浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金 2019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:兴业银行股份有限公司
送出日期:2019年8月23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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2019年8月21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2019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	浦银普瑞	
基金主代码	006200	
交易代码	006200	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年12月13日	
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	
报告期末基金份额总额	20,002,833.42份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	浦银普瑞A	浦银普瑞C
下属分级基金的交易代码:	006200	006201
报告期末下属分级基金的份额总额	20,000,185.55份	2,647.87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,力争长期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,通过内动性考察和信用分析策略进行筛选。整体投资通过对风险的严格控制,运用多种和税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	中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金和股票型基金。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	曾麓燕
	联系电话	021-23212888	021-52629999-212040
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	zengluyan@cib.com.cn
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95561
传真		021-23212885	021-62538023

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	浦银普瑞A	浦银普瑞C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	797,972.80	21,513.29
本期利润	664,844.06	20,972.54
加权平均基金份额本期利润	0.0096	0.0116
本期基金份额净值增长率	1.18%	1.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0071	0.0052
期末基金资产净值	20,273,929.98	2,678.89
期末基金份额净值	1.0137	1.0117

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

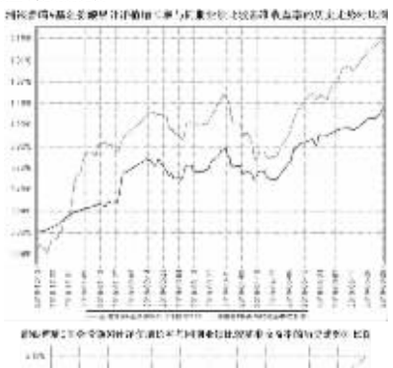
浦银普瑞A

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	0.26%	0.02%	0.52%	0.03%	-0.26%	-0.01%
过去三个月	0.43%	0.04%	0.64%	0.06%	-0.21%	-0.02%
过去六个月	1.18%	0.04%	2.00%	0.06%	-0.82%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.37%	0.04%	2.16%	0.06%	-0.79%	-0.02%

浦银普瑞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	0.23%	0.01%	0.52%	0.03%	-0.29%	-0.02%
过去三个月	0.34%	0.04%	0.64%	0.06%	-0.30%	-0.02%
过去六个月	1.00%	0.04%	2.00%	0.06%	-1.00%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.17%	0.04%	2.16%	0.06%	-0.99%	-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:1、本基金合同生效日为2018年12月13日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满1年。

2、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2018年12月13日至2019年6月12日。建仓期结束时符合相关规定。

§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2019年6月30日止,浦银安盛旗下共管理46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、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、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3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、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、浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛中短债债券型证券投资基金、浦银安盛普益纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛融定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金、浦银安盛全球智能科技股票型证券投资基金(QDII)、浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛双债增强债券型证券投资基金。

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		
钟明	公司旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金、浦银安盛中短债债券型证券投资基金、浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金、浦银安盛安盛双债增强债券型证券投资基金基金经理。	2018年12月13日	-	14	钟明女士,复旦大学MBA。2005年至2017年被银行关业基金管理有限公司,先后从事基金会计岗位、债券交易员岗位、基金经理助理岗位和基金经理岗位。2017年5月加盟浦银安盛基金管理有限公司,担任固定收益投资部总监之职。2017年11月起,担任公司旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金以及浦银安盛日日鑫货币市场基金、浦银安盛中短债债券型证券投资基金、浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金的基金经理。2018年12月起担任浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金的基金经理。2019年5月起担任浦银安盛双债增强债券型证券投资基金的基金经理。
章源枫	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、浦银安盛达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、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、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发起式证券投资基金、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、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、浦银安盛日日鑫货币市场基金、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3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年6月起担任公司旗下浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2017年6月至2018年7月担任公司旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金及浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017年6月至2019年1月担任公司旗下浦银安盛盛勤3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2018年9月起兼任浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2018年11月起担任公司旗下浦银安盛普益纯债债券型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。2019年3月起担任公司旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金及浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金基金经理。	2019年3月8日	-	8	章源枫先生,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、投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、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年6月起担任公司旗下浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2017年6月至2018年7月担任公司旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金及浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017年6月至2019年1月担任公司旗下浦银安盛盛勤3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2018年9月起兼任浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2018年11月起担任公司旗下浦银安盛普益纯债债券型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。2019年3月起担任公司旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金及浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金基金经理。
郑双超	固定收益类基金经理助理	2018年12月13日	-	8	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担任固定收益类基金经理助理。
杜雪川	固定收益类基金经理助理	2018年12月13日	-	6	杜雪川先生,上海交通大学应用经济学硕士,2013年7月至2016年4月就职于国泰君安期货,先后从事分析师、公司评级及信用分析师等岗位。2016年4月加盟浦银安盛基金管理有限公司,担任固定收益投资部信用研究员岗位。2018年4月4日调岗担任固定收益类基金经理助理。

