

浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金2015年半年度报告

2015年06月30日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

送出日期：2015年08月25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。本半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2015年8月21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2015年1月1日起至6月30日止。

§1	重要提示及目录	2
§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	主要财务指标和基金净值表现	6
	3.1 主要会计数据和财务指标	6
	3.2 基金净值表现	7
§4	管理人报告	9
	4.1 基金管理人及基金经理情况	9
	4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
	4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
	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	13
	4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
	4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
	4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
	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	14
§5	托管人报告	14
	5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
	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	14
	5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6	半年度财务会计报告（未经审计）	15
	6.1 资产负债表	15
	6.2 利润表	16
	6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
	6.4 报表附注	19
§7	投资组合报告	45
	7.1 期末基金资产组合情况	45
	7.2 期末按行业分类的股票投资组合	46
	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	47
	7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
	7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
	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股指期货交易情况说明	50
	7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
	7.12 投资组合报告附注	50
§8	基金份额持有人信息	51
	8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
	8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	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情况	52
§9	开放式基金份额变动	52
§10	重大事件揭示	53
	10.1 基金份额持有人大会决议	53
	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	53
	10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
	10.4 基金投资策略的改变	53

10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况	53
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8	其他重大事件	54
§11	影响投资者决策的其他重要信息	56
§12	备查文件目录	56
12.1	备查文件目录	56
12.2	存放地点	56
12.3	查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金	
基金简称	浦银安盛月月盈定期支付债券	
基金主代码	519128	
基金运作方式	契约型定期开放式	
基金合同生效日	2014年12月05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	294,318,520.20	
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
下属分级基金的基金代码	519128	519129
报告期末下属分级基金的份额总额	276,359,946.66	17,958,573.54

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	叶忆红
	联系电话	021-23212888	021-68475888
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	yeyh@bankofshanghai.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95594
传真		021-23212985	021-68476936
注册地址		上海市浦东新区浦东大道981号3幢316室	上海市银城中路168号
办公地址		上海市淮海中路381号中环广场38楼	上海市银城中路168号
邮政编码		200020	200120
法定代表人		姜明生	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》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金半年度报告备置地点	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
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

单位：人民币元

	报告期（2015年01月01日-2015年06月30日）
--	------------------------------

3.1.1 期间数据和指标	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	5,865,322.73	348,298.40
本期利润	4,590,738.70	265,678.29
加权平均基金份额本期利润	0.0164	0.0146
本期基金加权平均净值利润率	1.59%	1.42%
本期基金份额净值增长率	1.59%	1.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年06月30日)	
期末可供分配利润	5,906,935.60	347,482.97
期末可供分配基金份额利润	0.0214	0.0193
期末基金资产净值	282,266,882.26	18,306,056.51
期末基金份额净值	1.0210	1.0190
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	2.10%	1.90%

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

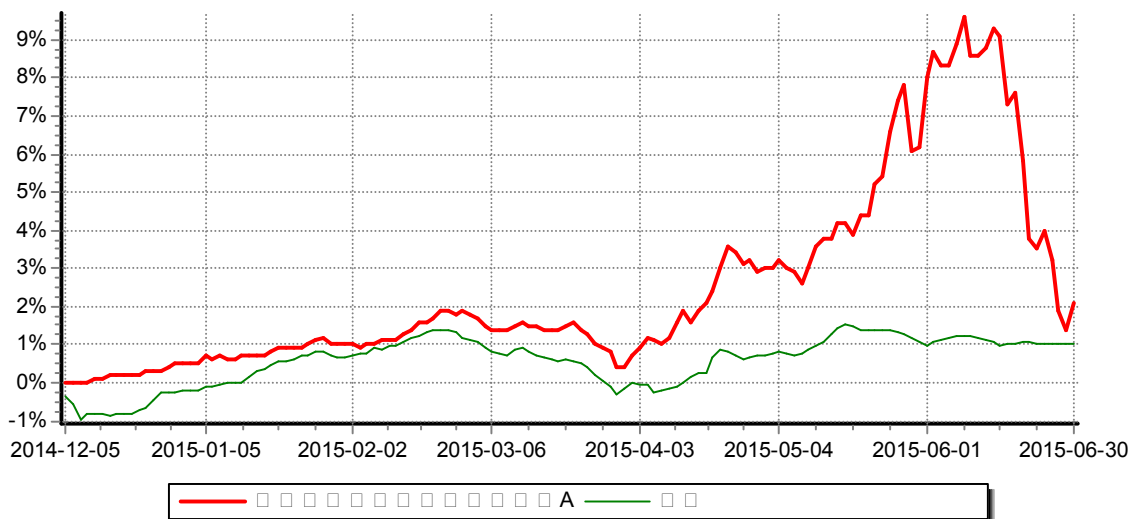
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

