

浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金2019年第3季度报告

2019-09-30
基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人：浙商银行股份有限公司
报告送出日期：2019-10-25

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。
基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年10月23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预示其未来表现，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。
本报告自2019年7月1日起至9月30日止。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes 基金名称 (浦银安盛盛泽定期开放债券), 基金代码 (006998), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日 (2018-09-28), 报告期末基金份额总额 (1,398,507,147.98), 投资策略 (在严格控制投资风险的前提下, 力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报).

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期 (2019-07-01 至 2019-09-30). Includes 本期已实现收益 (13,715,905.03), 本期利润 (12,918,459.49), 加权平均基金份额本期利润 (0.0092), 期末基金资产净值 (1,438,242,725.21), 期末基金份额净值 (1.028).

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。

基金净值表现

Table with 6 columns: 阶段 (Period), 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 过去三个月 (0.90%, 0.03%, 1.39%, 0.04%, -0.49%, -0.01%).

自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：注：根据基金合同约定，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规定，本基金建仓期为2018年9月28日至2019年3月25日，建仓期结束时符合相关规定。

其他指标

Table with 2 columns: 其他指标 (Other Indicators) and 报告期 (2019-07-01至2019-09-30). Includes 基金份额持有人户数 (1,028), 基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例 (0.0001).

基金管理人（或基金投资小组）简介

Table with 5 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理期限 (Term), 证券从业年限 (Experience), 说明 (Remarks). Lists 曹麒麟 (Manager) and 曹麒麟 (Assistant Manager).

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

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《公平交易管理制度》，建立健全了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。在具体执行中，在投资决策流程上，构建一套研究平台，为所有投资组合公平的提供研究支持。在投资交易过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资决策制度，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，详细规定了对不同投资组合的授权交易执行的流程和规定，以保证投资执行的公平性；从事后监控角度上，一方面定期针对股票交易情况进行分析，对不平时段（即：11:31、15:10和15:11）发生的非组合间对同一股票的同日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非故意价差；同时对于旗下投资组合及其各投资类别的收益差异的分析；另一方面是公司公平交易制度的遵守和专户业务的执行情况定期进行专项检查，并对发现的问题及时跟踪。

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超过该证券当日成交量的5%的情形。

报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度经济基本面上压力加大，财政支出节奏平稳，央行先后完成了贷款换购1.68万亿元操作，为通过疏通流动性传导渠道，缓解实体经济融资难、融资贵问题提供支撑。三季度快速上涨，叠加石油由跌转升油价上涨，市场对原油核心资产关注度上升，通胀预期有所升温，国内流动性宽松程度有所提升，三季度末流动性宽松程度有所提升，受到央行降准降准、资管新规落地延期等因素影响，9月中旬以后市场有所企稳，10月中旬开始企稳反弹。报告期内，本基金以权益类资产为主，维持中性的仓位水平组合仓位，取得了一定的资本利得和稳定的股息收入。未来，本基金将继续秉承稳健专业的投资理念，积极防范、严控风险，力争为基金份额持有人带来长期稳定回报。

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1.0284元；本报告基金份额净值增长率为0.90%，业绩比较基准收益率为1.39%。

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

Table with 4 columns: 序号 (No.), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage). Includes 权益类投资 (1,911,505,960.00), 固定收益类投资 (1,911,505,960.00), 债券类投资, 金融衍生品投资, 买入返售金融资产, 银行存款和结算备付金合计, 其他资产, 合计 (1,944,266,824.67).

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 序号 (No.), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage). Lists 农林牧渔, 采矿业, 制造业, 电力、热力、燃气及水生产和供应业, 建筑业, 批发和零售业, 交通运输、仓储和邮政业, 住宿和餐饮业, 信息传输、软件和信息技术服务业, 金融业, 房地产业, 租赁和商务服务业, 科学研究和技术服务业, 水利、环境和公共设施服务业, 居民服务、修理和其他服务业, 教育, 卫生和社会工作, 文化、体育和娱乐业, 综合, 合计.

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table with 4 columns: 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage). Lists 基础材料, 医药生物, 食品饮料, 金融, 电子, 计算机, 通信, 国防军工, 公用事业, 房地产, 合计.

