# 浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金
# 2021年第2季度报告

2021年6月30日

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：2021年7月21日

# 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 20 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 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

# §2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 浦银安盛安和回报定开混合 | |
| 基金主代码 | 004276 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017 年 3 月 23 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 52,334,703.09 份 | |
| 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，属于中等风险、中等收益预期的基金品种，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 | 中国民生银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 浦银安盛安和回报定开混合 A | 浦银安盛安和回报定开混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 004276 | 004277 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 43,598,804.56 份 | 8,735,898.53 份 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日） | |
|---|---|---|
| | 浦银安盛安和回报定开混合 A | 浦银安盛安和回报定开混合 C |
| 1.本期已实现收益 | -654,450.39 | -162,210.10 |
| 2.本期利润 | 549,862.18 | 107,228.94 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0176 | 0.0161 |
| 4.期末基金资产净值 | 44,387,183.89 | 8,892,852.00 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0181 | 1.0180 |

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。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 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

浦银安盛安和回报定开混合 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 | 1.40% | 0.13% | 1.79% | 0.20% | -0.39% | -0.07% |
| 过去六个月 | 2.15% | 0.33% | 2.06% | 0.27% | 0.09% | 0.06% |
| 过去一年 | 9.67% | 0.34% | 7.39% | 0.27% | 2.28% | 0.07% |
| 过去三年 | 25.37% | 0.34% | 22.81% | 0.27% | 2.56% | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 31.64% | 0.30% | 27.93% | 0.24% | 3.71% | 0.06% |

