

浦银安盛 6 个月定期开放债券型证券投资  
基金  
2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 26 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 2021 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛 6 个月定期债券	
基金主代码	519121	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 5 月 16 日	
报告期末基金份额总额	47,902,612.98 份	
投资目标	在控制风险的基础上，追求超过业绩比较基准的当期收入和投资总回报，为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。	
投资策略	本基金利用定期开放、定期封闭的运作特性，秉承主动投资管理理念，在有效流动性管理和控制风险的前提下，优化组合、稳健投资，实现基金资产的长期稳健增值。	
业绩比较基准	6 个月定期存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛 6 个月定期债券 A	浦银安盛 6 个月定期债券 C
下属分级基金的交易代码	519121	519122
报告期末下属分级基金的份额总额	46,713,449.16 份	1,189,163.82 份

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日）	
	浦银安盛 6 个月定期债券 A	浦银安盛 6 个月定期债券 C
1. 本期已实现收益	465,491.33	48,612.06
2. 本期利润	506,116.73	81,839.52
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0116	0.0132
4. 期末基金资产净值	50,049,114.62	1,272,287.61
5. 期末基金份额净值	1.071	1.070

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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 6 个月定期债券 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.04%	0.06%	0.33%	0.00%	0.71%	0.06%
过去六个月	1.61%	0.06%	0.65%	0.00%	0.96%	0.06%
过去一年	2.93%	0.06%	1.31%	0.00%	1.62%	0.06%
过去三年	10.60%	0.07%	3.98%	0.00%	6.62%	0.07%
过去五年	16.32%	0.08%	6.71%	0.00%	9.61%	0.08%
自基金合同生效起至今	37.93%	0.20%	14.94%	0.01%	22.99%	0.19%

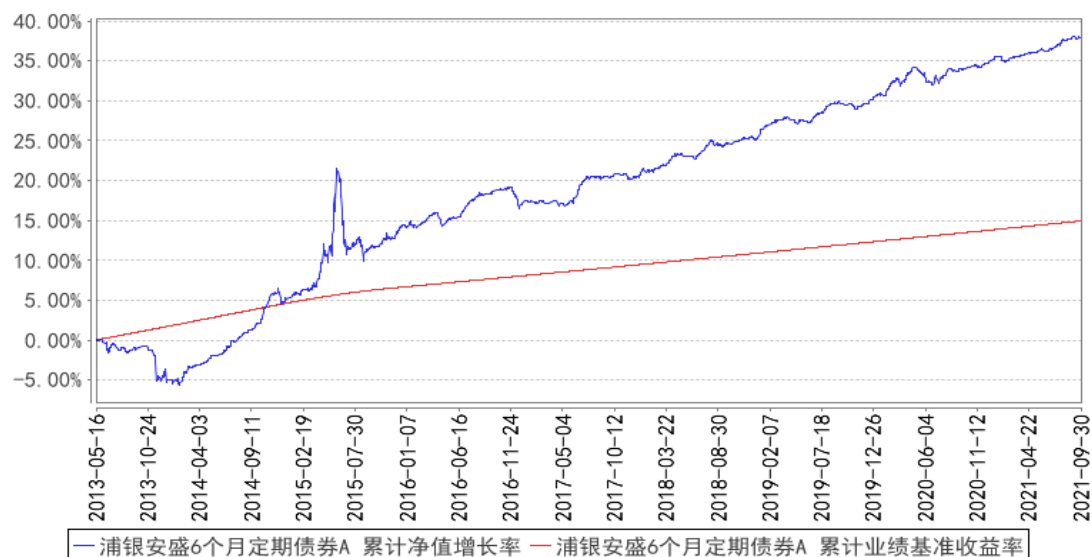
浦银安盛 6 个月定期债券 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

