

浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金
证券投资基金证券投资基金（原浦银安盛盛元
纯债债券型证券投资基金基金转型）
2018 年年度报告

2018 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：2019 年 3 月 27 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 25 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。

自 2018 年 12 月 24 日起，原浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金转型为浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金，原浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 23 日止，浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金本报告期自 2018 年 12 月 24 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	6
2.1 基金基本情况（转型后）.....	6
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	7
2.2 基金产品说明（转型前）.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	9
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	10
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现（转型后）.....	11
3.2 基金净值表现（转型前）.....	15
3.3 其他指标.....	19
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	19
§4 管理人报告	21
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	21
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	26
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	26
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.....	27
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	28
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	29
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	35
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	35
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.....	36
§5 托管人报告	37
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	37
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.....	37
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.....	37
§6 审计报告（转型后）	38
6.1 审计报告基本信息.....	38
6.2 审计报告的基本内容.....	38
§6 审计报告（转型前）	41
6.1 审计报告基本信息.....	41
6.2 审计报告的基本内容.....	41
§7 年度财务报表（转型后）	44
7.1 资产负债表（转型后）.....	44
7.2 利润表.....	45
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	46
7.4 报表附注.....	47
§7 年度财务报表（转型前）	75

7.1 资产负债表（转型前）	75
7.2 利润表	76
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	77
7.4 报表附注	78
§8 投资组合报告（转型后）	108
8.1 期末基金资产组合情况	109
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	109
8.3 报告期内股票投资组合的重大变动	110
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	110
8.5 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	111
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细	111
8.7 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	111
8.8 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	111
8.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	111
8.10 投资组合报告附注	112
§8 投资组合报告（转型前）	114
8.1 期末基金资产组合情况	114
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	114
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	115
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	115
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	115
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	116
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细	116
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	116
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	116
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	117
8.11 投资组合报告附注	117
§9 基金份额持有人信息（转型后）	119
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	119
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	119
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	119
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	120
§9 基金份额持有人信息（转型前）	121
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	121
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	121
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	121
§ 10 开放式基金份额变动(转型后)	123
§ 10 开放式基金份额变动(转型前)	124
§11 重大事件揭示	125
11.1 基金份额持有人大会决议	125
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	125
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	125
11.4 基金投资策略的改变	125
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	125
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	125

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）	125
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）	126
11.9 其他重大事件（转型后）	127
11.9 其他重大事件（转型前）	128
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	130
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	130
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	130
§13 备查文件目录.....	131
13.1 备查文件目录.....	131
13.2 存放地点.....	131
13.3 查阅方式.....	131

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金	
基金简称	浦银安盛盛元定开债券	
基金主代码	519322	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 12 月 24 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	9,729,009,681.06 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛盛元定开债券 A	浦银安盛盛元定开债券 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	9,729,005,527.30 份	4,153.76 份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金	
基金简称	浦银安盛盛元纯债债券	
基金主代码	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	4,941,624,545.35 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	4,941,620,391.59 份	4,153.76 份

2.2 基金产品说明（转型后）

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。

2.2 基金产品说明（转型前）

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	曾麓燕
	联系电话	021-23212888	021-52629999-212040
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	015292@cib.com.cn
客户服务电话	021-33079999 或 400-8828-999		95561
传真	021-23212985		021-62535823
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		福州市湖东路 154 号
办公地址	上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼		上海市江宁路 168 号兴业大厦 20 楼
邮政编码	200020		200041
法定代表人	谢伟		高建平

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

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 12 月 24 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	浦银安盛盛元定开债券 A	浦银安盛盛元定开债券 C
本期已实现收益	8,422,410.05	3.51
本期利润	22,177,896.23	9.54
加权平均基金份额本期利润	0.0027	0.0023
本期加权平均净值利润率	0.26%	0.22%
本期基金份额净值增长率	4.87%	4.84%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 12 月 31 日	
期末可供分配利润	227,692,365.39	95.85

期末可供分配基金份额利润	0.0234	0.0231
期末基金资产净值	10,202,757,236.35	4,354.70
期末基金份额净值	1.0487	1.0484
3.1.3 累计期末指标	2018年12月31日	
基金份额累计净值增长率	0.21%	0.20%

注：1、本基金《基金合同》2018年12月24日生效。以上财务指标中“本期”指2018年12月24日（基金合同生效日）至2018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。

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年1月1日至2018年12月23日		2017年		2016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	234,522,186.23	20,949.96	186,663,252.85	25,484.17	81,252,591.74	26,670.99
本期利润	369,511,943.43	36,020.32	162,901,585.30	24,003.28	44,348,337.31	-3,725.21

加权平均基金份额本期利润	0.0748	0.0722	0.0313	0.0288	0.0096	-0.0022
本期加权平均净值利润率	7.20%	6.97%	3.07%	2.83%	0.94%	-0.21%
本期基金份额净值增长率	7.47%	7.17%	3.18%	2.83%	1.67%	1.51%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 12 月 23 日		2017 年末		2016 年末	
期末	227,692,365.39	95.85	165,856,304.30	16,955.62	93,863,574.16	17,746.64

可供分配利润						
期末可供分配基金份额利润	0.0461	0.0231	0.0336	0.0305	0.0153	0.0137
期末基金资产净值	5,170,579,840.12	4,345.16	5,107,727,754.94	573,284.68	6,245,847,527.66	1,318,933.18
期末基金份额净值	1.0461	1.0459	1.0336	1.0305	1.0167	1.0151
3.1.3 累计期末指标	2018 年 12 月 23 日		2017 年末		2016 年末	
基金份额	12.74%	11.86%	4.90%	4.38%	1.67%	1.51%

额 累 计 净 值 增 长 率						
--------------------------------------	--	--	--	--	--	--

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（转型后）

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

浦银安盛盛元定开债券 A

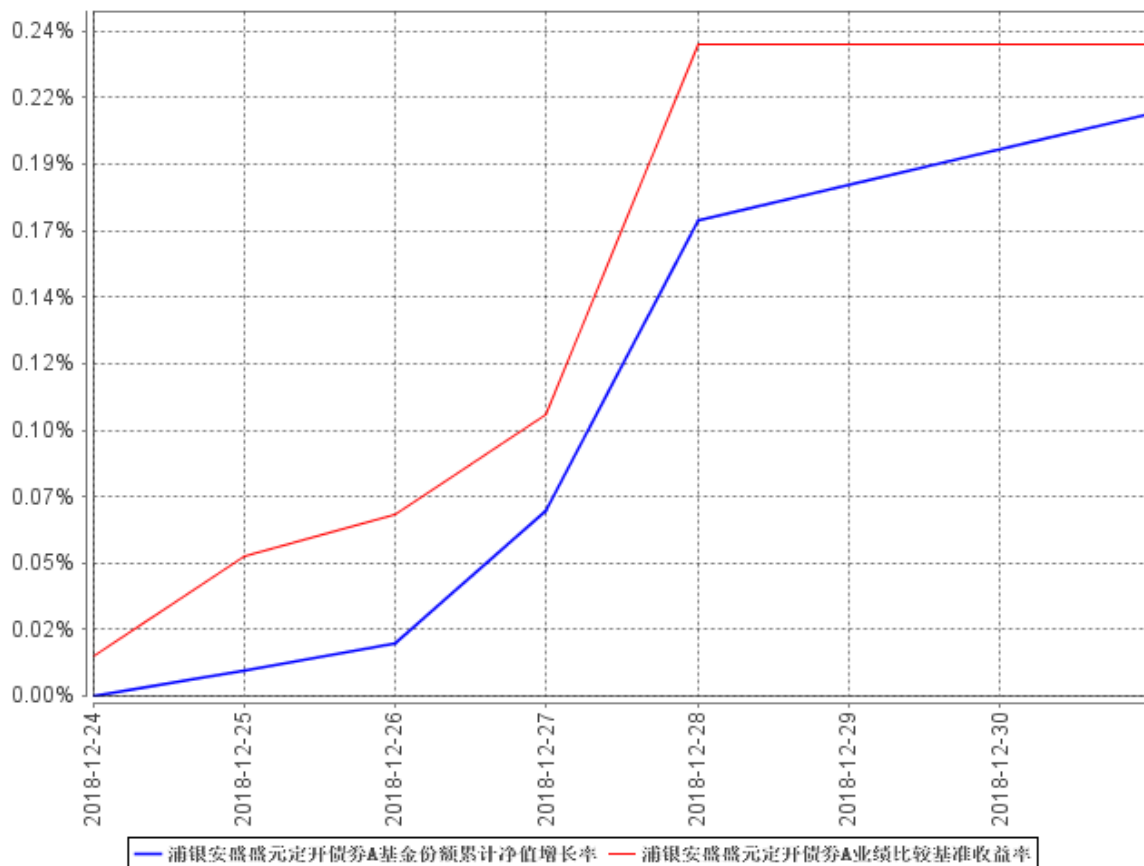
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金合同生效起至今	0.21%	0.04%	0.24%	0.05%	-0.03%	-0.01%

浦银安盛盛元定开债券 C

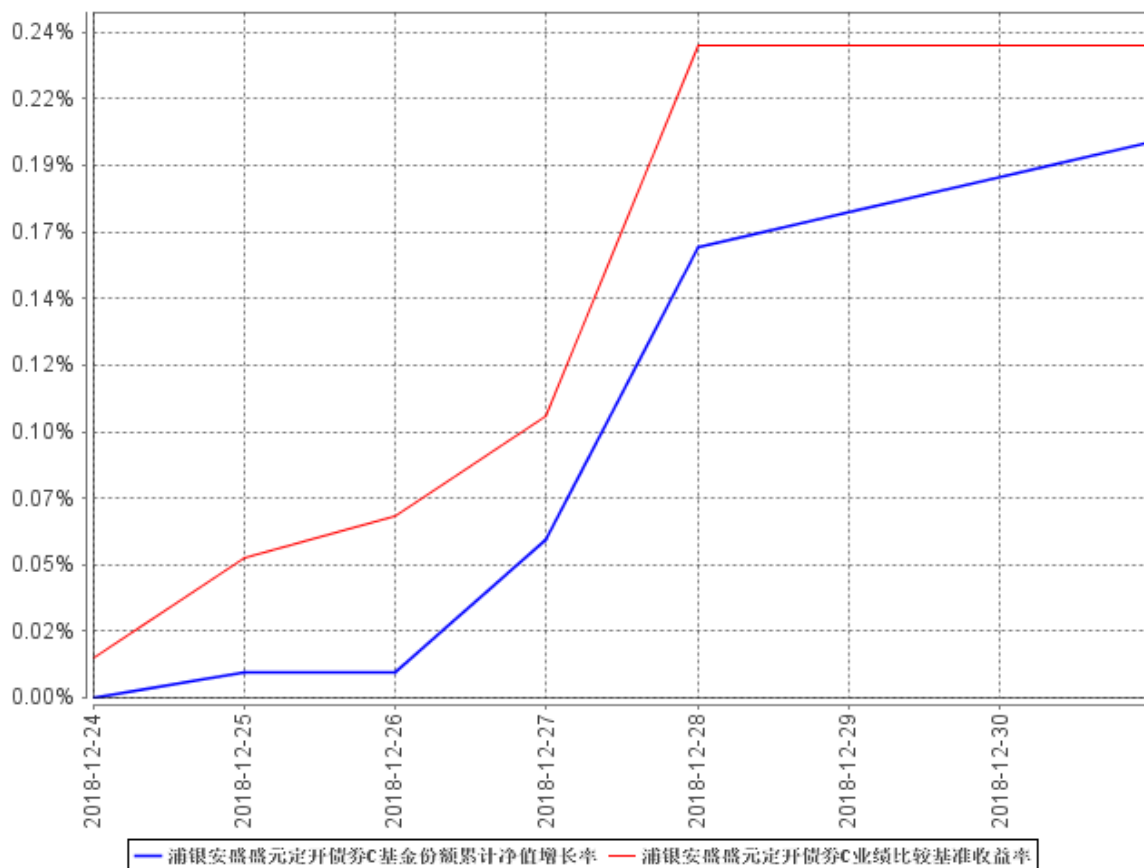
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金合同生效起至今	0.20%	0.04%	0.24%	0.05%	-0.04%	-0.01%

