

重要提示

基金管理人承诺基金合同生效后本报告所载数据不存在虚假记载、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。基金托管人承诺按照基金合同规定，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，保证基金合同不存在虚假记载、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，也不保证基金资产净值不受损失。基金的投资业绩并不代表其未来表现，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读基金的风险揭示书。本报告中所列数据未经审计。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 数据 (Data). Rows include 基金简称, 场内简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 报告期末基金份额总额, 报告期末基金份额净值, 报告期末基金份额总额, 报告期末基金份额净值.

注：1、上述基金份额数据不包括持有人认购基金的各项费用，计入认购基金份额净值低于两个百分点。
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。

主要财务指标

Table with 4 columns: 主要财务指标, 主要货币(元), 浦银安盛安恒回报定期开放混合 2019-07-01 - 2019-09-30, 浦银安盛安恒回报定期开放混合C(元) 2019-07-01 - 2019-09-30. Rows include 本期已实现收益, 本期利润, 加权平均基金份额本期利润, 期末基金份额净值, 期末基金份额净值.

注：1、上述基金份额数据不包括持有人认购基金的各项费用，计入认购基金份额净值低于两个百分点。
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

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

Table with 6 columns: 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. Rows include 本报告期, 过去三个月.

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

Table with 6 columns: 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. Rows include 过去三个月.

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

Table with 6 columns: 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. Rows include 过去三个月.

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

注：根据基金合同约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。本基金建仓期为2018年8月1日至2019年2月1日，建仓期结束时符合相关规定。

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

注：根据基金合同约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。本基金建仓期为2018年8月1日至2019年2月1日，建仓期结束时符合相关规定。

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

注：根据基金合同约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。本基金建仓期为2018年8月1日至2019年2月1日，建仓期结束时符合相关规定。

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

注：根据基金合同约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。本基金建仓期为2018年8月1日至2019年2月1日，建仓期结束时符合相关规定。

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

注：根据基金合同约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。本基金建仓期为2018年8月1日至2019年2月1日，建仓期结束时符合相关规定。

其他指标

Table with 2 columns: 其他指标, 报告期末(2019-07-01至2019-09-30), 报告期末(2019-09-30).

基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明. Rows include 褚晓刚.

注：1、本基金基金经理的任职日期为基金合同约定的日期。
2、证券从业年限的计算标准遵照中国证监会《证券投资基金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

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。报告期内本基金管理人没有发生任何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

本基金管理人根据《公平交易管理制度》，建立健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待所管理的每一个投资组合。在投资决策过程中，在投资流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平提供研究支持。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授权控制制度，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，详细制定了针对多个投资组合的投顾环节的公平交易执行的程序规范，以保证投资指令交易过程的公平性。从事后监控角度，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（同日、3日、5日、10日）发生的不同组合同一股票的交易价差进行分析，并设计跟踪监控系统，以实现对异常交易行为的实时监控。同时加强投资组合交易指令的实时监控，对异常交易行为进行定期核查，并及时发现问题进行及时的报告。

异常交易行为的专项说明

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比例。

报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，在较多外部因素冲击以及国内经济增速的大背景下，股票市场呈现一定结构性。从板块上看，中小盘好于大盘及大盘蓝筹。从行业上看，电子计算机为代表的科技股和医药食品饮料为代表的消费股走强，在多数行业下跌，周期股跌幅较大；从主线上看，消费电子、芯片、国产替代、医药服务、白酒等受政策驱动。

报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛安恒回报定期开放混合A基金份额净值为1.0725元，本报告期基金份额增长率为0.80%；截至本报告期末浦银安盛安恒回报定期开放混合C基金份额净值为1.0500元，本报告期基金份额增长率为0.72%，同期业绩比较基准收益率为1.27%。

报告期内基金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 5 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 5 columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

报告期末按行业分类的港股股票投资组合

Table with 5 columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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 5 columns: 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(%)

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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 5 columns: 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(%)

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 with 5 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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 with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

报告期末本基金投资的股指期货持仓交易情况说明

Table with 5 columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约价值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

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交易情况说明

Table with 5 columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约价值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

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。

报告期末本基金投资的国债期货持仓交易情况说明

Table with 5 columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约价值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

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因违法违规行为受到监管部门立案调查或在报告期内一年内受到公开谴责、处罚的情况。

申明基金投资的前十名股票是否涉及基金合同约定的备选股票

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约定的备选股票的范围。

其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

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的情况。

开放式基金份额变动

Table with 4 columns: 项目, 浦银安盛安恒回报定期开放混合, 浦银安盛安恒回报定期开放混合A, 浦银安盛安恒回报定期开放混合C

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 4 columns: 项目, 浦银安盛安恒回报定期开放混合, 浦银安盛安恒回报定期开放混合A, 浦银安盛安恒回报定期开放混合C

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, 交易方式, 交易日期, 交易金额(套), 交易金额(元), 适用费率

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with 5 columns: 项目, 持有份额总额, 持有份额占基金总份额比例, 发起份额总额, 发起份额占基金总份额比例, 发起份额锁定期限

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, 序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间, 期初份额, 申购份额, 赎回份额, 持有份额, 份额占比

影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件
2、中国证监会核准浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金合同
3、浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金招募说明书
4、浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金托管协议
5、基金管理人基金募集推广、宣传推介、公开申购
6、基金托管人业务资格批复和营业执照
7、本报告期内在中国证监会指定网站披露的各项公告
8、中国证监会要求的其他文件

存放地点

上海市浦东新区中环路381号中环路388号基金管理人办公场所

查询方式

投资者可登录基金管理人网站(www.pyfunds.com)查询，或在交易时间内至基金管理人办公场所免费查询。
投资者若对本报告有任何疑问，可咨询基金管理人。
客户服务中心电话：400-888-999 或 021-33079999