

浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资 基金 2020 年年度报告

2020 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

送出日期：2021 年 3 月 31 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。本年度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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 30 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。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	14
§ 4 管理人报告	15
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	19
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.....	21
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	21
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	22
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	23
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	23
4.9 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.....	23
§ 5 托管人报告	25
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	25
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.....	25
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	25
§ 6 审计报告	26
6.1 审计报告基本信息.....	26
6.2 审计报告的基本内容.....	26
§ 7 年度财务报表	29
7.1 资产负债表.....	29
7.2 利润表.....	30
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	31
7.4 报表附注.....	32
§ 8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况.....	58
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	58
8.3 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.....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
8.6 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.....	59
8.7 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.....	59

8.8 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	59
8.9 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	59
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
8.11 投资组合报告附注	60
§ 9 基金份额持有人信息.....	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
9.3 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	62
§ 10 开放式基金份额变动.....	64
§ 11 重大事件揭示.....	65
11.1 基金份额持有人大会决议	65
11.2 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	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
11.4 基金投资策略的改变	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
11.8 其他重大事件	66
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
12.1 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	69
§13 备查文件目录.....	70
13.1 备查文件目录	70
13.2 存放地点	70
13.3 查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金	
基金简称	浦银安盛月月盈定期支付债券	
基金主代码	519128	
交易代码	519128	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 12 月 5 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	
报告期末基金份额总额	17,179,855.91 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	16,094,825.70 份	1,085,030.21 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，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。

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	上海银行股份有限公司
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	95594
传真	021-23212985	021-68476936
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号

办公地址	上海市淮海中路 381 号中 环广场 38 楼	中国（上海）自由贸易试验区银 城中路 168 号 42 层
邮政编码	200020	200120
法定代表人	谢伟	金煜

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网 址	www.py-axa.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊 普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据 和 指标	2020 年		2019 年		2018 年	
	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	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	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
本期 已 实 现 收 益	722,139.18	42,972.61	1,573,969.25	322,735.40	-42,443.31	-3,642.17
本期 利 润	491,686.32	27,776.78	1,862,954.02	380,858.05	1,810,326.02	395,110.97
加 权 平 均 基 金 份 额 本 期 利 润	0.0299	0.0251	0.0631	0.0625	0.0420	0.0379
本 期 加 权 平	2.45%	2.10%	5.38%	5.44%	3.74%	3.41%

均净值利润率						
本期基金份额净值增长率	2.41%	2.12%	5.16%	4.80%	3.63%	3.21%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
期末可供分配利润	3,702,047.34	220,848.69	3,122,837.85	185,396.35	5,581,680.34	1,258,046.27
期末可供分配基金份额利	0.2300	0.2035	0.1861	0.1647	0.1370	0.1205

润						
期末基金资产净值	19,819,876.23	1,307,390.39	20,167,186.82	1,328,465.99	46,585,902.21	11,760,976.78
期末基金份额净值	1.231	1.205	1.202	1.180	1.143	1.126
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
基金份额累计净值增长率	23.10%	20.50%	20.20%	18.00%	14.30%	12.60%

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

浦银安盛月月盈定期支付债券 A

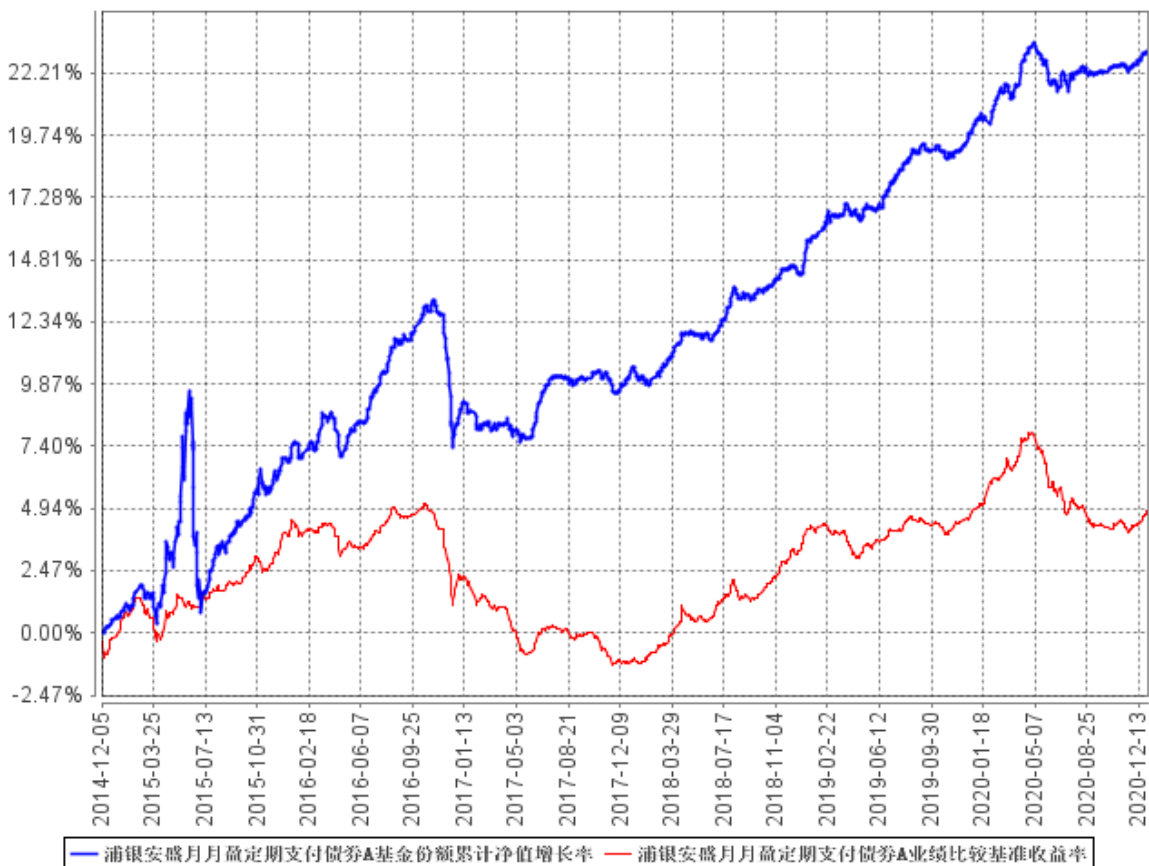
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.65%	0.04%	0.64%	0.04%	0.01%	0.00%
过去六个月	1.15%	0.06%	-0.85%	0.07%	2.00%	-0.01%
过去一年	2.41%	0.08%	-0.06%	0.09%	2.47%	-0.01%
过去三年	11.60%	0.07%	6.09%	0.07%	5.51%	0.00%
过去五年	15.15%	0.09%	0.83%	0.08%	14.32%	0.01%
自基金合同生效起至今	23.10%	0.16%	4.85%	0.08%	18.25%	0.08%

