

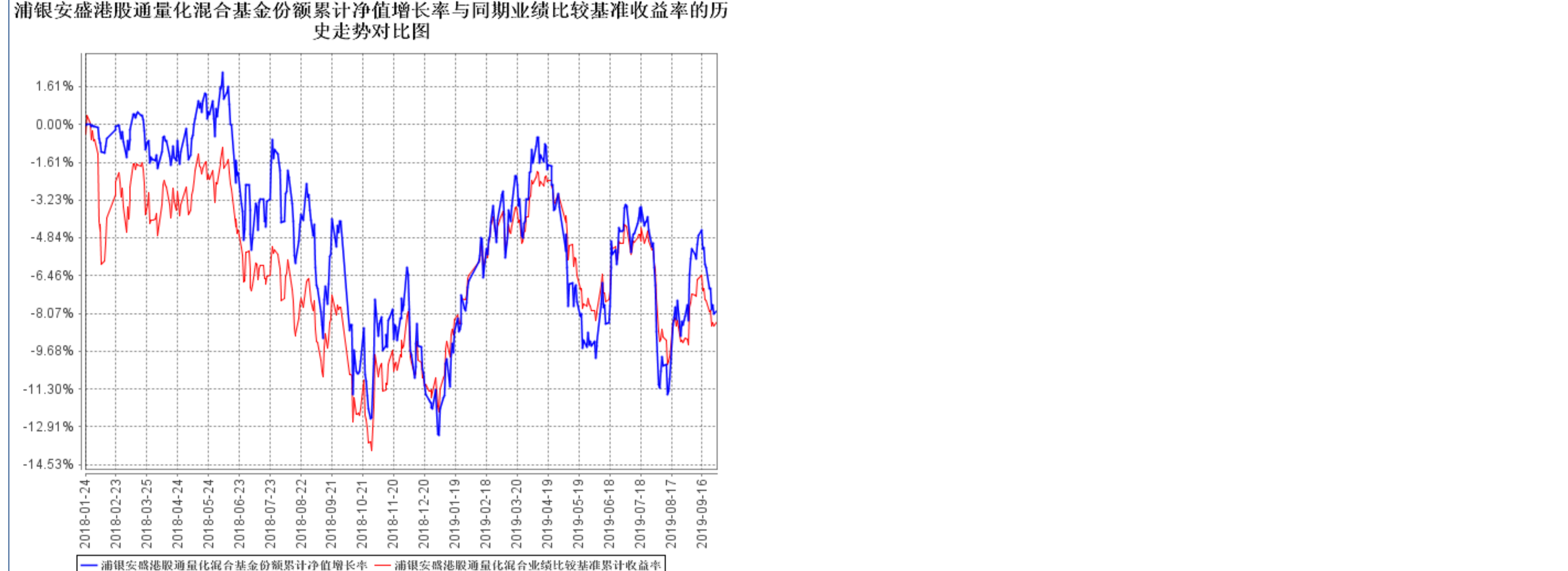
重要提示
基金管理人及基金托管人承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金基本情况
基金名称：浦银安盛港股通量化混合
场内简称：
基金代码：005255
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：180,611,518.91

主要财务指标
本期已实现收益：-4,683,322.45
本期利润：-6,734,065.05
加权平均基金份额本期利润：-0.0341
期末基金资产净值：166,277,992.93
期末基金份额净值：0.9206

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更低于所列数字。
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
阶段：过去三个月
净值增长率①：-3.54%
净值增长率标准差②：0.80%
业绩比较基准收益率③：-3.52%
业绩比较基准收益率标准差④：0.53%



其他指标
其他指标：
报告期末（2019-07-31至2019-09-30）
报告期末（2019-09-30）

基金经理（或基金经理小组）简介
姓名：洪啸
职务：基金经理
任职日期：2018-01-24
离任日期：-
证券从业年限：20
说明：Itooka Ken女士，日本广岛大学经济学硕士，CFA，1999年至2000年在日本团体生命保险有限公司从事股票投资管理。