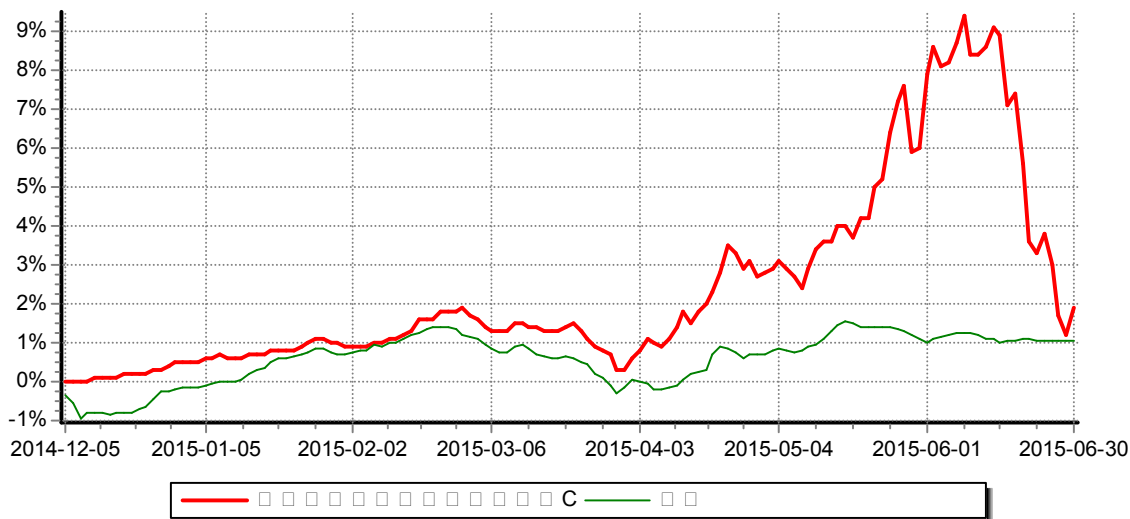
阶段 (浦银安盛月月盈定期支付债券A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.86%	0.92%	-0.08%	0.05%	-3.78%	0.87%
过去三个月	1.69%	0.65%	1.35%	0.10%	0.34%	0.55%
过去六个月	1.59%	0.47%	1.20%	0.10%	0.39%	0.37%
自基金合同生效起至	2.10%	0.44%	1.01%	0.11%	1.09%	0.33%

今						
阶段 (浦银安盛月月盈定期支付债券C)	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	-3.87%	0.93%	-0.08%	0.05%	-3.79%	0.88%
过去三个月	1.60%	0.66%	1.35%	0.10%	0.25%	0.56%
过去六个月	1.39%	0.48%	1.20%	0.10%	0.19%	0.38%
自基金合同生效起至今	1.90%	0.44%	1.01%	0.11%	0.89%	0.33%

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

浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2014年12月05日-2015年06月30日)





注：1、本基金基金合同生效日为2014年12月5日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。

2、根据基金合同第十三部分第四条规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。本基金建仓期为2014年12月5日至2015年6月4日，建仓期结束时本基金投资组合比例符合本基金基金合同约定。

§ 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管理有限公司，公司总部设在上海，注册资本为人民币2.8亿元，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、资产管理和证监会许可的其他业务。

截至2015年6月30日止，浦银安盛旗下共管理19只基金，即浦银安盛价值成长股票型证券投资基金、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、浦银安盛红利精选股票型证券投资基金、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、浦银安盛增利分级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、浦银安盛月月盈安心养老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及浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
薛铮	本公司固定收益投资部总监，公司旗下浦银安盛优化收益债券基金、浦银安盛幸福回报债券基金、	2014年12月05日	—	9	薛铮先生，上海财经大学数量经济学硕士。2006年3月至2009年6月，先后就职于红顶金融研究中心，上海证券有限公司从事固定收益研究工作。2009年7月进入浦银安盛基金管理有限公司，历任固定收益研究员、固定收益基金经理助理、货币基金基金经理等职务。2011年12月起担任浦银安盛稳健增利债券基金（原增利分级债券基金）基金经理。2012年9月