浦银安盛月月盈定期支付债券 C

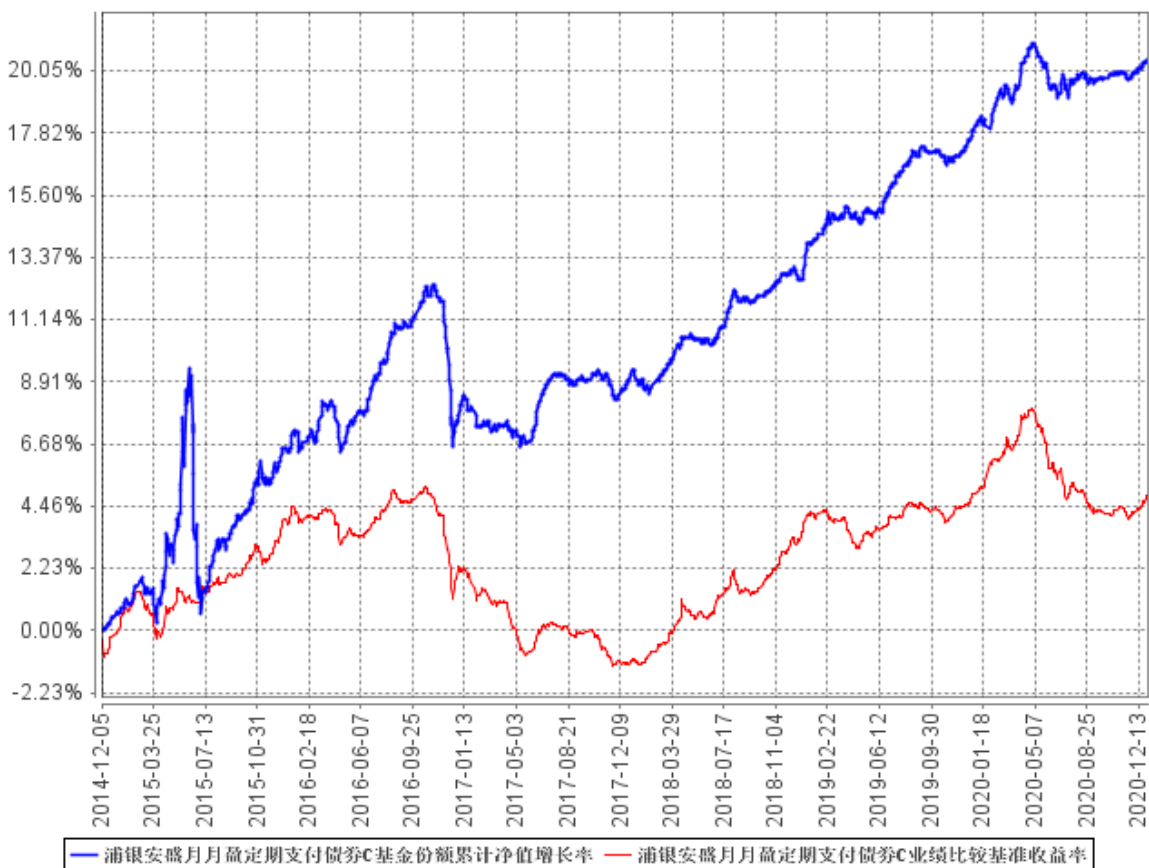
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.58%	0.04%	0.64%	0.04%	-0.06%	0.00%
过去六个月	1.01%	0.07%	-0.85%	0.07%	1.86%	0.00%
过去一年	2.12%	0.08%	-0.06%	0.09%	2.18%	-0.01%
过去三年	10.45%	0.07%	6.09%	0.07%	4.36%	0.00%
过去五年	13.15%	0.09%	0.83%	0.08%	12.32%	0.01%
自基金合同生效起至今	20.50%	0.17%	4.85%	0.08%	15.65%	0.09%

