浦银安盛港股通稳定优选灵活配置混合型证券投资基金2019年第2季度报告

2019-07-20

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：2019-07-20

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事会成员保证报告所载资料的真实性、准确性和完整性，对报告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，承担个别和连带的责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月12日复核了本期报告中的财务指标、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。

本报告中财务数据的审计：

未经审计

本报告期2019年1月1日至2019年3月31日。

§2 基金简介

基金基本情况

项目	概况
基金简称	浦银安盛港股通稳定优选
场内简称	-
基金主代码	005233
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018-01-24
报告期末基金份额总额	216,103,171.32
投资目标	本基金通过积极主动的资产配置，在合理控制风险并保证充分流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	资产配置策略:采用自上而下的方法，根据宏观经济、证券市场、上市公司等方面的分析框架，动态把握不同资产类别的投资价值，用定性研究以及风险收益特征的量化研究，进行配置。固收类资产配置方式为：根据宏观经济、证券市场、上市公司等方面的分析框架，动态把握不同资产类别的投资价值，用定性研究以及风险收益特征的量化研究，进行配置。股票类资产配置方式为：根据宏观经济、证券市场、上市公司等方面的分析框架，动态把握不同资产类别的投资价值，用定性研究以及风险收益特征的量化研究，进行配置。港股通标的股票投资策略：本基金将在港股通标的范围内，结合定性分析和定量分析，根据公司的盈利能力、成长性、估值水平等因素，选择具有长期投资价值的优质公司作为投资对象。
业绩比较基准	恒生综合指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高风险、中长期收益预期收益品种，其风险收益预期高于货币市场基金、债券型基金、本基金可投资港股通标的股票，港股通标的投资面临市场风险、汇率风险、流动性风险、政策风险、特有风险等风险。
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

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019-04-01-2019-06-30）
本期已实现收益	-2,734,101.19
本期利润	-1,906,725.73
加权平均基金份额本期利润	-0.0088
期末基金资产净值	208,388,403.90
期末基金份额净值	0.9642

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、本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入－个人所得税－管理费－托管费－交易费－其他费用。

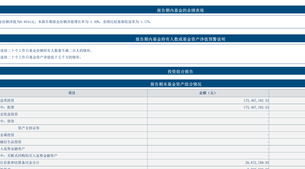
3、本期期末数为本期末最后一个报告期日的数据。

基金净值表现

本期末至期末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

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	-0.88%	0.43%	-1.17%	0.32%	0.29%	0.11%

自基金合同生效日至基金份额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



注：1、根据基金合同规定，基金管理人应当在基金合同生效之日起6个月内使基金投资组合比例符合基金合同的各项约定，本基金建立期为2018-1-24至2018-7-24日，建立期间未进行任何调仓。

2、业绩基准指标计算标准基点时间参数：以周末最后一个交易日的数据为准。

其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2019-04-01至2019-06-30）
其他指标	报告期（2019-06-30）

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		
Tools Ka-er	公司数字研究部数据建模及量化投资策略小组组长兼基金经理;公司数字研究部量化投资策略小组副组长兼基金经理;公司数字研究部量化投资策略小组组长兼基金经理;浦银安盛沪深300指数增强基金（ETF）基金经理。	2018-01-24	-	20	Tools Ka-er女士，日本广岛大学经济学硕士，CFA。2009年至2009年在日本野村证券证券研究部实习，2009年在日本野村证券担任日本金融投资管理公司证券从业人员，2010年10月加盟浦银安盛基金管理有限公司从事海外产品投资研究等工作，2011年7月担任浦银安盛沪深300指数增强基金（ETF）基金经理，2013年7月担任公司数字研究部量化投资策略小组组长兼基金经理，2015年1月起，兼任浦银安盛港股通稳定优选灵活配置混合型证券投资基金经理，2019年5月起，兼任浦银安盛港股通稳定优选灵活配置混合型证券投资基金经理。2019年5月起，兼任浦银安盛沪深300指数增强基金（ETF）基金经理。
李莹	公司数字研究部数据建模及量化投资策略小组组长兼基金经理;公司数字研究部量化投资策略小组副组长兼基金经理	2018-01-24	-	12	李莹女士，测量工程学硕士学位及金融学硕士，2007年10月入职，历任研究员、高级研究员、基金经理助理、基金经理（现任基金经理：2011年7月起，兼任浦银安盛沪深300指数增强基金（ETF）基金经理，2013年7月起，兼任浦银安盛港股通稳定优选灵活配置混合型证券投资基金经理，2015年1月起，兼任浦银安盛港股通稳定优选灵活配置混合型证券投资基金经理，2019年5月起，兼任浦银安盛沪深300指数增强基金（ETF）基金经理。

注：1、本基金基金经理的任职日期为公司公告的日期。

2、证券从业年限计算标准遵从证券业协会《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》及其他有关法律法规、证监会颁发的有关法律规定、本基金合同、基金管理人内部规章制度，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。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

本报告期内本基金（以下简称管理人）遵从并建立了有效的公平交易制度和体系，保证公平对待旗下所有一个基金组合。

在日内投资决策、日内投资交易阶段，一级市场（证券发行）、场外申购赎回以及场内（证券交易所）、严格遵守公司投资决策程序和交易规则，保证交易基金及公平分配各投资组合的投资机会和投资指令的交易机会的原则，以保证投资决策公正程序的公平性，本报告期内，公司投资决策程序、交易规则执行情况良好，未发现违反公平交易原则的情况。

