

浦银安盛鑫通定期开放债券型发起式证券投资基金2019年第2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：交通银行股份有限公司
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。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月12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。
本报告中所列财务数据未经审计。
本报告中所列投资业绩数据未经审计。
本报告日期为2019年6月30日止。

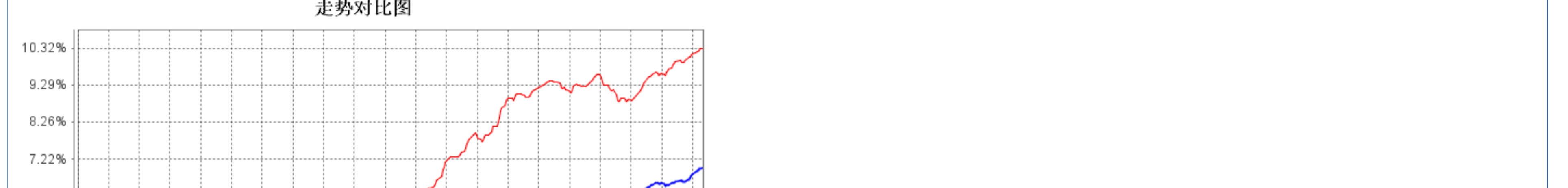
基金基本情况
项目 数值
基金简称 浦银安盛鑫通定期开放
场内简称
基金代码 004800
基金运作方式 契约型开放式
基金合同生效日 2017-12-28
报告期末基金总份额 4,842,252,729.24
投资目标 在严格控制投资风险的前提下，力争长期实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略 本基金一方面按照自上而下的方法进行资产配置决策，另一方面通过自下而上的方法，通过流动性考察和信用分析策略进行筛选，整体投资通过风险严格控制，运用多种积极的资产管理增值策略，实现本基金的投资目标。
业绩比较基准 中证综合债指数收益率
风险收益特征 本基金为债券型基金，预期收益和风险高于货币型基金，低于混合型基金、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 交通银行股份有限公司

主要财务指标
主要财务指标 报告期(2019-04-01至2019-06-30) 单位：人民币元
本期已实现收益 65,375,700.98
本期利润 34,092,429.43
加权平均基金份额本期利润 0.0071
期末基金资产净值 4,933,685,354.32
期末基金份额净值 1.0189

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可能有所降低。
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
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
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 0.71% 0.03% 0.61% 0.06% 0.07% 0.01%

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
浦银安盛鑫通定期开放债券型发起式证券投资基金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
其他指标 报告期(2019-04-01至2019-06-30) 单位：人民币元
其他指标 报告期(2019-06-30)

基金经理（或基金经理小组）简介

姓名 职务 任本基金的基金经理时间 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明
刘天熹 基金经理 2017-12-28 9 刘天熹先生，上海交通大学经济学博士，加盟浦银安盛基金前，曾在万家基金、鹏华基金工作，先后从事固定收益研究、基金经理助理、债券投资经理等工作。2014年4月加盟浦银安盛基金公司，从事固定收益专户产品的投资工作。2014年9月转入固定收益投资部，担任公司旗下浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金及浦银安盛季季定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2016年8月至2018年7月担任浦银安盛鑫通定期开放债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2017年4月起，担任公司旗下浦银安盛月月定期开放债券型证券投资基金及浦银安盛季季定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2017年11月起，担任浦银安盛鑫通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，担任浦银安盛鑫通定期开放债券型证券投资基金基金经理。2019年2月起，担任浦银安盛鑫通定期开放债券型证券投资基金基金经理。2019年5月起，担任浦银安盛鑫通定期开放债券型证券投资基金基金经理。2019年5月起，担任浦银安盛鑫通定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注：1、本基金基金经理的任职日期为公司公告的聘任日期。
2、证券从业年限的计算标准遵照行业协会《证券投资基金从业资格管理办法》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

本报告期内，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求最大利益。本报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

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《公平交易管理规定》，建立健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待所下的每一个投资组合。
在具体执行中，在投资授权基础上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平的信息提供支持。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，保证各基金及专户业务的投资决策机制、在交易执行环节上，详细制定了面对多个投资组合的公平交易的具体操作流程，包括投资组合的公平交易、集中交易和公平交易。一方面定期和不定期进行投资组合、持仓和持仓的公平交易、持仓和持仓的公平交易、持仓和持仓的公平交易、持仓和持仓的公平交易。另一方面是公司对公平交易制度的遵守和相关业务交易的执行情况定期进行核查，并对发现的问题进行及时的报告。
本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，公平对待各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

