

浦银安盛货币市场证券投资基金
2011 年年度报告
2011 年 12 月 31 日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年三月二十六日

§ 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	1
1.1	重要提示	1
§ 2	基金简介	4
2.1	基金基本情况	4
2.2	基金产品说明	4
2.3	基金管理人和基金托管人	4
2.4	信息披露方式	5
2.5	其他相关资料	5
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1	主要会计数据和财务指标	5
3.2	基金净值表现	6
3.3	自基金合同生效以来基金的利润分配情况	9
§ 4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
§ 5	托管人报告	17
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2	托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§ 6	审计报告	17
6.1	管理层对财务报表的责任	18
6.2	注册会计师的责任	18
6.3	审计意见	18
§ 7	年度财务报表	19
7.1	资产负债表	19
7.2	利润表	20
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4	报表附注	22
§ 8	投资组合报告	41
8.1	期末基金资产组合情况	41
8.2	债券回购融资情况	42
8.3	债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明	42
8.4	基金投资组合平均剩余期限	42
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	43
8.6	期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	43
8.7	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	43
8.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	44

8.9	投资组合报告附注	44
§ 9	基金份额持有人信息	45
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	45
§ 10	开放式基金份额变动	45
§ 11	重大事件揭示	46
11.1	基金份额持有人大会决议	46
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	46
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
11.4	基金投资策略的改变	46
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	46
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况	46
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
11.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况	47
11.9	其他重大事件	48
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	49
§ 13	备查文件目录	49
13.1	备查文件目录	49
13.2	存放地点	50
13.3	查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛货币市场证券投资基金	
基金简称	浦银安盛货币	
基金主代码	519509	
基金运作方式	开放式契约型	
基金合同生效日	2011年3月9日	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	430,445,984.39 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B
下属分级基金的交易代码	519509	519510
报告期末下属分级基金的份额总额	143,228,162.60 份	287,217,821.79 份

2.2 基金产品说明

投资目标	力求在保持基金资产安全性和良好流动性的基础上,获得超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	根据对短期利率变动的预测,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略,利用基本分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保证流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浦银安盛基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	朱义明
	联系电话	021-23212812	010-65556899
	电子邮箱	guj@py-axa.com	zhuyiming@citicib.com.cn
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95558
传真		021-23212985	010-65550832
注册地址		上海市浦东新区浦东大道981	北京市东城区朝阳门北大街8

	号3幢316室	号富华大厦C座
办公地址	上海市淮海中路381号中环广场38楼	北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
邮政编码	200020	100027
法定代表人	姜明生	田国立

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有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	中国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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2011年3月9日（基金合同生效日）至2011年12月31日		2010年		2009年	
	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B
本期已实现收益	9,195,466.40	9,168,281.01	-	-	-	-
本期利润	9,195,466.40	9,168,281.01	-	-	-	-
本期基金份额净值收益率	2.89%	3.09%	-	-	-	-
3.1.2 期末	2011年末		2010年末		2009年末	

数据和指标	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B
期末基金资产净值	143,228,162.60	287,217,821.79	-	-	-	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	-	-	-	-
3.1.3 累计期末指标	2011 年末		2010 年末		2009 年末	
	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B
基金份额累计净值收益率	2.89%	3.09%	-	-	-	-

注：1、本基金合同生效日为 2011 年 3 月 9 日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。

4、本基金收益分配按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 浦银安盛货币 A

阶段	份额净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.1048%	0.0062%	0.1215%	0.0000%	0.9833%	0.0062%

过去六个月	1.9361%	0.0054%	0.2431%	0.0000%	1.6930%	0.0054%
自基金合同生效起至今	2.8902%	0.0049%	0.3855%	0.0001%	2.5047%	0.0048%

注：本基金收益分配按月结转份额。

2. 浦银安盛货币 B

阶段	份额净值 收益率①	净值收益 率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	1.1048%	0.0062%	0.1215%	0.0000%	0.9833%	0.0062%
过去六个月	2.0593%	0.0054%	0.2431%	0.0000%	1.8162%	0.0054%
自基金合同生 效起至今	3.0928%	0.0049%	0.3855%	0.0001%	2.7073%	0.0048%

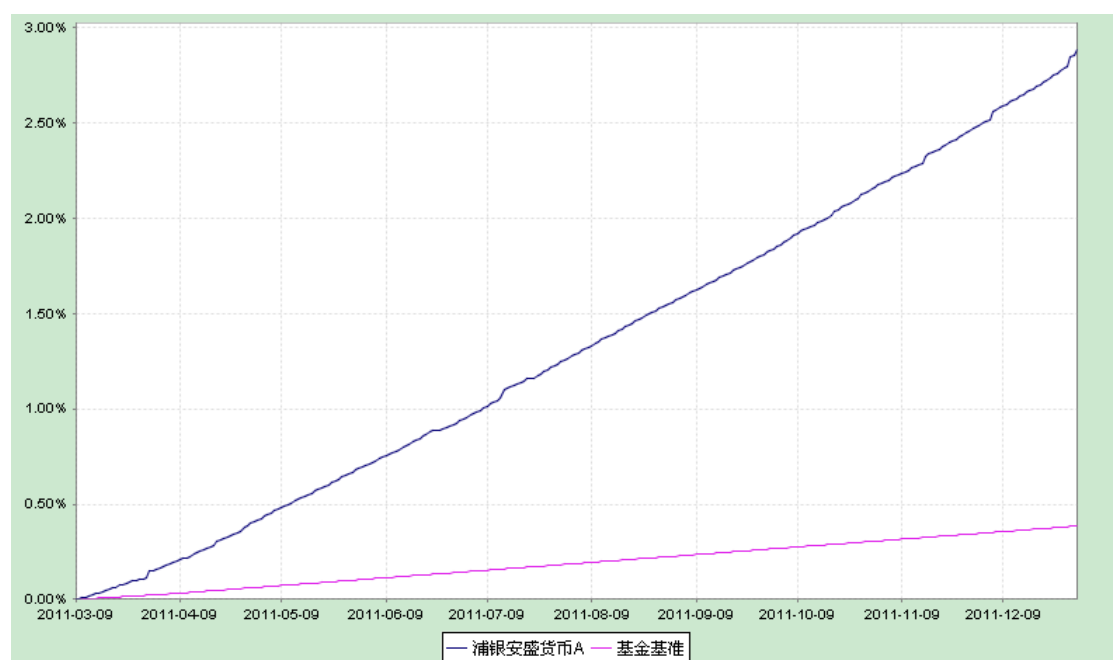
注：本基金收益分配按月结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛货币市场证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011年3月9日至2011年12月31日)

