

浦银安盛红利精选混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月25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2017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,也不保证基金份额持有人不受本金损失。

基金的投资存在净值不再为其保本承诺。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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况	
基金名称	浦银安盛红利精选混合
基金代码	519115
交易代码	519115
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月3日
报告期末基金份额总额	53,794,905.64份
投资目标	本基金在严格控制投资风险的前提下,通过投资盈利能力较高、分红稳定或分红能力较大的上市公司和国内依法公开发行上市的各种债券,力争为投资者提供超越市场收益和长期增值的投资回报。
投资策略	本基金坚持价值投资理念,在严格控制投资风险的前提下,通过投资盈利能力较高、分红稳定或分红能力较大的上市公司和国内依法公开发行上市的各种债券,力争为投资者提供超越市场收益和长期增值的投资回报。
业绩比较基准	中证红利指数×75%+中证全债指数×25%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,基金资产整体的预期收益和风险均较高,属于中高风险、中高收益的证券投资基金。本基金为中长期投资的股票资产,追求长期资本增值,对长期投资的风险承受能力较强。
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

注:自2015年8月4日起,本基金类型由股票型变更为混合型,本基金的基金名称变更为“浦银安盛红利精选混合型证券投资基金”,具体内容详见基金管理人于2015年8月4日发布的《关于浦银安盛红利精选混合型证券投资基金变更基金名称、基金类型及业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》。

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 2017年7月1日至2017年9月30日
1.本期已实现收益	3,116,310.39
2.本期利润	6,921,802.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.1177
4.期末基金资产净值	89,678,353.17
5.期末基金份额净值	1.667

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。

3.21 基金净值表现

3.21 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	8.04%	0.63%	2.50%	0.03%	5.49%	0.64%

3.22 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、②上述任职日期,前任基金经理根据本基金管理人对外披露的信息日期填写。

③基金经理的交叉通过从行业协会(证券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,基金合同约定和基金合同的约定,未发生任何违法违规行为,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,基金合同约定和基金合同的约定,未发生任何违法违规行为,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,基金合同约定和基金合同的约定,未发生任何违法违规行为。

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,保证公平对待旗下所有的基金组合。

在系统执行中,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,保证各基金及专户业务的独立投资决策机制,在交易执行环节上,详细制定了面对多个投资组合投资决策的公平交易执行流程和规范,以保证投资执行过程的公平性,从事后监督角度上,一方面定期对股票交易情况进行分析,对不同类型窗口(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,并进行统计量性的检验,以确定交易价差对相关基金的业绩差异的影响,同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益差异的分析,另一方面基金公司对公平交易制度的遵守和相关交易流程的执行情况进行定期检查,并对发现的违规问题进行及时纠正。

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异常交易,法律、中国证监会和证券交易所颁布的相关规定及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行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

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,保证公平对待旗下所有的基金组合。

在系统执行中,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,保证各基金及专户业务的独立投资决策机制,在交易执行环节上,详细制定了面对多个投资组合投资决策的公平交易执行流程和规范,以保证投资执行过程的公平性,从事后监督角度上,一方面定期对股票交易情况进行分析,对不同类型窗口(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,并进行统计量性的检验,以确定交易价差对相关基金的业绩差异的影响,同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益差异的分析,另一方面基金公司对公平交易制度的遵守和相关交易流程的执行情况进行定期检查,并对发现的违规问题进行及时纠正。

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异常交易,法律、中国证监会和证券交易所颁布的相关规定及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行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

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,保证公平对待旗下所有的基金组合。

在系统执行中,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,保证各基金及专户业务的独立投资决策机制,在交易执行环节上,详细制定了面对多个投资组合投资决策的公平交易执行流程和规范,以保证投资执行过程的公平性,从事后监督角度上,一方面定期对股票交易情况进行分析,对不同类型窗口(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,并进行统计量性的检验,以确定交易价差对相关基金的业绩差异的影响,同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益差异的分析,另一方面基金公司对公平交易制度的遵守和相关交易流程的执行情况进行定期检查,并对发现的违规问题进行及时纠正。

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。



注:自2015年8月4日起,本基金类型由股票型变更为混合型,本基金的基金名称变更为“浦银安盛红利精选混合型证券投资基金”,具体内容详见基金管理人于2015年8月4日发布的《关于浦银安盛红利精选混合型证券投资基金变更基金名称、基金类型及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	
姓名	职务
陈皓非	基金经理
2016年1月14日	9

注:①上述任职日期,前任基金经理根据本基金管理人对外披露的信息日期填写。

③基金经理的交叉通过从行业协会(证券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,基金合同约定和基金合同的约定,未发生任何违法违规行为,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,基金合同约定和基金合同的约定,未发生任何违法违规行为,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,基金合同约定和基金合同的约定,未发生任何违法违规行为。

