

上银聚鸿益半年定期开放债券型发起式证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

2019年6月30日

基金管理人:上银基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
送出日期:2019年08月24日

§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。本半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2019年8月23日复核了本报告中财务指标、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。投资者有风险,投资人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。
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。本报告期自2019年01月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上银聚鸿益半年定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	上银聚鸿益半年定开债
基金代码	016422
基金运作方式	契约型开放式
基金存续期间	不定期
基金管理人	上银基金管理有限公司
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	1,010,000,000.00份
基金合同生效日期	2018年7月20日

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以中长期利率趋势判断为基础,结合久期管理,采取自上而下和自下而上相结合的方式确定债券组合久期,并综合考量利率预期、信用状况、流动性状况、风险收益特征等因素,在严格控制风险的前提下,合理配置固定收益类资产,力争实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率+0.50%年化收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金,低于股票型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人及基金托管人

名称	基金管理人	基金托管人
名称	上银基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
住所	福建省厦门市思明区湖滨南路101号1001室	福建省福州市台江区江滨中大道181号
法定代表人	陈建生	高建平
信息披露负责人	陈建生	陈建生
联系电话	010-63202700	021-62070000
电子邮箱	shangyin@shangyin-fund.com	xyb@xybank.com
网址	www.shangyin-fund.com	www.xybank.com

2.4 信息披露方式

基金半年度报告正文的披露网址	www.shangyin-fund.com
基金半年度报告摘要的披露网址	www.shangyin-fund.com

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上银基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
住所	福建省厦门市思明区湖滨南路101号1001室	福建省福州市台江区江滨中大道181号
法定代表人	陈建生	高建平
信息披露负责人	陈建生	陈建生
联系电话	010-63202700	021-62070000
电子邮箱	shangyin@shangyin-fund.com	xyb@xybank.com
网址	www.shangyin-fund.com	www.xybank.com

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。
2、期末可供分配利润采用期末资产负债表末未分配利润与未分配利润中已实现孰低数(均为未余额,不是当期发生数)。
3、上述基金业绩指标不包括基金份额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。
4、本基金基金合同生效日为2018年7月20日,自基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上银基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
住所	福建省厦门市思明区湖滨南路101号1001室	福建省福州市台江区江滨中大道181号
法定代表人	陈建生	高建平
信息披露负责人	陈建生	陈建生
联系电话	010-63202700	021-62070000
电子邮箱	shangyin@shangyin-fund.com	xyb@xybank.com
网址	www.shangyin-fund.com	www.xybank.com

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。
2、期末可供分配利润采用期末资产负债表末未分配利润与未分配利润中已实现孰低数(均为未余额,不是当期发生数)。
3、上述基金业绩指标不包括基金份额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。
4、本基金基金合同生效日为2018年7月20日,自基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上银基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
住所	福建省厦门市思明区湖滨南路101号1001室	福建省福州市台江区江滨中大道181号
法定代表人	陈建生	高建平
信息披露负责人	陈建生	陈建生
联系电话	010-63202700	021-62070000
电子邮箱	shangyin@shangyin-fund.com	xyb@xybank.com
网址	www.shangyin-fund.com	www.xybank.com

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。
2、期末可供分配利润采用期末资产负债表末未分配利润与未分配利润中已实现孰低数(均为未余额,不是当期发生数)。
3、上述基金业绩指标不包括基金份额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。
4、本基金基金合同生效日为2018年7月20日,自基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上银基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
住所	福建省厦门市思明区湖滨南路101号1001室	福建省福州市台江区江滨中大道181号
法定代表人	陈建生	高建平
信息披露负责人	陈建生	陈建生
联系电话	010-63202700	021-62070000
电子邮箱	shangyin@shangyin-fund.com	xyb@xybank.com
网址	www.shangyin-fund.com	www.xybank.com

