

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
报告送出日期：2019-10-25

重要提示

基金管理人承诺基金管理人保证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

Table with columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Includes fund name, code, type, and investment objectives.

主要财务指标

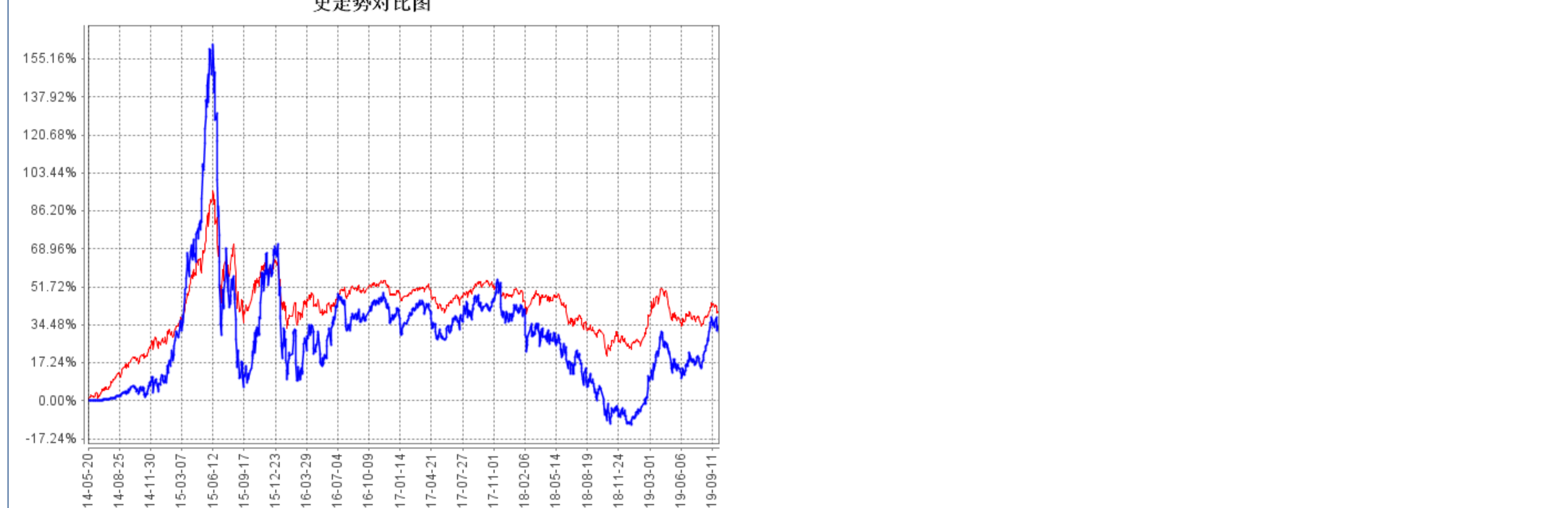
Table with columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators), 报告期 (2019-07-01 to 2019-09-30), 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan).

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 comparing fund performance metrics (Net Growth Rate, Standard Deviation, etc.) over the last three months.

自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



其他指标

Table listing other indicators and reporting periods.

基金经理（或基金经理小组）简介

Table with columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任职日期 (Start Date), 离任日期 (End Date), 证券从业年限 (Years of Experience), 说明 (Remarks).

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。

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基金组合。
在具体分析中，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提供研究支持。

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法违规、法规、中国证监会和证券交易所发布的相关规范性文件中的异常交易行为。

报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，贸易战的升级一度致数股大幅下挫，但随后指数修复反弹，显示了市场对贸易战的影响已经逐渐消化。上证指数下跌2.47%，创业板指上涨2.68%，沪深300下跌0.29%。

报告期内基金的投资表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.309元，本报告期基金份额净值增长率为0.93%，业绩比较基准收益率为0.69%。

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。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table showing asset composition by category: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage).

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table showing stock portfolio by industry: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

Table showing Hong Kong stock portfolio by industry: 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

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 listing top 10 stocks by fair value: 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), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing bond portfolio by type: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

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 listing top 5 bonds by fair value: 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), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

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 listing top 10 asset-backed securities by fair value: 序号 (Serial Number), 贵金属代码 (Precious Metal Code), 贵金属名称 (Precious Metal Name), 数量 (份) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

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 listing top 5 precious metals by fair value: 序号 (Serial Number), 贵金属代码 (Precious Metal Code), 贵金属名称 (Precious Metal Name), 数量 (份) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

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 listing top 5 warrants by fair value: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Quantity), 合约市值 (元) (Contract Value), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table showing derivatives positions and gains/losses: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Quantity), 合约市值 (元) (Contract Value), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table showing derivatives positions and gains/losses: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Quantity), 合约市值 (元) (Contract Value), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change), 风险说明 (Risk Statement).

基金投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况
本报告期内本基金投资的18名证券的主体没有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。

Table listing other assets: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount).

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
报告期末前十名股票是否存在流通受限情况的说明

Table showing fund performance metrics: 项目 (Item), 数量 (Quantity).

Table showing fund manager's use of assets: 项目 (Item), 基金金额 (Fund Amount).

Table showing fund manager's use of assets: 项目 (Item), 基金金额 (Fund Amount).

Table showing fund manager's use of assets: 项目 (Item), 基金金额 (Fund Amount).

Table showing fund manager's use of assets: 项目 (Item), 基金金额 (Fund Amount).

Table showing fund manager's use of assets: 项目 (Item), 基金金额 (Fund Amount).

Table showing fund manager's use of assets: 项目 (Item), 基金金额 (Fund Amount).

Table showing fund manager's use of assets: 项目 (Item), 基金金额 (Fund Amount).

Table showing fund manager's use of assets: 项目 (Item), 基金金额 (Fund Amount).

Table showing fund manager's use of assets: 项目 (Item), 基金金额 (Fund Amount).

Table showing fund manager's use of assets: 项目 (Item), 基金金额 (Fund Amount).

Table showing fund manager's use of assets: 项目 (Item), 基金金额 (Fund Amount).

Table showing fund manager's use of assets: 项目 (Item), 基金金额 (Fund Amount).