

浦银安盛量化多策略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：中国民生银行股份有限公司
报告送出日期：2019-10-25

重要提示

基金管理人承诺不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。
基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2019年10月25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。
基金的投资业绩并不代表其未来表现，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。
本报告中所称报告期末指2019年9月30日。
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). 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, 下属基金的基金简称, 下属基金的风险收益特征.

主要财务指标

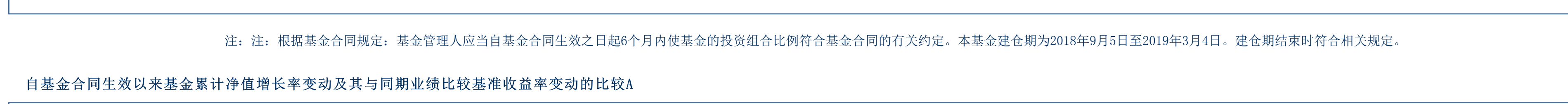
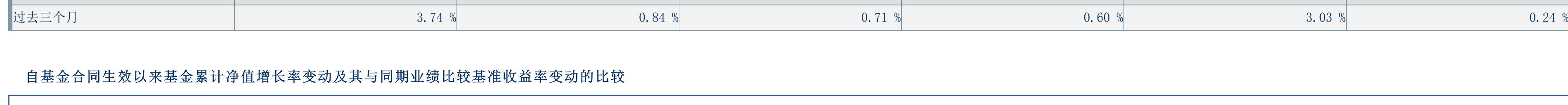
Table with 4 columns: 主要财务指标, 本基金(元), 浦银安盛量化多策略混合A(元), 浦银安盛量化多策略混合C(元). Rows include 本期已实现收益, 本期利润, 加权平均基金份额本期利润, 期末基金份额净值, 期末基金份额净值.

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，计入费用后收益水平要低于所列数字。
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）扣除相关费用后的净额。
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 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, 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, 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.

注：1、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9月11日至2018年9月31日。建仓期结束符合相关规定。
2、本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



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 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理期间, 说明. Rows include 李俊, 基金经理, 2018-09-05 to present, 18 years experience.

注：1、本基金基金经理的任职日期为基金合同约定的聘任日期。
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。

管理人报告报告期内本基金运作遵守信誉情况的说明

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

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，保证公平对待所管理的每一个投资组合。在具体的投资中，在投资决策环节，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流程和授权控制，保证公募基金及专业专户的独立投资决策机制。在交易执行环节，详细制定了面对多个投资组合的投资指令的分配执行的流程规定，以保证投资指令交易过程的公平性，从事后监控角度上，一方面定期对投资组合交易执行情况进行分析，对不同时间窗口（例如：3日、5日、10日）发生的不同组合间交叉及反向交易进行分析，并进行计算异常情况的识别，以确定交易指令对非相关科目的影响度，同时跟踪下投资组合及其各投资类属的收益差异分析，另一方面是公司公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行检查，并对发现的问题进行及时的报告。

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、中国证监会规定和证券交易所颁布的规范性文件等规定的异常交易行为。报告期内未发现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量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

2019年三季度，在中美贸易冲突不断加剧，市场对美联储加息预期的担忧，以及国内经济增长乏力压力加大等多重因素影响下，股市呈现较大幅度的波动。同时，监管部门自多项应对措施，完善股票市场的利率（LPR）形成机制，全面降准，支持实体经济发展的积极信号，以及科创板开市后中国资本市场，首批科创板公司实现成功上市，上市公司中报业绩预告显示，2019年上半年全部A股上市公司净利润同比增长19%，科技和军工板块表现较好，周期类行业表现较差。
本报告期内，本基金根据中期报告结论，更新了股票的配置分析结果，并根据行业相应调整。本基金精选优质的成长型和价值股，组合保持对较高的股票投资比例，行业配置偏向消费、医疗和科技等行业，组合表现优于同期业绩基准。

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A基金份额净值为1.1785元，本报告期基金份额净值增长率为14.08%；截至本报告期末浦银安盛量化多策略混合C基金份额净值为1.1262元，本报告期基金份额净值增长率为13.74%，同期业绩比较基准收益率为17%。

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、本报告期内超过连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元，未超过六十个工作日。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 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(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 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(%)

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交易情况说明

Table with 4 columns: 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

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

Table with 4 columns: 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

本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

投资组合报告附注

报告期内本基金投资的前十名证券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范围。

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1. 卖出证券, 2. 应收证券利息, 3. 应收股利, 4. 应收利息, 5. 应收申购款, 6. 其他应收款, 7. 待摊费用, 8. 预缴, 9. 应付利息.

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债券。

Table with 5 columns: 序号, 代码, 股票名称, 流通受限部分的公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

开放式基金份额变动

Table with 4 columns: 项目, 浦银安盛量化多策略混合, 浦银安盛量化多策略混合A, 浦银安盛量化多策略混合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, 浦银安盛量化多策略混合, 浦银安盛量化多策略混合A, 浦银安盛量化多策略混合C

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 6 columns: 序号, 交易方式, 交易日期, 交易数量(份), 交易金额(元), 适用费率

报告期末发起式基金资金持有基金份额情况

Table with 5 columns: 项目, 持有基金份额, 持有基金份额占基金总资产比例, 发起份额总额, 发起份额占基金总资产比例, 发起份额锁定期满期限

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 6 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, 中期份额, 期末份额, 持有份额, 占基金总资产比例

基金管理人提示投资者注意：当持有份额较多的投资者进行大额赎回操作时，基金管理人需通过对基金持有证券的变现变现以及风控措施，防范操作可能产生基金净值波动、流动性风险、资产变现成本的风险，并造成基金净值波动，同时，该等大额赎回将产生(1) 基金资产流动性风险；(2) 基金资产流动性风险；(3) 因基金资产流动性风险导致中低收入者无法及时赎回的风险；以及(4) 因基金资产净值低于5000万元触发基金投资目标实现困难或基金终止风险。

影响投资者决策的其他重要信息

备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集注册文件
2、浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同
3、浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
4、浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议
5、基金管理人信息披露制度、内部控制制度、公司治理制度
6、基金管理人业务规则和投资决策制度
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

上海市浦东新区世纪大道160号陆家嘴基金大厦26楼

查阅方式

投资者可依法基金管理人网站(www.pyfunds.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。
客户服务中心电话：400-8828-999 或 021-33079999。