

浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券
投资基金
2020 年中期报告

2020 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 日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，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	19
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	20
6.1 资产负债表.....	20
6.2 利润表.....	21
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22

6.4 报表附注.....	23
§7 投资组合报告.....	48
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.11 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
8.3 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.....	52
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
11.1 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.....	57

§12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	8,756,961,729.15 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	8,756,957,575.39 份	4,153.76 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，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	本基金业绩比较基准为：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。

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	兴业银行股份有限公司
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	95561
传真	021-23212985	021-62159217
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 981 号 3 幢 316 室	福州市湖东路 154 号
办公地址	上海市淮海中路 381 号中	上海市银城路 167 号 4 楼

	环广场 38 楼	
邮政编码	200020	200120
法定代表人	谢伟	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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	浦银安盛盛元定开债券 A	浦银安盛盛元定开债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	310,173,769.49	139.21
本期利润	270,170,816.29	120.37
加权平均基金份额本期利润	0.0309	0.0290
本期加权平均净值利润率	2.84%	2.68%
本期基金份额净值增长率	2.90%	2.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末可供分配利润	602,747,290.70	265.82
期末可供分配基金份额利润	0.0688	0.0640
期末基金资产净值	9,559,170,113.33	4,514.25
期末基金份额净值	1.0916	1.0868
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	8.78%	8.23%

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

浦银安盛盛元定开债券 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	-0.67%	0.09%	-0.74%	0.11%	0.07%	-0.02%
过去三个月	0.50%	0.08%	-0.26%	0.11%	0.76%	-0.03%
过去六个月	2.90%	0.08%	2.32%	0.11%	0.58%	-0.03%
过去一年	5.85%	0.06%	5.00%	0.08%	0.85%	-0.02%
自基金合同	8.78%	0.05%	7.35%	0.07%	1.43%	-0.02%

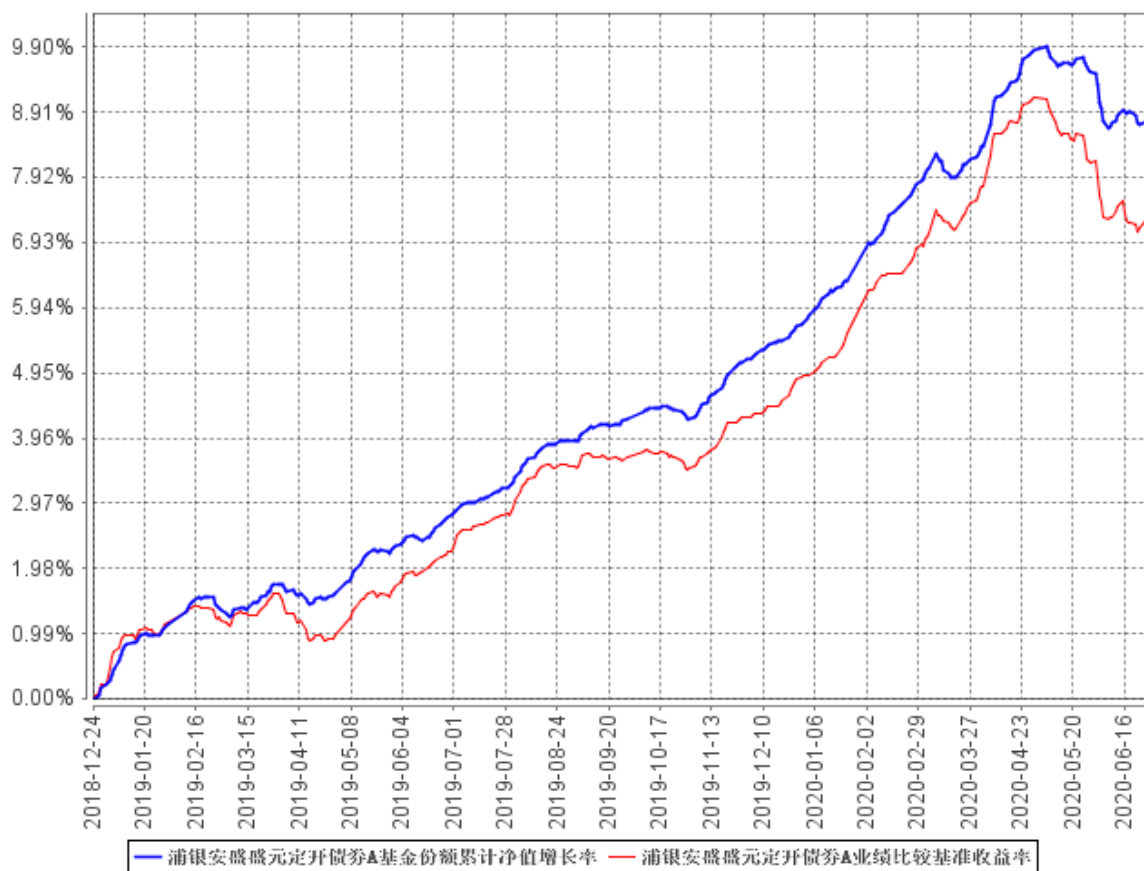
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

