

**浦银安盛日日盈货币市场基金2014年年度报告**

**2014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：交通银行股份有限公司**

**送出日期：2015年3月26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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年3月24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。本基金自2014年5月30日起增加D级基金份额类别。

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2014年3月25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	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	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	7
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	11
§4	管理人报告	12
4.1	基金管理人及基金经理情况	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	15
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	16
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	22
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	22
§5	托管人报告	22
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	22
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	23
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	23
§6	审计报告	23
6.1	审计报告基本信息	23
6.2	审计报告的基本内容	23
§7	年度财务报表	25
7.1	资产负债表	25
7.2	利润表	26
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	28
7.4	报表附注	29
§8	投资组合报告	52
8.1	期末基金资产组合情况	52
8.2	债券回购融资情况	53
8.3	基金投资组合平均剩余期限	53
8.4	期末按债券品种分类的债券投资组合	54
8.5	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	55
8.6	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	55
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	56
8.8	投资组合报告附注	56
§9	基金份额持有人信息	56
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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情况	57
§10	开放式基金份额变动	58
§11	重大事件揭示	58
11.1	基金份额持有人大会决议	58

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 .....	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
11.4 基金投资策略的改变 .....	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
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 .....	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	61
11.9 其他重大事件 .....	61
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
§13 备查文件目录 .....	65
13.1 备查文件目录 .....	65
13.2 存放地点 .....	65
13.3 查阅方式 .....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛日日盈货币市场基金		
基金简称	浦银安盛日日盈货币		
基金主代码	519566		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年3月25日		
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	3,087,573,893.16		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	浦银安盛日日盈货币A	浦银安盛日日盈货币B	浦银安盛日日盈货币D
下属分级基金的交易代码	519566	519567	519568
报告期末下属分级基金的份额总额	35,380,704.66	1,063,879,978.23	1,988,313,210.27

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>(1) 滚动配置策略</p> <p>本基金将根据具体投资品种的市场特性采用持续投资的方法，既能提高基金资产变现能力的稳定性，又能保证基金资产收益率与市场利率的基本一致。</p> <p>(2) 久期控制策略</p> <p>本基金将根据对货币市场利率趋势的判断来配置基金资产的久期。在预期利率上升时，缩短基金资产的久期，以规避资本损失或获得较高的再投资收益；在预期利率下降时，延长基金资产的久期，以获取资本利得或锁定较高的收益率。</p> <p>(3) 套利策略</p> <p>套利策略包括跨市场套利和跨品种套利。跨市场套利</p>

	<p>是利用同一金融工具在各个子市场的不同表现进行套利。跨品种套利是利用不同金融工具的收益率差别，在满足基金自身流动性、安全性需要的基础上寻求更高的收益率。</p> <p>(4) 时机选择策略</p> <p>股票、债券发行以及年末效应等因素可能会使市场资金供求情况发生暂时失衡，从而推高市场利率。充分利用这种失衡就能提高基金资产的收益率。</p>
业绩比较基准	活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	汤嵩彦
	联系电话	021-23212888	95559
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95559
传真		021-23212985	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区浦东大道 981号3幢316室	上海市浦东新区银城中路 188号
办公地址		上海市淮海中路381号中 环广场38楼	上海市浦东新区银城中路 188号
邮政编码		200020	200120
法定代表人		姜明生	牛锡明

### 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》、《上海证券报》、《证券时报》
----------------	------------------------

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	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	2014年		
	浦银安盛日日盈货 币A	浦银安盛日日盈货 币B	浦银安盛日日盈货币D
本期已实现收益	3,235,118.73	53,396,391.37	46,193,206.86
本期利润	3,235,118.73	53,396,391.37	46,193,206.86
本期净值收益率	3.3388%	3.5318%	2.5022%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末		
期末基金资产净值	35,380,704.66	1,063,879,978.23	1,988,313,210.27
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2014年末		
累计净值收益率	3.3388%	3.5318%	2.5022%

注：1、本基金《基金合同》2014年3月25日生效。以上财务指标中"本期"指2014年3月25日（基金合同生效日）至2014年12月31日止期间。

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、本基金收益分配按日结转份额。

5、自2014年5月30日起，本基金增加D级基金份额类别。

## 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

阶段 (浦银安盛日日盈货币 A)	份额净 值收益 率①	份额净 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	1.0300 %	0.0041 %	0.0883 %	0.0000 %	0.9417 %	0.0041 %
过去六个月	2.1084 %	0.0036 %	0.1766 %	0.0000 %	1.9318 %	0.0036 %
自基金合同生效起至 今	3.3388 %	0.0034 %	0.2708 %	0.0000 %	3.0680 %	0.0034 %
阶段 (浦银安盛日日盈货币 B)	份额净 值收益 率①	份额净 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	1.0913 %	0.0041 %	0.0883 %	0.0000 %	1.0030 %	0.0041 %
过去六个月	2.2324 %	0.0036 %	0.1766 %	0.0000 %	2.0558 %	0.0036 %
自基金合同生效起至 今	3.5318 %	0.0034 %	0.2708 %	0.0000 %	3.2610 %	0.0034 %
阶段 (浦银安盛日日盈货币 D)	份额净 值收益 率①	份额净 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	1.0302 %	0.0041 %	0.0883 %	0.0000 %	0.9419 %	0.0041 %
过去六个月	2.1108 %	0.0036 %	0.1766 %	0.0000 %	1.9342 %	0.0036 %
自基金合同生效起至 今	2.5022 %	0.0038 %	0.2035 %	0.0000 %	2.2987 %	0.0038 %

