

浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资  
基金  
2019 年第 2 季度报告

2019 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

报告送出日期：2019 年 7 月 16 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 7 月 12 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 4 月 1 日起至 6 月 30 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	49,995,557.27 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	39,797,705.84 份	10,197,851.43 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 4 月 1 日 — 2019 年 6 月 30 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	523,347.65	121,682.23
2. 本期利润	287,379.41	62,148.49
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0072	0.0061
4. 期末基金资产净值	46,772,729.86	11,789,991.47
5. 期末基金份额净值	1.175	1.156

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

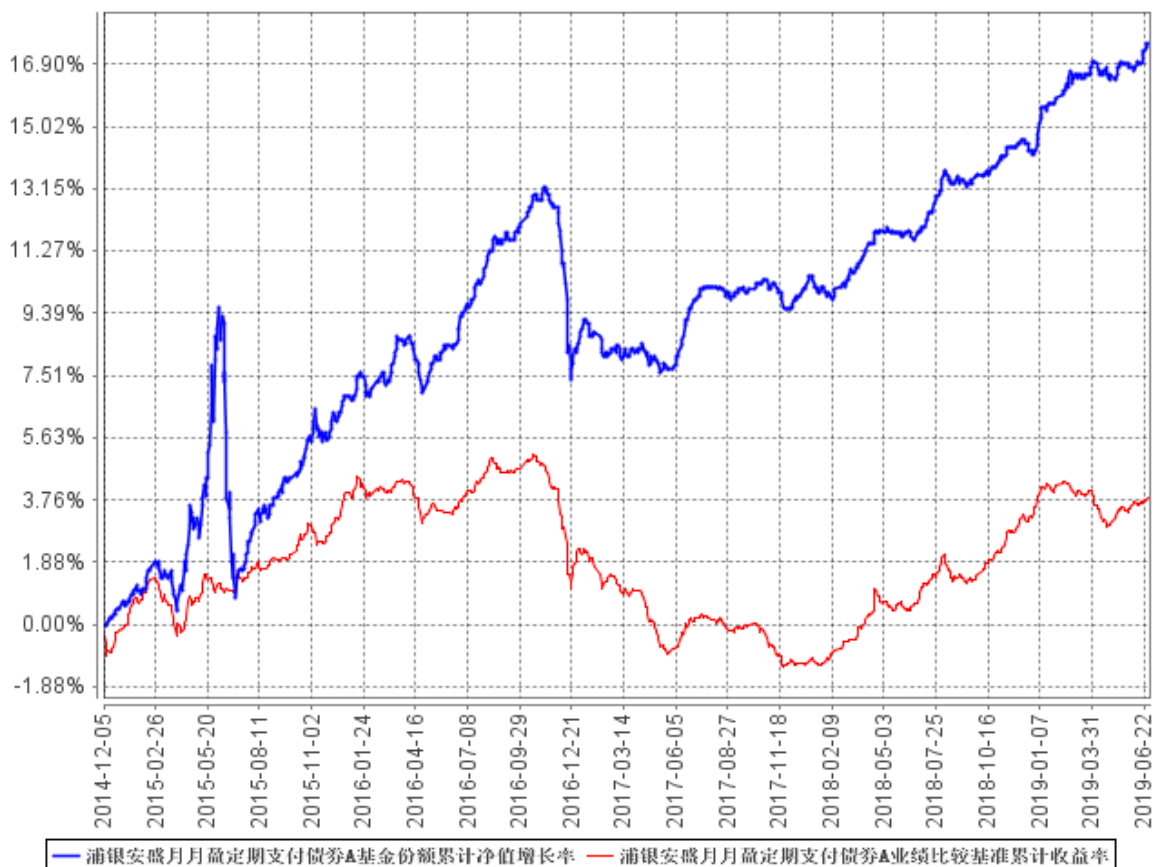
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.60%	0.08%	-0.24%	0.06%	0.84%	0.02%