浦银安盛盛元定开债券 C

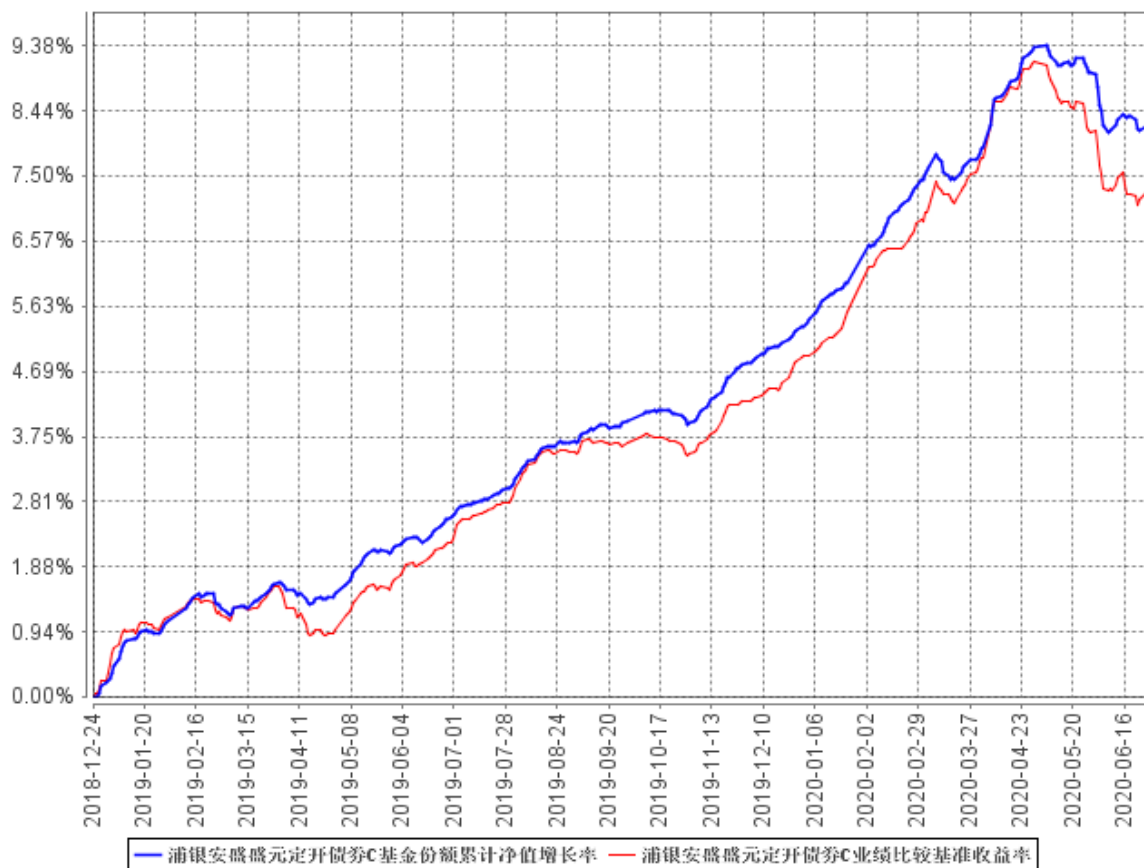
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.69%	0.09%	-0.74%	0.11%	0.05%	-0.02%
过去三个月	0.42%	0.08%	-0.26%	0.11%	0.68%	-0.03%
过去六个月	2.74%	0.08%	2.32%	0.11%	0.42%	-0.03%
过去一年	5.49%	0.06%	5.00%	0.08%	0.49%	-0.02%
自基金合同生效起至今	8.23%	0.05%	7.35%	0.07%	0.88%	-0.02%

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

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



注：本基金由浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金于 2018 年 12 月 24 日转型而来。

§ 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 19.1 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 2020 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 62 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、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、浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛幸福聚益 18 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金、浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金、浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF)、浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安久回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛中短债债券型证券投资基金、浦银安盛普益纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛融定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金、浦银安盛全球智能

