浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年 9 月 30 日

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期:2018 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 10 月 24 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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛基本面 400 指数
基金主代码	519117
交易代码	519117
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年 5 月 14 日
报告期末基金份额总额	40, 866, 720.14 份
投资目标	本基金采取指数化投资策略,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,追求对标的指数的有效跟踪。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日平均跟踪误差的绝对值不超过 0.35%,且年化跟踪误差不超过 4%,以实现对业绩比较基准的有效跟踪。
投资策略	本基金采取完全复制方法进行指数化投资,依据中证锐联基本面 400 指数成份股及其权重配比,合理设置个股投资权重,构建股票组合,使股票组合能有效跟踪中证锐联基本面 400 指数的表现,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日平均跟踪误差的绝对值不超过 0.35%,且年化跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	中证锐联基本面 400 指数收益率× 95%+银行活期存款利率(税后)× 5%。
风险收益特征	本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018 年 7 月 1 日 - 2018 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	- 491, 715.73
2.本期利润	- 2, 297, 395.30
3.加权平均基金份额本期利润	- 0.0680
4.期末基金资产净值	53, 354, 215.85
5.期末基金份额净值	1.306

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。

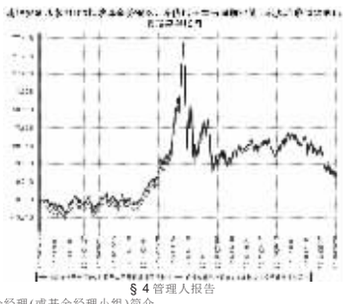
3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

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
过去三个月	- 5.09%	1.19%	- 6.27%	1.21%	1.18%	- 0.02%

3.2.2 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



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈士俊	本公司金融工程部总监,公司职工监事,公司旗下浦银安盛沪深 300 指数基金、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数基金基金经理、浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数基金(LOF)、浦银安盛量化多策略灵活配置混合基金基金经理	2012年 5 月 14 日	-	17	陈士俊先生,清华大学管理学博士。2001 年至 2003 年间曾在国泰君安证券有限公司研究所担任金融工程研究员 2 年;2003 年至 2007 年 10 月在银河基金管理有限公司工作 4 年,先后担任金融工程部研究员、研究部主管,2007 年 10 月加入浦银安盛基金管理有限公司,任本公司金融工程部总监,并于 2010 年 12 月起兼任浦银安盛沪深 300 指数基金基金经理。2012 年 3 月兼任本公司职工监事。2012 年 5 月起,兼任浦银安盛中证锐联基本面 400 指数基金基金经理。2017 年 4 月起,兼任浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数基金(LOF)基金经理。2018 年 9 月起,兼任浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 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。本报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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,保证公平对待旗下的每一个基金组合。

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,详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规定,以保证投资执行交易过程的公平性;从事后监控角度上,一方面是定期对股票交易情况进行分析,对不同时间窗口(同日,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,并进行统计显著性的检验,以确定交易价差对相关基金的业绩差异的贡献度;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;另一方面是公司对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查,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,未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 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认定的异常交易行为。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量超过该证券当日成交量的 5%的情形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年第 3 季度,PMI 指标持续走低,中国经济增长承受压力。中美贸易冲突不断升级,人民币贬值加剧,政府适时出台多项稳定国内经济的政策,以缓解国际贸易环境恶化对经济的冲击,并再次启动"逆周期因子"稳定人民币汇率预期。A 股上市公司中报显示,整体净利润同比增长 14.5%,较去年和今年一季度的增速有所放缓。A 股市场呈现震荡调整,中证锐联基本面 400 指数下跌 6.62%,大盘蓝筹股表现较好,中小盘股票跌幅较大。

本报告期内,本基金采取完全复制方法密切跟踪标的指数的表现,组合表现基本与同期业绩比较基准保持基本一致。

4.5 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 1.306 元;本报告期基金份额净值增长率为 -5.09%,业绩比较基准收益率为 -6.27%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

1、本报告期内本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、本报告期内超过连续二十个工作日基金资产净值低于五千万,未超过连续六十个工作日。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	50, 502, 603.53	90.60
	其中:股票	50, 502, 603.53	90.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5, 176, 779.35	9.29
8	其他资产	62, 858.87	0.11
9	合计	55, 742, 241.75	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	390, 400.22	0.73
B	采矿业	2, 649, 213.70	4.97
C	制造业	28, 547, 847.77	53.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1, 474, 433.44	2.76
E	建筑业	1, 763, 866.55	3.31
F	批发和零售业	3, 933, 418.11	7.37
G	交通运输、仓储和邮政业	2, 425, 696.86	4.55
H	住宿和餐饮业	42, 952.80	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1, 447, 467.35	2.71
J	金融业	2, 895, 089.07	5.43
K	房地产业	3, 551, 840.25	6.66
L	租赁和商务服务业	516, 794.52	0.97
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	247, 477.50	0.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	545, 675.39	1.02
S	综合	70, 430.00	0.13
	合计	50, 502, 603.53	94.66

