

浦银安盛货币市场证券投资基金

2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年八月二十九日

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。本半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 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
3	主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1	资产负债表.....	14
6.2	利润表.....	15
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4	报表附注.....	17
7	投资组合报告.....	33
7.1	期末基金资产组合情况.....	33
7.2	债券回购融资情况.....	33
7.3	债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明.....	33
7.4	基金投资组合平均剩余期限.....	33
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	34
7.6	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.....	35
7.7	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	35
7.8	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.....	35

7.9	投资组合报告附注.....	35
8	基金份额持有人信息.....	36
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	36
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	36
9	开放式基金份额变动.....	37
10	重大事件揭示.....	37
10.1	基金份额持有人大会决议.....	37
10.2	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.....	37
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	37
10.4	基金投资策略的改变.....	38
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	38
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	38
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	38
10.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	39
10.9	其他重大事件.....	39
11	影响投资者决策的其他重要信息.....	40
12	备查文件目录.....	40
12.1	备查文件目录.....	40
12.2	存放地点.....	41
12.3	查阅方式.....	41

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	
交易代码	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	227,870,722.57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	152,414,335.74份	75,456,386.83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	010-65556812
	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 号 3 幢 316 室	北京市东城区朝阳门北大街 8 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》
登载基金半年度报告正文的管理人 互联网网址	www.py-axa.com
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）	
	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B
本期已实现收益	3,371,719.93	3,017,472.12
本期利润	3,371,719.93	3,017,472.12
本期净值收益率	2.10%	2.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)	
	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B
期末基金资产净值	152,414,335.74	75,456,386.83

期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012年6月30日)	
	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B
累计净值收益率	5.05%	5.39%

注：1、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。

2、本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。

3、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
过去一个月	0.4261%	0.0205%	0.0348%	0.0001%	0.3913%	0.0204%
过去三个月	0.9793%	0.0121%	0.1184%	0.0001%	0.8609%	0.0120%
过去六个月	2.1034%	0.0091%	0.2433%	0.0001%	1.8601%	0.0090%
过去一年	4.0802%	0.0075%	0.4963%	0.0001%	3.5839%	0.0074%
自基金合同生效起至今	5.0544%	0.0069%	0.6445%	0.0001%	4.4099%	0.0068%

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
过去一个月	0.4457%	0.0205%	0.0348%	0.0001%	0.4109%	0.0204%
过去三个月	1.0395%	0.0122%	0.1184%	0.0001%	0.9211%	0.0121%
过去六个月	2.2251%	0.0091%	0.2433%	0.0001%	1.9818%	0.0090%
过去一年	4.3303%	0.0075%	0.4963%	0.0001%	3.8340%	0.0074%
自基金合同生效起至今	5.3867%	0.0069%	0.6445%	0.0001%	4.7422%	0.0068%

注：本基金收益分配按月结转份额。

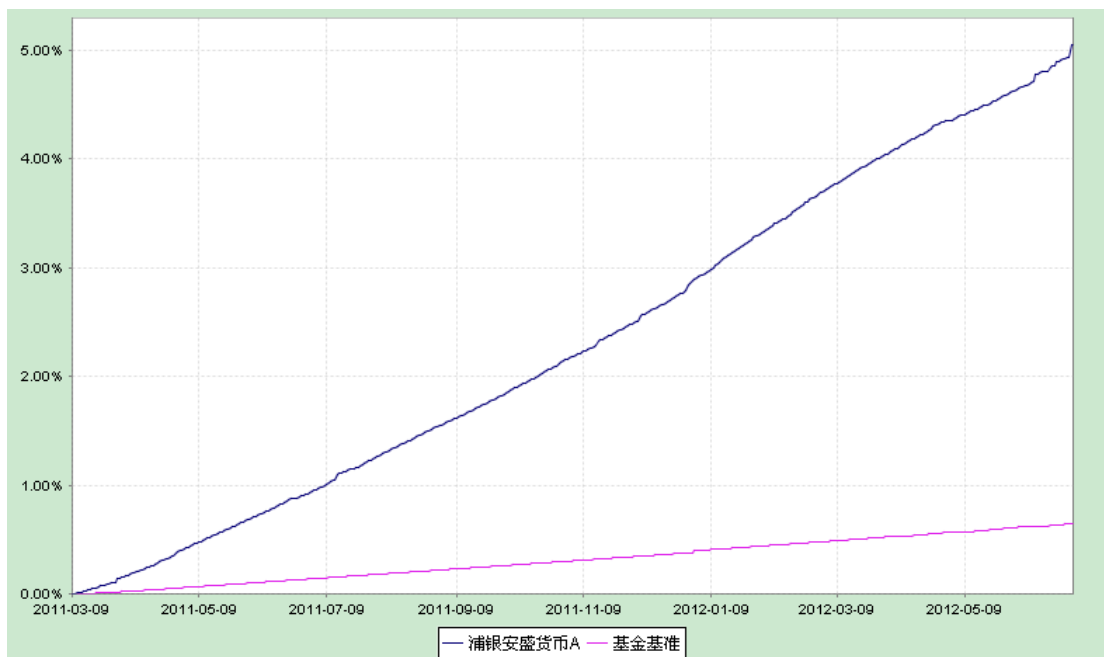
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变