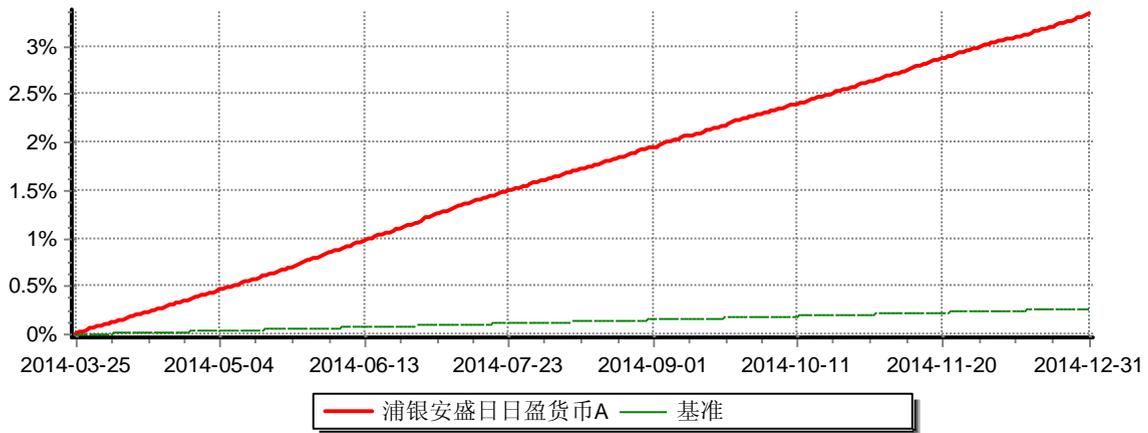
注：本基金收益分配按日结转份额。

### 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

#### 浦银安盛日日盈货币A

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

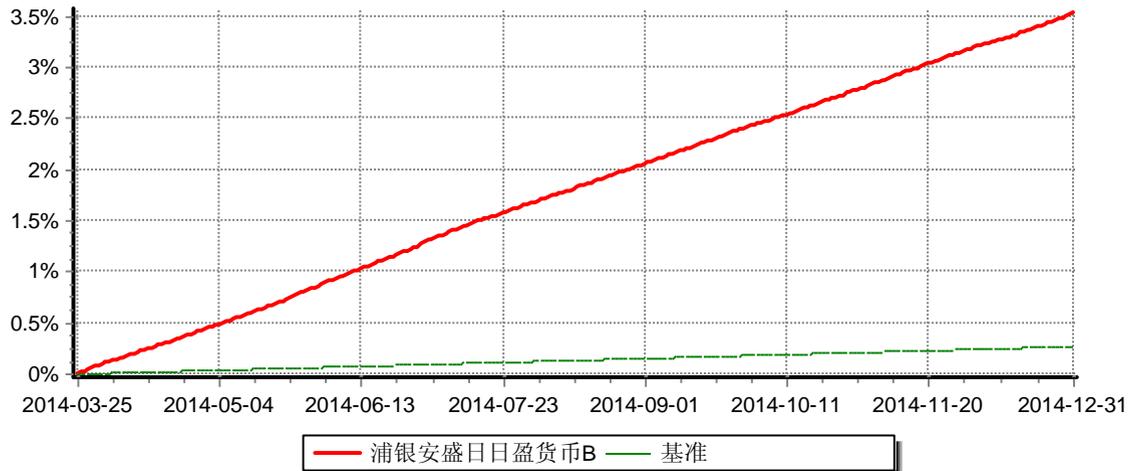
(2014年3月25日-2014年12月31日)



#### 浦银安盛日日盈货币B

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

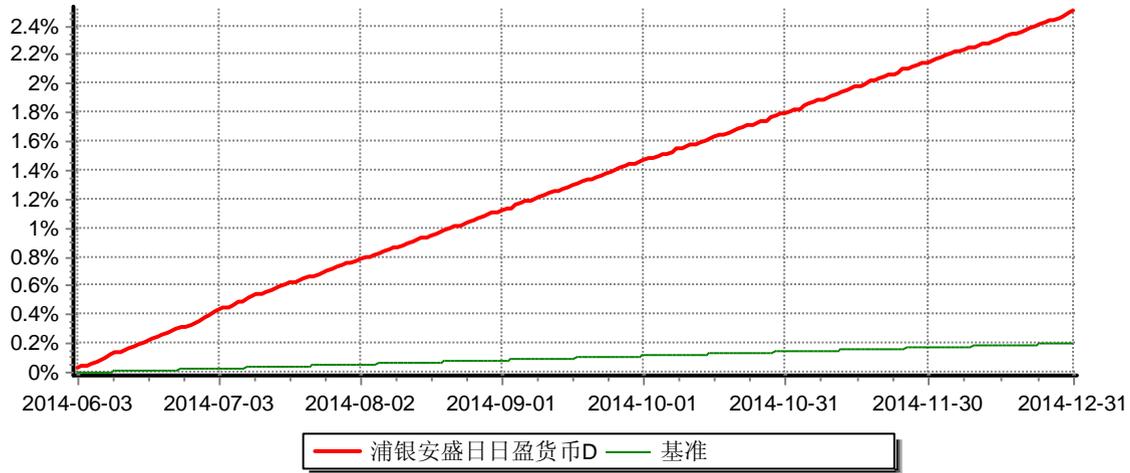
(2014年3月25日-2014年12月31日)



#### 浦银安盛日日盈货币D

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年6月3日-2014年12月31日)

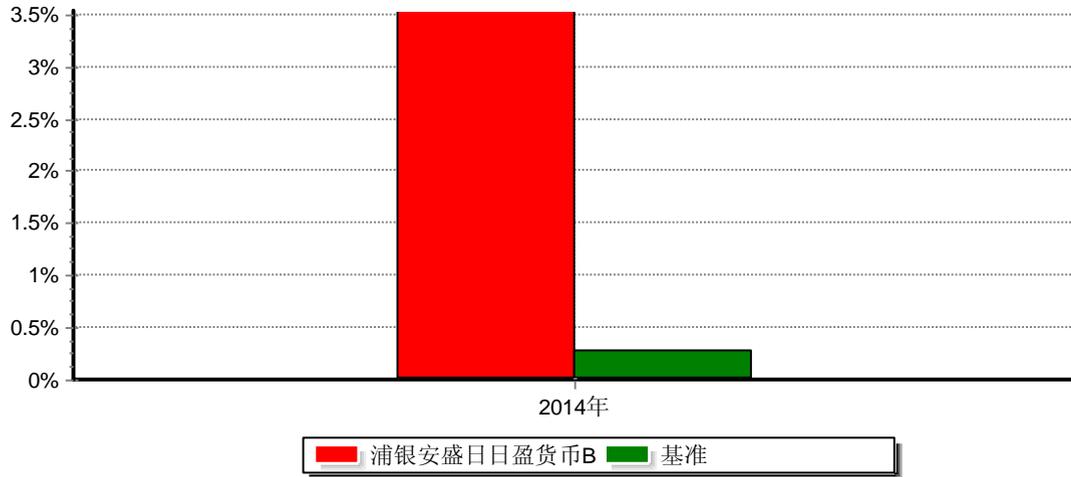


注：1、本基金合同生效日为2014年3月25日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。  
 2、根据基金合同第十二部分第四条规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为2014年3月25日至2014年9月24日，建仓期结束时本基金投资组合比例符合本基金基金合同约定。

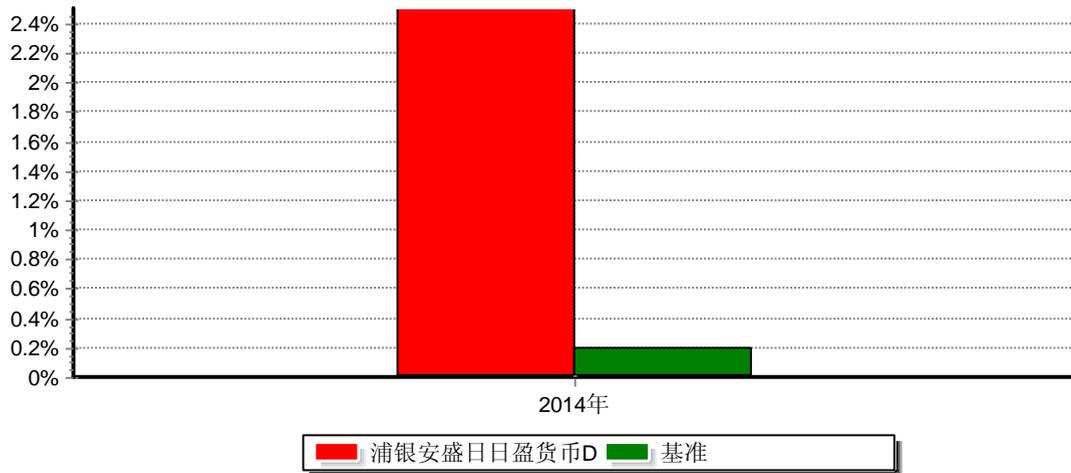
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于2014年3月25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。



