

浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资 基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	14
§ 4 管理人报告	16
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	16
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	19
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	20
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	21
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	22
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	23
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	23
4.9 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.....	23
§ 5 托管人报告	24
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	24
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	24
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	24
§ 6 审计报告	25
6.1 审计报告基本信息.....	25
6.2 审计报告的基本内容.....	25
§ 7 年度财务报表	28
7.1 资产负债表.....	28
7.2 利润表.....	29
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	30
7.4 报表附注.....	31
§ 8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况.....	60
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	60
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
8.6 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.....	64
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	64

8.8 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贵金属投资明细	64
8.9 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	64
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
8.12 投资组合报告附注	65
§ 9 基金份额持有人信息	67
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	67
§ 10 开放式基金份额变动	68
§ 11 重大事件揭示	69
11.1 基金份额持有人大会决议	69
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4 基金投资策略的改变	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
11.8 其他重大事件	70
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	72
12.1 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	72
§ 13 备查文件目录	73
13.1 备查文件目录	73
13.2 存放地点	73
13.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金	
基金简称	浦银安盛安恒回报定开混合	
基金主代码	004274	
交易代码	004274	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年8月9日	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	213,026,971.07份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	浦银安盛安恒回报定开混合 A	浦银安盛安恒回报定开混合 C
下属分级基金的交易代码:	004274	004275
报告期末下属分级基金的份额总额	148,729,563.66份	64,297,407.41份

2.2 基金产品说明

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×15%+中证全债指数收益率×85%
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	浦银安盛基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳
	联系电话	021-23212888
	电子邮箱	compliance@py-axa.com
客户服务电话	021-33079999 或 400-8828-999	95561
传真	021-23212985	021-62159217
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 981 号 3 幢 316 室	福州市湖东路 154 号
办公地址	上海市淮海中路 381 号中	上海市银城路 167 号 4 楼

	环广场 38 楼	
邮政编码	200020	200120
法定代表人	谢伟	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据 和 指标	2020 年		2019 年		2018 年 8 月 9 日 (基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日	
	浦银安盛安恒回报定期开放混合 A	浦银安盛安恒回报定期开放混合 C	浦银安盛安恒回报定期开放混合 A	浦银安盛安恒回报定期开放混合 C	浦银安盛安恒回报定期开放混合 A	浦银安盛安恒回报定期开放混合 C
本期已实现收益	44,762,450.38	23,825,513.61	14,765,681.76	4,805,088.63	-665,761.30	-234,884.46
本期利润	51,123,869.88	27,634,018.58	22,653,327.29	8,429,017.33	-2,239,060.99	-647,218.98
加权平均基金份额本期利润	0.1950	0.1883	0.1051	0.0917	-0.0133	-0.0147
本期加权平	17.56%	17.01%	10.09%	8.80%	-1.34%	-1.48%

均净值利润率						
本期基金份额净值增长率	19.12%	18.71%	11.58%	11.14%	-1.33%	-1.47%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
期末可供分配利润	18,119,497.08	7,663,112.59	11,870,343.91	6,429,469.30	-2,239,060.99	-647,218.98
期末可供分配基金份额利	0.1218	0.1192	0.0377	0.0349	-0.0133	-0.0147