浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金 2016年年度报告摘要

2016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:中信银行股份有限公司

送出日期:2017年3月30日

§1 重要提示

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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3月27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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2016年7月11日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	浦银安盛盛鑫定开债券	
基金主代码	519324	
交易代码	519324	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年7月11日	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	330,684,013.95份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	浦银安盛盛鑫A	浦银安盛盛鑫C
下属分级基金的交易代码:	519324	519325
报告期末下属分级基金的份额总额	329,374,131.84份	1,309,882.11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当期收入和投资总回报。
投资策略	本基金一方面按照自上而下的方法对基金的资产配置、久期管理、类属配置进行动态管理,寻找各类资产的潜在良好投资机会,一方面在个券选择上采用自下而上的方法,通过流动性考察和信用分析策略进行筛选。整体投资通过对风险的严格控制,运用多种积极的资产管理增值策略,实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浦银安盛基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	方赫
	联系电话	021-23212888	4006800000
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		021-33079999或400-8828-999	95558
传真		021-23212985	010-85230024

2.4 信息披露方式

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

§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	2016年7月11日(基金合同生效日)-2016年12月31日		2015年		2014年	
	浦银安盛盛鑫A	浦银安盛盛鑫C	浦银安盛盛鑫A	浦银安盛盛鑫C	浦银安盛盛鑫A	浦银安盛盛鑫C
本期已实现收益	4,149,054.41	15,547.40	-	-	-	-
本期利润	2,550,786.17	11,571.40	-	-	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0088	0.0092	-	-	-	-
本期基金份额净值增长率	1.20%	1.00%	-	-	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2016年末		2015年末		2014年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0118	0.0103	-	-	-	-
期末基金资产净值	333,262,234.22	1,323,340.70	-	-	-	-
期末基金份额净值	1.012	1.010	-	-	-	-

注:1.本基金(基金合同)2016年7月11日生效。以上财务指标中"本期"指2016年7月11日(基金成立日)至2016年12月31日止期间。

2.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。

3.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。

4.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

5、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。

6.本基金(基金合同)生效日为2016年7月11日,至报告期末,合同成立未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

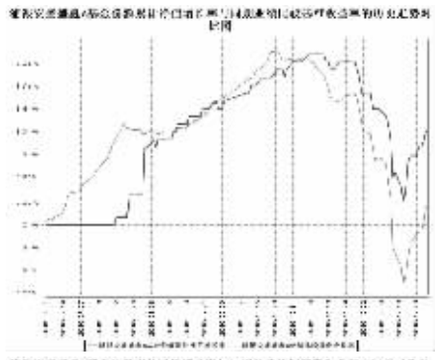
浦银安盛盛鑫A

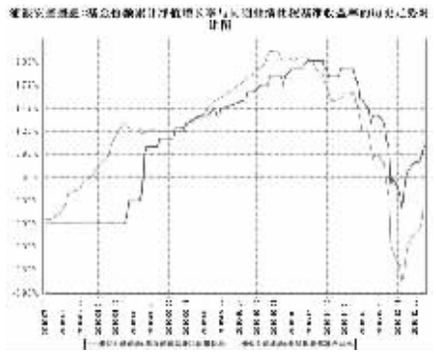
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.39%	0.11%	-1.41%	0.12%	1.02%	-0.01%
自基金合同生效起至今	1.20%	0.11%	0.22%	0.10%	0.98%	0.01%

浦银安盛盛鑫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	-0.49%	0.11%	-1.41%	0.12%	0.92%	-0.01%
自基金合同生效起至今	1.00%	0.10%	0.22%	0.10%	0.78%	0.00%