浦银安盛月月盈定期支付债券 C

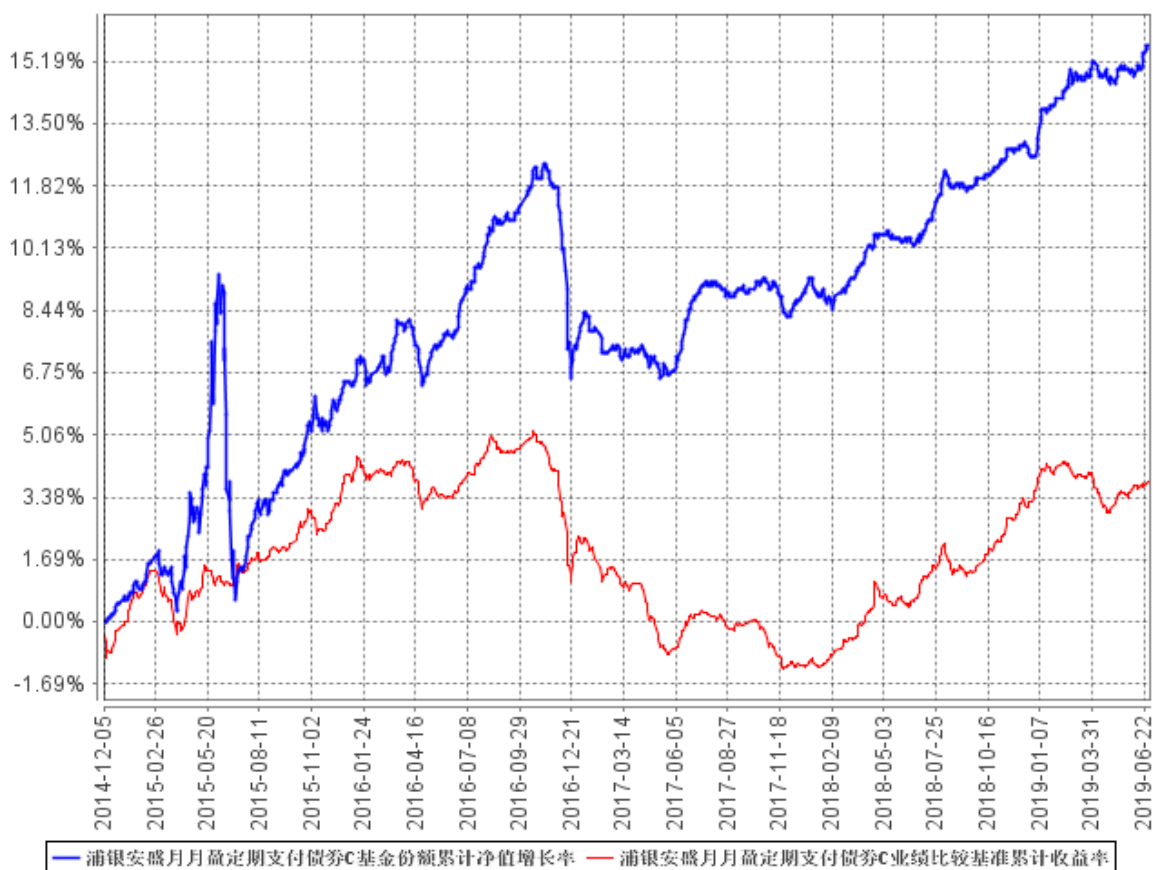
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.52%	0.08%	-0.24%	0.06%	0.76%	0.02%

### 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

	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>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 3 个月定期开放债券型发起式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。2019 年 5 月起，担任浦银安盛双债增强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、浦银安盛盛勤 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金以及浦银安盛双债增强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

二季度债券市场先抑后扬，季度初在一季度超预期信用扩张和经济数据冲击下，收益率曲线整体上移，随后在中美贸易摩擦加剧、二季度基本面经济数据下滑以及银行间市场资金利率显著下行的影响下，收益率曲线震荡下行，截至 6 月底，国债 10 年估值较二季度收益率高点下行



14BP，国债 1 年估值下行 3BP，国开 10 年估值下行 19BP，国开 1 年估值下行 13.7BP，曲线整体陡峭化，可转债整个二季度呈现震荡走势。

4 月开始本组合保持了中性仓位，适当降低了久期水平，同时降低了可转债仓位，保证组合净值的平稳增长，5 月开始逐步增加组合久期，并增加了部分可转债仓位，在整个二季度保证了较好的组合回报率。

