浦银安盛货币市场证券投资基金

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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信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	浦银安盛货币		
基金主代码	519509		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011年3月9日		
报告期末基金份额总额	39,436,047,461.92份		
投资目标	力求在保持基金资产安全性和良好流动性的基础上,获得超越银行活期存款收益的稳定收益。		
投资策略	根据对短期利率变动的预测,采用投资组合平均剩余期限控下的主动性投资策略,利用基本分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保证流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。		
业绩比较基准	银行活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,实现期收益和风险均低于债券型基金,高于储蓄及银行理财基金。		
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司		
基金托管人	中信银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B	浦银安盛货币E
下属分级基金的交易代码	519509	519510	519516
报告期末下属分级基金的份额总额	295,584,881.19份	39,134,402,035.78份	6,060,544.95份

§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)		
	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B	浦银安盛货币E
1.本期已实现收益	2,554,309.61	391,106,289.52	62,334.40
2.本期利润	2,554,309.61	391,106,289.52	62,334.40
3.期末基金资产净值	295,584,881.19	39,134,402,035.78	6,060,544.95

注:1.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。

2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.本基金收益分配按日结转份额,浦银安盛货币市场证券投资基金于2014年9月12日刊登公告,自2014年9月15日起为指定的特定销售渠道增加浦银安盛货币市场证券投资基金E类份额,该类份额仅能通过特定的销售渠道办理申购、赎回等业务。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浦银安盛货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7878%	0.0010%	0.0883%	0.0000%	0.6995%	0.0010%

浦银安盛货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8489%	0.0010%	0.0883%	0.0000%	0.7606%	0.0010%

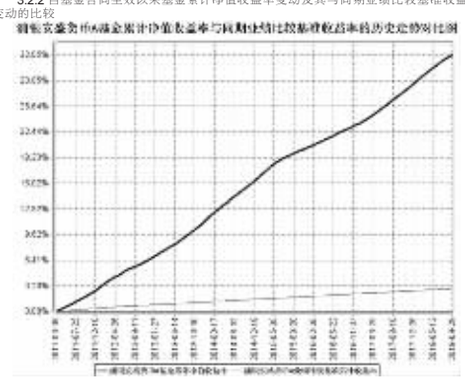
浦银安盛货币E

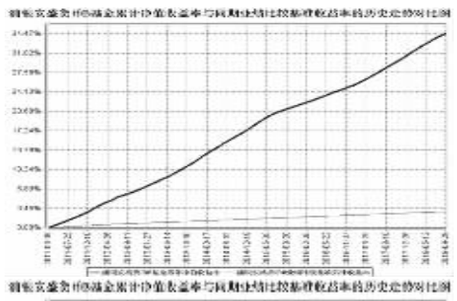
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7876%	0.0010%	0.0883%	0.0000%	0.6993%	0.0010%

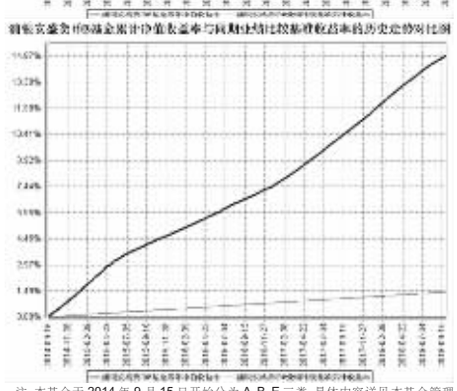
注:1.自2017年6月8日起,本基金收益分配由原"月结转份额"变更为"日结转份额"。具体内容详见基金管理人于2017年5月2日发布的《关于浦银安盛货币市场证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告》及其后续公告。

2.本基金于2014年9月15日开始分为A,B,E三类。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较







注:本基金于2014年9月15日开始分为A,B,E三类,具体内容详见本基金管理人于2014年9月12日刊登的《关于浦银安盛货币市场证券投资基金增加基金份额类别的公告》。