科技股票型证券投资基金 (QDII)、浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛双债增强债券型证券投资基金、浦银安盛环保新能源混合型证券投资基金、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、浦银安盛盛煊 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、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、浦银安盛普丰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛颐和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛先进制造混合型证券投资基金、浦银安盛盛智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛晖一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛熙一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛科技创新优选三年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、浦银安盛普嘉 87 个月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		
章潇枫	公司旗下部分基金的基金经	2017 年 6 月 8 日	-	9	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

	理。			<p>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，2016年6月至2017年5月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的（原浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金）基金经理。2017年6月至2019年1月担任浦银安盛盛勤3个月定期开放债券型发起式证券投资基金（原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。2019年3月起担任公司旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金以及</p>
--	----	--	--	---

					浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金基金经理。 2019年8月起，担任浦银安盛盛焯3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2019年9月起，担任浦银安盛普丰纯债债券型证券投资基金基金经理。
郑双超	公司固定收益类基金经理助理	2017年12月14日	-	9	郑双超先生，清华大学计算数学专业硕士。2011年7月至2017年12月，先后就职于嘉实基金管理有限公司、东吴证券股份有限公司和天风证券股份有限公司，从事量化分析、固定收益分析、债券投资等工作。2017年12月14日加盟浦银安盛基金管理有限公司担任债券基金基金经理助理。
杜雪川	固定收益公司类基金经理助理	2018年4月4日	-	7	杜雪川先生，上海交通大学应用经济学硕士。2013年7月至2016年4月就职于德意志银行，先后从事分析师、公司评级及信用分析师等岗位。2016年4月加盟浦银安盛基金管理有限公司，担任固定收益投资部信用研究员岗位。2018年4月4日调岗至固定收益投资部基金经理助理职位。

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，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

一季度新型冠状病毒爆发，国内充分阻断传播途径的严格防疫措施收效较好，经济活动平稳复苏，但欧美国家在第二波疫情中受创颇深，经济活动受影响的程度和持续时间超出预期，3月中旬全球金融市场一度出现了流动性危机，资产相关性急速上升，除美元外所有资产均下跌。G20成员国家普遍推出了巨额财政支出计划和降息、量化宽松等货币政策，美联储创设了一揽子流动性支持方案以维稳金融市场。国内受制于通胀水平和实体杠杆水平较高的约束，央行在价格型工具的使用上较为克制，两次降息合计 30bp，更多采用了降准、再贷款再贴现等政策直接降低商业银行的负债成本，进而降低实体经济融资利率，解决中小企业融资难、融资贵的问题。整个一季度，受益于国内流动性极度宽松以及内外需交困下经济增长预期下降，债市快速上涨，各期限收益率水平达到或接近历史最低位置。

二季度初央行下调超额存款准备金利率进一步刺激了债市做多情绪，曲线加速陡峭化下行。4月末开始伴随经济复苏的顺利推进，央行货币政策进入观察期，资金市场从疫情期间的超宽松的

危机模式中逐步退出，短端融资成本向政策利率迅速靠拢，带动短债收益率 5 月底大幅上行 100BP 左右，此前极度陡峭的收益率曲线快速修复。这轮货币政策预期急剧转向引致的剧烈调整到 6 月下旬左右逐步恢复平稳，各类利差均处于合理状态。

报告期内，本基金高配高等级信用债，在一季度采用中性偏高的杠杆和久期水平，在二季度维持中性的杠杆水平和组合久期，一季度净值较快增长、二季度在暴跌中净值亦有较大回撤，整体取得了一定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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛盛元定开债券 A 基金份额净值为 1.0916 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.90%；截至本报告期末浦银安盛盛元定开债券 C 基金份额净值为 1.0868 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.74%；同期业绩比较基准收益率为 2.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入三季度，股票市场的情绪空前高涨，牛市气息浓厚带动风险偏好快速上行。疫情的有效防控、复工复产的持续推进并不是股市“疯牛”的关键，茅台等核心资产走的是 2016 年以来 5 年的长牛，现在早已不便宜，牛市起点无从谈起，至多是空中加油。短期暴涨的原因其实和 4 月债市收益率急速下行类似：其一都有政策预期的“边际变化”，债券是调超额存准利率、股市是官媒发声唱多；其二是无视利空，钱多两个字足以给做多者足够的信心，进一步引发踏空者的恐慌性买入。所以近期股票市场走的是从混乱预期的市场，突然走向预期一致的系统性变化，这一合力造成急速波动，也即赚钱三部曲“无人知道的故事”、“部分人认可的故事”和“众所周知的故事”的最后一段也可能是最泡沫的一段。