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

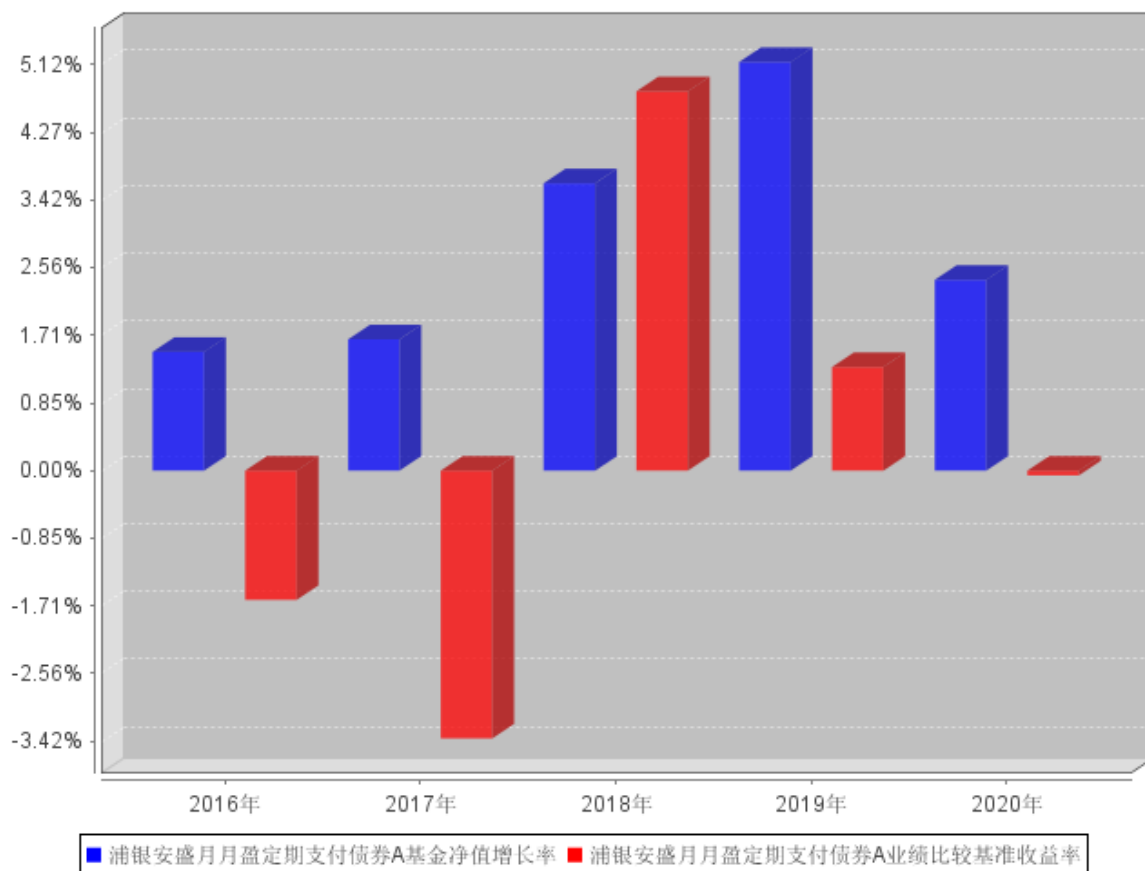


浦银安盛月月盈定期支付债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

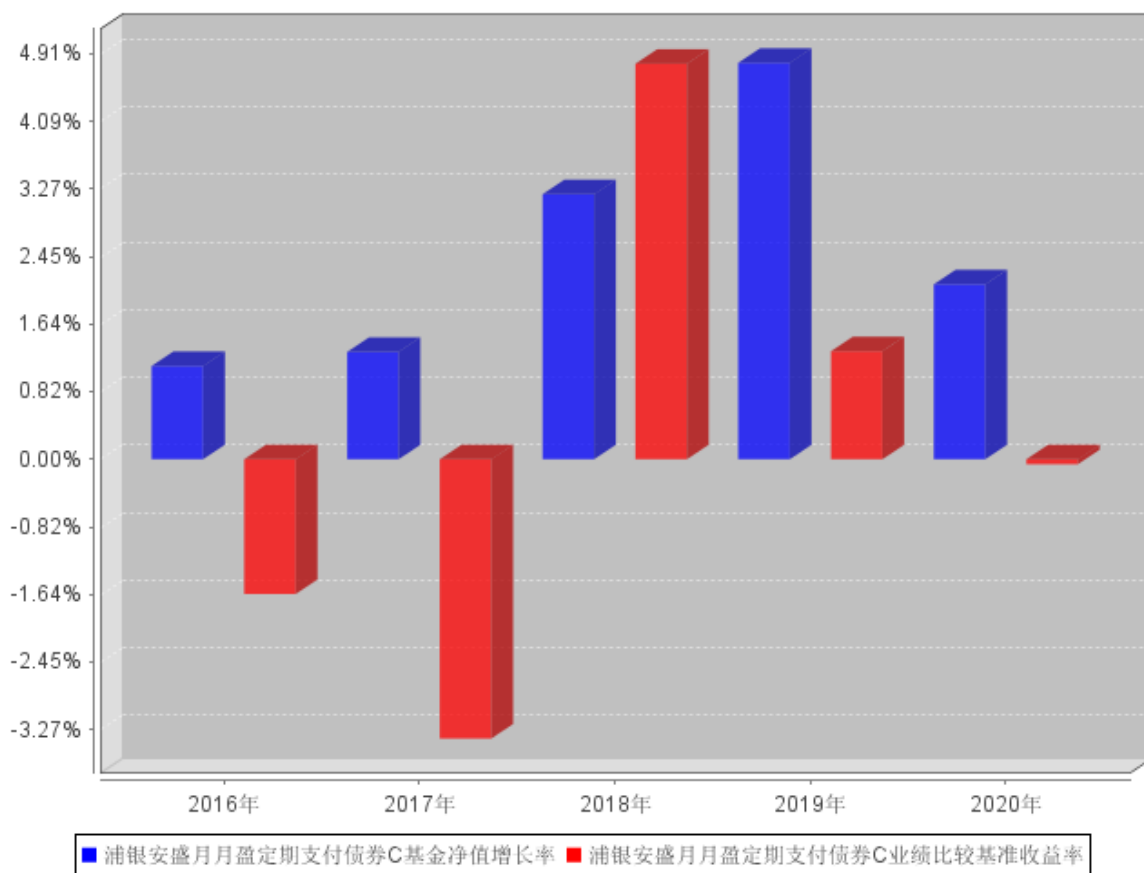


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浦银安盛月月盈定期支付债券A过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



浦银安盛月月盈定期支付债券C过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行过利润分配。

§ 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 12 月 31 日止，浦银安盛旗下共管理 72 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、浦银安盛普嘉 87 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、浦银安盛安远回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛价值精选混合型证券投资基金、浦银安盛普华 66 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛普天纯债债券型证券投资基金、浦银安盛普庆纯债债券型证券投资基金、浦银安盛睿和优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛中债 3-5 年农发行债券指数证券投资基金、浦银安盛盛毅一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金和浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）。

