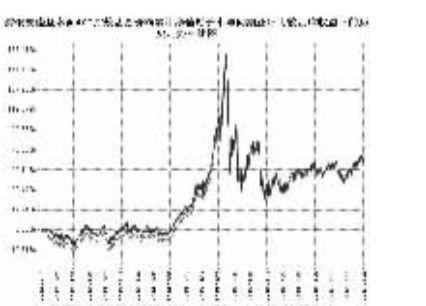


浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金

2017年第三季度报告



4.3.2 异常交易行为的专项说明

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% 的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年第三季度,尽管受环保检查和部分城市房地产调控政策影响,国内经济持续增长,表现出良好的韧性。中国制造业采购经理指数 PMI 的 9 月值达到 52.4,其中生产、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%,其中非金融类公司同比增长 32.1%,受益于经济稳健增长和供应端改革的中上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,本基金整体上,上游周期行业如煤炭、钢铁和有色等板块表现出众,消费行业中的食品饮料以及消费电子等板块也有不错的表现。

本报告期内,本基金采取全面复制方法密切跟踪标的指数的表现,组合表现基本与同期业绩比较基准保持一致。

4.5 报告期内基金的投资业绩

截至本报告期末,本基金份额净值为 1.7000 元;本报告期基金份额净值增长率为 7.53%,业绩比较基准收益率为 7.98%。

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人数不满二百人的情形。

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 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	55,765,816.73	94.21
2	其中:股票	55,765,816.73	94.21
3	基金投资	-	-
4	其中:股票	6,300.00	0.01
5	资产支持证券	-	-
6	其中:股票	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	3,388,674.43	5.72
8	其他资产	33,859.32	0.06
9	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

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	156,945.33	0.27
B	采矿业	2,585,989.96	4.40
C	制造业	31,508,336.09	53.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,533,831.59	2.61
E	建筑业	2,049,852.76	3.48
F	批发和零售业	4,285,927.85	7.29
G	交通运输、仓储和邮政业	2,334,292.62	3.97
H	住宿和餐饮业	47,947.80	0.08
I	信息技术、软件和信息技术服务业	2,093,622.40	3.56
J	金融业	3,582,456.57	6.09
K	房地产业	2,918,094.19	4.96
L	租赁和商务服务业	879,236.05	1.49
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	270,432.03	0.46

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业人员的定义遵从行业协会(证券业从业人员资格管理办法)的相关规定。

4.2 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。本报告期内未持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,详细规定了多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规则,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;另一方面是公司对于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核查,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,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% 的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年第三季度,尽管受环保检查和部分城市房地产调控政策影响,国内经济持续增长,表现出良好的韧性。中国制造业采购经理指数 PMI 的 9 月值达到 52.4,其中生产、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%,其中非金融类公司同比增长 32.1%,受益于经济稳健增长和供应端改革的中上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,本基金整体上,上游周期行业如煤炭、钢铁和有色等板块表现出众,消费行业中的食品饮料以及消费电子等板块也有不错的表现。

本报告期内,本基金采取全面复制方法密切跟踪标的指数的表现,组合表现基本与同期业绩比较基准保持一致。

4.5 报告期内基金的投资业绩

截至本报告期末,本基金份额净值为 1.0474 元;本报告期基金份额净值增长率为 3.86%,业绩比较基准收益率为 2.82%。

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人数不满二百人的情形。

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 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	69,721,869.02	93.81
2	其中:股票	69,721,869.02	93.81
3	基金投资	-	-
4	其中:股票	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	其中:股票	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	4,335,366.36	5.83
8	其他资产	282,700.60	0.38
9	合计	74,319,935.98	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	采矿业	1,301,451.00	1.77
C	制造业	3,825,560.00	5.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,036,220.00	1.41
E	建筑业	2,270,255.00	3.70
F	批发和零售业	175,540.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	486,307.00	0.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	682,640.00	0.93

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业人员的定义遵从行业协会(证券业从业人员资格管理办法)的相关规定。

4.2 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。本报告期内未持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,详细规定了多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规则,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;另一方面是公司对于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核查,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% 的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年第三季度,国内经济整体表现较为良好,在货币政策保持中性偏紧的情况下,GDP 保持了稳定的增长。受益于供给侧改革和环保督察,传统周期性和高污染行业的企业中大幅调整,龙头企业和中上游具有比较优势的公司规模大幅扩张,预计经济未来还是延续当前的宏观和货币政策,在保持经济适度增长的同时提升经济结构的品质。

本基金在第三季度增配了工业大幅改善的化工、造纸、钢铁等行业。

4.5 报告期内基金的投资业绩

截至本报告期末,浦银安盛睿智精选混合 A 基金份额净值为 1.2120 元,本报告期基金份额净值增长率为 17.33%;截至本报告期末,浦银安盛睿智精选混合 C 基金份额净值为 1.1930 元,本报告期基金份额净值增长率为 17.08%;同期业绩比较基准收益率为 2.81%。

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人数不满一百人的情形。

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 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	150,409,062.89	92.76
2	其中:股票	150,409,062.89	92.76
3	基金投资	-	-
4	其中:股票	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	其中:股票	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	10,792,115.99	6.66
8	其他资产	944,045.78	0.58
9	合计	162,145,224.66	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	采矿业	4,580,443.60	2.87
C	制造业	130,446,343.63	81.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,053.44	0.02
E	建筑业	5,579,807.90	3.51
F	批发和零售业	2,148,685.45	1.35
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	94,391.98	0.06
J	金融业	1,445,085.00	0.91
K	房地产业	1,574,025.00	0.98
L	租赁和商务服务业	75,324.02	0.05
M	科学研究和技术服务业	18,528.72	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	通信、软件和信息技术服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.07
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.03
S	综合	-	-
合计		150,409,062.89	94.49

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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