

浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资  
基金  
2019 年第 1 季度报告

2019 年 3 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：上海银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 4 月 19 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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 4 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。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

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	契约型定期开放式	
基金合同生效日	2014 年 12 月 5 日	
报告期末基金份额总额	50,593,114.64 份	
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。	
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	
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	40,274,202.54 份	10,318,912.10 份

注：自 2018 年 6 月 8 日起，本基金的基金名称变更为“浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金”，具体内容详见基金管理人于 2018 年 6 月 8 日发布的《关于变更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名称的公告》。

### §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（2019 年 1 月 1 日 — 2019 年 3 月 31 日）	
	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
1. 本期已实现收益	442,086.91	101,294.04
2. 本期利润	1,015,732.34	246,129.96
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0251	0.0237
4. 期末基金资产净值	47,041,896.62	11,867,022.07
5. 期末基金份额净值	1.168	1.150

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 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

浦银安盛月月盈定期支付债券 A

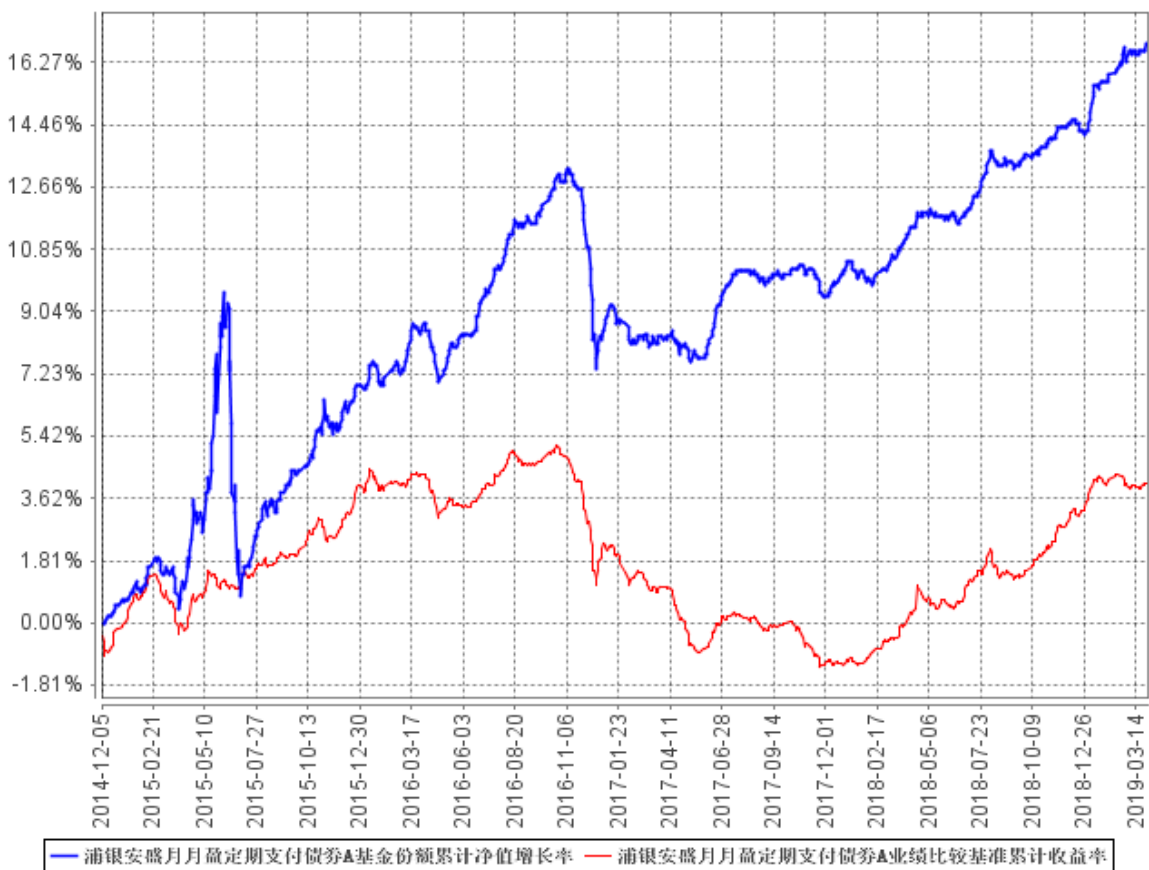
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.19%	0.09%	0.47%	0.05%	1.72%	0.04%