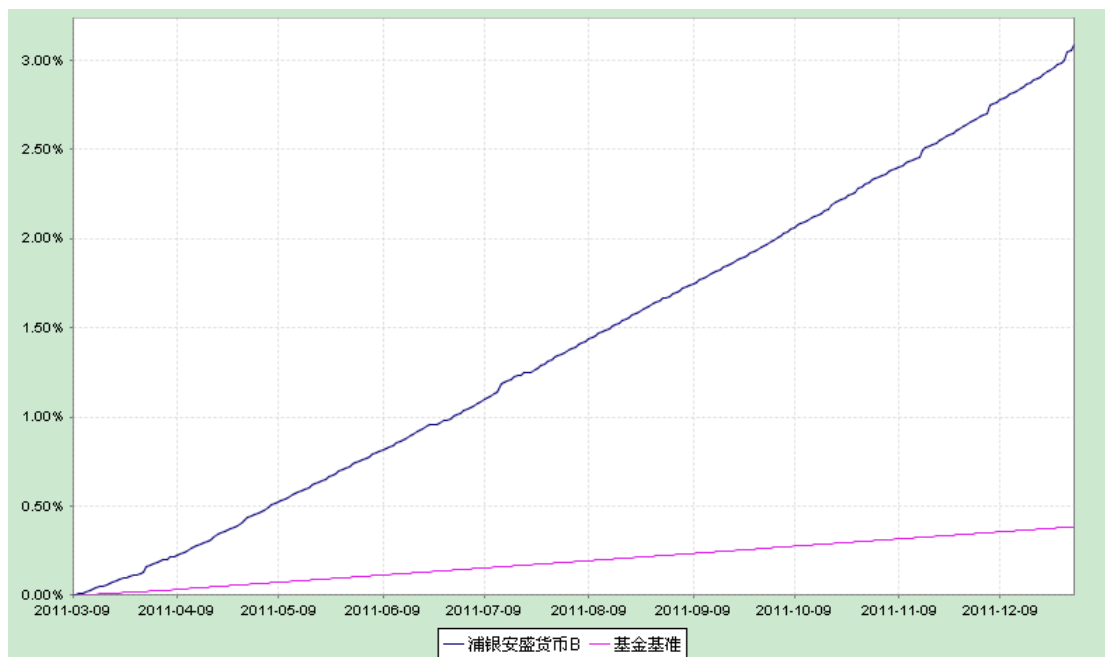
1、浦银安盛货币 A

(2011年3月9日至2011年12月31日)



2、浦银安盛货币 B

(2011 年 3 月 9 日至 2011 年 12 月 31 日)



注：1、本基金合同生效日为 2011 年 3 月 9 日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

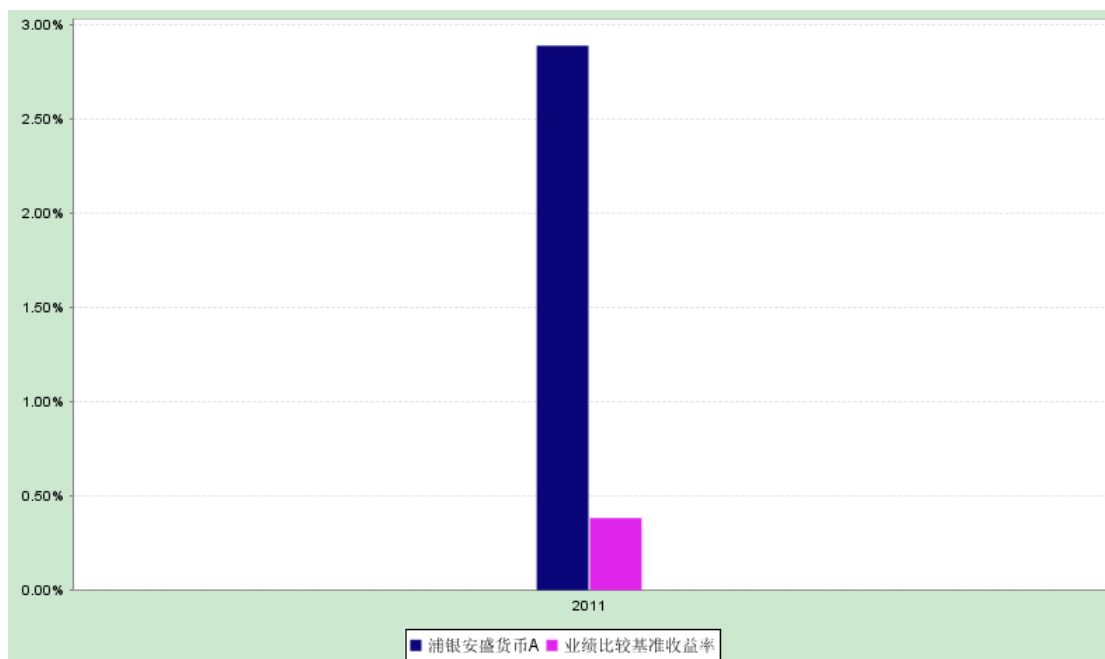
2、根据基金合同第十二部分第六条规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期自 2011 年 3 月 9 日至 2011 年 9 月 9 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浦银安盛货币市场证券投资基金