站在目前的时点贸然判断股市是新一轮牛市起点还是疫情压制下的熊市反弹很难准确，但从暴涨的品种来看，涨低估值和券商都是演绎钱多和就是逻辑不易出错且风险较小的标的。当市场真正实现空中加油继续切换到核心资产，投资者必须回答自己一个问题，在目前这个位置，从 2016 年长牛至今的核心资产们仍然便宜吗？

对于债券市场来说，货币政策仍然是影响下半年收益率走势的核心因素。在全球疫情仍严重以及国内就业压力承压的背景下，央行无意也不会继续收紧资金面，目前正处于对复苏斜率和多目标完成情况的观察期。在全球进一步滑入负利率的背景下，随着人民币国际化进程，我国国债收益率也不会成为成熟市场中独一无二的高息品种。尽管现在整个收益率曲线的中枢有所抬升，不认为债市已经进入趋势性熊市。

股债负相关何时解除或者说债市何时企稳回升其实有很多触发因素，因为市场情绪已经包含

了几乎一致的看好情绪。列两个可以预想到的线索，一是“V型”复苏的右半边其实是对数型的复苏，斜率逐渐趋缓，这将在8月开始得到确认；二是国际形势或者新冠疫情有一些事件性的恶化，毕竟资产价格都到了疫情没来过中国、中美关系阶段回暖的位置，而实际上未来更可能是疫情常态化、外部环境更加紧张，这些事件会清楚的说明疫后世界经济终究是缓慢复苏的、逆全球化仍在推进。

总的来说，在半年末的时点，根据对经济复苏进程的预测，股债性价比逐渐倾向债券，债券市场的收益率水平相对于基本面较为合理，有一定的下行空间。

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副总经理暨首席运营官、风险管理部负责人、指数与量化投资部负责人、研究部负责人、产品估值部和注册登记部负责人组成。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以及中债金融估值中心有限公司签订了《中债信息产品服务三方协议》。

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

本基金《基金合同》第十六部分第三条约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

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、本基金为发起式基金，基金持有人数符合法律法规及基金合同的要求。

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

报告期内，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、基金合同和托管协议的规定，诚信、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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,733,968.91	7,231,890.22
结算备付金		43,980,069.54	53,953,032.36
存出保证金		81,158.71	175,852.71
交易性金融资产	6.4.7.2	12,064,332,660.00	11,262,797,330.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		12,064,332,660.00	11,262,797,330.00
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	-	676,352,694.53
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	213,366,250.68	163,302,543.73
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		12,324,494,107.84	12,163,813,343.55
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		2,758,338,120.48	2,865,576,933.37
应付证券清算款		1,074,450.08	3,499,794.51
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,353,162.06	2,359,645.10
应付托管费		784,387.34	786,548.39
应付销售服务费		1.20	1.24
应付交易费用	6.4.7.7	109,919.37	110,656.59
应交税费		1,034,246.52	1,147,655.94

应付利息		1,484,465.35	1,034,130.73
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	140,727.86	242,000.00
负债合计		2,765,319,480.26	2,874,757,365.87
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	8,756,961,729.15	8,757,009,681.06
未分配利润	6.4.7.10	802,212,898.43	532,046,296.62
所有者权益合计		9,559,174,627.58	9,289,055,977.68
负债和所有者权益总计		12,324,494,107.84	12,163,813,343.55

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额为 8,756,961,729.15 份。其中 A 类基金份额净值 1.0916 元，A 类基金份额 8,756,957,575.39 份；C 类基金份额净值 1.0868 元，C 类基金份额 4,153.76 份。

6.2 利润表

会计主体：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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		322,673,950.83	288,920,073.71
1.利息收入		233,257,742.43	253,422,458.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	509,692.07	975,685.75
债券利息收入		232,366,421.43	248,448,182.82
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		381,628.93	3,998,590.05
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		129,419,180.44	60,932,105.68
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	129,419,180.44	60,932,105.68
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	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-40,002,972.04	-25,434,490.59
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	-	-
减：二、费用		52,503,014.17	35,517,064.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	14,183,350.77	14,935,353.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,727,783.67	4,978,451.02
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	7.28	7.24
4. 交易费用	6.4.7.19	86,244.17	70,910.45
5. 利息支出		32,548,611.94	14,701,044.43
其中：卖出回购金融资产支出		32,548,611.94	14,701,044.43
6. 税金及附加		782,637.78	670,721.50
7. 其他费用	6.4.7.20	174,378.56	160,577.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		270,170,936.66	253,403,008.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		270,170,936.66	253,403,008.80