注：本基金合同于2014年3月25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。



注：本基金D级基金份额类别自2014年5月30日起增加，增加当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度 (浦银安盛日日盈货币A)	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
2014年	3,230,922.79	—	4,195.94	3,235,118.73	

合计	3,230,922.79	—	4,195.94	3,235,118.73	
----	--------------	---	----------	--------------	--

单位：人民币元

年度 (浦银安盛日日盈货币B)	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
2014年	53,263,153.95	—	133,237.42	53,396,391.37	
合计	53,263,153.95	—	133,237.42	53,396,391.37	

单位：人民币元

年度 (浦银安盛日日盈货币D)	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
2014年	45,957,321.57	—	235,885.29	46,193,206.86	
合计	45,957,321.57	—	235,885.29	46,193,206.86	

## § 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管理有限公司，公司总部设在上海，注册资本为人民币2.8亿元，股东持股比例分别为51%、39%和10%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和证监会许可的其他业务。

截至2014年12月31日止，浦银安盛旗下共管理17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、浦银安盛增利分级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证券投资基金、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及浦银安盛月月盈安心养老定期支付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相关的系统功能升级，升级由系统提供商负责完成，升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。业务应用系统日常的维护管理由公司负责，但与系统提供商签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外，我公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吕栋	公司旗下浦银安盛优化收益债券基金、浦银安盛货币基金以及浦银安盛日日盈货币基金基金经理	2014年3月25日	—	8	吕栋先生，复旦大学理学学士、麻省理工大学-斯隆商学院金融学硕士。2006年8月到2010年6月，先后在瑞银集团（UBS）旗下Dillon Read 对冲基金及瑞银集团(UBS)固定收益部任分析员。2011年6月，加盟花旗集团（香港）任投资银行部分析员。2011年11月起加盟浦银安盛基金管理公司担任专户投资经理助理。2013年7月起，调任至公司固定收益投资

					部工作。2013年9月起担任浦银安盛优化收益债券基金基金经理。2014年1月起兼任浦银安盛货币基金基金经理。2014年3月起兼任浦银安盛日日盈货币基金基金经理。
康佳燕	公司旗下浦银安盛货币基金以及浦银安盛日日盈货币基金基金经理	2014年7月21日	—	8	康佳燕女士，香港大学工商管理硕士。2005年6月至2007年5月，先后就职于金盛人寿保险公司、泰信基金管理公司从事基金会计工作。2007年6月加盟浦银安盛基金管理有限公司，先后在基金会计部、交易部、固定收益部从事基金估值、债券交易、固定收益投资工作。2013年12月起在专户管理部担任固定收益投资经理。2014年6月起担任浦银安盛货币基金基金经理。2014年7月起，兼任浦银安盛日日盈货币基金基金经理。
程鸣	公司旗下货币基金基金经理助理	2014年7月25日	—	3	程鸣女士，复旦大学管理学本科。2011年6月至2014年7月，先后就职于财达证券有限公司、中银国际证券有限公司，从事债券交易工作。2014年7月加盟浦银安盛基金管理有限公司担任货币基金经理助理。
丁进	本基金前任基	2014年3月25日	2014年7月24日	9	丁进先生，北京化工大学应用数学专业理学硕士。

	金经理 助理			2005年7月至2010年10月期间，先后在北京顺泽锋投资咨询公司、新华信国际信息咨询公司从事交易模型开发研究、企业信用分析等工作，2010年10月起，在光大证券担任固定收益分析师，从事债券研究、信用产品以及可转债研究。2012年8月加盟浦银安盛基金公司，担任固定收益基金经理助理。
--	-----------	--	--	---

注：1、吕栋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。

2、其他人员的任职日期为公司决定的聘任日期。

3、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

本基金管理人根据《公平交易管理规定》，建立并健全了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；另一方面是公司公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查，并对发现的问题进行及时的报告。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年中国经济保持低位运行，通胀长期维持在较低水平，疲软的基本面为2014年债券市场的走牛打下了基础。在基本面、资金面、政策面多重利好的刺激下，2014年债券市场走出了一轮大牛市，债券市场收益率大幅下行。利率债方面，短端政策性金融债收益率下行幅度接近150bp。信用债方面，短融收益率下行幅度近150BP，1年期AAA品

种收益率从近6.2%回到4.7%附近。2014年债券市场稳步下行，鲜有波折，11月份受中登黑天鹅事件的影响，债券市场出现过短暂调整，随后又重归下行通道。2014年度，本基金均衡配置了信用债和同业存款，信用债以中高等级为主，同业存款注重期限匹配，在保持组合流动性的基础上实现了较好的收益。

#### 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3.3388%，B类净值收益率为3.5318%，同期业绩比较基准收益率为0.2708%；D类净值收益率为2.5022%，同期业绩比较基准收益率为0.2035%。

#### 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2015年，中国经济难言乐观。从内部看，2015年中国经济增速继续保持低位，通缩压力开始出现，短时间内经济难有起色。从外部看，受美国货币政策调整影响，2015年中国面临资金外流压力，基础货币存在明显缺口，需要央行采用结构性货币工具进行对冲。我们认为2015年基本面将会是“低增长、低通胀、宽货币”的组合，这无疑有利于债券市场的继续走牛。而且从估值的角度来看，经过近段时间的调整，债券市场收益率再次回到了一个具有吸引力的水平。有利的基本面组合加上有吸引力的收益率水平将有助于延续债券市场的牛市行情。

#### 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。2014年，合规风控工作仍然是对公司进行全面风险管理，积极配合公司前台业务的完善一线风险管控工作，并协调、监督全公司和投资组合的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险及内部控制工作。

##### 1、 进一步健全合规风控团队，提高团队的专业素养

2014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，合规风控团队也不断加强自身专业素质的提升，强化全面专业素质，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、共同提高、自然和谐的良好局面。

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

##### 2、 进一步建立健全风险控制体系

###### (1) 对投资组合进行定期业绩归因分析和风险评估

合规风控部进一步完善了每日、每周、每月的风险评估。初步建立了较为完整、及时的量化的预警风险评估体系。

(2) 推动兼职风控员方案实施

2014年,积极推动试行了兼职风控员方案,在各业务部门中指定员工担任兼职风控员,在合规风控部的业务指导和部门负责人的行政领导下,开展和协助部分合规风控工作。一方面提高业务部门自身的自我合规风控能力,一方面提高部门内与合规风控相关常规事项的咨询和决策效率,从而提升公司整体风险控制水平和风险政策贯彻力度。

