

浦银安盛量化多策略灵活配置混合证券投资基金2019年第二季度报告

2019-06-30

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：2019-07-16

重要提示

基金管理人承诺基金财产由基金托管人保管，基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人承诺基金财产由基金托管人保管，基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人承诺基金财产由基金托管人保管，基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

基金基本情况

Table with 2 columns: Item (项目) and Value (数值). Includes details like fund name, code, type, and investment objectives.

主要财务指标

Table with 4 columns: Main Financial Indicators (主要财务指标), Main Fund Assets (本基金资产), and Performance for different periods.

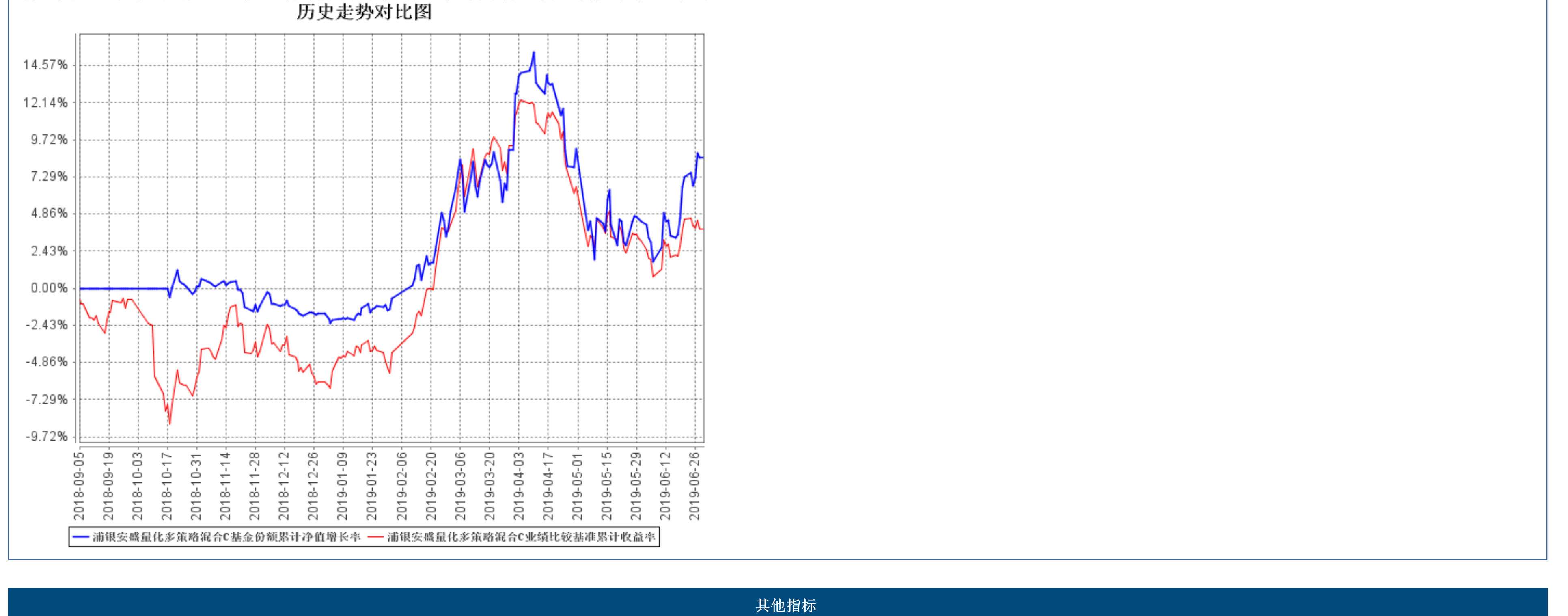
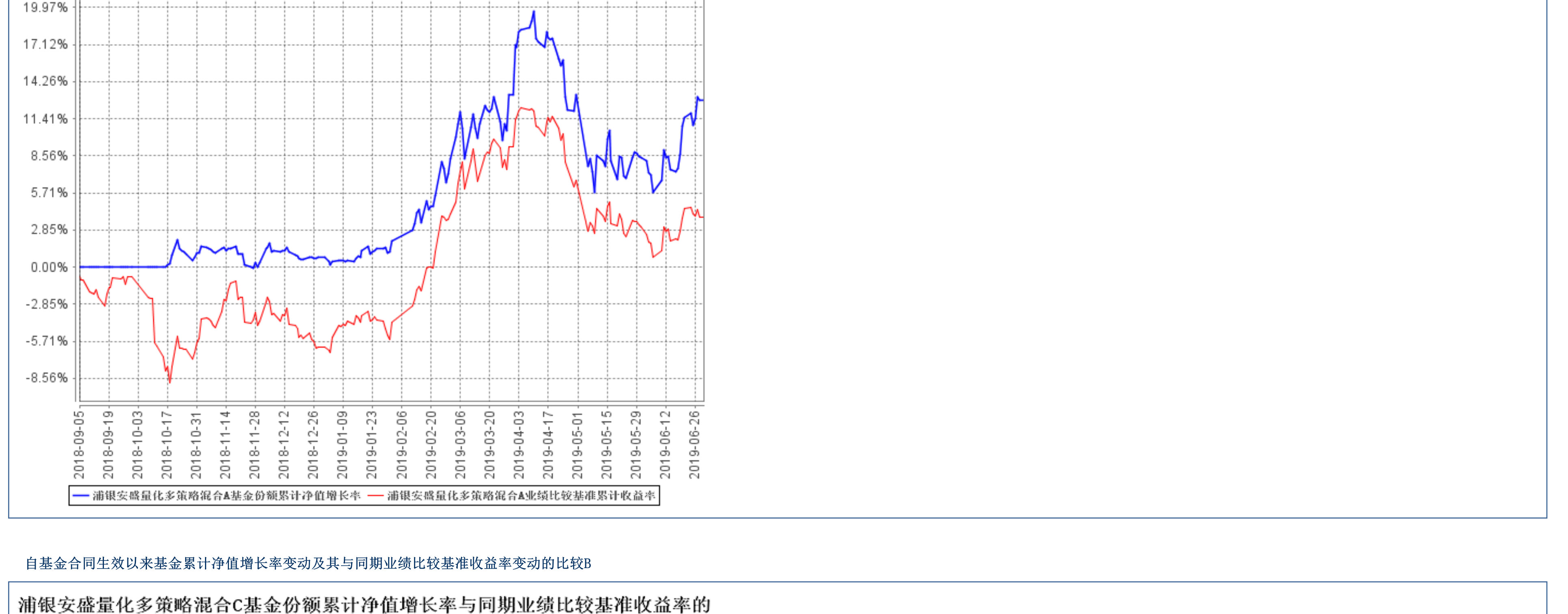
注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。
2、本期已实现收益指基金本期实现的收益，扣除费用后，其收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。
3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

