心经济稳健增长的持续性,信用风险事件频发传导至股票市场,"去杠杆"叠加货币政策不放松,投资情绪偏悲观。从外部因素看,中美贸易摩擦升温,人民币在6月出现较大幅度贬值。这些因素对市场影响负面。股票市场表现不佳,呈现"一九行情",仅休闲服务、医药生物、食品饮料板块取得小幅正收益,大部分行业下跌。债券违约风险事件多次发生,信用风险的蔓延引发市场关注,投资者普遍谨慎。

报告期内,本基金的投资策略基本稳定,稳健增长的蓝筹股是主要配置方向,适度增加了食品饮料、医药生物的配置。固定收益投资上,基金对信用债仍然保持谨慎,采取中短久期的票息投资策略,同时做好现金管理。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛安和回报A基金份额净值为1.0181元,本报告期基金份额净值增长率为0.32%;截至本报告期末浦银安盛安和回报C基金份额净值为1.0159元,本报告期基金份额净值增长率为0.10%;同期业绩比较基准收益率为0.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们认为宏观经济有其韧性的一面,但也存在下行的压力。财政政策与货币政策均有较大的作为空间。央行两次降准释放流动性,未来仍有防松的可能。外部贸易摩擦增添了投资的不确定性,内部信用风险事件可能并未结束。

我们认为,股票市场已经反映了一些不确定因素,较大幅度的下跌也使估值优势进一步显现,投资机会逐渐增多,无需过度悲观。

考虑到当下的市场环境,结合内外部各种影响因素,本基金将把低估值和确定性作为投资的重要考量指标。基金对于发债人的筛选将更加严格,发债地区、行业、评级等都是关键考量因素,信用债的配置时机还需等待,基金将适度关注利率债的投资机会。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益,设立了浦银安盛基金管理有限公司估值委员会(以下简称"估值委员会"),制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由公司分管高管、金融工程部负责人、研究部负责人、风险管理部负责人、产品估值部和注册登记部负责人组成。估值委员会成员均具有5年以上专业工作经历,具备良好的专业经验、胜任能力和独立性。估值委员会的职责主要包括:保证基金估值的公平、合理;制订健全、有效的估值政策和程序;确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性;定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金基金经理未参与或决定基金的估值。

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司以及中债金融估值中心有限公司签订了《中债信息产品服务三方协议》。

本基金管理人与中证指数有限公司签订了《债券估值数据服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》第十六部分第三条约定,在符合有关基金分红条件的前提下, 本基金每个封闭期内收益分配次数最少为1次, 最多为12次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的90%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;本基金收益分配采用现金分红与红利再投资方式; 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本报告期内本基金进行了1次收益分配, 向A类份额持有人分配利润:12,654,671.75元,向C类份额持有人分配利润:1,815,159.19。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内, 中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,依法安全保管了基金财产,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督, 对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本基金本报告期内向A级份额持有人分配利润:12,654,671.75元,向C级份额持有人分配利润:1,815,159.19元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金
报告截止日: 2018年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2018年6月30日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | | |
| 银行存款 | | 7,351,031.43 | 8,918,387.97 |
| 结算备付金 | | 26,921.89 | 73,840.15 |
| 存出保证金 | | 25,705.74 | 27,290.46 |
| 交易性金融资产 | | 137,219,562.10 | 442,196,991.05 |
| 其中:股票投资 | | 23,001,062.10 | 69,415,723.85 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 114,218,500.00 | 372,781,267.20 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | 21,374,137.06 | 19,440,269.16 |
| 应收证券清算款 | | 856,886.08 | 72,479.96 |
| 应收利息 | | 1,057,830.32 | 9,369,204.74 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 167,912,074.62 | 480,098,463.49 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2018年6月30日 | 上年度末 2017年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 1,089,666.12 | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 137,600.87 | 405,517.49 |
| 应付托管费 | | 27,520.16 | 81,103.48 |
| 应付销售服务费 | | 1,903.84 | 19,351.83 |
| 应付交易费用 | | 22,218.03 | 53,605.46 |
| 应交税费 | | 7,641.91 | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 178,518.49 | 330,000.00 |
| 负债合计 | | 1,465,069.42 | 889,578.26 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 163,502,506.83 | 458,050,183.97 |
| 未分配利润 | | 2,944,498.37 | 21,158,701.26 |
| 所有者权益合计 | | 166,447,005.20 | 479,208,885.23 |
| 负债和所有者权益总计 | | 167,912,074.62 | 480,098,463.49 |