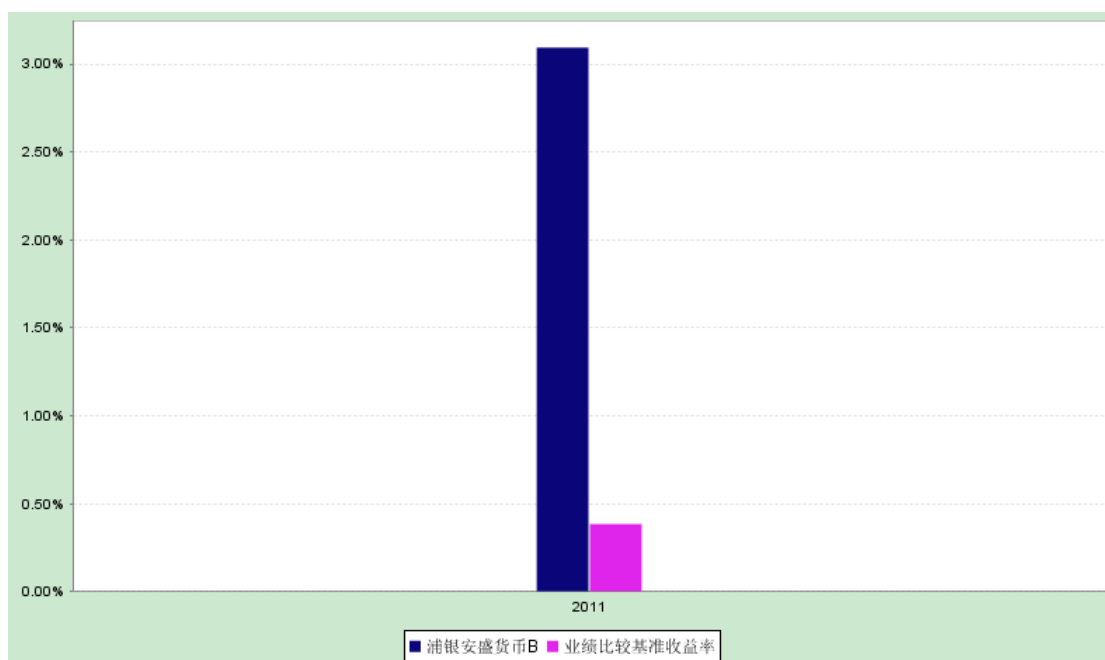
自基金合同生效以来每年净值收益率图

1、浦银安盛货币 A



注：本基金合同于 2011 年 3 月 9 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。

2、浦银安盛货币 B



注：本基金合同于 2011 年 3 月 9 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 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

1、浦银安盛货币 A

金额单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付赎回 款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润分配合 计	备注
2011 年	6,298,493.44	2,649,188.22	247,784.74	9,195,466.40	-
合计	6,298,493.44	2,649,188.22	247,784.74	9,195,466.40	-

2、浦银安盛货币 B

金额单位：人民币元

年度	已按再投资 形式转实收 基金	直接通过应付赎 回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润分 配合计	备注
2011 年	5,659,728.91	3,320,744.79	187,807.31	9,168,281.01	-
合计	5,659,728.91	3,320,744.79	187,807.31	9,168,281.01	-

§ 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，由上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A. 及上海盛融投资有限公司共同创建，公司总部设在上海，注册资本为人民币 2 亿元，股东持股比例分别为 51%、39%和 10%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和证监会许可的其他业务。

截至 2011 年 12 月 31 日止，浦银安盛旗下共管理 7 只基金，即浦银安盛价值成长股票型证券投资基金、浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛红利精选股票型证券投资基金、浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金和浦银安盛增利分级债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周文桐	公司副总经理兼首席	2011-03-09	-	12	周文桐先生，美国国籍。北京大学生物学学士，美国西北大学分子生物学博士，芝加哥大学工商

	投资 官、本 基金基 金经理				管理硕士。1999 年至 2009 年任职美国奥本海默基金公司,先后担任研究员和基金经理之职。2009 年 10 月起任职法国安盛投资管理有限公司(亚太区),2010 年 1 月加盟浦银安盛基金公司任公司副总经理兼首席投资官。2010 年 6 月 25 日到 2011 年 6 月 30 日,兼任浦银安盛优化收益债券型基金基金经理。2011 年 3 月起,兼任本基金基金经理。
綦鹏	本基 基金 经理 助理	2011-11-14	-	5	綦鹏先生,上海财经大学公共经济管理学院技术经济及管理专业硕士。曾先后在中国建设银行广东省分行从事公信贷工作、广东发展银行总行资金部从事债券投资交易等、华安基金管理有限公司任高级债券交易员和万家基金管理公司任固定收益基金经理助理。2011 年 11 月起加盟浦银安盛基金管理有限公司,担任本基金基金经理助理。
曲少伦	本基 前基 金经 理助 理	2011-03-09	2011-07-20	14	曲少伦先生,同济大学工商管理硕士。1996 年 12 月至 2003 年 9 月在中信证券公司资产管理部从事研究以及客户资产管理。2007 年 1 月至 2009 年 4 月在生命人寿保险股份有限公司投资管理部担任交易部经理之职。2009 年 4 月至 2010 年 5 月在天治基金管理公司投资管理部同时担任债券基金和货币基金的基金经理助理。2010 年 6 月,进入浦银安盛基金管理公司工作,担任固定收益高级研究员兼优化收益债券基金基金经理助理,2011 年 3 月 9 日起,兼任本基金基金经理助理。