§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		
钟明	公司旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛平稳回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛稳健纯债债券型证券投资基金、浦银安盛增利债券型证券投资基金、浦银安盛月月乐定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金基金经理。	2017年11月1日	-	13	钟明女士,复旦大学MBA,2005年至2017年就职于兴业基金管理有限公司,先后从事基金会计投资、债券交易员岗位,基金经理等岗位职务近12年岗位。2017年5月加盟浦银安盛基金管理有限公司,担任固定收益投资部副总监之职。2017年11月1日起,担任公司旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛平稳回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛稳健纯债债券型证券投资基金、浦银安盛增利债券型证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金基金经理。

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

三季度国内经济基本面稳中承压,紧信用环境使得社融增速有所回落,叠加外部贸易摩擦,使得宏观经济的不确定性进一步加大。监管协同采取定向降准等多项措施维稳经济,着力疏导中小企业融资难问题。国际来看,美国就业数据和经济数据持续向好,年内已实现第3次加息至2.25%,并上调2018年GDP增速由2.8%至3.1%,上调2019年GDP预期值至2.5%;欧元区成员国经济增速继续分化,通胀压力整体增大,且希腊和意大利债务隐患增大;新兴经济体阿根廷、土耳其等依赖外贸国家外汇贬值压力增大,国际资本流动性增大。国内来看,受前期去杠杆影响,整体看经济动能虽维持PMI在50以上,但近月来小幅下行,9月制造业PMI已由前期51.5%回落至50.8%,经济下行压力仍存在,支持债市走牛的基本因素未改变。基于上述国内外经济形势,货币政策报告期内宽松力度增大,央行货币政策保持合理充裕,并着重疏通信用传到机制。另一方面三季度大量发行的地方政府债,同时财政政策配合发力,各部委推出多项措施稳定经济,着力疏导中小企业融资难的现状。三季度资金面整体呈现宽松态势,预期央行将通过货币政策组合继续保持市场流动性合理充裕。报告期内,货币基金密切关注公开市场操作变化,跟进资金面和收益率期限结构变化情况,择时增加长久期资产配置;同时临近季底在保证流动性安全前提下补充短久期资产提高收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期浦银安盛货币A的基金份额净值收益率为0.7878%,本报告期浦银安盛货币B的基金份额净值收益率为0.8489%,本报告期浦银安盛货币E的基金份额净值收益率为0.7876%,同期业绩比较基准收益率为0.0883%。

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.本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§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)	占基金资产的比例(%)
1	固定收益投资	12,191,217,997.58	29.80
	其中:债券	11,851,217,997.58	28.97
	资产支持证券	340,000,000.00	0.83
2	买入返售金融资产	16,148,444,852.66	39.47
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	12,397,520,766.36	30.30
4	其他资产	175,527,860.80	0.43
5	合计	40,912,711,477.40	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	191
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额(元) / 占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,463,996,884.00 / 3.71
	其中:买断式回购融资	- / -

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本报告期内本基金未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	58
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	占基金资产净值的比例(%)	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	68.86	371
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	3.19	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	7.35	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	4.16	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	19.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		103.30	371

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	50,085,791.00	0.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,141,134,687.94	5.43
	其中:政策性金融债	2,141,134,687.94	5.43
4	企业债券	49,858,666.66	0.13
5	企业短期融资券	971,432,234.99	2.46
6	中期票据	-	-
7	同业存单	8,638,706,616.99	21.91
8	其他	-	-
9	合计	11,851,217,997.58	30.05
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111866538	18临证银行CD157	8,000,000	781,360,979.43	1.98
2	111894953	18江西银行CD039	5,000,000	499,688,437.17	1.27
3	111865576	18武银行CD096	5,000,000	499,215,746.22	1.27
4	111881684	18临证银行CD319	5,000,000	498,762,388.51	1.26
5	140202	14国开02	4,900,000	493,666,072.87	1.25
6	180201	18国开01	4,700,000	471,570,725.78	1.20
7	111884300	18振证银行CD386	4,000,000	394,132,552.97	1.00
8	011800702	18长安投SCP001	3,000,000	300,001,031.33	0.76
9	111800622	18长建银行CD182	3,000,000	299,789,844.17	0.76
10	111806182	18交通银行CD182	3,000,000	299,391,990.33	0.76