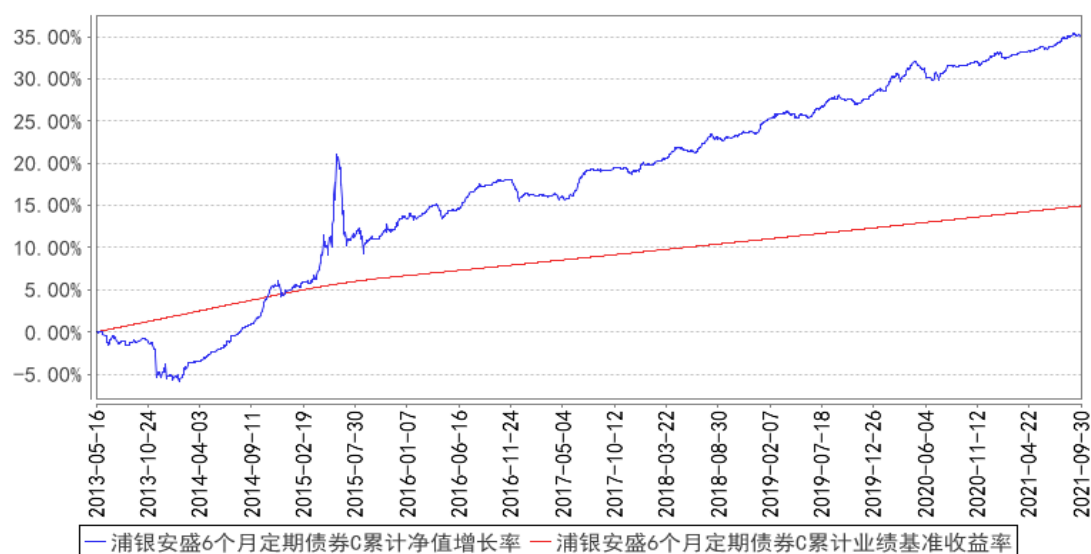
过去三个月	1.13%	0.07%	0.33%	0.00%	0.80%	0.07%
过去六个月	1.61%	0.06%	0.65%	0.00%	0.96%	0.06%
过去一年	2.84%	0.06%	1.31%	0.00%	1.53%	0.06%
过去三年	9.90%	0.07%	3.98%	0.00%	5.92%	0.07%
过去五年	14.97%	0.08%	6.71%	0.00%	8.26%	0.08%
自基金合同生效起至今	35.27%	0.20%	14.94%	0.01%	20.33%	0.19%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛6个月定期债券A 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6个月定期债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘大巍	本基金的基金经理	2016年8月17日	-	11年	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的基金经理。2016年8月至2020年12月任浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2016年8月至2018年7月担任浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2017年4月至2021年1月担任浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金的基金经理。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 月至 2021 年 7 月担任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。
--	--	--	--	--

注：1、本基金基金经理的任职日期为公司决定的聘任日期。

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《公平交易管理规定》，建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个基金组合。

在具体执行中，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平的提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度，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和规定，以保证投资执行交易过程的公平性；从事后监控角度上，一方面是定期对股票交易情况进行分析，对不同时间窗口（同日，3 日，5 日和 10 日）发生的不同组合对同一股票的同向交易及反向交易进行价差分析，并进行统计显著性的检验，以确定交易价差对相关基金的业绩差异的贡献度；同时对旗下投资组合及

其各投资类别的收益率差异的分析；另一方面是公司对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查，并对发现的问题进行及时的报告。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在违反法律、法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件认定的异常交易行为。报告期内未发生本基金与旗下其他投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

7 月伊始，市场对于经济基本面和通胀预期仍有较大分歧，收益率窄幅波动，但 7 月初央行跟随国务院的要求，进行了降准操作，对市场影响较大，该操作消除了市场对于经济基本面的分歧，从宏观层面形成了经济增长趋弱的一致预期，而该预期一旦形成，在一段时期内很难反转。在此背景下本组合在整个 7、8 月份增加了整体仓位和久期，进入 9 月后，随着资管新规开始影响市场，资金面也有收紧的迹象，考虑到四季度资金面波动会有所加大，同时地方政府债也开始放量，我们认为策略上应该适当回归防御，因此本组合降低了整体仓位和久期。整个运作期组合净值维持了稳定增长。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛 6 个月定期债券 A 的基金份额净值为 1.071 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.04%，同期业绩比较基准收益率为 0.33%，截至本报告期末浦银安盛 6 个月定期债券 C 的基金份额净值为 1.070 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.13%，同期业绩比较基准收益率为 0.33%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

- 1、本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
- 2、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

## § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-

	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	46,425,602.31	85.79
	其中：债券	46,425,602.31	85.79
	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	6,900,000.00	12.75
	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	389,681.48	0.72
8	其他资产	399,321.08	0.74
9	合计	54,114,604.87	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,471,971.00	2.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,130,470.00	58.71
	其中：政策性金融债	20,392,000.00	39.73
4	企业债券	7,496,887.36	14.61
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	4,004,800.00	7.80
7	可转债（可交换债）	3,321,473.95	6.47