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

2019年上半年经济基本面先扬后抑,债券收益率水平呈现宽幅震荡行情。一季度,信贷和社融超预期增长,建安投资增速转正拉动地产投资增速超预期,消费和大宗商品价格韧性仍强,经济基本面表现良好,与年初市场一致看空上半年经济的预期不符。全球风险偏好显著回升,国内股票市场快速上涨,债市收益率水平在年初快速下行后,整体以弱势震荡的走势消化风险偏好回升和基本面预期差。流动性方面,央行继续维持流动性合理充裕,先后落地了降准、TMLF等宽松政策,资金利率整体维持在低位,中枢较去年四季度低约15-20bp。一季度收益率曲线长端钝化,呈窄幅震荡行情,信用债受益于宽信用政策发力信用利差明显收窄。二季度初在一季度超预期信用扩张和经济数据冲击下,收益率曲线整体上移。但经济并没有维持以往周期中呈现的惯性上升态势,总需求在信用仍处于扩张初期就出现下滑,这与本轮经济周期的政策导向密切相关。4月19日政治局会议重提“供给侧结构性改革”、“坚持结构性去杠杆”、“推动高质量发展中防范化解风险”显示出当前经济政策在稳增长与调结构、控制整体宏观杠杆率的天平上更倾向后者,在一定程度上抑制了政府加杠杆稳定经济增长的政策空间。5月末受个别银行突发同业风险事件的影响,银行间货币市场出现了流动性分层现象,为避免事件进一步发酵,货币市场流动性趋于更加宽松。在中美贸易摩擦加剧、二季度基本面经济数据下滑以及银行间市场资金利率显著下行的影响下,收益率曲线震荡下行,曲线整体陡峭化。

报告期内,本基金以流动性管理为主,高配1-3年利率债,择机进行了中长期限利率债波段操作,整体仓位保持高流动性的状态。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银普瑞A基金份额净值为1.0137元, 本报告期基金份额净值增长率为1.18%;截至本报告期末浦银普瑞C基金份额净值为1.0117元,本报告期基金份额净值增长率为1.00%;同期业绩比较基准收益率为2.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,考虑消费贡献了6成经济增长的动能,地产在因城施策之下出现结构性分化整体温和下行, 周期变化的幅度减弱, 经济基本面短期仍以窄幅波动为主。银行间流动性分层的情况预计仍将持续,金融机构的信用风险面临再定价,中小银行金融机构负债的难度增大、稳定性减弱,中低等级发行人主体的信用利差有走扩风险。财政支出一季度节奏较快,二季度趋于平稳,近期财政政策托底经济的积极性较强, 下半年财政政策变化依然是市场面临的较大不确定性之一。总的来说,考虑流动性风险也依然没有完全消除,货币政策或继续维持较为宽松的状态,无风险利率大幅上行的风险不大,同时基本面窄幅波动、通胀水平仍高的情况下利率也缺乏大幅下行的想象空间, 预计一段时间内仍以震荡为主, 等待新的变量出现。