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020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）	8,757,009,681.06	532,046,296.62	9,289,055,977.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	270,170,936.66	270,170,936.66
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）	-47,951.91	-4,334.85	-52,286.76
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-47,951.91	-4,334.85	-52,286.76
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)	8,756,961,729.15	802,212,898.43	9,559,174,627.58
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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)	9,729,009,681.06	473,751,909.99	10,202,761,591.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	253,403,008.80	253,403,008.80
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)	-972,000,000.00	-25,077,600.00	-997,077,600.00
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-972,000,000.00	-25,077,600.00	-997,077,600.00
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)	-	-428,076,421.82	-428,076,421.82
五、期末所有者权益(基金净值)	8,757,009,681.06	274,000,896.97	9,031,010,578.03

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：

 郁蓓华 郁蓓华 钱琨
 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”，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[2016]1206号《关于准予浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金注册的批复》核准，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《浦银安盛盛元纯债债券型证券投资

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 200,781,448.69 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(2016)第 825 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,790,482.23 份基金份额，其中认购资金利息折合 9,033.54 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决通过的《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》及中国证监会证监许可[2018]1819 号《关于准予浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金变更注册的批复》，浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金变更注册为浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金，修订和更新后的《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》及其他法律文件自 2018 年 12 月 24 日起生效。

本基金以定期开放的方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。自基金合同生效日起(包括基金合同生效日)或者每一个开放期结束之日次日起(包括该日)3 个月的期间内，本基金采取封闭运作模式。每一个封闭期结束后，本基金即进入开放期，开放期的期限为自封闭期结束之日后第一个工作日起(含该日)一至二十个工作日，具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。开放期内，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。开放期未赎回的份额将自动转入下一个封闭期。

基金为发起式基金，发起资金申购部分为 9,554,748.71 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《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》和《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》的规定，本基金根据申购费用收取方式的不同，基金份额分为不同类别：在投资者申购基金时收取认购、申购费用的为 A 类基金份额；不收取申购费用，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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的债券（国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、地方政府债、中小企业私募债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款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金融工具(但须符合中国证监会的相

关规定)。本基金不买入股票、权证等权益类资产,可转换债券仅投资于可分离交易可转债的纯债部分。本基金各类资产的投资比例为:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%。应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,开放期开始前 10 个工作日、开放期以及开放期结束后的 10 个工作日内,本基金债券资产的投资比例不受上述比例限制。开放期内,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;在封闭期内,本基金不受上述 5%的限制。本基金的业绩比较基准为:中证综合债指数收益率。

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<年度报告和中期报告>》、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》、《浦银安盛盛元定期开放债券型发起式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 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他

相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	2,733,968.91
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	2,733,968.91

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 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	2,393,024,216.77	2,396,821,700.00
	银行间市场	9,607,664,011.49	9,667,510,960.00
	合计	12,000,688,228.26	12,064,332,660.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	12,000,688,228.26	12,064,332,660.00	63,644,431.74

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

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

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 2020年6月30日
应收活期存款利息	565.10
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	19,791.10
应收债券利息	213,345,857.98
应收资产支持证券利息	-
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	-
应收出借证券利息	-
其他	36.50
合计	213,366,250.68

6.4.7.6 其他资产

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 2020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	109,919.37
合计	109,919.37

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	140,727.86
合计	140,727.86

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

浦银安盛盛元定开债券 A		
项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,757,005,527.30	8,757,005,527.30
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-47,951.91	-47,951.91
- 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	8,756,957,575.39	8,756,957,575.39

金额单位：人民币元

浦银安盛盛元定开债券 C		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	4,153.76	4,153.76
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 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	4,153.76	4,153.76

注：1. 申购含红利再投。

2. 根据《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》和《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》的相关规定，本基金以定期开放方式运作。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

浦银安盛盛元定开债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	292,576,726.84	239,469,329.66	532,046,056.50
本期利润	310,173,769.49	-40,002,953.20	270,170,816.29
本期基金份额交易产生的变动数	-3,205.63	-1,129.22	-4,334.85
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-3,205.63	-1,129.22	-4,334.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	602,747,290.70	199,465,247.24	802,212,537.94

单位：人民币元

浦银安盛盛元定开债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	126.61	113.51	240.12
本期利润	139.21	-18.84	120.37
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-