8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	46,425,602.31	90.46

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	180211	18 国开 11	200,000	20,392,000.00	39.73
2	101754086	17 沪世博 MTN001	40,000	4,004,800.00	7.80
3	143136	17 东兴 03	35,000	3,551,100.00	6.92
4	112857	19 广发 03	30,000	3,011,400.00	5.87
5	143787	18 京投 07	25,000	2,477,000.00	4.83

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.9.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 5.9.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 5.10 投资组合报告附注

##### 5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除东兴证券、中信证券和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。

2021 年 8 月 30 日，国家开发银行公告，因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会大连监管局于 2021-08-23 依据相关法规给予：公开处罚处分决定。

2021 年 1 月 8 日，东兴证券公告，公司风险管理子公司上海伴兴实业发展有限公司（以下简称“上海伴兴”）与不具备衍生产品交易业务资格的大连银行及海峡银行开展了挂钩黄金的价差场外期权交易。此外，上海伴兴未按照《上海伴兴实业发展有限公司风险管理制 度》对与大连银行等开展的相关项目编制《风险评估报告》。公司 2019 年对上海伴兴进行了合规检查，但未提出前述问题，反映出公司未健全并持续完善覆盖子公司及其业务的合规管理、风险管理和内部控制体系，未能实现风险管理全覆盖，违反了《期货公司监督管理办法》（证监会令第 155 号）第五十一条的规定。收到中国证券监督管理委员会上海监管局行政监管措施决定书。

2021 年 2 月 10 日，中信证券公告，由于：一、私募基金托管业务内部控制不够完善，个别项目履职不谨慎。一是业务准入管控不到位，部分项目业务准入未严格执行公司规定的标准和审批程序，未充分关注和核实管理人准入材料。二是投资监督业务流程存在薄弱环节，部分产品未及时调整系统中设定的监督内容，部分投资监督审核未按公司规定履行复核程序，对投资监督岗履职情况进行监督约束的内控流程不完善。三是信息披露复核工作存在不足，对个别产品季度报告的复核存在迟延。四是业务隔离不到位，托管部门与从事基金服务外包业务的子公司未严格执行业务隔离要求。二、个别首次公开发行保荐项目执业质量不高，存在对发行人现金交易等情况关注和披露不充分、不准确，对发行人收入确认依据、补贴可回收性等情况核查不充分等问题。三、公司个别资管产品未按《证券公司定向资产管理业务实施细则》（证监会公告〔2012〕30 号）第二十九条第二款规定，根据合同约定的时间和方式向客户提供对账单，说明报告期内客户委托资产的配置状况、净值变动、交易记录等情况。公司收到深圳证监局关于对中信证券股份有限公司采取责令改正措施的决定。

本基金管理人的研究部门对东兴证券、中信证券和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。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,131.31
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	397,189.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	399,321.08

#### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110052	贵广转债	1,042,800.00	2.03
2	127025	冀东转债	463,440.00	0.90
3	127027	靖远转债	246,280.00	0.48
4	113602	景 20 转债	235,780.00	0.46
5	128107	交科转债	226,600.00	0.44
6	113588	润达转债	216,880.00	0.42
7	128129	青农转债	213,477.75	0.42
8	113042	上银转债	103,830.00	0.20

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银安盛 6 个月定期债券 A	浦银安盛 6 个月定期债券 C
报告期期初基金份额总额	42,273,850.68	8,847,925.26
报告期期间基金总申购份额	5,611,786.72	-
减：报告期期间基金总赎回份额	1,172,188.24	7,658,761.44
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	46,713,449.16	1,189,163.82

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：1、本报告期本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

2、截至本报告期末，本基金管理人的全资子公司上海浦银安盛资产管理有限公司持有本基金浦银安盛 6 个月定期债券 A 23,040,553.00 份。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20210701-20210930	23,040,553.00	0.00	0.00	23,040,553.00	48.10
产品特有风险							
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。							

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准浦银安盛 6 个月定期开放债券型证券投资基金募集的文件
- 2、浦银安盛 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同
- 3、浦银安盛 6 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书
- 4、浦银安盛 6 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、本报告期内在中国证监会规定媒介上披露的各项公告
- 8、中国证监会要求的其他文件

### 9.2 存放地点

上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼基金管理人办公场所。

### 9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（[www.py-axa.com](http://www.py-axa.com)）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

客户服务中心电话：400-8828-999 或 021-33079999。

浦银安盛基金管理有限公司

2021 年 10 月 26 日