

2017年9月30日
基金管理人:浙商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:2017年10月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事及董事会成员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2017年10月23日复核了本报表中的财务指标、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2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金
基金代码	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
报告期末基金资产总额	34,612,325.20元
投资目标	本基金采取指数化投资策略，通过严格的的投资纪律约束和数量化的投资管理手段，追求对标的指数的有效跟踪，本基金力争复制本基金的业绩增长与业绩比较基准收益之间的日平均跟踪误差不超过0.05%，且年跟踪误差不超过4%，以求实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	中证沪深300指数收益率×95%+银行存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其风险和收益高于混合型基金、债券型基金，低于股票型基金，适合风险承受能力中等的投资者。
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

单位：人民币元

主要财务指标	报告期: 2017年7月1日 - 2017年9月30日
1.本期已实现收益	114,808.27
2.本期利润	4,249,165.73
3.加权平均基金份额利润	0.1195
4.期末基金资产净值	58,831,154.26
5.期末基金份额净值	1.700

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将低于所示数字。

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本基金报告期基金份额净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率为① 净值增长率为② 业绩比较基准收益率为③ 业绩比较基准收益率为④ ①-③ ②-④

过去三个月 75% 90% 78% 92% -0.45% -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

浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金

2017年第三季度报告

4.3.2异常交易行为的专项说明

2017年9月30日，尽管投资风格部分行业房地产调控等政策影响，国内经济平稳增长，表现出良好的韧性，中国制造业采购经理指数PMI 9月度达到52.4%，其生产、新订单和购进价格等分项指标表现强劲，据wind资讯统计，2017年上半年A股利润同比增长16.4%，其中金融类公司同比增长32.1%，受益于经济稳健增长和供应端企业的中游企业业绩增长较快，面对优异的经济指标和盈利数据，部分证券市场研究机构开始憧憬中国经济增长新周期的来临。三季度，A股将普遍上涨，中证锐联基本面400指数上涨8.40%，上证周期行业如煤炭、钢铁和有色等板块将表现出消费、汽车行业中的食品饮料以及通信、电子等板块也有不错的表现。

本报报告期内未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

2.本报报告期内未出现连续二十个交易日基金资产净值低于五千万的情形。

3.5报告期组合投资报告

5.1报告期末本基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 55,765,816.73 94.21

2 固定收益投资 55,765,816.73 94.21

3 货币市场基金 6,300.00 0.01

其中：债券 6,300.00 0.01

4 货币资产 6,300.00 0.01

5 其他资产 6,300.00 0.01

6 银行存款和结算备付金合计 3,888,674.63 5.72

7 其他资产 33,859.32 0.06

8 合计 59,194,650.48 100.00

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

序号 代码 行业类别 公允价值(元) 占基金总资产的比例(%)

1 农林、牧、渔业 156,945.33 0.27

2 安徽省 2,585,886.96 4.40

3 制造业 31,508,336.09 53.56

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 1,533,813.59 2.61

5 建筑业 2,049,852.76 3.48

6 批发和零售业 4,285,927.85 7.29

7 交通运输、仓储和邮政业 2,334,292.62 3.97

8 住宿和餐饮业 47,947.80 0.08

9 信息传播、软件和信息技术服务业 2,093,622.40 3.56

10 金融业 3,582,456.57 6.09

11 房地产业 2,918,094.19 4.96

12 其他服务业 879,295.06 1.49

13 科学研究、技术服务业 0.00 0.00

14 水利、环境和公共设施管理业 270,432.03 0.46

5.2.2报告期末按行业分类的港股通股票投资组合

5.2.3报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 国家债券 1,109,000.00 1.51

2 安徽省 0.00 0.00

3 制造业 0.00 0.00

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 0.00 0.00

5 建筑业 0.00 0.00

6 批发和零售业 0.00 0.00

7 交通运输、仓储和邮政业 0.00 0.00

8 住宿和餐饮业 0.00 0.00

9 信息传播、软件和信息技术服务业 0.00 0.00

10 金融业 0.00 0.00

11 房地产业 0.00 0.00

12 其他服务业 0.00 0.00

13 科学研究、技术服务业 0.00 0.00

14 水利、环境和公共设施管理业 0.00 0.00

15 金融业 0.00 0.00

16 交通运输、仓储和邮政业 0.00 0.00

17 其他服务业 0.00 0.00

18 住宿和餐饮业 0.00 0.00

19 信息传播、软件和信息技术服务业 0.00 0.00

20 其他服务业 0.00 0.00

21 其他服务业 0.00 0.00

22 其他服务业 0.00 0.00

23 其他服务业 0.00 0.00

24 其他服务业 0.00 0.00

25 其他服务业 0.00 0.00

26 其他服务业 0.00 0.00

27 其他服务业 0.00 0.00

28 其他服务业 0.00 0.00

29 其他服务业 0.00 0.00

30 其他服务业 0.00 0.00

31 其他服务业 0.00 0.00

32 其他服务业 0.00 0.00

33 其他服务业 0.00 0.00

34 其他服务业 0.00 0.00

35 其他服务业 0.00 0.00

36 其他服务业 0.00 0.00

37 其他服务业 0.00 0.00

38 其他服务业 0.00 0.00

39 其他服务业 0.00 0.00

40 其他服务业 0.00 0.00

41 其他服务业 0.00 0.00

42 其他服务业 0.00 0.00

43 其他服务业 0.00 0.00

44 其他服务业 0.00 0.00

45 其他服务业 0.00 0.00

46 其他服务业 0.00 0.00

47 其他服务业 0.00 0.00

48 其他服务业 0.00 0.00

49 其他服务业 0.00 0.00

50 其他服务业 0.00 0.00

51 其他服务业 0.00 0.00

52 其他服务业 0.00 0.00

53 其他服务业 0.00 0.00

54 其他服务业 0.00 0.00

55 其他服务业 0.00 0.00

56 其他服务业 0.00 0.00

57 其他服务业 0.00 0.00

58 其他服务业 0.00 0.00

59 其他服务业 0.00 0.00

60 其他服务业 0.00 0.00

61 其他服务业 0.00 0.00

62 其他服务业 0.00 0.00

63 其他服务业 0.00 0.00

64 其他服务业 0.00 0.00

65 其他服务业 0.00 0.00