注：1、除周文桐作为本基金的首任基金经理，其任职日期为本基金成立之日外，其余人员的“任职日期”和“离任日期”分别指公司决定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下尚无与本投资组合投资风格相似的其他投资组合。

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

2011年，货币市场利率在普遍、差别上调存准率以及保证金纳入存准率上调基数的影

响下，整体流动性脉冲式紧张，四季度存准率开始下调，资金面转缓。货币基金投资短债品种收益率先上后下，短融绝对收益率创出面市以来新高，超过 07 年高点，shibor 浮息金融债价格先涨后跌，体现了货币市场利率走势预期。

2011 年本基金维持较高短融配置，并加大了定存投资，力争取得超越回购利率的收益水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011 年 12 月 31 日，浦银货币 A，成立以来净值增长率 2.8902%，浦银货币 B，成立以来净值增长率 3.0928%，业绩比较基准收益率 0.3855%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012 年，配合经济底部回升要求、通胀均值水平下降，政策微调施展空间较大，流动性状况较 2011 年明显改善，存款准备金率下调、公开市场央票发行利率下降等放松信号继续出现，将有利于货币市场利率走缓。短融收益率存在下行趋势，尤其是中低评级品种，利差缩窄，降幅明显。随着欧债危机风险的逐步释放，美国经济的缓慢复苏，国内基本面亦存在阶段转好，这使得上半年债市交易机会明显好于后半年，全年来看，目前投资短融仍具有配置价值。

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，落实风险控制，强化监察稽核管理，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。2011 年度，监察稽核工作的重点依旧是管理公司的合规风险，监督检查公司和基金业务的合法合规、公司的内控和内部风险控制、公司制度流程的执行、以及配合公司业务地开展等。主要集中在以下几个方面：

1、进一步健全监察团队，提高监察团队的专业素养

在内部管理上，监察稽核团队进一步健全监察稽核工作的各项规章制度和工作流程，进一步明确监察稽核人员的工作职责，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。公司鼓励和支持监察稽核人员参与相关的专业考试和学习。目前监察稽核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、共同提高、自然和谐的良好局面。

2、实施合规检查

根据相关法规要求、公司的实际运作情况及监察稽核计划，在每月和每个季度，监察稽核团队有重点、分步骤、有针对性地对公司所有部门的业务和合规运作，以及执行法规和制度的情况进行定期检查，并在检查后督促整改和跟踪检查。在有效控制公司的合规风险以及推动公司内控监管第二道和第三道防线方面发挥了一定的作用。

合规检查主要采取定期检查与不定期检查相结合，常规检查与专项检查相结合的方式。定期检查的结果主要体现在每月合规报告及季度监察稽核报告中。不定期检查主要是就定期检查中发现的问题，与业务部门进行沟通，帮助各部门及时完善和改进工作。不定期检查的结果主要体现在合规报告及整改反馈表中。

总体来说，合规检查工作比往年的广度和深度有了较大的改进，没有出现重大失误或纰漏。

3、实施专项稽核

根据监察稽核计划，实施了以下专项稽核：

- （1）对货币基金成立之日起至 2011 年 7 月的运作情况进行了专项稽核；
- （2）在 2011 年 12 月完成了一次反洗钱工作的内部稽核和反洗钱自评估工作；
- （3）对 3 位投资管理人员进行了离任审查工作，并出具了离任审查报告。

4、实施合规性审核

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。
- （2）与公司专业法律顾问一起，对公司报批基金产品的合法合规性进行了全面审核；
- （3）对一级市场证券的申购，从关联交易角度进行合法合规性审核，未出现在一级市场投资与公司存在关联关系上市公司发行证券的情形。

5、信息披露和文件报送

监察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。所有的披露均做到了及时、准确，基本未出现迟披、漏披、延披、错披的情形。

6、法律事务

监察部对公司对外签署的协议、合同进行了审核，在合理范围内最大限度地防范由合同产生的违约风险及侵权风险，同时，根据中国证监会发布的关于销售费用及反洗钱等相关法

律法规，对基金代销协议模板进行了更新；按月制作《浦银安盛月度法规资讯》及《浦银安盛简报》的“监管动态”部分；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，监察稽核团队还负责与公司法律和基金产品律师联系和沟通，配合公司的业务开展。

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

7、组织开展合规培训

合规培训包括新员工入司培训、高管培训、投资管理人员合规培训以及反洗钱专项合规培训等。培训前，监察稽核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。

合规培训部分提高和增强了员工的合规守法意识，促进了公司业务的合规运作。

8、督导和推动公司的制度建设和完善

督导和推动公司的制度建设和完善是监察稽核团队的重要工作之一。监察稽核团队全年推动公司新订、修订了 32 个公司层面的制度及议事规则，1 个董事会层面的基本制度；另外，还有 2 个基本制度正待报董事会审议，另有 10 个销售部的流程尚在制定、修订过程中。

9、组织进行反洗钱工作。

根据公司的安排，公司反洗钱工作由监察稽核团队组织和牵头。全年开展的反洗钱工作包括：（1）完善反洗钱相关制度；（2）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；（3）向中国人民银行定期报送可疑交易；（4）定期向人民银行报送非现场监管报表；（5）进行反洗钱的合规培训；（6）进行反洗钱的专项审计。

10、落实监管政策和要求，配合和协助监管机关的现场检查，以及股东的现场评估工作

与监管机关的日常沟通和交流主要由督察长和监察部负责。此外，2011 年，监察稽核团队积极配合和协助上海证监局对公司进行“公司治理”方面的现场检查、证监会的调研、股东“浦发银行”的现场评估的统筹协调工作。

11、协助公司基金产品的申报、及专户管理资格的申请。

2011 年度，监察稽核团队积极协助产品部完成了 3 只公募基金产品申请材料的审阅，以及跟监管机关的联络和沟通。此外，还积极配合公司向监管机关申请专户管理资格的工作，在材料审阅，与监管机关的联络和沟通上做了不少工作，公司最后在 2011 年底获得专户管理资格。