本期末	265.82	94.67	360.49
-----	--------	-------	--------

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	130,449.72
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	378,415.68
其他	826.67
合计	509,692.07

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

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 2020年1月1日至2020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	129,419,180.44
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	129,419,180.44

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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	9,412,379,813.04
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,130,755,161.62
减：应收利息总额	152,205,470.98
买卖债券差价收入	129,419,180.44

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

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**

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

本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

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 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-40,002,972.04
——股票投资	-
——债券投资	-40,002,972.04
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-40,002,972.04

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	3,240.42
银行间市场交易费用	83,003.75
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	86,244.17

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	81,055.52
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	15,050.70
债券帐户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	174,378.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
浦银安盛基金管理有限公司	基金管理人、基金代销机构
兴业银行股份有限公司	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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。

6.4.10.1.2 债券交易

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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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。

6.4.10.1.4 权证交易

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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	14,183,350.77	14,935,353.15
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

注：支付基金管理人浦银安盛的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.30%/ 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,727,783.67	4,978,451.02

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.10%/ 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的	本期
----------	----

各关联方名称	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浦银安盛盛元定开 债券 A	浦银安盛盛元定开 债券 C	合计
浦银安盛基金管理有限 公司	0.00	7.28	7.28
合计	0.00	7.28	7.28
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浦银安盛盛元定开 债券 A	浦银安盛盛元定开 债券 C	合计
浦银安盛基金管理有限 公司	0.00	7.24	7.24
合计	0.00	7.24	7.24

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
----	----

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	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）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,554,748.71	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	9,554,748.71	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.11%	-

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	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）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,554,748.71	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	9,554,748.71	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.11%	-

注：1、期间申购/买入总份额包含红利再投。

2、本基金自 2018 年 12 月 24 日转为发起式基金。基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.10.5.2 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

份额单位：份

浦银安盛盛元定开债券 A				
关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例

兴业银行股份 有限公司	8,747,400,809.63	99.89%	8,747,400,809.63	99.89%
----------------	------------------	--------	------------------	--------

注：1、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浦银盛元 C。
2、除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
兴业银行	2,733,968.91	130,449.72	84,806,098.93	755,754.11

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

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。

6.4.11 利润分配情况

本基金在本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金在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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金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 1,546,338,120.48 元，分别于 2020 年 7 月 1 日、2020 年 7 月 2 日、2020 年 7 月 7 日到期。

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
042000112	20 湘高速 CP001	2020 年 7 月 2 日	99.97	914,000	91,372,580.00
101801187	18 陕煤化 MTN004	2020 年 7 月 2 日	104.63	385,000	40,282,550.00
101900509	19 泉国投 MTN001	2020 年 7 月 2 日	104.52	1,000,000	104,520,000.00
101901302	19 中化工 MTN004	2020 年 7 月 2 日	101.41	869,000	88,125,290.00
091900026	19 中国华融债 01(品种一)	2020 年 7 月 1 日	101.29	105,000	10,635,450.00
101900142	19 重庆交投 MTN001	2020 年 7 月 1 日	101.44	2,000,000	202,880,000.00
091900026	19 中国华融债 01(品种一)	2020 年 7 月 2 日	101.29	189,000	19,143,810.00
101901075	18 合建投 MTN001	2020 年 7 月 2 日	104.10	1,000,000	104,100,000.00
091900026	19 中国华融债 01(品种一)	2020 年 7 月 2 日	101.29	136,000	13,775,440.00
091900026	19 中国华融债 01(品种一)	2020 年 7 月 2 日	101.29	1,410,000	142,818,900.00
102000025	20 泉州城建 MTN001	2020 年 7 月 7 日	100.91	1,000,000	100,910,000.00
102000670	20 合建投 MTN001	2020 年 7 月 7 日	98.09	850,000	83,376,500.00
102001036	20 长沙先导 MTN001B	2020 年 7 月 7 日	98.49	1,000,000	98,490,000.00
101900060	19 金川 MTN001	2020 年 7 月 1 日	101.49	368,000	37,348,320.00
012000651	20 贵州高速 SCP001	2020 年 7 月 1 日	100.19	584,000	58,510,960.00
101900060	19 金川	2020 年 7 月	101.49	632,000	64,141,680.00

