

浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券
投资基金
2018 年第 4 季度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 1 月 21 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 1 月 17 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。

自 2018 年 12 月 24 日起，原浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金转型为浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金，原浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金本报告期自 2018 年 10 月 1 日起至 12 月 23 日止，浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金本报告期自 2018 年 12 月 24 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

转型后：

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 浦银安盛盛元定开债券 |
| 基金主代码 | 519322 |
| 交易代码 | 519322 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018 年 12 月 24 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 9,729,009,681.06 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 | 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,实现本基金的投资目标。 |
| 业绩比较基准 | 中证综合债指数收益率。 |

| | | |
|-----------------|--|--------------|
| 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,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 浦银安盛基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 浦银安盛盛元定开债券 A | 浦银安盛盛元定开债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 519322 | 519323 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 9,729,005,527.30 份 | 4,153.76 份 |

转型前:

| | | |
|-----------------|--|--------------|
| 基金简称 | 浦银安盛盛元纯债债券 | |
| 基金主代码 | 519322 | |
| 交易代码 | 519322 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 7 月 22 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 4,941,624,545.35 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 | 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,一方面在个股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,实现本基金的投资目标。 | |
| 业绩比较基准 | 中证综合债指数收益率。 | |
| 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,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 浦银安盛基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 浦银安盛盛元纯债债券 A | 浦银安盛盛元纯债债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 519322 | 519323 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 4,941,620,391.59 份 | 4,153.76 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2018年12月24日—2018年12月31日） | |
|-----------------|------------------------------|--------------|
| | 浦银安盛盛元定开债券 A | 浦银安盛盛元定开债券 C |
| 1. 本期已实现收益 | 8,422,410.05 | 3.51 |
| 2. 本期利润 | 22,177,896.23 | 9.54 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0027 | 0.0023 |
| 4. 期末基金资产净值 | 10,202,757,236.35 | 4,354.70 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0487 | 1.0484 |

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。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2018年10月1日—2018年12月23日） | |
|-----------------|-----------------------------|--------------|
| | 浦银安盛盛元纯债债券 A | 浦银安盛盛元纯债债券 C |
| 1. 本期已实现收益 | 61,860,738.60 | 3,694.75 |
| 2. 本期利润 | 106,883,425.51 | 8,985.22 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0216 | 0.0242 |
| 4. 期末基金资产净值 | 5,170,579,840.12 | 4,345.16 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0463 | 1.0461 |

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（转型后）

3.2.1 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

浦银安盛盛元定开债券 A

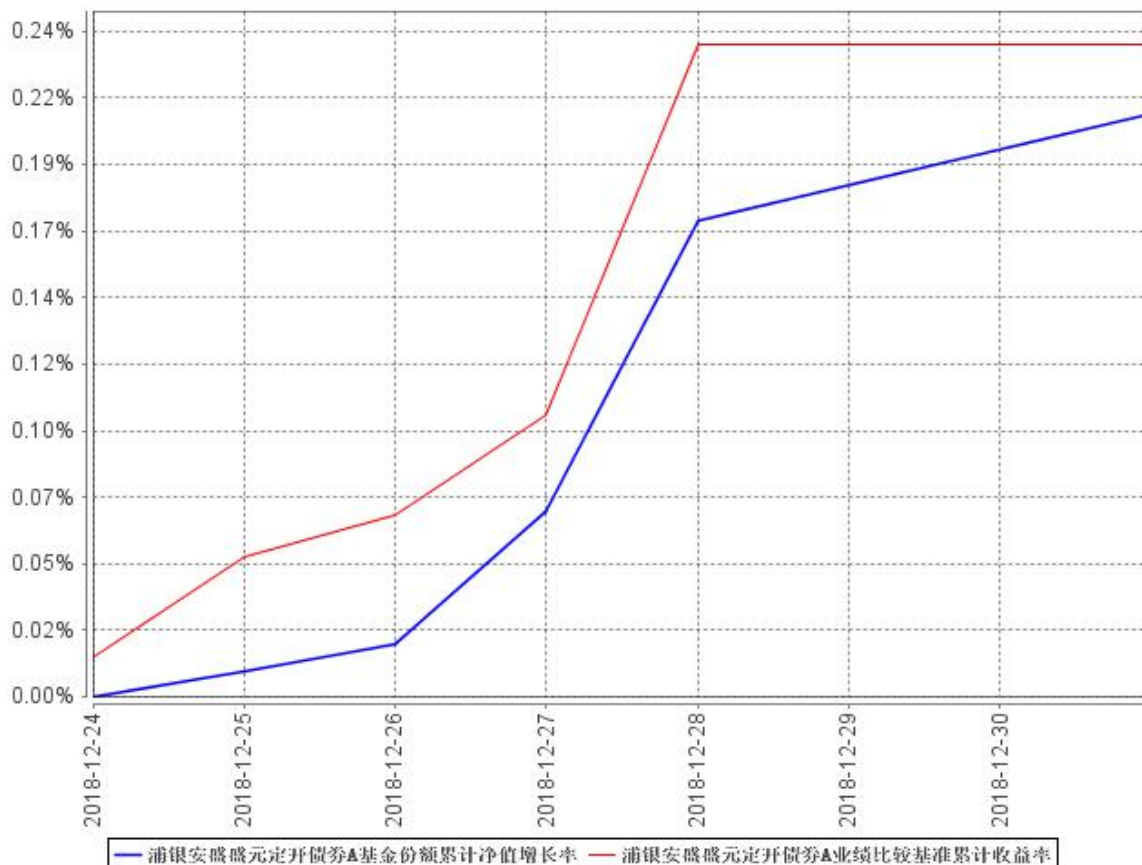
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基准收 益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|--------|---------------|----------------|-------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.21% | 0.04% | 0.24% | 0.05% | -0.03% | -0.01% |