3.2.2 自基金转型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

浦银安盛盛元定开债券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

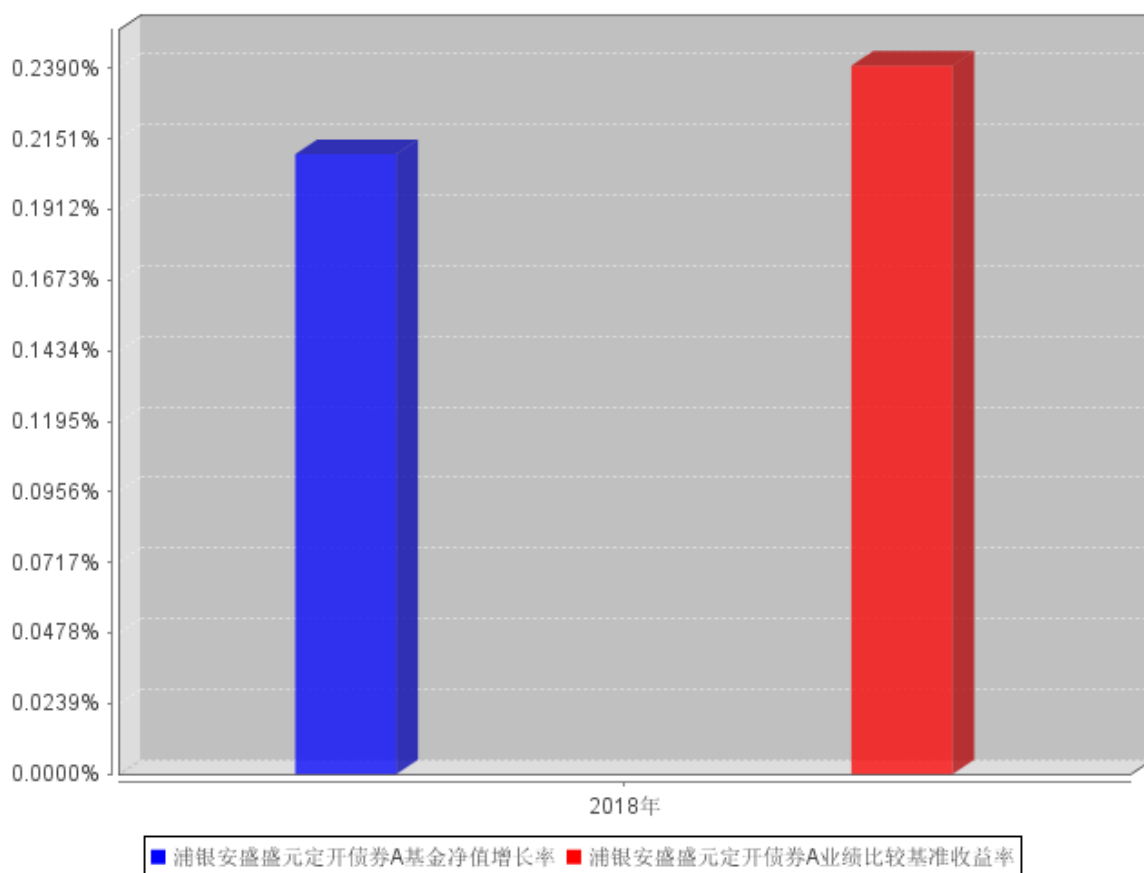


浦银安盛盛元定开债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

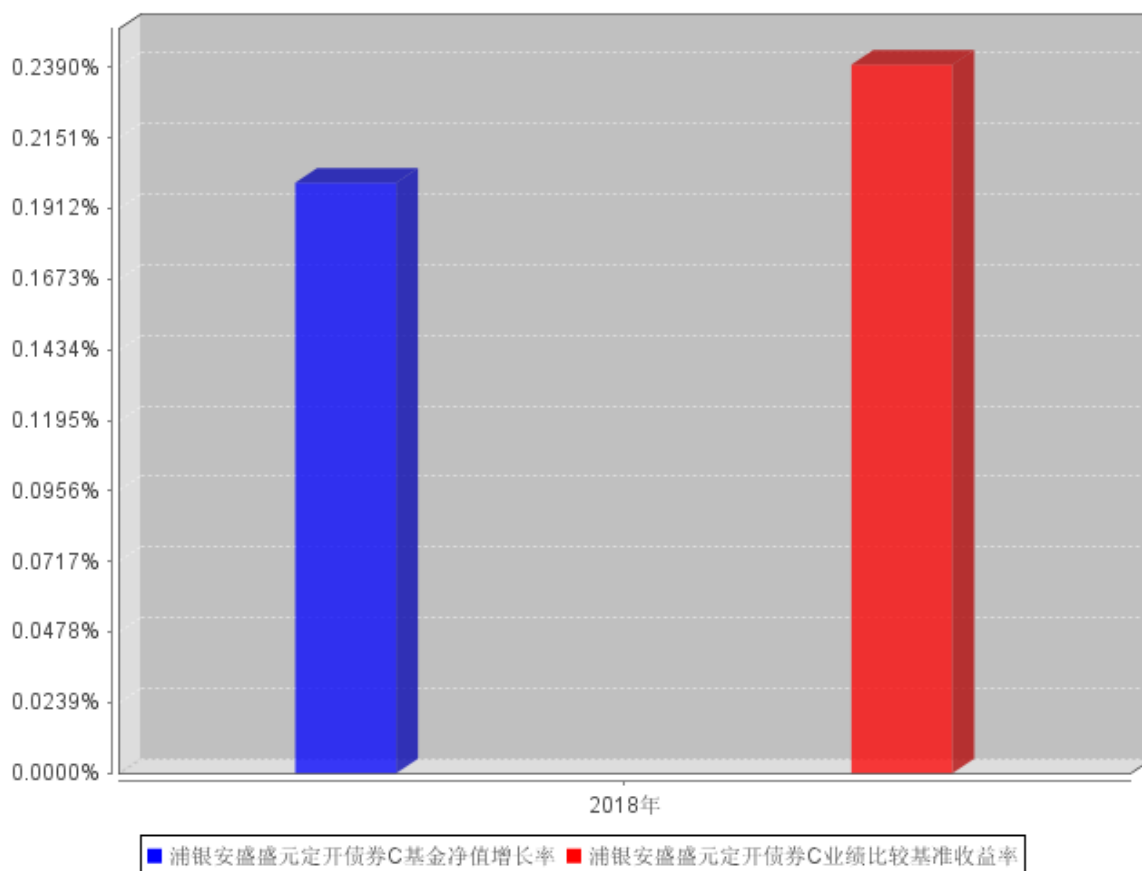


3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浦银安盛盛元定开债券A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对比图



浦银安盛盛元定开债券C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对比图



注：浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金于 2018 年 12 月 24 日转型为浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金，转型当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

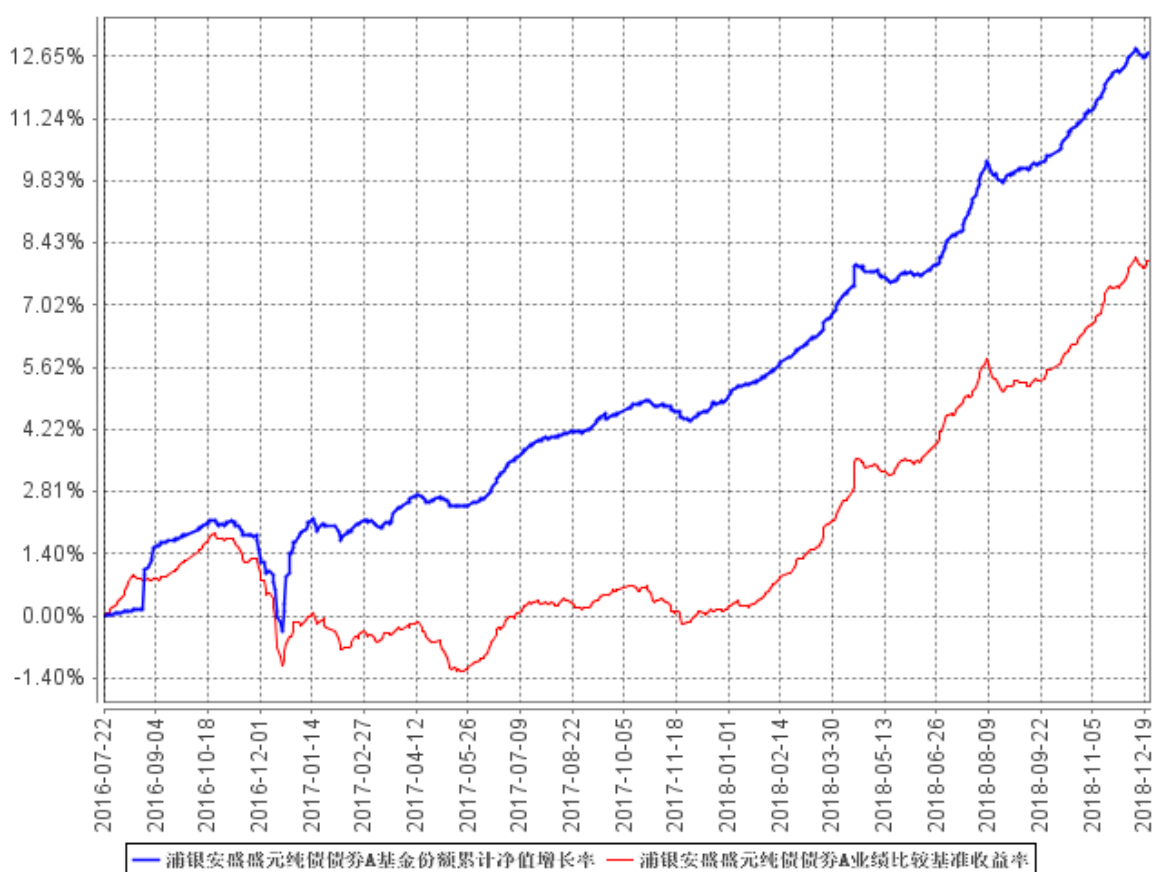
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① ③	② ④
过去三个月	2.09%	0.04%	2.33%	0.05%	-0.24%	-0.01%
过去六个月	4.26%	0.05%	3.68%	0.05%	0.58%	0.00%
过去一年	7.45%	0.05%	7.87%	0.06%	-0.42%	-0.01%
自基金合同生效起至今	12.72%	0.07%	8.01%	0.07%	4.71%	0.00%

