

浦银安盛货币市场证券投资基金 2016 年 第 2 季度报告

2016 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：2016 年 7 月 21 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2016 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛货币		
基金主代码	519509		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011 年 3 月 9 日		
报告期末基金份额总额	1,144,877,069.56 份		
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	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。		
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		
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	浦银安盛货币 E
下属分级基金的交易代码	519509	519510	519516

报告期末下属分级基金的份额总额	226,351,751.99 份	911,164,768.27 份	7,360,549.30 份
-----------------	---------------------	---------------------	-------------------

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年4月1日—2016年6月30日）		
	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B	浦银安盛货币 E
1. 本期已实现收益	952,142.32	5,361,774.79	52,002.16
2. 本期利润	952,142.32	5,361,774.79	52,002.16
3. 期末基金资产净值	226,351,751.99	911,164,768.27	7,360,549.30

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。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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、本基金收益分配按月结转份额。浦银安盛货币市场证券投资基金于2014年9月12日刊登公告，自2014年9月15日起为指定的特定销售渠道增加浦银安盛货币市场证券投资基金E类份额，该类份额仅能通过特定的销售渠道办理申购、赎回等业务。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

浦银安盛货币 A

阶段	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	0.6595%	0.0069%	0.0871%	0.0000%	0.5724%	0.0069%

浦银安盛货币 B

阶段	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	0.7191%	0.0069%	0.0871%	0.0000%	0.6320%	0.0069%

浦银安盛货币 E

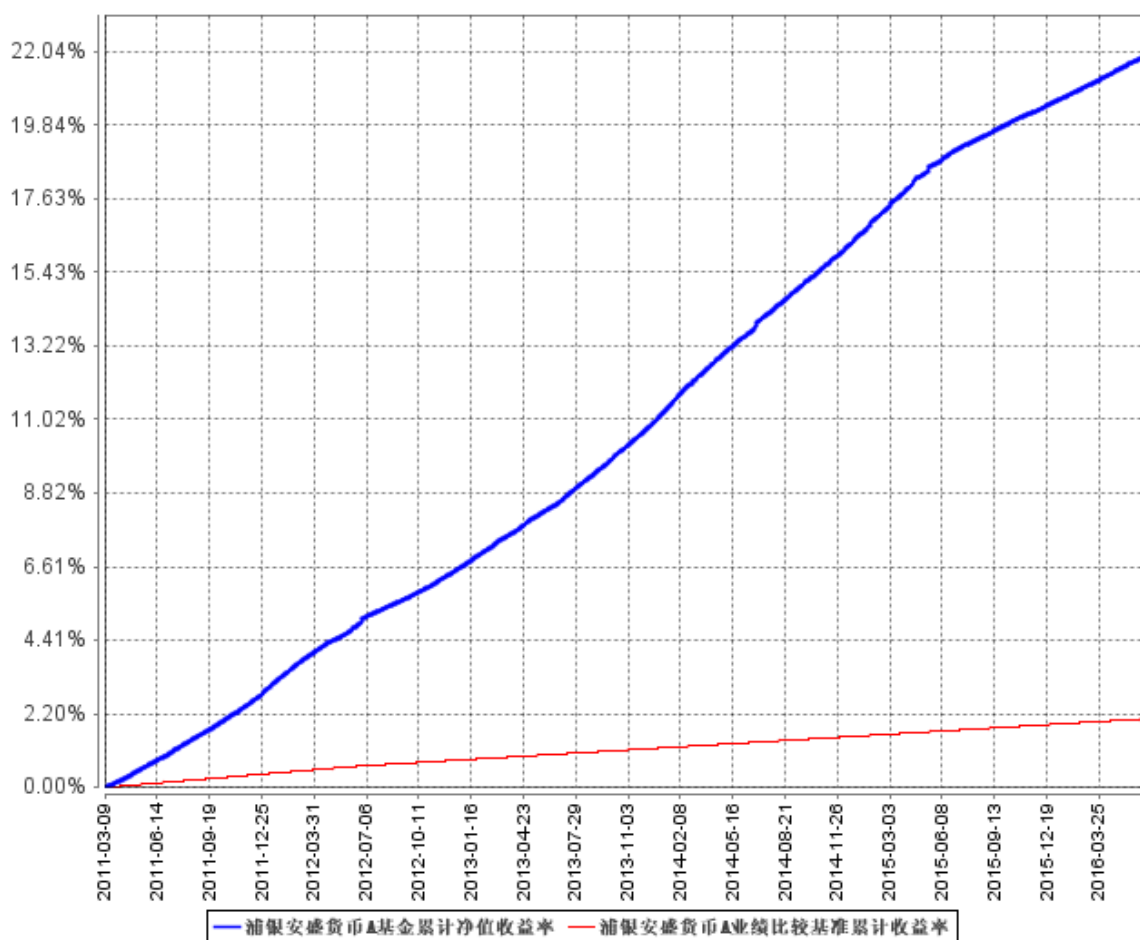
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.7191%	0.0069%	0.0871%	0.0000%	0.6320%	0.0069%