浦银安盛盛元定开债券 C

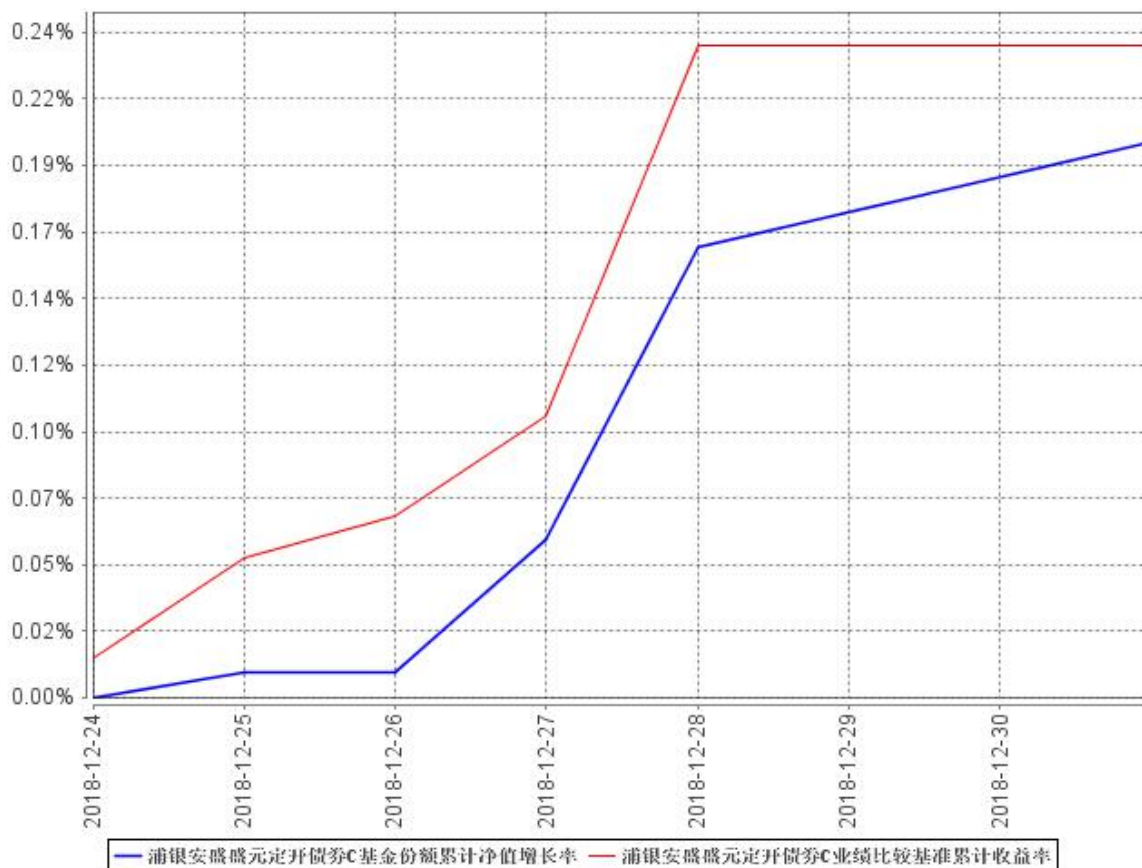
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.20% | 0.04% | 0.24% | 0.05% | -0.04% | -0.01% |