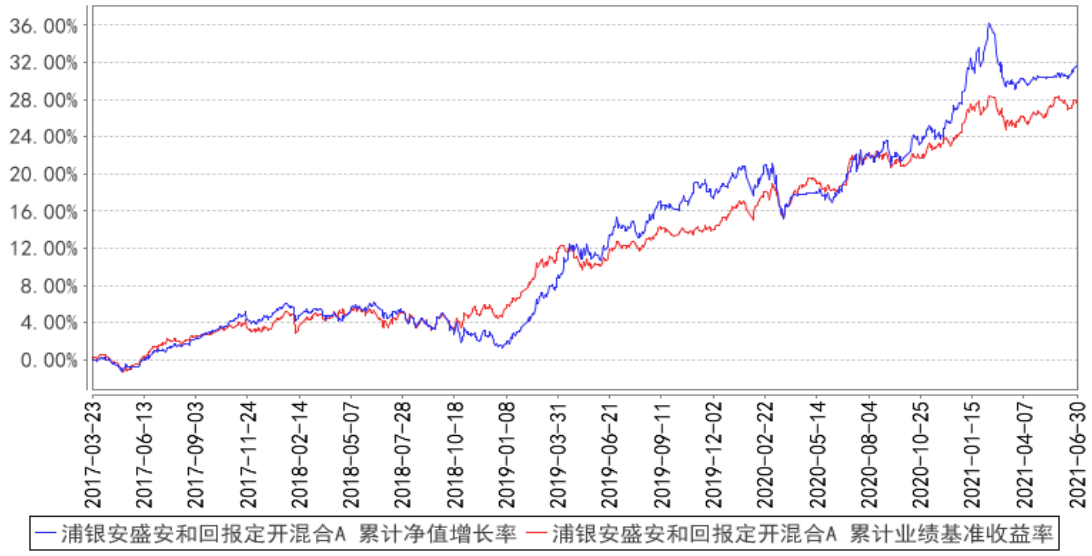
浦银安盛安和回报定开混合 C

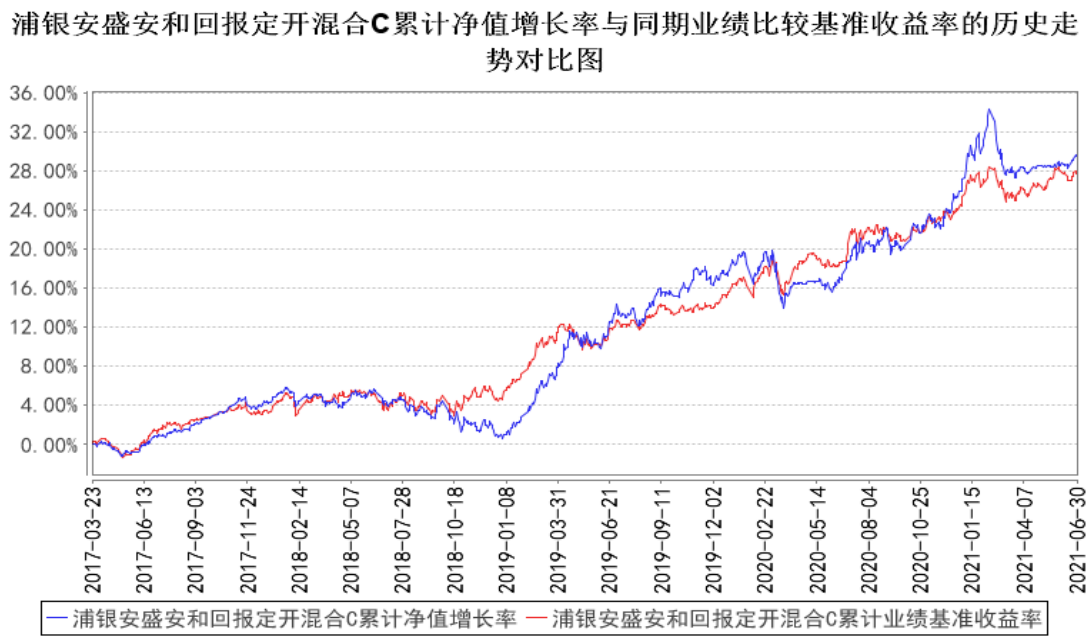
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差 | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|

| | | | | ④ | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.31% | 0.13% | 1.79% | 0.20% | -0.48% | -0.07% |
| 过去六个月 | 1.98% | 0.33% | 2.06% | 0.27% | -0.08% | 0.06% |
| 过去一年 | 9.28% | 0.34% | 7.39% | 0.27% | 1.89% | 0.07% |
| 过去三年 | 24.09% | 0.34% | 22.81% | 0.27% | 1.28% | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 29.64% | 0.30% | 27.93% | 0.24% | 1.71% | 0.06% |

### 3.2.2 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

浦银安盛安和回报定开混合A 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






# §4 管理人报告

## 4.1 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 | | |
| 赵楠 | 公司旗下部分基金基金经理。 | 2021 年 3 月 8 日 | - | 10 年 | 赵楠女士，上海财经大学西方经济学硕士，2011 年 07 月至 2020 年 12 月在光大保德信基金管理有限公司先后担任研究员及投资经理。2020 年 12 月加盟浦银安盛基金管理有限公司，现任职权益投资部拟任基金经理。在我司任职期间，主要负责基金经理日常辅助研究工作。2021 年 3 月起，担任浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金及浦银安盛安远回报一年持有期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。

## 4.2 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。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 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，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。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。

### 4.3.2 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。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年二季度，流动性处于相对充裕的状态，国内经济整体仍是处于景气格局，但边际上有所回落。期结构性特点比较明显，出口偏好是经济的强劲支撑，但消费恢复仍然较弱。反观海外，全球经济正处于复苏最快的时段，而由于出行限制的打开，耐用品消费逐渐向服务消费转变。总体而言，市场认为我国经济处于潜在增速水平徘徊，而长期来看流动性边际宽松仍是未来市场主旋律。

报告期内，由于流动性较宽裕，美债收益率保持平稳，投资者对利率上行的担忧阶段性缓解，股债迎来双升。A 股走势震荡上行，结构性机会较多，成长风格显著跑赢价值风格。报告期内沪深 300 指数上涨 3.48%，创业板指上涨 26.05%，恒生指数上涨 1.58%。板块方面，新能源汽车销量超预期及芯片紧缺等推动电力设备、电子等板块涨幅较大，而由于猪价下跌、政策限制等原因农林牧渔、房地产等板块跌幅较大。国债收益率震荡下行，中证国债指数上涨 1.34%，中证

全债指数上涨 1.32%。

报告期内，我们积极调整组合结构以应对市场变化，仍然坚守稳健+弹性的组合配置理念以获取较稳健的收益，对于权益组合主动增配了新能源、电子等板块取得较好的收益，在择股上既看重远期空间，也注重短期估值和盈利的匹配程度。对于债券投资，我们坚持投资高评级债券以规避信用风险可能带来的波动。在集中开放期，我们降低了仓位以应对申赎的波动。