	MTN001	1 日			
041900375	19 云投 CP001	2020 年 7 月 1 日	100.67	2,000,000	201,340,000.00
101800961	18 北大荒 MTN001	2020 年 7 月 1 日	102.61	1,890,000	193,932,900.00
合计				16,332,000	1,655,704,380.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2020 年 6 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 1,212,000,000 元，于 2020 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为债券型基金，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。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的债券（国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、地方政府债、中小企业私募债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金不买入股票、权证等权益类资产，可转换债券仅投资于可分离交易可转债的纯债部分。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%。应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，开放期开始前 10 个工作日、开放期以及开放期结束后的 10 个工作日内，本基金债券资产的投资比例不受上述比例限制。开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在科学的风险管理的前提下，实现基金财产的安全和增值。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理，设立了三层次的风险控制体系：第一层次为各业务部门对各自部门潜在风险的自我管理和检查；第二层次为公司总经理领导的管理层、风险控制委员会、风险管理部和法律合规部的风险管理；第三层次为董事会层面对公司的风险管理，包括董事会、合规及审计委员会、督察长。

本基金管理人下设的各业务部门是公司第一线风险控制的实施者，均备有符合法律法规、公司政策的业务流程，其中包含与其业务相关的风险控制措施、风险管理计划、工作流程和管理责任。这些流程均得到公司管理层的批准。

本基金管理人设立的风险控制委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权利机构，主要负责制定公司的风险管理政策，并监督实施，确保公司整体风险暴露得到有效的识别、评估、监控和控制。公司设立风险管理部与法律合规部监控公司面临的各类风险。风险管理部建立了定性和数量化分析模型进行基金投资风险和绩效评估，法律合规部根据基金相关法律法规、公司基本制度及业务流程，对信息披露、法律文件等进行事中审核，并对基金管理人经营活动及各职能部门履职情况的合法合规性进行监督和检查。

董事会下属的合规及审计委员会，负责对公司整体风险管理和内部控制的有效性进行审议和评估。同时，督察长及合规及审计委员会负责检查、评价公司风险控制的充分性和有效性，并向董事会报告。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险可能产生的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人兴业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能

性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	1,326,044,700.00	626,515,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	1,403,075,700.00	1,152,178,100.00
合计	2,729,120,400.00	1,778,693,100.00

注：于 2020 年 6 月 30 日，未评级部分为短期融资券。债券信用评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	4,922,755,000.00	5,756,786,750.00
AAA 以下	4,384,849,260.00	3,559,476,480.00
未评级	27,608,000.00	167,841,000.00
合计	9,335,212,260.00	9,484,104,230.00

注：于 2020 年 6 月 30 日，未评级部分为政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 2,758,338,120.48 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿

透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年6 月 30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,733,968.91	-	-	-	2,733,968.91
结算备付金	43,980,069.54	-	-	-	43,980,069.54
存出	81,158.71	-	-	-	81,158.71

保证 金					
交易 性金 融资 产	3,185,289,660.00	8,036,496,000.00	842,547,000.00		-12,064,332,660.00
应收 利息	-	-	-	213,366,250.68	213,366,250.68
资产 总计	3,232,084,857.16	8,036,496,000.00	842,547,000.00	213,366,250.68	12,324,494,107.84
负债					
卖出 回购 金融 资产 款	2,758,338,120.48	-	-	-	2,758,338,120.48
应付 证券 清算 款	-	-	-	1,074,450.08	1,074,450.08
应付 管理 人报 酬	-	-	-	2,353,162.06	2,353,162.06
应付 托管 费	-	-	-	784,387.34	784,387.34
应付 销售 服务 费	-	-	-	1.20	1.20
应付 交易 费用	-	-	-	109,919.37	109,919.37
应付 利息	-	-	-	1,484,465.35	1,484,465.35
应交 税费	-	-	-	1,034,246.52	1,034,246.52
其他 负债	-	-	-	140,727.86	140,727.86
负债 总计	2,758,338,120.48	-	-	6,981,359.78	2,765,319,480.26
利率 敏感	473,746,736.68	8,036,496,000.00	842,547,000.00	206,384,890.90	9,559,174,627.58

度缺 口					
上年 度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,231,890.22	-	-	-	7,231,890.22
结算 备付 金	53,953,032.36	-	-	-	53,953,032.36
存出 保证 金	175,852.71	-	-	-	175,852.71
交易 性金 融资 产	2,324,928,600.00	8,070,993,930.00	866,874,800.00	-	11,262,797,330.00
买入 返售 金融 资产	676,352,694.53	-	-	-	676,352,694.53
应收 利息	-	-	-	-163,302,543.73	163,302,543.73
其他 资产	-	-	-	-	-
资产 总计	3,062,642,069.82	8,070,993,930.00	866,874,800.00	163,302,543.73	12,163,813,343.55
负债					
卖出 回购 金融 资产 款	2,865,576,933.37	-	-	-	2,865,576,933.37
应付 证券 清算 款	-	-	-	3,499,794.51	3,499,794.51
应付	-	-	-	2,359,645.10	2,359,645.10