注：1、本基金基金经理的任职日期为公司作出的聘任日期。
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，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
公平交易专项说明
本基金经理人根据《公平交易管理规定》，建立健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待所管的每一个基金组合。
在具体执行中，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平的研究提供支持。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，详细规定了面对多个投资组合的投资指令的分配流程和分配规则，以保证研究执行交易过程的公平性。从事后监控角度上，一方面定期对投资组合情况进行分析，对时间窗口（同日、3日、5日、10日、15日）发生的不同组合对同一股票的同一交易及反向交易进行价差分析，并进行统计跟踪分析，以确定交易指令对相关基金份额是否的分配，同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异的分析；另一方面是公司公平交易制度的遵守和相关事务的执行情况进行定期报告，并及时发现问题进行及时的报告。

报告期内基金的投资策略和运作分析
2019年第三季度港股震荡下行，恒生综合指数下跌7.0%，几乎持平了上半年的全部涨幅。在全球经济放缓的背景下，美联储时隔十年后重启加息模式，在7月和9月分别降息25个基点，外围市场提供了较大的流动性利好条件，但是已经持续数日的冲突事件增加了投资者对香港社会稳定性的担忧，导致了外资流入信心，拖累了指数的表现。国内政策利好持续发布，包括资管新规下达标部分2020年地方政府债务限额，央行释放全面降准、不过人民币贬值、中美贸易摩擦的再次反复和美国财政问题给市场带来了较大的不确定性。
港股在基本面上呈现进一步的韧性，港股中报显示主要数据营收、净利润增速虽然有所下行，但是幅度明显放缓，内资股和非内资股的业绩表现分化，中国近期政策力度加大内资股业绩较好，而受香港地区经济增速下行和社会事件等影响，香港本地股的表现欠佳。
当前港股所处的市场环境特殊的估值压制在历史高位以下，港股估值优势凸显，具有中长期配置价值。在国内稳增长和加杠杆的背景下，投资者正重新等待实体经济和企业盈利增速的企稳回升。上半年港股表现弱势，港股盈利前景稳定性存疑，有望在下半年继续保持。展望后市，全球经济增长、中美贸易摩擦和地缘事件存在诸多不确定性，投资者应密切关注并动态调整仓位，但历史经验表明，往往在估值性价比相对高企且未来有潜在增长和盈利，我们会继续配置重心放在业绩稳定且高成长性的标的上，为长期的复利回报做好准备。

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0.9206元，本报告期基金份额净值增长率为-3.54%，业绩比较基准收益率为-3.52%。

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。

报告期末基金资产组合情况
序号：1 权益类投资 148,046,644.29 88.67%
2 固定收益投资 148,046,644.29 88.67%
3 资产支持证券 - -
4 金融衍生品投资 - -
5 买入返售金融资产 - -
6 银行存款和结算备付金合计 18,980,000.45 11.13%
7 其他资产 330,376.31 0.20%
8 合计 166,957,021.05 100.00%

注：其中股指期货投资（148,046,644.29元）占股指期货持仓88.67%。

报告期末按行业分类的境内股票投资组合
序号：A 农、林、牧、渔业 -
B 采矿业 -
C 制造业 7,380,148.00 4.44%
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 -
E 建筑业 -
F 批发和零售业 709,380.00 0.43%
G 交通运输、仓储和邮政业 -
H 住宿和餐饮业 -
I 信息传输、软件和信息技术服务业 692,736.00 0.41%
J 金融业 1,331,008.00 0.80%
K 房地产业 -
L 租赁和商务服务业 -
M 科学研究和技术服务业 700,410.00 0.42%
N 水利、环境和公共设施管理业 -
O 居民服务、修理和其他服务业 -
P 教育 -
Q 卫生和社会工作 738,385.00 0.44%
R 文化、体育和娱乐业 -
S 综合 -
合计 11,642,665.00 6.94%

