

# 浦银安盛优化收益债券型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 29 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。本中期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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |            |
|--|------------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2#</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2#         |
| 1.2 目录.....                                  | 3#         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>6#</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 6#         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 6#         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6#         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 7#         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 7#         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>8#</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 8#         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8#         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>11#</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 11#        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 14#        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 15#        |
| 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.....             | 15#        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 16#        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 17#        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 17#        |
| 4.8 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.....       | 18#        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>19#</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 19#        |
| 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..... | 19#        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....      | 19#        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>20#</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 20#        |
| 6.2 利润表.....                                 | 21#        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 22#        |

|  |            |
|--|------------|
| 6.4 报表附注.....                              | 23#        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>47#</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 47#        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 47#        |
| 7.3 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.....     | 47#        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 47#        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 48#        |
| 7.6 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.....    | 48#        |
| 7.7 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..... | 48#        |
| 7.8 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..... | 48#        |
| 7.9 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.....    | 48#        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 49#        |
| 7.11 投资组合报告附注.....                         | 49#        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>51#</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 51#        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 51#        |
| 8.3 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.....     | 51#        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>53#</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>54#</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 54#        |
| 10.2 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.....      | 54#        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 54#        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 54#        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 54#        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....         | 54#        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 54#        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 56#        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>58#</b> |
| 11.1 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.....    | 58#        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                     | <b>59#</b> |

|                  |     |
|------------------|-----|
| 12.1 备查文件目录..... | 59# |
| 12.2 存放地点.....   | 59# |
| 12.3 查阅方式.....   | 59# |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                   |                |
|-----------------|-------------------|----------------|
| 基金名称            | 浦银安盛优化收益债券型证券投资基金 |                |
| 基金简称            | 浦银安盛优化收益债券        |                |
| 基金主代码           | 519111            |                |
| 交易代码            | 519111            |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式            |                |
| 基金合同生效日         | 2008 年 12 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           | 中国工商银行股份有限公司      |                |
| 报告期末基金份额总额      | 146,741,921.67 份  |                |
| 基金合同存续期         | 不定期               |                |
| 下属分级基金的基金简称:    | 浦银安盛优化收益债券 A      | 浦银安盛优化收益债券 C   |
| 下属分级基金的交易代码:    | 519111            | 519112         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 137,355,977.30 份  | 9,385,944.37 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金通过对宏观经济运行状况、金融市场的运行趋势进行自上而下的分析，通过信用分析为基础进行自下而上的精选个券，在严格控制投资风险的基础上，主要对固定收益市场各种资产定价不合理产生的投资机会进行充分挖掘，力争实现基金资产的长期稳定增值。                    |
| 投资策略   | 本基金在宏观经济和债券市场自上而下和自下而上分析的基础上，把握市场利率的趋势性变化与不同债券的价值差异，通过久期配置、收益率曲线策略等方法，实施积极的债券投资策略。同时，在比较债券类资产与权益类资产投资价值的基础上，通过大类资产配置的调整以获得超越业绩比较基准的投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数   |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型证券投资基金，属于证券投资基金中的较低收益、较低风险品种。一般情形下，其风险和收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币型基金。本基金力争在科学的风险管理的前提下，谋求实现基金资产的安全和增值。                                  |

### 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                   | 中国工商银行股份有限公司          |
| 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<br>400-8828-999 | 95588                 |
| 传真      | 021-23212985                   | 010-66105799          |
| 注册地址    | 中国（上海）自由贸易试验                   | 北京市西城区复兴门内大街 55       |