

浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型 证券投资基金 2016 年半年度报告摘要

2016 年 6 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：上海银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示

1.1 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	浦银安盛月月盈定期支付债券	
基金主代码	519128	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 12 月 5 日	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	115,084,518.46 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	浦银安盛月月盈定期支付债券 A	浦银安盛月月盈定期支付债券 C
下属分级基金的交易代码:	519128	519129
报告期末下属分级基金的份额总额	108,293,491.25 份	6,791,027.21 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的前提下，追求超过业绩比较基准的收益水平。
投资策略	本基金一方面按照自上而下的方法对基金的资产配置、久期管理、类属配置进行动态管理，寻找各类资产的潜在良好投资机会，一方面在个券选择上采用自下而上的方法，通过流动性考察和信用分析策略进行筛选。整体投资通过对风险的严格控制，运用多种积极的资产管理增值策略，实现投资目标。
业绩比较基准	中债综合全价指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	浦银安盛基金管理有限公司	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳
	联系电话	021-23212888
	电子邮箱	compliance@py-axa.com
客户服务电话	021-33079999 或 400-8828-999	95594
传真	021-23212985	021-68476936

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	浦银安盛月月盈定期支付债券 A	浦银安盛月月盈定期支付债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016年1月1日-2016年6月30日)	报告期(2016年1月1日-2016年6月30日)
本期已实现收益	8,075,816.84	482,404.32
本期利润	5,043,617.17	292,023.44
加权平均基金份额本期利润	0.0203	0.0182
本期基金份额净值增长率	2.34%	2.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0916	0.0853
期末基金资产净值	118,432,512.02	7,384,045.70
期末基金份额净值	1.094	1.087

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。

4、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

浦银安盛月月盈定期支付债券 A

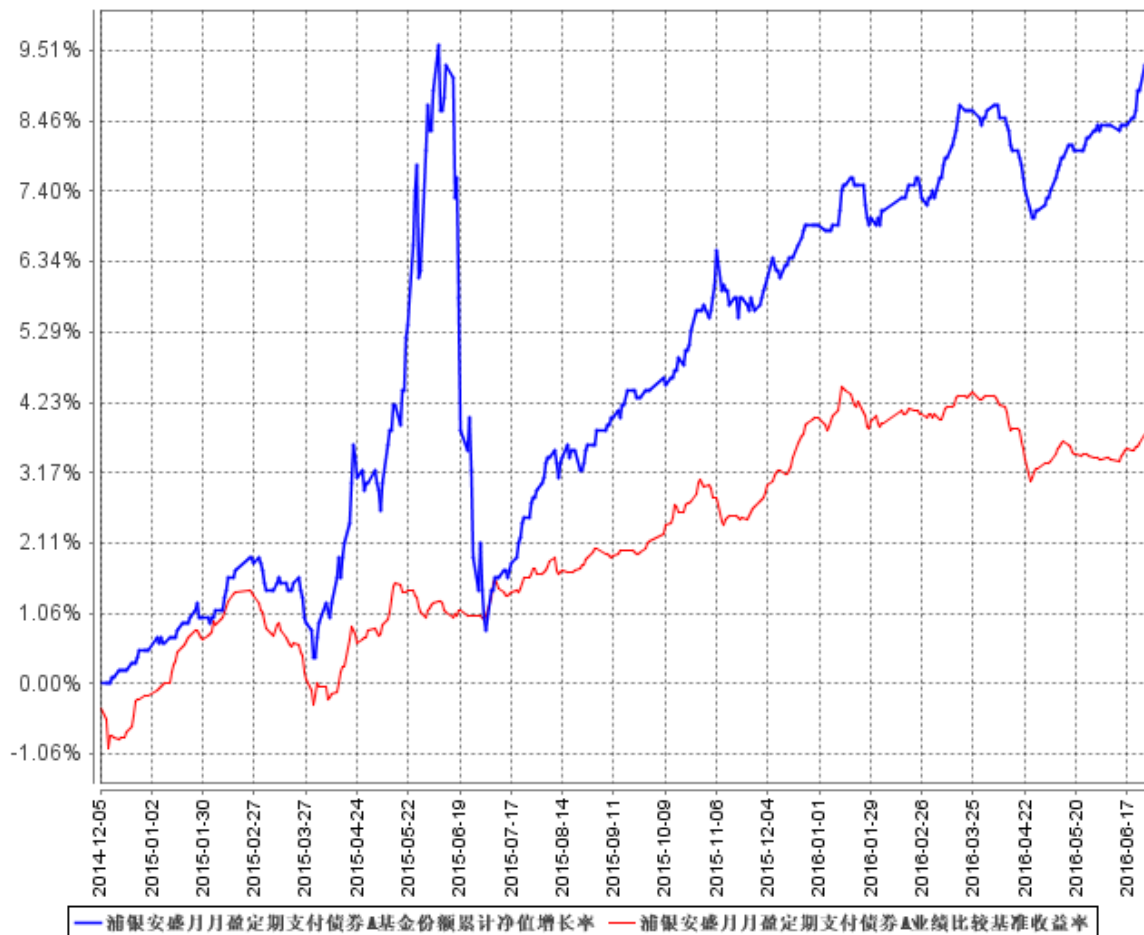
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