浦银安盛月月盈定期支付债券 C

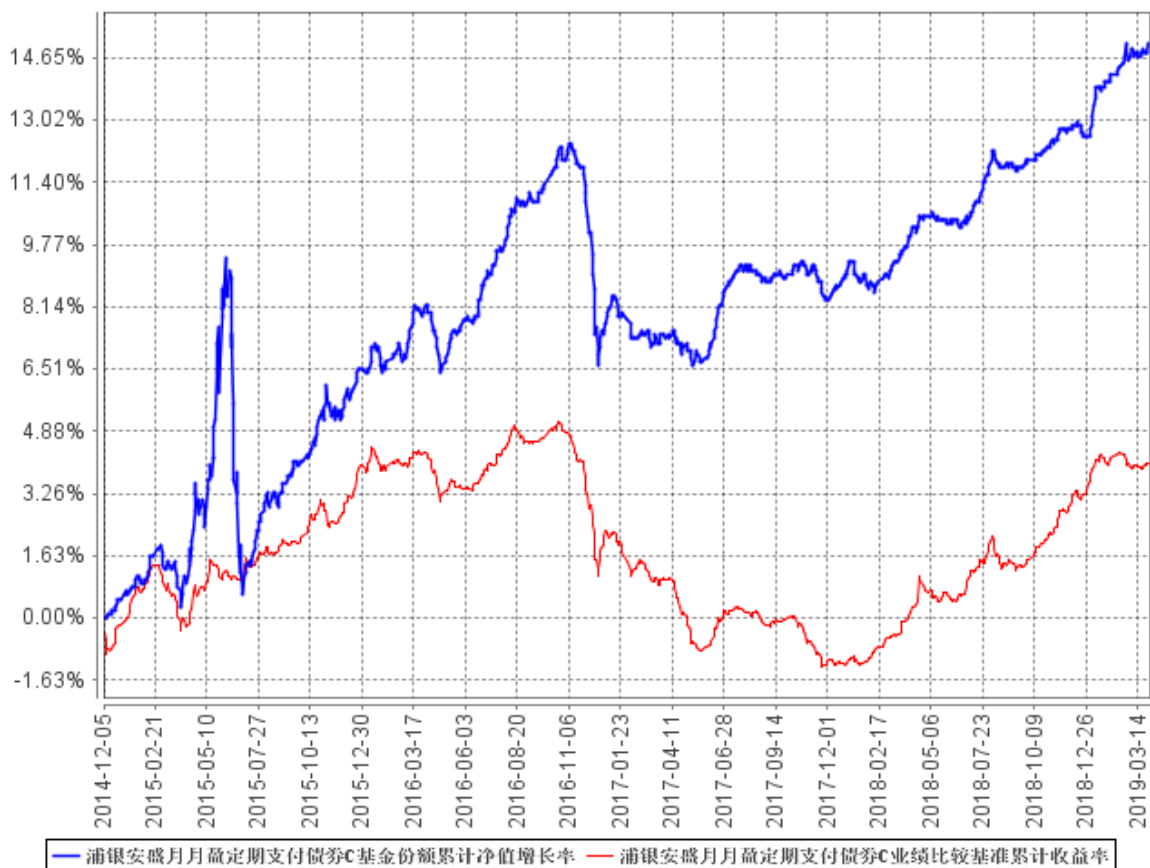
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.13%	0.09%	0.47%	0.05%	1.66%	0.04%

### 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

浦银安盛月月盈定期支付债券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



浦银安盛月月盈定期支付债券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

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		
刘大巍	公司旗下浦银安盛 6 个月定期开放债券型证券投资基金、浦	2017 年 4 月 17 日	-	9	刘大巍先生，上海财经大学经济学博士。加盟浦银安盛基金前，曾在万家基金、泰信基金工作，先后从事固定收益研究、基金经理助理、债券投资经理等工作。2014 年 4 月加盟浦银安盛基金公司，从事固定收益专户产品的投资

	<p>银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金、浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金、浦银安盛日日盈货币市场基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基</p>			<p>工作。2016 年 8 月转岗至固定收益投资部，担任公司旗下浦银安盛 6 个月定期开放债券型证券投资基金以及浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月至 2018 年 7 月担任浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2017 年 4 月起，担任公司旗下浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金及浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月起，担任浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 11 月起，担任浦银安盛日日盈货币市场基金及浦银安盛日日丰货币市场基金基金经理。2017 年 12 月起，担任浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2018 年 12 月起，担任浦银安盛盛融定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 3 月起，担任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金以及浦银安盛中短债债券型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--

	金、浦银安盛盛融定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛中短债债券型证券投资基金、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金以及浦银安盛盛勤纯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遵规守信情况的说明