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



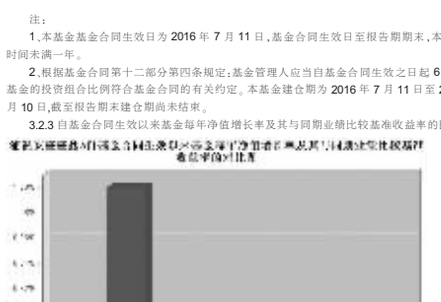


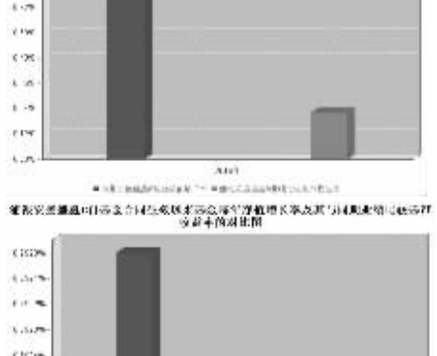
注:

1.本基金基金合同生效日为2016年7月11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.根据基金合同第十二部分第四条规定: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约定。本基金建仓期为2016年7月11日至2017年1月10日,截至报告期末建仓期尚未结束。

3.2.3 自基金合同生效以来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





注:本基金合同于2016年7月11日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金自基金合同生效以来未进行过利润分配。

§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、境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务。

截至2016年12月31日止,浦银安盛旗下共管理28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(LOF)、浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金、浦银安盛半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、浦银安盛半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、浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金、浦银安盛日丰货币市场基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛半福聚益18个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金以及浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金。

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统,这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成,之后日常的维护管理由公司负责,但与第三方服务公司签订有技术服务合同,由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统等。这些系统也主要是在公司筹建之初采购专业系统提供商的产品建设而成,建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级,升级由系统提供商负责完成,升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。业务应用系统日常的维护管理由公司负责,但与系统提供商签订有技术服务合同,由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外,我公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

另外,本公司可以根据自身发展战略的需要,委托资质良好的基金服务机构代为办理基金份额登记、估值核算等业务。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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、浦银安盛半福回报债券基金、浦银安盛稳健增利债券基金(LOF)、浦银安盛月月盈债券基金、浦银安盛半福聚利债券基金、浦银安盛盛鑫债券基金以及浦银安盛盛元纯债债券基金基金经理	2016年7月11日	-	10	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LOF(原增利分级债券基金)基金经理。2012年9月起兼任浦银安盛半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月至2016年8月,兼任浦银安盛6个月定期开放债券基金基金经理。2013年6月至2016年8月,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。2016年5月起,兼任浦银安盛半福聚利债券基金基金经理。2016年7月起,兼任浦银安盛盛鑫定期开放债券基金和浦银安盛盛元纯债债券基金基金经理。2016年11月起,兼任浦银安盛半福聚益18个月定期开放债券基金和浦银安盛盛泰纯债债券基金基金经理。2016年12月起,兼任浦银安盛盛达纯债债券基金基金经理。
章潘枫	公司旗下固定收益基金经理助理	2016年6月14日	-	5	章潘枫先生,上海财经大学数量经济学硕士。2011年7月至2016年6月就职于湘财证券先后从事金融工程研究岗位、报价回购业务岗位以及高级投资经理岗位。2016年6月14日加盟我司固定收益投资部门担任固定收益基金经理助理岗位。

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《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

管理人于2009年颁布了《浦银安盛基金管理有限公司公平交易管理规定》(以下简称公平交易管理规定),并分别于2011年及2012年进行了两次修订。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;
- 证券投资基金经理及其助理和特定客户资产投资组合经理及其助理相互隔离,不得相互兼任、互为备份;
- 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)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

报告期内,本基金管理人根据《公平交易管理规定》,建立健全有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在具体执行中,在投资决策流程上,构建统一的研究平台,为所有投资组合公平的提供研究支持。同时,在投资决策过程中,严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度,保证公募基金及专户业务的独立投资决策机制;在交易执行环节上,详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规定,以保证投资执行交易过程的公平性;从事后监控角度上,一方面是定期对股票交易情况进行分析,对不同时间窗口(同日、3日、5日)发生的不同组合对同一股票的同向交易及反向交易进行价差分析,并进行统计显著性的检验,以确定交易价差对相关基金的业绩差异的贡献度;同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异的分析;另一方面是公司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。