浦银安盛盛元纯债债券 C

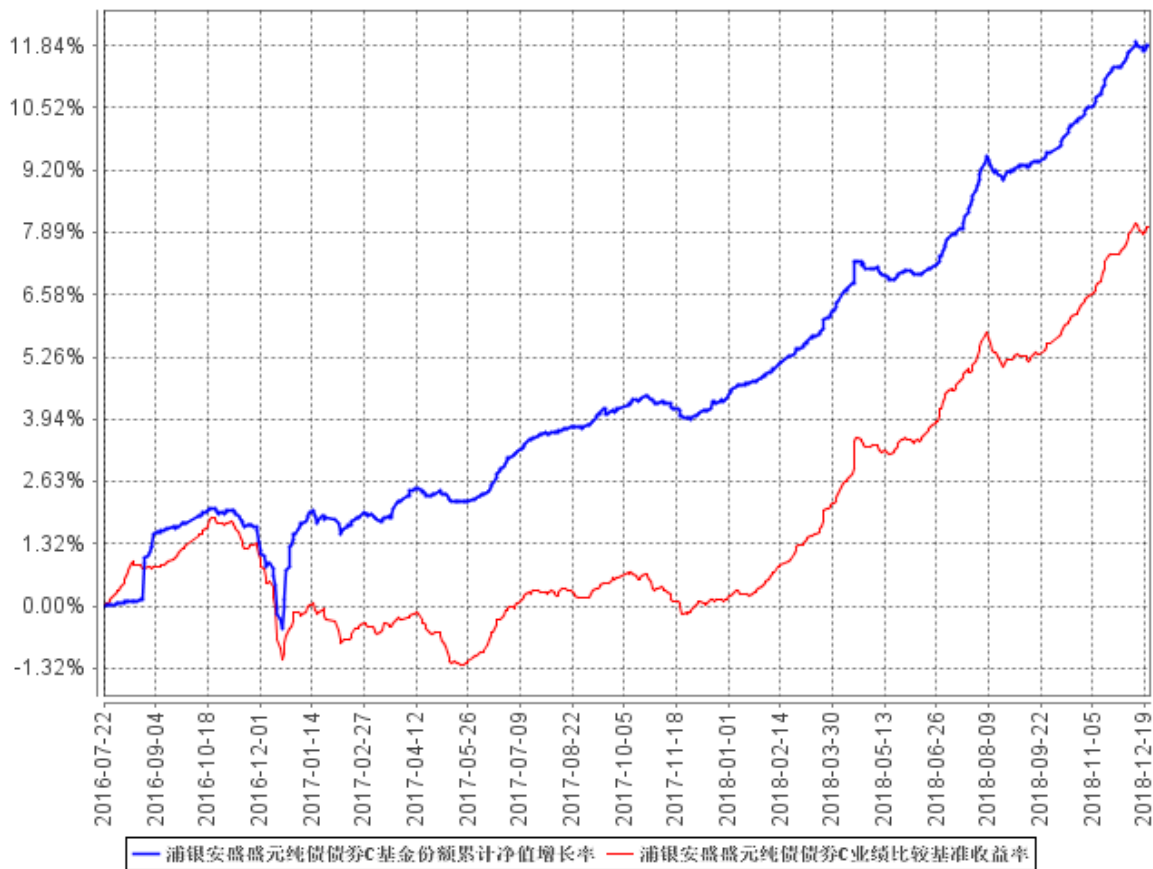
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	③ ③	④ ④
过去三个月	2.09%	0.04%	2.33%	0.05%	-0.24%	-0.01%
过去六个月	4.26%	0.05%	3.68%	0.05%	0.58%	0.00%
过去一年	7.45%	0.05%	7.87%	0.06%	-0.42%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	12.72%	0.07%	8.01%	0.07%	4.71%	0.00%

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

浦银安盛盛元纯债债券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

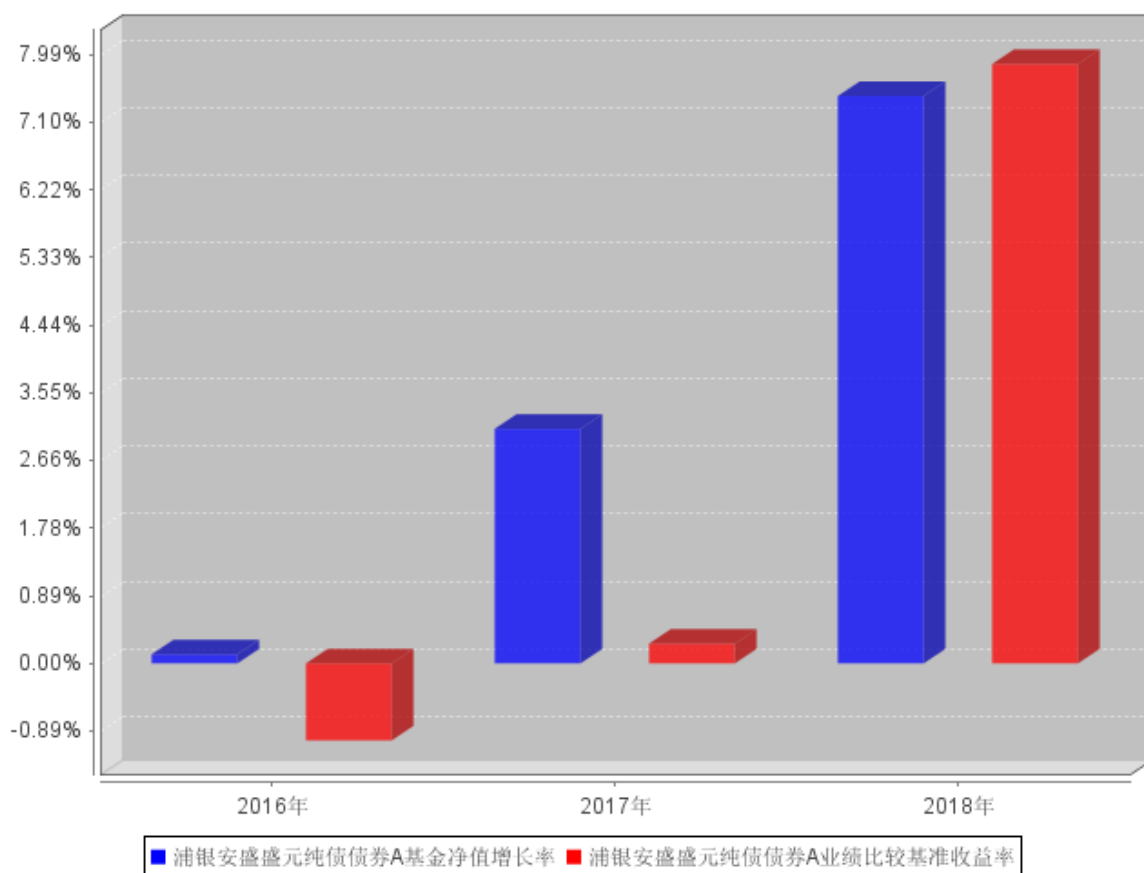


浦银安盛盛元纯债债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

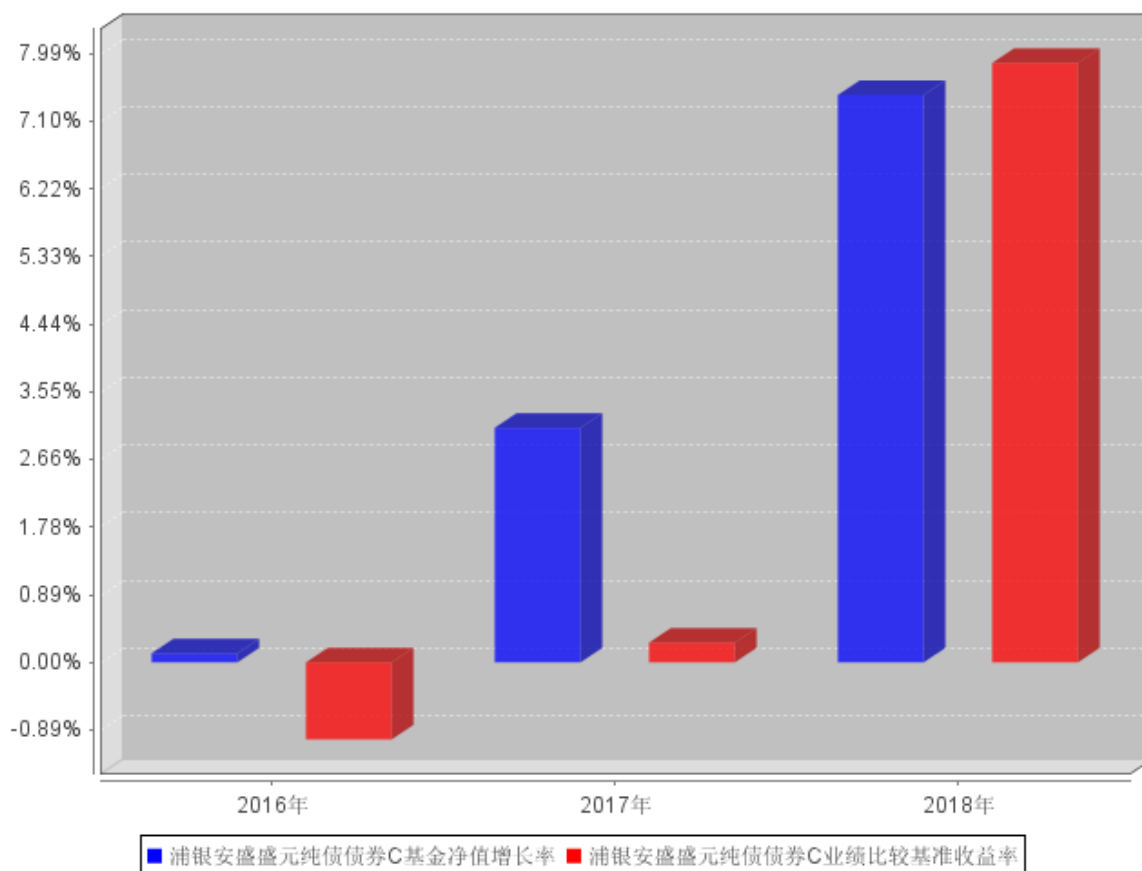


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浦银安盛盛元纯债债券A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对比图



浦银安盛盛元纯债债券C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对比图



注：浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金基金合同于 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 其他指标

3.4 过去三年基金的利润分配情况

转型前

单位：人民币元

浦银安盛盛元纯债债券 A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	0.6200	306,397,691.24	63.22	306,397,754.46	
2017	0.1500	92,145,533.08	88.51	92,145,621.59	
2016	-	-	-	-	
合计	0.7700	398,543,224.32	151.73	398,543,376.05	

单位：人民币元

浦银安盛盛元纯债债券 C					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注

2018	0.5600	29,060.82	621.79	29,682.61	
2017	0.1300	1,466.66	384.69	16,851.35	
2016	-	-	-	-	
合计	0.6900	45,527.48	1,006.48	46,533.96	

转型后

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 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 2018 年 12 月 31 日止，浦银安盛旗下共管理 43 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、浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金、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。

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（转型后）

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		
章潇枫	公司旗下浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛泰纯债	2017年6月8日	-	7	章潇枫先生，复旦大学数学与应用数学专业本科学历。加盟浦银安盛基金前，曾任职于湘财证券股份有限公司，历任金融工程研究员、报价回购岗以及自营债券投资岗。2016年6月加盟浦银安盛基金