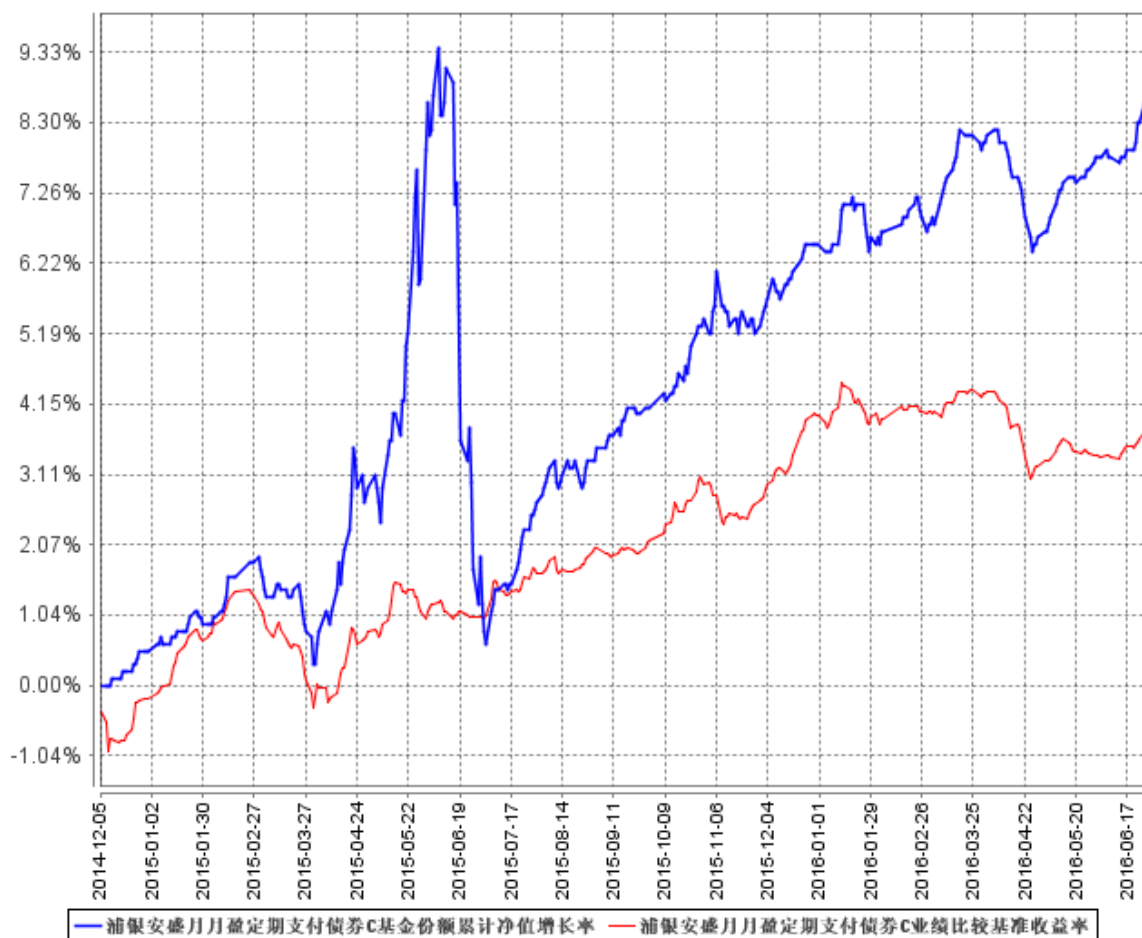
过去一个月	1.02%	0.11%	0.36%	0.04%	0.66%	0.07%
过去三个月	0.83%	0.11%	-0.52%	0.07%	1.35%	0.04%
过去六个月	2.34%	0.11%	-0.21%	0.07%	2.55%	0.04%
过去一年	7.15%	0.14%	2.74%	0.07%	4.41%	0.07%
自基金合同生效起至今	9.40%	0.29%	3.77%	0.09%	5.63%	0.20%