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资按行业分类的境内股票投资组合。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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	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(%)
1	000425	徐工机械	91, 600	361, 820.00	0.68
2	601555	东吴证券	53, 383	341, 117.37	0.64
3	600535	天士力	14, 367	328, 716.96	0.62
4	600522	中天科技	37, 868	325, 286.12	0.61
5	601168	西部矿业	50, 800	322, 580.00	0.60
6	000059	华锦股份	44, 700	320, 946.00	0.60
7	601997	贵阳银行	25, 400	310, 642.00	0.58
8	000878	云南铜业	32, 800	307, 664.00	0.58
9	600266	北京城建	34, 900	288, 274.00	0.54
10	600325	华发股份	40, 540	285, 401.60	0.53

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体除东吴证券和云南铜业以外不在被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。2018 年 6 月 11 日中国证监会深圳证监局下发的[2018]42 号《关于对东吴证券股份有限公司深圳分公司采取责令增加内部合规检查次数并提交合规检查报告的决定》,公司违反了《证券公司监督管理条例》第六十三条的有关规定;2017 年 11 月 13 日,中国证监会浙江证监局下发了[2017]71 号《关于对东吴证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定》;2018 年 6 月 19 日,中国证监会上海证监局向公司子公司东吴基金下发了沪证监决字[2018]58 号行政监管措施决定书。2017 年 12 月 20 日,云南铜业收到中国证券监督管理委员会云南监管局出具的《云南证监局关于云南铜业的监管关注函》,对公司提出公司治理、内部管理、内部信息及信息披露管理和财务核算方面的监管要求。2018 年 6 月 11 日,云南铜业子公司易门铜业收到玉溪市环境保护局的《行政处罚决定书》。2018 年 9 月 27 日,云南铜业子公司云南楚雄矿冶有限公司于收到牟定县环境保护局出具的《牟定县环境保护局行政处罚决定书》。本基金管理人的研究部门对东吴证券和云南铜业保持了及时的研究跟踪,投资决策符合本基金管理人的投资流程。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6, 175.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	882.16
5	应收申购款	6, 801.61
6	其他应收款	49, 000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62, 858.87

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	31, 137, 294.96
报告期期间基金总申购份额	10, 388, 379.88
减:报告期期间基金总赎回份额	658, 954.70
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	40, 866, 720.14

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

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。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准基金募集的文件

2、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数型证券投资基金基金合同

3、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数型证券投资基金招募说明书

4、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数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的各项公告

8、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼基金管理人办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.py-axa.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。

客户服务中心电话:400-8828-999 或 021-33079999 。

浦银安盛基金管理有限公司

2018 年 10 月 26 日

浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

2018年 9 月 30 日

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人:招商证券股份有限公司

报告送出日期:2018 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 10 月 24 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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛沪港深基本面 LOF
场内简称	沪港深 F
基金主代码	166402
交易代码	166402
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2017年 4 月 27 日
报告期末基金份额总额	47, 385, 064.20 份
投资目标	本基金采用被动式投资策略,紧密跟踪中证锐联沪港深基本面 100 指数。在正常市场情况下,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.40%以内,年跟踪误差控制在 5%以内。
投资策略	本基金以紧密跟踪标的指数、获取指数长期增长的稳定收益为宗旨,在降低跟踪误差和控制流动性风险的条件下,构建指数化的投资组合。
业绩比较基准	中证锐联沪港深基本面 100 指数收益率× 95%+银行人民币活期存款利率(税后)× 5%
风险收益特征	本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。本基金将投资港股通标的股票,需承担汇率风险以及境外市场的风险。
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018 年 7 月 1 日 - 2018 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	506, 383.13
2.本期利润	2, 187, 073.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.0480
4.期末基金资产净值	51, 373, 307.23
5.期末基金份额净值	1.0842

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。

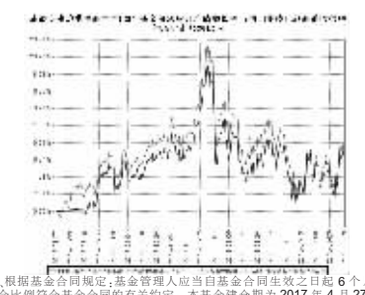
3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

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
过去三个月	4.45%	0.93%	4.06%	0.93%	0.39%	0.00%

3.2.2 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:1、根据基金合同规定: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约定。本基金建仓期为 2017 年 4 月 27 日至 2017 年 10 月 26 日。建仓期结束后符合相关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈士俊	本公司金融工程部总监,公司职工监事,公司旗下浦银安盛沪深 300 指数基金、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数基金基金经理、浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数基金(LOF)、浦银安盛量化多策略灵活配置混合基金基金经理	2017年 4 月 27 日	-	17	陈士俊先生,清华大学管理学博士。2001 年至 2003 年间曾在国泰君安证券有限公司研究所担任金融工程研究员 2 年;2003 年至 2007 年 10 月在银河基金管理有限公司工作 4 年,先后担任金融工程部研究员、研究部主管,2007 年 10 月加入浦银安盛基金管理有限公司,任本公司金融工程部总监,并于 2010 年 12 月起兼任浦银安盛沪深 300 指数基金基金经理。2012 年 3 月兼任本公司职工监事。2012 年 5 月起,兼任浦银安盛中证锐联基本面 400 指数基金基金经理。2017 年 4 月起,兼任浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数基金(LOF)基金经理。2018 年 9 月起,兼任浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 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。本报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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,保证公平对待旗下的每一个基金组合。