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

18 年底，我们判断年末资金面的紧张仅为暂时现象，19 年 1 季度银行间市场仍然会保持宽松的流动性，因此在 18 年底本组合大幅增加了债券仓位和久期，同时增加了部分可转债仓位，使得春节前本组合充分把握了宽松流动性下股债双牛的市场行情，净值稳定增长；春节后资金面波动有所加大，通胀预期升温，股票市场的持续上涨带来的风险偏好回升开始对债券市场形成影响，在此背景下，我们判断债券市场将会开始进入震荡调整行情，权益类资产的机会成本会显著下降，因此开始降低债券仓位和久期，增加可转债的配置，整个 3 月保证了组合净值的稳步上升。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛月月盈定期支付债券 A 基金份额净值为 1.168 元，本报告期基金份



额净值增长率为 2.19%；截至本报告期末浦银安盛月月盈定期支付债券 C 基金份额净值为 1.150 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.13%；同期业绩比较基准收益率为 0.47%。

#### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	76,470,317.50	95.48
	其中：债券	76,470,317.50	95.48
	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	847,582.74	1.06
8	其他资产	2,769,290.77	3.46
9	合计	80,087,191.01	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：本基金本报告期末未持有股票。

#### 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	5,403,552.00	9.17
	其中：政策性金融债	5,403,552.00	9.17
4	企业债券	68,663,126.60	116.56
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,403,638.90	4.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	76,470,317.50	129.81

**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	018006	国开 1702	52,800	5,403,552.00	9.17
2	127900	18 铁道 17	50,000	5,171,000.00	8.78
3	122367	14 财富债	50,100	5,117,214.00	8.69
4	143187	17 洪政 01	50,000	5,074,000.00	8.61
5	143079	17 信投 G1	50,000	5,063,000.00	8.59

**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：本基金投资范围尚未包含国债期货。

### 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：本基金投资范围尚未包含国债期货。

### 5.9.3 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。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除财富证券、中信证券、国信证券和海通证券以外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。

2019 年 3 月 19 日，财富证券因公司北京市朝阳区东三环中路证券营业部在 2016 年 8 月至 2018 年 6 月间，存在多起同一证券经纪人名下不同客户同日同一 IP 和 MAC 地址委托的异常交易，多次触及预警，涉及客户 30 人次，营业部未采取有效措施进行调查处理，未对证券经纪人实施有效监控。根据相关法律法规，中国证监会北京监管局决定对公司北京市朝阳区东三环中路证券营业部采取责令改正的行政监管措施。

2018 年 11 月 5 日，中信证券就公司融资融券业务开展过程中，与司度（上海）贸易有限公司的相关业务或涉嫌违反相关规定，公司收到中国证监会结案通知书（结案字[2018]18 号），其中提及，经审理，中国证监会认为公司的涉案违法事实不成立，决定该案结案。

2018 年 1 月 30 日，国信证券股份有限公司收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》（成稽调查通字[18001]号）。因公司保荐业务及财务顾问业务涉嫌违反证券法律法规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司立案调查。2018 年 5 月 21 日，公司及从事相关业务的人员龙飞虎、王晓娟、张苗、曹仲原收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2018]45 号）。2018 年 6 月 21 日，公司收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2018]46

号)。2018 年 11 月 5 日，国信证券收到中国证监会《结案通知书》(结案字[2018]19 号)，经审理，中国证监会认为，公司及公司相关人员因司度(上海)贸易有限公司及相关中介机构涉嫌违法违规案涉案违法事实不成立，中国证监会决定本案结案。

2018 年 11 月 5 日，海通证券收到中国证监会下发的《结案通知书》(结案字[2018]20 号)，经审理，中国证监会认为，公司及公司相关员工因司度(上海)贸易有限公司及相关中介机构涉嫌违法违规案涉案违法事实不成立，决定本案结案。

本基金管理人的研究部门对财富证券、中信证券、国信证券和海通证券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。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中不存在超出基金合同规定的备选股票库范围的情况。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,418.43
2	应收证券清算款	1,098,115.54
3	应收股利	-
4	应收利息	1,663,756.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,769,290.77

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113013	国君转债	473,640.00	0.80
2	110042	航电转债	455,285.00	0.77
3	110041	蒙电转债	443,600.00	0.75
4	110040	生益转债	362,070.00	0.61
5	110033	国贸转债	344,820.00	0.59
6	113019	玲珑转债	324,223.90	0.55

### 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：本基金本报告期末未持有股票。

## §6 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
报告期期初基金份额总额	40,756,463.15	10,441,436.30
报告期期间基金总申购份额	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	482,260.61	122,524.20
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	40,274,202.54	10,318,912.10

## §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

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集的文件

- 2、 浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金基金合同
- 3、 浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金招募说明书
- 4、 浦银安盛月月盈定期支付债券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

## 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

2019 年 4 月 19 日