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0846%
报告期内偏离度的最低值	0.0275%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0426%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:本报告期内无负偏离度绝对值达到0.25%的情况

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注:本报告期内无正偏离度绝对值达到0.5%的情况

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十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	149553	宁证04A1	2,400,000	240,000,000.00	0.61
2	150005	宁证06A1	1,000,000	100,000,000.00	0.25

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金所持有的债券(包括票据)采用摊余成本法进行估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。

5.9.2

本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,221,271.05
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	165,371,728.32
4	应收申购款	7,934,861.43
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	175,527,860.80

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	358,516,100.85	41,926,373,824.90	9,701,330.16
报告期期间基金总申购份额	142,466,762.78	13,601,063,218.76	903,089.05
报告期期间基金总赎回份额	205,397,982.44	16,393,035,007.88	4,543,874.26
报告期期末基金份额总额	295,584,881.19	39,134,402,035.78	6,060,544.95

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	运用费率
1	巨利发展	2018年7月2日	37547	37547	0.00%
2	巨利发展	2018年7月3日	12249	12249	0.00%
3	巨利发展	2018年7月4日	11752	11752	0.00%
4	巨利发展	2018年7月5日	11251	11251	0.00%
5	巨利发展	2018年7月6日	114,26	114,26	0.00%
6	巨利发展	2018年7月9日	317102	317102	0.00%
7	巨利发展	2018年7月10日	105,23	105,23	0.00%
8	巨利发展	2018年7月11日	102,35	102,35	0.00%
9	巨利发展	2018年7月12日	101,44	101,44	0.00%
10	巨利发展	2018年7月13日	100,07	100,07	0.00%
11	巨利发展	2018年7月16日	298,40	298,40	0.00%
12	巨利发展	2018年7月17日	98,12	98,12	0.00%
13	巨利发展	2018年7月18日	98,88	98,88	0.00%
14	巨利发展	2018年7月19日	99,26	99,26	0.00%
15	巨利发展	2018年7月20日	100,67	100,67	0.00%
16	巨利发展	2018年7月23日	296,81	296,81	0.00%