动的比较

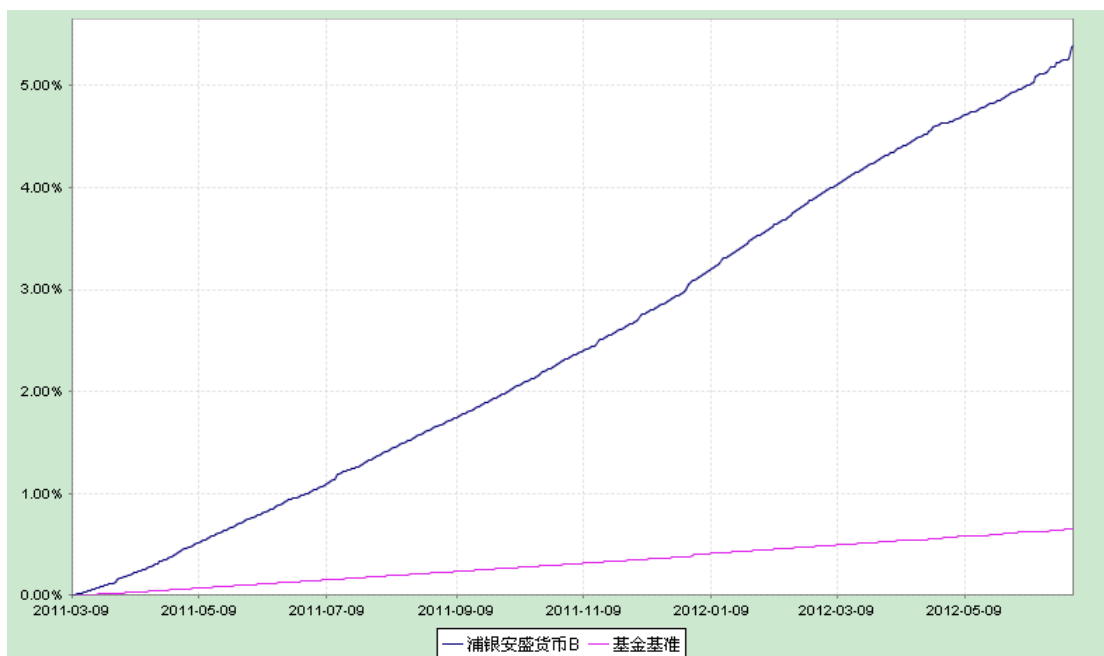
浦银安盛货币市场证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011 年 3 月 9 日至 2012 年 6 月 30 日)

1、浦银安盛货币 A



2、浦银安盛货币 B



注：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。本基金建仓期为 2011 年 3 月 9 日至 2011 年 9 月 9 日，截止报告期末，建仓已完成，各项资产投资比例符合基金合同要求。

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 2012 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 8 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、浦银安盛分级增利债券型证券投资基金和浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金。