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

浦银安盛盛元定开债券A基金份额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



浦银安盛盛元定开债券C基金份额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



3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 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

浦银安盛盛元纯债债券 A

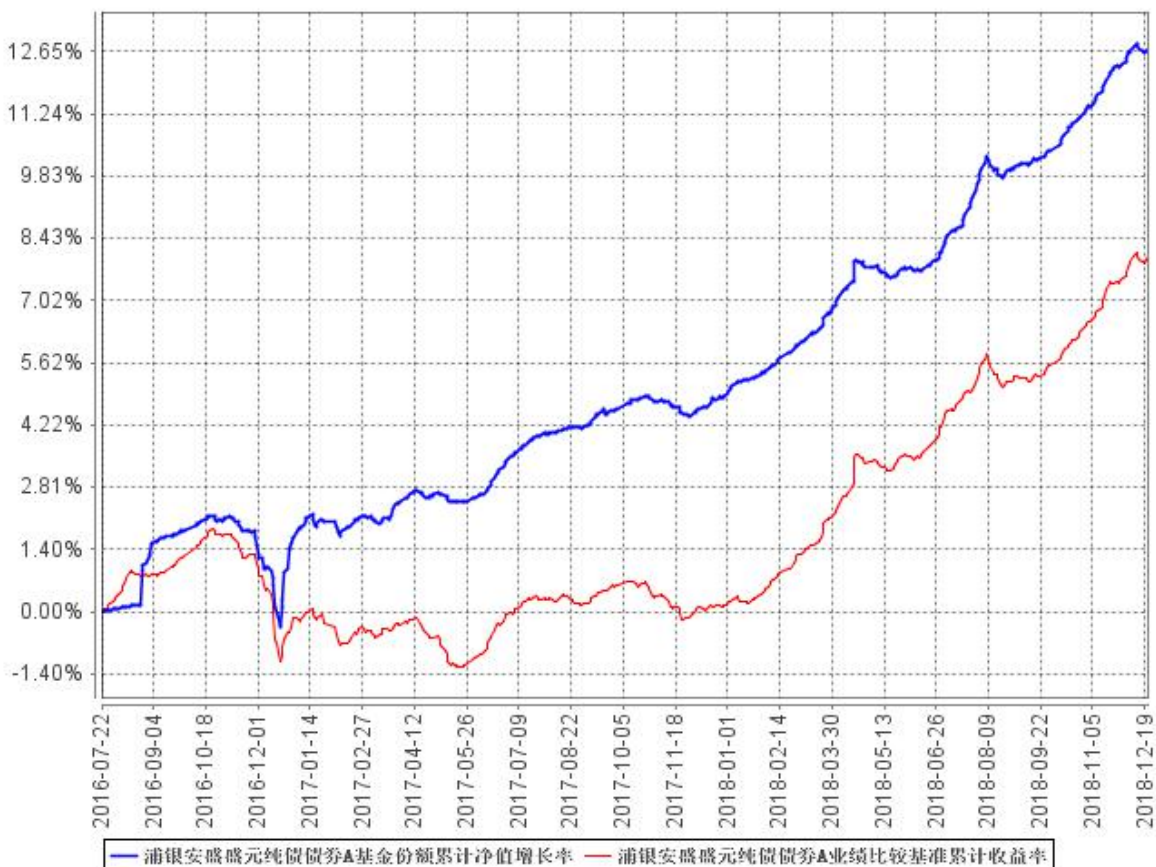
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 2.09% | 0.04% | 2.33% | 0.05% | -0.24% | -0.01% |