12、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，监察稽核团队负责指导、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。

13、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。

14、与中介机构的协调

监察稽核团队负责与律师事务所和审计师事务所等外部机构的日常工作协调。

回顾过去的 2011 年，从董事会、管理层到员工，都对监察稽核工作予以了比以前更多的重视和理解、支持，监察稽核团队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的基石。

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兼首席运营官、风险管理部负责人、金融工程部负责人、研究部负责人、基金会计部负责人组成。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签订了《中债收益率曲线和中债估值最

终用户服务协议》。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书等有关约定，本基金的收益分配采用“每日分配、按月支付”的方式，即为投资者每日计算当日收益并分配，每月支付。本报告期浦银货币 A 级基金应分配收益 9,195,466.40 元，实际分配收益 9,195,466.40 元；浦银货币 B 级基金应分配收益 9,168,281.01 元，实际分配收益 9,168,281.01 元。

§ 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

2011 年，本基金托管人在对浦银安盛货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011 年，浦银安盛货币市场基金的管理人——浦银安盛基金管理有限公司在浦银安盛货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

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

本托管人依法对浦银安盛基金管理有限公司编制和披露的浦银安盛货币市场基金 2011 年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字（2012）第 20548 号

浦银安盛货币市场证券投资基金 全体基金份额持有人：

我们审计了后附的 浦银安盛货币市场证券投资基金(以下简称“浦银安盛货币市场基金”)的财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年 3 月 9 日(基金合同生效日)至 2011 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。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是浦银安盛货币市场基金的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；
- (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述浦银安盛货币市场基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会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货币市场基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年 3 月 9 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司 注册会计师 汪 隽 王 灵

上海市浦东新区陆家嘴环

路 1318 号星展银行大厦 6 楼

2012-03-21

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛货币市场证券投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	354,642,557.74	-
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	20,002,521.66	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		20,002,521.66	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,084,527.82	-
应收股利		-	-
应收申购款		55,460,136.97	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		431,189,744.19	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		55,818.62	-
应付托管费		16,914.74	-
应付销售服务费		25,253.87	-
应付交易费用	7.4.7.7	11,180.52	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		435,592.05	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	199,000.00	-
负债合计		743,759.80	-
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	430,445,984.39	-
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		430,445,984.39	-
负债和所有者权益总计		431,189,744.19	-

注：1、本基金《基金合同》生效日为 2011 年 3 月 9 日，无上年度可比期间。

2、报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 430,445,984.39 份。其中浦银货币 A 级的基金份额为 143,228,162.60 份，浦银货币 B 级的基金份额为 287,217,821.79 份。

7.2 利润表

会计主体：浦银安盛货币市场证券投资基金

本报告期：2011 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011年3月9日（基金合同生	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12
-----	-----	-----------------------	------------------------------

		效日)至2011年12月31日	月31日
一、收入		22,010,460.57	-
1. 利息收入		20,863,583.22	-
其中: 存款利息收入	7.4.7.11	7,896,411.25	-
债券利息收入		8,191,411.19	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,775,760.78	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		1,128,232.18	-
其中: 股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	1,128,232.18	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	-	-
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	18,645.17	-
减: 二、费用		3,646,713.16	-
1. 管理人报酬		1,975,581.91	-
2. 托管费		598,661.14	-
3. 销售服务费		821,904.88	-
4. 交易费用	7.4.7.18	-	-
5. 利息支出		13,887.51	-
其中: 卖出回购金融资产支出		13,887.51	-
6. 其他费用	7.4.7.19	236,677.72	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		18,363,747.41	-
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		18,363,747.41	-

注: 本基金《基金合同》生效日为 2011 年 3 月 9 日, 无上年度可比期间。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 浦银安盛货币市场证券投资基金

本报告期: 2011 年 3 月 9 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2011年3月9日（基金合同生效日）至2011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）	3,774,407,616.02	-	3,774,407,616.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,363,747.41	18,363,747.41
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）	-3,343,961,631.63	-	-3,343,961,631.63
其中：1. 基金申购款	3,632,266,527.56	-	3,632,266,527.56
2. 基金赎回款	-6,976,228,159.19	-	-6,976,228,159.19
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）	-	-18,363,747.41	-18,363,747.41
五、期末所有者权益（基金净值）	430,445,984.39	-	430,445,984.39
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

注：本基金《基金合同》生效日为2011年3月9日，无上年度可比期间。

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码（序号）从7.1至7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：钱华，主管会计工作负责人：陈麓，会计机构负责人：赵迎华

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

浦银安盛货币市场证券投资基金(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[2010]1479号文批准，由浦银安盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛货币市场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 3,773,820,436.52 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 073 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同》于 2011 年 3 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,774,407,616.02 份，其中认购资金利息折合 587,179.50 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，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同》和《浦银安盛货币市场证券投资基金招募说明书》的规定，本基金自募集期起根据投资者认(申)购金额，对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，将基金份额分为不同的类别。最低申购金额为 1,000.00 元且按照 0.25%年费率计提销售服务费的，称为 A 类；最低申购金额为 5,000,000.00 元且按照 0.01%年费率计提销售服务费的，称为 B 类。本基金 A 类、B 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 B 类基金份额分别计算每万份基金净收益和七日年化收益率。投资者可自行选择认(申)购的基金份额类别，不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为：现金、通知存款、短期融资券、一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金业绩比较基准为：银行活期存款利率(税后)。

于 2011 年 12 月 31 日，本基金存放于上海银行股份有限公司的银行存款占基金资产净值的比例为 78.99%，不符合《货币市场基金管理暂行规定》中“存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的百分之三十”的规定。上述指标于 2012 年 2 月 9 日方才调整合规。