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		
薛铮	本基金基金经理兼浦银安盛增利分级债券型证券投资基金基金经理	2012-02-01	-	6	薛铮，上海财经大学数量经济学硕士。2006 年 3 月至 2008 年 5 月，在红顶金融研究中心担任固定收益研究员。2008 年 6 月至 2009 年 6 月，在上海证券有限公司固定收益部担任投资经理助理之职。2009 年 7 月进入浦银安盛基金管理有限公司，任浦银安盛优化收益债券型基金基金经理助理兼固定收益研究员。2011 年 6 月至 2012 年 6 月，担任浦银安盛优化收益债券型证券投资基金基金经理。2011 年 12 月起，担任浦银安

					盛增利分级债券型证券投资基金基金经理。2012年2月起担任本基金基金经理。
周文桐	公司副总经理、首席投资官兼本基金基金经理	2011-03-09	2012-04-26	13	周文桐，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。

注：1、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，其离任日期指公司决定确定的解聘日期。

2、薛铮的任职日期指公司决定确定的聘任日期。

3、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

本基金管理人已制定了《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基金组合。

在具体执行中，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平的提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度，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 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012 年上半年，经济增速回落促使央行货币政策进入降息周期模式，2 月底下调存款准备金率，5 月中旬再次下调存准，6 月初至 7 月初 1 个月内两次降息。下调存款准备金和央行积极的公开市场操作，使得银行间市场资金面逐步宽松，即使在传统 6 月末紧张时点，银行间 7 天质押式回购利率也未超过 5%，其月平均利率由年初的 4.45% 回落至 6 月份的 3.23%，3 月份第一次降准是一个显著的拐点。

通胀上半年延续逐步回落趋势，仅 3 月份有小幅反弹，基本符合事前预期。短融收益率也随着资金面宽松一路下行，与年初相比平均下降 200BP 以上，其中低评级短融下降幅度最大。一年期央行票据二级市场收益率下行幅度也超过 80BP。报告期内，本基金配置了部分银行存款，并对短融进行了波段操作，获取了较高的收益回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期 A 类净值收益率为 2.1034%，B 类净值收益率为 2.2251%，同期业绩比较基准收益率为 0.2433%，本基金的业绩比较基准为税后活期存款利率。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年, 政府稳增长为首要目标, 财政和货币政策将进一步加大力度, 考虑到外汇占款持续增长乏力, 货币政策下半年降准和降息可能性都很大, 这使得流动性整体维持略宽松局面。下半年通胀预计同比仍处于低位, 对于债市不构成压力, 4 季度通胀可能由于基数效应和季节性因素有所反弹但幅度有限, 全年通胀同比水平平均预计在 2.7%。

当前货币市场利率中枢处于历史平均水平, 银行间 7 天回购利率在 3.15%附近。虽然流动性拐点已过, 但利率市场化使得全社会短期资金成本上升, 预计回购利率水平维持在目前水平附近。基金将采取相对积极的配置, 并密切跟踪经济的各项指标, 根据经济环境的变化适时调整策略。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定, 确保基金资产估值的公平、合理, 有效维护投资人的利益, 设立了浦银安盛基金管理有限公司估值委员会 (以下简称“估值委员会”), 制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由公司分管高管、金融工程部负责人、研究部负责人、监察稽核部负责人、基金会计部负责人组成。估值委员会成员五分之三以上具有 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服务协议》。

4.7 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 3,371,719.93 元,实际分配收益 3,371,719.93 元;浦银货币 B 级基金应分配收益 3,017,472.12 元,实际分配收益 3,017,472.12 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

2012 年上半年,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投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012 年上半年,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 托管人对本半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 2012 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	118,235,417.83	354,642,557.74
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	70,024,060.61	20,002,521.66
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		70,024,060.61	20,002,521.66
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	39,800,379.70	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	518,286.83	1,084,527.82
应收股利		-	-
应收申购款		53,100.00	55,460,136.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		228,631,244.97	431,189,744.19
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
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		73,792.41	55,818.62
应付托管费		22,361.36	16,914.74
应付销售服务费		35,563.36	25,253.87
应付交易费用	6.4.7.7	16,071.95	11,180.52

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		528,247.20	435,592.05
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	84,486.12	199,000.00
负债合计		760,522.40	743,759.80
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	227,870,722.57	430,445,984.39
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		227,870,722.57	430,445,984.39
负债和所有者权益总计		228,631,244.97	431,189,744.19