	浦银安盛稳健增利债券基金、浦银安盛6个月债券基金、浦银安盛季季添利债券基金以及浦银安盛月月盈债券基金经理				起兼任浦银安盛幸福回报债券基金基金经理。 2012年11月起，担任本公司固定收益投资部总监。 2013年5月起，兼任浦银安盛6个月定期开放债券基金基金经理。2013年6月起，兼任浦银安盛季季添利债券基金基金经理。 2014年7月起，兼任浦银安盛优化收益债券基金基金经理。2014年12月起，兼任浦银安盛月月盈债券基金基金经理。
姜锡峰	公司旗下固定收益基金经理助理	2015年06月01日	—	4	姜锡峰先生，上海财经大学企业管理专业硕士。曾就职于湘财证券研究所担任固定收益研究员。 2014年3月加盟浦银安盛基金管理有限公司担任固定收益研究员之职。 2015年6月起调至固定收益投资部任固定收益基金经理助理。
丁进	原固定收益类基金经理助理	2014年12月05日	2015年02月06日	10	丁进先生，北京化工大学应用数学专业理学硕士。 2005年7月至2010年10月期间，先后在北京顺泽锋投资咨询公司、新华信国际信息咨询公司从事交易

					模型开发研究、企业信用分析等工作，2010年10月起，在光大证券担任固定收益分析师，从事债券研究、信用产品以及可转债研究。2012年8月加盟浦银安盛基金公司，担任固定收益基金经理助理。丁进于2015年2月6日离职。
--	--	--	--	--	---

注：1、薛铮和丁进作为本基金的首任基金经理和基金经理助理，其任职日期为本基金成立之日。

2、其余的任职日期和离职日期为公司决定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，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

本基金管理人已制定了《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 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。

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中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

上半年的宏观经济走势可以概括为4个字，底部徘徊。在经历了多重刺激之后，各类经济数据没有明显的改善，只有房地产业呈现出复苏的迹象。受资金市场宽松和刺激政策影响，上半年债券市场各品种收益率均出现了一定的下行，债券市场经历了一轮小牛市。上半年资金面、基本面和政策面的利好因素已被市场反应，下半年市场走向将取决于资金面和新的政策催化剂。目前来看，政策仍有进一步放松的空间，预计债券市场行情仍将持续，后期仍有下行空间。在报告期内，基金借力较为宽松的资金面，获取稳定的息差，并择机参与了一些债券品种的资本利得机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期A类净值增长率1.59%，C类净值增长率1.39%，同期业绩比较基准收益率为1.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为宏观经济下半年继续向下寻底的可能性已然不大，但海外流动性收紧带来的资金外流对国内经济会产生一定的负面影响。我们预计接下来仍将陆续会有政策出台，货币政策宽松仍会延续。总的来说，下半年的GDP仍将处在走廊之中，预计走势会相对稳定。稳中偏弱的宏观经济和相对低位的资金利率将有助于下半年债券市场行情的开展。

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分管高管、金融工程部负责人、研究部负责人、合规风控部负责人、基金运营部负责人组成。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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签订了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

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

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。

4.8 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 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、《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》和《浦银安盛月月盈安心养老定期开放债券型证券投资基金托管协议》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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金

报告截止日：2015年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年06月30日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,255,792.25	66,566,829.50
结算备付金		7,833,224.16	—
存出保证金		71,599.12	—
交易性金融资产	6.4.7.2	411,575,574.04	46,868,577.46
其中：股票投资		27,017,300.28	—
基金投资		—	—
债券投资		384,558,273.76	46,868,577.46
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	—	240,000,000.00
应收证券清算款		24,148,934.16	—
应收利息	6.4.7.5	10,989,712.58	442,958.55
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		458,874,836.31	353,878,365.51
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年06月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债		—	—
卖出回购金融资产款		157,699,244.95	—
应付证券清算款		1,784.47	51,797,189.45
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		180,687.72	150,035.79
应付托管费		51,625.06	42,867.36
应付销售服务费		5,502.72	4,574.95
应付交易费用	6.4.7.7	101,605.23	—
应交税费		—	—
应付利息		109,704.23	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	151,743.16	—
负债合计		158,301,897.54	51,994,667.55
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	294,318,520.20	300,244,255.12
未分配利润	6.4.7.10	6,254,418.57	1,639,442.84
所有者权益合计		300,572,938.77	301,883,697.96
负债和所有者权益总计		458,874,836.31	353,878,365.51

注：1、本基金《基金合同》生效日为2014年12月5日，上年度期间为2014年12月5日至2014年12月31日。

2、报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.021元，基金份额总额294,318,520.20份。其中A类基金份额参考净值1.021元，份额总额276,359,946.66份；C类基金份额参考净值1.019元，份额总额17,958,573.54份。