(3) 对公司新产品提供高效、有力的支持

2014年,公司新发行了7只专户产品,4只公募基金。合规风控部与投资团队、产品团队、运营团队合作,就各产品的流动性风险、市场风险、信用风险等方面进行分析,制定相应的风险控制措施和投资控制指标。

(4) 进一步完善子公司内部控制体系

2014年年底,初步建立了子公司多层次的内部控制体系:

业务部门的一线风险控制。子公司设金融市场部和运营管理部两大业务部门,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。管理层下设项目评审及决策委员会以及风险控制委员会,采取集体决策制,管理和监督各个部门和各项业务进行,以确保子公司运作在有效的控制下。管理层对内部控制制度的有效执行承担责任;

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

母公司及其董事会通过稽核检查、审阅报告、参与会议等方式监督子公司内部控制和风险控制情况。

2014年,子公司建立了较为完整的通道类业务的内控制度体系和法律合规框架,使通道业务在规范中进行发展。

(5) 协助人力资源部完善了合规风控考核体系

2014年,公司加大了对各部门、各岗位的风险事件考核力度,依照重大、高、中、低四个不同等级风险事件,同时结合是否自动及时上报、是否受外界因素影响等因素进行考核,初步做到责任明确、落实到人。

3、 稽核工作

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

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

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

2014年实施的专项稽核包括：

- (1) 完成对上年度反洗钱工作的内部稽核和反洗钱自评估工作；
- (2) 根据监管部门统一部署，对公司各方面进行了全面自查工作；
- (3) 根据监管部门要求，对公司非法集资风险进行了排查；
- (4) 根据监管部门的监管通报内容，对照公司实际业务开展情况进行了自查；
- (5) 根据监管部门要求，对从业人员违规买卖股票行为进行了自查。

总体来说，2014年度由于人员配备的原因，稽核工作的深度及广度还有待进一步提高。本报告期内，相关人员已招聘到位，未来将着重加强各部门制度执行及操作风险的稽核工作，不断深化和提高稽核工作的开展情况。

#### 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，力求公司对外材料的合法合规性；
- (2) 2014年，与公司专业法律顾问一起，对公司发行的基金和专户产品法律文件的合法合规性进行了全面审核；
- (3) 对一级市场数百个证券的申购，从关联交易角度进行合法合规性审核，未出现在一级市场投资与公司存在禁止关联交易的关联关系公司发行证券的情形。

#### 5、 信息披露和文件报送

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

信息披露工作是一项繁杂的事物性工作，需要信息披露负责人耐心、细致、认真的

工作态度和较强的协调能力，不仅涉及到披露的格式，还涉及披露的内容，以及整理、审阅和报送等。该项工作虽然占据了合规风控团队很多时间，但由于团队成员的工作认真、仔细，所有的披露均做到了及时、准确，基本未出现重大迟披、漏披、延披、错披的情形。

2014年，按时按质完成基金定期报告（月报、季报、半年报、年报、监察稽核报告）和招募说明书更新的提示及合规审核工作，并协助业务部门对重大事件临时报告、临时公告进行编制，及时进行合规审核，并安排公告的披露及上报事宜。2014年全年共审核并安排披露、上报数百份公告及报告，未出现重大迟、漏等现象。

## 6、 法律事务

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

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

## 7、 组织开展合规培训

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

(1) 对于2014年新入司员工分两场进行了入职合规培训，内容包括公司制度流程体系、主要业务法律法规、公司利益冲突管理要求等。对于外地同事，则采取先发送书面培训材料，待其来司时再进行面对面培训的方式；

(2) 由于中国证券业协会每年会安排15小时左右的远程在线合规培训。为避免占用业务人员过多工作时间以及培训内容过多重复，2014全年为业务人员提供了共7场（不含反洗钱合规培训）的专项合规培训；

(3) 对反洗钱领导小组及反洗钱骨干人员开展了2场反洗钱合规培训，共计4小时15人次。

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

与草拟了部分制度，审阅并修改了所有已经颁布的公司基本管理制度和督导和推动公司的制度建设和完善是合规风控团队的重要工作之一。合规风控团队全年推动公司所

有新订、修订制度、流程的工作。

#### 9、 组织进行反洗钱工作

公司反洗钱工作由合规风控团队组织和牵头。全年开展的反洗钱工作包括：（1）完善反洗钱相关制度；（2）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调研

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

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

（2）组织、协调和督导公司的专项自查；

（3）代表公司参与上海基金业同业公会的相关会议。

根据监管机关的要求，公司发生任何问题，都需要及时向监管机关报告，因此，在报告方面，还需要加强和提升，增强与监管机关的沟通。

#### 11、 督导处理投资人的投诉

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

#### 12、 向董事会报告公司经营的合法合规情况

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

#### 13、 与中介机构的协调

合规风控团队负责与律师事务所和审计师事务所的日常工作协调，包括：

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

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

回顾过去的2014年，从董事会、管理层到员工，对合规风控工作都比以前有了更多的重视和理解、支持，合规风控团队与公司各部门的联系日益紧密和协调，这为公司合

规风控风控工作的开展进一步奠定了良好基石。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了浦银安盛基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由公司分管高管、金融工程部负责人、研究部负责人、合规风控部负责人、基金运营部负责人组成。估值委员会成员均具有5年以上专业工作经历，具备良好的专业经验、胜任能力和独立性。估值委员会的职责主要包括：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金基金经理未参与或决定基金的估值。

本基金管理人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、按日结转”的方式，即为投资者每日计算当日收益并分配，每日结转。

本报告期浦银安盛日日盈货币A级基金应分配收益3,235,118.73元，实际分配收益3,235,118.73元；浦银安盛日日盈货币B级基金应分配收益53,396,391.37元，实际分配收益53,396,391.37元，浦银安盛日日盈货币D级基金应分配收益46,193,206.86元，实际分配收益46,193,206.86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、本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
- 2、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2014年度，托管人在浦银安盛日日盈货币市场基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人

应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2014年度，浦银安盛基金管理有限公司在浦银安盛日日盈货币市场基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内向A级份额持有人分配利润：3,235,118.73元，向B级份额持有人分配利润：53,396,391.37元，向D级份额持有人分配利润：46,193,206.86元。

## 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

2014年度，由浦银安盛基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关浦银安盛日日盈货币市场基金的年度报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字（2015）第20457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	浦银安盛日日盈货币市场基金 全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的 浦银安盛日日盈货币市场基金(以下简称"浦银安盛日日盈货币基金")的财务报表，包括2014年12月31日的资产负债表、2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是 浦银安盛日日盈货币基金 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：

	<p>(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;</p> <p>(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。</p>
注册会计师的责任段	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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>
审计意见段	<p>我们认为,上述 浦银安盛日日盈货币基金 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 浦银安盛日日盈货币基金2014年12月31日的财务状况以及2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	薛竞 魏佳亮
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6

