

# 浦银安盛鑫福混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

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：2021 年 10 月 26 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 2021 年 10 月 25 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 2021 年 7 月 1 日起至 2021 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛鑫福混合	
基金主代码	012302	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 5 月 27 日	
报告期末基金份额总额	496,866,269.38 份	
投资目标	在严格控制投资风险的前提下，力争实现超过业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	采用浦银安盛基金资产配置模型，合理配置股票和债券的比例。在股票基准指数沪深 300 指数的行业权重基础上，结合行业统计数据、上市公司行业板块业绩数据以及行业估值水平等，分析不同行业板块的预期收益和风险，合理均衡的配置行业比例。本基金在股票投资方面以中长期的量化选股策略为主，同时在短期策略关注的事件发生频率较高期间进行灵活配置。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×25%+中证全债指数收益率×70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与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	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛鑫福混合 A	浦银安盛鑫福混合 C
下属分级基金的交易代码	012302	012303
报告期末下属分级基金的份额总额	230,092,488.48 份	266,773,780.90 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（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日）	
	浦银安盛鑫福混合 A	浦银安盛鑫福混合 C
1. 本期已实现收益	-136,373.15	-190,741.20
2. 本期利润	-2,441,261.94	-1,979,245.64
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0150	-0.0125
4. 期末基金资产净值	227,570,569.48	263,521,383.62
5. 期末基金份额净值	0.9890	0.9878

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 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

浦银安盛鑫福混合 A

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	-1.16%	0.28%	-1.15%	0.36%	-0.01%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-1.10%	0.24%	-1.49%	0.33%	0.39%	-0.09%

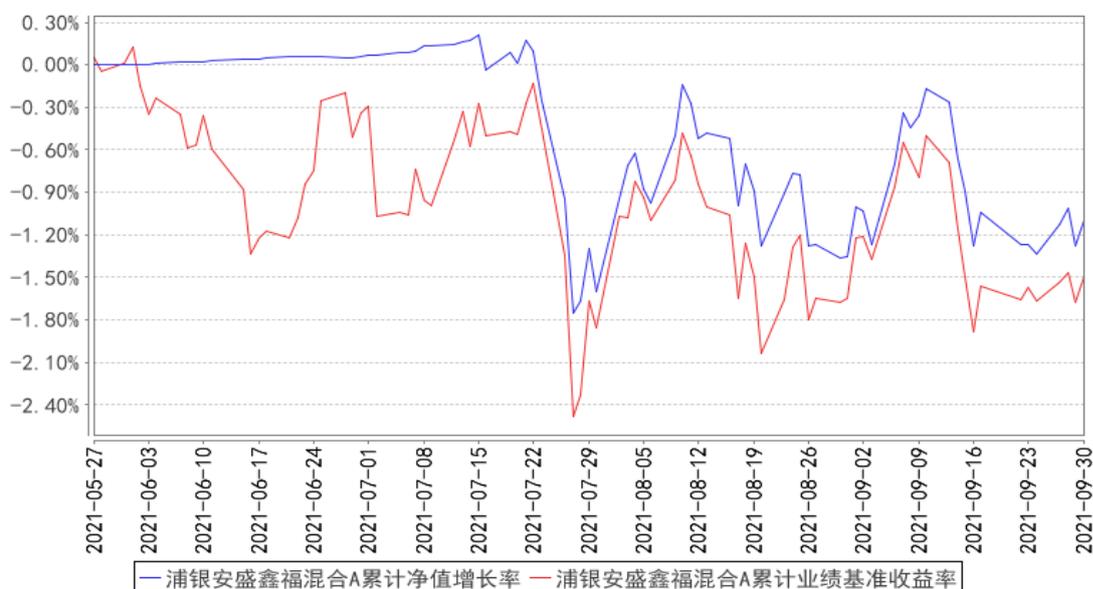
浦银安盛鑫福混合 C

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	-1.25%	0.28%	-1.15%	0.36%	-0.10%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-1.22%	0.24%	-1.49%	0.33%	0.27%	-0.09%

