

浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资
基金
2019 年第 4 季度报告

2019 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：上海银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 1 月 20 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 2020 年 1 月 16 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛季季添利债券	
基金主代码	519123	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 6 月 14 日	
报告期末基金份额总额	39,581,619.66 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	同期中国人民银行公布的三个月定期存款基准利率（税后）*1.1	
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	上海银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛季季添利债券 A	浦银安盛季季添利债券 C
下属分级基金的交易代码	519123	519124
报告期末下属分级基金的份额总额	36,426,650.84 份	3,154,968.82 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（2019年10月1日—2019年12月31日）	
	浦银安盛季季添利债券 A	浦银安盛季季添利债券 C
1. 本期已实现收益	278,827.57	19,731.59
2. 本期利润	352,444.54	26,010.27
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0096	0.0082
4. 期末基金资产净值	50,200,037.36	4,249,668.23
5. 期末基金份额净值	1.378	1.347

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

浦银安盛季季添利债券 A

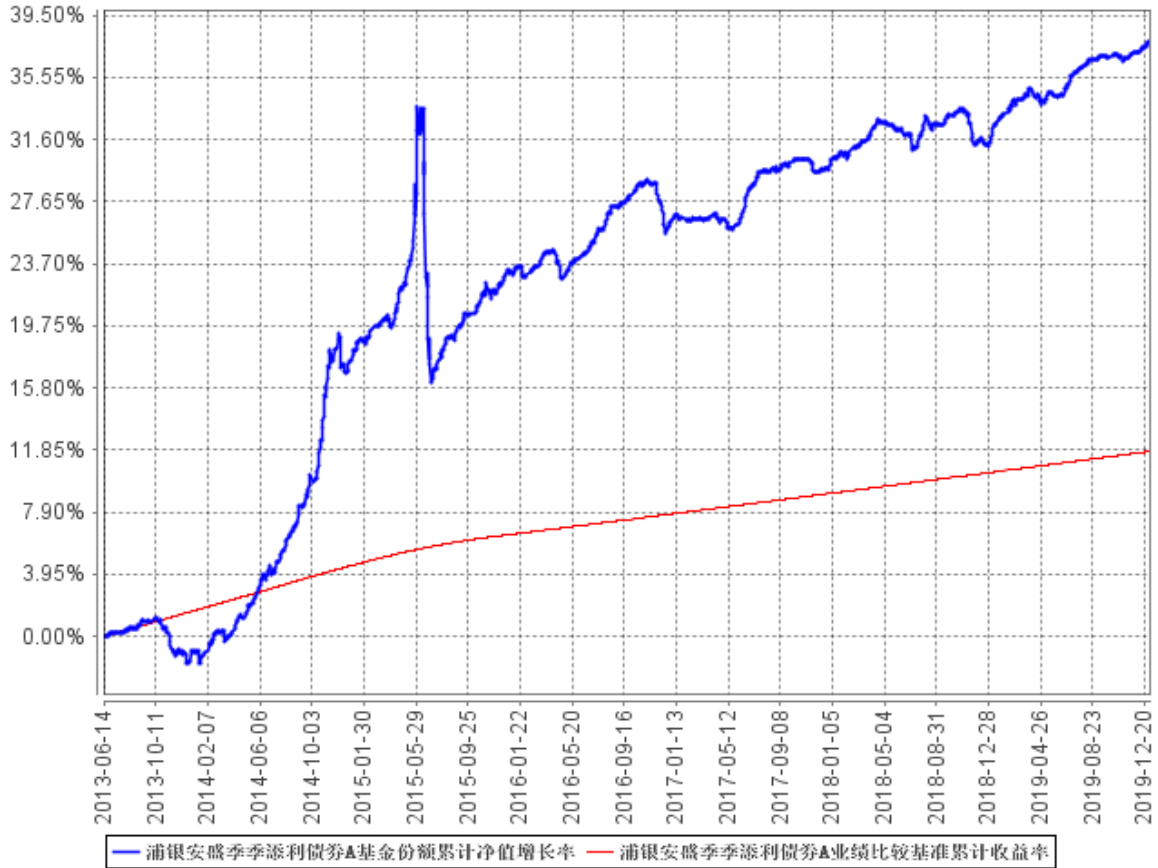
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.73%	0.04%	0.31%	0.00%	0.42%	0.04%