	<p>债券型证券投资基金、浦银安盛盛达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、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 (LOF)、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金以及浦银安盛普益纯债债券型证券投资基金基金经理。</p>				<p>公司，在固定收益投资部担任基金经理助理岗位。2017 年 5 月起担任公司旗下浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛达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及浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2017 年 6 月起担任公司旗下浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金及浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月至 2018 年 7 月担任公司旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金及浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月至 2019 年 1 月担任浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月起兼任浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起担任公司旗下浦银安盛普益纯债债券型证券投资基金基金经理。</p>
郑双超	固定收益类基金经理助理	2017 年 12 月 14 日	-	8	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债券基金基金经理助理。
杜雪川	固定收益类基金经理助理	2018 年 4 月 4 日	-	6	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 日调岗至固定收益投资部基金经理助理职位。

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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
章潇枫	公司旗下浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金、浦银安盛	2017 年 6 月 8 日	-	8	章潇枫先生，复旦大学数学与应用数学专业本科学历。加盟浦银安盛基金前，曾任职于湘财证券股份有限公司，历任金融工程研究员、报价回购岗以及自营债券投资岗。2016 年 6 月加盟浦银安盛基金公司，在固定收益投资部担任基金经理助理岗位。2017 年 5 月起担任公司旗下浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基

	<p>幸福聚益 18 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 (LOF)、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金以及浦银安盛普益纯债债券型证券投资基金基金经理。</p>				<p>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及浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。</p> <p>2017 年 6 月起担任公司旗下浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金及浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月至 2018 年 7 月担任公司旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金及浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月至 2019 年 1 月担浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月起兼任浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起担任公司旗下浦银安盛普益纯债债券型证券投资基金基金经理。</p>
郑双超	固定收益类基金经理助理	2017 年 12 月 14 日	-	8	<p>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债券基金基金经理助理。</p>

杜雪川	固定收益类基金经理助理	2018年4月4日	-	6	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日调岗至固定收益投资部基金经理助理职位。
-----	-------------	-----------	---	---	---

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 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）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。

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

2018 年债券市场收益率走出了相当顺畅的下行行情。上半年我国宏观经济内部整体上持续有韧性，边际压力有所加大，特朗普掀起贸易战使外部不确定性增强，外需向下的预期升温。一季度，金融环境仍处于紧货币、紧信用的强监管态势，社融增速下滑，非标快速收缩，金融机构信用创造能力和欲望明显减弱，尽管基本面韧性仍在，债券市场收益率还是走出了纠错行情，伴随融资需求的减弱逐步脱离了顶部区间。二季度，随着央行开启新一轮降准，金融环境过渡至宽货币、紧信用，债券市场收益率震荡下行，期间随着信用创造的不断收缩，中小企业频繁爆雷，低等级和民营企业信用债的信用利差快速走扩。三季度，定向降准、信用债换 MLF 等一系列定向扶持政策出台，金融环境彻底转向宽货币、宽信用，但金融机构信用创造信心的恢复非一日之功，受到资本充足率、小微不良高企、经济下行周期难以逆势扩张等因素制约，合理充裕无法合理传导，金融体系流动性仅传导至中高等级信用债，利率债收益率震荡下行，AAA 和 AA+级央企、国企信用利差快速收窄，低等级和民营企业信用债仍少有人问津。四季度，全球主要发达国家经济增长减速，国内经济也同步加速下行，社融增速大幅放缓，汽车消费持续低迷，房地产销售和土地出让加速下行，固定资产投资表现亮眼起到托底经济的作用，债券市场收益率震荡下行。

2018 年度，本基金维持高杠杆和中等以上久期，调仓卖出低等级信用债，高配高等级信用债，期间通过中期限利率债等进行波段操作，整体仓位保持偏进攻的状态。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期转型前 A 类基金的净值增长率为 7.45%，C 类基金的净值增长率为 7.45%，业绩比较基准收益率为 7.87%；转型后 A 类基金的净值增长率为 0.21%，C 类基金的净值增长率为 0.20%，业绩比较基准收益率为 0.24%。

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 2019 年，债券市场主要的机会来自货币政策进一步宽松带来短端利率的松动，以及可能出现的地产投资下滑。以 10 年国开债为例，过去 16 年来中枢位置大约在 4%，假如地产投资全年没有明显下滑，那么其收益率大部分时间里大概率落在 3.5%-4%区间内震荡，其下行的主要动力决定于短端利率能否有效松动，举例来说七天回购利率维持在 2%以下；假如地产投资在适当放松后未有起色，销售下滑最终带来投资下行，那么 10 年国开债的收益率水平有望再次挑战

3%。

2019 年上半年特别是一季度，市场对经济基本面弱有一致性预期，但受库存周期往上，信贷集中投放，地产因城施策等因素影响，经济基本面亦有一定支撑，经济超预期差的可能性不大。年初 10 年国开债下行至 3.50%的水平已经充分了 price in 了市场一致预期，往后大概率进入震荡格局。在股票估值处于历史性低位的情况下，需提防风险偏好提升对债券市场的不利影响。目前市场对 2019 年经济走势一致预期是前低后高，但低估了下半年地产投资走弱的风险。考虑 2018 年四季度地产销售和土地出让明显下滑，根据历史经验今年二、三季度地产投资往下的压力会很大，很可能使得地产因城施策等放松政策的效果不及预期。经济复苏、前低后高预期若被证伪，债券市场会出现真正大的投资机会。

本基金将继续秉承稳健专业的投资理念，谨慎操作、严格风控，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

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。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。2018 年，合规风控工作内容涵盖了制度内控、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。合规法务方面，在部门同事和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，同时各类仲裁程序和违约债券法律处置程序顺畅；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，借助中债资信买方评级服务，信用风险管控能力大幅提升；稽核内审方面，根据监管要求和公司内部审计计划开展了各项专项稽核工作，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。

（一）进一步健全合规风控团队，提高团队的专业素养

2018 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 workflows，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。

（二）进一步建立健全风险控制体系

1、完善公司风险控制制度体系的建设

2018 年监管机关发布了《关于进一步加强证券基金经营机构债券交易监管的通知》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等对资本市场和基金公司产生较大影响的法规。我司也根据相关法规的要求，对我司的制度进行了修订和完善。同时，公司新增和修订了《2019 年度风险偏好》、《浦银安盛基金管理有限公司账户解冻、回转及应急交易流程》、《ETF 投资管理制度》、《ETF 风险管理小组管理规定》、《ETF 应急预案》、《风险分级管理规定》等规章制度和业务流程，满足未来业务开展的需要，并进一步提高我司业务开展的规范性。此外，风险管理部组织牵头实施了 BCP 各关键业务系统的应急演练和紧急情况下通知路径的电话树应急演练，组织风险偏好制度和年度风险偏好限额的制定，并对投资者适当性风险等级划分方法的调整等工作。

2、对投资组合进行定期风险评估

风险管理部进一步完善了在市场风险、信用风险、流动性风险和创新产品/业务风险等方面的风险评估及提示机制。在市场风险方面，从市场趋势和宏观政策方面，对我司产品的股票仓位、板块配置、行业配置、债券组合久期、杠杆、波动率等进行提示；在信用风险方面，风险管理部引入专业信用风险人员，对信用风险预警债券、中债资信分层名单中层级较低的债券、高风险行业（两高一剩等）的债券以及有负面新闻的相关债券，定期对组合持仓进行排查并对信用分析师和投资经理进行提示和监督。同时，风险管理部定期从独立角度对质押券的信用风险进行监测，一旦发现信用风险隐患或信用风险事件，则立即提示相关涉事部门；在流动性风险方面，风险管理部针对不同产品类型制定流动性监控方案，并根据市场情况或时间节点定期或不定期进行流动性压力测试，关注各项合规指标，实时监控，并提示基金经理，监督反馈及调整事宜。在创新产品/业务风险管控方面，公司 2018 年逐步推行了创新产品/业务风险评估流程，创新业务的发起部门、风险管理部和其它配合部门均能在创新业务开展前较早的参与该业务的风险识别，并提出相应的控制措施建议，对于识别出的无法控制的风险，尽早向公司提出资源支持或通过部门

间的交叉控制措施来化解相应风险。

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

风险管理部至少每月会对公司旗下管理全部公募及专户产品的业绩表现、相对市场其他类似产品的表现、主要收益来源及风险暴露情况进行分析，帮助基金经理明明白白赚钱，同时为绩效考核委员会提供了量化绩效考核的数据支持。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

风险管理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。目前，风险管理部异常交易分析的频率为每月一次，并根据《关于规范债券市场参与者债券交易业务的通知》的要求及时报送异常交易行为，进一步确保投资组合的投资过程中的合法合规。

5、对公司新产品提供高效、有力的支持

2018 年，公司新发行了 2 只专户产品，9 只公募基金及开发中的产品 20 余只。风险管理部与投资团队、产品团队、运营团队合作，就各产品的投资合规风险、流动性风险、市场风险、信用风险、操作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

2018 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、另类投资部、投资管理部、财富管理部（筹）、及运营管理部等业务部门，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，同时根据业务特征，设立资产证券化业务内核委员会，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；

基金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。公司按照《浦银安盛基金管理有限公司子公司管理规定》，对子公司实行风控合规垂直管理，明确了子公司重大事项报告机制，并建立了对子公司的稽核评估机制，年内按照相关法规要求对子公司开展了两次审计工作。母公司对子公司的内控管理主要以事后稽核及重大事件报告为主，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

2018 年，公司进一步加大对各部门、各岗位的风险事件考核力度。公司建立完善了《合规绩效考核管理规定》，依照问题或风险事件的不同等级和影响程度，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，通过下发合规风控函的形式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。

（三）稽核（审计）工作

根据相关法规要求、公司的实际运作情况及稽核计划，稽核团队有重点、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稽核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稽核报告及整改进展情况表中。

此外，稽核团队还负责协助接受外部检查、对股东审计团队的定期报告工作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。

2018 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工作；
- 2、完成了对子公司业务的两次专项审计工作；
- 3、根据监管部门要求，完成 2018 年投资者适当性自查工作；
- 4、根据行业内近期监管通报问题进行了基金分红专项检查工作；
- 5、开展了公司综合管理事务专项审计工作；
- 6、完成了数次投资管理人员离任审查工作；

另外，2018 年度，内审团队协调配合审计署以及总行审计部门两次重要的外部审计工作，并配合外部会计师事务所完成了年度内控审计和专项审计等工作。

2019 年，公司监察稽核部将在公司预算内进一步完善人员配置，不断深化稽核工作的深度和提高稽核工作的有效性。

（四）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、2018 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，对于出现的重大关联交易，将及时进行披露；

4、参与公司增资及设立分公司相关三会程序及法律文件审核；

5、互联网营销等创新业务合规论证。

（五）信息披露和文件报送

由于公司信息披露的负责人设在监察稽核部，因此监察稽核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务性工作，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法务团队很多时间，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，基本未出现重大迟披、漏披、延披、错披的情形。

2018 年，按时按质完成基金及其他定期报告（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。2018 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。

（六）法律事务

对公司签署的上千份协议、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，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，合规法务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。年内，合规法务团队还进行东特钢债转股法律程序、银河证券交易所协议式回购对我方违约

的法律程序，协助公安局调查取证等。

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，公司未发生重大诉讼或仲裁现象，较好地控制了法律风险。

（七）合规和法律培训

根据工作安排，监察稽核部的合规法务团队负责公司的合规培训工作，合规培训采取现场和非现场方式，内容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、反洗钱培训、违法违规案例通报等。现场培训前，合规法务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、合规法务团队每日登陆各监管官网及报备平台，搜集新法律法规、监管动态及行业违规案例，邮件发业务部门学习参考，并向管理层、董事及股东方传达，持续进行合规教育。

