

浦银安盛货币市场证券投资基金 2016 年 半年度报告摘要

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

送出日期：2016 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示

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 2016 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 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 | 契约型开放式 | | |
| 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 | 1,144,877,069.56 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 | 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 |

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 | 方韡 |
| | 联系电话 | 021-23212888 | 010-89936330 |
| | 电子邮箱 | compliance@py-axa.com | fangwei@citicbank.com |
| 客户服务电话 | | 021-33079999 或 400-8828-999 | 95558 |
| 传真 | | 021-23212985 | 010-85230024 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|------------------|
| 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 |

§ 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

| 基金级别 | 浦银安盛货币 A | 浦银安盛货币 B | 浦银安盛货币 E |
|---------------|---|--|--|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日) | 报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日) | 报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 1,645,714.45 | 20,825,528.05 | 90,579.19 |
| 本期利润 | 1,645,714.45 | 20,825,528.05 | 90,579.19 |
| 本期净值收益率 | 1.2667% | 1.3874% | 1.2664% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016 年 6 月 30 日) | | |
| 期末基金资产净值 | 226,351,751.99 | 911,164,768.27 | 7,360,549.30 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 |

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。

4、自 2014 年 9 月 15 日起，本基金增加 E 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

浦银安盛货币 A

| 阶段 | 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 |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去一个月 | 0.2356% | 0.0105% | 0.0287% | 0.0000% | 0.2069% | 0.0105% |
| 过去三个月 | 0.6595% | 0.0069% | 0.0871% | 0.0000% | 0.5724% | 0.0069% |

| | | | | | | |
|------------|----------|---------|---------|---------|----------|---------|
| 过去六个月 | 1.2667% | 0.0051% | 0.1742% | 0.0000% | 1.0925% | 0.0051% |
| 过去一年 | 2.5109% | 0.0041% | 0.3511% | 0.0000% | 2.1598% | 0.0041% |
| 过去三年 | 12.4295% | 0.0074% | 1.0560% | 0.0000% | 11.3735% | 0.0074% |
| 自基金合同生效起至今 | 22.0422% | 0.0068% | 2.0646% | 0.0002% | 19.9776% | 0.0066% |

浦银安盛货币 B

| 阶段 | 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 |
|------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去一个月 | 0.2552% | 0.0105% | 0.0287% | 0.0000% | 0.2265% | 0.0105% |
| 过去三个月 | 0.7191% | 0.0069% | 0.0871% | 0.0000% | 0.6320% | 0.0069% |
| 过去六个月 | 1.3874% | 0.0051% | 0.1742% | 0.0000% | 1.2132% | 0.0051% |
| 过去一年 | 2.7577% | 0.0041% | 0.3511% | 0.0000% | 2.4066% | 0.0041% |
| 过去三年 | 13.2421% | 0.0074% | 1.0560% | 0.0000% | 12.1861% | 0.0074% |
| 自基金合同生效起至今 | 23.6105% | 0.0068% | 2.0646% | 0.0002% | 21.5459% | 0.0066% |