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、XBRL 系统、反洗钱系统等。这些系统也主要是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		
刘大巍	公司旗下部分基金的基金经理。	2017年4月17日	-	10	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。2019年3月至2020年6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。2019年5月至2020年6月担

					任浦银安盛双债增强债券型证券投资基金基金经理。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以及浦银安盛中短债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。
杜雪川	公司旗下固定收益类基金基金经理助理	2018年4月4日	2020年9月18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 日调岗担任固定收益类基金经理助理。
郑双超	公司旗下固定收益类基金基金经理助理	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固定收益类基金经理助理。

注: 1、本基金基金经理及助理的任职日期为公司决定的聘任日期,离任日期为公司决定的解聘日期。

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 公平交易制度和控制方法

管理人制定了《浦银安盛基金管理有限公司公平交易管理规定》,并进行了多次修订。现行公平交易管理规定分为总则、实现公平交易的具体措施、公平交易监控与实施效果评估、公平交易的报告和信息披露、隔离及保密、附则等六部分。公平交易管理规定从投资决策、研究支持、交

易实施、监控与评估、报告与披露等各个环节，预防和发现可能违反公平交易的异常情况，并予以及时纠正与改进。

管理人用于公平交易控制方法包括：

- 公司建立严格的投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；
- 相对所有组合建立并使用统一的、系统化的研究平台；
- 明确了投资决策委员会、投资总监、投资组合经理三级授权体系；
- 要求同一基金经理管理的多个组合下达投资指令应尽量“同时同价”；
- 严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；
- 执行投资交易系统中的公平交易程序；
- 银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配严格依照制度和程序规范进行，并对该分配过程进行监控；
- 定期对投资目标和投资策略类似的投资组合的业绩表现进行分析、归因和评估；
- 对不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内、10 日内）管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。分析如发现有涉嫌不公平的交易，投资组合经理及交易主管对该情况需提供详细的原因说明，并将检查结果向公司管理层和督察长汇报。同时改进公平交易管理方法及流程。
- 其他能够防范公平交易异常情况的有效方式。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。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 and 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、债券交易情况进行分析，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投资标的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；另一方面是公司对于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。

4.3.3 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

20 年初开始，虽然新冠疫情已经开始蔓延，但尚未引起足够重视，市场对于库存周期见底反弹仍然有较强的预期，央行货币政策也早已经转向中性，因此本账户在年初保持了较低的仓位和久期，春节期间，疫情爆发的程度和扩散的速度超出所有人预期，春节后央行迅速介入，向市场超额投放流动性，同时市场开始对于全年的经济增速心存疑虑，债券市场收益率在节后第一个交易日即快速下行，我们认为疫情带来的影响难以预测，不但会对实体经济产生重大的负面影响，还会对金融市场的流动性产生不可预测的冲击，因此央行对流动性的呵护会较市场预期更大，本组合在节后第一周大幅增加了久期和仓位，后续的市场走势证明该不确定性对市场的冲击远较预期更强，在此期间，本组合保持了净值快速稳定的增长。

进入二季度，受到全球流动性极度宽松的影响，各种金融类资产都大幅上涨，而国内疫情虽然时有反复，但已经逐步得到有效控制，统计局发布的各项数据显示经济基本面收到的冲击并未如预期强烈，尤其是外贸数据受到出口替代的推动表现亮眼，央行也开始逐步回收前期投放的流动性，考虑到股市的赚钱效应和相对偏低的债券收益率水平，本组合逐步降低了仓位和久期，同时增加了部分可转债仓位，但由于市场调整速度较快，在此期间组合净值还是出现了较大的调整。

下半年开始，债券市场在疫情的反复和基本面数据的波动影响下，收益率震荡上行，在此期间本组合维持了偏低的仓位和久期，保证了组合净值的稳定，考虑到债券市场在年末通常会出现跨年行情，12 月开始组合适当增加了久期和仓位，也在最后一个月获得了较好的收益。

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月月盈定期支付债券 A 基金份额净值为 1.231 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.41%；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 1.205 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.12%；同期业绩比较基准收益率为-0.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年的债券市场，基本上来看，全球疫情已经开始逐步得到控制，尤其是美国为主的发达国家，随着新冠疫苗的普及，市场对于经济复苏的预期开始增强；国内经济增长从去年下

半年开始已经逐步摆脱了疫情的冲击，加上货币政策和财政政策的双重支持，预计今年会稳中有升。

货币政策来看，美国已经开始放慢了货币宽松的步伐，货币政策进入稳定期，并且已经开始讨论加息的可能性，国内监管部门已经明确提出了货币政策不急转弯的说法，意味着转向已经是趋势，不同之处在于转向的速度和幅度；加之前期极度的货币宽松引发的通胀预期和房地产市场有泡沫化的迹象，都不支持货币政策继续前期的宽松环境。

最后从债券市场的绝对收益率水平来看，当前 10 年期国债收益率处于历史中位数偏低水平，历年年初在此收益率水平上都很难看到当年出现牛市行情。

考虑到货币政策紧缩的背景下，债券市场难有表现，我们认为 21 年的债券市场更可能表现出窄幅震荡的走势。货币政策虽然不支持收益率大幅下行，但从社融增速走势来看，也已经有见顶回落的迹象，经济增速受到信用收缩的影响，也难以看到大幅反弹的情况，因此债券收益率的上行幅度也受到了基本面的制约。总的来说，货币政策在 21 年会表现的更具针对性和灵活性，债券市场难有趋势性行情。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》等有关法规诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，强化风险及合规管理，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金份额持有人的合法权益。