2、公司 2018 年对新入职员工分两场进行了入职合规现场培训，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、反洗钱等相关合规要求；

3、由于中国证券基金业协会每年会安排 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，2018 全年为业务人员提供了 13 次现场合规培训，内容包括老鼠仓、宣传销售、监管新规、反洗钱等。2018 年初，公司根据控股股东上海浦东发展银行的有关通知规定，组织公司员工签署了《案件防控目标责任书》，员工对履行相关案件防控措施和要求进行了承诺。

4、公司 2018 年对反洗钱相关人员及公司其他员工开展了 4 场反洗钱合规培训（现场培训 3 次，非现场培训 1 次），共计 12.2 个小时 66 人次。

2018 年，公司对《浦银安盛基金管理有限公司合规手册》、《浦银安盛基金管理有限公司宣传销售工作合规指南》进行了修订，作为员工合规培训教育的一个有效方式，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。

（八）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团队的重要工作之一。合规法务团队全年推动公司所有新订、修订制度、流程的工作。

（九）组织进行反洗钱工作

公司反洗钱工作由监察稽核部的合规法务团队具体牵头和落实。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）定期或不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。

（十）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监察稽核部负责，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、合规法务团队落实相关法规的检查工作；
- 4、代表公司参与上海基金同业公会的相关会议。

（十一）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，合规法务团队负责指导、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。

（十二）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。

（十三）与中介机构的协调

监察稽核部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、分公司设立等出具法律意见书。

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 2018 年，从董事会、管理层到员工，对监察稽核部工作都比以前有了更多的重视和理解、支持，监察稽核部与公司各部门的联系日益紧密和协调，这为公司监察稽核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

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期末可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

本基金本报告期内浦银安盛盛元 A 级基金应分配收益 306,397,754.46 元，实际分配收益 306,397,754.46 元；浦银安盛盛元 C 级基金应分配收益 29,682.61 元，实际分配收益 29,682.61 元。

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、本基金转型过渡期出现人数连续 20 工作日小于 200 人的情形，转型后人数符合法律规定。

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

报告期内，本托管人严格遵守《证券公司客户资产管理业务管理办法》及其他有关法律法规、本计划合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了托管人义务，不存在损害本计划委托人利益的行为。

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、本计划合同和托管协议的规定，对管理人在本计划的投资运作、资产净值的计算、收益的计算、计划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计划委托人利益的行为。

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报告期《浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金证券投资基金（原浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金基金转型）2018 年年度报告》中的财务指标、净值表现、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（转型后）

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(2019)第 22200 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	浦银安盛盛元定期开放债券型发起式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盛元定期开放债券型发起式证券投资基金(原浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金, 以下简称“浦银安盛盛元定期开放债券基金”)的财务报表, 包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表, 2018 年 12 月 24 日(转型生效日)至 2018 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。</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盛元定期开放债券基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 12 月 24 日(转型生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间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盛元定期开放债券基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>浦银安盛盛元定期开放债券基金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”)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, 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盛元定期开放债券基金的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项(如</p>

	<p>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盛元定期开放债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督浦银安盛盛元定期开放债券基金的财务报告过程。</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。</p> <p>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。</p>

	<p>同时，根据获取的审计证据，就可能对浦银安盛盛元定期开放债券基金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。然而，未来的事项或情况可能导致浦银安盛盛元定期开放债券基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</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	张振波 罗佳
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	2019 年 3 月 26 日

§6 审计报告（转型前）

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(2019)第 25094 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：
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了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 2018 年 12 月 23 日(基金转型前日)的资产负债表,2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 23 日(基金转型前日)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。</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盛元纯债基金 2018 年 12 月 23 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 23 日(基金转型前日)止期间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盛元纯债基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>浦银安盛盛元纯债基金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”)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,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盛元纯债基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),</p>

	<p>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盛元纯债基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督浦银安盛盛元纯债基金的财务报告过程。</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。</p> <p>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，就可能导致对浦银安盛盛元纯债基金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</p>

	<p>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。然而，未来的事项或情况可能导致浦银安盛盛元纯债基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</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	张振波 罗佳
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	2019 年 3 月 26 日

§7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	18,032,542.28
结算备付金		12,858,490.65

存出保证金		13,133.32
交易性金融资产	7.4.7.2	8,821,328,180.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		8,821,328,180.00
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	1,884,972,187.46
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	179,610,751.53
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		10,916,815,285.24
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018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		693,400,000.00
应付证券清算款		16,824,749.51
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,564,129.34
应付托管费		521,376.47
应付销售服务费		34.26
应付交易费用	7.4.7.7	55,414.08
应交税费		787,175.04
应付利息		539,815.49
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	361,000.00
负债合计		714,053,694.19
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	9,729,009,681.06
未分配利润	7.4.7.10	473,751,909.99
所有者权益合计		10,202,761,591.05
负债和所有者权益总计		10,916,815,285.24

注：1、报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额为 9,729,009,681.06 份，其中 A 类基金份额净值 1.0487 元，A 类基金份额 9,729,005,527.30 份；C 类基金份额净值 1.0484 元，C 类基

金份额 4,153.76 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 12 月 24 日(转型生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 12 月 24 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 12 月 24 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		23,972,529.89
1. 利息收入		10,217,037.68
其中：存款利息收入	7.4.7.11	84,516.54
债券利息收入		7,390,966.81
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,741,554.33
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-
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	-
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	13,755,492.21
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	-
减：二、费用		1,794,624.12
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	587,558.43
2. 托管费	7.4.10.2.2	195,852.82
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	0.32
4. 交易费用	7.4.7.19	6,449.87
5. 利息支出		936,897.54
其中：卖出回购金融资产支出		936,897.54
6. 税金及附加		19,955.99
7. 其他费用	7.4.7.20	47,909.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,177,905.77
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,177,905.77
-------------------	--	---------------

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 12 月 24 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 12 月 24 日（基金合同生效日）至 2018 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）	4,941,624,545.35	228,959,639.93	5,170,584,185.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,177,905.77	22,177,905.77
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）	4,787,385,135.71	222,614,364.29	5,009,999,500.00
其中：1. 基金申购款	4,787,385,135.71	222,614,364.29	5,009,999,500.00
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-	-	-
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）	9,729,009,681.06	473,751,909.99	10,202,761,591.05

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：

<u> 郁蓓华 </u>	<u> 郁蓓华 </u>	<u> 钱琨 </u>
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

浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金（原“浦银安盛盛元纯债债券型证券投资

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[2016]1206号《关于准予浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金注册的批复》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《浦银安盛盛元纯债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 200,781,448.69 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(2016)第 825 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,790,482.23 份基金份额，其中认购资金利息折合 9,033.54 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决通过的《浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金转型有关事项的议案》及中国证监会证监许可[2018]1819号《关于准予浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金变更注册的批复》，浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金变更注册为浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金，修订和更新后的《浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》及其他法律文件自 2018 年 12 月 24 日起生效。

本基金以定期开放的方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。自基金合同生效日起（包括基金合同生效日）或者每一个开放期结束之日次日起（包括该日）3 个月的期间内，本基金采取封闭运作模式。每一个封闭期结束后，本基金即进入开放期，开放期的期限为自封闭期结束之日后第一个工作日起（含该日）一至二十个工作日，具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。开放期内，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。开放期末赎回的份额将自动转入下一个封闭期。

基金为发起式基金，发起资金申购部分为 9,554,748.71 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和《浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据申购费用收取方式的不同，基金份额分为不同类别：在投资者申购基金时收取认购、申购费用的为 A 类基金份额；不收取申购

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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛盛元定期开放债券型发起式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债券（国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、地方政府债、中小企业私募债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款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金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不买入股票、权证等权益类资产，可转换债券仅投资于可分离交易可转债的纯债部分。本基金各类资产的投资比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%。应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，开放期开始前 10 个工作日、开放期以及开放期结束后的 10 个工作日内，本基金债券资产的投资比例不受上述比例限制。开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例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；在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。本基金的业绩比较基准为：中证综合债指数收益率。

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 2019 年 3 月 26 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〈年度报告和半年度报告〉》、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》、《浦银安盛盛元定期开放债券型发起式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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 12 月 24 日(转型生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 12 月 24 日(转型生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2018 年 12 月 24 日(转型生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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。

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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	18,032,542.28
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：	18,032,542.28

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	估值增值	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	1,571,769,051.98	1,567,335,600.00	-4,433,451.98
	银行间市场	7,161,496,607.32	7,253,992,580.00	92,495,972.68
	合计	8,733,265,659.30	8,821,328,180.00	88,062,520.70
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	8,733,265,659.30	8,821,328,180.00	88,062,520.70	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2018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	1,884,972,187.46	-
合计	1,884,972,187.46	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
应收活期存款利息	79,942.82
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	6,364.93
应收债券利息	176,856,501.84
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	2,667,935.45
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	6.49
合计	179,610,751.53

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	55,414.08

合计	55,414.08
----	-----------

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	361,000.00
合计	361,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

浦银安盛盛元定开债券 A		
项目	本期 2018年12月24日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	4,941,620,391.59	4,941,620,391.59
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	4,787,385,135.71	4,787,385,135.71
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	9,729,005,527.30	9,729,005,527.30

金额单位：人民币元

浦银安盛盛元定开债券 C		
项目	本期 2018年12月24日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	4,153.76	4,153.76
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	4,153.76	4,153.76

注：1. 根据《关于浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生

效的公告》，本基金转型选择期为 2018 年 12 月 18 日至 2019 年 1 月 16 日。在转型选择期内，投资人仅可以申请赎回，不可以申请申购。转型选择期内，本基金基金份额的全部基金份额持有人如果全部赎回已持有的本基金基金份额或者告知基金管理人其对基金份额采取的选择措施均已实施完毕，则基金管理人可视情况提前终止选择期，并通过公告形式确认本基金正式转型。根据 2018 年 12 月 21 日发布的《浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告》，基金管理人根据全部基金份额持有人的选择提前终止转型选择期，并公告《浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 12 月 24 日生效。

2. 根据《浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》、《浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》及《浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金 2018 年度开放日常申购、赎回的业务公告》的相关规定，本基金于 2018 年 12 月 24 日(基金合同生效日)至 2019 年 1 月 22 日止期间向投资人开放基金交易申购和赎回业务。

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

浦银安盛盛元定开债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	111,160,327.36	117,799,121.17	228,959,448.53
本期利润	8,422,410.05	13,755,486.18	22,177,896.23
本期基金份额交易产生的变动数	108,109,627.98	114,504,736.31	222,614,364.29
其中：基金申购款	108,109,627.98	114,504,736.31	222,614,364.29
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	227,692,365.39	246,059,343.66	473,751,709.05

金额单位：人民币元

浦银安盛盛元定开债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	92.34	99.06	191.40
本期利润	3.51	6.03	9.54
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-

本期已分配利润	-	-	-
本期末	95.85	105.09	200.94

7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期	
	2018 年 12 月 24 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
活期存款利息收入	79,878.77	
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	4,629.04	
其他	8.73	
合计	84,516.54	

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-买卖股票差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-买卖债券差价收入。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年12月24日(基金合同生效日)至 2018年12月31日
1. 交易性金融资产	13,755,492.21
——股票投资	-
——债券投资	13,755,492.21
——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	-
合计	13,755,492.21

7.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年12月24日(基金合同生效日)至2018 年12月31日