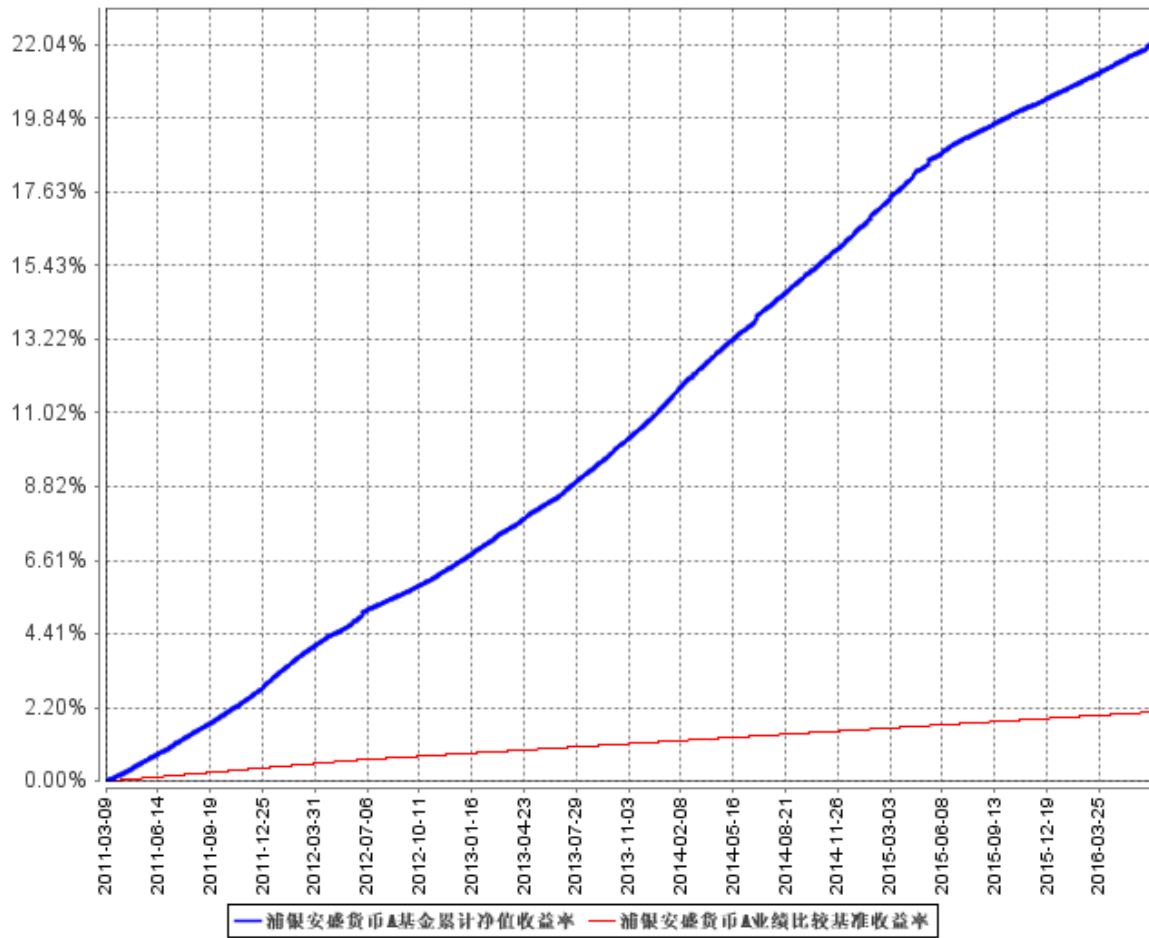
浦银安盛货币 E

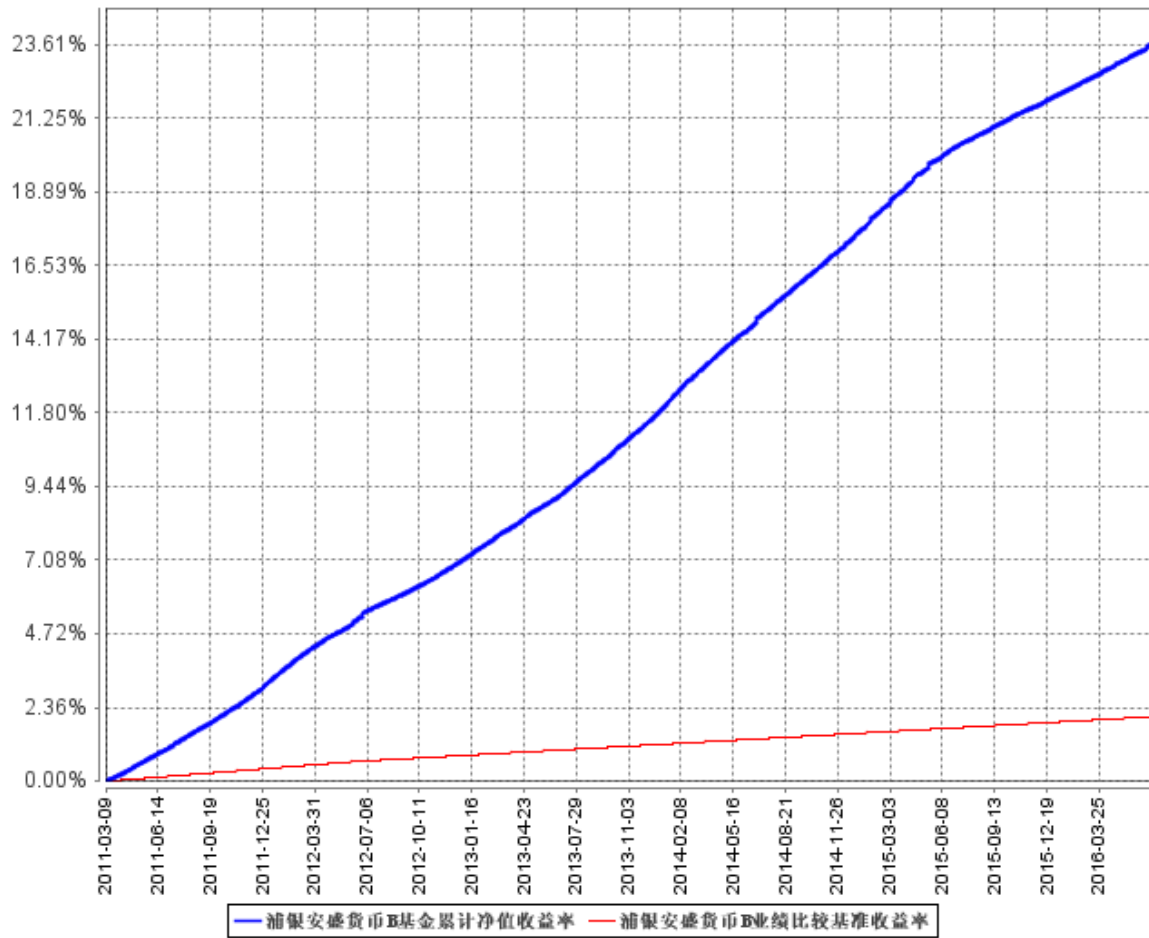
| 阶段 | 份额净值 收益率① | 份额净值 收益率标 准差② | 业绩比较 基准收益 率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|---------|---------|
| 过去一个月 | 0.2355% | 0.0105% | 0.0287% | 0.0000% | 0.2068% | 0.0105% |
| 过去三个月 | 0.6590% | 0.0069% | 0.0871% | 0.0000% | 0.5719% | 0.0069% |
| 过去六个月 | 1.2664% | 0.0051% | 0.1742% | 0.0000% | 1.0922% | 0.0051% |
| 过去一年 | 2.5106% | 0.0041% | 0.3511% | 0.0000% | 2.1595% | 0.0041% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.1617% | 0.0076% | 0.6296% | 0.0000% | 5.5321% | 0.0076% |