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 227,870,722.57 份。其中浦银货币 A 级的基金份额为 152,414,335.74 份，浦银货币 B 级的基金份额为 75,456,386.83 份。

6.2 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 3 月 9 日(基金合 同生效日)至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		7,348,186.52	14,313,554.80
1.利息收入		6,449,977.51	13,391,173.07
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,518,868.12	4,895,711.99
债券利息收入		914,969.71	5,467,494.34
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收入		1,016,139.68	3,027,966.74
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		897,064.90	903,736.56
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	897,064.90	903,736.56
资产支持证券投资收 益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益(损失以	6.4.7.16	-	-

“-”号填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.17	1,144.11	18,645.17
减: 二、费用		958,994.47	2,533,740.31
1. 管理人报酬		495,236.48	1,399,887.50
2. 托管费		150,071.63	424,208.30
3. 销售服务费		209,401.10	606,031.64
4. 交易费用	6.4.7.18	-	-
5. 利息支出		833.09	13,887.51
其中: 卖出回购金融资产支出		833.09	13,887.51
6. 其他费用	6.4.7.19	103,452.17	89,725.36
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		6,389,192.05	11,779,814.49
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		6,389,192.05	11,779,814.49

注: 本基金上年度可比期间为 2011 年 3 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2011 年 6 月 30 日。

6.3 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: 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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)	430,445,984.39	-	430,445,984.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,389,192.05	6,389,192.05
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)	-202,575,261.82	-	-202,575,261.82
其中: 1. 基金申购款	1,469,001,858.61	-	1,469,001,858.61
2. 基金赎回款	-1,671,577,120.43	-	-1,671,577,120.43
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金	-	-6,389,192.05	-6,389,192.05

净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	227,870,722.57	-	227,870,722.57
项目	上年度可比期间 2011年3月9日（基金合同生效日）至2011年6月30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）	-	11,779,814.49	11,779,814.49
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）	-3,286,472,974.77	-	-3,286,472,974.77
其中：1. 基金申购款	1,404,726,154.40	-	1,404,726,154.40
2. 基金赎回款	-4,691,199,129.17	-	-4,691,199,129.17
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“-”号填列）	-	-11,779,814.49	-11,779,814.49
五、期末所有者权益（基金净值）	487,934,641.25	-	487,934,641.25

注：本基金上年度可比期间为 2011 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日。

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：郁蓓华，主管会计工作负责人：郁蓓华，会计机构负责人：赵迎华

6.4 报表附注

6.4.1 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》及其配套法规和《浦银安盛货币市场投资基金基金合同》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(其中 A 类份额净认购金额为 2,574,133,436.52 元, B 类份额净认

购金额为 1,199,687,000.00 元),已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 A 类份额为 2,574,555,555.18 份,B 类份额为 1,199,852,060.84 份),其中认购资金利息折合 587,179.50 份基金份额(其中 A 类份额产生的利息为 422,118.66 份,B 类份额产生的利息为 165,060.84 份)。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《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛货币市场投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于法律法规允许投资的金融工具,具体如下:1. 现金;2. 通知存款;3. 短期融资券;4. 一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;5. 期限在一年以内(含一年)的债券回购;6. 期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;7. 剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券;8. 剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券;9. 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。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他产品,基金管理人在履行适当的程序后,可以将其纳入投资范围。本基金业绩比较基准为银行活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人于 2012 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
活期存款	20,235,417.83
定期存款	98,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	98,000,000.00
其他存款	-
合计	118,235,417.83

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30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	70,024,060.61	70,021,000.00	-3,060.61	-0.0013
	合计	70,024,060.61	70,021,000.00	-3,060.61	-0.0013

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。

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2012 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入银行间返售证券	39,800,379.70	-
合计	39,800,379.70	-

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	21,652.03
应收定期存款利息	340,846.47
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	800.00
应收债券利息	138,290.42
应收买入返售证券利息	16,697.91
应收申购款利息	-
其他	-
合计	518,286.83

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	16,071.95
合计	16,071.95

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	84,486.12
合计	84,486.12

6.4.7.9 实收基金

浦银安盛货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	143,228,162.60	143,228,162.60
本期申购	737,685,705.42	737,685,705.42
本期赎回（以“-”号填列）	-728,499,532.28	-728,499,532.28
本期末	152,414,335.74	152,414,335.74