交易所市场交易费用	149.87
银行间市场交易费用	6,300.00
合计	6,449.87

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年12月24日(基金合同生效日)至 2018年12月31日
审计费用	2,650.93
信息披露费	5,258.22
其他费用	40,000.00
合计	47,909.15

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	基金管理人的股东
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内未有应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2018年12月24日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	587,558.43
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00

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 0.30% 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 × 0.30% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018年12月24日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	195,852.82

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10%/ 当年天数。

7.4.10.2.3 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 2018年12月24日(基金合同生效日)至2018年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浦银安盛盛元定开 债券 A	浦银安盛盛元定开 债券 C	合计
	浦银安盛基金管理有限 公司	0.00	0.32
合计	0.00	0.32	0.32

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

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。

7.4.10.3 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未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018年12月24日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	浦银安盛盛元定开债券 A	浦银安盛盛元定开债券 C
基金合同生效日持有的基金份额	0.00	0.00
期初持有的基金份额	0.00	0.00
期间申购/买入总份额	9,554,748.71	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额	9,554,748.71	0.00

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.10%	0.00%
-----------------------	-------	-------

注：1、期间申购/买入总份额包含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、基金管理人在上年度可比期间未持有本基金。

3、本基金自 2018 年 12 月 24 日转为发起式基金。基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

浦银安盛盛元定开债券 A		
关联方名称	本期末 2018 年 12 月 24 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
兴业银行股份有限公司	9,719,400,809.63	99.90%

份额单位：份

浦银安盛盛元定开债券 C		
关联方名称	本期末 2018 年 12 月 24 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例

注：浦银盛元 C

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浦银盛元 C。

7.4.10.5 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 2018 年 12 月 24 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	18,032,542.28	79,878.77

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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 693,400,000.00 元，截至 2019 年 1 月 2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险收益的产品。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种，包括债券（国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、地方政府债、中小企业私募债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不买入股票、权证等权益类资产，可转换债券仅投资于可分离交易可转债的纯债部分。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%。应开放期流动性需要，为保护基金份额

持有人利益，开放期开始前 10 个工作日、开放期以及开放期结束后的 10 个工作日内，本基金债券资产的投资比例不受上述比例限制。开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例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。

7.4.13.1 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监察稽核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，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，将风险控制可在可承受的范围内。

7.4.13.2 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兴业银行，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。

7.4.13.2.1 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 2018年12月31日
A-1	201,730,000.00
A-1 以下	-
未评级	1,082,570,000.00
合计	1,284,300,000.00

注：于 2018 年 12 月 31 日，未评级部分为政策性金融债、短期融资券。债券信用评级取自第三

方评级机构。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.2.4 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 2018年12月31日
AAA	3,973,932,500.00
AAA 以下	2,222,109,680.00
未评级	1,340,986,000.00
合计	7,537,028,180.00

注：于 2018 年 12 月 31 日，未评级部分为国债、政策性金融债、地方政府债。债券信用评级取自第三方评级机构。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.3 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 2018 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 693,400,000.00 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。

7.4.13.3.1 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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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期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 2018 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。

7.4.13.4 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、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 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。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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2018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	-	-	-	-	18,032,542.28
结算备付金	-	-	-	-	12,858,490.65
存出保证金	-	-	-	-	13,133.32
交易性金融资产	-5,622,658,120.00	1,178,461,000.00		-	8,821,328,180.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	1,884,972,187.46
应收利息	-	-		-179,610,751.53	179,610,751.53

资产总计	-5,622,658,120.00	1,178,461,000.00	179,610,751.53	10,916,815,285.24
负债				
卖出回购 金融资产 款	-	-	-	693,400,000.00
应付证券 清算款	-	-	16,824,749.51	16,824,749.51
应付管理 人报酬	-	-	1,564,129.34	1,564,129.34
应付托管 费	-	-	521,376.47	521,376.47
应付销售 服务费	-	-	34.26	34.26
应付交易 费用	-	-	55,414.08	55,414.08
应付利息	-	-	539,815.49	539,815.49
应交税费	-	-	787,175.04	787,175.04
其他负债	-	-	361,000.00	361,000.00
负债总计	-	-	20,653,694.19	714,053,694.19
利率敏感 度缺口	-5,622,658,120.00	1,178,461,000.00	158,957,057.34	10,202,761,591.05

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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（2018年12月31日）
	市场利率上升 25 基点	-51,767,137.08
	市场利率下降 25 基点	52,463,681.33

7.4.13.4.2 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，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 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；同时采用“自下而上”的策略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：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%。应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，开放期开始前 10 个工作日、开放期以及开放期结束后的 10 个工作日内，本基金债券资产的投资比例不受上述比例限制。开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例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。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：于 2018 年 12 月 23 日(基金转型前日)，本基金未持有交易性权益类投资(2017 年 12 月 31 日：同)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.14 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 2018 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二层次的余额为 8,821,328,180.00 元，无属于第一或第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期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 2018 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。

(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。

§7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表（转型前）

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：2018 年 12 月 23 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 23 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	474,431.69	48,399,055.39
结算备付金		12,858,490.65	52,961,217.96
存出保证金		13,133.32	80,971.27
交易性金融资产	7.4.7.2	6,715,047,060.00	4,316,428,860.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		6,715,047,060.00	4,219,190,860.00
资产支持证券投资		-	97,238,000.00
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	0.00	1,225,285,357.93
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	156,732,124.06	98,913,886.63
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		6,885,125,239.72	5,742,069,349.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 23 日	上年度末 2017 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		1,711,576,668.27	619,100,000.00
应付证券清算款		114,544.77	12,280,240.26
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		976,570.91	1,298,766.85
应付托管费		325,523.65	432,922.28
应付销售服务费		33.94	174.70
应付交易费用	7.4.7.7	41,287.10	18,814.88
应交税费		585,800.94	-

应付利息		567,534.01	289,390.59
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	353,090.85	348,000.00
负债合计		1,714,541,054.44	633,768,309.56
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	4,941,624,545.35	4,942,427,779.70
未分配利润	7.4.7.10	228,959,639.93	165,873,259.92
所有者权益合计		5,170,584,185.28	5,108,301,039.62
负债和所有者权益总计		6,885,125,239.72	5,742,069,349.18

注：报告截止日 2018 年 12 月 23 日（基金转型前日），基金份额总额为 4,941,624,545.35 份，其中 A 类基金份额净值 1.0463 元，A 类基金份额 4,941,620,391.59 份；C 类基金份额净值 1.0461 元，C 类基金份额 4,153.76 份。

7.2 利润表

会计主体：浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 23 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 23 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		422,706,659.15	190,928,987.28
1. 利息收入		311,185,346.91	266,507,171.95
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,077,139.40	851,844.74
债券利息收入		305,825,707.16	252,778,783.46
资产支持证券利息收入		634,225.19	9,781,639.06
买入返售金融资产收入		3,648,275.16	3,094,904.69
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-23,493,051.24	-51,815,059.64
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	-23,824,995.96	-53,569,676.63
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	331,944.72	1,754,616.99
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	135,004,827.56	-23,763,148.44
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	9,535.92	23.41
减: 二、费用		53,158,695.40	28,003,398.70
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	15,065,962.83	15,939,267.46
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,021,987.66	5,313,089.10
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,769.70	3,005.71
4. 交易费用	7.4.7.19	51,240.87	56,679.19
5. 利息支出		31,641,143.73	6,271,876.77
其中: 卖出回购金融资产支出		31,641,143.73	6,271,876.77
6. 税金及附加		949,053.35	-
7. 其他费用	7.4.7.20	427,537.26	419,480.47
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		369,547,963.75	162,925,588.58
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		369,547,963.75	162,925,588.58

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金

本报告期: 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 23 日

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 23 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)	4,942,427,779.70	165,873,259.92	5,108,301,039.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	369,547,963.75	369,547,963.75
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)	-803,234.35	-34,146.67	-837,381.02
其中: 1. 基金申购款	81,552.74	2,940.41	84,493.15
2. 基金赎回款	-884,787.09	-37,087.08	-921,874.17
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“-”	-	-306,427,437.07	-306,427,437.07

号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	4,941,624,545.35	228,959,639.93	5,170,584,185.28
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	6,144,345,680.79	102,820,780.05	6,247,166,460.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	162,925,588.58	162,925,588.58
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)	-1,201,917,901.09	-7,710,635.77	-1,209,628,536.86
其中: 1. 基金申购款	367,112.65	6,177.85	373,290.50
2. 基金赎回款	-1,202,285,013.74	-7,716,813.62	-1,210,001,827.36
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)	-	-92,162,472.94	-92,162,472.94
五、期末所有者权益(基金净值)	4,942,427,779.70	165,873,259.92	5,108,301,039.62

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

浦银安盛盛元纯债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[2016]1206号《关于准予浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金注册的批复》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《浦银安盛盛元纯债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200,781,448.69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(2016)第 825 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,790,482.23 份基金份额，其中认购资金利息折合 9,033.54 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金基金合同》和《浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据认购、申购费用和销售服务费收取方式的不同，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，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额为 A 类基金份额；不收取认购、申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额为 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛盛元纯债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债、金融债、企业债、公司债、次级债、中央银行票据、地方政府债、中小企业私募债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同业存单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)。本基金不买入股票、权证等权益类资产，可转换债券仅投资于可分离交易可转债的纯债部分。本基金各类资产的投资比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；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：中证综合债指数收益率。

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 2019 年 3 月 26 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<年度报告和半年度报告>》、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》、《浦银安盛盛元纯债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。

根据本基金基金份额持有人大会表决结果及中国证监会批复,本基金于 2018 年 12 月 24 日变更为浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金,因此本基金财务报表仍以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 23 日(基金转型前日)止期间的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 2018 年 12 月 23 日(基金转型前日)的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 23 日(基金转型前日)止期间的的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 23 日(基金转型前日)。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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。

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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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

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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 23 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	474,431.69	48,399,055.39
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：	474,431.69	48,399,055.39

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月23日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,422,115,298.56	1,417,409,500.00
	银行间市场	5,218,624,732.95	5,297,637,560.00
	合计	6,640,740,031.51	6,715,047,060.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	6,640,740,031.51	6,715,047,060.00	74,307,028.49
项目	上年度末 2017年12月31日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,201,850,051.37	1,181,967,800.00
	银行间市场	3,078,034,087.81	3,037,223,060.00
	合计	4,279,884,139.18	4,219,190,860.00
资产支持证券	97,252,055.27	97,238,000.00	-14,055.27
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,377,136,194.45	4,316,428,860.00	-60,707,334.45

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2018年12月23日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-

项目	上年度末 2017 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	1,225,285,357.93	-
合计	1,225,285,357.93	-

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 23 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	64.05	8,370.25
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	1,735.89	26,215.75
应收债券利息	156,730,322.35	97,333,467.80
应收资产支持证券利息	-	323,595.93
应收买入返售证券利息	-	1,222,196.86
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1.77	40.04
合计	156,732,124.06	98,913,886.63

7.4.7.6 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。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 23 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	41,287.10	18,814.88
合计	41,287.10	18,814.88

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 23 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	353,090.85	348,000.00
合计	353,090.85	348,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

浦银安盛盛元纯债债券 A		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 23 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,941,871,450.64	4,941,871,450.64
本期申购	79,973.50	79,973.50
本期赎回(以“-”号填列)	-331,032.55	-331,032.55
- 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	4,941,620,391.59	4,941,620,391.59

金额单位：人民币元

浦银安盛盛元纯债债券 C		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 23 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	556,329.06	556,329.06
本期申购	1,579.24	1,579.24
本期赎回(以“-”号填列)	-553,754.54	-553,754.54
- 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	4,153.76	4,153.76

