浦银安盛盛元纯债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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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 22 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	浦银安盛盛元纯债债券
基金主代码	519322
交易代码	519322
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年 7 月 22 日
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	6, 144, 345, 680.79 份
基金合同存续期	不定期

下属分级基金的基金简称：	浦银安盛盛元纯债债券 A	浦银安盛盛元纯债债券 C
下属分级基金的交易代码：	519322	519323
报告期末下属分级基金的份额总额	6, 143, 046, 414.33 份	1, 299, 266.46 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的前提下，力争实现超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金一方面按照自上而下的方法对基金的资产配置、久期管理、类属配置进行动态管理，寻找各类资产的潜在良好投资机会，一方面在个券选择上采用自下而上的方法，通过流动性考察和信用分析策略进行筛选，整体投资通过对风险的严格控制，运用多种积极的资产管理增值策略，实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浦银安盛基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	张志永
	联系电话	021- 23212888	021- 52629999- 212004
	电子邮箱	compliance@py- axa.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		021- 33079999 或 400- 8828- 999	95561
传真		021- 23212985	021- 62159217

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 22 日(基金合同生效日) - 2016 年 12 月 31 日			2015年			2014年		
	浦银安盛盛元纯债债券 A	浦银安盛盛元纯债债券 C		浦银安盛盛元纯债债券 A	浦银安盛盛元纯债债券 C		浦银安盛盛元纯债债券 A	浦银安盛盛元纯债债券 C	
本期已实现收益	81, 252, 591.74	26, 670.99	-	-	-	-	-	-	-
本期利润	44, 348, 337.31	- 3, 725.21	-	-	-	-	-	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0096	- 0.0022	-	-	-	-	-	-	-
本期基金份额净值增长率	1.67%	1.51%	-	-	-	-	-	-	-
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	0.0153	0.0137	-	-	-	-	-	-	-
期末基金资产净值	6, 245, 847, 527.66	1, 318, 933.18	-	-	-	-	-	-	-
期末基金份额净值	1.0167	1.0151	-	-	-	-	-	-	-

注：1.本基金《基金合同》2016年 7 月 22 日生效。以上财务指标中 " 本期 " 指 2016 年 7 月 22 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向下未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

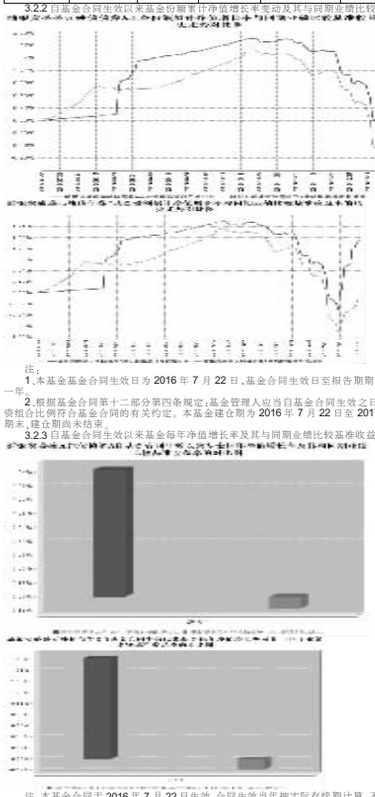
浦银安盛盛元纯债债券 A

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	- 0.16%	0.15%	- 1.41%	0.12%	1.25%	0.03%
自基金合同生效起至今	1.67%	0.14%	- 0.15%	0.10%	1.82%	0.04%

浦银安盛盛元纯债债券 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	- 0.25%	0.15%	- 1.41%	0.12%	1.16%	0.03%
自基金合同生效起至今	1.51%	0.14%	- 0.15%	0.10%	1.66%	0.04%

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 22 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 22 日至 2017 年 1 月 21 日，截至报告期末，建仓期内。