浦银安盛月月盈定期支付债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.83%	0.10%	0.36%	0.04%	0.47%	0.06%
过去三个月	0.65%	0.11%	-0.52%	0.07%	1.17%	0.04%
过去六个月	2.07%	0.11%	-0.21%	0.07%	2.28%	0.04%
过去一年	6.67%	0.13%	2.74%	0.07%	3.93%	0.06%
自基金合同生效起至今	8.70%	0.29%	3.77%	0.09%	4.93%	0.20%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浦银安盛基金管理有限公司（以下简称“浦银安盛”）成立于 2007 年 8 月，股东为上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A. 及上海国盛集团资产有限公司，公司总部设在上海，注册资本为人民币 2.8 亿元，股东持股比例分别为 51%、39%和 10%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理、境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务。

截至 2016 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 21 只基金，即浦银安盛价值成长混合型证券投资基金、浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛红利精选混合型证券投资基金、浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 (LOF)、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金、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

战略新兴产业混合型证券投资基金、浦银安盛 6 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛日日盈货币市场基金、浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金、浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金以及浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金。

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统，这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成，之后日常的维护管理由公司负责，但与第三方服务公司签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户子系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统等。这些系统也主要是在公司筹建之初采购专业系统提供商的产品建设而成，建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级，升级由系统提供商负责完成，升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。业务应用系统日常的维护管理由公司负责，但与系统提供商签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外，我公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

另外，本公司可以根据自身发展战略的需要，委托资质良好的基金服务机构代为办理基金份额登记、估值核算等业务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
薛铮	本公司固定收益投资部总监，公司旗下浦银安盛优化收益债券基	2014 年 2 月 5 日	-	9	薛铮先生，上海财经大学数量经济学硕士。2006 年 3 月至 2009 年 6 月，先后就职于红顶金融研究中心，上海证券有限公司从事固定收益研究工作。2009 年 7 月进入浦银安盛基金管理公司，历任固定收益研究员、固定收益基金经理助理、货币基金基金经理等职务。

	金、浦银安盛幸福回报债券基金、浦银安盛稳健增利债券基金、浦银安盛 6 个月债券基金、浦银安盛季季添利债券基金、浦银安盛月月盈债券基金以及浦银安盛幸福聚利债券基金基金经理				2011 年 12 月起担任浦银安盛稳健增利债券基金（原增利分级债券基金）基金经理。2012 年 9 月起兼任浦银安盛幸福回报债券基金基金经理。2012 年 11 月起，担任本公司固定收益投资部总监。2013 年 5 月起，兼任浦银安盛 6 个月定期开放债券基金基金经理。2013 年 6 月起，兼任浦银安盛季季添利债券基金基金经理。2014 年 7 月起，兼任浦银安盛优化收益债券基金基金经理。2014 年 12 月起，兼任浦银安盛月月盈债券基金基金经理。2016 年 5 月起，兼任浦银安盛幸福聚利债券基金基金经理。
姜锡峰	原固定收益基金经理助理	2015 年 6 月 1 日	2016 年 5 月 6 日	-	姜锡峰先生，上海财经大学企业管理专业硕士。曾就职于湘财证券研究所担任固定收益研究员。2014 年 3 月加盟浦银安盛基金管理有限公司担任固定收益研究员之职。2015 年 6 月起调至固定收益投资部任固定收益基金经理助理。姜锡峰于 2016 年 5 月 6 日离职。
章潇枫	公司旗下固定收益基金经理助理	2016 年 6 月 14 日	-	5	章潇枫先生，上海财经大学数量经济学硕士。2011 年 7 月至 2016 年 6 月就职于湘财证券先后从事金融工程研究岗位、报价回购业务岗位以及高级投资经理岗位。2016 年 6 月 14 日加盟我司固定收益投资部门担任固定收益基金经理助理岗位。