金额单位：人民币元

注：申购含红利再投份额。

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

浦银安盛盛元纯债债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	183,039,770.05	-17,183,465.75	165,856,304.30
本期利润	234,522,186.23	134,989,757.20	369,511,943.43
本期基金份额交易产生的变动数	-3,874.46	-7,170.28	-11,044.74
其中：基金申购款	2,268.91	628.95	2,897.86
基金赎回款	-6,143.37	-7,799.23	-13,942.60
本期已分配利润	-306,397,754.46	-	-306,397,754.46
本期末	111,160,327.36	117,799,121.17	228,959,448.53

金额单位：人民币元

浦银安盛盛元纯债债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,868.97	-1,913.35	16,955.62
本期利润	20,949.96	15,070.36	36,020.32
本期基金份额交易产生的变动数	-10,043.98	-13,057.95	-23,101.93
其中：基金申购款	19.09	23.46	42.55
基金赎回款	-10,063.07	-13,081.41	-23,144.48
本期已分配利润	-29,682.61	-	-29,682.61
本期末	92.34	99.06	191.40

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月23日	2017年1月1日至2017年12月31日
活期存款利息收入	710,135.02	731,416.22
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	366,237.08	120,045.33
其他	767.30	383.19
合计	1,077,139.40	851,844.74

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月23日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	-23,824,995.96	-53,569,676.63
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	-23,824,995.96	-53,569,676.63

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月23日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	6,153,227,950.13	10,724,525,643.17
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,968,709,269.57	10,427,581,918.35
减：应收利息总额	208,343,676.52	350,513,401.45
买卖债券差价收入	-23,824,995.96	-53,569,676.63

7.4.7.13.3 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贵金属投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.13.4 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贵金属投资收益-申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月23日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
卖出资产支持证券成交总额	98,365,478.72	455,067,634.95
减：卖出资产支持证券成本总额	97,252,055.27	444,335,527.73

减：应收利息总额	781,478.73	8,977,490.23
资产支持证券投资收益	331,944.72	1,754,616.99

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 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。

7.4.7.14.2 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。

7.4.7.14.3 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。

7.4.7.14.4 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。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 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。

7.4.7.15.2 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。

7.4.7.16 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。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月23日	2017年1月1日至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	135,004,827.56	-23,763,148.44
——股票投资	-	-
——债券投资	134,692,938.89	-24,907,711.55
——资产支持证券投资	311,888.67	1,144,563.11
——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	135,004,827.56	-23,763,148.44

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月23日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
基金赎回费收入	0.54	23.41
其他	9,535.38	-
合计	9,535.92	23.41

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月23日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
交易所市场交易费用	5,985.37	1,072.69
银行间市场交易费用	45,255.50	55,606.50
合计	51,240.87	56,679.19

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月23日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
审计费用	118,349.07	108,000.00
信息披露费	234,741.78	240,000.00
银行汇划费用	22,365.45	18,189.17
债券帐户维护费	36,000.00	36,000.00
其他费用	16,080.96	17,291.30
合计	427,537.26	419,480.47

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

《浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金基金合同》自 2018 年 12 月 24 日失效，《浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于同日起生效，本基金于 2018 年 12 月 24 日转型为浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金。

7.4.9 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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	基金管理人的股东
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月23日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	15,065,962.83	15,939,267.46
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	0.00	0.00

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 0.30% 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 × 0.30% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月23日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,021,987.66	5,313,089.10

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% / 当年天数。

7.4.10.2.3 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		
	2018年1月1日至2018年12月23日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浦银安盛盛元纯债债券 A	浦银安盛盛元纯债债券 C	合计

浦银安盛基金管理有限 公司	0.00	1,769.70	1,769.70
合计	0.00	1,769.70	1,769.70
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浦银安盛盛元纯债 债券 A	浦银安盛盛元纯债 债券 C	合计
浦银安盛基金管理有限 公司	0.00	3,005.71	3,005.71
合计	0.00	3,005.71	3,005.71

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

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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自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。

7.4.10.4.2 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

注：浦银盛元 C 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浦银盛元 C。

7.4.10.5 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 2018年1月1日至2018年12月23 日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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

兴业银行	474,431.69	710,135.02	48,399,055.39	731,416.22
------	------------	------------	---------------	------------

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：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。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

浦银安盛盛元纯债债券 A

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形 式 发放总额	本期利润分 配 合计	备注
		场内	场外					
1	2018 年 9 月 21 日	-	2018 年 9 月 21 日	0.1400	69,186,630.51	14.79	69,186,645.30	
2	2018 年 6 月 4 日	-	2018 年 6 月 4 日	0.4800	237,211,060.73	48.43	237,211,109.16	
合计	-	-	-	0.6200	306,397,691.24	63.22	306,397,754.46	

浦银安盛盛元纯债债券 A

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形 式 发放总额	本期利润分 配 合计	备注
1	2018 年 9 月 21 日	2018 年 9 月 21 日	0.1400	69,186,630.51	14.79	69,186,645.30	
合计	-	-	0.6200	306,397,691.24	63.22	306,397,754.46	

浦银安盛盛元纯债债券 C

金额单位：人民币元

序号	权益	除息日	每 10 份 基金份额分红	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配 合计	备注
----	----	-----	------------------	--------------	---------------	------------------	----

	登记日	场内	场外	数				
1	2018 年 9 月 21 日	-	2018 年 9 月 21 日	0.1200	6,115.34	136.91	6,252.25	
2	2018 年 6 月 4 日	-	2018 年 6 月 4 日	0.4400	22,945.48	484.88	23,430.36	
合计	-	-		0.5600	29,060.82	621.79	29,682.61	

浦银安盛盛元纯债债券 C

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配 合计	备注
1	2018 年 9 月 21 日	2018 年 9 月 21 日	0.1200	6,115.34	136.91	6,252.25	
合计	-	-	0.5600	29,060.82	621.79	29,682.61	

7.4.12 期末（2018 年 12 月 23 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2018 年 12 月 23 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 1,314,476,668.27 元，是以如下债券作为抵押：

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
1280100	12 北部湾债	2018 年 12 月 24 日	103.67	500,000	51,835,000.00
1720048	17 三峡银行三农债 03	2018 年 12 月 24 日	103.09	1,000,000	103,090,000.00
1820039	18 南京银	2018 年 12	101.67	469,000	47,823,930.00

	行 02	月 24 日			
1880004	18 铁道 01	2018 年 12 月 24 日	105.60	1,131,000	119,433,600.00
101800632	18 南电 MTN002	2018 年 12 月 25 日	102.59	1,000,000	102,590,000.00
101800760	18 汇金 MTN009	2018 年 12 月 25 日	101.37	21,000	2,128,770.00
101800760	18 汇金 MTN009	2018 年 12 月 25 日	101.37	500,000	50,685,000.00
041800236	18 马鞍山钢铁 CP001	2018 年 12 月 26 日	100.96	511,000	51,590,560.00
101760007	17 象屿 MTN001	2018 年 12 月 26 日	101.50	450,000	45,675,000.00
101760035	17 象屿 MTN002	2018 年 12 月 26 日	101.89	400,000	40,956,000.00
101800624	18 汇金 MTN005BC	2018 年 12 月 26 日	101.61	127,000	12,904,470.00
101800633	18 晋焦煤 MTN003	2018 年 12 月 26 日	102.95	601,000	61,872,950.00
1880004	18 铁道 01	2018 年 12 月 26 日	105.60	1,100,000	116,160,000.00
101756019	17 鞍钢集 MTN001	2018 年 12 月 26 日	102.29	400,000	40,916,000.00
101800034	18 厦门市政 MTN001	2018 年 12 月 26 日	104.09	650,000	67,658,500.00
101800624	18 汇金 MTN005BC	2018 年 12 月 26 日	101.61	414,000	42,066,540.00
101801176	18 鞍钢集 MTN001	2018 年 12 月 26 日	101.06	500,000	50,530,000.00
101801187	18 陕煤化 MTN004	2018 年 12 月 26 日	101.79	500,000	50,895,000.00
101800267	18 浏阳城建 MTN001	2018 年 12 月 26 日	103.54	600,000	62,124,000.00
101800633	18 晋焦煤 MTN003	2018 年 12 月 26 日	102.95	173,000	17,810,350.00
101800732	18 陕投集团 MTN003	2018 年 12 月 26 日	103.73	900,000	93,357,000.00
101800961	18 北大荒 MTN001	2018 年 12 月 26 日	101.10	1,500,000	151,650,000.00
合计				13,447,000	1,383,552,670.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 23 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 397,100,000.00 元，截至 2018 年 12 月 24 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险收益的产品。

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债、金融债、企业债、公司债、次级债、中央银行票据、地方政府债、中小企业私募债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同业存单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)。本基金不买入股票、权证等权益类资产，可转换债券仅投资于可分离交易可转债的纯债部分。本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例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。

7.4.13.1 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，设立了多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监察稽核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，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。

7.4.13.2 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兴业银行，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。

7.4.13.2.7 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 2018年12月23日	上年度末 2017年12月31日
A-1	201,606,000.00	48,877,500.00
A-1 以下	-	-
未评级	441,473,000.00	834,915,000.00
合计	643,079,000.00	883,792,500.00

注：于 2018 年 12 月 23 日(基金转型前日)，未评级部分为政策性金融债和短期融资券。债券信用评级取自第三方评级机构。

7.4.13.2.8 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。

7.4.13.2.9 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。

7.4.13.2.10 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 2018年12月23日	上年度末 2017年12月31日
AAA	3,300,168,000.00	776,509,000.00
AAA 以下	2,370,510,060.00	1,893,582,360.00
未评级	401,290,000.00	665,307,000.00
合计	6,071,968,060.00	3,335,398,360.00

注：于 2018 年 12 月 23 日(基金转型前日)，未评级部分为政策性金融债和地方政府债。债券信用评级取自第三方评级机构。

7.4.13.2.11 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年12月23日	上年度末 2017年12月31日
AAA	-	97,238,000.00

AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	97,238,000.00

7.4.13.2.12 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。

7.4.13.3 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。

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 2018 年 12 月 23 日(基金转型前日)，除卖出回购金融资产款余额中有 693,400,000.00 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，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。

7.4.13.3.1 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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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发行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 2018 年 12 月 23 日(基金转型前日)，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。于 2018 年 12 月 23 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

7.4.13.4 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、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 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。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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2018 年 12 月 23 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	474,431.69	-	-	-	474,431.69
结算备付金	12,858,490.65	-	-	-	12,858,490.65
存出保证金	13,133.32	-	-	-	13,133.32
交易性金融资产	1,846,034,140.00	4,626,351,920.00	242,661,000.00	-	6,715,047,060.00
应收利息	-	-	-	156,732,124.06	156,732,124.06
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,859,380,195.66	4,626,351,920.00	242,661,000.00	156,732,124.06	6,885,125,239.72
负债					
卖出回购金融资产款	1,711,576,668.27	-	-	-	1,711,576,668.27
应付证券清算款	-	-	-	114,544.77	114,544.77
应付管理人报酬	-	-	-	976,570.91	976,570.91
应付托管费	-	-	-	325,523.65	325,523.65
应付销售服务费	-	-	-	33.94	33.94