6.2 利润表

会计主体：浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金

本报告期：2015年01月01日-2015年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年01月01日- 2015年06月30日	上年度可比期间 2014年01月01日- 2014年06月30日
一、收入		7,812,297.26	—
1.利息收入		8,347,306.39	—
其中：存款利息收入	6.4.7 .11	109,322.40	—
债券利息收入		7,879,855.04	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		358,128.95	—
其他利息收入		—	—
2.投资收益		822,195.01	—
其中：股票投资收益	6.4.7 .12	5,924,442.75	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7 .13	-5,261,926.33	—
资产支持证券投资收益	6.4.7 .13.3	—	—
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	159,678.59	—
3.公允价值变动收益	6.4.7 .17	-1,357,204.14	—
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		2,955,880.27	—
1. 管理人报酬		1,063,490.05	—
2. 托管费		303,854.28	—
3. 销售服务费		32,401.87	—
4. 交易费用	6.4.7 .19	226,263.06	—
5. 利息支出		1,166,735.25	—
其中：卖出回购金融资产支出		1,166,735.25	—
6. 其他费用	6.4.7 .20	163,135.76	—
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		4,856,416.99	—
减：所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		4,856,416.99	—

注：本基金《基金合同》生效日为2014年12月5日，无上年度可比期间。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金

本报告期：2015年01月01日-2015年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年06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)	300,244,255.12	1,639,442.84	301,883,697.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	4,856,416.99	4,856,416.99

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）	-5,925,734.92	-241,441.26	-6,167,176.18
其中：1.基金申购款	—	—	—
2.基金赎回款	-5,925,734.92	-241,441.26	-6,167,176.18
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）	294,318,520.20	6,254,418.57	300,572,938.77
项 目	上年度可比期间 2014年01月01日-2014年06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)	—	—	—
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	—	—
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）	—	—	—
其中：1.基金申购款	—	—	—
2.基金赎回款	—	—	—
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）	—	—	—

注：本基金《基金合同》生效日为2014年12月5日，无上年度可比期间。

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》批准,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《浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金基金合同》和《浦银安盛月月盈安心养老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《浦银安盛月月盈安心养老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《浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金基金合同》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%。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数。

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<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中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2015年1月1日至2015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2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2015年1月1日起至2015年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

人民币

6.4.4.3 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股票投资和债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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入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其他各类应付款项等。

6.4.4.4 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。

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。

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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别的基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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股票投资和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股票，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[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4)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、资产支持证券和私募债券除外)，按照中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号--公允价值计量》、《企业会计准则第40号--合营安排》、《企业会计准则第41号--在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号--长期股权投资》、《企业会计准则第9号--职工薪酬》、《企业会计准则第30号--财务报表列报》、《企业会计准则第33号--合并财务报表》以及《企业会计准则第37号--金融工具列报》，要求除《企业会计准则第37号--金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外，其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金

本报告期无重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

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、资产支持证券和私募债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期改为采用中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错。

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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 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。自2013年1月1日起, 对基金从上市公司取得的股息红利所得, 持股期限在1个月以内(含1个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在1个月以上至1年(含1年)的, 暂减按50%计入应纳税所得额; 持股期限超过1年的, 暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

项目	本期末 2015年06月30日
----	--------------------

活期存款	4,255,792.25
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	4,255,792.25

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2015年06月30日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	28,969,451.30	27,017,300.28	-1,952,151.02
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	248,843,802.59	249,114,273.76
	银行间市场	134,606,285.05	135,444,000.00
	合计	383,450,087.64	384,558,273.76
资产支持证券	—	—	—
其他	—	—	—
合计	412,419,538.94	411,575,574.04	-843,964.90

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:2015年06月30日
----	-----------------

应收活期存款利息	2,597.02
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	3,172.41
应收债券利息	10,983,914.17
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	—
其他	28.98
合计	10,989,712.58

注：此处其他列示的是基金存于上交所与深交所的结算保证金的期末应收利息。

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 2015年06月30日
交易所市场应付交易费用	95,247.18
银行间市场应付交易费用	6,358.05
合计	101,605.23

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提审计费	32,728.42
预提信息披露费	119,014.74
合计	151,743.16

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (浦银安盛月月盈定期支付债券A)	本期 2015年01月01日-2015年06月30日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	281,931,861.35	281,931,861.35
本期申购	—	—
本期赎回	-5,571,914.69	-5,571,914.69
期末数	276,359,946.66	276,359,946.66
项目 (浦银安盛月月盈定期支付债券C)	基金份额 (份)	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	18,312,393.77	18,312,393.77
本期申购	—	—
本期赎回	-353,820.23	-353,820.23
期末数	17,958,573.54	17,958,573.54