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,保证公平对待旗下所有的基金组合。

在系统执行中,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,保证各基金及专户业务的独立投资决策机制,在交易执行环节上,详细制定了面对多个投资组合投资决策的公平交易执行流程和规范,以保证投资执行过程的公平性,从事后监督角度上,一方面定期对股票交易情况进行分析,对不同类型窗口(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,并进行统计量性的检验,以确定交易价差对相关基金的业绩差异的影响,同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益差异的分析,另一方面基金公司对公平交易制度的遵守和相关交易流程的执行情况进行定期检查,并对发现的违规问题进行及时纠正。

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异常交易,法律、中国证监会和证券交易所颁布的相关规定及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行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

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,保证公平对待旗下所有的基金组合。

在系统执行中,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,保证各基金及专户业务的独立投资决策机制,在交易执行环节上,详细制定了面对多个投资组合投资决策的公平交易执行流程和规范,以保证投资执行过程的公平性,从事后监督角度上,一方面定期对股票交易情况进行分析,对不同类型窗口(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,并进行统计量性的检验,以确定交易价差对相关基金的业绩差异的影响,同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益差异的分析,另一方面基金公司对公平交易制度的遵守和相关交易流程的执行情况进行定期检查,并对发现的违规问题进行及时纠正。

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。

5.22 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。

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	300322	德业科技	260,000	3,923,800.00	4.39
2	300340	中炬高新	95,000	3,592,450.00	3.98
3	000063	中兴通讯	120,000	3,396,000.00	3.79
4	300296	利源股份	160,000	3,224,000.00	3.60
5	000002	万科A	120,000	3,150,000.00	3.51
6	300219	润兴股份	240,000	3,136,800.00	3.50
7	300115	长盛精密	90,000	3,111,300.00	3.47
8	002008	神州高铁	71,000	3,095,600.00	3.45
9	002573	润丰股份	139,961	3,051,149.80	3.40
10	300327	中顺洁柔	87,520	3,006,864.00	3.35

5.4 报告期末按基金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组合

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债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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组合

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组合

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

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 本期国债期货投资政策

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受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选证券的范围。

5.11.3 其他资产构成

合计

5.22 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。

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	300322	德业科技	260,000	3,923,800.00	4.39
2	300340	中炬高新	95,000	3,592,450.00	3.98
3	000063	中兴通讯	120,000	3,396,000.00	3.79
4	300296	利源股份	160,000	3,224,000.00	3.60
5	000002	万科A	120,000	3,150,000.00	3.51
6	300219	润兴股份	240,000	3,136,800.00	3.50
7	300115	长盛精密	90,000	3,111,300.00	3.47
8	002008	神州高铁	71,000	3,095,600.00	3.45
9	002573	润丰股份	139,961	3,051,149.80	3.40
10	300327	中顺洁柔	87,520	3,006,864.00	3.35

5.4 报告期末按基金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组合

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债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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组合

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组合

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

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 本期国债期货投资政策

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受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

本基金投资的前十名证券,没有超出基金合同约定的备选证券的范围。

5.11.3 其他资产构成

合计

5.22 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	46,377.32
2	应收证券清算款	63,888.43
3	应收股利	-
4	应收利息	1,181.41
5	应收申购款	27,736.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	139,123.44

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

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.12 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.12.1 报告期末本基金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。

5.12.2 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。

5.13 其他资产构成

合计

5.22 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。

5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

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债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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贵金属投资组合

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资组合

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.27 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.27.1 报告期末本基金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。

5.27.2 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。

5.28 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.28.1 报告期末本基金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。

5.28.2 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。

5.29 投资组合报告附注

5.29.1 报告期末本基金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债券。

5.29.2 报告期末本基金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债券。

5.29.3 报告期末本基金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债券。

5.29.4 报告期末本基金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债券。

5.29.5 报告期末本基金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债券。

5.29.6 报告期末本基金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债券。

5.29.7 报告期末本基金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债券。

5.29.8 报告期末本基金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债券。

5.29.9 报告期末本基金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债券。

5.29.10 报告期末本基金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债券。

5.29.11 报告期末本基金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债券。

5.29.12 报告期末本基金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债券。

5.29.13 报告期末本基金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债券。

5.29.14 报告期末本基金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债券。

5.29.15 报告期末本基金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债券。

5.29.16 报告期末本基金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债券。

5.29.17 报告期末本基金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债券。

5.29.18 报告期末本基金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债券。

5.29.19 报告期末本基金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债券。

5.29.20 报告期末本基金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债券。

5.29.21 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细