浦银安盛货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	287,217,821.79	287,217,821.79
本期申购	731,316,153.19	731,316,153.19
本期赎回（以“-”号填列）	-943,077,588.15	-943,077,588.15
本期末	75,456,386.83	75,456,386.83

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。

6.4.7.10 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
上年度末	-	-	-
本期利润	3,371,719.93	-	3,371,719.93
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	-3,371,719.93	-	-3,371,719.93
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
上年度末	-	-	-
本期利润	3,017,472.12	-	3,017,472.12
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	-3,017,472.12	-	-3,017,472.12
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	224,139.20
定期存款利息收入	4,293,296.02
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	800.05
其他	632.85
合计	4,518,868.12

6.4.7.12 股票投资收益

无。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	214,619,136.38
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	210,435,497.38
减：应收利息总额	3,286,574.10
债券投资收益	897,064.90

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15 股利收益

无。

6.4.7.16 公允价值变动收益

无。

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	1,144.11

合计	1,144.11
----	----------

6.4.7.18 交易费用

无。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	35,803.04
信息披露费	39,781.56
上清所债券托管账户维护费	8,950.76
银行费用	9,511.05
中债登债券托管帐户服务费	8,950.76
其他	455.00
合计	103,452.17

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
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，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年3月9日（基金合同生效日） 至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	495,236.48	1,399,887.50
其中：支付销售机构的客户维护费	181,337.73	503,836.31

注：1、本基金上年度可比期间为 2011 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年3月9日（基金合同生效日） 至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	150,071.63	424,208.30

注：1、本基金上年度可比期间为 2011 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日。

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：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数

6.4.10.2.3 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 2012年1月1日至2012年6月30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	45,988.69	318.68	46,307.37
上海浦东发展银行股份有限公司	76,665.02	1,224.33	77,889.35

浦银安盛基金管理有限公司	1,768.83	3,031.59	4,800.42
合计	124,422.54	4,574.60	128,997.14
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2011年3月9日（基金合同生效日）至2011年6月30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	205,975.83	5,353.40	211,329.23
上海浦东发展银行股份有限公司	355,912.12	4,871.34	360,783.46
浦银安盛基金管理有限公司	292.53	3,451.85	3,744.38
合计	562,180.48	13,676.59	575,857.07

注：1、本基金上年度可比期间为 2011 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日。

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：

日销售服务费 = 前一日该级基金份额的基金资产净值 × R / 当年天数

其中：R 为该级基金份额的年销售服务费率。

6.4.10.3 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 2012年1月1日至2012年6月30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
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2011年3月9日（基金合同生效日）至2011年6月30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	-	-	-	-

注：本基金上年度可比期间为 2011 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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与上年度可比期间均未持有浦银安盛货币 A。

浦银安盛货币 B

基金管理人在本报告期与上年度可比期间均未持有浦银安盛货币 B。

6.4.10.4.2 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及上年度末均未持有浦银安盛货币 A。

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及上年度末均未持有浦银安盛货币 B。

6.4.10.5 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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年3月9日（基金合同生效日）至 2011年6月30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-活期存款	20,235,417.83	224,139.20	626,905.64	943,770.07
中信银行-定期存款	15,000,000.00	766,895.91	-	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、本基金上年度可比期间为 2011 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 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
2,454,616.16	810,931.20	106,172.57	3,371,719.93	-

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
1,659,567.10	1,371,422.44	-13,517.42	3,017,472.12	-

6.4.12 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币型证券投资基金，属于证券投资基金中的较低收益、较低风险品种。一般情形下，其风险和收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。本基金主要投资于国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业(公司)债等流动性较好的货币市场工具。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、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。

6.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中信银行，部分定期存款存放在具有托管资格的上海银行，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，因此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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券。

6.4.13.2.1 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 2012年6月30日	上年末 2011年12月31日
A-1	60,023,756.81	20,002,521.66
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	10,000,303.80	0.00
合计	70,024,060.61	20,002,521.66

注：1、持有的短期融资券按其债项的短期信用评级列示，持有的其他信用债以其债项评级作为长期信用评级进行披露。

6.4.13.2.2 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 2012 年 6 月 30 日	上年末 2011 年 12 月 31 日
AAA	0.00	-
AAA 以下	70,024,060.61	-
未评级	0.00	-
合计	70,024,060.61	-