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目 (浦银安盛月月盈定期支付债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,061,821.48	481,938.19	1,543,759.67
本期利润	5,865,322.73	-1,274,584.03	4,590,738.70
本期基金份额交易产生的变动数	-165,135.27	-62,427.50	-227,562.77
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	-165,135.27	-62,427.50	-227,562.77
本期已分配利润	—	—	—
本期末	6,762,008.94	-855,073.34	5,906,935.60

单位：人民币元

项目 (浦银安盛月月盈定期支付债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	64,382.12	31,301.05	95,683.17
本期利润	348,298.40	-82,620.11	265,678.29
本期基金份额交易产生的变动数	-9,936.47	-3,942.02	-13,878.49
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	-9,936.47	-3,942.02	-13,878.49
本期已分配利润	—	—	—
本期末	402,744.05	-55,261.08	347,482.97

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年06月30日
活期存款利息收入	61,993.09
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	47,080.91
其他	248.40
合计	109,322.40

注：此处其他列示的是基金上交所与深交所结算保证金利息。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年06月30日
卖出股票成交总额	106,709,414.10
减：卖出股票成本总额	100,784,971.35

买卖股票差价收入	5,924,442.75
----------	--------------

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 2015年01月01日-2015年06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	-5,261,926.33
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	-5,261,926.33

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 2015年01月01日-2015年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	394,636,327.49
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	395,904,442.66
减：应收利息总额	3,993,811.16
买卖债券差价收入	-5,261,926.33

6.4.7.13.3 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。

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。

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。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年06月30日
股票投资产生的股利收益	159,678.59
基金投资产生的股利收益	—
合计	159,678.59

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年01月01日-2015年06月30日
1.交易性金融资产	-1,357,204.14
——股票投资	-1,952,151.02
——债券投资	594,946.88
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	-1,357,204.14

6.4.7.18 其他收入

本基金在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 2015年01月01日-2015年06月30日
交易所市场交易费用	221,388.06
银行间市场交易费用	4,875.00
合计	226,263.06

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年06月30日
审计费用	32,728.42
信息披露费	119,014.74
银行汇划费用	4,992.60
债券帐户维护费	6,000.00
其他费用	400.00
合计	163,135.76

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
上海浦东发展银行股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金代销机构
浦银安盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
上海银行股份有限公司	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

- 1、本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行股票交易。
- 2、本基金《基金合同》生效日为2014年12月5日，无上年度可比期间。

6.4.10.1.2 权证交易

- 1、本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行权证交易。
- 2、本基金《基金合同》生效日为2014年12月5日，无上年度可比期间。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

- 1、本基金本报告期间无应支付关联方的佣金。
- 2、本基金《基金合同》生效日为2014年12月5日，无上年度可比期间。

6.4.10.1.4 债券交易

- 1、本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行债券交易。
- 2、本基金《基金合同》生效日为2014年12月5日，无上年度可比期间。

6.4.10.1.5 债券回购交易

- 1、本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。
- 2、本基金《基金合同》生效日为2014年12月5日，无上年度可比期间。

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

关联方名称	本期 2015年01月01日-	上年度可比期间 2014年01月01日-

	2015年06月30日	2014年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,063,490.05	—
其中：支付销售机构的客户维护费	341,339.59	—

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、本基金《基金合同》生效日为2014年12月5日，无上年度可比期间。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年01月01日- 2015年06月30日	上年度可比期间 2014年01月01日- 2014年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	303,854.28	—

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金《基金合同》生效日为2014年12月5日，无上年度可比期间。

6.4.10.2.3 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 2015年01月01日-2015年06月30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	—	15,181.61	15,181.61
上海浦东发展银行股份有限公司	—	13,267.71	13,267.71
浦银安盛基金管理有限公司	—	281.57	281.57
合计	—	28730.89	28730.89

注：1、本基金合同生效日为2014年12月5日，无上年度可比期间。

2、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%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

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

销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中划出，由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

- 1、本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。
- 2、本基金《基金合同》生效日为2014年12月5日，无上年度可比期间。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人在本报告期末未持有本基金。本基金合同生效日为2014年12月5日，无上年度可比期间。

6.4.10.4.2 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

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。本基金合同生效日为2014年12月5日。

6.4.10.5 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 2015年01月01日-2015年06月 30日		上年度可比期间 2014年01月01日-2014年06月 30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海银行股份有限公司	4,255,792.25	61,993.09		