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

Table with 6 columns: 序号 (No.), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage). Lists 宁德时代, 隆基股份, 东方财富, 招商银行, 中国平安, 五粮液, 美的集团, 贵州茅台, 伊利股份, 恒瑞医药.

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

Table with 6 columns: 序号 (No.), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (张) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage). Lists 18国债02, 18国债12, 18国债13, 18国债02, 18国债03.

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资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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持有贵金属。

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持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change), 风险说明 (Risk Description). Includes 公允价值变动总额合计 (0), 股指期货投资本期收益 (0), 股指期货投资本期公允价值变动 (0).

本基金投资股指期货的投资政策

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交易情况说明

注：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

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change), 风险指标说明 (Risk Indicator Description). Includes 公允价值变动总额合计 (0), 国债期货投资本期收益 (0), 国债期货投资本期公允价值变动 (0).

本期国债期货投资评价

注：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没有监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

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，没有超出基金合同规定的备选股票库的范围。

其他资产构成

Table with 4 columns: 序号 (No.), 项目 (Item), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount). Includes 存出保证金 (2,859.89), 应收证券清算款, 应收股利 (32,836,786.76), 应收利息, 其他应收款, 其他, 合计 (32,839,646.56).

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持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持有股票。

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes 报告期初基金份额总额 (1,398,507,147.98), 报告期间基金申购份额, 报告期间基金赎回份额, 报告期间基金净申购份额 (份额减少“-”填列), 报告期末基金份额总额 (1,398,507,147.98).

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 基金份额 (Share Amount). Includes 报告期初管理人持有本基金基金份额 (10,000,000.00), 报告期间买入/申购基金份额 (0.00), 报告期间卖出/赎回基金份额 (0.00), 报告期末管理人持有本基金基金份额 (10,000,000.00), 报告期末持有的基金份额占基金份额总额的比例 (%) (0.72%).

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

Table with 5 columns: 序号 (No.), 投资日期 (Investment Date), 交易金额 (元) (Transaction Amount), 交易份额 (份) (Share Amount), 适用费率 (Applicable Rate). Includes 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份额情况

Table with 6 columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Shares), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage), 发起份额总数 (Initiated Shares), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage), 自合同生效之日起持有期限 (Holding Period). Includes 基金管理人自有资金 (10,000,000.00, 0.72%), 基金管理人高级管理人员 (0.00, 0.00%), 基金投资管理人员 (0.00, 0.00%), 基金管理人股东 (0.00, 0.00%), 其他 (0.00, 0.00%), 合计 (10,000,000.00, 0.72%).

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

Table with 6 columns: 机构投资者 (Institutional Investor), 序号 (No.), 持有基金份额达到或超过20%的时间区间 (Time Interval), 期初份额 (Start Shares), 申购份额 (Purchase Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 报告期末持有基金份额 (End Shares), 报告期末持有基金份额占比 (Percentage). Includes 个人 (1, 2019年7月11-2019年9月30日, 1,388,507,147.98, 0.00, 0.00, 1,388,507,147.98, 99.28%).

基金管理人提示投资风险：当特定的机构投资者进行大额赎回时，基金管理人需通过大额持有证券的变现变现以支付赎回款，该等操作可能会产生基金份额净值波动，产生冲击成本的风险，并造成基金净值波动；同时，该等大额赎回可能导致（1）单只净值波动风险；（2）基金份额大幅波动的风险；（3）因引发基金本身巨额赎回而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5000万元从而触发投资目标实现或基金终止等风险。

影响投资决策的其他重要因素

备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集的文件
2、浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同
3、浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书
4、浦银安盛盛泽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牌照、营业执照、公司章程
6、基金托管人业务资格牌照和营业执照
7、本报告期内在中国证监会指定报刊上披露的历次公告
8、中国证监会要求的其他文件

存放地点

上海市淮海中路381号中环广场出租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.py-asset.com) 查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。
投资者对本报告如有任何疑问，可咨询基金管理人。
客户服务电话：400-8828-999 或 021-33099999。