

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

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2019年1月21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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年1月17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2018年10月1日起至2018年12月31日止。

2 基金产品概况

基金名称	浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金
基金代码	000274
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年9月3日
报告期末基金份额总额	212,379,516.28份
投资目标	在严格控制风险的前提下，力争实现超过业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金主要采用自下而上的方法对基金的资产配置、行业配置、股票配置、债券配置、现金配置等进行动态调整，通过定期评估和不定期调整，整体优化投资组合的配置比例，从而达到基金资产的保值增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×15%+中证全债指数收益率×85%
风险收益特征	本基金为偏债型基金为主的投资组合，其收益风险预期介于货币市场基金与股票型基金之间，属于股票型基金。
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金A类
下属分级基金的交易代码	000274
报告期末下属分级基金的份额总额	168,267,862.37份
报告期末下属分级基金的单位净值	144,121,695.01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(2018年10月1日 - 2018年12月31日)	
报告期初总资产		浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金	
1.本期已实现收益	-782,000.00	2018年9月3日	-243,496.30
2.本期利润	-2,730,130.54	2018年9月3日	-765,032.44
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0162	2018年9月3日	-0.0071
4.期末基金份额净值	166,018,791.39	43,474,440.00	
5.期末基金资产净值	0.9897	0.9863	

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将低于所列数字。

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

浦银安盛安恒回报定期开放混合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	-1.62%	0.23%	0.01%	0.24%	-2.18%	-0.01%

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

浦银安盛安恒回报定期开放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	-1.71%	0.23%	0.01%	0.24%	-2.27%	-0.01%

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将低于所列数字。

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。

3.3 基金净值表现

3.3.1 本报告期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

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《公平交易制度》，建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下每一个基金组合。

2.证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券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性情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定，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取最大利益。本报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.6 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资产净值不满足二百人的情形。

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期开混合A基金份额净值为144.121,695.01份。

0.9863元，报告期内本基金份额净值增长率为-0.35%。

2.本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五百万元的情形。

3.本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过基金资产净值的5%的情形。

4.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值低于五千万的情形。

5.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值低于两个百分点的情形。

6.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值低于两个百分点且偏离度大于0.5%的情形。

7.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于2%的情形。

8.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于3%的情形。

9.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于5%的情形。

10.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于10%的情形。

11.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于20%的情形。

12.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于30%的情形。

13.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于50%的情形。

14.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于100%的情形。

15.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于200%的情形。

16.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于300%的情形。

17.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于500%的情形。

18.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于1000%的情形。

19.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于2000%的情形。

20.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于3000%的情形。

21.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于5000%的情形。

22.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于10000%的情形。

23.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于20000%的情形。

24.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于30000%的情形。

25.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于50000%的情形。

26.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于100000%的情形。

27.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于200000%的情形。

28.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于300000%的情形。

29.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于500000%的情形。

30.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于1000000%的情形。

31.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于2000000%的情形。

32.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于3000000%的情形。

33.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于5000000%的情形。

34.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于10000000%的情形。

35.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于20000000%的情形。

36.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于30000000%的情形。

37.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于50000000%的情形。

38.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于100000000%的情形。

39.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于200000000%的情形。

40.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于300000000%的情形。

41.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于500000000%的情形。

42.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于1000000000%的情形。

43.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于2000000000%的情形。

44.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于3000000000%的情形。

45.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于5000000000%的情形。

46.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于10000000000%的情形。

47.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于20000000000%的情形。

48.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于30000000000%的情形。

49.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于50000000000%的情形。

50.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于100000000000%的情形。

51.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于200000000000%的情形。

52.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于300000000000%的情形。

53.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于500000000000%的情形。

54.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于1000000000000%的情形。

55.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于2000000000000%的情形。

56.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于3000000000000%的情形。

57.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于5000000000000%的情形。

58.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于10000000000000%的情形。

59.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于20000000000000%的情形。

60.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于30000000000000%的情形。

61.本基金本报告期内未出现一个自然日基金资产净值偏离度大于50