

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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2019-10-25

重要提示

基金管理人承诺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责任。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2019年10月23日复核了本报告中的财务指标、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预示其未来表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。本报告自2019年7月1日起至9月30日止。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes 基金名称 (浦银安盛价值成长混合), 基金代码 (519110), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日 (2008-04-16), 报告期末基金份额总额 (1,255,651,882.91), 投资目标 (以追求长期资本增值为目的...), 投资策略 (本基金奉行自上而下与自下而上相结合的投资策略...), 业绩比较基准 (沪深300指数×75%+中证全指指数×25%), 风险收益特征 (本基金为混合型基金产品...), 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).

注：自2015年8月1日起，本基金类型由股票型变更为混合型，本基金的基金名称变更为“浦银安盛价值成长混合型证券投资基金”。本基金业绩比较基准由“沪深300指数×75%+中证全指指数×25%”变更为“沪深300指数×75%+中证全指指数×25%”。具体内容详见基金管理人于2015年8月4日发布的《关于浦银安盛价值成长混合型证券投资基金变更基金名称、基金类型及业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》。

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期 (2019-07-01 至 2019-09-30). Includes 本期已实现收益 (87,953,462.31), 本期利润 (62,141,824.39), 加权平均基金份额本期利润 (0.0305), 期末基金资产净值 (1,626,355,035.69), 期末基金份额净值 (1.296).

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利息收入、投资收益、其他收入（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 with 2 columns: 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 (Comparison of fund net value growth rate and benchmark return). Includes 本报告期 (2.97%), 本报告期业绩比较基准收益率 (1.32%), 业绩比较基准收益率差 (0.21%), 业绩比较基准收益率差标准差 (0.72%), ①-② (2.18%), ②-③ (0.60%).

自基金合同生效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

浦银安盛价值成长混合型基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：自2015年8月1日起，本基金类型由股票型证券投资基金变更为混合型证券投资基金，本基金的基金名称变更为“浦银安盛价值成长混合型证券投资基金”。具体内容详见基金管理人于2015年8月4日发布的《关于浦银安盛价值成长混合型证券投资基金变更基金名称、基金类型及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

Table with 2 columns: 其他指标 (Other Indicators) and 报告期 (2019-07-01至2019-09-30). Includes 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).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with 5 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金基金经理的任期 (Term as Fund Manager), 证券从业年限 (Years of Securities Industry Experience), 说明 (Remarks). Includes 曹建伟 (Cao Jianwei) as the fund manager.

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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

管理人对于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。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

本基金管理人根据《公平交易管理规定》，建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待下的每一个投资组合。在具体执行中，在投资决策流程中，由统一的研究平台，为所有投资组合公平的提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度，保证公募基金及专户业务的独立投资决策机制。在交易执行环节上，详细制定了对多个投资组合的资产指令下达执行的流程和规定，以保证投资指令执行的公平性。从事后监控角度上，一方面定期对投资组合交易情况进行分析，对不同时间窗口（日、1日、3日、5日和10日）发生的不同组合对同一股票的同向交易及反向交易进行价差分析，并进行及时复盘分析，以核实交易价差和成交基金的业绩差异情况。同时通过对投资组合及其各投资组合的收益率进行分析；另一方面定期对公平交易制度的遵守和业务流程的严格执行情况进行定期核查，并对发现的问题进行及时的报告。本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，公平对待旗下各投资组合，未发现违反公平交易的行为。

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颁布的相关规范性文件中的异常交易行为。报告期内未发生旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量的5%的情形。

报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，市场继续维持了震荡的走势，市场最大的下跌因素依然是中美摩擦之间的不确定性，但市场对市场的韧性逐渐增强，由于全球经济增长趋缓，货币利率下行，股票市场的优质核心资产，虽然业绩增速有限，但是估值可以得到较充分的提升。市场就在这样一个背景下，变得不再那么脆弱。而华为供应链为代表的电子股，受益于中美贸易下的订单转移，业绩增长非常稳健，整个板块有了很好的收益。港口行业有望全面加速并逐渐扩散到其他行业。我们在三季度适当增加了持仓调整，减持了部分上週涨幅较大的品种，增加了估值更为合理的股票。

报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.296元，本报告期基金份额净值增长率为2.37%，业绩比较基准收益率为1.21%。

报告期内基金份额持有人或基金资产净值预警说明

1、本报告期内未出现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、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount in Yuan), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage of Total Assets). Includes 权益类投资 (1,490,743,361.67), 固定收益类投资 (3,602,170.00), 贵金属投资 (0.00), 金融衍生品投资 (0.00), 买入返售金融资产 (0.00), 银行存款和结算备付金合计 (134,156,631.90), 其他资产 (5,241,258.22), 合计 (1,633,743,423.79).