- 注：1、薛铮作为本基金的首任基金经理，其任职日期为本基金成立之日。
- 2、其余的任职日期和离职日期为公司决定的聘任日期和解聘日期。
- 3、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，本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，以及公司的规章制度，本着诚实守信、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。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《公平交易管理规定》，建立健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

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）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。

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% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年债券市场在经济 L 型、货币政策灵活稳定和全球范围避险情绪升温的共同推动下继续牛市格局，多个品种的收益率创下或接近历史低点。回顾 2016 年上半年，1 月股灾 3.0，大量资金涌入债券市场，推动收益率水平持续下行，3 月底达到历史低点。4 月公布的一季度经济数据强劲，叠加信用事件集中发生等因素，债券市场收益率快速上行。5 月债券市场在配置需求的支撑下结束调整，维持震荡格局。6 月经济数据开始疲软，债券市场重新进入牛市节奏，期间英国脱欧黑天鹅发生，全球避险情绪骤升，债券作为避险资产大涨。2016 年上半年，本基金均衡配置信用资质较好的信用债，把握机会进行调仓，提高了组合的安全性和流动性，同时择机进行利率债波段操作，提高组合收益，最终取得了较好的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期 A 类净值增长率为 2.34%，C 类净值增长率为 2.07%，同期业绩比较基准收益率为-0.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年下半年，从基本面看，经济长期 L 型底，工业增速下滑，房地产投资增速不可持续，通胀降温全年在 2 左右；从政策面看，货币政策以灵活、稳健为主，资金利率长期宽松，财政政策受基数较大因素影响且地方政府主动作为动力不强，下半年仍以托底为主，供给侧改革目前重心在煤炭、钢铁，且钢铁行业去产能效果并不理想，稳增长的去产能过程将加剧资产荒；从资金面看，今年以来人民币整体呈贬值趋势，但资金外流情况明显缓解，央行使用降准等强刺激工具的可能性上升；从供需看，下半年银行理财、保险高收益资产到期量大，债券配置需求很大，另一方面地方债、平台债的背后关系尚未完全厘清，企业融资面临比较混乱的情况，企业债、公司债供给持续不及预期；从国际环境看，英国脱欧标志着民粹主义在全球范围内逐渐占据上风，下半年欧洲不确定性很高，全球避险情绪有望进一步发酵。总的来说，各类外部因素有利于下半年债券市场继续走牛，下半年操作的主要思路是维持目前较高的持仓水平，调仓保证组合的安全性和流动性，同时择机进行利率债波段操作。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了浦银安盛基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由公司分管高管、金融工程部负责人、研究部负责人、合规风控部负责人、基金运营部负责人组成。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验、胜任能力和独立性。估值委员会的职责主要包括：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金基金经理未参与或决定基金的估值。

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签订了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

本基金管理人与中证指数有限公司签订了《债券估值数据服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以在每个运作周期结束后，于开放期内进行收益分配，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

- 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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金基金合同》和《浦银安盛月月盈安心养老定期开放债券型证券投资基金托管协议》的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金
报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,080,812.95	264,900.58
结算备付金		9,038,943.17	10,823,989.63
存出保证金		36,105.80	131,677.13