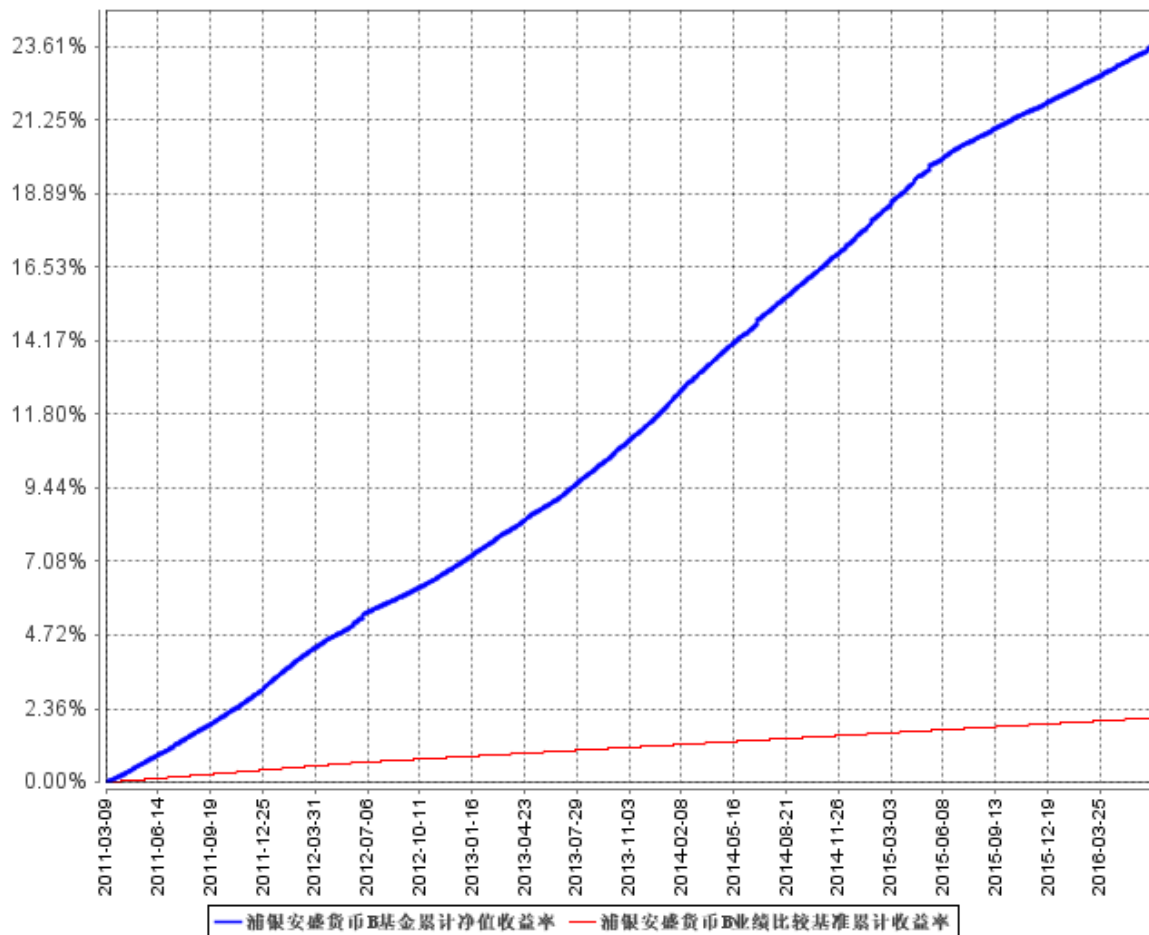
过去三个月	0.6590%	0.0069%	0.0871%	0.0000%	0.5719%	0.0069%
-------	---------	---------	---------	---------	---------	---------