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、证监会规定和证券交易所颁布的相关规定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间有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交易量的20%的情况。

报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度债市先扬后抑，季末在二季度超预期扩张和经济数据冲击下，收益率曲线整体上行，随后在中美贸易摩擦加剧、二季度基本面经济数据下潜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，截至6月底，国债10年期国债二季度收益率高点下行10BP，国债10年期国债下行10BP，国债10年期国债下行13.7BP，曲线整体呈平坦化。1月开始本基金保持了中仓位，适当降低了久期水平，保证组合净值的平稳增长，3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

截至本报告期末本基金份额净值为1.0189元，本报告期基金份额净值增长率为0.71%，业绩比较基准收益率为0.61%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

1、本基金为发起式基金，报告期内基金持有人数符合法律法规及基金合同的要求。
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。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)
1 权益类投资 - -
2 固定收益投资 5,772,793,000.00 98.10
其中：债券 5,411,563,000.00 95.36
资产支持证券 161,230,000.00 2.74
3 贵金属投资 - -
4 金融衍生品投资 - -
5 买入返售金融资产 15,500,000.00 0.28
其中：买断式回购的买入返售金融资产 - -
6 银行存款和结算备付金合计 77,091.29 0.00
7 其他资产 96,489,586.32 1.84
8 合计 5,884,809,677.61 100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业 - -
B 采矿业 - -
C 制造业 - -
D 电力、热力、燃气及生产和服务业 - -
E 建筑业 - -
F 批发和零售业 - -
G 交通运输、仓储和邮政业 - -
H 住宿和餐饮业 - -
I 信息技术业 - -
J 金融业 - -
K 房地产业 - -
L 租赁和商务服务业 - -
M 科学研究和技术服务业 - -
N 水利、环境和公共设施管理业 - -
O 医药生物、医药和其他服务业 - -
P 教育 - -
Q 卫生和社会工作 - -
R 文化、体育和娱乐业 - -
S 综合 - -
合计 - -

注：本基金本报告期末未有股票。

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
A 基础材料 - -
B 消费者非必需品 - -
C 消费者用品 - -
D 能源 - -
E 金融 - -
F 医疗保健 - -
G 工业 - -
H 信息技术 - -
I 电信服务 - -
J 公用事业 - -
K 房地产 - -
合计 - -

注：本基金本报告期末未有港股通股票。

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

注：本基金本报告期末未有股票。

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 国家债券 - -
2 央行票据 - -
3 金融债券 2,927,282,000.00 59.33
其中：政策性金融债 346,466,000.00 7.03
4 企业债券 535,131,000.00 10.85
5 企业短期融资券 251,930,000.00 5.11
6 中期票据 1,897,244,000.00 38.45
7 可转债(可交换债) - -
8 同业存单 - -
9 其他 - -
10 合计 5,611,563,000.00 113.74

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 1728021 17工商银行二级01 4,000,000 404,520,000.00 8.20
2 1728100 17平安银行二级 3,200,000 326,016,000.00 6.61
3 1728009 17招商银行01 3,000,000 300,000,000.00 6.14
4 1728006 17中信银行二级 3,000,000 303,030,000.00 6.14
5 101803223 18国债控股07N003 2,200,000 222,838,000.00 4.52

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 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(%)
1 1698906 16国津1A 3,000,000 67,650,000.00 1.37
2 1888203 18工总20A1 3,000,000 36,860,000.00 0.75
3 1889053 18国股1A 3,000,000 36,720,000.00 0.74

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

注：本基金本报告期末未有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险说明
公允价值变动总额合计(元) -
股指期货投资本期收益(元) -
股指期货投资本期公允价值变动(元) -

本基金投资股指期货的投资政策

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策
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期货持仓和损益明细

代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险说明
公允价值变动总额合计(元) -
国债期货投资本期收益(元) -
国债期货投资本期公允价值变动(元) -