2020 年以来，公司强化风险意识，增强风险防范能力，促进公司持续、健康、稳定地高质量发展，充分保护投资者的利益，维护公司股东的合法权益，依照法律法规及监管部门的要求，结合公司实际业务开展情况，制定和修订完善了一系列制度流程体系，建立了全面合规和风险管理机制。今年以来，公司各项合规风控审计管理方面总体上得到了良好的控制，各项控制措施切实而有效，年内未发生重大违规及风险事件。

在公司董事会的指导、管理层的支持和各部门的密切配合下，合规风控审计工作紧紧围绕公司的经营目标和计划，以及公司的特点和现状，扎扎实实地开展。2020 年，合规风控工作内容涵盖了制度内控、法律合规、信息披露、反洗钱、风险监控、绩效评估、内部审计等工作。

法律合规方面，新规落实、法律事务、合规审核、合规检查、信息披露、反洗钱等各项工作均有序开展，公司各项合规记录良好，为公司各项业务的开展打下了坚实基础。

风险管理方面，对信用风险、流动性风险、市场风险、操作风险均建立了完善的二层风险监控机制，进一步开发并优化量化风险评估模型，利用数字化、专业化管理提升风险评估、监测及预警效能，并提升风险化解及处置能力。

审计方面，按照审计计划完成了法规要求的常规审计项目和根据风险导向开展的重要业务领域的专项审计项目，另外还配合会计师事务所开展了重要的外部审计工作。今后将继续秉持以风险为导向的重点业务领域专项审计，同时兼顾对公司所有业务循环的审计覆盖面。

4.7 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》。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以在每个运作周期结束后，于开放期内进行收益分配，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

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。

4.9 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、本报告期内超过连续六十个工作日基金资产净值低于五千万，本基金管理人已按规定向中

国证监会进行了报告并提交了解决方案。

§ 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

本报告期，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、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、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

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 25059 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金(以下简称“浦银安盛月月盈定期支付债券”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了浦银安盛月月盈定期支付债券 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于浦银安盛月月盈定期支付债券,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	我们提醒财务报表使用者关注,如财务报表附注“7.4.2 会计报表的编制基础”所述,浦银安盛月月盈定期支付债券的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)拟在资产负债表日后清算浦银安盛月月盈定期支付债券的剩余资产。因此,上述浦银安盛月月盈定期支付债券的财务报表以清算基础编制。该事项不影响已发表的审计意见。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,

	<p>使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估浦银安盛月月盈定期支付债券的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算浦银安盛月月盈定期支付债券、终止运营或别无其他现实的选择。参见财务报表附注 7.4.2 有关以清算基础编制财务报表的说明。</p> <p>基金管理人治理层负责监督浦银安盛月月盈定期支付债券的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p>

	<p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能对导致对浦银安盛月月盈定期支付债券持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	薛竞 赵钰
会计师事务所的地址	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	16,795.62	61,634.25
结算备付金		124,231.18	35,055.17
存出保证金		923.31	12,917.93
交易性金融资产	7.4.7.2	23,371,347.60	23,274,255.40
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		23,371,347.60	23,274,255.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,000,000.00	-
应收证券清算款		28,619.43	-
应收利息	7.4.7.5	373,453.95	400,274.98
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		24,915,371.09	23,784,137.73
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		3,730,000.00	2,200,000.00
应付证券清算款		39.93	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		12,510.61	12,742.75
应付托管费		3,574.45	3,640.78
应付销售服务费		387.09	393.75
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		1,582.18	1,157.27
应付利息		1,010.21	1,550.37

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	39,000.00	69,000.00
负债合计		3,788,104.47	2,288,484.92
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	17,179,855.91	17,908,189.90
未分配利润	7.4.7.10	3,947,410.71	3,587,462.91
所有者权益合计		21,127,266.62	21,495,652.81
负债和所有者权益总计		24,915,371.09	23,784,137.73

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额为 17,179,855.91 份，其中 A 类基金份额净值 1.231 元，A 类基金份额 16,094,825.70 份；C 类基金份额净值 1.205 元，C 类基金份额 1,085,030.21 份。

7.2 利润表

会计主体：浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		938,841.46	3,061,108.01
1.利息收入		1,009,763.06	2,128,276.25
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,705.19	9,989.30
债券利息收入		1,003,895.34	2,092,410.46
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,162.53	25,876.49
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		174,727.09	585,724.34
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	174,727.09	585,724.34
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-245,648.69	347,107.42
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-

列)			
减：二、费用		419,378.36	817,295.94
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	149,691.79	291,878.25
2. 托管费	7.4.10.2.2	42,769.05	83,393.69
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	4,628.51	24,593.07
4. 交易费用	7.4.7.19	110.82	1,754.88
5. 利息支出		151,983.85	305,939.37
其中：卖出回购金融资产支出		151,983.85	305,939.37
6. 税金及附加		2,692.34	2,625.72
7. 其他费用	7.4.7.20	67,502.00	107,110.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		519,463.10	2,243,812.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		519,463.10	2,243,812.07

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	17,908,189.90	3,587,462.91	21,495,652.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	519,463.10	519,463.10
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）	-728,333.99	-159,515.30	-887,849.29
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-728,333.99	-159,515.30	-887,849.29
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	17,179,855.91	3,947,410.71	21,127,266.62

项目	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
金净值)			
一、期初所有者权益(基金净值)	51,197,899.45	7,148,979.54	58,346,878.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,243,812.07	2,243,812.07
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)	-33,289,709.55	-5,805,328.70	-39,095,038.25
其中: 1. 基金申购款	13,381.44	2,383.90	15,765.34
2. 基金赎回款	-33,303,090.99	-5,807,712.60	-39,110,803.59
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)	17,908,189.90	3,587,462.91	21,495,652.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金(原名为“浦银安盛月月盈安心养老定期支付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[2014]130号文《关于核准浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金募集的批复》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《浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金基金合同》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人民币300,138,824.58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(2014)第722号验资报告予以验

