浦银安盛日日鑫货币市场基金

2019年第一季度报告

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4月19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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月17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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛日日鑫
基金主代码	003228
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月30日
报告期末基金份额总额	29,394,323,931.76份
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	(1)滚动配置策略 本基金将根据具体投资品种的市场特性采用持续投资的方法,既能提高基金资产变现能力的稳定性,又能保证基金资产收益率与市场利率的基本一致。 (2)久期控制策略 本基金将根据对货币市场利率趋势的判断调配剩余基金资产的久期。在预期利率上升时,缩短基金资产的久期,以规避资本损失或获得较高的再投资收益;在预期利率下降时,延长基金资产的久期,以获取资本利得或锁定较高的收益率。 (3)套利策略 套利策略包括跨市场套利和跨品种套利。跨市场套利是利用同一金融工具在各个子市场的不同表现进行套利。跨品种套利是利用不同金融工具的收益率差别,在满足基金日身流动性、安全性需要的基础上寻求更高的收益率。 (4)时机选择策略 股票、债券发行以及年末效应等因素可能会使市场资金供求情况发生暂时失衡,从而推高市场利率。充分利用这种失衡就能提高基金资产的收益率。
业绩比较基准	人民币活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	浦银日日鑫A	浦银日日鑫B
下属分级基金的交易代码	003228	003229
报告期末下属分级基金的份额总额	43,651,301.31份	29,350,672,630.45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(2019年1月1日 - 2019年3月31日)	
	浦银日日鑫A	浦银日日鑫B
1. 本期已实现收益	285,374.16	245,564,657.57
2. 本期利润	285,374.16	245,564,657.57
3. 期末基金资产净值	43,651,301.31	29,350,672,630.45

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。

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

浦银日日鑫A

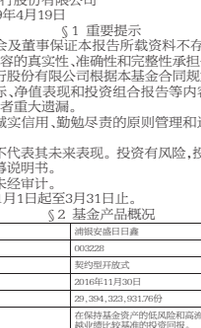
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6389%	0.0006%	0.0863%	0.0000%	0.5526%	0.0006%

浦银日日鑫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	0.6982%	0.0006%	0.0863%	0.0000%	0.6119%	0.0006%

注:1、本基金收益分配按日结转份额。

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



§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、浦银安盛幸福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、浦银安盛日日鑫货币市场证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金、浦银安盛增利债券型证券投资基金以及浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金基金经理。	2017年11月1日	-	14	钟明女士,复旦大学MBA。2005年至2017年就职于兴全基金管理有限公司,先后从事基金会计岗位、债券交易员岗位、基金经理助理岗位和基金经理岗位。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、浦银安盛幸福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、浦银安盛货币市场证券投资基金及浦银安盛日日鑫货币市场基金基金经理。2018年10月起担任浦银安盛中短债债券型证券投资基金的基金经理。2018年12月起担任浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金的基金经理。
龚素君	公司旗下浦银安盛货币市场证券投资基金以及浦银安盛日日鑫货币市场基金基金经理	2019年3月4日	-	7	龚素君女士,华中科技大学金融学硕士,2012年3月至2013年6月在第一创业证券股份有限公司任职稽核与风险管理岗;2013年7月至2017年11月在郑州银行股份有限公司金融市场部,担任投资交易员。2017年11月加盟浦银安盛基金管理有限公司,在固定收益投资部任职货币基金基金经理助理。2019年3月起担任浦银安盛货币市场证券投资基金以及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

一季度银行间资金面整体维持合理宽裕,配合地方债提前发行、财政投放加速和货币投放精准引导等措施实施,数据综合来看3月PMI有超预期回升势头,市场对于经济企稳的预期逐步增强,收益率曲线趋向陡峭化,长端调整压力明显。权益方面,风险偏好的提升使得股市反弹明显,幅度已超30%,进一步增大债市调整压力。虽然银行间资金面持续宽松,但经济基本面预期较年初已明显转向乐观,后期货币政策降准概率降低,市场情绪在3月开始谨慎进入防御状态。

报告期,货币基金操作上采取杠杆和交易策略,结合资金面的波动获取短期交易机会,同时灵活调控久期,获取超额回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期浦银日日鑫A的基金份额净值收益率为0.6389%,本报告期浦银日日鑫B的基金份额净值收益率为0.6982%,同期业绩比较基准收益率为0.0863%。