展望三季度，在宏观环境维持稳定的情况下，权益和债券市场均具有结构性的机会，我们将保持耐心，积极应对，力求给投资人带来稳健回报。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛安和回报定开混合 A 的基金份额净值为 1.0181 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.40%，同期业绩比较基准收益率为 1.79%，截至本报告期末浦银安盛安和回报定开混合 C 的基金份额净值为 1.0180 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.31%，同期业绩比较基准收益率为 1.79%。

### 4.6 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、本报告期内超过连续二十个工作日基金资产净值低于五千万，未超过连续六十个工作日。

## §5 投资组合报告

### 5.1 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 | 权益投资 | 8,461,388.40 | 15.84 |
| | 其中：股票 | 8,461,388.40 | 15.84 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 38,581.18 | 0.07 |
| | 其中：债券 | 38,581.18 | 0.07 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 39,600,000.00 | 74.15 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 4,925,175.35 | 9.22 |
| 8 | 其他资产 | 380,212.69 | 0.71 |
| 9 | 合计 | 53,405,357.62 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 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 | 6,577,716.20 | 12.35 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 411,945.00 | 0.77 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 99,330.00 | 0.19 |
| 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 | 486,841.20 | 0.91 |
| J | 金融业 | 569,002.00 | 1.07 |
| K | 房地产业 | 150,003.00 | 0.28 |
| L | 租赁和商务服务业 | 166,551.00 | 0.31 |
| 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 | 8,461,388.40 | 15.88 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 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 | 002511 | 中顺洁柔 | 16,800 | 462,840.00 | 0.87 |
| 2 | 688599 | 天合光能 | 13,094 | 371,214.90 | 0.70 |
| 3 | 002080 | 中材科技 | 11,900 | 311,423.00 | 0.58 |
| 4 | 300258 | 精锻科技 | 22,000 | 294,140.00 | 0.55 |
| 5 | 002759 | 天际股份 | 7,300 | 271,195.00 | 0.51 |
| 6 | 002624 | 完美世界 | 11,300 | 270,183.00 | 0.51 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 7 | 600810 | 神马股份 | 21,800 | 260,946.00 | 0.49 |
| 8 | 688036 | 传音控股 | 1,243 | 260,408.50 | 0.49 |
| 9 | 603995 | 甬金股份 | 6,600 | 253,770.00 | 0.48 |
| 10 | 603369 | 今世缘 | 4,600 | 249,136.00 | 0.47 |

### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

## 5.4 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） | 38,581.18 | 0.07 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 38,581.18 | 0.07 |

## 5.5 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 | 123083 | 朗新转债 | 314 | 38,581.18 | 0.07 |

## 5.6 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。

## 5.7 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。

## 5.8 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。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被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。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 10,381.40 |
| 2 | 应收证券清算款 | 347,494.31 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 22,336.98 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 380,212.69 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 123083 | 朗新转债 | 38,581.18 | 0.07 |

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 浦银安盛安和回报定开混合 A | 浦银安盛安和回报定开混合 C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 36,400,936.22 | 8,096,166.12 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 32,432,001.02 | 7,122,108.61 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 25,234,132.68 | 6,482,376.20 |
| 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 | 43,598,804.56 | 8,735,898.53 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：1、本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

2、截至本报告期末，本基金管理人的全资子公司上海浦银安盛资产管理有限公司持有浦银安和 A 24,753,936.03 份。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过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 | 1 | 2021 年 06 | 0.00 | 24753936.03 | 0 | 24,753,936.03 | 47.30 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 构 | | 月 09 日-2021 年 06 月 30 日 | | | | | |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 基金管理人提示投资者注意：当特定的机构投资者进行大额赎回操作时，基金管理人需通过对基金持有证券的快速变现以支付赎回款，该等操作可能会产生基金仓位调整的困难，产生冲击成本的风险，并造成基金净值的波动；同时，该等大额赎回将可能产生（1）单位净值尾差风险；（2）基金净值大幅波动的风险；（3）因引发基金本身的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 万元从而影响投资目标实现或造成基金终止等风险。 | | | | | | | |

# §9 备查文件目录

## 9.1 备查文件目录

1、 中国证监会批准基金募集的文件

2、 浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金基金合同

3、 浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金招募说明书

4、 浦银安盛安和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规定报刊上披露的各项公告

8、 中国证监会要求的其他文件

## 9.2 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

## 9.3 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 。

**浦银安盛基金管理有限公司**

**2021 年 7 月 21 日**