应付交易费用	-	-	-	41,287.10	41,287.10
应付利息	-	-	-	567,534.01	567,534.01
应交税费	-	-	-	585,800.94	585,800.94
其他负债	-	-	-	353,090.85	353,090.85
负债总计	1,711,576,668.27	-	-	2,964,386.17	1,714,541,054.44
利率敏感度缺口	147,803,527.39	4,626,351,920.00	242,661,000.00	153,767,737.89	5,170,584,185.28
上年度末 2017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	48,399,055.39	-	-	-	48,399,055.39
结算备付金	52,961,217.96	-	-	-	52,961,217.96
存出保证金	80,971.27	-	-	-	80,971.27
交易性金融资产	1,621,734,500.00	2,694,694,360.00	-	-	-4,316,428,860.00
买入返售金融资产	1,225,285,357.93	-	-	-	-1,225,285,357.93
应收利息	-	-	-	98,913,886.63	98,913,886.63
资产总计	2,948,461,102.55	2,694,694,360.00	-	98,913,886.63	5,742,069,349.18
负债					
卖出回购金融资产款	619,100,000.00	-	-	-	619,100,000.00
应付证券清算款	-	-	-	12,280,240.26	12,280,240.26
应付管理人报	-	-	-	1,298,766.85	1,298,766.85

酬					
应付托管费	-	-	-	432,922.28	432,922.28
应付销售服务费	-	-	-	174.70	174.70
应付交易费用	-	-	-	18,814.88	18,814.88
应付利息	-	-	-	289,390.59	289,390.59
其他负债	-	-	-	348,000.00	348,000.00
负债总计	619,100,000.00	-	-	14,668,309.56	633,768,309.56
利率敏感度缺口	2,329,361,102.55	2,694,694,360.00	-	84,245,577.07	5,108,301,039.62

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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（2018年12月23日）	上年度末（2017年12月31日）
	市场利率上升 25 基点	-32,561,892.88	-15,400,243.37
	市场利率下降 25 基点	32,872,107.81	15,263,921.92

7.4.13.4.2 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，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：于 2018 年 12 月 23 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00% (2017 年 12 月 31 日：0.00%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2017 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2018 年 12 月 23 日 (基金转型前日)，本基金未持有交易性权益类投资 (2017 年 12 月 31 日：同)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2017 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14 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 2018 年 12 月 23 日 (基金转型前日)，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二层次的余额为 6,715,047,060.00 元，无属于第一或第三层次的余额 (2017 年 12 月 31 日：第二层次 4,316,428,860.00 元，无第一或第三层次)。

(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 2018 年 12 月 23 日(基金转型前日)，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 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（转型后）

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	8,821,328,180.00	80.80
	其中：债券	8,821,328,180.00	80.80
	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	1,884,972,187.46	17.27
	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	30,891,032.93	0.28
8	其他各项资产	179,623,884.85	1.65
9	合计	10,916,815,285.24	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。

8.2.3 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。

8.3 报告期内股票投资组合的重大变动

8.3.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.3.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.3.3 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。

8.4 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	2,067,650,000.00	20.27
	其中：政策性金融债	1,381,817,000.00	13.54
4	企业债券	3,127,867,680.00	30.66
5	企业短期融资券	1,143,999,000.00	11.21
6	中期票据	2,481,811,500.00	24.32
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计		8,821,328,180.00	86.46
----	----	--	------------------	-------

8.5 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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	180019	18 付息国债 19	6,500,000	666,965,000.00	6.54
2	1880004	18 铁道 01	4,000,000	422,680,000.00	4.14
3	1828019	18 平安银行 01	3,500,000	350,280,000.00	3.43
4	101800625	18 汇金 MTN006BC	2,000,000	204,720,000.00	2.01
5	101800624	18 汇金 MTN005BC	2,000,000	203,340,000.00	1.99

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 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。

8.10 投资组合报告附注

8.10.1 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。

8.10.2 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

本基金本报告期末未持有股票，故不存在本基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

8.10.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	13,133.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	179,610,751.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	179,623,884.85

8.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.10.5 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。

§8 投资组合报告（转型前）

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	6,715,047,060.00	97.53
	其中：债券	6,715,047,060.00	97.53
	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	0.00	-
	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	13,332,922.34	0.19
8	其他资产	156,745,257.38	2.28
9	合计	6,885,125,239.72	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	706,577,000.00	13.67
	其中：政策性金融债	491,542,000.00	9.51
4	企业债券	2,976,923,560.00	57.57
5	企业短期融资券	603,047,000.00	11.66
6	中期票据	2,428,499,500.00	46.97
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,715,047,060.00	129.87

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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1880004	18 铁道 01	4,000,000	422,400,000.00	8.17
2	101800625	18 汇金 MTN006BC	2,000,000	204,420,000.00	3.95
3	101800624	18 汇金 MTN005BC	2,000,000	203,220,000.00	3.93
4	101800961	18 北大荒 MTN001	2,000,000	202,200,000.00	3.91
5	160208	16 国开 08	2,000,000	199,920,000.00	3.87

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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**

注：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

注：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。

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

本基金本报告期末未持有股票，故不存在本基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

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	13,133.32

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	156,732,124.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	156,745,257.38

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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（转型后）

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
浦银安盛盛元定开债券A	8	1,216,125,690.91	9,728,955,558.34	100.00%	49,968.96	0.00%
浦银安盛盛元定开债券C	18	230.76	0.00	0.00%	4,153.76	100.00%
合计	26	374,192,680.04	9,728,955,558.34	100.00%	54,122.72	0.00%

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	浦银安盛盛元定开债券 A	19.21	0.00%
	浦银安盛盛元定开债券 C	203.22	4.89%
	合计	222.43	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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	浦银安盛盛元定开债券 A	0
	浦银安盛盛元定开债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	浦银安盛盛元定开债券 A	0
	浦银安盛盛元定开债券 C	0
	合计	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,554,748.71	0.10	9,554,748.71	0.10	自申购确认之日起不少于 3 年

基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	9,554,748.71	0.10	9,554,748.71	0.10	自申购确认之日起不少于3年

注：上述份额总数均包含利息结转份额。

§9 基金份额持有人信息（转型前）

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
浦银安盛盛元纯债债券A	7	705,945,770.23	4,941,570,422.63	100.00%	49,968.96	0.00%
浦银安盛盛元纯债债券C	18	230.76	0.00	0.00%	4,153.76	100.00%
合计	25	197,664,981.81	4,941,570,422.63	100.00%	54,122.72	0.00%

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	浦银安盛盛元纯债债券A	19.21	0.00%
	浦银安盛	203.22	4.89%

	盛元纯债 债券 C		
	合计	222.43	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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	浦银安盛盛元纯债债券 A	-
	浦银安盛盛元纯债债券 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	浦银安盛盛元纯债债券 A	-
	浦银安盛盛元纯债债券 C	-
	合计	-

§ 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

项目	浦银安盛盛元定 开债券 A	浦银安盛盛元定 开债券 C
基金合同生效日基金份额总额	4,941,620,391.59	4,153.76
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,787,385,135.71	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	9,729,005,527.30	4,153.76

注：1、总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

2、自 2018 年 12 月 24 日起，原浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金转型为发起式基金。

§ 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

项目	浦银安盛盛元纯 债债券 A	浦银安盛盛元纯 债债券 C
基金合同生效日基金份额总额	200,350,467.41	440,014.82
本报告期期初基金份额总额	4,941,871,450.64	556,329.06
本报告期期间基金总申购份额	79,973.50	1,579.24
减:本报告期期间基金总赎回份额	331,032.55	553,754.54
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,941,620,391.59	4,153.76

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

2018 年 11 月 17 日至 2018 年 12 月 16 日，基金管理人以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并审议通过了《关于浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金转型有关事项的议案》，详见本基金管理人于 2018 年 11 月 14 日发布的《关于浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告》及其后续公告。

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

报告期内基金管理人、基金托管人未发生重大人事变动。

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 121,000 元，截止本报告期末，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已提供审计服务的连续年限为 3 年。

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、基金托管人涉及托管业务的部门及其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（转型后）

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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
招商证券	2	-	-	-	-	-

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：

本基金本报告期无新增交易单元。

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
招商证券	149,653,753.42	100.00%	1,340,200,000.00	100.00%	-	-

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）**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	交易单元数量	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	--------	------	-----------	----

		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	
招商证券	2	-	-	-	-	-

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：

本基金本报告期无新增交易单元。

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
招商证券	1,270,771,017.82	100.00%	47,384,300,000.00	100.00%	-	-

11.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告	报刊及公司官网	2018年12月21日
2	浦银安盛盛元定期开放债券型	公司官网	2018年12月21日

	发起式证券投资基金基金合同		
3	浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议	公司官网	2018 年 12 月 21 日
4	浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书	公司官网	2018 年 12 月 21 日
5	浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金 2018 年度开放日常申购、赎回的业务公告	报刊及公司官网	2018 年 12 月 22 日

11.9 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	报刊及公司官网	2018 年 1 月 22 日
2	浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金招募说明书正文（更新）2018 年第 1 号	公司官网	2018 年 3 月 7 日
3	浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金招募说明书摘要（更新）2018 年第 1 号	报刊及公司官网	2018 年 3 月 7 日
4	浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金 2017 年年度报告	公司官网	2018 年 3 月 29 日
5	浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金 2017 年年度报告摘要	报刊及公司官网	2018 年 3 月 29 日
6	关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同的公告	报刊及公司官网	2018 年 3 月 30 日
7	浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金基金合同	公司官网	2018 年 3 月 30 日
8	浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金托管协议	公司官网	2018 年 3 月 30 日
9	浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	报刊及公司官网	2018 年 4 月 21 日

10	浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金 2018 年度第一次分红公告	报刊及公司官网	2018 年 5 月 31 日
11	浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金 2018 年第 2 季度报告	报刊及公司官网	2018 年 7 月 18 日
12	浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金 2018 年半年度报告	公司官网	2018 年 8 月 27 日
13	浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金 2018 年半年度报告摘要	报刊及公司官网	2018 年 8 月 27 日
14	浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金招募说明书摘要（更新）2018 年第 2 号	报刊及公司官网	2018 年 9 月 5 日
15	浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金招募说明书正文（更新）2018 年第 2 号	公司官网	2018 年 9 月 5 日
16	浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金 2018 年度第二次分红公告	报刊及公司官网	2018 年 9 月 19 日
17	浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	报刊及公司官网	2018 年 10 月 26 日
18	关于浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告	报刊及公司官网	2018 年 11 月 14 日
19	关于浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的第一次提示性公告	报刊及公司官网	2018 年 11 月 15 日
20	关于浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的第二次提示性公告	报刊及公司官网	2018 年 11 月 16 日
21	关于浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	报刊及公司官网	2018 年 12 月 18 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

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	2018 年 1 月 1 日-2018 年 12 月 31 日	4,941,570,422.63	4,777,830,387.00	0.00	9,719,400,809.63	99.90%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等相关规定，经与基金托管人协商一致，浦银安盛基金管理有限公司对旗下所涉及的公开募集证券投资基金的基金合同有关条款进行了修改。详见本基金管理人于 2018 年 3 月 30 日发布的《关于根据〈公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定〉修改基金合同的公告》。

2、经公司董事会决议通过，浦银安盛基金管理有限公司在上海、北京和深圳设立分公司。相关工商登记注册手续已办理完毕，并取得营业执照。详见基金管理人于 2018 年 6 月 6 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告》和 2019 年 1 月 8 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于设立北京、深圳分公司的公告》。

§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、 浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同
- 3、 浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书
- 4、 浦银安盛盛元定期开放债券型发起式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

2019 年 3 月 27 日