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)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	9,638,809,276.43	31.30
	其中:债券	9,638,809,276.43	31.30
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	8,385,067,520.11	27.23
	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	12,627,632,530.43	41.01
4	其他资产	142,522,756.06	0.46
5	合计	30,794,032,083.03	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	1.77	
	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	1,388,797,692.80	4.72
	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	42
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	53
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	32

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	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	58.56	4.72
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	23.80	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	9.90	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	5.14	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	6.89	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		104.28	4.72

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,974,636,226.40	6.72
	其中:政策性金融债	1,974,636,226.40	6.72
4	企业债券	79,984,368.05	0.27
5	企业短期融资券	1,010,491,262.79	3.44
6	中期票据	100,312,536.43	0.34
7	同业存单	6,473,384,882.76	22.02
8	其他	-	-
9	合计	9,638,809,276.43	32.79
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天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	111814159	18江苏银行CD159	7,000,000	697,377,852.29	2.37
2	160415	16农发15	6,200,000	620,092,155.93	2.11
3	111887618	18宁波银行CD208	4,000,000	399,109,082.04	1.36
4	111921030	19渤海银行CD030	4,000,000	398,675,780.77	1.36
5	111881963	18汉口银行CD106	3,500,000	348,971,236.84	1.19
6	111896521	18西安银行CD017	3,200,000	319,528,996.81	1.09
7	111896058	18长沙银行CD079	3,000,000	299,451,415.90	1.02
8	111887318	18徽商银行CD161	3,000,000	299,382,099.68	1.02
9	111882364	18青岛农商行CD052	3,000,000	298,953,168.39	1.02
10	180209	18国开09	2,900,000	290,814,738.70	0.99

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	0.0460%
报告期内偏离度的最低值	0.0182%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0345%

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

江苏银行因未依法履行其他职责,中国银行业监督管理委员会江苏监管局于2019-01-25依据相关法规给予:公开处罚处分决定。

宁波银行因未依法履行其他职责,中国银行业监督管理委员会宁波监管局于2019-03-03依据相关法规给予:公开处罚处分决定;因未依法履行其他职责,中国银行业监督管理委员会宁波监管局于2018-12-13依据相关法规给予:公开处罚处分决定;因未依法履行其他职责,中国银行业监督管理委员会宁波监管局于2018-06-07依据相关法规给予:公开处罚处分决定。

汉口银行因未依法履行其他职责,中国银行业监督管理委员会湖北监管局于2019-02-26依据相关法规给予:公开处罚处分决定;因未依法履行其他职责,中国银行业监督管理委员会湖北监管局于2018-12-28依据相关法规给予:公开处罚处分决定。

青岛农商银行因未依法履行其他职责,中国银行业监督管理委员会青岛监管局于2018-09-30依据相关法规给予:公开处罚处分决定。

徽商银行因未依法履行其他职责,中国银行业监督管理委员会安徽监管局于2018-09-10依据相关法规给予:公开处罚处分决定。

长沙银行因未依法履行其他职责,中国银行业监督管理委员会湖南监管局于2018-04-16依据相关法规给予:公开处罚处分决定。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	141,323,172.39
4	应收申购款	1,199,583.67
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	142,522,756.06

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	浦银日日鑫A	浦银日日鑫B
报告期期初基金份额总额	30,695,700.44	30,373,527,183.48
报告期期间基金总申购份额	99,183,224.02	21,805,340,500.27
报告期期间基金总赎回份额	86,227,623.15	22,828,195,053.30
报告期期末基金份额总额	43,651,301.31	29,350,672,630.45