	楼
审计报告日期	2015-03-24

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛日日盈货币市场基金

报告截止日：2014年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	1,464,101,733.66
结算备付金		
存出保证金		—
交易性金融资产	7.4.7.2	1,554,010,690.94
其中：股票投资		—
基金投资		—
债券投资		1,554,010,690.94
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	—
应收证券清算款		—
应收利息	7.4.7.5	35,880,007.54
应收股利		—
应收申购款		53,155,122.91
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		3,107,147,555.05
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>

2014年12月31日		
<b>负 债:</b>		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债		—
卖出回购金融资产款		17,099,854.35
应付证券清算款		—
应付赎回款		11,905.62
应付管理人报酬		953,890.86
应付托管费		289,057.83
应付销售服务费		502,057.90
应付交易费用	7.4.7.7	39,190.98
应交税费		—
应付利息		4,314.28
应付利润		373,318.65
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	300,071.42
负债合计		19,573,661.89
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	3,087,573,893.16
未分配利润	7.4.7.10	—
所有者权益合计		3,087,573,893.16
负债和所有者权益总计		3,107,147,555.05

注：1、本财务报表的实际编制期间自2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间。

2、报告截止日2014年12月31日，基金份额净值1.000元，基金份额总额3,087,573,893.16份。其中浦银安盛日日盈货币A级的基金份额为35,380,704.66份，浦银安盛日日盈货币B级的基金份额为1,063,879,978.23份，浦银安盛日日盈货币D级的基金份额为1,988,313,210.27份。

3、本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，至报告期末，合同成立未满一年。

4、本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

## 7.2 利润表

会计主体：浦银安盛日日盈货币市场基金

本报告期：2014年3月25日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014年3月25日至2014年12月31日
<b>一、收入</b>		119,587,230.56
1.利息收入		108,200,767.66
其中：存款利息收入	7.4.7.11	63,781,995.47
债券利息收入		39,104,036.80
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		5,314,735.39
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,386,462.90
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	11,386,462.90
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	—
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）		—
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5.其他收入（损失以“-”号填列）		—
<b>减：二、费用</b>		16,762,513.60
1. 管理人报酬		7,776,733.64
2. 托管费		2,356,585.88

3. 销售服务费		3,101,772.18
4. 交易费用		—
5. 利息支出		3,196,220.95
其中：卖出回购金融资产支出		3,196,220.95
6. 其他费用	7.4.7.17	331,200.95
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		102,824,716.96
减：所得税费用		—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		102,824,716.96

注：1、本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，至报告期末，合同成立未满一年。

2、本基金《基金合同》生效日为2014年3月25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：浦银安盛日日盈货币市场基金

本报告期：2014年3月25日至2014年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2014年3月25日至2014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)	2,030,603,326.51	—	2,030,603,326.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		102,824,716.96	102,824,716.96
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)	1,056,970,566.65	—	1,056,970,566.65
其中：1.基金申购款	17,686,295,117.26	—	17,686,295,117.26
2.基金赎回款	-16,629,324,550.61	—	-16,629,324,550.61
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)	—	-102,824,716.96	-102,824,716.96

五、期末所有者权益(基金净值)	3,087,573,893.16	—	3,087,573,893.16
-----------------	------------------	---	------------------

注：1、本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，至报告期末，合同成立未满一年。

2、本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

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

浦银安盛日日盈货币市场基金(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[2014]228号文《关于核准浦银安盛日日盈货币市场基金募集的批复》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《浦银安盛日日盈货币市场基金基金合同》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2,030,248,334.26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(2014)第154号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《浦银安盛日日盈货币市场基金基金合同》于2014年3月25日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,030,603,326.51份，其中认购资金利息折合354,992.25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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《浦银安盛日日盈货币市场基金基金合同》和《浦银安盛日日盈货币市场基金招募说明书》的规定，根据投资人持有基金份额的数量等的不同，浦银安盛日日盈基金分别设置不同类别的基金份额，每类基金份额按照不同的费率计提费用，形成A类和B类两类基金份额。本基金管理人自2014年5月30日起为指定的特定销售渠道增加本基金的D类基金份额。该类份额仅能通过特定销售渠道办理申购、赎回等业务，该类份额不适用基金份额自动升降级机制。本基金各类基金份额按照不同的费率计提费用，分别公布每万份基金已实现收益和7日年化收益率。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛日日盈货币市场基金基金合同》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、资产支持证券、中期票据，以及中国证监会及中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。本基金业绩比较基准为活期存款利率(税后)。

## 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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《浦银安盛日日盈货币市场基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日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2014年12月31日的财务状况以及2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日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2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

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，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含的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的相关交易费用计入初始确认金额。

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，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。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

为了避免债券投资的账面价值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。每份基金份额面值为1.00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类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 7.4.4.8 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。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值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则按直线法计算。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 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。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值1.00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收益科目，同时以红利再投资方式进行支付。

#### 7.4.4.11 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。

#### **7.4.4.12 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**

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号--公允价值计量》、《企业会计准则第40号--合营安排》、《企业会计准则第41号--在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号--长期股权投资》、《企业会计准则第9号--职工薪酬》、《企业会计准则第30号--财务报表列报》、《企业会计准则第33号--合并财务报表》以及《企业会计准则第37号--金融工具列报》，要求除《企业会计准则第37号--金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外，其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

##### **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[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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 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。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。
- (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。

## 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 2014年12月31日
活期存款	6,601,733.66
定期存款	1,457,500,000.00
其中：存款期限1-3个月	1,139,500,000.00
存款期限1个月以内	168,000,000.00
存款期限3个月以上	150,000,000.00
其他存款	—
合计	1,464,101,733.66

注：1、定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

2、本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2014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	1,554,010,690.9 4	1,554,473,700.0 0	463,009.06	0.0150
	合计	1,554,010,690.9 4	1,554,473,700.0 0	463,009.06	0.0150

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。

3、本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

### 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。本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

**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**

本基金在本报告期末未持有买入返售金融资产。本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末2014年12月31日
应收活期存款利息	311.08
应收定期存款利息	6,484,336.38
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	0.06
应收债券利息	29,395,360.02
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	—
合计	35,880,007.54

注：本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

**7.4.7.6 其他资产**

本基金在本报告期末未持有其他资产。本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末2014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	39,190.98
合计	39,190.98

注：本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	71.42
审计费	60,000.00
预提信息披露费用	240,000.00
合计	300,071.42

注：本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目(浦银安盛日日盈货币A)	2014年3月25日（基金合同生效日）至2014年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	809,224,203.79	809,224,203.79
本期申购	462,293,647.21	462,293,647.21
本期赎回（以“-”号填列）	-1,236,137,146.34	-1,236,137,146.34
本期末	35,380,704.66	35,380,704.66

金额单位：人民币元

项目(浦银安盛日日盈货币B)	2014年3月25日（基金合同生效日）至2014年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,221,379,122.72	1,221,379,122.72
本期申购	5,130,122,246.22	5,130,122,246.22
本期赎回（以“-”号填列）	-5,287,621,390.71	-5,287,621,390.71
本期末	1,063,879,978.23	1,063,879,978.23

