浦银安盛安久回报定期开放混合型证券投资基金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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2019-10-25

目录全部展开 目录全部收拢
- 重要提示
- 基金产品概况
  - 基金基本情况
- 主要财务指标和基金净值表现
  - 主要财务指标
  - 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
    - 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
  - 其他指标
- 管理人报告
  - 基金经理（或基金经理小组）简介
  - 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
  - 公平交易专项说明
    - 公平交易制度的执行情况
    - 异常交易行为的专项说明
  - 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
    - 报告期内基金的投资策略和运作分析
    - 报告期内基金的业绩表现
  - 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
- 投资组合报告
  - 报告期末基金资产组合情况
  - 报告期末按行业分类的股票投资组合

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。

基金托管人交通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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年7月1日起至9月30日止。

基金基本情况

项目	数值	
基金简称	浦银安盛安久回报定开混合	
场内简称		
基金主代码	004801	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018-04-19	
报告期末基金份额总额	76,238,191.92	
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。	
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。整体投资通过对风险的严格控制，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	沪深300指数收益率×20%+中证全债指数收益率×80%。	
风险收益特征	本基金为债券投资为主的混合型基金，其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。	
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	
下属2级基金的基金简称	浦银安盛安久回报定开混合A	浦银安盛安久回报定开混合C
下属2级基金的场内简称		
下属2级基金的交易代码	004801	004802
报告期末下属2级基金的份额总额	75,961,051.42	277,140.50
下属2级基金的风险收益特征		

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	主基金(元)	浦银安盛安久回报定开混合A(元) 2019-07-01 - 2019-09-30	浦银安盛安久回报定开混合C(元) 2019-07-01 - 2019-09-30
本期已实现收益		1,053,790.25	3,575.16
本期利润		1,445,293.10	5,000.14
加权平均基金份额本期利润		0.0190	0.0180
期末基金资产净值		81,087,049.20	294,864.77
期末基金份额净值		1.0675	1.0640

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

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

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A

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	1.81 %	0.23 %	1.19 %	0.19 %	0.62 %	0.04 %

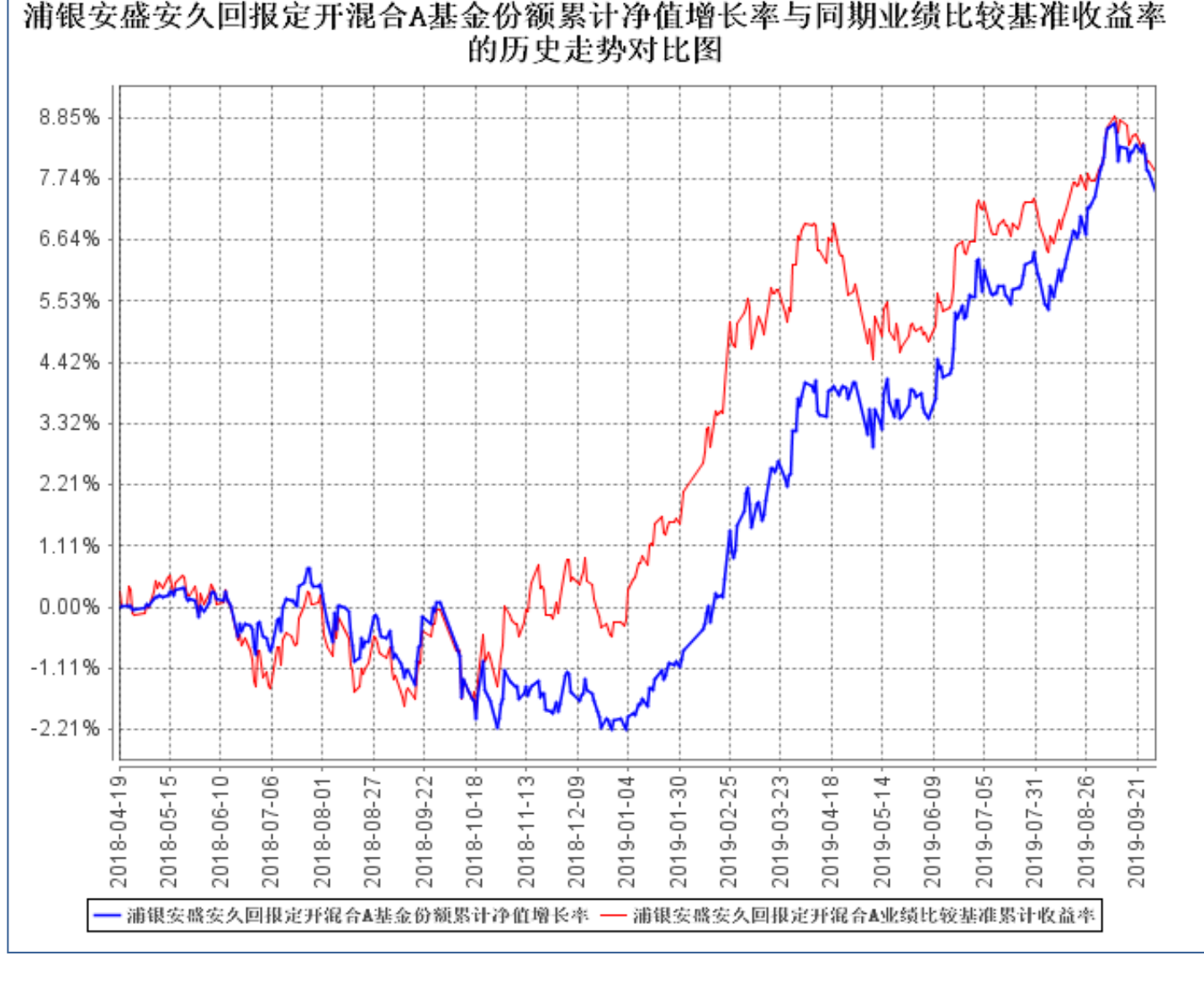
本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较B