交易性金融资产	6.4.7.2	210,500,175.80	445,557,905.04
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		210,500,175.80	445,557,905.04
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,338,443.34	3,811,339.27
应收利息	6.4.7.5	4,567,187.86	7,793,939.56
应收股利		-	-
应收申购款		696,872.73	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		228,258,541.65	468,383,751.21
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		98,500,000.00	162,499,607.25
应付证券清算款		249,550.69	-
应付赎回款		3,344,615.70	-
应付管理人报酬		110,334.70	181,143.43
应付托管费		31,524.19	51,755.27
应付销售服务费		3,214.75	5,511.79
应付交易费用	6.4.7.7	2,482.50	4,282.42
应交税费		-	-
应付利息		-	20,841.00
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	200,261.40	306,000.00
负债合计		102,441,983.93	163,069,141.16
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	115,084,518.46	285,652,157.17
未分配利润	6.4.7.10	10,732,039.26	19,662,452.88
所有者权益合计		125,816,557.72	305,314,610.05
负债和所有者权益总计		228,258,541.65	468,383,751.21

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.093 元，基金份额总额 115,084,518.46 份。

其中 A 类基金份额参考净值 1.093 元，份额总额 108,293,491.25 份；C 类基金份额参考净值

1.087 元，份额总额 6,791,027.21 份。

6.2 利润表

会计主体：浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		8,246,700.81	7,812,297.26
1.利息收入		9,965,775.71	8,347,306.39
其中：存款利息收入	6.4.7.11	129,962.98	109,322.40
债券利息收入		9,835,812.73	7,879,855.04
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	358,128.95
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,503,340.33	822,195.01
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	5,924,442.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,503,340.33	-5,261,926.33
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	159,678.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-3,222,580.55	-1,357,204.14
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	165.32	-
减：二、费用		2,911,060.20	2,955,880.27
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	993,444.35	1,063,490.05
2. 托管费	6.4.9.2.2	283,841.22	303,854.28
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	30,074.26	32,401.87
4. 交易费用	6.4.7.19	6,410.67	226,263.06
5. 利息支出		1,435,999.55	1,166,735.25
其中：卖出回购金融资产支出		1,435,999.55	1,166,735.25
6. 其他费用	6.4.7.20	161,290.15	163,135.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,335,640.61	4,856,416.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,335,640.61	4,856,416.99

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	285,652,157.17	19,662,452.88	305,314,610.05
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期净利润)	-	5,335,640.61	5,335,640.61
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号 填列)	-170,567,638.71	-14,266,054.23	-184,833,692.94
其中：1.基金申购款	17,672,046.91	1,509,900.30	19,181,947.21
2.基金赎回款	-188,239,685.62	-15,775,954.53	-204,015,640.15
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的基 金净值变动(净值减少 以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	115,084,518.46	10,732,039.26	125,816,557.72
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	300,244,255.12	1,639,442.84	301,883,697.96
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期净利润)	-	4,856,416.99	4,856,416.99
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号 填列)	-5,925,734.92	-241,441.26	-6,167,176.18

其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-5,925,734.92	-241,441.26	-6,167,176.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	294,318,520.20	6,254,418.57	300,572,938.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u> 郁蓓华 </u>	<u> 郁蓓华 </u>	<u> 钱琨 </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]130号文《关于核准浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金募集的批复》批准,由浦银安盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币300,138,824.58元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第722号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金基金合同》于2014年12月5日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为300,244,255.12份,其中认购资金利息折合105,430.54份基金份额。本基金的基金管理人为浦银安盛基金管理有限公司,基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金基金合同》和《浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据认购、申购费用收取方式的不同,基金份额分为不同类别:在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用的为A类基金份额;不收取认购、申购费用,从本类别基金资产中计提销售服务费的为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。

本基金以定期开放方式运作,即本基金以运作周期和自由开放期相结合的方式运作。本基

金以 18 个月为一个运作周期，每个运作周期为自基金合同生效日(包括基金合同生效日)或每个自由开放期结束之日次日起(包括该日)至 18 个月后的对日的前一日止。在每个运作周期结束后进入自由开放期。本基金的每个自由开放期为 5 至 20 个工作日。自由开放期的具体期间由基金管理人在上一个运作周期结束前公告说明。在自由开放期间本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。