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 22 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 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、浦银安盛安盛平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、浦银安盛季季红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、浦银安盛日益回报市场基金、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、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、浦银安盛鑫安智开放债券型证券投资基金、浦银安盛鑫安智开放债券型证券投资基金、浦银安盛鑫泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛幸福聚益 18 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛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。

公司自总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、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		
薛玲	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、浦银安盛安福回报债券基金、浦银安盛稳健增利债券基金（LOF）、浦银安盛月月盈债券基金、浦银安盛丰福聚利债券基金、浦银安盛鑫泰纯债债券基金、浦银安盛鑫安智开放债券基金、浦银安盛幸福聚益 18 个月定期开放债券基金和浦银安盛鑫泰纯债债券基金基金经理。	2016 年 7 月 22 日	-	10	薛玲先生，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，货币基金基金经理助理、基金经理。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 月起兼任浦银安盛丰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，兼任浦银安盛季季红债券基金基金经理。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，兼任浦银安盛鑫泰纯债债券基金基金经理。2016 年 7 月起，兼任浦银安盛鑫安智开放债券基金和浦银安盛永盛达纯债债券基金基金经理。2016 年 11 月起，兼任浦银安盛幸福聚益 18 个月定期开放债券基金和浦银安盛鑫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。
崔潇枫	公司旗下固定收益基金经理助理	2016 年 6 月 14 日	-	5	崔潇枫先生，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、股份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、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合规信息总的管理及保密制度，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间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，一方面是定期对投资交易情况进行分析，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贡献的贡献度；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 月判断经济有下行分风险，稳增长和去产能同步进行将加剧"资产荒"进而挂平一切价值法则，因此增加了长期限权重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 1.67%，C 类净值增长率为 1.51%，同期业绩比较基准收益率为 -0.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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利率走廊上沿震荡，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，控制房价上涨，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偏市场里的那么积极，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，关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》等有关法规或实守信，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。根据配合公司前台业务的完善一线风险管控工作，并协调、监督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)引入独立实方估评机构，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(市场上唯一的实方评级机构)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；固收部根据日主评估，同时参考合规风控部团队监控周报，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》，对流动性风险监控部进一步完善，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)建立健全合规风控分析及评估模型，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，对其管理自己的业务进行检查、监督和控制，保证业务的开展符合国家证监会、法规、监管规定及子公司的规章制度，并对部门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，逐步过渡到以过程控制为主的事后稽核，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控考核体系

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的规范的执行，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。在有效控制公司的合规风险以及推动公司合规文化建设的同时，2016 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，关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》等有关法规或实守信，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。根据配合公司前台业务的完善一线风险管控工作，并协调、监督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)引入独立实方估评机构，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(市场上唯一的实方评级机构)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；固收部根据日主评估，同时参考合规风控部团队监控周报，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》，对流动性风险监控部进一步完善，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)建立健全合规风控分析及评估模型，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，对其管理自己的业务进行检查、监督和控制，保证业务的开展符合国家证监会、法规、监管规定及子公司的规章制度，并对部门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，逐步过渡到以过程控制为主的事后稽核，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控考核体系

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的规范的执行，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。在有效控制公司的合规风险以及推动公司合规文化建设的同时，2016 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，关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。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规，基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人应尽的义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信，净值计算，利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本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、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 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 21531 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	浦银安盛盛元纯债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元纯债债券型证券投资基金(以下简称 " 浦银安盛盛元纯债基金 ")的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 7 月 22 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元纯债债券型证券投资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所采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分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，上述浦银安盛盛元纯债基金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，公允反映了浦银安盛盛元纯债基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 7 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛克 | 张振波
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)
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
审计报告日期	2017年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016年 12 月 31 日	上年度末 2015年 12 月 31 日
银行存款	7.4.7.1	11, 035, 999.54	-
结算备付金		393, 636.36	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	7, 474, 207, 380.00	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		6, 933, 768, 880.00	-
资产支持证券投资		540, 438, 500.00	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金