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

2016年7月判断经济有下台阶风险,稳增长和去产能同步进行将加剧"资产荒"进而抹平一切价值洼地,因此增加了长期限政策性金融债和高票息信用债配比,并在10月中前保持杠杆水平稳定,在7-10月这波利差收窄半牛市中取得了较高的收益。10月下旬开始,随着央行不断"缩短放长"、MPA考核等金融去杠杆政策加码,资金利率时点性紧张频现,市场分歧不断加大,减持长期限政策性金融债,并逐步卖出信用债降低组合杠杆和久期,在年末债市大调整前段减少了损失。2016年度,本基金全年均衡配置资质较好的信用债,期间精选个券和利率债等进行波段操作,并把握机会进行调仓,提高了组合的安全性和流动性,最终取得了较好的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期A类净值增长率为1.20%,C类净值增长率为1.00%,同期业绩比较基准收益率为0.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年末中央经济工作会议提出,要把防控金融风险放到更加重要的位置,下决心处置一批风险点,着力防控资产泡沫,提高和改进监管能力,确保不发生系统性金融风险,这决定了2017年债市的主基调。首先,金融去杠杆,这表明货币政策总体上一定是中性甚至偏紧的,17年时点性的流动性紧张可能比16年发生的更频繁。非存款类金融机构借入资金的中枢可能在明年走廊上沿震荡,考虑到经济下行的压力较大,企业负债率仍处高位,利率重回上升趋势的负面影响大强,加息或者上调利率走廊中枢的概率不大。其次,抑制房价上涨,甚至持开放的态度面对经济增速可能低于6.5%,这表明稳增长不再是首要目标,房地产投资回落是大概率事件,基建投资等财政政策也不会像市场想的那么积极,经济下台阶中长期看利好债市。其他如通胀和美国等因素目前还不甚明朗,减产协议如能进一步加码,石油持续上涨会带来输入性通胀,但美国的新增供给加大以及能源政策变化也给石油价格带来了不确定性;美国方面,总统权力过度后,特朗普的积极财政政策和贸易保护政策能否顺利推行且真正推动经济和通胀上行仍存较大疑问。2017年将是充满不确定性和机遇的一年,短期来看4月以前市场仍将由资金面主导,央行偏紧的态度叠加去年末大跌后脆弱的市场情绪,债市仍有可能再次寻底,保持好组合的高流动性和偏高信用资质是重中之重。中长期来看高负债率下企业难以承受利率持续上行,经济增速可能下台阶将利好债市。

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。2016年,合规风控工作仍然是对公司进行全面风险管理,涵盖了制度内控、法律合规、信息披露、风险监控、绩效评估、内部稽核及反洗钱等工作。积极配合公司前台业务的完善一线风险管控工作,并协调、监督全公司和投资组合的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险及内部控制工作。合规法律方面,在公司全体同仁的共同努力下,公司合规及信披记录良好,为公司各项业务的开展打下了坚实基础;风险管理方面,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;稽核方面,根据监管要求及行业热议风险点,有针对的开展了计划外专项稽核,及时查找和发现的潜在风险,提出了完善制度流程及加强执行的有效建议。

1.进一步健全合规风控团队,提高团队的专业素养

2016年,随着公司管理投资组合的数量与规模大幅提升、业务类型的不断拓展,合规风控团队不断加强自身专业素质的提升,全面提高专业素质,鼓励和支持合规风控人员参与相关的专业考试和学习。目前合规风控团队内部形成了良好的学习和业务研讨的氛围,团队成员各自发挥自身优势,相互取长补短,专业素质得到均衡提升,在内部形成了互帮互学、互相协同、勤奋上进的良好局面。

内部管理上,合规风控团队进一步健全合规风控工作的各项规章制度和工作流程,进一步明确各岗位人员的工作职责,强化自觉、客观的工作态度和高度的工作责任感,培养团队协作精神。

对外沟通上,持续与监管机构、交易所、自律协会、外部律师、外部会计师及双方股东对口部门保持密切良好的沟通,同时与公司其他部门保持良好协作,配合和支持部门间需求接洽。

