

浦银安盛中短债债券型证券投资基金2019年第二季度报告

2019-06-30

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
报告送出日期：2019-07-16

重要提示

基金管理人承诺基金本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。
基金托管人中国民生银行股份有限公司对本基金本报告所载资料进行了复核，未发现虚假记载、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预示其未来表现，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。
本报告所载资料未经审计。
本报告日期2019年6月30日止。

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 浦银中短债 (Puyin Short-Term Bond), 数值 (Value). Includes details like 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, etc.

主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标, 本基金(元), 浦银中短债(A)(元), 浦银中短债(B)(元). Includes 本期已实现收益, 本期利润, etc.

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据。
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。

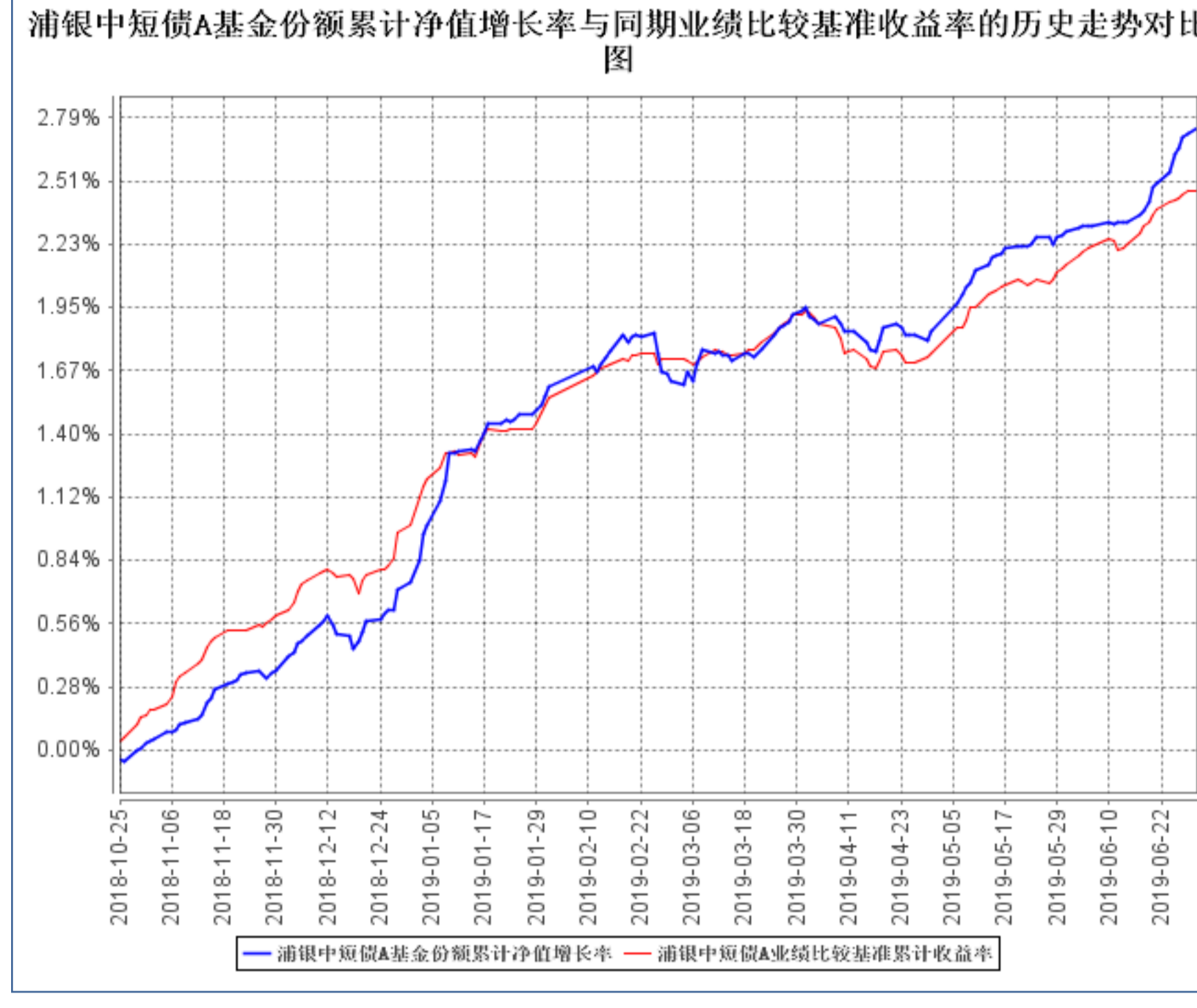
基金净值表现

Table with columns: 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. Includes sections for 浦银安盛中短债A and 浦银安盛中短债B.