本财务报表由本基金的基金管理人于 2012 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证

券投资基金会计核算业务指引》、《浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年 3 月 9 日至 2011 年 12 月 31 日期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年 3 月 9 日至 2011 年 12 月 31 日期间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 2011 年 3 月 9 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 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。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。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，于交易日按公允价值在资产

负债表内确认。取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债等相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。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。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

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

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

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。当本基金依法有权抵销债权债务且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。每份基金份额面值为 1.000 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少,以及因类别调整而引起的 A、B 级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 损益平准金

本基金为货币市场基金,无损益平准金。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其公允价值与摊余成本之间的差额确认为投资收益。

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也可按直线法计算。

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也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同类每份基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有申请当日的分红权益,而赎回的基金份额享有申请当日的分红权益。本基金以份额面值 1.000 元固定份额净值交易方式,每日计算当日收益并全部分配结转至应付利润科目,每月以红利再投资方式集中支付累计收益。

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，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

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，本基金计算影子价格过程中确定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：

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

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- 2、基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- 3、对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。

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 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
----	--------------------	---------------------

活期存款	14,642,557.74	-
定期存款	340,000,000.00	-
其中：存款期限 1-3 个月	80,000,000.00	-
存款期限 1 个月以内	260,000,000.00	-
其他存款	-	-
合计	354,642,557.74	-

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	20,002,521.66	20,021,000.00	18,478.34	0.0043
	合计	20,002,521.66	20,021,000.00	18,478.34	0.0043
项目		上年度末 2010 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应收活期存款利息	5,312.33	-
应收定期存款利息	607,183.37	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-

应收债券利息	472,032.12	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	1,084,527.82	-

7.4.7.6 其他资产

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 2011年12月31日	上年度末 2010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	11,180.52	-
合计	11,180.52	-

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提上清所债券托管账户维护费	4,500.00	-
预提信息披露费用	90,000.00	-
预提中债登债券托管账户维护费	4,500.00	-
审计费	100,000.00	-
合计	199,000.00	-

7.4.7.9 实收基金

浦银安盛货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年3月9日（基金合同生效日）至2011年12月31日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	2,574,555,555.18	2,574,555,555.18
本期申购	1,145,957,687.90	1,145,957,687.90
本期赎回（以“-”号填列）	-3,577,285,080.48	-3,577,285,080.48
本期末	143,228,162.60	143,228,162.60

浦银安盛货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年3月9日（基金合同生效日）至2011年12月31日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	1,199,852,060.84	1,199,852,060.84
本期申购	2,748,951,057.06	2,748,951,057.06
本期赎回（以“-”号填列）	-3,661,585,296.11	-3,661,585,296.11
本期末	287,217,821.79	287,217,821.79

注：1.申购含红利再投、分级份额调增和转换入份额，赎回含分级份额调减和转换出份额。

2. 本基金自 2011 年 2 月 21 日至 2011 年 3 月 4 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 3,773,820,436.52 元。根据《浦银安盛货币市场证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 587,179.50 元在本基金成立后，折算为 587,179.50 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《浦银安盛货币市场证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于 2011 年 3 月 9 日(基金合同生效日)至 2011 年 3 月 23 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务和赎回业务自 2011 年 3 月 24 日起开始办理，转换业务自 2011 年 4 月 26 日起开始办理。

7.4.7.10 未分配利润

浦银安盛货币 A

单位：人民币元

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	-	-	-
本期利润	9,195,466.40	-	9,195,466.40
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	-9,195,466.40	-	-9,195,466.40
本期末	-	-	-

浦银安盛货币 B

单位：人民币元

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	-	-	-
本期利润	9,168,281.01	-	9,168,281.01
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	-9,168,281.01	-	-9,168,281.01
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月9日（基金合同生效 日）至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31 日
活期存款利息收入	1,037,288.70	-
定期存款利息收入	6,840,312.56	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	12,353.30	-
其他	6,456.69	-
合计	7,896,411.25	-

7.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月9日（基金合同生 效日）至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付） 成交总额	2,170,700,645.51	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑 付）成本总额	2,160,476,924.37	-
减：应收利息总额	9,095,488.96	-
债券投资收益	1,128,232.18	-

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月9日（基金合同生 效日）至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31 日
卖出资产支持证券（及到期兑 付）成交金额	-	-
卖出资产支持证券（及到期兑 付）成本总额	-	-
应收利息总额	-	-
资产支持证券投资收益	-	-

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15 股利收益

无。

7.4.7.16 公允价值变动收益

无。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月9日（基金合同生效日） 至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	18,645.17	-
合计	18,645.17	-

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月9日（基金合同生效 日）至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
审计费用	100,000.00	-
信息披露费	90,000.00	-
银行费用	28,277.72	-
上清所债券托管账户维护费	4,500.00	-
其他	400.00	-
中债登债券托管帐户维护费	13,500.00	-
合计	236,677.72	-

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

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海浦东发展银行股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金代销机构
法国安盛投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海盛融投资有限公司	基金管理人的股东
浦银安盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2011年3月9日（基金合同生效 日）至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,975,581.91	-
其中：支付销售机构的客户维护费	691,281.03	-

注：1、本基金《基金合同》生效日为2011年3月9日，无上年度可比期间。

2、支付基金管理人浦银安盛基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%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：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.33%÷当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月9日（基金合同生效 日）至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	598,661.14	-

注：1、本基金《基金合同》生效日为 2011 年 3 月 9 日，无上年度可比期间。

2、支付基金托管人中信银行股份有限公司的基金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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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 2011年3月9日（基金合同生效日）至2011年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B	合计
中信银行股份有限公司	285,248.08	6,818.10	292,066.18
上海浦东发展银行股份有限公司	466,690.35	5,979.88	472,670.23
浦银安盛基金管理有限公司	545.91	7,277.32	7,823.23
合计	752,484.34	20,075.30	772,559.64