浦银安盛季季添利债券 C

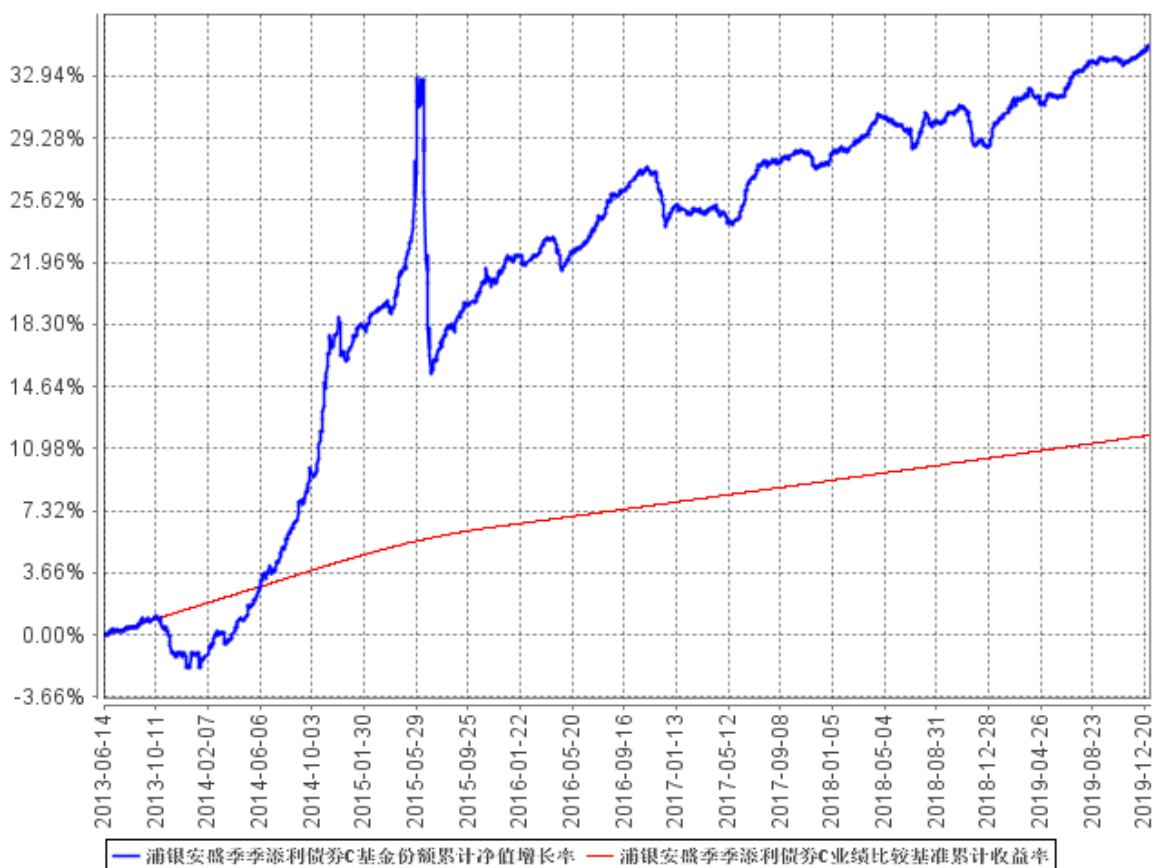
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.60%	0.04%	0.31%	0.00%	0.29%	0.04%

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

浦银安盛季季添利债券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



浦银安盛季季添利债券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	公司旗下部分基金的基金经理。	2016年8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工作。2016年8月转

				<p>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 11 月至 2019 年 11 月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 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 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。2019 年 7 月起，担任浦银安盛上海清算所高等级优选短期融资券指数证券投资基金基金经理。2019 年 9 月起，担任浦银安盛盛诺 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。</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。

