

信息披露 Disclosure

浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金

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
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、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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更新。
本半年度报告摘要摘自半年度报告全文,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。
本报告自2019年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

基金名称	浦银安盛安恒回报定期混合
基金代码	004274
交易代码	004274
基金运作方式	定期开放
基金合同生效日	2016年8月9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
报告期内基金份额总额	212,379,518.29份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称:	浦银安盛安恒回报定期混合C
下属分级基金的交易代码:	004274
报告期末下属分级基金的份额总	168,257,852.79份
	44,121,665.91份

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。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,整体投资通过对风险严格控制,运用多种积极的投资管理增值策略,实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×10%+中证全指指数收益率×85%
风险收益特征	本基金为追求投资与资产增值的基金,其风险收益预期高于货币型基金和债券型基金基金,低于股票型基金。

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
姓名	魏佳	曹慧燕
联系电话	021-2221-2288	021-53252999-212040
电子邮箱	compliance@py-asa.com	zenghuiyan@cib.com.cn
客户服务电话	021-33078999 或 400-8828-999	95561
传真	021-2221-2886	021-62538823

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

名称	浦银安盛安恒回报定期混合C
姓名	魏佳
联系电话	021-2221-2288
电子邮箱	compliance@py-asa.com
客户服务电话	021-33078999 或 400-8828-999
传真	021-2221-2886

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

名称	浦银安盛安恒回报定期混合C
姓名	魏佳
联系电话	021-2221-2288
电子邮箱	compliance@py-asa.com
客户服务电话	021-33078999 或 400-8828-999
传真	021-2221-2886

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

名称	浦银安盛安恒回报定期混合C
姓名	魏佳
联系电话	021-2221-2288
电子邮箱	compliance@py-asa.com
客户服务电话	021-33078999 或 400-8828-999
传真	021-2221-2886

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

名称	浦银安盛安恒回报定期混合C
姓名	魏佳
联系电话	021-2221-2288
电子邮箱	compliance@py-asa.com
客户服务电话	021-33078999 或 400-8828-999
传真	021-2221-2886

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

名称	浦银安盛安恒回报定期混合C
姓名	魏佳
联系电话	021-2221-2288
电子邮箱	compliance@py-asa.com
客户服务电话	021-33078999 或 400-8828-999
传真	021-2221-2886

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

名称	浦银安盛安恒回报定期混合C
姓名	魏佳
联系电话	021-2221-2288
电子邮箱	compliance@py-asa.com
客户服务电话	021-33078999 或 400-8828-999
传真	021-2221-2886

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

名称	浦银安盛安恒回报定期混合C
姓名	魏佳
联系电话	021-2221-2288
电子邮箱	compliance@py-asa.com
客户服务电话	021-33078999 或 400-8828-999
传真	021-2221-2886

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

名称	浦银安盛安恒回报定期混合C
姓名	魏佳
联系电话	021-2221-2288
电子邮箱	compliance@py-asa.com
客户服务电话	021-33078999 或 400-8828-999
传真	021-2221-2886

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

名称	浦银安盛安恒回报定期混合C
姓名	魏佳
联系电话	021-2221-2288
电子邮箱	compliance@py-asa.com
客户服务电话	021-33078999 或 400-8828-999
传真	021-2221-2886

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

名称	浦银安盛安恒回报定期混合C
姓名	魏佳
联系电话	021-2221-2288
电子邮箱	compliance@py-asa.com
客户服务电话	021-33078999 或 400-8828-999
传真	021-2221-2886

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

名称	浦银安盛安恒回报定期混合C
姓名	魏佳
联系电话	021-2221-2288
电子邮箱	compliance@py-asa.com
客户服务电话	021-33078999 或 400-8828-999
传真	021-2221-2886

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

名称	浦银安盛安恒回报定期混合C
姓名	魏佳
联系电话	021-2221-2288
电子邮箱	compliance@py-asa.com
客户服务电话	021-33078999 或 400-8828-999
传真	021-2221-2886