自基金合同生效以来本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

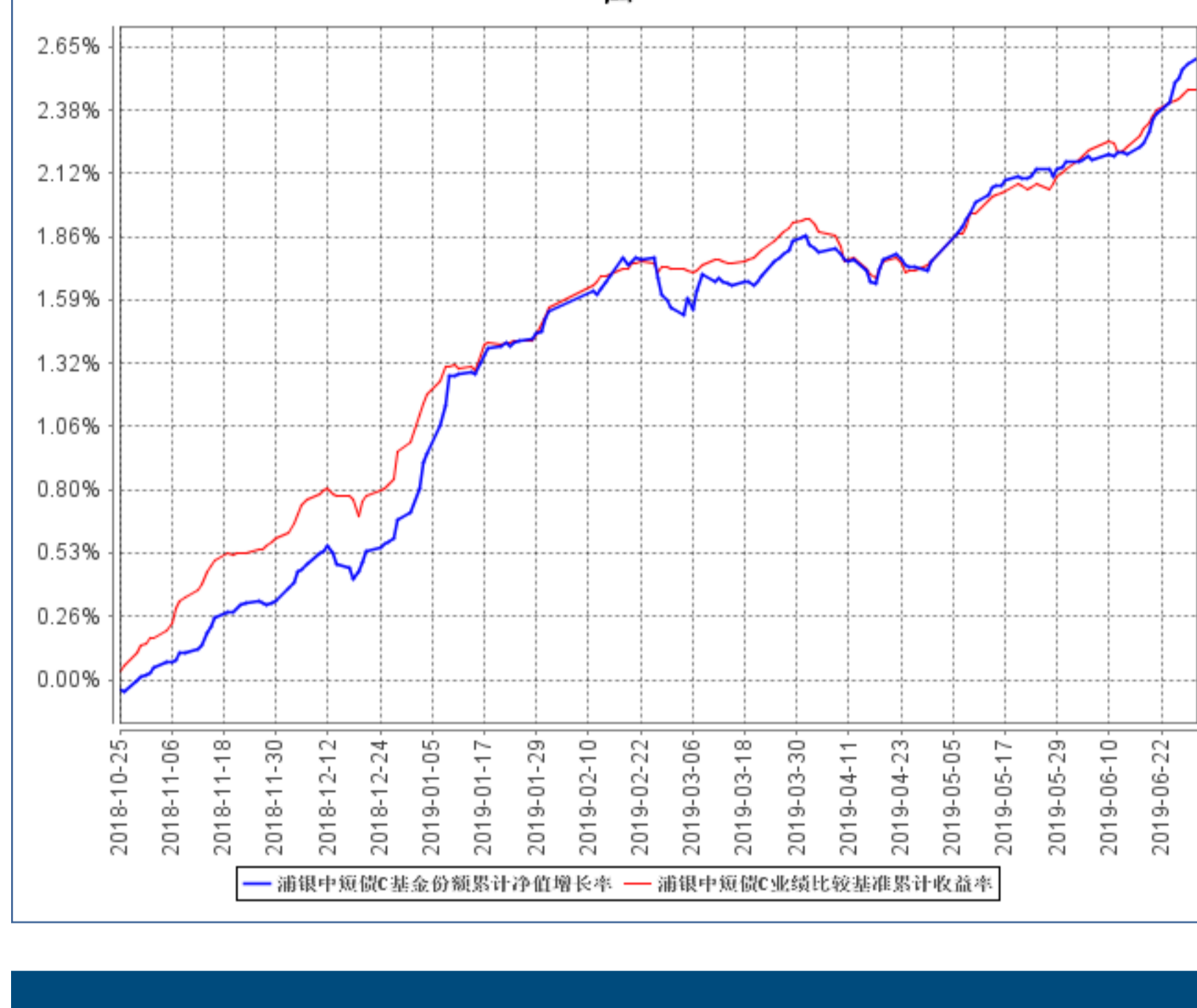
注：1、本基金合同生效日为2015年10月23日，基金合同生效日至本报告期末，本基金成立时间未满两年。
2、业绩比较基准设定：基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内将基金的投资组合比例符合基金合同的约定。本基金合同期为2015年8月15日至2019年4月1日，建仓期结束后符合相关规定。