基金净值表现

Table showing performance comparison between the fund and its benchmark over various periods.

Table showing performance comparison between the fund and its benchmark over various periods.

Table showing performance comparison between the fund and its benchmark over various periods.



其他指标

Table with 2 columns: Other Indicators (其他指标) and Reporting Period (报告期间).

基金经理 (或基金小组) 简介

Table listing the fund manager's name, position, and background information.

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。

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。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况
本基金管理人根据《公平交易管理制度》，建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待了每一个投资组合。

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、中国证监会规定和基金合同约定的异常交易行为。

报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛量化多策略混合基金资产净值为1.1257元，本报告期基金份额净值增长率为-0.32%，截至本报告期末浦银安盛量化多策略混合基金资产净值为1.0856元，本报告期基金份额净值增长率为-0.42%，同期业绩比较基准收益率为-4.99%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

1、本报告期内未发生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、本报告期内连续超过二十个工作日基金资产净值低于五千万元，本基金管理人已按规定向中国证监会进行了报告并提交了解决方案。

投资组合报告

Table showing the top 10 stock holdings of the fund as of the reporting period.

报告期末按行业分类的境内股权投资组合

Table showing the fund's domestic equity investment portfolio categorized by industry.

报告期末按行业分类的港股投资股票组合

Table showing the fund's Hong Kong equity investment portfolio categorized by industry.

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

Table showing the top 10 stock holdings of the fund based on fair value.

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing the fund's bond investment portfolio categorized by bond type.

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

Table showing the top 5 bond holdings of the fund based on fair value.

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资产支持证券投资明细

Table showing the top 5 asset-backed investment holdings of the fund based on fair value.

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

Table showing the top 5 precious metal holdings of the fund based on fair value.

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

Table showing the top 5 warrant holdings of the fund based on fair value.

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table showing the fund's futures trading positions and P&L.

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。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table showing the fund's Treasury futures trading positions and P&L.

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table showing the fund's Treasury futures trading positions and P&L.

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

Table showing the top 5 warrant holdings of the fund based on fair value.

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table showing the fund's futures trading positions and P&L.

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

Table showing the top 5 warrant holdings of the fund based on fair value.

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

Table showing the top 5 warrant holdings of the fund based on fair value.

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

Table showing the top 5 warrant holdings of the fund based on fair value.

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

Table showing the top 5 warrant holdings of the fund based on fair value.

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

Table showing the top 5 warrant holdings of the fund based on fair value.

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

Table showing the top 5 warrant holdings of the fund based on fair value.

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

Table showing the top 5 warrant holdings of the fund based on fair value.

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

Table showing the top 5 warrant holdings of the fund based on fair value.

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

Table showing the top 5 warrant holdings of the fund based on fair value.

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

Table showing the top 5 warrant holdings of the fund based on fair value.

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

Table showing the top 5 warrant holdings of the fund based on fair value.

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

Table showing the top 5 warrant holdings of the fund based on fair value.

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

Table showing the top 5 warrant holdings of the fund based on fair value.

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

Table showing the top 5 warrant holdings of the fund based on fair value.

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

Table showing the top 5 warrant holdings of the fund based on fair value.