

浦银安盛盛通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：交通银行股份有限公司
报告送出日期：2019-10-25

重要提示

基金管理人承诺及重要提示：基金管理人承诺不以虚假记载、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约定，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。基金资产由基金管理人代表其基金份额持有人进行投资，投资风险由投资者自行承担。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。本基金的财务资料未经审计。本报告自2019年7月1日起至2019年9月30日止。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes fields like 基金简称 (浦银安盛盛通定期开放), 场内简称, 基金代码 (004800), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日期 (2017-12-28), 报告期末基金总份额 (4,842,252,729.24), 投资策略 (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), 投资范围 (本基金为固定收益类资产, 采用自上而下的方法对债券资产进行配置), 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, 预期收益和预期风险高于货币市场基金, 低于股票型基金、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

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期 (2019-07-01 至 2019-09-30) (Reporting Period). Includes 本期实现收益 (56,656,189.29), 本期利润 (58,147,480.42), 加权平均基金份额本期利润 (8.0222), 期末基金资产净值 (4,891,833,034.76), 期末基金份额净值 (1.0099).

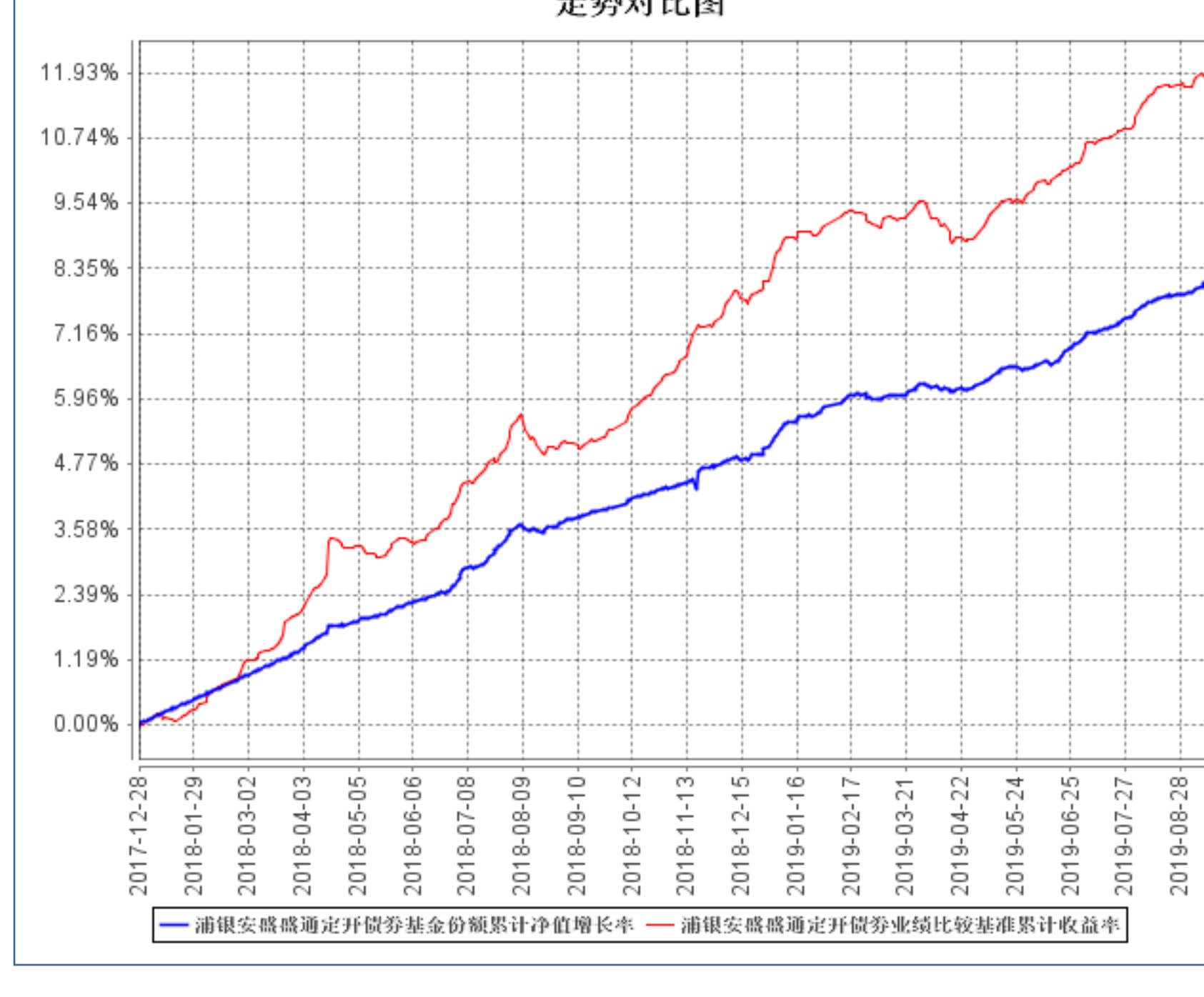
注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

基金净值表现

Table showing 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 (Comparison of fund share net value growth rate and benchmark return). Includes 过去三个月 (Last 3 months) and 过去十二个月 (Last 12 months) data for 净值增长率① (Net value growth rate), 净值增长率标准差② (Net value growth rate standard deviation), 业绩比较基准收益率③ (Benchmark return), 业绩比较基准收益率标准差④ (Benchmark return standard deviation), ①-③ (①-③), ②-④ (②-④).