本基金按照基金合同的约定，每月定期通过自动赎回基金份额向基金份额持有人支付一定现金，即本基金以约定的定期支付基准日的基金份额净值为基础，按照《浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金招募说明书》约定的年化现金支付比率，计算基金份额持有人当期可获得支付的现金，并自动赎回基金份额持有人所持的对应金额的基金份额，以该自动赎回的资金向基金份额持有人进行现金支付。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购或增发新股。本基金各类资产的投资比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，在每个开放期的前 3 个月和后 3 个月以及开放期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股权的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2016 年 6 月 30 日
活期存款	1,080,812.95
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,080,812.95

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	180,800,173.01	180,953,175.80
	银行间市场	28,487,182.24	29,547,000.00
	合计	209,287,355.25	210,500,175.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	209,287,355.25	210,500,175.80	1,212,820.55

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金在本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,547.24
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,660.75
应收债券利息	4,560,965.20
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	14.67
合计	4,567,187.86

注：此处其他列示的是基金存于上交所与深交所的结算保证金的期末应收利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金在本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	2,482.50
合计	2,482.50

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	200,261.40
合计	200,261.40

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

浦银安盛月月盈定期支付债券 A	
项目	本期

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	268,208,772.62	268,208,772.62
本期申购	16,411,230.15	16,411,230.15
本期赎回(以“-”号填列)	-176,326,511.52	-176,326,511.52
jiJinChaiFHFEZSQRQA 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	108,293,491.25	108,293,491.25

浦银安盛月月盈定期支付债券 C		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	17,443,384.55	17,443,384.55
本期申购	1,260,816.76	1,260,816.76
本期赎回(以“-”号填列)	-11,913,174.10	-11,913,174.10
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	6,791,027.21	6,791,027.21

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

浦银安盛月月盈定期支付债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,538,872.00	3,988,325.10	18,527,197.10
本期利润	8,075,816.84	-3,032,199.67	5,043,617.17
本期基金份额交易产生的变动数	-12,690,311.48	-741,482.02	-13,431,793.50
其中：基金申购款	1,395,125.38	13,306.04	1,408,431.42
基金赎回款	-14,085,436.86	-754,788.06	-14,840,224.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,924,377.36	214,643.41	10,139,020.77

浦银安盛月月盈定期支付债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	876,206.92	259,048.86	1,135,255.78

本期利润	482,404.32	-190,380.88	292,023.44
本期基金份额交易产生的变动数	-779,281.51	-54,979.22	-834,260.73
其中：基金申购款	101,927.97	-459.09	101,468.88
基金赎回款	-881,209.48	-54,520.13	-935,729.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	579,329.73	13,688.76	593,018.49

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	41,062.78
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	88,473.33
其他	426.87
合计	129,962.98

注：此处其他列示的是基金上交所与深交所结算保证金利息以及基金申购款滞留利息。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,503,340.33
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,503,340.33

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	389,555,138.36
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	379,896,375.67
减：应收利息总额	8,155,422.36
买卖债券差价收入	1,503,340.33

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-3,222,580.55
——股票投资	-

——债券投资	-3,222,580.55
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-3,222,580.55

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	165.32
合计	165.32

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	3,045.67
银行间市场交易费用	3,365.00
合计	6,410.67

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	104,426.14
银行汇划费用	8,228.75
债券帐户维护费	18,000.00
其他费用	800.00
合计	161,290.15

注：此处其他费用列示的是上清所费用。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海浦东发展银行股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金代销机构
浦银安盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
上海银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.9.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.9.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.9.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
----	-------------------------	---------------------------------

	30日	
当期发生的基金应支付的管理费	993,444.35	1,063,490.05
其中：支付销售机构的客户维护费	318,664.86	341,339.59

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	283,841.22	303,854.28

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浦银安盛月月盈定期支付债券A	浦银安盛月月盈定期支付债券C	合计
上海银行股份有限公司	-	13,610.04	13,610.04