浦银安盛盛元纯债债券 C

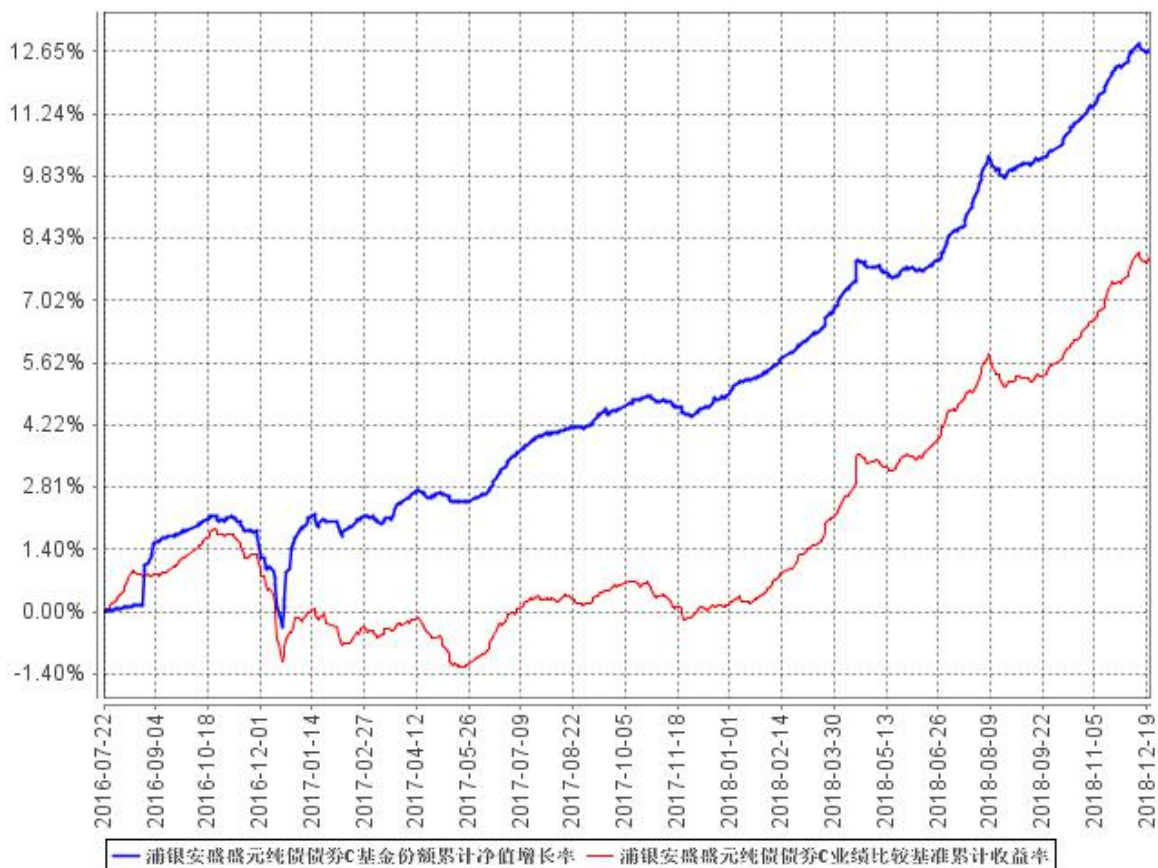
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 2.09% | 0.04% | 2.33% | 0.05% | -0.24% | -0.01% |

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

浦银安盛盛元纯债债券A基金份额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



浦银安盛盛元纯债债券C基金份额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



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

| 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 | | |
| 章潇枫 | 公司旗下浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安 | 2017年6月8日 | - | 7 | 章潇枫先生，复旦大学数学与应用数学专业本科学历。加盟浦银安盛基金前，曾任职于湘财证券股份有限公司，历任金融工程研究员、报价回购岗以及自营债券投资岗。2016年6月加盟 |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | <p>盛盛达纯债债券型证券投资基金、浦银安盛幸福聚益 18 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 (LOF)、浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金以及浦银安盛普益纯债债券型证券投资基金基金经理。</p> | | | <p>浦银安盛基金公司，在固定收益投资部担任基金经理助理岗位。2017 年 5 月起担任公司旗下浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金、浦银安盛幸福聚益 18 个月定期开放债券型证券投资基金及浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2017 年 6 月至 2018 年 7 月担任公司旗下浦银安盛优化收益债券型基金及浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月起担任公司旗下浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金及浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月起兼任浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起担任公司旗下浦银安盛普益纯债债券型证券投资基金基金经理。</p> |
|--|--|--|--|---|