§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)	适用费率
1	基金转换入	2019年1月3日	139,983,063.26	139,983,063.26	0.00%
2	红利发放	2019年1月4日	12,303.63	12,303.63	0.00%
3	红利发放	2019年1月7日	31,351.35	31,351.35	0.00%
4	红利发放	2019年1月8日	11,455.55	11,455.55	0.00%
5	红利发放	2019年1月9日	11,386.97	11,386.97	0.00%
6	红利发放	2019年1月10日	11,283.07	11,283.07	0.00%
7	红利发放	2019年1月11日	10,622.56	10,622.56	0.00%
8	红利发放	2019年1月14日	31,470.82	31,470.82	0.00%
9	红利发放	2019年1月15日	10,364.21	10,364.21	0.00%
10	红利发放	2019年1月16日	10,956.21	10,956.21	0.00%
11	红利发放	2019年1月17日	10,378.37	10,378.37	0.00%
12	红利发放	2019年1月18日	10,344.22	10,344.22	0.00%
13	红利发放	2019年1月21日	31,046.33	31,046.33	0.00%
14	红利发放	2019年1月22日	10,499.50	10,499.50	0.00%
15	红利发放	2019年1月23日	11,562.36	11,562.36	0.00%
16	红利发放	2019年1月24日	10,558.18	10,558.18	0.00%
17	红利发放	2019年1月25日	10,577.84	10,577.84	0.00%
18	红利发放	2019年1月28日	32,160.72	32,160.72	0.00%
19	红利发放	2019年1月29日	12,300.51	12,300.51	0.00%
20	红利发放	2019年1月30日	11,288.57	11,288.57	0.00%
21	红利发放	2019年1月31日	11,314.04	11,314.04	0.00%
22	红利发放	2019年2月1日	11,388.79	11,388.79	0.00%
23	红利发放	2019年2月11日	113,925.99	113,925.99	0.00%
24	红利发放	2019年2月12日	11,051.48	11,051.48	0.00%
25	红利发放	2019年2月13日	10,550.09	10,550.09	0.00%
26	红利发放	2019年2月14日	10,381.92	10,381.92	0.00%
27	红利发放	2019年2月15日	10,365.01	10,365.01	0.00%
28	红利发放	2019年2月18日	30,954.05	30,954.05	0.00%
29	红利发放	2019年2月19日	11,194.35	11,194.35	0.00%
30	红利发放	2019年2月20日	10,139.80	10,139.80	0.00%
31	红利发放	2019年2月21日	10,996.53	10,996.53	0.00%
32	红利发放	2019年2月22日	10,058.71	10,058.71	0.00%
33	红利发放	2019年2月25日	30,219.44	30,219.44	0.00%
34	红利发放	2019年2月26日	10,510.08	10,510.08	0.00%
35	红利发放	2019年2月27日	10,289.28	10,289.28	0.00%
36	红利发放	2019年2月28日	10,739.99	10,739.99	0.00%
37	红利发放	2019年3月1日	10,629.48	10,629.48	0.00%
38	红利发放	2019年3月4日	31,589.48	31,589.48	0.00%
39	红利发放	2019年3月5日	10,652.26	10,652.26	0.00%
40	红利发放	2019年3月6日	10,421.59	10,421.59	0.00%
41	红利发放	2019年3月7日	12,197.67	12,197.67	0.00%
42	红利发放	2019年3月8日	9,771.72	9,771.72	0.00%
43	红利发放	2019年3月11日	29,406.48	29,406.48	0.00%
44	红利发放	2019年3月12日	12,145.17	12,145.17	0.00%
45	红利发放	2019年3月13日	9,599.47	9,599.47	0.00%
46	红利发放	2019年3月14日	12,046.57	12,046.57	0.00%
47	红利发放	2019年3月15日	9,734.21	9,734.21	0.00%
48	红利发放	2019年3月18日	29,382.59	29,382.59	0.00%
49	红利发放	2019年3月19日	10,642.96	10,642.96	0.00%
50	红利发放	2019年3月20日	5,020.74	5,020.74	0.00%
51	赎回	2019年3月20日	-80,000,000.00	-80,006,607.61	0.00%
52	红利发放	2019年3月21日	5,574.01	5,574.01	0.00%
53	红利发放	2019年3月22日	4,684.66	4,684.66	0.00%
54	红利发放	2019年3月25日	13,700.17	13,700.17	0.00%
55	红利发放	2019年3月26日	4,583.36	4,583.36	0.00%
56	红利发放	2019年3月27日	5,101.68	5,101.68	0.00%
57	红利发放	2019年3月28日	5,312.73	5,312.73	0.00%
58	红利发放	2019年3月29日	4,877.85	4,877.85	0.00%
合计			60,836,118.63	60,829,511.02	