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。
2、期末可供分配利润采用期末资产负债表末未分配利润与未分配利润中已实现孰低数(均为未余额,不是当期发生数)。
3、上述基金业绩指标不包括基金份额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。
4、本基金基金合同生效日为2018年7月20日,自基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上银基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
住所	福建省厦门市思明区湖滨南路101号1001室	福建省福州市台江区江滨中大道181号
法定代表人	陈建生	高建平
信息披露负责人	陈建生	陈建生
联系电话	010-63202700	021-62070000
电子邮箱	shangyin@shangyin-fund.com	xyb@xybank.com
网址	www.shangyin-fund.com	www.xybank.com

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。
2、期末可供分配利润采用期末资产负债表末未分配利润与未分配利润中已实现孰低数(均为未余额,不是当期发生数)。
3、上述基金业绩指标不包括基金份额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。
4、本基金基金合同生效日为2018年7月20日,自基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上银基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
住所	福建省厦门市思明区湖滨南路101号1001室	福建省福州市台江区江滨中大道181号
法定代表人	陈建生	高建平
信息披露负责人	陈建生	陈建生
联系电话	010-63202700	021-62070000
电子邮箱	shangyin@shangyin-fund.com	xyb@xybank.com
网址	www.shangyin-fund.com	www.xybank.com

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。
2、期末可供分配利润采用期末资产负债表末未分配利润与未分配利润中已实现孰低数(均为未余额,不是当期发生数)。
3、上述基金业绩指标不包括基金份额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。
4、本基金基金合同生效日为2018年7月20日,自基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上银基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
住所	福建省厦门市思明区湖滨南路101号1001室	福建省福州市台江区江滨中大道181号
法定代表人	陈建生	高建平
信息披露负责人	陈建生	陈建生
联系电话	010-63202700	021-62070000
电子邮箱	shangyin@shangyin-fund.com	xyb@xybank.com
网址	www.shangyin-fund.com	www.xybank.com

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。
2、期末可供分配利润采用期末资产负债表末未分配利润与未分配利润中已实现孰低数(均为未余额,不是当期发生数)。
3、上述基金业绩指标不包括基金份额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。
4、本基金基金合同生效日为2018年7月20日,自基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上银基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
住所	福建省厦门市思明区湖滨南路101号1001室	福建省福州市台江区江滨中大道181号
法定代表人	陈建生	高建平
信息披露负责人	陈建生	陈建生
联系电话	010-63202700	021-62070000
电子邮箱	shangyin@shangyin-fund.com	xyb@xybank.com
网址	www.shangyin-fund.com	www.xybank.com

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。
2、期末可供分配利润采用期末资产负债表末未分配利润与未分配利润中已实现孰低数(均为未余额,不是当期发生数)。
3、上述基金业绩指标不包括基金份额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。
4、本基金基金合同生效日为2018年7月20日,自基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上银基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
住所	福建省厦门市思明区湖滨南路101号1001室	福建省福州市台江区江滨中大道181号
法定代表人	陈建生	高建平
信息披露负责人	陈建生	陈建生
联系电话	010-63202700	021-62070000
电子邮箱	shangyin@shangyin-fund.com	xyb@xybank.com
网址	www.shangyin-fund.com	www.xybank.com

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。
2、期末可供分配利润采用期末资产负债表末未分配利润与未分配利润中已实现孰低数(均为未余额,不是当期发生数)。
3、上述基金业绩指标不包括基金份额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。
4、本基金基金合同生效日为2018年7月20日,自基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。

后,将估值结果发送基金托管人。基金托管人则按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核,复核无误后由基金管理人依据基金合同和有关法律法规的规定予以对外公布。
上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内本基金利润分配情况的说明
依据基金合同有关规定,本报告期内本基金向全体份额持有人进行过一次利润分配。权益登记日为2019年3月25日,每10份基金份额派发0.150元,发放红利15,150,000.00元,全部为现金分红。
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况的说明
本报告期内,本基金未出现《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于五千万元需要在半年度报告中予以披露的情况。