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。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

| 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 | | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|-----|--|----------------|---|---|---|
| 章潇枫 | <p>公司旗下浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金、浦银安盛幸福聚益 18 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 (LOF)、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金以及浦银安盛普益纯债债券型证券投资基金基金经理。</p> | 2017 年 6 月 8 日 | - | 7 | <p>章潇枫先生，复旦大学数学与应用数学专业本科学历。加盟浦银安盛基金前，曾任职于湘财证券股份有限公司，历任金融工程研究员、报价回购岗以及自营债券投资岗。2016 年 6 月加盟浦银安盛基金公司，在固定收益投资部担任基金经理助理岗位。2017 年 5 月起担任公司旗下浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金、浦银安盛幸福聚益 18 个月定期开放债券型证券投资基金及浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2017 年 6 月至 2018 年 7 月担任公司旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金及浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月起担任公司旗下浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金及浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月起兼任浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起担任公司旗下浦银安盛普益纯</p> |
|-----|--|----------------|---|---|---|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|-----------------|
| | | | | | 债债券型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|-----------------|

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，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 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度，土地市场进一步趋冷，经济数据加速下滑，债市整体走牛。流动性方面，央行继续维持流动性合理充裕，先后实施了降准、定向降息、TMLF 等宽松政策，资金面持续宽松。海外方面，随着欧央行确定年底结束 QE，美联储 12 月如期加息且继续缩表，美欧日股票市场大幅下挫，主要发达国家国债收益率大幅下行，十年日债跌至负区间，美债长短倒挂，初现衰退苗头。十年期美债收益率跌至 2.70%，中美利差走扩至 50bp。

报告期内，本基金增持高等级信用债，提高杠杆水平，拉长组合久期，取得了较好的资本利得和稳定的票息收入。未来，本基金将继续秉承稳健专业的投资理念，谨慎操作、严格风控，力争为基金份额持有人带来长期稳定回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期转型前 A 类基金的净值增长率为 2.09%，C 类基金的净值增长率为 2.09%，业绩比较基准收益率为 2.33%；转型后 A 类基金的净值增长率为 0.21%，C 类基金的净值增长率为 0.20%，业绩比较基准收益率为 0.24%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

- 1、本基金转型过渡期出现人数连续 20 工作日小于 200 人的情形，转型后人数符合法律规定。
- 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

转型后：

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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 8,821,328,180.00 | 80.80 |
| | 其中：债券 | 8,821,328,180.00 | 80.80 |
| | 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 | 1,884,972,187.46 | 17.27 |
| | 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 | 30,891,032.93 | 0.28 |
| 8 | 其他资产 | 179,623,884.85 | 1.65 |
| 9 | 合计 | 10,916,815,285.24 | 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

注：本期末本基金未持有境内股票。

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 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。

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 2,067,650,000.00 | 20.27 |
| | 其中：政策性金融债 | 1,381,817,000.00 | 13.54 |
| 4 | 企业债券 | 3,127,867,680.00 | 30.66 |
| 5 | 企业短期融资券 | 1,143,999,000.00 | 11.21 |
| 6 | 中期票据 | 2,481,811,500.00 | 24.32 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 8,821,328,180.00 | 86.46 |

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 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|------------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 180019 | 18 付息国债 19 | 6,500,000 | 666,965,000.00 | 6.54 |
| 2 | 1880004 | 18 铁道 01 | 4,000,000 | 422,680,000.00 | 4.14 |
| 3 | 1828019 | 18 平安银行 01 | 3,500,000 | 350,280,000.00 | 3.43 |

| | | | | | |
|---|-----------|-------------------|-----------|----------------|------|
| 4 | 101800625 | 18 汇金 MTN006BC | 2,000,000 | 204,720,000.00 | 2.01 |
| 5 | 101800624 | 18 汇金 MTN005BC | 2,000,000 | 203,340,000.00 | 1.99 |