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

名称	浦银安盛安恒回报定期混合C
姓名	魏佳
联系电话	021-2221-2288
电子邮箱	compliance@py-asa.com
客户服务电话	021-33078999 或 400-8828-999
传真	021-2221-2886

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

名称	浦银安盛安恒回报定期混合C
姓名	魏佳
联系电话	021-2221-2288
电子邮箱	compliance@py-asa.com
客户服务电话	021-33078999 或 400-8828-999
传真	021-2221-2886

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

名称	浦银安盛安恒回报定期混合C
姓名	魏佳
联系电话	021-2221-2288
电子邮箱	compliance@py-asa.com
客户服务电话	021-33078999 或 400-8828-999
传真	021-2221-2886

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

名称	浦银安盛安恒回报定期混合C
姓名	魏佳
联系电话	021-2221-2288
电子邮箱	compliance@py-asa.com
客户服务电话	021-33078999 或 400-8828-999
传真	021-2221-2886

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

名称	浦银安盛安恒回报定期混合C
姓名	魏佳
联系电话	021-2221-2288
电子邮箱	compliance@py-asa.com
客户服务电话	021-33078999 或 400-8828-999
传真	021-2221-2886

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

名称	浦银安盛安恒回报定期混合C
姓名	魏佳
联系电话	021-2221-2288
电子邮箱	compliance@py-asa.com
客户服务电话	021-33078999 或 400-8828-999
传真	021-2221-2886

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

名称	浦银安盛安恒回报定期混合C
姓名	魏佳
联系电话	021-2221-2288
电子邮箱	compliance@py-asa.com
客户服务电话	021-33078999 或 400-8828-999
传真	021-2221-2886

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理简介

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
姓名	职务	任期开始日期	离任日期	
魏佳	基金经理	2016年8月9日	-	魏佳先生,浦银理工大学经济学硕士,2004年毕业于上海财经大学,先后任职于上海信息中心、建设银行上海市分行、浦发银行总行,从事宏观经济、货币政策以及债券与货币行业研究工作,在上海汽车财务公司从事投融资管理职务。2014年11月担任公司旗下浦银安盛新经济精选混合型证券投资基金基金经理,2017年2月起,兼任公司旗下浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金基金经理,2018年11月起担任浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金基金经理。2019年7月至2019年8月担任浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金基金经理。
魏佳	基金经理	2018年8月9日	-	魏佳先生,浦银理工大学经济学硕士,2004年毕业于上海财经大学,先后任职于上海信息中心、建设银行上海市分行、浦发银行总行,从事宏观经济、货币政策以及债券与货币行业研究工作,在上海汽车财务公司从事投融资管理职务。2014年11月担任公司旗下浦银安盛新经济精选混合型证券投资基金基金经理,2017年2月起,兼任公司旗下浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金基金经理,2018年11月起担任浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金基金经理。2019年7月至2019年8月担任浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金基金经理。

注:1.本基金基金经理的聘任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循行业协会《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,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的前提下,为基金份额持有人追求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内本基金投资情况的专项说明
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《公平交易管理制度》,建立健全有效的公平交易执行体系,保证公平对待下的每一个投资组合。

在具体分析中,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控制制度,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,详细制定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和机制,以保证投资指令交易过程的公平性;从事后监控角度上,一方面定期定期股票交易情况进行分析,对不同类型的(同一、同一、同一)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;在确定交易价差对相关基金业绩差异的准确性;同时对于投资组合及其各投资类别的收益差异的分析;另一方面是公司对公司交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期核查,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。报告期内未发生旗下所有投资组合参与的交易方向、交易品种及交易金额等异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内本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,经济基本面叠加通胀预期的货币政策,债券市场出现一波阶段性行情。权益市场表现为两个阶段。第一阶段是在宽信用预期下债券利率的上升,随后,受不确定性因素的增多,市场进入第二阶段,出现高位回落与震荡整理。主要指数均出现上涨,市场风格偏向蓝筹,在普涨的背景下,一些主题基金也有阶段性表现。食品饮料、非银金融、农林牧渔等行业涨幅靠前,建筑装修、钢铁、传媒仅录得个别涨幅。