注：1、本基金《基金合同》生效日为2014年12月5日，无上年度可比期间。

2、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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

- 1、本基金本报告期末未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。
- 2、本基金《基金合同》生效日为2014年12月5日，无上年度可比期间。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

- 1、本基金在本报告期无其他关联交易事项。
- 2、本基金《基金合同》生效日为2014年12月5日，无上年度可比期间。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金在本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015年06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股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

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

截至本报告期末2015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人民币86,299,270.55元。是以如下债券作为质押：

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
1382021	13蒙水务MTN1	2015-07-01	101.66	100,000	10,166,000.00
1280316	12惠安国投债	2015-07-01	104.78	100,000	10,478,000.00
1282401	12雨润MTN1	2015-07-01	100.84	100,000	10,084,000.00
1480140	14淄博城运债	2015-07-03	105.89	200,000	21,178,000.00
1480411	14铁道07	2015-07-03	107.95	200,000	21,590,000.00
140228	14国开28	2015-07-06	100.13	100,000	10,013,000.00
1480451	14沪南汇债	2015-07-06	104.42	200,000	20,884,000.00
合计				1,000,000	104,393,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年06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 71,399,974.40元，于2015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。

6.4.13 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%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

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

本基金的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：第一层次为公司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、合规风控部的风险管理；第三层次为公司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、督察长和内部审计。本基金的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。本基金的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，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。公司设立合规风控部，独立地监控公司面临的各类风险。合规风控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。合规风控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，督察长及合规风控部会负责检查、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产生的可能损失。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，将风险控制可在可承受的范围内。

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。

本公司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行上海银行，因而与该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，因此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。

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 2015年06月30日	上年度末 2014年12月31日
A-1	—	—
A-1以下	—	—
未评级	—	—
合计	—	—

注：持有发行期限在一年以内（含）的债券按其债项评级作为短期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为长期信用评级进行列示。本基金本报告期末持有按短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2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 2015年06月30日	上年度末 2014年12月31日
AAA	71,570,160.20	—
AAA以下	281,545,316.30	22,833,388.00
未评级	30,048,397.26	20,035,397.26
合计	383,163,873.76	42,868,785.26

注：持有发行期限在一年以上的债券按其债项评级作为长期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为短期信用评级进行列示。本基金持有的未评级的债券为私募债、企业债和政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于开放期内基金份额持有人可随时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。

由于本基金以定期开放方式运作，针对定期开放时兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人会在运作期保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金所持大部分证券可在证券交易所上市，其余亦在银行间同业市场交易，除在6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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。

于2015年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有157,699,244.95元将在2015年7月6日以内到期且计息(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，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 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、外汇风险及其他价格风险。

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。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 2015年06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	4,255,792.25	—	—	—	4,255,792.25
结算备付金	7,833,224.16	—	—	—	7,833,224.16
存出保证金	71,599.12	—	—	—	71,599.12
交易性金融资产	35,707,180.00	262,962,341.76	85,888,752.00	27,017,300.28	411,575,574.04
衍生金融资产	—	—	—	—	—
买入返售金融资产	—	—	—	—	—
应收证券清算款	—	—	—	24,148,934.16	24,148,934.16
应收利息	—	—	—	10,989,712.58	10,989,712.58
应收股利	—	—	—	—	—
应收申购款	—	—	—	—	—
其他资产	—	—	—	—	—
资产总计	47,867,795.53	262,962,341.76	85,888,752.00	62,155,947.02	458,874,836.31
负债					
卖出回购金融资产款	157,699,244.95	—	—	—	157,699,244.95
应付证券清算款	—	—	—	1,784.47	1,784.47
应付赎回款	—	—	—	—	—
应付管理人报酬	—	—	—	180,687.72	180,687.72
应付托管费	—	—	—	51,625.06	51,625.06
应付销售服务费	—	—	—	5,502.72	5,502.72
应付交易费用	—	—	—	101,605.23	101,605.23
应交税费	—	—	—	—	—
应付利息	—	—	—	109,704.23	109,704.23

