

浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

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,以保障投资执行交易过程的公平性;从事后监控角度上,一方面定期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显著度,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的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多的单边交易超过该证券当日成交量的情形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2018年四季度,国内经济依旧表现疲软,央行的多次降准并没有有效提振社会融资增速;虽然国债利率下行,但企业融资成本依然较高。外部环境方面,美国在美联储持续加息的压力下暴跌,降低了全球的风险偏好;中美贸易战多次反复,导致对出口等方面的前景不明朗。

总体来看,上述因素对A股的风险偏好造成了较大的负面影响,导致市场在四季度延续了前期的弱势状态,主要指数表现都不佳。基金组合在房地产、医药、通信、食品等方面进行了超配。

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1.247元;本报告期基金份额净值增长率为-14.76%,业绩比较基准收益率为-6.23%。

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元的情形。

5 投资组合报告
5.1 投资组合报告
5.1.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.4 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), 占基金资产净值的比例(%)

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, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 资产支持证券代码, 资产支持证券名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

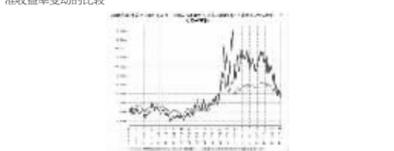
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 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指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

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10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

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

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《公平交易管理制度》,建立并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投资组合。

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的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多的单边交易超过该证券当日成交量的情形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2018年四季度,国内经济依旧表现疲软,央行的多次降准并没有有效提振社会融资增速;虽然国债利率下行,但企业融资成本依然较高。外部环境方面,美国在美联储持续加息的压力下暴跌,降低了全球的风险偏好;中美贸易战多次反复,导致对出口等方面的前景不明朗。

总体来看,上述因素对A股的风险偏好造成了较大的负面影响,导致市场在四季度延续了前期的弱势状态,主要指数表现都不佳。基金组合在房地产、医药、通信、食品等方面进行了超配。

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1.247元;本报告期基金份额净值增长率为-14.76%,业绩比较基准收益率为-6.23%。

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元的情形。

5 投资组合报告
5.1 投资组合报告
5.1.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.4 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), 占基金资产净值的比例(%)

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, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 资产支持证券代码, 资产支持证券名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 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指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.12 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.13 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.14 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.15 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.16 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.17 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.18 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.19 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.20 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.21 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.22 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.23 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.24 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.25 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.26 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.27 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.28 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.29 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.30 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.31 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.32 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.33 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.34 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.35 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.36 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.37 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.38 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.39 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.40 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.41 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.42 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.43 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.44 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.45 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.46 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.47 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.48 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.49 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.50 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.51 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.52 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.53 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.54 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.55 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.56 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.57 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.58 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.59 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.60 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.61 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.62 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.63 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.64 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.65 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.66 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.67 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.68 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.69 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.70 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.71 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.72 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.73 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股指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股指期货代码, 股指期货名称, 数量, 公允价值(元),