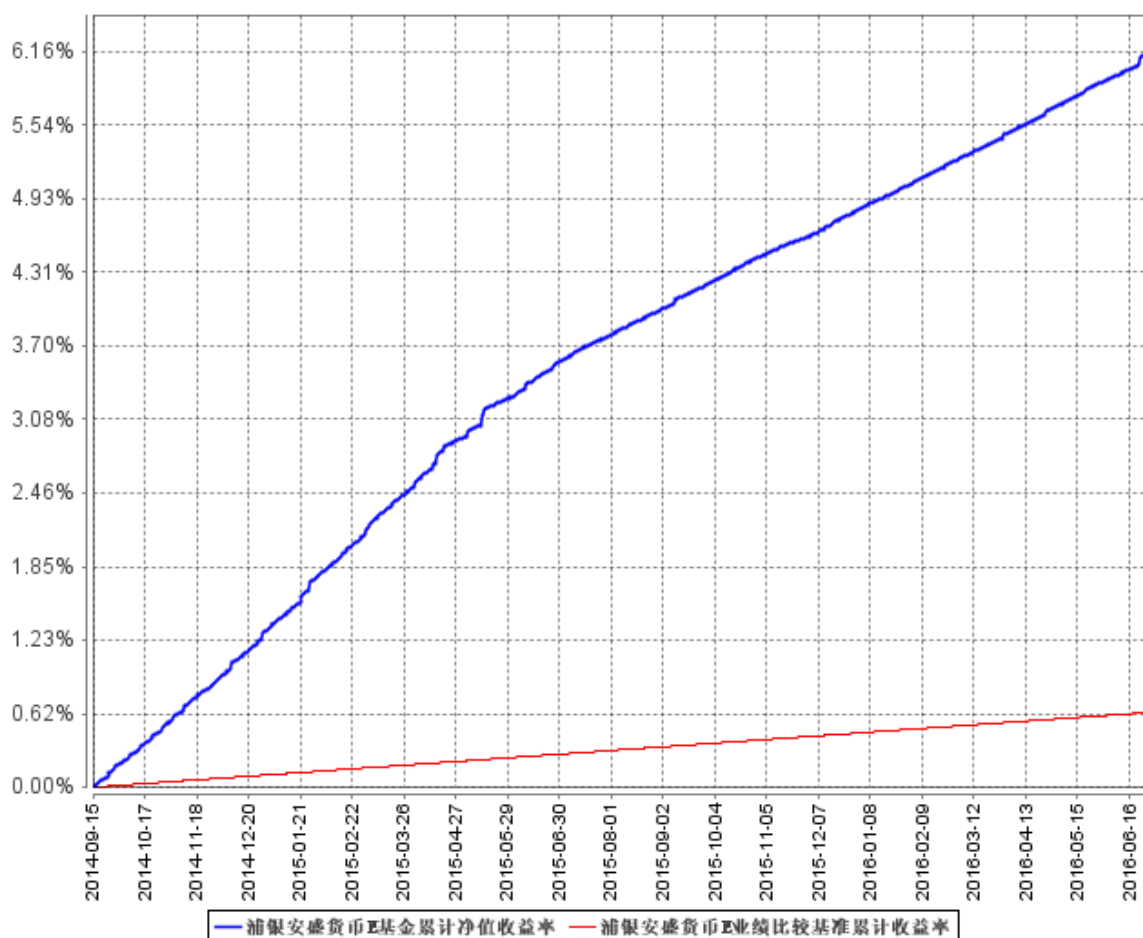
注：1、本基金收益分配按月结转份额。

2、本基金于 2014 年 9 月 15 日开始分为 A、B、E 三类。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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







注：本基金于 2014 年 9 月 15 日开始分为 A、B、E 三类，具体内容详见本基金管理人于 2014 年 9 月 12 日刊登的《关于浦银安盛货币市场证券投资基金增加基金份额类别的公告》。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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		
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 6 月 19 日	-	10	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。
--	--	--	--	--	--

注：1. 此处的任职日期为公司决定的聘任日期。

2. 证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，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，本着诚实信用、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。本报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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 日和 10 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。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2 季度债券市场整体走势先抑后扬。继一季末国企债券信用事件爆发后，4 月份债券收益率呈恐慌性上行，后受美国加息预期降低，一季度经济复苏迹象被证伪等因素影响下，长端债券利率一路回落至 3 月末水平，短端品种受资金利率支撑，下行幅度较小，期限利差收紧，收益率曲线平坦化。另外，信用风险依旧值得关注，2 季度信用利差显著扩大。在报告期内，本基金均衡配置了短融和同业存款，并借力较为宽松的资金面，获取稳定的息差，并择机进行了部分个券的波段操作。