金额单位：人民币元

项目(浦银安盛日日盈货币D)	2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	—	—
本期申购	12,093,879,223.83	12,093,879,223.83
本期赎回(以“-”号填列)	-10,105,566,013.56	-10,105,566,013.56
本期末	1,988,313,210.27	1,988,313,210.27

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2014年3月13日至2014年3月21日止期间公开发售，共募集有效净认购资金2,030,248,334.26元。根据《浦银安盛日日盈货币市场基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入354,992.25元在本基金成立后，折算为354,992.25份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3、根据《浦银安盛日日盈货币市场基金招募说明书》的相关规定，本基金于2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年3月27日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购、赎回及在公司直销柜台和电子直销平台转换及定期定额投资业务自2014年3月28日起开始办理。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目 (浦银安盛日日盈 货币A)	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	3,235,118.73	—	3,235,118.73
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	-3,235,118.73	—	-3,235,118.73
本期末	—	—	—

单位：人民币元

项目 (浦银安盛日日盈)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
-----------------	-------	-------	---------

货币B)			
上年度末	—	—	—
本期利润	53,396,391.37	—	53,396,391.37
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	-53,396,391.37	—	-53,396,391.37
本期末	—	—	—

单位：人民币元

项目 (浦银安盛日日盈 货币D)	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	46,193,206.86	—	46,193,206.86
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	-46,193,206.86	—	-46,193,206.86
本期末	—	—	—

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年3月25日至2014年12月31日
活期存款利息收入	75,829.24
定期存款利息收入	63,447,517.37
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	258,648.86
其他	—

合计	63,781,995.47
----	---------------

注：本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 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 2014年3月25日至2014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	11,386,462.90
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	11,386,462.90

注：本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

##### 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 2014年3月25日至2014年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到 期兑付)成交总额	4,535,779,594.13
减：卖出债券(、债转股及债 券到期兑付)成本总额	4,449,828,243.54
减：应收利息总额	74,564,887.69
买卖债券差价收入	11,386,462.90

注：本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

**7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

**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**

本基金本报告期末无贵金属投资收益。本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期末无贵金属投资收益。本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期末无贵金属投资收益。本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期末无贵金属投资收益。本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期末无衍生工具收益--买卖权证差价收入。本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

**7.4.7.16 股利收益**

本基金本报告期内无股利收益。本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

**7.4.7.17 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月25日至2014年12月31日
审计费用	60,000.00

信息披露费	240,000.00
银行费用	15,300.95
中债登债券托管帐户服务费	7,500.00
上清所债券托管账户维护费	7,500.00
其他	900.00
合计	331,200.95

注：本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

## 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

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，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
法国安盛投资管理有限公司	基金管理人的股东
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人、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
上海国盛集团资产有限公司	基金管理人的股东
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、基金代销机构
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
上海盛融投资有限公司	基金管理人的原股东

注：1、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。

2、本报告期内，根据上海市政府的要求，经上海国盛（集团）有限公司批准，本基金管理人原股东上海盛融投资有限公司（以下简称"上海盛融"）由其母公司上海国盛集团资产有限公司（以下简称"上海国盛"）吸收合并，上海盛融持有的本基金管理人10%的股权由上海国盛承继，本基金管理人股东因此由上海盛融变更为上海国盛。本基金管理人正在就此事项履行相关工商变更手续。

## 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 应支付关联方的佣金**

本基金在本报告期无应支付关联方的佣金。本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

**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 2014年3月25日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,776,733.64
其中：支付销售机构的客户维护费	1,684,676.41

注：1、本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

2、在通常情况下，基金管理费按前一日的基金资产净值的0.33%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月25日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,356,585.88

注：1、本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

2、在通常情况下，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

**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 2014年3月25日至2014年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	浦银安盛日日盈货币A	浦银安盛日日盈货币B	浦银安盛日日盈货币D	合计
交通银行股份有限公司	82,165.32	3,994.60	—	86,159.92
浦银安盛基金管理有限公司	17,734.53	93,423.86	—	111,158.39
上海浦东发展银行股份有限公司	41,000.23	2,047.86	2,793,909.04	2,836,957.13
合计	140,900.08	99,466.32	2,793,909.04	3,034,275.44

注：本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给浦银安盛基金管理有限公司，再由浦银安盛基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A/D类基金份额和B类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%和0.01%。对于由B类降级为A类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额持有人的费率；对于由A类升级为B类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其达到B类条件的开放日后的下一个工作日起享受B类基金份额持有人的费率。销售服务费的计算公式为：

日A类基金份额销售服务费 = 前一日A类基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

日D类基金份额销售服务费 = 前一日D类基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

日B类基金份额销售服务费 = 前一日B类基金资产净值 × 0.01% / 当年天数。

#### 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

本基金在本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金《基金合同》生效日为2014年3月25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

基金管理人在本报告期末持有本基金。本基金《基金合同》生效日为2014年3月25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

份额单位：人民币元

关联方名称		本期末 2014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
浦银 安盛 日日 盈货 币B	上海浦银安盛资产管 理有限公司	9,088,934.87	0.85%

注：本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

#### 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 2014年3月25日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	6,601,733.66	75,829.24

注：1、本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金《基金合同》生效日为2014年3月25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2014年3月25日，无上年度可比期间。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期无其他关联交易事项。本基金《基金合同》生效日为2014年3月25日，无上年度可比期间。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金 (浦银安盛日日盈 货币A)	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

3,230,922.79	—	4,195.94	3,235,118.73	
已按再投资形式转 实收基金 (浦银安盛日日盈 货币B)	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
53,263,153.95	—	133,237.42	53,396,391.37	
已按再投资形式转 实收基金 (浦银安盛日日盈 货币D)	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
45,957,321.57	—	235,885.29	46,193,206.86	

注：本基金在本年度累计分配收益102,824,716.96元，其中以红利再投资方式结转入实收基金102,451,398.31元(附注7.4.7.9)，计入应付收益科目373,318.65元。

#### 7.4.12 期末（2014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

本基金在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

截至本报告期末2014年12月31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人民币17,099,854.35元，是以如下债券作为质押：

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
041473007	14天富 CP001	2015-01-06	99.97	180000	17,994,600.00
合计				180,000.00	17,994,600.00

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末2014年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的

卖出回购证券款余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

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。本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，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、资产支持证券、中期票据，以及中国证监会及中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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、合规风控部的风险管理；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，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。公司设立合规风控部，独立地监控公司面临的各类风险。合规风控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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，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。

#### 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 2014年12月31日
A-1	984,052,557.61
A-1以下	—
未评级	569,958,133.33
合计	1,554,010,690.94

注：持有发行期限在一年以内（含）的债券按其债项评级作为短期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为长期信用评级进行列示。本基金持有的未评级的债券均为政策性金融债或超短期融资券，且本基金成立于2014年3月25日。