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,详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规定,以保证投资执行交易过程的公平性;从事后监控角度上,一方面是定期对股票交易情况进行分析,对不同时间窗口(同日,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,并进行统计显著性的检验,以确定交易价差对相关基金的业绩差异的贡献度;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;另一方面是公司对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查,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,未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 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认定的异常交易行为。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量超过该证券当日成交量的 5%的情形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年第 3 季度,PMI 指标持续走低,中国经济增长承受压力。中美贸易冲突不断升级,人民币贬值加剧,政府适时出台多项稳定国内经济的政策,以缓解国际贸易环境恶化对经济的冲击,并再次启动"逆周期因子"稳定人民币汇率预期。A 股上市公司中报显示,整体净利润同比增长 14.5%,较去年和今年一季度的增速有所放缓。A 股市场呈现震荡调整,大盘蓝筹股表现较好,中小盘股票跌幅较大。港股市场在三季度受中美贸易冲突、美联储加息和美元走强等因素影响而下跌,疫苗造假和海外科技股回调拖累港股医药和科技股票表现。港股中报显示,港股通股票整体净利润同比增长 9%,符合市场预期。第 2 季度,中证锐联沪港深 F100 指数上涨 4.26%。

本报告期内,本基金采取完全复制方法密切跟踪标的指数的表现,组合表现基本与同期业绩比较基准保持基本一致。

4.5 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 1.0842 元;本报告期基金份额净值增长率为 4.45%,业绩比较基准收益率为 4.06%。

4.6 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、本报告期内出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形,未超过连续六十个工作日。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	48, 268, 146.19	90.98
	其中:股票	48, 268, 146.19	90.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4, 631, 361.62	8.73
8	其他资产	151, 501.63	0.29
9	合计	53, 051, 009.44	100.00

注:其中港股通股票投资(29128782.49 元)占总资产比例 54.91%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1, 234, 985.00	2.40
C	制造业	3, 175, 030.00	6.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	847, 231.00	1.65
E	建筑业	2, 485, 723.60	4.84
F	批发和零售业	110, 536.00	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	312, 873.00	0.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	371, 519.00	0.72
J	金融业	9, 675, 573.10	18.83
K	房地产业	925, 893.00	1.80
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	19, 139, 363.70	37.26

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期内无积极投资股票。

5.2.3 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	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	162, 209.98	0.32
C 消费者常用品	345, 441.98	0.67
D 能源	3, 521, 964.68	6.86
E 金融	15, 450, 390.89	30.07
F 医疗保健	-	-
G 工业	1, 706, 768.63	3.32
H 信息技术	906, 278.11	1.76
I 电信服务	2, 516, 155.43	4.90
J 公用事业	1, 270, 194.62	2.47
K 房地产	3, 249, 378.17	6.33
合计	29, 128, 782.49	56.70

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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	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(%)
1	H00005	汇丰控股	63, 600	3, 872, 765.54	7.54
2	H00939	建设银行	563, 000	3, 388, 617.05	6.60
3	H00941	中国移动	33, 000	2, 240, 308.70	4.36
4	H01398	工商银行	424, 000	2, 134, 125.14	4.15
5	H03988	中国银行	516, 000	1, 580, 108.62	3.08
6	601318	中国平安	22, 685	1, 553, 922.50	3.02
7	H00386	中国石油化工股份	200, 000	1, 379, 761.60	2.69
8	601668	中国建筑	201, 540	1, 106, 454.60	2.15
9	H01299	友邦保险	17, 800	1, 094, 851.39	2.13
10	601166	兴业银行	66, 600	1, 062, 270.00	2.07

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注:本基金本报告期内无积极投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	11, 542.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	138, 414.40
4	应收利息	1, 545.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	151, 501.63

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的股票。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	41, 447, 037.65
报告期期间基金总申购份额	14, 235, 475.86
减:报告期期间基金总赎回份额	8, 297, 449.31
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	47, 385, 064.20

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

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。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准基金募集的文件

2、浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数型证券投资基金(LOF)基金合同

3、浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数型证券投资基金(LOF)招募说明书

4、浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数型证券投资基金(LOF)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的各项公告

8、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼基金管理人办公场所

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.py-axa.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。

客户服务中心电话:400-8828-999 或 021-33079999 。

浦银安盛基金管理有限公司

2018 年 10 月 26 日

浦银安盛价值成长混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年 9 月 30 日

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:2018 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 10 月 24 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