17	巨利发展	2018年7月24日	98,12	98,12	0.00%
18	巨利发展	2018年7月25日	98,64	98,64	0.00%
19	巨利发展	2018年7月26日	98,18	98,18	0.00%
20	巨利发展	2018年7月27日	100,57	100,57	0.00%
21	巨利发展	2018年7月30日	298,88	298,88	0.00%
22	巨利发展	2018年7月31日	101,02	101,02	0.00%
23	巨利发展	2018年8月11日	99,78	99,78	0.00%
24	巨利发展	2018年8月12日	98,27	98,27	0.00%
25	巨利发展	2018年8月13日	95,66	95,66	0.00%
26	巨利发展	2018年8月16日	282,32	282,32	0.00%
27	巨利发展	2018年8月17日	93,59	93,59	0.00%
28	巨利发展	2018年8月18日	92,32	92,32	0.00%
29	巨利发展	2018年8月19日	91,27	91,27	0.00%
30	巨利发展	2018年8月10日	90,20	90,20	0.00%
31	巨利发展	2018年8月13日	264,47	264,47	0.00%
32	巨利发展	2018年8月14日	86,69	86,69	0.00%
33	巨利发展	2018年8月15日	82,37	82,37	0.00%
34	巨利发展	2018年8月16日	84,03	84,03	0.00%
35	巨利发展	2018年8月17日	88,38	88,38	0.00%
36	巨利发展	2018年8月20日	256,18	256,18	0.00%
37	巨利发展	2018年8月21日	85,71	85,71	0.00%
38	巨利发展	2018年8月22日	86,60	86,60	0.00%
39	巨利发展	2018年8月23日	79,80	79,80	0.00%
40	巨利发展	2018年8月24日	84,40	84,40	0.00%
41	巨利发展	2018年8月27日	251,77	251,77	0.00%
42	巨利发展	2018年8月28日	83,04	83,04	0.00%
43	巨利发展	2018年8月29日	82,94	82,94	0.00%
44	巨利发展	2018年8月30日	82,17	82,17	0.00%
45	巨利发展	2018年8月31日	81,89	81,89	0.00%
46	巨利发展	2018年9月3日	242,68	242,68	0.00%
47	巨利发展	2018年9月4日	80,54	80,54	0.00%
48	巨利发展	2018年9月5日	76,87	76,87	0.00%
49	巨利发展	2018年9月6日	81,55	81,55	0.00%
50	巨利发展	2018年9月7日	81,26	81,26	0.00%
51	巨利发展	2018年9月10日	236,98	236,98	0.00%
52	巨利发展	2018年9月11日	78,97	78,97	0.00%
53	巨利发展	2018年9月12日	77,91	77,91	0.00%
54	巨利发展	2018年9月13日	78,17	78,17	0.00%
55	巨利发展	2018年9月14日	78,03	78,03	0.00%
56	巨利发展	2018年9月17日	234,24	234,24	0.00%
57	巨利发展	2018年9月18日	77,68	77,68	0.00%
58	巨利发展	2018年9月19日	88,10	88,10	0.00%
59	巨利发展	2018年9月20日	88,78	88,78	0.00%
60	巨利发展	2018年9月21日	82,77	82,77	0.00%
61	巨利发展	2018年9月25日	319,30	319,30	0.00%
62	巨利发展	2018年9月26日	82,72	82,72	0.00%
63	巨利发展	2018年9月27日	84,06	84,06	0.00%
64	巨利发展	2018年9月28日	91,17	91,17	0.00%
合计			8,342,25	8,342,25	0.00%