浦银中短债A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



自基金合同生效以来本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

浦银中短债C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



其他指标

Table with columns: 其他指标, 截至日期 (2019-01-01至2019-06-30), 报告日期 (2019-06-30). Includes 基金份额持有人户数, etc.

基金经理（或基金经理小组）简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明. Lists managers like 钟明, 刘天威, etc.

注：1、本基金基金经理的任职日期为基金合同生效日期。
2、证券从业年限的计算标准遵照《证券基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，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，本着诚信原则，勤勉尽责地开展投资管理，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。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况
本基金管理人根据《公平交易管理制度》，建立健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待所管理的每一个基金组合。
本基金组合中，在投资管理环节，构建统一的投资平台，所有投资组合公平地进行资产配置；在投资决策环节，严格执行公平交易的投资决策流程；在交易执行环节，严格按照公平交易制度的规定，在交易所内集中执行所有投资组合的指令，并严格执行公平交易制度的相关规定。
报告期内，基金管理人严格执行公平交易制度，未发现异常交易行为。

异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。中国证监会和证券交易所颁布的关联交易文件予以认可的异常交易行为。报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度整体市场震荡偏弱，季初受一季度超预期信用扩张和信贷数据冲击下，收益率曲线整体上移，随后中美贸易摩擦加剧，二季度美国GDP数据下降以及国内房地产市场降温下行影响下，收益率曲线再度下行，截至6月16日，国债10年期国债二季报收益率高于1年期，国债收益率下行10BP，国开10年期下行13.7BP，国开收益率下行。6月开始组合持仓结构性调整，适当降低了久期水平，保证组合净值的平稳增长。6月开始逐步增加组合久期，在整个二季度保证了较好的组合回报率。

报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银中短债A基金的净值为1.021元，本报告期末基金净值增长率为36.78%。截至本报告期末浦银中短债C基金份额净值为1.020元，本报告期末基金净值增长率为36.71%。同期业绩比较基准收益率为30.54%。

报告期内基金份额持有人数量或基金资产净值预警说明

- 1、本基金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、本基金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。

投资组合报告

报告期末基金资产配置情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table with columns: 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

报告期末按公允价值占基金资产净值大小排名的前十名股票投资明细

Table with columns: 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(%)

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

报告期末按公允价值占基金资产净值大小排名的前五名债券投资明细

Table with columns: 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(%)

报告期末按公允价值占基金资产净值大小排名的前十名资产支持证券投资明细

Table with columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

Table with columns: 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(%)

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

报告期末本基金投资的国债逆回购交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债逆回购。

报告期末本基金投资的银行存款和协议存款

本基金本报告期末未持有银行存款和协议存款。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

报告期末本基金投资的国债逆回购交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债逆回购。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资

本基金本报告期末未持有权证投资。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资

本基金本报告期末未持有权证投资。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资

本基金本报告期末未持有权证投资。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资

本基金本报告期末未持有权证投资。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资

本基金本报告期末未持有权证投资。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资

本基金本报告期末未持有权证投资。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资

本基金本报告期末未持有权证投资。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资

本基金本报告期末未持有权证投资。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资

本基金本报告期末未持有权证投资。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资

本基金本报告期末未持有权证投资。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资

本基金本报告期末未持有权证投资。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资

本基金本报告期末未持有权证投资。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资

本基金本报告期末未持有权证投资。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资

本基金本报告期末未持有权证投资。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资

本基金本报告期末未持有权证投资。

浦银安盛基金管理人网址 www.pyfunds.com 查阅。或在营业时间内向基金管理人办公场所免费查阅。