

# 浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金

## 2018年第四季度报告

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。

本报告期末，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中所认定的异常交易行为。报告期末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5%的情形。

### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度，经济形势延续了前期的弱势特征。中央经济工作会议定调经济运行出现变化及忧虑点，“外部环境复杂严峻，经济面临下行压力”。社融增速下行，PMI指标、规模以上工业企业增加值、房地产新开工与销售等各类指标都不尽人意。当前国内经济处于下行周期，上市公司整体业绩增速亦反映这一趋势。

总体看，随着各类风险的相继释放，股票市场在四季度再次出现了比较明显的调整。各类市场指数均出现下跌，从行业角度看，跌幅靠前的既有钢铁、采掘、化工等传统周期板块，也有医药生物、食品饮料等大消费板块，显示出市场预期较悲观，风险偏好较低、信心较弱。

报告期内，本基金采取了稳健的投资策略，采取了低于业绩基准的权益仓位，并配置了相当的固定收益类品种。虽然净值总体回撤幅度不大，但是受系统性风险影响，为持有人获取绝对收益的难度显著增加，基金净值表现一般。从投资结构上看，基金规避了周期性板块，食品饮料、大金融、交运、公用事业等低估值、稳健增长的行业是权益类资产的主要配置方向；基金均衡配置了利率债、信用债等品种，基本都为中短久期。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛安恒回报定开混合A基金份额净值为0.9867元，本报告期基金份额净值增长率为-1.62%；截至本报告期末浦银安盛安恒回报定开混合C基金份额净值为0.9853元，本报告期基金份额净值增长率为-1.71%；同期业绩比较基准收益率为0.56%。

### 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元的情形。

## § 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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	27,507,084.00	13.08
2	其中:股票	27,507,084.00	13.08
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	166,288,000.00	79.10
5	其中:债券	166,288,000.00	79.10
6	资产支持证券	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	金融衍生品投资	-	-
9	其他资产	9,097,215.00	4.36
10	银行存款和结算备付金合计	4,229,405.26	2.01
11	其他资产	2,214,672.57	1.06
12	合计	210,346,421.83	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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	27,507,084.00	13.08
2	其中:股票	27,507,084.00	13.08
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	166,288,000.00	79.10
5	其中:债券	166,288,000.00	79.10
6	资产支持证券	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	金融衍生品投资	-	-
9	其他资产	9,097,215.00	4.36
10	银行存款和结算备付金合计	4,229,405.26	2.01
11	其他资产	2,214,672.57	1.06
12	合计	210,346,421.83	100.00

### 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

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	001306	上海银行	300,000	20,088,000.00	0.69
2	11380406	18F中国银行	300,000	20,088,000.00	0.69
3	11380718	18F招商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
4	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
5	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
6	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
7	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
8	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
9	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
10	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69

### 5.4 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	018006	18国债01	200,000	20,088,000.00	0.69
2	11380406	18F中国银行	300,000	20,088,000.00	0.69
3	11380718	18F招商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
4	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
5	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
6	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
7	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
8	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
9	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
10	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69

### 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资产支持证券投资明细

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	180019	18国债01	6,500,000	650,965,000.00	0.64
2	180004	18国债01	4,000,000	422,080,000.00	0.414
3	180019	18国债01	3,500,000	360,280,000.00	0.343
4	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
5	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
6	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
7	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
8	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
9	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
10	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201

### 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五名贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018006	18国债01	200,000	20,088,000.00	0.69
2	11380406	18F中国银行	300,000	20,088,000.00	0.69
3	11380718	18F招商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
4	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
5	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
6	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
7	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
8	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
9	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69
10	10180426	18F工商银行	300,000	20,088,000.00	0.69

### 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股指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180019	18国债01	6,500,000	650,965,000.00	0.64
2	180004	18国债01	4,000,000	422,080,000.00	0.414
3	180019	18国债01	3,500,000	360,280,000.00	0.343
4	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
5	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
6	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
7	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
8	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
9	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
10	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201

### 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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180019	18国债01	6,500,000	650,965,000.00	0.64
2	180004	18国债01	4,000,000	422,080,000.00	0.414
3	180019	18国债01	3,500,000	360,280,000.00	0.343
4	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
5	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
6	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
7	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
8	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
9	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
10	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201

### 5.9 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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180019	18国债01	6,500,000	650,965,000.00	0.64
2	180004	18国债01	4,000,000	422,080,000.00	0.414
3	180019	18国债01	3,500,000	360,280,000.00	0.343
4	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
5	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
6	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
7	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
8	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
9	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
10	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201

### 5.10 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资产支持证券投资明细

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	180019	18国债01	6,500,000	650,965,000.00	0.64
2	180004	18国债01	4,000,000	422,080,000.00	0.414
3	180019	18国债01	3,500,000	360,280,000.00	0.343
4	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
5	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
6	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
7	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
8	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
9	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
10	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201

### 5.11 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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180019	18国债01	6,500,000	650,965,000.00	0.64
2	180004	18国债01	4,000,000	422,080,000.00	0.414
3	180019	18国债01	3,500,000	360,280,000.00	0.343
4	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
5	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
6	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
7	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
8	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
9	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
10	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201

### 5.12 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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180019	18国债01	6,500,000	650,965,000.00	0.64
2	180004	18国债01	4,000,000	422,080,000.00	0.414
3	180019	18国债01	3,500,000	360,280,000.00	0.343
4	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
5	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
6	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
7	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
8	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
9	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
10	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201

### 5.13 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资产支持证券投资明细

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	180019	18国债01	6,500,000	650,965,000.00	0.64
2	180004	18国债01	4,000,000	422,080,000.00	0.414
3	180019	18国债01	3,500,000	360,280,000.00	0.343
4	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
5	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
6	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
7	10180426	18F工商银行	2,000,000	204,720,000.00	0.201
8	1				