注:1.截至本报告期末,本基金管理人持有浦银货币A 1,068,925.3份。

2.截至本报告期末,本基金管理人的全资子公司上海浦银安盛资产管理有限公司持有本基金浦银货币A 4,758,820.79份。

3.基金管理人固有资金投资本基金费用按照本基金法律文件约定收取,本基金无申购赎回手续费。

§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

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	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
			期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年7月1日-2018年9月30日	23,184,518,512.84	193,344,294.54	2,039,584,996.14	21,338,277,811.24	54.11%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品持有风险

基金管理人提示投资者注意,当特定的机构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快速变现以支付赎回款,该等操作可能会产生基金合位调整的困难,产生净占成本的风险,并造成基金净值的波动;同时,该等大额赎回将可能产生:1)单位净值延长风险;2)基金净值大幅波动的风险;3)因引发基金净价红利期回购导致中小投资者无法及时赎回的风险;以及4)因基金资产净值低于5000万元从而影响投资目标实现或造成基金终止等风险。

§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、浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同

3、浦银安盛货币市场证券投资基金招募说明书

4、浦银安盛货币市场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

浦银安盛精致生活灵活配置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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	浦银安盛精致生活混合
基金主代码	519113
交易代码	519113
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年6月4日
报告期末基金份额总额	203,043,043.81份
投资目标	在中国经济健康快速的可持续发展过程中,寻找由于经济结构优化、产业结构升级而涌现的那些最能够代表国民生活水平改善的以及满足国民生活需求升级的提供生活产品和服务的上市公司,分享快速民无那股红利长,并充实其他金融工具的投资机会,通过灵活配置资产,在严格控制风险的基础上,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金坚持"自上而下"与"自下而上"相结合的投资策略,通过灵活资产配置,行业发展趋势判断、个股精选选择代表国民生活水平改善的以及满足国民生活需求升级要求的快速及长期稳定增长的上市公司。 具体来说,在资产配置策略方面,本基金将根据宏观经济、政策、估值水平和市场情绪等因素对未来资本市场的发展趋势趋势预测,进而确定大类资产的配置比例,而在行业配置策略方面,本基金是最后关注国民生活的主题基金,因此将以行业覆盖范围和行业精选策略两个方面进行安排。在个股选择策略方面,本基金将采取精选个股的策略,并建立以公司特有的股票核心公司时间为研究模型PEM对其投资的上市公司加以甄别。 在债券投资策略方面,在资本市场国际化的背景下,通过利用债券市场风险收益特征的国际化趋势和国内宏观经济景气周期引发的债券市场收益率的变化趋势,采取自上而下的策略和自底上,在权证投资策略方面,本基金将按照法律法规相关规定进行权证投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*55%+中证全债指数收益率*45%
风险收益特征	本基金为混合型基金,本基金属于中高风险,中高收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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	-61,677,043.97
2.本期利润	-47,527,929.30
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0239
4.期末基金资产净值	296,992,044.13
5.期末基金份额净值	1.463

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	-13.79%	1.69%	-1.70%	0.89%	-12.09%	1.00%

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:自2015年9月17日起,本基金业绩比较基准由原"中信标普A股综合指数×55%+中信标普全债指数×45%"变更为"中信标普A股综合指数×55%+中证全债指数×45%"。具体内容详见基金管理人于2015年9月17日发布的《关于变更旗下基金业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》。

§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		
杨艳辉	本公司旗下浦银安盛新经济灵活配置混合基金、浦银安盛新经济灵活配置混合基金经理。浦银安盛安享投资定期开放混合基金、浦银安盛安享投资定期开放混合基金、浦银安盛安享投资定期开放混合基金、浦银安盛安享投资定期开放混合基金基金经理。	2017年2月7日	-	10	杨艳辉先生,南京理工大学经济学硕士,2004年至2010年,先后就职于上海证券中心、银建证券公司从事宏观经济、政策以及制造与消费行业研究工作,后在上海汽车财务公司担任投资经理助理之职,2011年4月加盟国泰君安证券资管,担任公司旗下国泰君安证券资管稳健增长证券投资基金基金经理,2014年7月起,兼任公司旗下浦银安盛新经济灵活配置混合基金经理,2017年2月起,兼任公司旗下浦银安盛经济带崛起混合基金基金经理,2018年4月-2018年1月起担任国泰君安证券资管稳健增长证券投资基金基金经理,2013年3月起,兼任浦银安盛战略新兴产业混合基金基金经理,2013年12月至2018年1月兼任浦银安盛消费升级混合基金基金经理,2016年2月至2018年1月兼任浦银安盛资管精选混合基金基金经理,2012年11月起兼任本公司权益投资部总监,2016年4月起兼任本公司首席投资官。

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年三季度,受贸易战以及金融去杠杆影响,国内宏观经济延续了上半年较弱的态势。从投资角度来看,房地产调控持续,地方政府债务压力导致基建投资放缓;从消费角度来看,当前消费占GDP的比重已经越来越高,但社会消费零售数据在三季度出现了增速下滑的趋势,导致市场对经济更为悲观。央行采取了一些放松措施,但在需求不足和政策不确定的情况下,资金难以进入实体经济。

三季度,A股市场在悲观预期下总体表现偏弱,主要指数表现都不佳,基金组合在医药、通信、化工、食品等方面进行了超配。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金业绩跑输基准,基建净值增长率为-13.79%,业绩比较基准收益率为-1.70%。

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.本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§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)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	275,678,783.60	91.00
	其中:股票	275,678,783.60	91.00
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	26,810,290.74	8.85
8	其他资产	459,155.43	0