证。经向中国证监会备案,《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合同》于 2014 年 12 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 300,244,255.12 份,其中认购资金利息折合 105,430.54 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,基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金基金合同》和《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》的规定,本基金根据认购、申购费用收取方式的不同,基金份额分为不同类别:在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用的为 A 类基金份额;不收取认购、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。

本基金以定期开放方式运作,即本基金以运作周期和自由开放期相结合的方式运作。本基金以 18 个月为一个运作周期,每个运作周期为自基金合同生效日(包括基金合同生效日)或每个自由开放期结束之日次日起(包括该日)至 18 个月后的对日的前一日止。在每个运作周期结束后进入自由开放期。本基金的每个自由开放期为 5 至 20 个工作日。自由开放期的具体期间由基金管理人在上一个运作周期结束前公告说明。在自由开放期间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。

本基金按照基金合同的约定,每月定期通过自动赎回基金份额向基金份额持有人支付一定现金,即本基金以约定的定期支付基准日的基金份额净值为基础,按照《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》约定的年化现金支付比率,计算基金份额持有人当期可获得支付的现金,并自动赎回基金份额持有人所持的对应金额的基金份额,以该自动赎回的资金向基金份额持有人进行现金支付。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券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固定收益证券品种(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场的新股申购或增发新股。本基金各类资产的投资比例为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%,在每个开放期的前 3 个月和后 3 个月以及开放期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占

基金资产净值的比例不受限制，但在开放期本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券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。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数。

本财务报表由本基金的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司于 2021 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 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》、《浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金合同》以及基金管理人浦银安盛基金管理有限公司于 2021 年 1 月 28 日发布的《关于浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于 2021 年 1 月 29 日进入财产清算期，详情参见附注 7.4.8.2 资产负债表日后事项，因此本基金财务报表以清算基础编制。于 2020 年 12 月 31 日，所有资产以可收回金额和账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.3.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.3.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.3.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动

计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.3.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

于本报告期内及上年度可比期间，对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。于本报告期末，各项金融资产以可收回金额和账面价值孰低计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.3.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价

格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.3.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.3.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.3.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.3.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除

在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.3.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.3.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.3.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.3.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.4.3 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。

7.4.5 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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。

7.4.6 重要财务报表项目的说明

7.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
活期存款	16,795.62	61,634.25
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：	16,795.62	61,634.25

7.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2020 年 12 月 31 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	23,519,871.15	23,371,347.60	-148,523.55
	银行间市场	-	-	-
	合计	23,519,871.15	23,371,347.60	-148,523.55
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		23,519,871.15	23,371,347.60	-148,523.55
项目	上年度末 2019年12月31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	23,177,130.26	23,274,255.40	97,125.14
	银行间市场	-	-	-
	合计	23,177,130.26	23,274,255.40	97,125.14
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		23,177,130.26	23,274,255.40	97,125.14

7.4.6.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.6.4 买入返售金融资产

7.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,000,000.00	-
项目	上年度末 2019年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	3.66	6.78
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	55.90	15.80
应收债券利息	373,393.99	400,246.60
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	0.40	5.80
合计	373,453.95	400,274.98

7.4.6.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.6.7 应付交易费用

注：本基金本报告期末及上年度末均无应付交易费用。

7.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31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	39,000.00	69,000.00
合计	39,000.00	69,000.00

7.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

浦银安盛月月盈定期支付债券 A

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	16,782,326.05	16,782,326.05
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-687,500.35	-687,500.35
- 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	16,094,825.70	16,094,825.70

金额单位：人民币元

浦银安盛月月盈定期支付债券 C		
项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,125,863.85	1,125,863.85
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-40,833.64	-40,833.64
- 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	1,085,030.21	1,085,030.21

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

浦银安盛月月盈定期支付债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,122,837.85	262,022.92	3,384,860.77
本期利润	722,139.18	-230,452.86	491,686.32
本期基金份额交易产生的变动数	-142,929.69	-8,566.87	-151,496.56
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-142,929.69	-8,566.87	-151,496.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,702,047.34	23,003.19	3,725,050.53

单位：人民币元

浦银安盛月月盈定期支付债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	185,396.35	17,205.79	202,602.14
本期利润	42,972.61	-15,195.83	27,776.78
本期基金份额交易产生的变动数	-7,520.27	-498.47	-8,018.74
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-7,520.27	-498.47	-8,018.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	220,848.69	1,511.49	222,360.18

7.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	718.34	2,832.20
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	2,939.23	7,001.81
其他	47.62	155.29
合计	3,705.19	9,989.30

7.4.6.12 股票投资收益

7.4.6.12.1 股票投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益。

7.4.6.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益-买卖股票差价收入。

7.4.6.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益-证券出借差价收入。

7.4.6.13 债券投资收益

7.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31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	174,727.09	585,724.34
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	174,727.09	585,724.34

7.4.6.13.2 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	9,774,056.34	120,911,901.96
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,418,705.88	118,346,187.06
减：应收利息总额	180,623.37	1,979,990.56
买卖债券差价收入	174,727.09	585,724.34

7.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.6.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.6.14 贵金属投资收益

7.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.6.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

7.4.6.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-赎回差价收入。

7.4.6.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-申购差价收入。

7.4.6.15 衍生工具收益**7.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.6.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.6.16 股利收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股利收益。

7.4.6.17 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
1. 交易性金融资产	-245,648.69	347,107.42
——股票投资	-	-
——债券投资	-245,648.69	347,107.42
——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	-245,648.69	347,107.42

7.4.6.18 其他收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无其他收入。

7.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12
----	-----------------------	------------------------------

	12 月 31 日	月 31 日
交易所市场交易费用	110.82	597.38
银行间市场交易费用	-	1,157.50
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	110.82	1,754.88

7.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00	60,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
其他	1,200.00	1,200.00
银行费用	302.00	910.96
债券帐户维护费	36,000.00	45,000.00
合计	67,502.00	107,110.96