#### 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 1.175 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.60%；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 1.156 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.52%；同期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	70,532,007.40	95.84
	其中：债券	70,532,007.40	95.84
	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	399,629.48	0.54
8	其他资产	2,663,132.03	3.62
9	合计	73,594,768.91	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	4,059,400.00	6.93
	其中：政策性金融债	4,059,400.00	6.93
4	企业债券	53,804,973.70	91.88
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	9,013,500.00	15.39
7	可转债（可交换债）	3,654,133.70	6.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	70,532,007.40	120.44

## 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	127900	18 铁道 17	49,980	5,141,942.40	8.78
2	143187	17 洪政 01	50,000	5,066,500.00	8.65
3	143079	17 信投 G1	50,000	5,050,000.00	8.62
4	101900113	19 中油股 MTN001	50,000	5,003,500.00	8.54
5	143464	18 海通 04	45,000	4,543,650.00	7.76

## 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华泰证券、中信证券、国信证券和中银国际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。

2018 年 12 月 6 日，华泰证券公告作为“某发行人 2018 年度第五期非公开定向债务融资工具”牵头主承销商，项目发行过程中，公司及相关工作人员存在违反银行间市场相关自律管理规则的行为，扰乱市场秩序；同时，华泰证券在债务融资工具项目管理、内部审批、质量控制等方面存在缺陷，内部控制机制运行不良。依据相关自律规定，经 2018 年第 11 次自律处分会议审议，给予华泰证券警告处分，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改；给予直接责任人刘强严重警告处分，并认定为非金融企业债务融资工具市场不适当人选，期限为三年；给予次要责任人薛韬警告处分，并认定为非金融企业债务融资工具市场不适当人选，期限为一年。

年。

2019 年 1 月 16 日，中信证券公告公司收到中信证券关于收到上海证券交易所问询函。

2018 年 12 月 7 日，国信证券公告因作为邹平电力购售电合同债权资产支持专项计划管理人，尽调过程中未勤勉尽责，出具资产支持专项计划说明书存在虚假记载，未及时监督、检查原始权益人持续经营情况和基础资产现金流情况，未及时就重大事项履行信息披露和报告义务，深交所出具《监管函》（深证函[2018]714 号），对公司采取书面警示的监管措施。

2018 年 11 月 15 日，国信证券公告，根据《证券公司监督管理条例》（国务院令 522 号）第七十条有关规定，深圳证监局对国信证券采取责令改正的行政监管措施。

2018 年 6 月 22 日，国信证券公告，依据《证券法》第一百九十二条、第二百二十三条的规定，中国证监会决定：一、对于国信证券保荐业务行为，责令其改正，给予警告，没收保荐业务收入 100 万元，并处以 300 万元罚款；对龙飞虎、王晓娟给予警告，并分别处以 30 万元罚款。二、对于国信证券并购重组财务顾问业务行为，责令其改正，没收并购重组财务顾问业务收入 600 万元，并处以 1,800 万元罚款；对张苗、曹仲原给予警告，并分别处以 10 万元罚款。

2019 年 3 月 18 日，中银国际证券因销售投资产品违规，受到香港证监会谴责及罚款 1000 万港元。

本基金管理人的研究部门对华泰证券、中信证券、国信证券和中银国际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

注：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	5,519.75
2	应收证券清算款	1,600,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	1,057,612.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,663,132.03

**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	110041	蒙电转债	782,250.00	1.34
2	110033	国贸转债	334,350.00	0.57
3	110040	生益转债	267,390.30	0.46
4	110042	航电转债	796,670.00	1.36
5	113019	玲珑转债	313,432.70	0.54
6	128046	利尔转债	305,441.78	0.52
7	113013	国君转债	452,960.00	0.77

**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	40,274,202.54	10,318,912.10
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	476,496.70	121,060.67
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	39,797,705.84	10,197,851.43

**§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 7 月 16 日