管理人报酬					
应付托管费	-	-	-	786,548.39	786,548.39
应付销售服务费	-	-	-	1.24	1.24
应付交易费用	-	-	-	110,656.59	110,656.59
应付利息	-	-	-	1,034,130.73	1,034,130.73
应交税费	-	-	-	1,147,655.94	1,147,655.94
其他负债	-	-	-	242,000.00	242,000.00
负债总计	2,865,576,933.37	-	-	9,180,432.50	2,874,757,365.87
利率敏感度缺口	197,065,136.45	8,070,993,930.00	866,874,800.00	154,122,111.23	9,289,055,977.68

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率上升 25 基点	-51,652,608.75	-61,234,871.06
市场利率下降 25 基点	52,103,891.40	61,858,397.78	

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

§ 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,064,332,660.00	97.89
	其中：债券	12,064,332,660.00	97.89
	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	46,714,038.45	0.38
8	其他各项资产	213,447,409.39	1.73
9	合计	12,324,494,107.84	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

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

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

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

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	323,988,000.00	3.39
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	3,253,463,260.00	34.03
5	企业短期融资券	2,729,120,400.00	28.55
6	中期票据	5,757,761,000.00	60.23
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,064,332,660.00	126.21

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	091900026	19 中国华融债 01(品种一)	2,200,000	222,838,000.00	2.33
2	101800961	18 北大荒 MTN001	2,000,000	205,220,000.00	2.15
3	101900142	19 重庆交投 MTN001	2,000,000	202,880,000.00	2.12
4	163094	20 江东 01	2,000,000	201,580,000.00	2.11
5	041900375	19 云投 CP001	2,000,000	201,340,000.00	2.11

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体除广发证券以外不存在被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

广发证券于 2019 年 8 月 5 日因未依法履行其他职责受到中国证券监督管理委员会给予监管关注处罚。

本基金管理人的研究部门对广发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。

7.11.2 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，没有超出基金合同规定的备选股票库的范围。

7.11.3 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	81,158.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	213,366,250.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	213,447,409.39

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§ 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
浦银安盛盛元定开债券 A	7	1,250,993,939.34	8,756,955,558.34	100.00%	2,017.05	0.00%
浦银安盛盛元定开债券 C	18	230.76	0.00	0.00%	4,153.76	100.00%
合计	25	350,278,469.17	8,756,955,558.34	100.00%	6,170.81	0.00%

8.2 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	浦银安盛盛元定开债券 A	19.21	0.00%
	浦银安盛盛元定开债券 C	174.18	4.19%
	合计	193.39	0.00%

8.3 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	浦银安盛盛元定开债券 A	0
	浦银安盛盛元定开债券 C	0
	合计	0

本基金基金经理持有本开放式基金	浦银安盛盛元定开债券 A	0
	浦银安盛盛元定开债券 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,554,748.71	0.11	9,554,748.71	0.11	自申购确认之日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00	0.00	0.00	0
基金经理等人员	0.00	0.00	0.00	0.00	0
基金管理人股东	0.00	0.00	0.00	0.00	0
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	0
合计	9,554,748.71	0.11	9,554,748.71	0.11	自申购确认之日起不少于 3 年

注：上述份额总数均包含利息结转份额。

§ 9 开放式基金份额变动

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
本报告期期初基金份额总额	8,757,005,527.30	4,153.76
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	47,951.91	-
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	8,756,957,575.39	4,153.76

注：1、总申购份额含红利再投份额。

2、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发起式基金。

§ 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、托管人及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	
招商证券	2	-	-	-	-	-

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单元的变更情况。

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
招商证券	993,658,244.49	100.00%	52,513,177,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	指定网站	2020 年 1 月 20 日
2	浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年度第一次开放日常申购、赎回的业务公告	报刊及指定网站	2020 年 3 月 2 日
3	浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金 2019 年年度报告	指定网站	2020 年 3 月 31 日
4	浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	指定网站	2020 年 4 月 21 日
5	浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年度第二次开放日常申购、赎回的业务公告	报刊及指定网站	2020 年 6 月 5 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日	8,747,400,809.63	0.00	0.00	8,747,400,809.63	99.89%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p>							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、 中国证监会批准浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金募集的文件
- 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

浦银安盛基金管理有限公司

2020 年 8 月 29 日