7.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.7.2 资产负债表日后事项

根据《浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金基金合同》、以及基金管理人浦银安盛基金管理有限公司于 2021 年 1 月 28 日发布的《关于浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于 2021 年 1 月 29 日进入财产清算程序。

7.4.8 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
浦银安盛基金管理有限公司（“浦银安盛”）	基金管理人、基金销售机构
上海银行股份有限公司（“上海银行”）	基金托管人、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海	基金管理人的股东、基金销售机构

浦东发展银行”)	
法国安盛投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海国盛集团资产有限公司	基金管理人的股东
上海浦银安盛资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	149,691.79	291,878.25
其中：支付销售机构的客户维护费	59,164.37	116,807.49

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 0.70%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 × 0.70% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	42,769.05	83,393.69

注：支付基金托管人上海银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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 × 0.20%/ 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020年1月1日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
上海银行股份有限公司	0.00	370.79	370.79
上海浦东发展银行股份有限公司	0.00	2,980.69	2,980.69
浦银安盛基金管理有限公司	0.00	376.88	376.88
合计	0.00	3,728.36	3,728.36
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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
上海银行股份有限公司	0.00	484.10	484.10
上海浦东发展银行股份有限公司	0.00	22,067.84	22,067.84
浦银安盛基金管理有限公司	0.00	384.20	384.20
合计	0.00	22,936.14	22,936.14

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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 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

7.4.8.4.1 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

注：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。

7.4.8.4.2 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

注：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。

7.4.8.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人在本报告期与上年度可比期间均未持有本基金。

7.4.8.5.2 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

注：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本基金。

7.4.8.6 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		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年12月31日		2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海银行	16,795.62	718.34	61,634.25	2,832.20

注：本基金的银行存款由基金托管人上海银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.10 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金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。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 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 3,730,000.00 元，截至 2021 年 1 月 11 日先后到期。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。

7.4.10.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末及上年度末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.11 金融工具风险及管理

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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券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固定收益证券品种（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不从二级市场买入股票或权证，也不参与一级市场新股申购或股票增发。

基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，在每个开放期的前 3 个月和后 3 个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券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。

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。

7.4.11.1 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。

7.4.11.2 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上海银行，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。

7.4.11.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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债券投资。

7.4.11.2.2 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。

7.4.11.2.3 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。

7.4.11.2.4 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12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	20,608,787.60	20,377,115.40
AAA 以下	357,000.00	846,140.00
未评级	2,405,560.00	2,051,000.00
合计	23,371,347.60	23,274,255.40

注：于2020年12月31日，未评级部分为国债、政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构。

7.4.11.2.5 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。

7.4.11.2.6 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投资。

7.4.11.3 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 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 3,730,000.00 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。

7.4.11.3.1 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 12 月 31 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。

7.4.11.4 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。

7.4.11.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

7.4.11.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	16,795.62	-	-	-	16,795.62
结算备付金	124,231.18	-	-	-	124,231.18
存出保证金	923.31	-	-	-	923.31
交易性金融资产	15,513,737.60	7,244,980.00	612,630.00	-	23,371,347.60
买入返售金融资产	1,000,000.00	-	-	-	1,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	28,619.43	28,619.43
应收利息	-	-	-	-373,453.95	373,453.95

资产总计	16,655,687.71	7,244,980.00	612,630.00	402,073.38	24,915,371.09
负债					
卖出回购金 融资产款	3,730,000.00	-	-	-	3,730,000.00
应付证券清 算款	-	-	-	39.93	39.93
应付管理人 报酬	-	-	-	12,510.61	12,510.61
应付托管费	-	-	-	3,574.45	3,574.45
应付销售服 务费	-	-	-	387.09	387.09
应付利息	-	-	-	1,010.21	1,010.21
应交税费	-	-	-	1,582.18	1,582.18
其他负债	-	-	-	39,000.00	39,000.00
负债总计	3,730,000.00	-	-	58,104.47	3,788,104.47
利率敏感度 缺口	12,925,687.71	7,244,980.00	612,630.00	343,968.91	21,127,266.62
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	61,634.25	-	-	-	61,634.25
结算备付金	35,055.17	-	-	-	35,055.17
存出保证金	12,917.93	-	-	-	12,917.93
交易性金融 资产	3,951,107.00	17,833,229.00	1,489,919.40	-	23,274,255.40
应收利息	-	-	-	400,274.98	400,274.98
资产总计	4,060,714.35	17,833,229.00	1,489,919.40	400,274.98	23,784,137.73
负债					
卖出回购金 融资产款	2,200,000.00	-	-	-	2,200,000.00
应付管理人 报酬	-	-	-	12,742.75	12,742.75
应付托管费	-	-	-	3,640.78	3,640.78
应付销售服 务费	-	-	-	393.75	393.75
应付利息	-	-	-	1,550.37	1,550.37
应交税费	-	-	-	1,157.27	1,157.27
其他负债	-	-	-	69,000.00	69,000.00
负债总计	2,200,000.00	-	-	88,484.92	2,288,484.92
利率敏感度 缺口	1,860,714.35	17,833,229.00	1,489,919.40	311,790.06	21,495,652.81

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早

者予以分类。

7.4.11.4.1.2 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12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-69,258.64	-105,623.36
市场利率下降 25 个基点	70,461.04	106,556.75	

7.4.11.4.2 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。

7.4.11.4.3 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。

7.4.12 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 667,230.00 元,属于第二层次的余额为 22,704,117.60 元,无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日:第一层次 1,798,099.40 元,第二层次 21,476,156.00 元,无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 其他

除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	23,371,347.60	93.80
	其中：债券	23,371,347.60	93.80
	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	1,000,000.00	4.01
	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	141,026.80	0.57
8	其他各项资产	402,996.69	1.62
9	合计	24,915,371.09	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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。