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	1.73 %	0.23 %	1.19 %	0.19 %	0.54 %	0.04 %

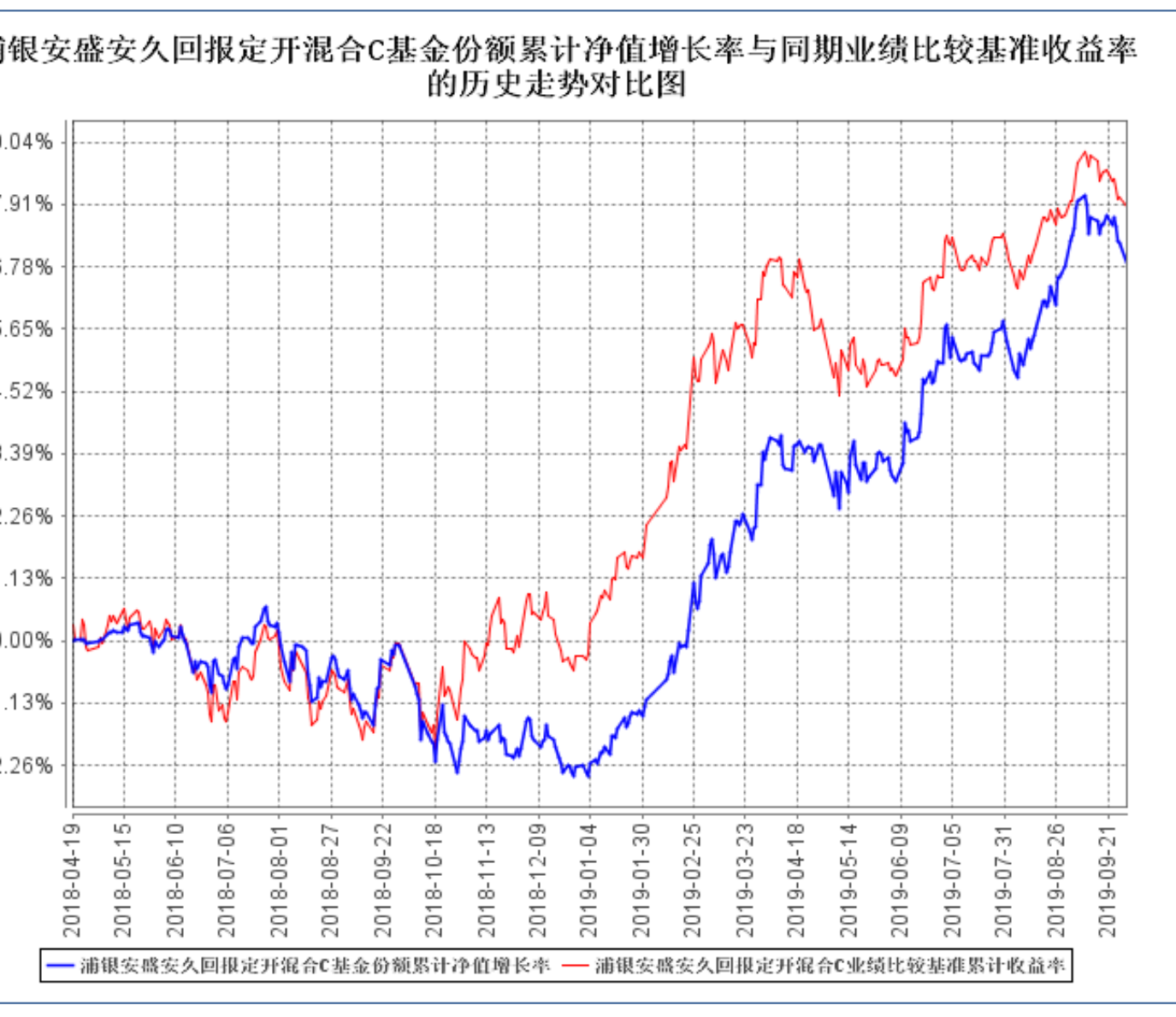
自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：注：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4月19日至2018年10月18日。建仓期结束时符合相关规定。

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A



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B



其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2019-07-01至2019-09-30）
其他指标	报告期（2019-09-30）

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
褚艳辉	公司旗下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以及浦银安盛环保新能源混合型证券投资基金基金经理。	2018-04-19	–	11	褚艳辉先生，南京理工大学经济学硕士。2004年8月至2008年4月间曾在上海信息中心担任宏观经济、政策研究员。2008年5月到2010年9月在爱建证券公司担任制造与消费大类行业高级研究员，后在上海汽车财务公司短暂担任投资经理助理之职。2011年4月加盟本公司担任高级行业研究员。2013年2月至2014年6月，担任本公司权益类基金基金经理助理。2014年6月起，担任公司旗下浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2014年7月至2018年11月，担任公司旗下浦银安盛新经济结构灵活配置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经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年3月起，兼任公司旗下浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金基金经理。2018年4月起，兼任浦银安盛安久回报定期开放混合型证券投资基金基金经理。2018年8月起，兼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月起，兼任浦银安盛环保新能源混合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。

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》，建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个基金组合。

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日和10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。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，公平对待旗下各投资组合，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、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。

报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，在较多外部负面事件冲击以及国内经济寻底的大背景下，股票市场却能呈现一定韧性。从板块上看，中小创好于主板及大市值板块；从行业上看，电子计算机为代表的科技股和医药食品饮料为代表的消费股上涨，但多数行业下跌，周期股跌幅较大；从主线上看，消费电子、芯片、国产安可、医疗服务、白酒等受到资金追捧。

报告期内，基金在投资运作上微调了大类资产的权重，配置了中性的权益仓位，以追求更好的风险收益比。低估值板块和稳健增长的行业是重点投资方向，我们相信，其中的龙头公司具备穿越经济低谷的能力，因此是权益部分的核心配置。受流动性宽松影响，固定收益投资有一定表现，市场信用分化加剧、交易情绪增强。基金以稳为主，选择方向在中短久期、高资质品种。