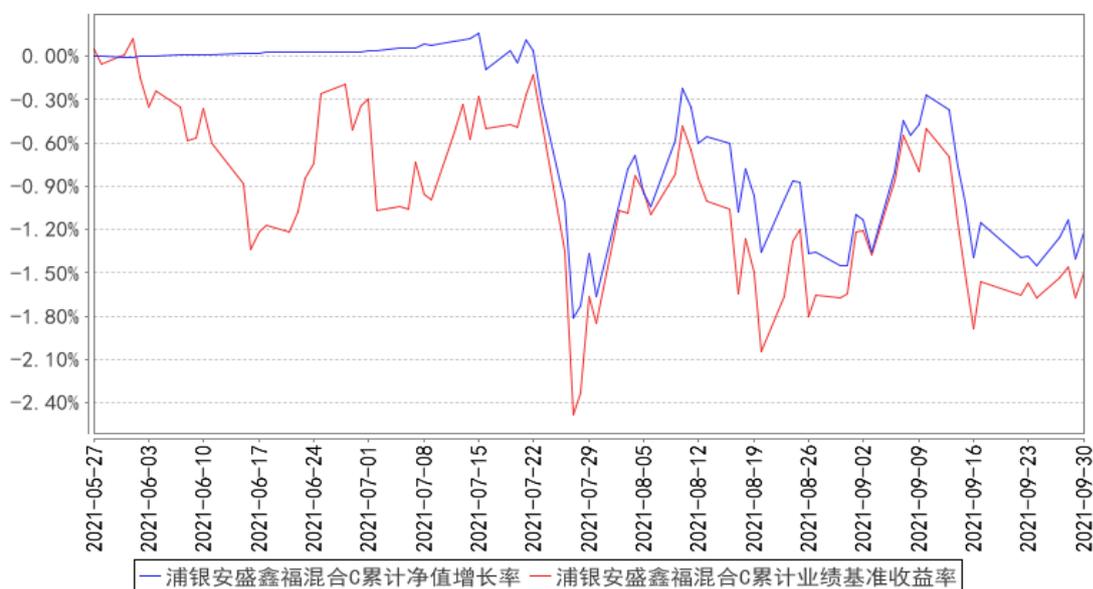
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

### 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

浦银安盛鑫福混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



浦银安盛鑫福混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2021 年 5 月 27 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未滿 1 年。

2、根据基金合同规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为 2021 年 5 月 27 日至 2021 年 11 月 26 日。截止本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

## § 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		
陈士俊	公司指数及量化投资部总监，公司职工监事，公司旗下部分基金基金经理。	2021年5月27日	-	20年	陈士俊先生，清华大学管理学博士。2001年至2003年间曾在国泰君安证券有限公司研究所担任金融工程研究员2年；2003年至2007年10月在银河基金管理有限公司工作4年，先后担任金融工程部研究员、研究部主管。2007年10月加入浦银安盛基金管理有限公司，任本公司指数及量化投资部总监，并于2010年12月起担任浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金基金经理。2012年3月担任本公司职工监事。2012年5月起，担任浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金基金经理。2017年4月起，担任浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金（LOF）基金经理。2018年9月起，担任浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年1月起，担任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020年4月起，担任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金及浦银安盛MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020年6月起，担任浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020年9月起，担任浦银安盛MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2021年5月起，担任浦银安盛鑫福混合型证券投资基金基金经理。2021年7月起担任浦银安盛中证ESG120策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

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合规守信情况的说明

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，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。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与债券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认定的异常交易行为。报告期内未发生本基金与旗下其他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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年第 3 季度，国内经济增速下滑，制造业采购经理指数 PMI 回落到荣枯线 50 以下。煤炭、原材料受到需求复苏和供应短缺的双重影响价格大幅上涨，国内部分地区出现限电限产情况，推动工业品价格指数 PPI 同比上涨超过 9%。政府因此出台了保供稳价措施，能源和原材料商品涨价趋势得到抑制。政府还发布了多项涉及民生领域的产业规范指导意见，对相关行业板块的投资预期产生一定的影响。第 3 季度，A 股市场结构分化，波动加大。上游资源品股票呈现先扬后抑的大幅波动，消费和医药行业股价表现较弱，公用事业及建筑装饰等低估值股票表现较好。沪深 300 指数下跌 6.85%，9 月末市盈率为 13.9 倍，股息率为 1.8%，具有较好的长期投资性价比。从

量化因子看，低波动、价值因子表现较好，盈利质量和成长因子表现较弱。

本报告期内，本基金在有效控制回撤风险的基础上力求获取稳健的投资回报。股票组合以沪深 300 指数为参考基准，采取中长期量化选股策略为主，并结合短期事件驱动等策略对组合进行灵活配置。债券组合以短久期的国债、高等级信用债为主。本基金保持较低的股票投资比例，投资收益较稳定。此外，本基金参与新股申购也获得了一定的收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛鑫福混合 A 的基金份额净值为 0.9890 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.16%，同期业绩比较基准收益率为-1.15%，截至本报告期末浦银安盛鑫福混合 C 的基金份额净值为 0.9878 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.25%，同期业绩比较基准收益率为-1.15%。