注：长期信用评级以持有的信用债项评级为依据进行披露。

6.4.13.3 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通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券可在银行间同业市场交易，其余亦在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12.1 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2012年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	118,235,417.83-	-	-	-	118,235,417.83-
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
证券清算款	-	-	-	-	-
交易性金融 资产	70,024,060.61-	-	-	-	70,024,060.61-
买入返售金 融资产	39,800,379.70-	-	-	-	39,800,379.70-
应收利息	-	-	-	518,286.83-	518,286.83-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	53,100.00	53,100.00
资产总计	228,059,858.14-	-	-	571,386.83-	228,631,244.97-
负债					
应付证券清 算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	73,792.41-	73,792.41-
应付托管费	-	-	-	22,361.36-	22,361.36-
应付销售费 用	-	-	-	35,563.36-	35,563.36-

应付交易费用	-	-	-	16,071.95-	16,071.95-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	528,247.20-	528,247.20-
其他负债	-	-	-	84,486.12-	84,486.12-
负债总计	-	-	-	760,522.40-	760,522.40-
利率敏感度缺口	228,059,858.14 -	-	-	-189,135.57-	227,870,722.57-
上年度末 2011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	-	-	-	-	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	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-
利率敏感度缺口	-	-	-	-	364,644,359.00

注：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。

6.4.13.4.1.2 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）	
		本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	市场利率上升0.25%	减少180,033.06	减少13,721.69
	市场利率下降0.25%	增加180,828.78	增加13,770.18

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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；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。本基金的投资组合中投资于定期存款的比例不超过基金资产净值的 30%，持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计不超过当日基金资产净值的 20%，现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 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	70,024,060.61	30.63
	其中：债券	70,024,060.61	30.63
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	39,800,379.70	17.41
	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	118,235,417.83	51.71
4	其他各项资产	571,386.83	0.25
5	合计	228,631,244.97	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.01	
	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。

7.3 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资产净值的 20%。

7.4 基金投资组合平均剩余期限

7.4.1 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	94
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	130
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	15

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有 4 次超过 120 天的记录，主要是由于基金赎回导致的被动超标。

7.4.2 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	32.93	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	17.55	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	32.04	-
	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)	17.56	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
6	合计	100.08	-

7.5 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	70,024,060.61	30.73
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	70,024,060.61	30.73

9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-
---	----------------------	---	---

7.6 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	041261024	12 浙商集 CP002	200,000	20,002,089.68	8.78
2	041262018	12 远东 CP001	100,000	10,018,827.15	4.40
3	041253029	12 方圆 CP001	100,000	10,003,491.68	4.39
4	071202001	12 国泰君安 CP001	100,000	10,000,596.53	4.39
5	011215001	12 中铝业 SCP001	100,000	10,000,303.80	4.39
6	071201001	12 招商 CP001	100,000	9,998,751.77	4.39

7.7 “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	6
报告期内偏离度的最高值	0.3200%
报告期内偏离度的最低值	-0.0047%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0641%

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 本报告期内不存在持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券摊余成本超过当日基金资产净值 20% 的情况。

7.9.3 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。

7.9.4 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	518,286.83
4	应收申购款	53,100.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	571,386.83

8 基金份额持有人信息

8.1 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	2,481	61,432.62	15,462,335.88	10.14%	136,951,999.86	89.86%
浦银 安盛 货币 B	10	7,545,638.68	34,440,967.51	45.64%	41,015,419.32	54.36%
合计	2,491	91,477.61	49,903,303.39	21.90%	177,967,419.18	78.10%

8.2 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
基金管理公司所有从业 人员持有本基金	浦银安盛货币 A	332,722.99	0.22%
	浦银安盛货币 B	0.00	0%

	合计	332,722.99	0.15%
--	----	------------	-------

注：1、本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量为 0；

2、本基金的基金经理持有该只基金份额总量为 0。

9 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
本报告期期初基金份额总额	143,228,162.6	287,217,821.79
本报告期基金总申购份额	737,685,705.42	731,316,153.19
减：本报告期基金总赎回份额	728,499,532.28	943,077,588.15
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	152,414,335.74	75,456,386.83