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

本基金本报告期末未持有股票，故不存在本基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 13,133.32 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |

| | | |
|---|-------|----------------|
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 179,610,751.53 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 179,623,884.85 |

5.10.4 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。

5.10.5 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的股票。

转型前：

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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 6,715,047,060.00 | 97.53 |
| | 其中：债券 | 6,715,047,060.00 | 97.53 |
| | 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 | 13,332,922.34 | 0.19 |
| 8 | 其他资产 | 156,745,257.38 | 2.28 |
| 9 | 合计 | 6,885,125,239.72 | 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

注：本期末本基金未持有境内股票。

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 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。

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 706,577,000.00 | 13.67 |
| | 其中：政策性金融债 | 491,542,000.00 | 9.51 |
| 4 | 企业债券 | 2,976,923,560.00 | 57.57 |
| 5 | 企业短期融资券 | 603,047,000.00 | 11.66 |
| 6 | 中期票据 | 2,428,499,500.00 | 46.97 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 6,715,047,060.00 | 129.87 |

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 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-------------------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 1880004 | 18 铁道 01 | 4,000,000 | 422,400,000.00 | 8.17 |
| 2 | 101800625 | 18 汇金 MTN006BC | 2,000,000 | 204,420,000.00 | 3.95 |
| 3 | 101800624 | 18 汇金 MTN005BC | 2,000,000 | 203,220,000.00 | 3.93 |
| 4 | 101800961 | 18 北大荒 MTN001 | 2,000,000 | 202,200,000.00 | 3.91 |
| 5 | 160208 | 16 国开 08 | 2,000,000 | 199,920,000.00 | 3.87 |

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

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

注：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

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内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

本基金本报告期末未持有股票，故不存在本基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|----------------|
| 1 | 存出保证金 | 13,133.32 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 156,732,124.06 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |

| | | |
|---|----|----------------|
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 156,745,257.38 |

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的股票。

§ 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

| 项目 | 浦银安盛盛元定开债券 A | 浦银安盛盛元定开债券 C |
|--|------------------|--------------|
| 基金合同生效日（2018 年 12 月 24 日） 基金份额总额 | 4,941,620,391.59 | 4,153.76 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总 申购份额 | 4,787,385,135.71 | - |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金 总赎回份额 | - | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆 分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 9,729,005,527.30 | 4,153.76 |

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

| 项目 | 浦银安盛盛元纯债债券 A | 浦银安盛盛元纯债债券 C |
|----------------|------------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 4,941,903,245.55 | 520,191.80 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 197.22 | 966.79 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 283,051.18 | 517,004.83 |

| | | |
|---------------------------|------------------|----------|
| 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 | 4,941,620,391.59 | 4,153.76 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

单位：份

| | |
|-------------------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 0.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 9,554,748.71 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 9,554,748.71 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总额比例（%） | 0.10 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率 |
|-----------|------|-------------|--------------|---------------|------|
| 1 | 申购 | 2018年12月26日 | 9,554,748.71 | 10,000,500.00 | - |
| 合计 | | | 9,554,748.71 | 10,000,500.00 | |

注：1、截至本报告期末，本基金管理人持有浦银盛元 A 9,554,748.71 份。

2、基金管理人固有资金投资本基金费用按照本基金法律文件约定收取，申购超过 1000 万，申购费 500 元/笔。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

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（转型前）

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 | 2018 年 10 月 1 日-2018 年 12 月 31 日 | 4,941,570,422.63 | 4,777,830,387.00 | 0.00 | 9,719,400,809.63 | 99.90% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 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。 | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2018 年 11 月 17 日至 2018 年 12 月 16 日,基金管理人以通讯方式召开了基金份额持有人大会,并审议通过了《关于浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金转型有关事项的议案》,详见本基金管理人于 2018 年 11 月 14 日发布的《关于浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告》及其后续公告。

§ 9 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集的文件
- 2、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同
- 3、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书
- 4、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式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指定报刊上披露的各项公告
- 8、中国证监会要求的其他文件

10.2 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。

10.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站 (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
2019 年 1 月 21 日