上海浦东发展银行股份有限公司	-	12,628.71	12,628.71
浦银安盛基金管理有限公司	-	281.35	281.35
合计	-	26,520.10	26,520.10
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浦银安盛月月盈定期支付债券A	浦银安盛月月盈定期支付债券C	合计
上海银行股份有限公司	-	15,181.61	15,181.61
上海浦东发展银行股份有限公司	-	13,267.71	13,267.71
浦银安盛基金管理有限公司	-	281.57	281.57
合计	-	28,730.89	28,730.89

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.35%。

销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.35% 年费率计提。

计算方法如下： $H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中划出，由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人在本报告期与上年度可比期间均未持有本基金。

6.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

6.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海银行股份有限公司	1,080,812.95	41,062.78	4,255,792.25	61,993.09

注：本基金的银行存款由基金托管人上海银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.10 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 98,500,000.00 元，于 2016 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	210,500,175.80	92.22
	其中：债券	210,500,175.80	92.22
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	10,119,756.12	4.43
7	其他各项资产	7,638,609.73	3.35
8	合计	228,258,541.65	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.3 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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	185,569,222.00	147.49
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	21,212,000.00	16.86
7	可转债（可交换债）	3,718,953.80	2.96
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	210,500,175.80	167.31

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	101455027	14 万华 MTN001	200,000	21,212,000.00	16.86
2	112238	15 振业债	189,000	19,136,250.00	15.21
3	122091	11 重机债	160,000	16,046,400.00	12.75
4	124532	14 甘公 01	107,080	12,024,013.20	9.56
5	112244	15 国海债	100,000	10,416,000.00	8.28

7.7 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。

7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金投资范围尚未包含国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金投资范围尚未包含国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金投资范围尚未包含国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	36,105.80
2	应收证券清算款	2,338,443.34
3	应收股利	-
4	应收利息	4,567,187.86
5	应收申购款	696,872.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,638,609.73

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128009	歌尔转债	543,493.80	0.43

7.12.5 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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：本基金为债券型基金，不参与股指期货交易。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
浦银安盛月月盈定期支	845	128,157.98	27,872,276.72	25.74%	80,421,214.53	74.26%

付债券 A						
浦银安盛月月盈定期支付债券 C	145	46,834.67	0.00	0.00%	6,791,027.21	100.00%
合计	990	116,246.99	27,872,276.72	24.22%	87,212,241.74	75.78%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	浦银安盛月月盈定期支付债券 A	0.00	0.00%
	浦银安盛月月盈定期支付债券 C	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	浦银安盛月月盈定期支付债券 A	0
	浦银安盛月月盈定期支付债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	浦银安盛月月盈定期支付债券 A	0
	浦银安盛月月盈定期支付债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银安盛月月盈 定期支付债券 A	浦银安盛月月盈 定期支付债券 C
基金合同生效日（2014 年 12 月 5 日）基金 份额总额	281,931,861.35	18,312,393.77
本报告期期初基金份额总额	268,208,772.62	17,443,384.55
本报告期基金总申购份额	16,411,230.15	1,260,816.76
减：本报告期基金总赎回份额	176,326,511.52	11,913,174.10
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	108,293,491.25	6,791,027.21

注：本基金按照基金合同的约定，每月定期通过自动赎回基金份额向基金份额持有人支付一定现金。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，未有改聘情况发生。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人其高级管理人员未受到有权机关调查、司法纪检部门采取强制措施、被移送司法机关或追究刑事责任、中国证监会稽查、中国证监会行政处罚、证券市场禁入、认定为不适当人选、被其他行政管理部门处罚及证券交易所公开谴责的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：1、证券经营机构交易单元选择的标准和程序：

(1) 选择证券经营机构交易单元的标准

财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格；
具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；
佣金费率合理；
本基金管理人要求的其他条件。

(2) 选择证券经营机构交易单元的程序

本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构；
基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内无租用证券公司交易的单元变动情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	182,175,231.71	63.80%	10,374,700,000.00	86.48%	-	-
招商证券	103,377,078.55	36.20%	1,622,120,000.00	13.52%	-	-

浦银安盛基金管理有限公司
2016年8月29日