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。

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

1、本基金管理人于 2012 年 3 月 16 日召开股东会，审议部分董事及监事更换事项。选举廖正旭先生、林道峰先生为公司内部董事，选举 James Young 先生为公司监事。陈士俊先生为公司新一任职工监事。公司原董事 James Young 先生、刘以研先生，原监事廖正旭先生、戴刚先生（职工监事），均因职务发生变动，不再担任原职；

2、本基金管理人于 2012 年 4 月 28 日发布公告，副总经理兼首席运营官陈箴先生及副总经理兼首席投资官周文桐先生自 2012 年 4 月 27 日起离任 于 2012 年 5 月 8 日发布公告，李宏宇先生自 2012 年 5 月 2 日起，担任公司副总经理兼首席市场营销官。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司，未有改聘情况发生。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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：

本基金本报告期内无租用证券公司交易的单元变动情况。

10.7.2 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	-	-	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%（含）以上的情况。

10.9 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	浦银安盛基金管理有限公司关于浦银货币基金于春节长假前两个工作日暂停申购、定投及转换转入业务的公告	三大证券报及公司网站	2012-1-17
2	浦银安盛基金管理有限公司关于新增中信万通证券为旗下部分基金代销机构的公告	三大证券报及公司网站	2012-1-17
3	浦银安盛货币市场证券投资基金2011年第4季度报告	三大证券报及公司网站	2012-1-18
4	浦银安盛货币市场证券投资基金2011年年度报告（摘要）	三大证券报及公司网站	2012-3-26
5	浦银安盛货币市场证券投资基金2011年年度报告（全文）	公司网站	2012-3-26
6	浦银安盛货币市场证券投资基金基金经理变更公告	三大证券报及公司网站	2012-2-2
7	浦银安盛基金管理有限公司关于新增中信证券（浙江）为旗下部分基金代销机构的公告	三大证券报及公司网站	2012-2-14
8	浦银货币基金2011年年度报告（全文）	公司网站	2012-3-26
9	浦银货币基金2011年年度报告（摘要）	三大证券报及公司网站	2012-3-26
10	浦银货币2012年第1季度报告	三大证券报及公司网站	2012-4-24
11	浦银安盛货币市场基金招募说明书更新正文（2012年第1号）	公司网站	2012-4-25

12	浦银安盛货币市场基金招募说明书更新摘要（2012年第1号）	三大证券报及公司网站	2012-4-25
13	浦银安盛货币市场证券投资基金基金经理变更公告	三大证券报及公司网站	2012-4-28
14	浦银安盛基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	三大证券报及公司网站	2012-4-28
15	浦银安盛基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	三大证券报及公司网站	2012-5-8
16	关于新增宁波银行为旗下部分基金代销机构的公告	三大证券报及公司网站	2012-6-15
17	关于浦银货币基金于端午节假期前两个工作日暂停申购、定投及转换转入业务的公告	三大证券报及公司网站	2012-6-18
18	关于旗下部分基金在天相投顾推出定期定额投资业务的公告	三大证券报及公司网站	2012-6-20
19	关于旗下部分基金在浦发银行开通基金转换业务的公告	三大证券报及公司网站	2012-6-26
20	关于旗下部分基金在交通银行开通基金转换业务的公告	三大证券报及公司网站	2012-6-26
21	关于旗下部分基金参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	三大证券报及公司网站	2012-6-28

11 影响投资者决策的其他重要信息

1、2012年7月28日，本基金管理人发布关于总经理变更的公告，自2012年7月23日起，由郁蓓华女士就任本基金管理人总经理一职。

2、2012年7月13日，基金托管人发布关于控股股东变更获中国银监会批准的公告，中国中信集团有限公司向中国中信股份有限公司转让其持有的中信银行股份。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准浦银安盛货币市场证券投资基金募集的文件
- 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托管协议
- 4、浦银安盛基金管理有限公司开放式基金业务规则
- 5、关于募集浦银安盛货币市场证券投资基金的法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件和营业执照

7、基金托管人业务资格批件和营业执照

8、中国证监会要求的其他文件

12.2 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。

12.3 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

二〇一二年八月二十九日