注:1、截至本报告期末,本基金管理人持有浦银日日鑫B 60,836,118.63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日日鑫B 365,715,343.65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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
		持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019年1月1日-2019年3月31日	12,092,257,083.46	71,213,413.52	2,532,731,728.37	9,630,738,768.61	32.76%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

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仓位调整的困难,产生冲击成本的风险,并造成基金净值的波动;同时,该等大额赎回将可能产生(1)单位净值尾差风险;(2)基金净值大幅波动的风险;(3)因引发基金本身的巨额赎回而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、 浦银安盛日日鑫货币市场基金基金合同

3、 浦银安盛日日鑫货币市场基金招募说明书

4、 浦银安盛日日鑫货币市场基金托管协议

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
2019年4月19日

浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

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年4月19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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月17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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛新兴产业混合
基金主代码	519120
交易代码	519120
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月25日
报告期末基金份额总额	201,231,464.24份
投资目标	通过资产的积极灵活配置,并通过重点关注国家战略新兴产业发展过程中带来的投资机会,在严格控制风险并保证充分流动性的前提下,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1.资产配置策略:动态把握不同资产类别的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化,进行股票、固定收益证券和现金等大类资产的合理配置。2.股票投资策略:主要采用主题投资策略,通过对战略性新兴产业的及国家政策的持续跟踪研究,结合对战略性新兴产业相关行业的发展趋势的研究分析,上市公司发展战略、商业模式、技术、上之的分析,对属于战略性新兴产业投资主题范畴的上市公司进行重点投资。3.通过研判债券市场风险收益特征的宏观经济变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构造组合。
业绩比较基准	65%×中证新兴产业指数+45%×中证全债指数
风险收益特征	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	交通银行股份有限公司

§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(2019年1月1日 - 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	70,635,636.89
2.本期利润	91,312,712.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.4448
4.期末基金资产净值	377,778,488.31
5.期末基金份额净值	1.877

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。

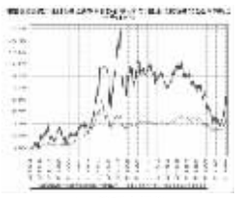
3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	30.98%	1.69%	15.27%	0.93%	15.71%	0.76%

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		
吴勇	公司首席投资官、权益投资部总监。公司旗下浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金和浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理。	2013年3月25日	-	12	吴勇先生,上海交通大学材料工程系学士,上海交通大学工商管理硕士、CFA、CPA。中国注册造价师。1993年8月至2007年8月先后就职于上海电力建设有限责任公司任预算主管、国家开发银行上海市分行任评审经理。2007年9月起加盟浦银安盛基金管理有限公司先后担任行业研究员、基金经理助理。2010年4月-2016年1月起担任浦银安盛红利精选混合型证券投资基金基金经理。2011年5月起兼任浦银安盛精致生活灵活配置混合型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型证券投资基金基金经理。2013年12月至2018年1月兼任浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年2月至2018年1月兼任浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。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

2019年一季度,A股市场走出了较为强劲的反弹趋势,沪深300、创业板指数都有了较大的涨幅,市场活跃度和风险偏好有所提升。就其原因,主要在于以下几方面:首先是金融去杠杆政策有所缓和,市场流动性有所放松;其次是中美贸易摩擦问题在两国领导人的推动下有了比较明显的进展,对国内经济的悲观预期有所修正;最后从市场角度来看,经历了2018年的下跌以后,A股的整体估值水平已经比较低。

基于A股市场估值较低,对经济和政策的悲观预期已经体现得较为充分的判断,本基金在一季度保持了较高的仓位,超配了农林牧渔、家电、通信等板块。

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1.877元;本报告期基金份额净值增长率为30.98%,业绩比较基准收益率为15.27%。

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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	351,488,346.94	88.97
	其中:股票	351,488,346.94	88.97
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	31,117,176.68	7.88
8	其他资产	12,440,188.66	3.15
9	合计	395,045,712.28	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	1,144,940.00	0.30
B	采矿业	-	-
C	制造业	325,419,312.25	86.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,453,950.00	0.38
F	批发和零售业	9,373,000.00	2.48
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,770,912