2.进一步建立健全风险控制体系

(1)引入独立买方信评机构,初步建立第二层级的信用风险防范机制

2016年,债券市场信用风险事件频发,公司合规风控部严格执行投资级(AA级以上)监控,并引入了中债资信(市场上唯一的买方评级机构)的信用风险关注债券三级预警名单,建立灰名单机制并每周向固收部发送监控周报;固收部根据自主评估,同时参考合规风控部固收监控周报,再次回顾持仓及债券库,发现存在信用风险隐患的债券,立即进行卖出及出库处理,在稳健管控信用风险的基础上追求积极回报。建立上述机制后,公司固收投资的信用风险得到良好的控制。

(2)对投资组合进行定期风险评估

合规风控部进一步完善了每日、每周、每月的风险评估。初步建立了较为完整、及时的量化的预警风险评估体系。同时,2016年公司发布实施了《流动性风险管理制度》及《流动性风险应急预案》,对流动性风险监控体系进行了进一步完善,通过日常流动性监测及定期、不定期的压力测试,对流动性风险进行有效的防范。

(3)建立健全业绩归因分析及评估模型,助力绩效考核及业绩持续改善

合规风控部位绩效考核委员会提供了量化绩效考核的数据支持,同时不断完善业绩归因模型,直观体现业绩和风险来源及风险调整后收益,帮助投研部门回顾投资成功经验及有待改善之处。

(4)对投资组合的公平交易及异常交易进行事前控制和事后分析

合规风控部继续着力于对公平交易、异常交易相关工作的提高,对公平交易及异常交易事后分析进行了进一步的完善,以进一步确保投资组合的合法合规。

(5)对公司新产品提供高效、有力的支持

2016年,公司新发行了14只专户产品,9只公募基金。合规风控部与投资团队、产品团队、运营团队合作,就各产品的流动性风险、市场风险、信用风险等方面进行分析,制定相应的风险控制措施和投资控制指标。

(6)进一步完善子公司内部控制体系

2016年,子公司内部控制体系得到进一步完善:

业务部门的一线风险控制:子公司设金融机构部、运营管理部、投资管理部、资金管理部、财富管理中心等业务部门,对其管理负责的业务进行检查、监督和控制,保证业务的开展符合国家法律、法规、监管规定及子公司的规章制度,并对部门的内部控制和风险管理负直接责任;

子公司设独立的风险管理部,负责对子公司内部控制和风险控制的充分性、合理性和有效性实施独立客观的风险管控、检查和评价;

管理层的控制:子公司在总经理领导下设立执行委员会,并在管理层下设项目评审及决策委员会以及风险控制委员会,采取集体决策制,管理和监督各个部门和各项业务进行,以确保子公司运作在有效的控制下。管理层对内部控制制度的有效执行承担责任;

执行董事及监事的监控和指导。所有员工应自觉接受并配合执行董事及监事对各项业务和工作行为的检查监督,合理的风险分析和管理建议应予采纳。执行董事对内部控制负最终责任;

母公司及其董事会通过稽核检查、审阅报告、参与会议等方式监督子公司内部控制和风险控制情况。母公司对子公司的内控管理正在从事前评审和事中审核,逐步转向事前咨询及讨论以及事后稽核,力争在保持子公司独立性、实现母子公司风险隔离的基础上,有效发挥母公司对子公司风险内控方面的监督管理作用。

(7)协助人力资源部完善了合规风险考核体系

2016年,公司进一步加大对各部门、各岗位的风险事件考核力度。公司继续按照《加强日常风险考核管理办法》,依照不同等级风险事件,同时结合是否自动及时上报、是否受外界因素影响等因素进行考核,责任明确、落实到人,并根据中风险及以上事件对责任人员采取扣除部分季度工资的惩处,有力地督促了相关人员对公司制度的执行,有效地推动了公司全体员工合规意识的提高。