注: 报告截止日2018年6月30日, 浦银安盛安和回报A基金份额净值1.0181元,基金份额总额157,026,222.60份;浦银安盛安和回报C基金份额净值1.0159元,基金份额总额6,476,284.23份。浦银安盛安和回报定开混合份额总额合计为163,502,506.83份。

6.2 利润表

会计主体:浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年3月23日(基金合同生效日)至2017年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 3,094,067.57 | 6,081,147.05 |
| 1.利息收入 | | 5,486,080.35 | 4,500,538.37 |
| 其中:存款利息收入 | | 128,864.17 | 2,045,691.20 |
| 债券利息收入 | | 4,218,843.90 | 973,962.59 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,138,372.28 | 1,480,894.58 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | | 2,740,081.23 | 744,352.28 |
| 其中:股票投资收益 | | 2,726,671.07 | -16,214.97 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | -5,719.78 | 41,653.25 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | 19,129.94 | 718,914.00 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | | -5,284,885.92 | 836,256.40 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | | 152,791.91 | - |
| 减:二、费用 | | 2,314,348.47 | 1,839,127.38 |
| 1. 管理人报酬 | | 1,562,669.46 | 1,239,279.61 |
| 2. 托管费 | | 312,533.90 | 247,855.87 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.8.2.3 | 59,775.16 | 59,246.81 |
| 4. 交易费用 | | 178,927.91 | 176,048.09 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | | 197,118.49 | 116,697.00 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | | 779,719.10 | 4,242,019.67 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | | 779,719.10 | 4,242,019.67 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 458,050,183.97 | 21,158,701.26 | 479,208,885.23 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 779,719.10 | 779,719.10 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列) | -294,547,677.14 | -4,524,091.06 | -299,071,768.19 |
| 其中:1.基金申购款 | 430,985.94 | 8,637.06 | 439,623.00 |
| 2.基金赎回款 | -294,978,663.08 | -4,532,728.11 | -299,511,391.19 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列) | - | -14,469,830.94 | -14,469,830.94 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 163,502,506.83 | 2,944,498.37 | 166,447,005.20 |
| 项目 | 上年度可比期间 2017年3月23日(基金合同生效日)至2017年6月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 458,050,183.97 | - | 458,050,183.97 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 4,242,019.67 | 4,242,019.67 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列) | - | - | - |
| 其中:1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 458,050,183.97 | 4,242,019.67 | 462,292,203.64 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

郁蓓华 郁蓓华 钱琨

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2016]3179号《关于准予浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金注册的批复》核准,由浦银安盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币457,865,450.98元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第301号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》于2017年3月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为458,050,183.97份基金份额,其中认购资金利息折合184,732.99份基金份额。本基金的基金管理人为浦银安盛基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司(以下简称"中国民生银行")。

根据《浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》和《浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据认购、申购费用收取方式的不同,基金份额分为不同类别:在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用的为A类基金份额;不收取认购、申购费用,从本类别基金资产中计提销售服务费的为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。

本基金为定期开放式基金。封闭期为自基金合同生效之日起(含)或自每一开放期结束之日次日起(含)12个月的期间。本基金自封闭期结束之后第一个工作日起进入不少于5个工作日且不超过20 个工作日的开放期,具体期间由基金管理人在上一个封闭期结束前公告说明。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》和《浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为:国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、股指期货、权证、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为 :股票投资占基金资产的比例为0-30%;开放期内,每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保持现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;在封闭期内,本基金不受前述5%的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金的业绩比较基准为:沪深300 指数收益率×20%+中证全债指数收益率×80%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称 "企业会计准则")、中国证监会颁布的 《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月1日至2018年6月30日期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号 《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》、《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务, 以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 浦银安盛基金管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国民生银行股份有限公司 | 基金托管人、基金代销机构 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 基金管理人的控股股东、基金代销机构 |

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立,并以一般交易价格为定价基础。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注:本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

注:本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注:本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注: 本基金在本报告期与上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年3月23日(基金合同生效日)至2017年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,562,669.46 | 1,239,279.61 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 420,770.78 | 405,735.77 |

注:支付基金管理人浦银安盛的基金管理费按前一日的基金资产净值的1.0%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算方法如下:

H=E×1.0%/当年