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Includes 农林牧渔, 采矿业, 制造业, 电力、热力、燃气及水生产和供应业, 建筑业, 批发和零售业, 交通运输、仓储和邮政业, 信息传输、软件和信息技术服务业, 金融业, 房地产业, 租赁和商务服务业, 科学研究和技术服务业, 水利、环境和公共设施管理业, 居民服务、修理和其他服务业, 教育, 卫生和社公事业, 文化、体育和娱乐业, 综合, 合计.

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table with 4 columns: 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Includes 基础材料, 消费必需品, 消费品, 能源, 金融, 医疗健康, 工业, 信息技术, 电信服务, 公用事业, 房地产.

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

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 with 6 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Includes 安纳达, 星源材质, 中环股份, 贵州茅台, 康龙升泰, 中微光电, 上海钢联, 海三晶, 五粮液, 沃森生物.

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Includes 国家债券, 央行票据, 金融债券, 政策性金融债, 企业短期融资券, 中期票据, 可转债 (可交换债), 其他, 合计.

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 with 6 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (张) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Includes 国债转债.

期末按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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：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 with 5 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险指标说明 (Risk Indicator). Includes 国债期货投资本期收益 (元) (0.00) and 国债期货投资本期公允价值变动 (元) (0.00).

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

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交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 5 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险指标说明 (Risk Indicator). Includes 国债期货投资本期收益 (元) (0.00) and 国债期货投资本期公允价值变动 (元) (0.00).

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

申明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

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票的范围。

其他资产构成

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount in Yuan). Includes 存出保证金 (554,288.98), 应收证券清算款 (4,212,044.90), 应收股利 (28,643.73), 应收申购款 (146,270.06), 其他 (5,241,258.22).

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes 报告期初基金份额总额 (1,523,789,326.29), 报告期间基金份额总额 (19,644,209.07), 减：报告期间基金份额总额 (287,781,503.05), 报告期间基金份额变动 (份额减少以“-”填列) (1,255,651,882.91).

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 基金份额 (Fund Shares). Includes 报告期初管理人持有的基金份额 (0.00), 报告期间买入/申购基金份额 (0.00), 报告期间卖出/赎回基金份额 (0.00), 报告期末管理人持有的基金份额 (0.00), 报告期末管理人持有的基金份额占基金份额总额 (%) (0.00).

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 交易日期 (Transaction Date), 交易品种 (Instrument), 交易金额 (元) (Amount in Yuan), 适用费率 (Applicable Rate). Includes 合计 (Total).

报告期末发起式基金发起资金投资本基金情况

Table with 5 columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Shares), 持有份额占基金份额总额比例 (Percentage of Total Shares), 发起份额总数 (Initiated Shares), 发起份额占基金份额总额比例 (Percentage of Total Shares), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Period).

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

Table with 5 columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval), 期初份额 (Start Shares), 申购份额 (Purchase Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有基金份额 (Total Shares), 份额占比 (Percentage). Includes 机构 (Institution) and 个人 (Individual).

基金管理人提示投资风险：当发生机构投资者进行大额赎回时，基金管理人承诺对持有证券的变现速度以及变现价格，该等资产可能会产生基金份额折损的风险，产生折损成本的风险，并造成基金份额的波动。同时，该等大额赎回还可能产生：(1) 单位净值波动风险；(2) 基金估值大幅波动的风险；(3) 引发基金本身的巨额赎回导致中小投资者无法及时赎回的风险；以及(4) 因基金资产净值低于5000万元从而触发投资目标实现或基金合同终止等风险。

影响投资决策的其他重要信息

注：本基金本报告期末未持有其他重要信息。

备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件
2、浦银安盛价值成长混合型证券投资基金基金合同
3、浦银安盛价值成长混合型证券投资基金招募说明书
4、浦银安盛价值成长混合型证券投资基金托管协议
5、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
6、基金托管人业务资格批件和营业执照
7、本报告期内在中国证监会指定报刊上披露过的所有公告
8、中国证监会要求的其他文件

存放地点

上海市淮海中路341号中核7楼浦银安盛基金管理人办公场所。

查阅方式

投资者可登录基金管理人网站 (www.py-asa.com) 查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。客户服务电话：400-888-999 或 021-3309999。