3.稽核工作

根据相关法规要求、公司的实际运作情况及稽核计划,合规风控团队有重点、分步骤、有针对性地对公司的业务和合规运作,以及执行法规和制度的情况进行稽核,并在稽核后督促整改和跟踪检查。在有效控制公司的风险以及推动公司内控监管第二道和第三道防线方面发挥了积极的作用。

稽核工作主要采取定期稽核与不定期稽核相结合、常规稽核与专项稽核相结合的方式。定期稽核的结果主要体现在月度合规报告及季度监察稽核报告中。不定期稽核主要是就定期稽核中发现的问题,与业务部门进行沟通,帮助各部门及时完善和改进工作。不定期稽核的结果主要体现在合规报告及整改反馈表中。

此外,合规风控团队还负责与负责公司内控评价的会计师事务所联系和沟通,配合公司的业务开展。

2016年实施的专项稽核包括:

(1)完成对上年度反洗钱工作的内部稽核和反洗钱自评估工作;

(2)完成了对子公司业务的专项审计;

(3)根据监管部门要求,对子公司开展了风险管理专项自查与评估工作;

(4)根据监管部门要求,公司及子公司开展了互联网金融风险整治的自查工作;

(5)根据监管部门要求,公司开展了中小投资者合法权益保护的专项自查工作;

(6)根据监管部门要求,公司开展了私募资管业务合规性专项审计工作。

总体来说,2016年度由于人员配置有限,稽核工作的深度及广度还有待进一步提高。2017年,合规风控部将在公司预算内进一步完善人员配置,不断深化和提高稽核工作的开展情况。

4.监察合规性审核

依据法律法规和公司制度对以下材料进行了审核:

(1)对基金宣传推介材料、公司宣传品、网站资料、客户服务资料、渠道用信息、以公司名义对外发布的新闻等进行了合规性审核,力求公司对外材料的合法合规性;

(2)2016年,与公司专业法律顾问一起,对公司发行的基金和专户产品法律文件的合法合规性进行了全面审核;

(3)对一级市场数百个证券的申购,从关联交易角度进行合法合规性审核,未出现在一级市场投资与公司存在禁止关联交易的关联关系公司发行证券的情形。

5.信息披露和文件报送

由于公司信息披露的负责人设在合规风控部,因此,合规风控部指定专人负责并协调公司的信息披露工作,督察长对信息披露工作进行指导、督促、监督、检查。信息披露工作包括拟定披露的文件格式、收集相关部门填写的内容并进行统稿和审核、对定稿的信息披露文件排版、制作成PDF文件向监管机关报备等。

信息披露工作是一项繁杂的事物性工作,需要信息披露负责人耐心、细致、认真的工作态度和较强的协调能力,不仅涉及到披露的格式,还涉及披露的内容,以及整理、审阅和报送等。该项工作虽然占据了合规风控团队很多时间,但由于团队成员的工作认真、仔细,所有的披露均做到了及时、准确,基本未出现重大迟报、漏披、延披、错披的情形。

2016年,按时按质完成基金定期报告(月报、季报、半年报、年报、监察稽核报告)和招募说明书更新的提示及合规审核工作,并协助业务部门对重大事件临时报告、临时公告进行编制,及时进行合规审核,并安排公告的披露及上报事宜。2016年全年共审核并安排披露、上报数百份公告及报告,未出现重大迟、漏等现象。

6.法律事务

对公司签署的上百份协议、合同等进行了法律审核,在合理范围内最大限度地防范由合同产生的违约风险及侵权风险,同时,根据中国证监会发布的关于销售费用及反洗钱等相关法律法规,对基金代销协议模板进行了更新;参与起草、审阅并修改董事会、股东会会议通知、决议等会议材料。此外,合规风控团队还负责与公司法律和基金产品律师联系和沟通,配合公司的业务开展。

全年的法务工作基本做到了有序而高效,积极协助了公司业务的正常开展,公司未发生诉讼或仲裁现象,较好地控制了法律风险。

7.组织开展合规培训

根据工作安排,合规风控团队负责公司的合规培训工作,合规培训包括新员工入司培训、重大新法规培训、从业人员投资限制培训、新股发行体制改革培训、退市机制改革培训等。培训前,合规风控团队会商量每次培训的议题和内容,并准备书面培训材料;培训中,采取讲实例的互动培训方式;培训后,积极听取员工的建议,以期不断改进培训效果。