4.5 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 0.6595%，B 类净值收益率为 0.7191%，E 类净值收益率为 0.6590%，同期业绩比较基准收益率为 0.0871%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

- 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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	619,130,187.84	54.00
	其中：债券	619,130,187.84	54.00
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	197,300,855.95	17.21
	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	300,554,354.13	26.21
4	其他资产	29,650,131.09	2.59
5	合计	1,146,635,529.01	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	4.68
	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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例（%）	原因	调整期
1	2016 年 4 月 25 日	35.27	巨额赎回	1 个工作日
2	2016 年 4 月 26 日	35.44	巨额赎回	1 个工作日
3	2016 年 4 月 27 日	35.07	巨额赎回	1 个工作日
4	2016 年 4 月 28 日	22.17	巨额赎回	1 个工作日

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	93
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	103
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	66

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。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。

5.3.2 报告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	30.82	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	10.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	21.37	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-180 天	24.41	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.72	-
5	180 天(含)-397 天(含)	10.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	97.56	-

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	199,942,456.53	17.46
	其中：政策性金融债	199,942,456.53	17.46
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	290,171,800.03	25.35
6	中期票据	-	-
7	同业存单	129,015,931.28	11.27
8	其他	-	-
9	合计	619,130,187.84	54.08
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	19,672,802.00	1.72

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150215	15 国开 15	500,000	50,002,273.03	4.37
2	011556003	15 中交建 SCP003	500,000	49,982,774.32	4.37
3	111691519	16 广州农村商业银行 CD017	500,000	49,700,059.18	4.34
4	111693524	16 广州农村商业银行 CD063	500,000	49,404,223.78	4.32
5	041556044	15 中燃投资 CP001	400,000	40,173,721.28	3.51
6	041559075	15 福州城投 CP002	400,000	40,134,088.03	3.51

7	150318	15 进出 18	400,000	40,041,423.26	3.50
8	071633003	16 华融证 券 CP003	400,000	39,994,607.63	3.49
9	041676003	16 杭州城 建 CP002	400,000	39,973,661.90	3.49
10	160204	16 国开 04	400,000	39,941,439.60	3.49

5.6 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.2116%
报告期内偏离度的最低值	0.0873%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1572%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

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。

5.8.2

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，但未发生其摊余成本超过当日基金资产净值 20%的情况。

5.8.3

本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	7,929,393.70

4	应收申购款	21,720,737.39
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	29,650,131.09

§6 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	浦银安盛货币 E
报告期期初基金份额总额	107,903,064.36	1,224,448,348.00	5,790,168.88
报告期期间基金总申购份额	247,458,925.06	628,107,896.17	5,413,167.40
报告期期间基金总赎回份额	129,010,237.43	941,391,475.90	3,842,786.98
报告期期末基金份额总额	226,351,751.99	911,164,768.27	7,360,549.30

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	红利发放	2016年4月18日	126,291.90	126,291.90	0.00%
2	基金转换入	2016年4月28日	71,188,029.81	71,188,029.81	0.00%
3	红利发放	2016年5月17日	208,090.53	208,090.53	0.00%
4	红利发放	2016年6月16日	263,531.08	263,531.08	0.00%
合计			71,785,943.32	71,785,943.32	

注：1、截至本报告期末，本基金管理人持有浦银货币 B122,767,489.42 份。

2、截至本报告期末，本基金管理人的全资子公司上海浦银安盛资产管理有限公司持有本基金浦银货币 B 54,692,054.21 份。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2016 年 4 月 26 日发布《关于变更公司经营范围及修订〈公司章程〉的公告》，公告披露：根据浦银安盛基金管理有限公司（以下简称“本公司”）股东会有关决议，本公司

经营范围由“基金募集、基金销售、资产管理和证监会许可的其他业务”变更为“基金募集、基金销售、资产管理，境外证券投资管理和证监会许可的其他业务”。根据相关法规及规范性文件的规定，本公司结合变更经营范围等事项修改了《公司章程》中的有关内容。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集的文件
- 2、浦银安盛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

9.2 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。

9.3 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
2016 年 7 月 21 日