4.2 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

6 月底以来，央行维护市场流动性的意图较为明显，导致了收益率曲线整体下移，期限利差和信用利差均大幅压缩，信用债和长久期债券配置价值大幅降低，在此情况下，本组合逐步降低了组合仓位和久期，提高了组合整体流动性。9 月开始，市场情绪开始谨慎，资金利率波动开始加大，在此期间本组合维持了低久期低仓位的操作策略，保证了组合净值稳定增长。11 月开始，我们认为市场对于年末流动性的担忧已经形成一致预期，在此情况下，提前配置资产是较好的策略，在此期间，本组合开始逐步增加组合久期和仓位，并适当增加了可转债仓位，在年末的收益率快速下行期间获得了较好的超额回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛季季添利债券 A 基金份额净值为 1.378 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.73%；截至本报告期末浦银安盛季季添利债券 C 基金份额净值为 1.347 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.60%；同期业绩比较基准收益率为 0.31%。

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	57,888,324.15	87.68
	其中：债券	57,888,324.15	87.68
	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	3,000,000.00	4.54
	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	4,168,578.28	6.31

8	其他资产	964,037.40	1.46
9	合计	66,020,939.83	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	2,285,781.40	4.20
	其中：政策性金融债	2,285,781.40	4.20
4	企业债券	39,971,738.80	73.41
5	企业短期融资券	3,009,600.00	5.53
6	中期票据	10,613,450.00	19.49
7	可转债（可交换债）	2,007,753.95	3.69
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	57,888,324.15	106.32

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	101900586	19 中油股 MTN005	40,000	4,070,800.00	7.48
2	143229	17 国君 G1	40,000	4,034,400.00	7.41
3	101900883	19 中石油 MTN003	40,000	4,032,400.00	7.41

4	122150	12 石化 02	35,000	3,620,400.00	6.65
5	143182	17 建材 01	35,000	3,526,950.00	6.48

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申万宏源集团、中国建材股份和中金公司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 12 月 19 日，申万宏源证券公告，申万宏源证券诉中信国安投资有限公司，中信国安集团有限公司质押式证券回购纠纷案，2. 申万宏源证券诉中信国安集团有限公司质押式证券回购纠纷案，为维护原告的合法权益，因此提交人民法院诉讼解决。

2019 年 8 月 1 日中国建材股份有限公司公告，中国建材股份有限公司（简称“本公司”）下
第 10 页 共 13 页

属子公司北新集团建材股份有限公司（简称“北新建材”）的全资子公司泰山石膏有限公司（简称“泰山石膏”）及泰安市泰山纸面石膏板有限公司（泰山石膏的全资子公司，与泰山石膏合称“泰山”）在美国石膏板诉讼案件中拟与原告和解集体的律师签署和解协议（简称“和解协议”）。

2019 年 5 月 31 日，中国国际金融股份有限公司公告，作为北京粮食集团有限责任公司（以下简称“京粮集团”）相关债务融资工具的主承销商，在相关工作开展过程中存在以下违反银行间市场相关自律管理规则的行为：一、京粮集团在债务融资工具存续期间发生资产无偿划转重大事项，并在多期债务融资工具募集说明书中予以披露。中金公司未能对上述重大事项进行有效监测，及时督导京粮集团进行存续期重大事项披露，也未及时召开持有人会议；二、中金公司关于“18 京粮 MTN002”项目的尽职调查报告未包含对京粮集团财务状况的调查情况。依据相关自律规定，经 2019 年第 9 次自律处分会议审议，给予中金公司诫勉谈话处分，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。

本基金管理人的研究部门对申万宏源集团、中国建材股份和中金公司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

报告期内，本基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定备选股票库投资的情况。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	69,819.66
2	应收证券清算款	1,203.06
3	应收股利	-
4	应收利息	893,014.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	964,037.40

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	113011	光大转债	997,280.00	1.83
2	123023	迪森转债	411,980.85	0.76
3	113517	曙光转债	237,560.00	0.44
4	113026	核能转债	216,360.00	0.40
5	113028	环境转债	144,573.10	0.27

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	浦银安盛季季添利债券 A	浦银安盛季季添利债券 C
报告期期初基金份额总额	38,399,165.80	3,245,376.50
报告期期间基金总申购份额	7.26	-
减：报告期期间基金总赎回份额	1,972,522.22	90,407.68
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	36,426,650.84	3,154,968.82

§ 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、 浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金基金合同
- 3、 浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金招募说明书
- 4、 浦银安盛季季添利定期开放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）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

2020 年 1 月 20 日