注：1、本基金《基金合同》生效日为 2011 年 3 月 9 日，无上年度可比期间。

2、浦银货币 A 级基金份额的销售服务费按前一日该级基金资产净值 0.25% 的年费率计提；浦银货币 B 级基金份额的销售服务费按前一日该级基金资产净值 0.01% 的年费率计提；各级基金份额的销售服务费逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日该级基金份额的基金资产净值} \times R / \text{当年天数}$$

其中：R 为该级基金份额的年销售服务费率。

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

单位：人民币元

本期 2011年3月9日（基金合同生效日）至2011年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中信银行	-	50,591,972.22	-	-	-	-
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

注：本基金《基金合同》生效日为 2011 年 3 月 9 日，无上年度可比期间。

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

浦银安盛货币 A

基金管理人在本报告期末持有浦银安盛货币 A。本基金《基金合同》生效日为 2011 年 3 月 9 日，无上年度可比期间。

浦银安盛货币 B

基金管理人在本报告期末持有浦银安盛货币 B。本基金《基金合同》生效日为 2011 年 3 月 9 日，无上年度可比期间。

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

浦银安盛货币 A

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有浦银安盛货币 A。本基金《基金合同》生效日为 2011 年 3 月 9 日，无上年度可比期。

浦银安盛货币 B

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有浦银安盛货币 B。本基金《基金合同》生效日为 2011 年 3 月 9 日，无上年度可比期。

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		上年度可比期间	
	2011 年 3 月 9 日（基金合同生效日） 至 2011 年 12 月 31 日		2010 年 1 月 1 日至 2010 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
中信银行-活期	14,642,557.74	1,037,288.70	-	-
中信银行-定期	0.00	3,296,123.33	-	-

注：1、本基金的活期银行存款及部分定期银行存款由基金托管人中信银行保管，按约定利率计息。

2、本基金《基金合同》生效日为 2011 年 3 月 9 日，无上年度可比期间。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期承销期内未参与关联方承销的证券。本基金《基金合同》生效日为 2011 年 3 月 9 日，无上年度可比期间。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

1、浦银安盛货币 A

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
6,298,493.44	2,649,188.22	247,784.74	9,195,466.40	-

2、浦银安盛货币B

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
5,659,728.91	3,320,744.79	187,807.31	9,168,281.01	-

7.4.12 期末（2011 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。本基金的投资范围为：现金、通知存款、短期融资券、一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。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。

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、监察部、法务部的风险管理；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、督察长和内部审计部。

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，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和监察部，独立地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。监察部根据基金相关法律法规、公司基本制度及业务流程，对信息披露、法律文件等进行事中审核，并对基金管理人经营活动及各职能部门履职情况的合法合规性进行监督和检查。

董事会下属的合规及审计委员会，负责对公司整体风险管理和内部控制的有效性进行审议和评估。同时，督察长及合规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产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行活期存款存放在本基金的托管行 中信银行股份有限公司，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。定期存款存放在中信银行股份有限公司和 上海银行股份有限公司，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券。

于 2011 年 12 月 31 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的信用类债券占基金资产净值的比例为 4.65%。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于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对本基金的申购赎回情况进行严密监控，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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还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，除发生巨额赎回情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

单位：人民币元

本期末 2011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	-	-	-	-	354,642,557.74
交易性金融资产	-	-	-	-	10,001,801.26
应收利息	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	-	-	-	-	364,644,359.00
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-
利率敏感度缺口	-	-	-	-	364,644,359.00
上年度末2010 年12月31日	1个月以内	1—3个月	6个月以内	3个月—1年	6个月—1年
资产					
银行存款					
交易性金融资产					
应收利息					
应收申购款					
资产总计	-	-	-	-	-

负债					
应付管理人报酬					
应付托管费					
应付销售服务费					
应付交易费用					
应付利润					
其他负债					
负债总计	-	-	-	-	-
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-

注：1、表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

2、本基金《基金合同》生效日为 2011 年 3 月 9 日，无上年度可比期间。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率外其他变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	-	-	-

注：于 2011 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资占基金资产净值的比例为 4.65%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。本基金主要投资于定期存款、协议存款以及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。

7.4.14 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)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。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii)各层次金融工具公允价值

于 2011 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为 20,002,521.66 元，无属于第一或第三层级的余额。

(iii)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级未发生重大变动。

(iv)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2)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

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	固定收益投资	20,002,521.66	4.64
	其中：债券	20,002,521.66	4.64
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

3	银行存款和结算备付金合计	354,642,557.74	82.25
4	其他各项资产	56,544,664.79	13.11
	合计	431,189,744.19	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	0.09	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

8.3 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本报告期内，本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 20%。

8.4 基金投资组合平均剩余期限

8.4.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	26
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	120
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	13

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本基金合同约定投资组合的平均剩余期限不超过 120 天，本基金本报告期内投资组合平均剩余期限无超过 120 天的情况。

8.4.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	66.13	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

2	30 天(含)—60 天	13.94	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	4.65	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天（含）	2.32	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	87.04	-

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	摊余成本	占基金资产净值 比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,002,521.66	4.65
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	20,002,521.66	4.65
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比 例（%）
1	1181010	11 桑德 CP01	100,000	10,001,801.26	2.32
2	1181330	11 常纺 CP01	100,000	10,000,720.40	2.32

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
----	------

报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1281%
报告期内偏离度的最低值	-0.2361%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0677%

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

本基金所持有的债券（包括票据）采用摊余成本法进行估值，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

8.9.2 本报告期内，本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券，其摊余成本超过当日基金资产净值 20%的情况如下：

序号	发生日期	该类浮动债占基金资产净值的比例（%）	原因	调整期
1	2011-03-29	20.39	大额赎回	2011-3-30

8.9.3 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

8.9.4 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,084,527.82
4	应收申购款	55,460,136.97
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	56,544,664.79