报告期内,基金采取了“固收+”的投资策略。基金配置了较大比例的固收类资产,作为整个组合的“安全垫资产”。考虑到信用风险暴露有所增加,基金基本未投资品种的信用评级,避免在债市出现事件性影响波及基金净值稳定。基金基本未投资品种信用评级的策略。此外,基金做市日常现金管理。基金维持了一定的权益资产配置。本基金主要获取阿尔法收益,在投资运作中,沿着消费与蓝筹的主线做配置。总体看,基金在追求较好的风险收益比的前提下,取得不错的绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的投资表现
截至本报告期末浦银安盛安恒回报定期开放混合A基金份额净值1.0104元,本报告期基金份额净值增长率为7.92%;截至本报告期末浦银安盛安恒回报定期开放混合C基金份额净值1.0615元,本报告期基金份额净值增长率为7.73%;同期业绩比较基准收益率为5.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望
展望下半年,宏观经济增速预计保持下半年的态势。必要时,逆周期的政策调节有望托底经济,内需消费是拉动经济的最重要动力,外部经济复杂对中国经济前景挑战和不确定性。实现高质量发展,国企改革、金融供给侧改革等是市场的关键点。尽管信贷与通胀预期已有一定程度,但未实现货币宽松,不排除通胀超预期风险。股市市场经过前期调整,估值水平有所回落,市场情绪有所修复,市场走势有所好转。我们认为,在追求权益资产的长期回报,从投资的确定性来看,选择景气行业的龙头公司是主要投资策略。考虑到整体经济未来景气度可能的下行,固收投资的市场具备投资价值,利率债的投资机会相对确定。未来中债国债利率有望进一步走稳的格局,高评级利率债相对有保护空间。

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、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《中债估值产品服务三方协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配的情况的说明
本基金管理人根据《基金合同》第十六条第三条约,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每个会计年度利润分配次数最多为12次,最多为12次,每次收益分配比例不得低于当期可供分配利润的90%。若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

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20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5,000万元的情形。

5.1 报告期内本基金无重大诉讼、仲裁、行政处罚等情况的说明
5.2 报告期内,本基金严格遵守《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约定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 管理人对报告期内本基金投资运作合规性、净值计算、利润分配等情况的说明
报告期内,本托管人根据有关法律、法规、基金合同和托管协议的约定,对基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.4 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.5 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.6 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.7 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.8 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.9 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.10 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.11 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.12 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.13 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.14 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.15 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.16 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.17 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.18 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.19 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.20 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.21 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.22 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.23 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.24 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.25 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.26 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.27 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

5.28 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金资产净值、基金收益分配、基金费用开支等方面进行了必要的监督和复核,未发现其有损害基金份额持有人利益的行为。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理简介

基金管理人:浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金
基金托管人:兴业银行股份有限公司
送出日期:2019年1月1日至2019年6月30日

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		18,202,701.49	-
1.利息收入		3,024,758.78	-
其中:存款利息收入	6.4.7.1.1	84,565.50	-
债券利息收入		2,726,214.70	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		213,978.58	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”号填列)		4,451,060.31	-
其中:股票投资收益	6.4.7.1.2	4,232,437.09	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1.3	-132,363.78	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.1.4	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.1.5	-	-
衍生工具收益	6.4.7.1.6	-	-
股利收益	6.4.7.1.7	351,977.00	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.1.8	10,726,892.40	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.1.9	-	-
减:二、费用		1,693,682.26	-
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,085,700.07	-
2.托管费	6.4.10.2.2	217,140.01	-
3.销售服务费	6.4.10.2.3	78,802.79	-
4.交易费用	6.4.7.1.9	196,200.09	-
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7.其他费用	6.4.7.20	115,760.29	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		16,509,019.24	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		16,509,019.24	-