8.2.2 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。

8.3 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.4.2 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.5 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	371,760.00	1.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,073,200.00	24.01
	其中：政策性金融债	2,033,800.00	9.63
4	企业债券	17,259,157.60	81.69
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	667,230.00	3.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	23,371,347.60	110.62

8.6 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	018006	国开 1702	20,000	2,033,800.00	9.63
2	122150	12 石化 02	18,000	1,840,680.00	8.71
3	143464	18 海通 04	15,000	1,508,100.00	7.14
4	155366	19 浦集 01	14,000	1,413,440.00	6.69
5	143807	18 电投 07	14,000	1,412,600.00	6.69

8.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.10.3 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除中国国家开发银行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。

2020 年 4 月 24 日，国家开发银行公告，因未依法履行其他职责，分支行高管王庆丰被中国银行保险监督管理委员会海南监管局于 2020-04-20 依据相关法规给予：公开批评处分决定。

本基金管理人的研究部门对中国国家开发银行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。

8.11.2 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不存在超出基金合同规定的备选股票库范围的情况。

8.11.3 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	923.31
2	应收证券清算款	28,619.43
3	应收股利	-
4	应收利息	373,453.95
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	402,996.69

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113026	核能转债	310,230.00	1.47
2	128109	楚江转债	119,020.00	0.56

3	110043	无锡转债	116,130.00	0.55
---	--------	------	------------	------

8.11.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
浦银安盛月月盈定期支付债券 A	276	58,314.59	0.00	0.00%	16,094,825.70	100.00%
浦银安盛月月盈定期支付债券 C	57	19,035.62	0.00	0.00%	1,085,030.21	100.00%
合计	333	51,591.16	0.00	0.00%	17,179,855.91	100.00%

9.2 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	浦银安盛月月盈定期支付债券 A	9.00	0.00%
	浦银安盛月月盈定期支付债券 C	17.77	0.00%
	合计	26.77	0.00%

9.3 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	浦银安盛月月盈定期	0

投资和研究部门负责人持有本开放式基金	支付债券 A	
	浦银安盛月月盈定期支付债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	浦银安盛月月盈定期支付债券 A	0
	浦银安盛月月盈定期支付债券 C	0
	合计	0

§ 10 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
基金合同生效日（2014 年 12 月 5 日）基金份额总额	281,931,861.35	18,312,393.77
本报告期期初基金份额总额	16,782,326.05	1,125,863.85
本报告期基金总申购份额	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	687,500.35	40,833.64
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	16,094,825.70	1,085,030.21

注：本基金按照基金合同的约定，每月定期通过自动赎回基金份额向基金份额持有人支付一定现金。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，本基金管理人重大人事变动如下：

2020 年 7 月 24 日，本基金管理人发布了《浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第五届董事会第一次会议审议通过，聘任邓列军先生担任本基金管理人首席信息官。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门发生的重大人事变动如下：

2020 年 3 月，许卿斌同志不再担任上海银行股份有限公司资产托管部总经理职务。上述人事变动已进行备案、公告。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 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。本报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 30,000.00 元。

11.6 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，管理人及其高级管理人员、基金托管人的托管业务部门及其相关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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	
海通证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

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：

本基金本报告期无交易单元变更。

11.7.2 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
海通证券	13,759,376.38	85.12%	400,300,000.00	93.69%	-	-
招商证券	2,405,326.58	14.88%	26,945,000.00	6.31%	-	-

11.8 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	浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金 2020 年定期支付表 (1 月)	指定网站	2020 年 1 月 16 日
2	浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	指定网站	2020 年 1 月 20 日
3	浦银安盛月月盈定期支付债	指定网站	2020 年 2 月 18 日

	券型证投资基金 2020 年定期支付表 (2 月)		
4	浦银安盛月月盈定期支付债券型证投资基金 2020 年定期支付表 (3 月)	指定网站	2020 年 3 月 17 日
5	关于浦银安盛基金管理有限公司旗下部分基金在同花顺基金开通基金转换业务的公告	报刊及指定网站	2020 年 3 月 23 日
6	浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金 2019 年年度报告	指定网站	2020 年 3 月 31 日
7	浦银安盛月月盈定期支付债券型证投资基金 2020 年定期支付表 (4 月)	指定网站	2020 年 4 月 16 日
8	浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	指定网站	2020 年 4 月 21 日
9	浦银安盛月月盈定期支付债券型证投资基金 2020 年定期支付表 (5 月)	指定网站	2020 年 5 月 18 日
10	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金在北京百度百盈基金销售有限公司开通基金转换业务及参加其费率优惠活动的公告	报刊及指定网站	2020 年 6 月 6 日
11	浦银安盛月月盈定期支付债券型证投资基金 2020 年定期支付表 (6 月)	指定网站	2020 年 6 月 16 日
12	浦银安盛月月盈定期支付债券型证投资基金 2020 年定期支付表 (7 月)	指定网站	2020 年 7 月 16 日
13	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摘要 (更新) 2020 年第 1 号	指定网站	2020 年 7 月 18 日
14	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摘正文 (更新) 2020 年第 1 号	指定网站	2020 年 7 月 18 日
15	浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	指定网站	2020 年 7 月 21 日
16	浦银安盛月月盈定期支付债	指定网站	2020 年 8 月 18 日

	券型证券投资基金 2020 年定期支付表（8 月）		
17	浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金 2020 年中期报告	指定网站	2020 年 8 月 29 日
18	浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金产品资料概要（更新）	指定网站	2020 年 8 月 31 日
19	浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金 2020 年定期支付表（9 月）	指定网站	2020 年 9 月 16 日
20	浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金 2020 年定期支付表（10 月）	指定网站	2020 年 1 月 16 日
21	浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	指定网站	2020 年 10 月 28 日
22	浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金 2020 年定期支付表（11 月）	指定网站	2020 年 11 月 17 日
23	浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金 2020 年定期支付表（12 月）	指定网站	2020 年 12 月 16 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 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。

13.3 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

2021 年 3 月 31 日