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门、工商部门、招商局、平安银行、中信银行、华夏银行、光大银行和农业银行以外证监局等部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
2019年5月15日，工商银行公告因未依法履行其他职责，分支行高管徐俊被中国银行业监督管理委员会处罚局于2019-05-07依据相关法律法规给予公开处罚处分决定。
2019年5月10日，招商银行公告因未依法履行其他职责，分支行高管王立波被中国银行业监督管理委员会处罚局于2019-05-29依据相关法律法规给予公开处罚处分决定。
2019年5月27日，中信银行公告因未依法履行其他职责，分支行高管李建被中国银行业监督管理委员会处罚局于2019-04-30依据相关法律法规给予公开处罚处分决定。
2019年4月16日，华夏银行公告因未依法履行其他职责，分支行高管张强被中国银行业监督管理委员会处罚局于2019-04-08依据相关法律法规给予公开处罚处分决定。
2019年5月13日，光大银行公告因未依法履行其他职责，分支行高管李国耀被中国银行业监督管理委员会处罚局于2019-05-05依据相关法律法规给予公开处罚处分决定。
2019年5月31日，农业银行公告因未依法履行其他职责，分支行高管李国耀被中国银行业监督管理委员会处罚局于2019-05-02依据相关法律法规给予公开处罚处分决定。
2019年6月18日，民生银行公告因未依法履行其他职责，分支行高管曹海被中国银行业监督管理委员会处罚局于2019-04-17依据相关法律法规给予公开处罚处分决定。

本基金管理人的研究人员对民生银行、工商银行、招商局、平安银行、中信银行、华夏银行、光大银行和农业银行保持了及时的研究跟踪，投资决策符合本基金管理人的投资策略。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

其他资产构成

序号 项目 名称 金额(元) 单位：人民币元
1 银行存款 53,332.00
2 应收证券清算款 503,798.99
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 93,952,454.93
6 其他应收款 -
7 待摊费用 -
8 其他 -
9 合计 96,489,586.32

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未有股票。

开放式基金份额变动

项目 数值 单位：份
报告期初基金份额总额 4,842,252,729.24
报告期基金总申购份额 -
报告期因基金份额赎回减少的基金份额 -
报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) -
报告期末基金份额总额 4,842,252,729.24

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

项目 基金份额 单位：份
报告期末管理人持有的本基金份额 10,000,000.00
报告期末管理人持有本基金份额占基金总份额比例 0.21%
报告期末管理人持有本基金份额占基金总份额比例 0.21%

注：截至本报告期末，基金管理人持有本基金份额10,000,000.00份，其中认购份额10,000,000.00份。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号 交易方式 交易日期 交易份额(份) 交易金额(元) 适用费率
合计 - - - - -

注：本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

报告期末发起式基金发起资金持有基金份额情况

项目 持有份额总数 持有份额占基金总份额比例 发起份额总数 发起份额占基金总份额比例 发起份额承诺持有期限
基金管理人自有资金 10,000,000.00 0.21% 10,000,000.00 0.21% 自合同生效之日起不少于3年
基金管理人高级管理人员 0.00 0.00% 0.00 0.00% 0
基金管理人股东 0.00 0.00% 0.00 0.00% 0
基金管理人法人 0.00 0.00% 0.00 0.00% 0
其他 0.00 0.00% 0.00 0.00% 0
合计 10,000,000.00 0.21% 10,000,000.00 0.21% 自合同生效之日起不少于3年

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别 序号 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 期初份额 申购份额 赎回份额 持有份额 份额占比
机构 1 2019年01月01日至2019年06月30日 4,832,252,729.24 0.00 0.00 4,832,252,729.24 99.79%
个人 - - - - - - - - - -

基金管理人提示投资者注意：特别提示机构投资者进行大额申购时，基金管理人需通过基金持有证券的快速变动以及大额赎回，该等资产可能产生基金仓位调整的风险，产生冲击成本的风险，并造成基金净值波动；同时，大额申购可能导致（1）单位净值波动风险；（2）基金净值大幅波动的风险；（3）引发基金本身的巨额赎回导致中小投资者无法及时赎回的风险；以及（4）因基金资产净值低于5000万从而严重影响投资目标实现造成基金终止等风险。

影响投资者决策的其他重要信息

备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集的文件
2、浦银安盛鑫通定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同
3、浦银安盛鑫通定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书
4、浦银安盛鑫通定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议
5、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
6、基金托管人业务资格批件和营业执照
7、本报告期内基金管理人及基金托管人披露的各项公告
8、中国证监会要求的其他文件

存放地点

上海市浦东新区中环路58号环球金融中心基金管理人办公场所

查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.piboss.com)查阅，或在营业时间到基金管理人办公场所免费查阅。
投资者对本报告如有疑议，可咨询基金管理人。
客户服务电话：400-8828-999 或 021-33079999