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
行业类别：A 基础材料 5,110,002.95 3.07%
B 消费品 10,201,625.39 6.24%
C 消费者用品 7,232,818.12 4.43%
D 能源 3,009,883.05 1.81%
E 金融 41,242,651.03 24.80%
F 医疗健康 9,526,132.13 5.73%
G 工业 15,137,290.06 9.10%
H 信息技术 17,006,478.50 10.23%
I 电信服务 9,234,940.75 5.55%
J 公用事业 1,946,194.82 1.17%
K 房地产 16,575,200.16 9.87%
合计 136,303,979.28 82.09%

注：注：以上行业采用全球行业分类标准（GICS）。

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
序号：1 00700 腾讯控股 28,200 11,377,029.02 6.94%
2 01299 友邦保险 121,200 8,995,413.17 4.87%
3 00039 建设银行 1,478,000 7,972,381.26 4.79%
4 00218 中国平安 90,000 7,472,292.05 4.69%
5 00041 中国移动 76,000 4,415,646.49 2.67%
6 03988 中国银行 1,077,000 4,381,206.89 2.63%
7 00883 中国海洋石油 270,000 3,009,883.05 1.81%
8 00728 中国电信 886,000 2,853,075.07 1.72%
9 01288 工商银行 1,065,000 2,783,016.53 1.67%
10 01398 工商银行 585,000 2,675,387.16 1.63%

报告期末按债券品种分类的债券投资组合
序号：1 国家债券 -
2 央行票据 -
3 金融债券 -
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：本基金本报告期末未持有债券。

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：1 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（%）

注：本基金本报告期末未持有债券。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
序号：1 基金代码 - 基金名称 - 数量（份） - 公允价值（元） - 占基金资产净值比例（%）

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
序号：1 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（%）

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
序号：1 权证代码 - 权证名称 - 数量（张） - 公允价值（元） - 占基金资产净值比例（%）

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
报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
代码： - 名称： - 持仓量（买/卖） - 合约市值（元） - 公允价值变动（元） - 风险说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

本基金投资股指期货的投资策略
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
本期国债期货投资情况
代码： - 名称： - 持仓量（买/卖） - 合约市值（元） - 公允价值变动（元） - 风险说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

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库的范围。

其他资产构成
序号：1 应收证券款 4,071.05
2 应收证券清算款 -
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 3,348.00
7 待摊费用 -
8 其他 -
9 合计 320,376.31

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可转债。

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
单位：份
报告期初基金份额总额 214,323,171.82
报告期间基金总申购份额 256,471.84
减：报告期间基金总赎回份额 33,960,124.23
报告期间基金拆分净份额（含份额减少以“-”填列） -
报告期末基金份额总额 180,611,518.91

基金管理人运用固有资金投资本基金情况
基金管理人持有本基金份额变动情况
单位：份
报告期初管理人持有本基金份额 -
报告期间买入/申购总份额 -
报告期间卖出/赎回总份额 -
报告期末管理人持有本基金份额 -
报告期末持有本基金份额占本基金总份额比例(%) -

注：本基金本报告期末管理人未运用固有资金投资本基金。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
序号：1 交易方式 - 交易日期 - 交易份额（份） - 交易金额（元） - 适用费率

注：本报告期末基金管理人未运用固有资金投资本基金。

报告期末发起式基金发起资金持有基金份额情况
项目：基金管理人固有资金 - 持有份额总数 - 持有份额占基金总份额比例 - 发起份额占基金总份额比例 - 发起份额承诺持有期限

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
投资者类别：机构 - 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 - 中购份额 - 赎回份额 - 持有份额 - 份额占比

注：本基金报告期内无一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

影响投资者决策的其他重要信息
备查文件目录
1、中国证监会核准基金募集的文件
2、浦银安盛港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同
3、浦银安盛港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
4、基金管理人业务资格批文、营业执照、公司章程
5、基金托管人业务资格批文和营业执照
6、本报告期内在中国证监会指定报刊上披露的各项公告
7、中国证监会要求的其他文件

存放地点
上海市浦东中路381号中银国际大厦88楼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-asset.com）查阅，或在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅。
投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人。
客户服务电话：400-8828-999 或 021-33079999