应付利润	—	—	—	—	—
其他负债	—	—	—	151,743.16	151,743.16
负债总计	157,699,244.95	—	—	602,652.59	158,301,897.54
利率敏感度缺口	109,831,449.42	262,962,341.76	85,888,752.00	61,553,294.43	300,572,938.77
上年度末 2014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	66,566,829.50	—	—	—	66,566,829.50
结算备付金	—	—	—	—	—
存出保证金	—	—	—	—	—
交易性金融资产	16,348,180.20	30,520,397.26	—	—	46,868,577.46
衍生金融资产	—	—	—	—	—
买入返售金融资产	240,000,000.00	—	—	—	240,000,000.00
应收证券清算款	—	—	—	—	—
应收利息	—	—	—	442,958.55	442,958.55
应收股利	—	—	—	—	—
应收申购款	—	—	—	—	—
其他资产	—	—	—	—	—
资产总计	322,915,009.70	30,520,397.26	—	442,958.55	353,878,365.51
负债					
卖出回购金融资产款	—	—	—	—	—
应付证券清算款	—	—	—	51,797,189.45	51,797,189.45

应付赎回款	—	—	—	—	—
应付管理人报酬	—	—	—	150,035.79	150,035.79
应付托管费	—	—	—	42,867.36	42,867.36
应付销售服务费	—	—	—	4,574.95	4,574.95
应付交易费用	—	—	—	—	—
应交税费	—	—	—	—	—
应付利息	—	—	—	—	—
应付利润	—	—	—	—	—
其他负债	—	—	—	—	—
负债总计	—	—	—	51,994,667.55	51,994,667.55
利率敏感度缺口	322,915,009.70	30,520,397.26	—	-51,551,709.00	301,883,697.96

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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	除市场利率外其他变量保持不变。		
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 2015年06月30日	上年度末 2014年12月31日
	市场利率上升0.25%	-2,592,234.8800	-264,817.9200
	市场利率下降0.25%	2,624,410.2100	267,361.8200

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债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用"自上而下"的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2015年06月30日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	27,017,300.28	8.99	—	—
交易性金融资产-债券投资	384,558,273.76	127.94	46,868,577.46	15.53
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	411,575,574.04	136.93	46,868,577.46	15.53

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除本基金业绩比较标准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 2015年06月30日	上年度末 2014年12月31日
	业绩比较基准上升5%	980,847.55	—
	业绩比较基准下降5%	-980,847.55	—

§ 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	27,017,300.28	5.89
	其中：股票	27,017,300.28	5.89
2	固定收益投资	384,558,273.76	83.80
	其中：债券	384,558,273.76	83.80
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	12,089,016.41	2.63
7	其他资产	35,210,245.86	7.67
8	合计	458,874,836.31	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	--------------

A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	4,603,321.32	1.53
C	制造业	6,629,600.00	2.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,844,378.96	1.94
J	金融业	9,940,000.00	3.31
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	27,017,300.28	8.99

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	1,000,000	9,940,000.00	3.31
2	601929	吉视传媒	386,533	5,844,378.96	1.94
3	603993	洛阳钼业	372,437	4,603,321.32	1.53
4	002408	齐翔腾达	200,000	3,428,000.00	1.14
5	002521	齐峰新材	230,000	3,201,600.00	1.07

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	53,435,273.82	17.70
2	000089	深圳机场	15,503,814.24	5.14
3	002408	齐翔腾达	14,343,256.97	4.75
4	002521	齐峰新材	10,039,982.40	3.33
5	601929	吉视传媒	6,029,914.80	2.00
6	600085	同仁堂	5,768,752.36	1.91
7	601139	深圳燃气	5,196,297.27	1.72
8	603993	洛阳钼业	4,361,237.27	1.44
9	600356	恒丰纸业	3,982,305.00	1.32
10	600037	歌华有线	3,595,395.21	1.19
11	000729	燕京啤酒	3,511,337.17	1.16
12	601988	中国银行	1,676,712.41	0.56
13	600067	冠城大通	1,074,038.84	0.36
14	600023	浙能电力	910,681.20	0.30
15	601398	工商银行	262,996.60	0.09
16	600875	东方电气	62,427.09	0.02

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	41,828,556.20	13.86
2	000089	深圳机场	18,069,399.77	5.99
3	002408	齐翔腾达	11,061,630.01	3.66
4	600085	同仁堂	9,966,296.33	3.30
5	601139	深圳燃气	5,378,698.43	1.78
6	002521	齐峰新材	4,528,006.92	1.50
7	600356	恒丰纸业	4,081,723.40	1.35

8	000729	燕京啤酒	4,004,335.64	1.33
9	600037	歌华有线	3,246,076.90	1.08
10	601988	中国银行	1,756,391.69	0.58
11	600023	浙能电力	1,292,010.00	0.43
12	600067	冠城大通	1,163,015.76	0.39
13	601398	工商银行	269,112.80	0.09
14	600875	东方电气	64,160.25	0.02

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	129,754,422.65
卖出股票收入（成交）总额	106,709,414.10