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

浦银安盛盛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

Table with 2 columns: 其他指标 (Other Indicators) and 报告期 (2019-07-01 至 2019-09-30) (Reporting Period). Includes 基金份额持有人户数 (Number of fund share holders) and 基金份额持有人户数较上期变化 (Change in number of fund share holders).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with 5 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金基金经理的任期 (Term of appointment as fund manager), 证券从业年限 (Years of securities industry experience), 说明 (Remarks). Lists 刘大巍 (Liu Dawei) as the fund manager, detailing his education, work experience, and tenure with the fund.

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。本报告期内未有基金份额持有人利益的行为。

公平交易制度的执行情况

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，保证公平对待旗下的每一个基金组合。在具体执行中，在投资决策上，构建统一的研究平台，所有投资组合的申报和研究，同时，在投资流程管理上，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度，保证基金及专户业务的独立投资决策机制；在交易执行环节上，详细制定多个投资组合的投资指令的分配和执行的程序规定，以保证投资执行的公平性；从事后控制角度上，一方面定期对投资组合交易情况进行分析，对不合理的窗口（同日、3日、5日择时）发生的不同组合合同一致性的同向交易及反向交易进行差异分析，并进行针对性显著的跟踪，以判定交易价差对相关基金的投资业绩的影响；同时对旗下投资组合及其投资类别的收益差异进行分析，另一方面是公司对公平交易制度的遵守和相关业务执行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的异常交易行为。报告期内未发生旗下所有投资组合间及与交易所公开竞价的不同同日反向交易成交较少的单边交易且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

三季度前半段，国内政策和市场数据开始对宏观经济企稳预期有所修正，货币政策开始宽松，同时在中美贸易摩擦加剧和全球市场的降息预期不断升温背景下，长期利率不断下行。在此期间，本基金保持了中性仓位并适当拉长了组合久期，但到了8月份，收益率曲线倒挂加剧和信用利差拉大到历史高位数据时，即开始逐步减仓，降低仓位并拉短久期，同时提高信用资质，导致组合的大盘股和蓝筹股表现不佳，长期利率开始快速下行，在此期间，本基金保持了中性仓位和久期，提前布局低估值品种，为后续波段操作预留空间。整个三季度，本基金保持了净值的平稳增长。

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1.0399元，本报告期基金份额净值增长率为1.38%，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约定。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 5 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount in RMB), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage of total assets). Lists categories like 权益类投资 (Equity investment), 固定收益投资 (Fixed income investment), 资产支持证券 (Asset-backed securities), 金融衍生品投资 (Financial derivatives investment), 买入返售金融资产 (Repurchase agreements), 银行存款和结算备付金合计 (Total bank deposits and settlement funds), 其他资产 (Other assets), 合计 (Total).

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of net asset value). Lists various industry categories such as 农林牧渔 (Agriculture, Forestry, Animal Husbandry, Fishing), 医药生物 (Pharmaceuticals and Biotechnology), 食品饮料 (Food and Beverage), etc.

报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of net asset value). Lists various industry categories such as 基础材料 (Basic Materials), 消费者非必需品 (Consumer Non-Durables), 医药生物 (Pharmaceuticals and Biotechnology), etc.

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 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity in Shares), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of net asset value). Lists the top 10 stocks held by the fund.

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of net asset value). Lists various bond types such as 国家债券 (Government Bonds), 央行票据 (Central Bank Bills), 金融债券 (Financial Bonds), etc.

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债券投资明细

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (份) (Quantity in Par), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of net asset value). Lists the top 10 bonds held by the fund.

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

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 证券代码 (Securities Code), 证券名称 (Securities Name), 数量 (份) (Quantity in Par), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of net asset value). Lists the top 5 asset-backed securities held by the fund.

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

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 贵金属代码 (Precious Metals Code), 贵金属名称 (Precious Metals Name), 数量 (克) (Quantity in Grams), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of net asset value). Lists the top 5 precious metals held by the fund.

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

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity in Shares), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of net asset value). Lists the top 5 warrants held by the fund.

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 5 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position Size (Buy/Sell)), 合约数量 (元) (Contract Quantity in RMB), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in RMB), 风险说明 (Risk Statement). Lists the top 5 derivatives held by the fund.

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 5 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position Size (Buy/Sell)), 合约数量 (元) (Contract Quantity in RMB), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in RMB), 风险说明 (Risk Statement). Lists the top 5 derivatives held by the fund.

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 5 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position Size (Buy/Sell)), 合约数量 (元) (Contract Quantity in RMB), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in RMB), 风险说明 (Risk Statement). Lists the top 5 derivatives held by the fund.

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未持有权证。