§ 9 基金份额持有人信息

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
浦银安盛货币A	1,846	77,588.39	25,438,007.57	17.76%	117,790,155.03	82.24%
浦银安盛货币B	9	31,913,091.31	245,790,768.44	85.58%	41,427,053.35	14.42%
合计	1,855	232,046.35	271,228,776.01	63.01%	159,217,208.38	36.99%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	浦银安盛货币A	40,144.45	0.03%
	浦银安盛货币B	0.00	0%
	合计	40,144.45	0.01%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B
基金合同生效日(2011年3月9日)基金份额总额	2,574,555,555.18	1,199,852,060.84
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,145,957,687.90	2,748,951,057.06
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,577,285,080.48	3,661,585,296.11
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	143,228,162.60	287,217,821.79

注：申购含红利再投、分级份额调增和转换入份额，赎回含分级份额调减和转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

本基金管理人于 2011 年 3 月 26 日发布《浦银安盛基金管理有限公司关于董事会换届的公告》，公告披露经公司 2011 年第一次股东会会议审议通过，选举产生公司第二届董事会成员，共 9 名董事：姜明生先生（董事长）、Bruno Guilloton 先生（副董事长）、章曦先生、James Young 先生、刘以研先生、刘长江先生、王家祥女士（独立董事）、尹应能先生（独立董事）、吴伟聪先生（独立董事）。其中，王家祥女士、刘长江先生为新当选董事。原董事刘斐女士、原独立董事石良平先生不再连任。

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仍为普华永道中天会计师事务所，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 100,000.00 元，截止本报告期末，普华永道中天会计师事务所已提供审计服务的连续年限为 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
国信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、证券经营机构交易单元选择的标准和程序：

（1）选择证券经营机构交易单元的标准

财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；

佣金费率合理；

本基金管理人要求的其他条件。

（2）选择证券经营机构交易单元的程序

本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构；

基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增国信证券 1 个交易单元。

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		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
国信证券	-	-	2,129,500,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	浦银安盛货币市场证券投资基金招募说明书	《中国证券报》及公司网站	2011-2-18
2	浦银安盛货币市场证券投资基金份额发售公告	《中国证券报》及公司网站	2011-2-18
3	浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同摘要	《中国证券报》及公司网站	2011-2-18
4	浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同	公司网站	2011-2-18
5	浦银安盛货币市场证券投资基金托管协议	公司网站	2011-2-18
6	关于新增工商银行浦银安盛货币市场基金代销机构的公告	《中国证券报》及公司网站	2011-2-24
7	关于新增渤海证券为浦银安盛货币市场基金代销机构的公告	《中国证券报》及公司网站	2011-2-25
8	浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同生效公告	《中国证券报》及公司网站	2011-3-10
9	浦银安盛基金管理有限公司关于新增中信证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》及公司网站	2011-3-22
10	浦银安盛货币市场证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	《中国证券报》及公司网站	2011-3-23
11	浦银安盛基金管理有限公司关于董事会换届的公告	《中国证券报》及公司网站	2011-3-26
12	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信银行推出定期定额投资业务的公告	《中国证券报》及公司网站	2011-4-21
13	浦银安盛货币市场证券投资基金开放日常转换和定期定额投资业务的公告	《中国证券报》及公司网站	2011-4-25
14	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金在浦发银行推出定期定额投资业务的公告	《中国证券报》及公司网站	2011-4-26
15	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券推出定期定额投资业务的公告	《中国证券报》及公司网站	2011-5-5
16	浦银安盛货币市场基金关于参加中信银行开通的信用卡“基金自动赎回还款”业务的公告	《中国证券报》及公司网站	2011-5-23
17	浦银安盛基金管理有限公司关于新增上海银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》及公司网站	2011-6-10
18	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海银行代销渠道开通基金转换业务的公告	《中国证券报》及公司网站	2011-6-17
19	浦银安盛基金管理有限公司关于新增交通	《中国证券报》及公	2011-7-18

	银行为浦银安盛货币市场证券投资基金代销机构的公告	司网站	
20	浦银安盛货币市场证券投资基金 2011 年第 2 季度报告	《中国证券报》及公司网站	2011-7-21
21	浦银安盛货币市场证券投资基金 2011 年半年度报告正文	公司网站	2011-8-25
22	浦银安盛货币市场证券投资基金 2011 年半年度报告摘要	《中国证券报》及公司网站	2011-8-25
23	浦银安盛基金管理有限公司关于新增华夏银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》及公司网站	2011-9-14
24	关于浦银货币基金于国庆节前两个工作日暂停（大额）申购、转换转入的公告	《中国证券报》及公司网站	2011-9-27
25	关于新增华泰证券为浦银安盛货币市场证券投资基金代销机构的公告	《中国证券报》及公司网站	2011-10-13
26	浦银安盛货币市场证券投资基金招募说明书更新正文	公司网站	2011-10-21
27	浦银安盛货币市场证券投资基金招募说明书更新摘要	《中国证券报》及公司网站	2011-10-21
28	浦银安盛货币市场证券投资基金 2011 年第 3 季度报告	《中国证券报》及公司网站	2011-10-25
29	中信银行法定代表人变更公告	《中国证券报》及中信银行网站	2011-8-18

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2012 年 2 月 2 日发布公告，增聘薛铮先生为本基金基金经理。上述事项已按规定向中国证券业协会办理完毕基金经理变更手续。薛铮先生的任职报告已报送中国证券监督管理委员会上海监管局备案。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准浦银安盛货币市场证券投资基金设立的文件
- 2、浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同
- 3、浦银安盛货币市场证券投资基金招募说明书
- 4、浦银安盛货币市场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

二〇一二年三月二十六日