#### 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%。于2014年12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有17,099,854.35元最晚将在2015年1月6日到期且计息(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。

#### 7.4.13.4 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2014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	1,464,101,733.66		—	—	1,464,101,733.66
结算备付金	—		—	—	—
存出保证金	—		—	—	—
证券清算款	—		—	—	—

交易性金融资产	1,554,010,690.94		—	—	1,554,010,690.94
买入返售金融资产	—		—	—	—
应收股利	—		—	—	—
应收利息	—		—	35,880,007.54	35,880,007.54
应收申购款	—		—	53,155,122.91	53,155,122.91
其他应收款	—		—	—	—
待摊费用	—		—	—	—
其他资产	—		—	—	—
资产总计	3,018,112,424.60	—	—	89,035,130.45	3,107,147,555.05
负债					
卖出回购金融资产款	17,099,854.35		—	—	17,099,854.35
应付证券清算款	—		—	—	—
应付赎回款	—		—	11,905.62	11,905.62
应付赎回费	—		—	71.42	71.42
应付管理人报酬	—		—	953,890.86	953,890.86
应付托管费	—		—	289,057.83	289,057.83
应付销售服务费	—		—	502,057.90	502,057.90
应付交易费用	—		—	39,190.98	39,190.98
应交税费	—		—	—	—
应付利息	—		—	4,314.28	4,314.28
应付收益	—		—	373,318.65	373,318.65
其他应付款	—		—	—	—
预提费用	—		—	300,000.00	300,000.00

其他负债	—	—	—	—
负债总计	17,099,854.35	—	—	2,473,807.54
利率敏感度缺口	3,001,012,570.25	—	—	86,561,322.91
				3,087,573,893.16

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。本基金成立于2014年3月25日。

#### 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2014年12月31日
	市场利率上升0.25%	-1,952,492.75
	市场利率下降0.25%	1,958,479.92

注：本基金成立于2014年3月25日。

#### 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；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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	—	—
交易性金融资产-基金投资	—	—
交易性金融资产-债券投资	1,554,010,690.94	50.33
交易性金融资产-贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	1,554,010,690.94	50.33

注：本基金成立于2014年3月25日。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于2014年12月31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%，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。本基金成立于2014年3月25日。

#### 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2014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工具中属于第二层次的余额为1,554,010,690.94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2014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) 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	1,554,010,690.94	50.01
	其中：债券	1,554,010,690.94	50.01
	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	1,464,101,733.66	47.12
4	其他各项资产	89,035,130.45	2.87
5	合计	3,107,147,555.05	100.00

## 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	4.49	
	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	17,099,854.35	0.55
	其中：买断式回购融资	—	—

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。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金在报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 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	119
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	122
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限（天数）	原因	调整期
1	2014-05-13	121	赎回	1个交易日
2	2014-11-05	122	赎回	1个交易日

注：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。

### 8.3.2 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	28.05	0.55
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	11.99	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	11.95	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—180天	18.47	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	180天(含)—397天(含)	27.29	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	97.75	0.55

#### 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	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	190,108,835.94	6.16
	其中：政策性金融债	180,109,298.25	5.83
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	1,363,901,855.00	44.17
6	中期票据	—	—
7	其他	—	—

8	合计	1,554,010,690.94	50.33
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

### 8.5 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	140204	14国开04	1,000,000	100,050,736.67	3.24
2	0114810 04	14淮南矿 SCP004	1,000,000	99,992,470.71	3.24
3	140207	14国开07	800,000	80,058,561.58	2.59
4	0414600 15	14永泰能源 CP001	500,000	50,210,940.52	1.63
5	0414560 43	14川高速 CP001	500,000	50,118,602.49	1.62
6	0414510 43	14大族CP001	500,000	50,004,343.21	1.62
7	0114810 06	14淮南矿 SCP006	500,000	49,987,446.22	1.62
8	0114710 05	14皖高速 SCP005	500,000	49,984,918.72	1.62
9	0414540 73	14河钢CP002	500,000	49,983,684.69	1.62
10	0114740 04	14陕煤化 SCP004	500,000	49,978,049.44	1.62

### 8.6 “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	14
报告期内偏离度的最高值	0.3260
报告期内偏离度的最低值	-0.0924
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1060

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

## 8.8 投资组合报告附注

### 8.8.1 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。

**8.8.2 本报告期内本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。**

**8.8.3 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。**

### 8.8.4 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	35,880,007.54
4	应收申购款	53,155,122.91
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	89,035,130.45

## §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	持有人户数	户均持有的	持有人结构
----	-------	-------	-------

级别	(户)	基金份额	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
浦银安盛日日盈货币A	5,570	6,352.01	988,920.44	2.80%	34,391,784.22	97.20%
浦银安盛日日盈货币B	17	62,581,175.19	1,031,934,918.97	97.00%	31,945,059.26	3.00%
浦银安盛日日盈货币D	130,450	15,241.96	568,744.48	0.03%	1,987,744,465.79	99.97%
合计	136,037	22,696.57	1,033,492,583.89	33.47%	2,054,081,309.27	66.53%

## 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	浦银安盛日日盈货币A	270,634.49	0.765%
	浦银安盛日日盈货币B	2,078,048.31	0.195%
	浦银安盛日日盈货币D	1,492,850.58	0.075%
	合计	3,841,533.38	0.124%

## 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	浦银安盛日	0

资和研究部门负责人持有本 开放式基金	日盈货币A	
	浦银安盛日 日盈货币B	>100
	浦银安盛日 日盈货币D	50~100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放 式基金	浦银安盛日 日盈货币A	0
	浦银安盛日 日盈货币B	0
	浦银安盛日 日盈货币D	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银安盛日日 盈货币A	浦银安盛日日 盈货币B	浦银安盛日日 盈货币D
基金合同生效日(2014年3月25 日)基金份额总额	809,224,203.79	1,221,379,122.7 2	—
基金合同生效日起至报告期期末 基金总申购份额	462,293,647.21	5,130,122,246.2 2	12,093,879,223. 83
减：基金合同生效日起至报告期 期末基金总赎回份额	1,236,137,146.3 4	5,287,621,390.7 1	10,105,566,013. 56
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	35,380,704.66	1,063,879,978.2 3	1,988,313,210.2 7

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

1、经基金管理人2014年第二次股东会会议审议通过，选举产生第三届董事会成员，相较第二届董事会成员，新增霍佳震先生、董叶顺先生为基金管理人独立董事，新增汪素南先生为基金管理人董事，原董事林道峰先生、独立董事谢百三先生不再连任。

2、经2014年度第三次股东会会议审议通过，章曦先生不再担任基金管理人董事职务，选举金杰先生接替章曦先生出任基金管理人第三届董事会董事。

3、报告期内基金托管人的专门基金托管部门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60,000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1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。报告期内中国证监会上海监管局对公司进行了常规全面现场检查，并于报告期后提出相应整改意见及监管措施决定书。公司将以此次现场检查为契机，进一步提升公司整体内控水平，通过构建完善的风险管理和合规管理体系，推动公司向现代资产管理机构的转型。本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名	交易单	债券交易	债券回购交易	应支付该券商的佣	备
-----	-----	------	--------	----------	---