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业务规则及其他有关证券交易管理规定的行为，未发现本基金当日单笔成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

报告期内基金投资和业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.9642元，本期实现基金份额净值增长率为-0.88%，业绩比较基准收益率为-1.17%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

1、本报告期内未出现基金资产净值低于5亿元的情况。

2、本报告期内未出现连续二个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情况。

§3 主要财务指标

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	权益类投资	175,407,192.32	80.09
	其中：股票	175,407,192.32	80.09
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式逆回购	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	29,973,199.93	13.69
7	其他资产	1,002,402.32	0.46
8	合计	206,372,594.57	100.00

注：权益投资金额栏填写（公允价值）。

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	农、林、牧、渔业	-	-
2	采矿业	-	-
3	制造业	10,396,192.32	4.99
4	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
5	建筑业	-	-
6	批发零售业	-	-
7	交通运输、仓储和邮政业	-	-
8	住宿和餐饮业	-	-
9	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
10	金融业	-	-
11	房地产业	-	-
12	租赁和商务服务业	-	-
13	科学研究和技术服务业	-	-
14	水利、环境和公共设施管理业	-	-
15	居民服务、修理和其他服务业	-	-
16	教育	-	-
17	卫生和社会工作	-	-
18	文化、体育和娱乐业	-	-
19	综合	-	-
	合计	-	-

注：本期末未基金投资境内股票。

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

序号	行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
1	基础材料	7,101,377.20	3.40
2	消费非必需品	8,176,589.72	3.92
3	消费必需品	15,423,155.16	7.40
4	医疗保健	5,199,990.12	2.49
5	金融	32,423,180.64	15.56
6	房地产	21,951,300.08	10.53
7	公用事业	25,397,412.80	12.19
8	通信服务	25,110,792.40	12.05
9	信息技术	19,799,390.40	9.50
10	工业	22,408,953.20	10.75
11	能源	17,485,102.32	8.39
合计		175,407,192.32	84.18

注：权益投资前十名。

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港股投资明细

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	00700	腾讯控股	46,900	15,797,537.10	7.58
2	00941	中国移动	200,500	13,921,908.50	6.68
3	00939	建设银行	1,719,000	10,325,508.78	5.18
4	00941	中国移动	110,500	7,673,302.50	3.68
5	01088	中国神华	1,905,000	5,328,982.30	2.56
6	00883	五矿	73,600	5,012,302.40	2.41
7	02318	中国平安	55,500	4,914,385.70	2.36
8	00883	中国海洋石油	208,000	4,181,527.40	2.01
9	01398	工商银行	1,200,000	3,725,452.32	1.79
10	00386	国机工业	66,000	3,724,718.16	1.79

注：权益投资前十名。

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	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债投资	-	-
	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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

注：本基金本期末未投资债券。

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	-	-	-	-	-
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

注：本期末本基金未投资债券。

报告期末按照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：本期末本基金未投资资产支持证券。

报告期末按照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：本期末本基金未投资权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本期末本基金未投资股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期末本基金未投资国债期货。

投资组合情况说明

受托期基金信息情况

报告期内本基金受托管理的子公司名称为交通银行银行资产管理有限公司，报告期内未发生该子公司投资情况。

申购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的说明

本基金投资范围为港股通标的股票，投资范围以基金合同规定的备选股票库为准。

报告期末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

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	00700	腾讯控股	46,900	15,797,537.10	7.58
2	00941	中国移动	200,500	13,921,908.50	6.68
3	00939	建设银行	1,719,000	10,325,508.78	5.18
4	00941	中国移动	110,500	7,673,302.50	3.68
5	01088	中国神华	1,905,000	5,328,982.30	2.56
6	00883	五矿	73,600	5,012,302.40	2.41
7	02318	中国平安	55,500	4,914,385.70	2.36
8	00883	中国海洋石油	208,000	4,181,527.40	2.01
9	01398	工商银行	1,200,000	3,725,452.32	1.79
10	00386	国机工业	66,000	3,724,718.16	1.79

报告期末基金投资的股票投资比例超过基金资产净值5%的说明

本期末本基金投资股票市值未超过基金资产净值5%。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本期末本基金未投资股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期末本基金未投资国债期货。

报告期末本基金投资的股票投资组合的交易费用

交易费用类别	交易成本（元）
佣金	-
印花税	-
合计	-

注：本期末本基金无股票投资交易费用。

报告期末本基金投资的股票投资组合的交易费用超过基金当期利润或资产净值千分之一的情况

本期末本基金无股票投资交易费用超过基金当期利润或资产净值千分之一的情况。

报告期末本基金投资的股票投资组合的交易费用与上期相比发生较大变动的情况

本期末本基金无股票投资交易费用与上期相比发生较大变动的情况。

报告期末本基金投资的股票投资组合的换手率

换手率
0.00%

报告期末本基金投资的股票投资组合的换手率与基金规模的关系

换手率	基金规模
0.00%	208,388,403.90

报告期末本基金投资的股票投资组合的换手率与同类型基金或同投资风格基金的比较

换手率	同类型基金或同投资风格基金的换手率
0.00%	0.00%

报告期末本基金投资的股票投资组合的换手率与同类型基金或同投资风格基金的换手率的比较说明

本期末本基金换手率与同类型基金或同投资风格基金的换手率一致。