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,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。三季度初将以震荡市的思维操作,以Carry为主,逢高择机参与中长端利率债交易,力争获取稳定的票息收入和一定的超额收益。

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副总经理暨首席运营官、风险管理部负责人、指数与量化投资部负责人、研究部负责人、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,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次收益分配比例不得低于该次期末可供分配利润的20%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

本基金本报告期内未进行利润分配, 符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

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、本报告期内超过连续二十个工作日基金资产净值低于五千万,未超过连续六十个工作日。

§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

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为;基金管理人在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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:浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	78,278.09	126,621,788.37
结算备付金		18,000.00	-
存出保证金		2,506.47	-
交易性金融资产	6.4.7.2	18,252,800.00	11,651,040.00
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		18,252,800.00	11,651,040.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,800,000.00	90,200,000.00
应收证券清算款		-	52,075.07
应收利息	6.4.7.5	227,090.87	526,756.21
应收股利		-	-
应收申购款		-	100.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		20,388,675.43	227,461,756.65
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	27,008,064.90
应付管理人报酬		4,991.67	32,941.43
应付托管费		1,663.90	10,980.47
应付销售服务费		0.72	4,145.71
应付交易费用	6.4.7.7	2,279.94	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	103,130.53	20,276.32
负债合计		112,066.56	27,076,408.83
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	20,002,833.42	200,000,044.95
未分配利润	6.4.7.10	273,775.45	375,304.87
所有者权益合计		20,276,608.87	200,375,349.82
负债和所有者权益总计		20,388,675.43	227,461,756.65

注:报告截止日2019年6月30日,浦银安盛普瑞纯债债券A基金份额净值1.0137元,基金份额总额20,000,185.55份;浦银安盛普瑞纯债债券C基金份额净值1.0117元,基金份额总额2,647.87份。浦银安盛普瑞纯债债券份额总额合计为20,002,833.42份。

6.2 利润表

会计主体:浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入		1,018,691.96	-
1.利息收入		1,462,138.16	-
其中:存款利息收入	6.4.7.11	194,752.08	-
债券利息收入		1,129,284.31	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		138,092.77	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-309,777.20	-
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-309,777.20	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-133,670.00	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	-	-
减:二、费用		332,875.37	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	107,281.62	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	35,762.89	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,233.80	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,418.61	-
5. 利息支出		73,101.78	-
其中:卖出回购金融资产支出		73,101.78	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	111,089.57	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		685,816.59	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		685,816.59	-

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	200,000,044.95	375,304.87	200,375,349.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	685,816.59	685,816.59
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)	-179,997,211.53	-787,346.01	-180,784,557.54
其中:1.基金申购款	49,462,543.83	337,706.93	50,000,249.76
2.基金赎回款	-229,459,755.36	-1,125,052.94	-230,784,808.30
五、期末所有者权益(基金净值)	20,002,833.42	273,775.45	20,276,608.87
项目	上年度可比期间 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

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

浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金(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[2017]980号《关于准予浦银安盛日日利货币市场基金注册的批复》和中国证监会证监许可[2018]1187号《关于准予浦银安盛日日利货币市场基金变更注册的批复》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《浦银安盛普瑞纯债债券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226,999,935.14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(2018)第0560号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金基金合同》于2018年12月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为226,999,935.16份基金份额,其中认购资金利息折合0.02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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金基金合同》和《浦银安盛普瑞纯债债券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、赎回费及销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同类别:在投资者认/申购基金时收取认购/申购费,在赎回时根据持有期限收取赎回费,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的为A类基金份额;不收取认购/申购费用,而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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛普瑞纯债债券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:具有良好流动性的债券(国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、地方政府债、中小企业私募债、次级债)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款等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)。本基金不投资于股票、权证,也不投资于可转换债券、可交换债券。本基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证综合债指数收益率。

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》、《浦银安盛普瑞纯债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2019年1月1日至2019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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基