(1)公司2016年对新入职员工分四场进行了入职合规培训,内容包括道德规范、业务运作、公司利益冲突管理、市场营销、投资及交易行为等相关合规要求;

(2)由于中国证券业协会每年会安排15小时左右的远程在线合规培训。为避免占用业务人员过多工作时间以及培训内容过多重复,2016全年为业务人员提供了两场现场专项合规培训(不含反洗钱合规培训),并通过邮件发送等方式持续对全体员工进行合规教育;

(3)对反洗钱相关人员开展了一场反洗钱合规培训,共计2.5个小时17人次。

2016年,公司制定下发了《浦银安盛基金管理有限公司合规手册》,将作为员工合规培训教育的一个新的有效方式,从而进一步丰富和完善公司合规培训教育体系,全方位推进公司合规水平的进一步提高。

8.督导和推动公司的制度建设和完善

督导和推动公司的制度建设和完善是合规风控团队的重要工作之一。合规风控团队全年推动公司所有新订、修订制度、流程的工作。

9.组织进行反洗钱工作

公司反洗钱工作由合规风控团队组织和牵头。全年开展的反洗钱工作包括:(1)完善反洗钱相关制度;(2)客户识别和客户风险等级划分;(3)利用反洗钱监控系统从TA数据中心自动抓取数据,对可疑交易进行适时监控;(4)向中国人民银行定期报送可疑交易;(5)定期根据监管要求向贵局及人民银行报送报告报表等各项材料;(6)进行反洗钱合规培训;(7)进行反洗钱的专项审计及自评估。

10.落实监管政策和要求,配合和协助监管机关的现场调研

与监管机关的沟通和交流主要由督察长和合规风控部负责,总体来说,在落实监管机关的监管政策和要求方面的工作包括:

(1)收发监管机关的所有文件,传达监管机关的政策,从收文和报送环节进行协调和督促;

(2)组织、协调和督导公司的专项自查;

(3)代表公司参与上海基金业同业公会的相关会议。

11.督导处理投资人的投诉

公司已经建立了投资人投诉的处理机制,合规风控团队负责指导、督促客服中心妥善处理投资人的重大投诉,包括商量投诉处理的反馈内容、形式和解决方法等,避免了因投资人投诉致使公司品牌和声誉受损的情形发生。

12.向董事会报告公司经营的合法合规情况

根据《公司章程》的要求,定期向董事会报告公司经营的合法合规情况。报告的形式包括:(1)书面报告:通过季度和年度监察稽核报告的形式;(2)当面报告:通过在董事会会议以及合规与审计委员会会议汇报的形式;(3)电邮或电话:当董事想了解公司的合规经营情况或提出一些问题时,通过电子邮件或电话的形式进行沟通和汇报。

13.与中介机构的协调

合规风控团队负责与律师事务所和审计师事务所的日常工作协调,包括:

(1)与律师事务所:就重大制度修订事项、基金产品募集、专户产品审核、高管和董事的任免出具法律意见书。

(2)与审计师事务所:就公司的内控评价工作建立了与普华永道会计师事务所日常沟通和协调的机制。

回顾过去的2016年,从董事会、管理层到员工,对合规风控工作都比以前有了更多的重视和理解、支持,合规风控团队与公司各部门的联系日益紧密和协调,这为公司合规风控风控工作的开展进一步奠定了良好基石。

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》。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金本报告期内未进行利润分配,符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.9 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

作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金2016年度基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,不存在任何损害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

本托管人认为,浦银安盛基金管理有限公司在浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,浦银安盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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(2017)第21520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	浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金(以下简称"浦银安盛盛鑫定期开放基金")的财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表、2016年7月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间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。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是浦银安盛盛鑫定期开放基金的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"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财务报表,并使其实现公允反映;(2)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。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充