注：“买入股票的成本”和“卖出股票的收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	10,013,000.00	3.33
	其中：政策性金融债	10,013,000.00	3.33
4	企业债券	321,849,873.76	107.08
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	51,301,000.00	17.07
7	可转债	1,394,400.00	0.46
8	其他	—	—
9	合计	384,558,273.76	127.94

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	1480411	14铁道07	200,000	21,590,000.00	7.18
2	1480140	14淄博城运债	200,000	21,178,000.00	7.05
3	1480451	14沪南汇债	200,000	20,884,000.00	6.95
4	101455027	14万华MTN001	200,000	20,446,000.00	6.80
5	124252	13邯交通	200,000	20,394,000.00	6.79

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股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金为债券型基金，不参与股指期货交易。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为债券型基金，不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围尚未包含国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金投资范围尚未包含国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围尚未包含国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	71,599.12
2	应收证券清算款	24,148,934.16
3	应收股利	—
4	应收利息	10,989,712.58
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	35,210,245.86

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占基金资产净值比例(%)
1	113501	洛钼转债	1,394,400.00	0.46

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

截至本报告期末本基金持有中小企业私募债余额为 20,035,397.26元，明细如下：

金额单位：元

债券代码	债券名称	票面利率(%)	数量(张)	期末估值总额
125400	14铜水务	9.50	200,000	20,035,397.26

§ 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
浦银安盛月月盈定期支付债券A	1,620	170,592.56	58,853,799.87	21.30%	217,506,146.79	78.70%
浦银安盛月月盈定期支付债券C	278	64,599.19	—	—	17,958,573.54	100.00%
合计	1,898	155,067.71	58,853,799.87	20.00%	235,464,720.33	80.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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	浦银安盛月月	—	—

员持有本开放式基金	盈定期支付债券A		
	浦银安盛月月盈定期支付债券C	—	—
	合计	—	—

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
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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	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05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	281,931,861.35	18,312,393.77
本报告期基金总申购份额	—	—
减：本报告期基金总赎回份额	5,571,914.69	353,820.23
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	276,359,946.66	17,958,573.54

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。

§ 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监管部门稽查或处罚的情况

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	69,046,041.76	64.70%	344,584,112.49	61.69%	3,545,800.00	57.00%	—	—	62,859.86	64.70%	
招商	1	37,66	35.30	213,9	38.31	2,675,	43.00	—	—	34,28	35.30	

证券		3,372.34	%	62,257.47	%	300,000.00	%			9.74	%	
----	--	----------	---	-----------	---	------------	---	--	--	------	---	--

注：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的单元变动情况。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	关于旗下部分基金增加广发证券为代销机构并开通定投及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2015-01-08
2	浦银安盛关于旗下部分基金新增一路财富（北京）信息科技有限公司为代销机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2015-02-09
3	关于浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金进行第一次定期支付的提示公告	报刊及公司网站	2015-03-12
4	浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金2015年定期支付表	公司网站	2015-03-18
5	关于调整旗下基金所持交易所固定收益品种估值方法的公告	报刊及公司网站	2015-04-01
6	浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金2015年	公司网站	2015-04-16

	定期支付表(4月)		
7	浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金2015年第一季度报告（全文）	报刊及公司网站	2015-04-21
8	浦银安盛基金管理有限公司关于股东变更的公告	报刊及公司网站	2015-04-22
9	关于旗下部分基金新增中金公司为代销机构的公告	报刊及公司网站	2015-04-24
10	浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金2015年定期支付表(5月)	公司网站	2015-05-18
11	浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金2015年定期支付表(6月)	公司网站	2015-06-16
12	关于旗下部分基金新增中山证券为代销机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2015-06-24
13	浦银安盛基金管理有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2015-06-27
14	浦银安盛基金管理有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2015-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2015年4月22日发布《浦银安盛基金管理有限公司关于股东变更的公告》，公告披露：根据上海市政府的要求，经上海国盛（集团）有限公司批准，本基金管理人原股东上海盛融投资有限公司（以下简称“上海盛融”）由其母公司上海国盛集团资产有限公司（以下简称“上海国盛”）吸收合并，上海盛融持有的本基金管理人10%的股权由上海国盛承继，本基金管理人股东因此由上海盛融变更为上海国盛。相关工商变更登记手续已办理完毕并已报中国证监会备案。

§ 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月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金设立的文件
- 2、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
- 3、浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金招募说明书
- 4、浦银安盛月月盈安心养老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

12.2 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。

12.3 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

二〇一五年八月二十五日