5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规、基金合同和托管协议的约定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害基金份额持有人利益的行为。
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵守法规、净值计算、利润分配等情况的说明
报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的约定,对基金管理人在本基金的资产运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为;基金管理人,在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人认真复核了本半年度报告中的财务数据,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表
会计主体:上银聚鸿益半年定期开放债券型发起式证券投资基金
报告截止日:2019年06月30日
单位:人民币元

资产	本报告期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
货币资金	8,152,928.14	1,145,028.62
结算备付金	4,296,728.14	3,932,028.62
交易性金融资产	34,515.14	30,628.22
买入返售金融资产	1,206,791,148.00	1,037,366,368.00
应收款项	—	—
预付款项	1,206,791,148.00	1,037,366,368.00
应收利息	—	—
其他资产	—	—
资产总计	1,419,951,759.28	1,076,731,823.44
负债	—	—
短期借款	—	—
应付票据	—	—
应付账款	—	—
预收款项	—	—
应付利息	—	—
应付股利	—	—
其他负债	—	—
负债总计	—	—
所有者权益	1,419,951,759.28	1,076,731,823.44
实收资本	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
未分配利润	409,951,759.28	66,731,823.44
所有者权益合计	1,419,951,759.28	1,076,731,823.44

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.0341元,基金份额总额1,010,000,000.00份。
6.2 利润表
会计主体:上银聚鸿益半年定期开放债券型发起式证券投资基金
本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日
单位:人民币元

项目	本报告 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度 2018年1月1日至2018年12月31日
一、收入	81,022,833.41	81,022,833.41
利息收入	81,022,833.41	81,022,833.41
投资收益	—	—
公允价值变动损益	—	—
其他收入	—	—
二、费用	122,969.89	122,969.89
销售费用	30,735,248.64	30,735,248.64
管理费用	88,624.25	88,624.25
其他费用	41,096.99	41,096.99
三、利润总额	80,852,863.52	80,852,863.52
所得税费用	—	—
净利润	80,852,863.52	80,852,863.52
归属于基金持有人的净利润	80,852,863.52	80,852,863.52
四、每股收益	—	—
基本每股收益	—	—
稀释每股收益	—	—
五、其他综合收益	—	—
六、综合收益总额	80,852,863.52	80,852,863.52
归属于基金持有人的综合收益总额	80,852,863.52	80,852,863.52
七、净利润	80,852,863.52	80,852,863.52
归属于基金持有人的净利润	80,852,863.52	80,852,863.52
八、每股收益	—	—
基本每股收益	—	—
稀释每股收益	—	—
九、其他综合收益	—	—
综合收益总额	80,852,863.52	80,852,863.52
归属于基金持有人的综合收益总额	80,852,863.52	80,852,863.52
净利润	80,852,863.52	80,852,863.52
归属于基金持有人的净利润	80,852,863.52	80,852,863.52
每股收益	—	—
基本每股收益	—	—
稀释每股收益	—	—

注:本基金合同生效日为2019年7月20日,截至本报告期末,本基金合同生效日未满一年,本报告期间的利润表无同期可比数据。
6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:上银聚鸿益半年定期开放债券型发起式证券投资基金
本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日
单位:人民币元

项目	本报告 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度 2018年1月1日至2018年12月31日
一、基金份额总额	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
二、基金份额净值	1.0341	1.0341
三、基金份额总额变动	—	—
四、基金份额净值变动	—	—
五、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
六、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
七、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
八、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
九、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
十、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
十一、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
十二、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
十三、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
十四、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
十五、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
十六、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
十七、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
十八、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
十九、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
二十、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
二十一、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
二十二、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
二十三、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
二十四、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
二十五、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
二十六、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
二十七、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
二十八、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
二十九、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
三十、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
三十一、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
三十二、基金份额总额及净值变动	1,010,000,000.00	1