#### 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	121,769,302.36	24.77
	其中：股票	121,769,302.36	24.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	230,636,000.00	46.91
	其中：债券	230,636,000.00	46.91
	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	83,782,143.12	17.04
8	其他资产	55,498,852.52	11.29
9	合计	491,686,298.00	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	1,162,560.00	0.24
B	采矿业	4,040,768.00	0.82
C	制造业	72,196,692.97	14.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,549,206.00	0.32
E	建筑业	267,090.00	0.05
F	批发和零售业	701,268.58	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	3,480,003.00	0.71
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,063,735.20	0.62
J	金融业	26,140,895.00	5.32
K	房地产业	3,199,236.00	0.65
L	租赁和商务服务业	3,097,312.00	0.63
M	科学研究和技术服务业	2,863,246.20	0.58
N	水利、环境和公共设施管理业	3,944.29	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	121,769,302.36	24.80

## 5.2.2 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。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

## 5.3.1 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

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	600519	贵州茅台	4,000	7,320,000.00	1.49
2	000858	五粮液	16,900	3,707,691.00	0.75
3	600036	招商银行	70,700	3,566,815.00	0.73
4	300059	东方财富	89,400	3,072,678.00	0.63
5	000333	美的集团	43,700	3,041,520.00	0.62
6	601318	中国平安	61,400	2,969,304.00	0.60
7	002415	海康威视	45,100	2,480,500.00	0.51
8	002142	宁波银行	60,800	2,137,120.00	0.44
9	300122	智飞生物	13,100	2,082,769.00	0.42

10	601166	兴业银行	108,000	1,976,400.00	0.40
----	--------	------	---------	--------------	------

### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	20,016,000.00	4.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,043,000.00	4.08
6	中期票据	171,131,000.00	34.85
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	19,446,000.00	3.96
9	其他	-	-
10	合计	230,636,000.00	46.96

### 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明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	101800429	18 京国资 MTN001	200,000	20,532,000.00	4.18
2	101901703	19 苏国信 MTN005	200,000	20,240,000.00	4.12
3	019649	21 国债 01	200,000	20,016,000.00	4.08
4	102000655	20 中电投 MTN006	200,000	19,898,000.00	4.05
5	102000998	20 华电股 MTN003	200,000	19,890,000.00	4.05

### 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 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明细

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明细

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 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IF2110	沪深 300 期货 2110 合约	-10	-14,598,600.00	80,400.00	-
IF2112	沪深 300 期货 2112 合约	-4	-5,804,880.00	-11,280.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					69,120.00
股指期货投资本期收益 (元)					-41,480.97
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					69,120.00

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与股指期货的投资，管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

## 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 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 本期国债期货投资评价

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体除宁波银行以外不存在被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

宁波银行股份有限公司贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储；开发贷款支用审核不严；房地产贷款放款和支用环节审核不严；贷款资金违规流入房市；房地产贷款资金回流借款人；票据业务开展不审慎。2021年8月6日，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局给予宁波银行股份有限公司公开处罚，罚款人民币 275 万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分。

本基金管理人的研究部门对腾讯控股保持了及时的研究跟踪，投资决策符合本基金管理人的投资流程。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库的范围。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,473,033.45
2	应收证券清算款	50,077,594.04
3	应收股利	-
4	应收利息	2,948,225.03
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,498,852.52

### 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处于转股期的可转换债券。

### 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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银安盛鑫福混合 A	浦银安盛鑫福混合 C
报告期期初基金份额总额	10,001,347.60	115,468,358.29
报告期期间基金总申购份额	220,091,141.18	151,305,432.81
减：报告期期间基金总赎回份额	0.30	10.20
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	230,092,488.48	266,773,780.90

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 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	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	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	2021 年 07 月 14 日-2021 年 09 月 30 日	0.00	119,787,877.91	0.00	119,787,877.91	24.11
	2	2021 年 07 月 01 日-2021 年 09 月 07 日	74,977,506.75	0.00	0.00	74,977,506.75	15.09
	3	2021 年 07 月 01 日-2021 年 07 月 14 日	39,988,003.60	0.00	0.00	39,988,003.60	8.05

#### 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、中国证监会批准浦银安盛鑫福混合型证券投资基金募集的文件
- 2、浦银安盛鑫福混合型证券投资基金基金合同
- 3、浦银安盛鑫福混合型证券投资基金招募说明书
- 4、浦银安盛鑫福混合型证券投资基金托管协议
- 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规定媒介上披露的各项公告
- 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](http://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

2021 年 10 月 26 日