浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金2019年第3季度报告

2019-09-30

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2019-10-31

§1 重要提示
§2 基金简介
§3 主要财务指标、基金净值表现
§4 管理人报告
§5 托管人报告
§6 报告期末基金资产组合情况
§7 报告期末按行业分类的股票投资组合
§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十名股票投资明细
§9 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
§10 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
§11 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
§12 报告期末本基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查的情况说明
§13 报告期末其他各项资产构成明细
§14 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
§15 基金管理人从事证券投资业务情况
§16 报告期末发起式基金发展情况
§17 报告期末发起式基金承担的证券业务佣金情况
§18 报告期末本基金投资的股票发行主体中信证券股份有限公司的投资决策程序说明
§19 投资组合报告附注
§20 开放式基金份额变动
§21 重大事件揭示
§22 影响投资者决策的其他重要信息
§23 备查文件目录

§2 基金简介

基金管理人

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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证投资者投资本基金的最低收益。

基金管理人不保证基金过往业绩及其净值高低对基金未来业绩的预测。投资者应认真阅读本基金的招募说明书、基金合同及时关注基金的公告。

基金管理人根据基金运作的实际情况对本报告进行编制。

基金托管人

基金托管人保证在对基金管理人的投资运作进行监督的过程中，严格按照法律、法规、基金合同及其他有关规定，忠实履行自己的义务，不谋取非法利益，不从事违反法律、法规、基金合同及其他有关规定的行为。

基金概况

项目	概况
基金简称	浦银安盛精致生活混合
场内简称	
基金主代码	519111
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008-08-04
报告期末基金份额总额	175,381,588.48
投资目标	在不降低资产流动性前提下获取较高收益，并在此基础上力争实现长期稳定的资本增值。
投资策略	1、分享股市长期增长的投资策略，本基金将根据宏观经济、证券市场资金流向、市场估值水平、市场风险等因素，对股票、债券、现金等资产的配置比例进行调整，以期在控制风险的前提下，实现基金资产的稳定增长。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证全债指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019-07-01-2019-09-30）
本期已实现收益	41,471,929.12
本期利润	48,101,105.32
加权平均基金份额本期利润	0.2806
期末基金资产净值	211,201,311.20
期末基金份额净值	1.2040

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（不含公允价值变动损益）扣除费用后的余额。

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

基金净值表现

本报告期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	18.81 %	0.79 %	-0.19 %	0.53 %	19.00 %	0.26 %

基金合同生效日以来基金累计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、自2011年9月1日起，本基金业绩比较基准由“中信标普300指数×10%+中信标普全债指数×90%”变更为“中信标普300指数×10%+中证全债指数×90%”，其他内容未发生变更。根据基金管理人于2011年9月1日发布的《关于变更旗下基金业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》。

其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2019-07-01-2019-09-30）
其他指标	报告期（2019-09-30）
可分配收益	21,101,311.20

管理人对报告期内本基金运作遵守合规性的说明

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，以及基金运作合同的约定，本基金运作合规，没有发生违反法律、法规、基金合同及其他有关规定的情况。

管理人对报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

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，以及基金运作合同的约定，本基金运作合规，没有发生违反法律、法规、基金合同及其他有关规定的情况。

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》，建立并健全了投资组合公平交易的分析、报告、监督等一系列管理流程。

1、公平交易的执行：投资决策流程上，根据投资组合的风格特征、目标、业绩特征及投资风格，严格遵守投资决策委员会、投资总监、基金经理、交易部门、研究部门、投资顾问等组成的投资决策委员会决策流程，在投资决策委员会的指导下，由基金经理进行决策，并通过交易部门执行。

2、公平交易的监控：交易部门在日常交易执行过程中，实时监控交易过程，对不同投资组合的交易时间、交易品种、交易价格、交易方向、交易量等进行监控，并定期对交易情况进行分析，并形成报告。

3、公平交易的分析报告：公平交易报告主要内容包括：不同投资组合之间同日反向交易、同日同向交易、不同投资组合之间同日交易、不同投资组合之间一段时间内交易、不同投资组合之间一段时间内交易的价格、不同投资组合之间一段时间内交易的价格、不同投资组合之间一段时间内交易的价格