报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛安久回报定开混合A基金份额净值为1.0675元，本报告期基金份额净值增长率为1.81%；截至本报告期末浦银安盛安久回报定开混合C基金份额净值为1.0640元，本报告期基金份额净值增长率为1.73%；同期业绩比较基准收益率为1.19%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

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	17,605,514.84	21.57
	其中：股票	17,605,514.84	21.57
2	固定收益投资	71,877.30	0.09
	其中：债券	71,877.30	0.09
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	55,000,000.00	67.39
	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	2,795,098.93	3.42
7	其他资产	6,141,863.29	7.53
8	合计	81,614,354.36	100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	10,859,074.84	13.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,144,800.00	1.41
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	945,840.00	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	992,000.00	1.22
J	金融业	3,663,800.00	4.50
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	居民服务、修理和其他服务业	–	–
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	17,605,514.84	21.63

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 消费者常用品	–	–
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	–	–

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

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（%）
1	600036	招商银行	56,000	1,946,000.00	2.39
2	600276	恒瑞医药	24,000	1,936,320.00	2.38
3	000858	五粮液	12,987	1,685,712.60	2.07
4	600519	贵州茅台	1,400	1,610,000.00	1.98
5	600309	万华化学	30,000	1,324,500.00	1.63
6	601318	中国平安	15,000	1,305,600.00	1.60
7	002311	海大集团	38,000	1,189,400.00	1.46
8	600025	华能水电	270,000	1,144,800.00	1.41
9	000333	美的集团	20,000	1,022,000.00	1.26
10	300033	同花顺	10,000	992,000.00	1.22

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	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	71,877.30	0.09
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	71,877.30	0.09

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	128071	合兴转债	690	71,877.30	0.09

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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）

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名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

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)			–		

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

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

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)	风险指标说明
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

本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、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

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	43,200.00
2	应收证券清算款	6,016,109.59
3	应收股利	–
4	应收利息	82,553.70
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	6,141,863.29

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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银安盛安久回报定开混合	浦银安盛安久回报定开混合A	浦银安盛安久回报定开混合C
报告期期初基金份额总额		75,961,051.42	277,140.50
报告期期间基金总申购份额			
减：报告期期间基金总赎回份额			
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）			
报告期期末基金份额总额	76,238,191.92	75,961,051.42	277,140.50

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	浦银安盛安久回报定开混合	浦银安盛安久回报定开混合A	浦银安盛安久回报定开混合C
报告期期初管理人持有的本基金份额			
报告期期间买入/申购总份额			
报告期期间卖出/赎回总份额			
报告期期末管理人持有的本基金份额			
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	–	–	–

注： 本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

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
基金管理人固有资金		–%		–%	
基金管理人高级管理人员		–%		–%	
基金经理等人员		–%		–%	
基金管理人股东		–%		–%	
其他		–%		–%	
合计		–%		–%	

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>
<tr><th rowspan="2">投资者类别</th><th colspan="6">报告期内持有基金份额变化情况</th><th colspan="2">报告期末持有基金情况</th></tr>
<tr><th>序号</th><th>持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间</th><th>期初份额</th><th>申购份额</th><th>赎回份额</th><th>持有份额</th><th>份额占比</th></tr>
<tr><td>机构</td><td>–</td><td>–</td><td>–</td><td>–</td><td>–</td><td>–</td><td>–</td></tr>
<tr><td>个人</td><td>–</td><td>–</td><td>–</td><td>–</td><td>–</td><td>–</td><td>–</td></tr>
<tr><td colspan="8">产品特有风险</td></tr>
<tr><td colspan="8">–</td></tr>
</table>

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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、 浦银安盛安久回报定期开放混合型证券投资基金基金合同
3、 浦银安盛安久回报定期开放混合型证券投资基金招募说明书
4、 浦银安盛安久回报定期开放混合型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、 本报告期内在中国证监会指定报刊上披露的各项公告
8、 中国证监会要求的其他文件

存放地点

上海市淮海中路381号中环广场38楼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-axa.com）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

客户服务中心电话：400-8828-999 或 021-33079999 。