称	元 数量					金		注
		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	佣金	占当期 佣金 总量的 比例	
招商证 券	2	—	—	2,712,40 0,000.00	100.00 %	—	—	
中信建 投	1		—	—	—		—	
东兴证 券	1		—	—	—		—	
平安证 券	1		—	—	—		—	
宏源证 券	1		—	—	—		—	
浙商证 券	2		—	—	—		—	
长江证 券	1		—	—	—		—	
中信证 券	1		—	—	—		—	
广发证 券	1		—	—	—		—	
东北证 券	1		—	—	—		—	
爱建证 券	1		—	—	—		—	
川财证 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：

本基金本报告期新增东兴证券、招商证券、爱建证券、中信建投、浙商证券、长江证券、东北证券、中信证券、川财证券、广发证券、平安证券和宏源证券交易单元。

### 11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

注：本基金本报告期内未发生偏离度绝对值超过0.5%的情况。

### 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	浦银安盛日日盈货币市场基金招募说明书	报刊及公司网站	2014-03-10
2	浦银安盛日日盈货币市场基金托管协议	公司网站	2014-03-10
3	浦银安盛日日盈货币市场基金基金合同内容摘要	报刊及公司网站	2014-03-10
4	浦银安盛日日盈货币市场基金基金份额发售公告	报刊及公司网站	2014-03-10
5	浦银安盛日日盈货币市场基金基金合同	公司网站	2014-03-10
6	关于新增中信万通和中信证券（浙江）为浦银安盛日日盈货币市场基金代销机构的公告	报刊及公司网站	2014-03-18
7	浦银安盛日日盈货币市场基金开放日常申购、赎回及在公司直销柜台和电子直销平台开通转换及定期定额投资业务公告	报刊及公司网站	2014-03-26

8	浦银安盛日日盈货币市场基金基金合同生效公告	报刊及公司网站	2014-03-26
9	浦银安盛日日盈货币基金在交通银行推出定期定额投资和基金转换业务的公告	报刊及公司网站	2014-03-27
10	关于浦银安盛日日盈货币市场基金在浦发银行推出定期定额投资业务的公告	报刊及公司网站	2014-03-27
11	关于浦银日日盈货币基金于清明假期前两个工作日暂停申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及公司网站	2014-04-01
12	关于浦银消费基金和浦银日日盈货币基金在浦发银行开通基金转换业务的公告	报刊及公司网站	2014-04-04
13	关于新增上海证券为浦银安盛日日盈货币基金代销机构的公告	报刊及公司网站	2014-04-09
14	关于浦银安盛日日盈货币市场基金在部分代销机构推出定期定额投资业务的公告	报刊及公司网站	2014-04-10
15	关于新增海通证券为浦银安盛旗下部分基金代销机构的公告	报刊及公司网站	2014-04-15
16	关于电子直销平台开通“现金宝”业务的公告	报刊及公司网站	2014-04-17
17	关于浦银安盛日日盈货币市场基金于五一假期前两个工作日暂停申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及公司网站	2014-04-24
18	浦银安盛基金管理有限公司关于董事会换届的公告	报刊及公司网站	2014-04-25
19	关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2014-04-26
20	关于新增华福证券为浦银安盛日日盈货币基金代销机构的公告	报刊及公司网站	2014-04-28

21	关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2014-04-29
22	关于浦银安盛日日盈货币市场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	报刊及公司网站	2014-05-26
23	浦银安盛日日盈货币市场基金招募说明书（增加D类份额）	公司网站	2014-05-28
24	关于浦银安盛日日盈货币市场基金增加基金份额类别的公告	报刊及公司网站	2014-05-28
25	浦银安盛关于旗下部分基金新增北京恒天明泽基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2014-06-07
26	关于旗下部分基金新增东北证券股份有限公司为代销机构并开通定投业务的公告	报刊及公司网站	2014-06-10
27	关于新增华夏银行为浦银安盛日日盈货币基金A类及B类基金份额代销机构的公告	报刊及公司网站	2014-07-14
28	浦银安盛日日盈货币市场基金2014年第2季度报告(全文)	报刊及公司网站	2014-07-19
29	关于浦银安盛日日盈货币市场基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）公告	报刊及公司网站	2014-07-21
30	浦银安盛日日盈货币市场基金基金经理变更公告	报刊及公司网站	2014-07-22
31	浦银安盛关于旗下部分基金新增广州证券为代销机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2014-07-25
32	关于旗下部分基金新增北京钱景财富投资管理有限公司为代销机	报刊及公司网站	2014-08-19

	构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告		
33	浦银安盛日日盈货币市场基金2014年半年度报告（正文）	公司网站	2014-08-26
34	浦银安盛日日盈货币市场基金2014年半年度报告摘要	报刊及公司网站	2014-08-26
35	关于浦银安盛日日盈货币市场基金于中秋节假期前两个工作日暂停A类、B类份额申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及公司网站	2014-09-02
36	关于浦银日日盈货币基金于国庆节假期前两个工作日暂停A类、B类份额申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及公司网站	2014-09-25
37	关于浦银新经济结构基金和浦银盛世精选基金在交通银行开通基金转换业务的公告	报刊及公司网站	2014-09-26
38	关于浦银新经济结构基金和浦银盛世精选基金在浦发银行开通基金转换业务的公告	报刊及公司网站	2014-09-26
39	浦银安盛日日盈货币市场基金2014年第3季度报告（全文）	报刊及公司网站	2014-10-24
40	浦银安盛日日盈货币市场基金招募说明书更新正文（2014年第1号）	公司网站	2014-11-07
41	浦银安盛日日盈货币市场基金招募说明书更新摘要（2014年第1号）	报刊及公司网站	2014-11-07
42	关于新增“银联通”部分银行卡电子直销业务功能及费率优惠的公告	报刊及公司网站	2014-12-18
43	关于旗下基金持有的交易所债券估值方法调整的公告	报刊及公司网站	2014-12-19

44	关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2014-12-23
45	关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2014-12-24
46	关于浦银安盛日日盈货币市场基金于元旦假期前两个工作日暂停A类及B类份额申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及公司网站	2014-12-26

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于2014年1月4日发布《关于增加注册资本及修改公司章程的公告》，披露基金管理人注册资本增至28,000万元人民币并据此修改了公司章程。

2、本基金管理人于2015年2月11日发布公告，本基金基金经理之一吕栋先生因个人原因离职不再担任本基金基金经理，本基金由本基金另一位基金经理薛铮先生继续管理。上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会办理完毕基金经理注销手续。吕栋先生的免职材料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日日盈货币市场基金设立的文件
- 2、浦银安盛日日盈货币市场基金基金合同
- 3、浦银安盛日日盈货币市场基金招募说明书
- 4、浦银安盛日日盈货币市场基金托管协议
- 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](http://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

二〇一五年三月二十六日