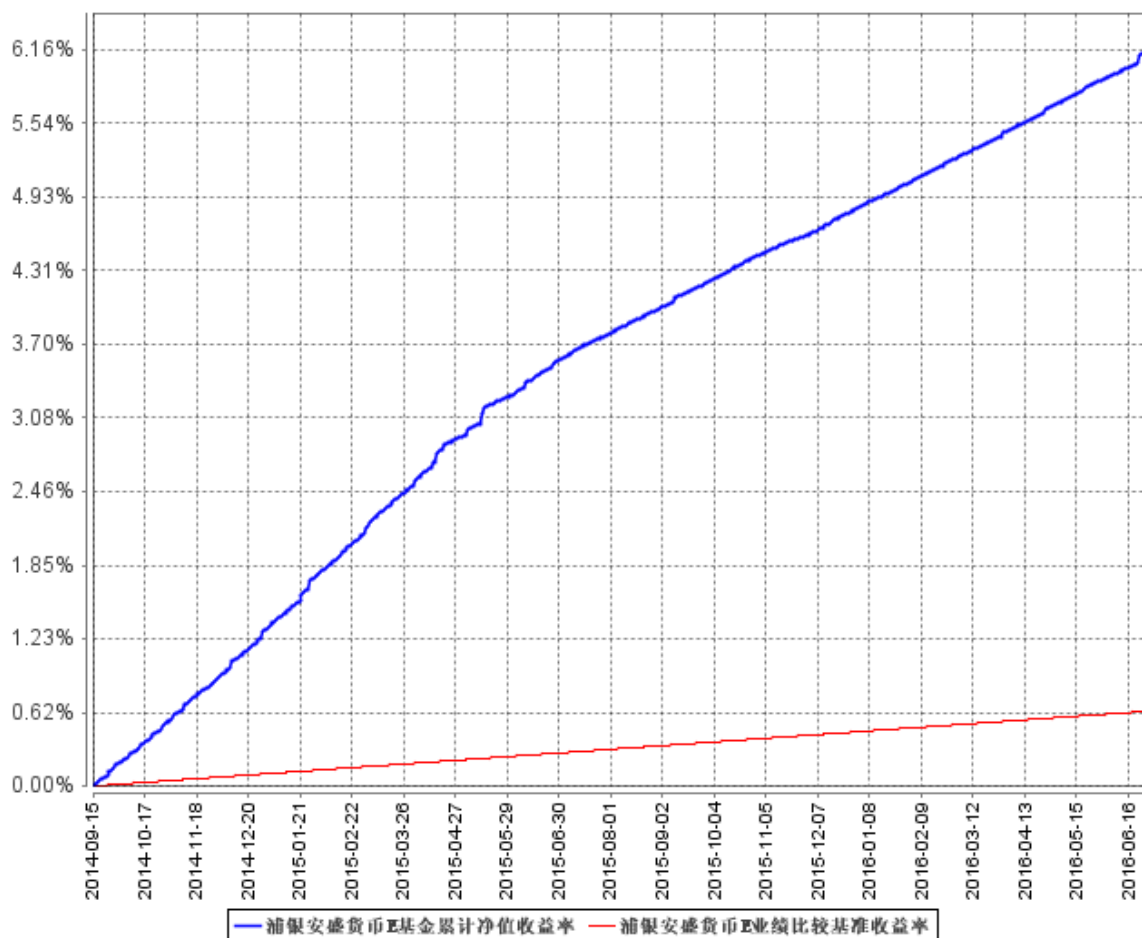
注：

- 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 和 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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浦银安盛基金管理有限公司（以下简称“浦银安盛”）成立于 2007 年 8 月，股东为上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A. 及上海国盛集团资产有限公司，公司总部设在上海，注册资本为人民币 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、境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务。

截至 2016 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 21 只基金，即浦银安盛价值成长混合型证券投资基金、浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛红利精选混合型证券投资基金、浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金、

浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 (LOF)、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、浦银安盛四季添利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛日日盈货币市场基金、浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金、浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金以及浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金。

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统，这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成，之后日常的维护管理由公司负责，但与第三方服务公司签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户子系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统等。这些系统也主要是在公司筹建之初采购专业系统提供商的产品建设而成，建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级，升级由系统提供商负责完成，升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。业务应用系统日常的维护管理由公司负责，但与系统提供商签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外，我公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 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 | | |
| 康佳燕 | 公司旗下浦银安盛货币基金以及浦银安盛 | 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 |

| | | | | | |
|----|----------------|----------------|---|---|---|
| | 日日盈货币基金基金经理 | | | | 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。 |
| 杨晶 | 公司旗下货币收益基金经理助理 | 2016 年 1 月 1 日 | - | 3 | 杨晶女士，伦敦大学玛丽皇后学院金融投资硕士。2013 年 4 月 1 日加盟我司曾任交易部固定收益交易员，2016 年 1 月调岗至固定收益投资部任货币基金经理助理。 |

注：1、此处的“任职日期”和“离任日期”指公司决定确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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在具体执行中，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平的提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度，保证公募基金及专户业务的独立投资决策机制；在交易执行环节上，详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规定，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 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

2016 年上半年债券市场在宏观经济下行，货币政策稳健但信用环境恶化等多重因素影响下，收益率一波三折，经历了先下后上再下的行情，呈现震荡走势。具体看，1 月春节叠加汇率因素以及 3 月底季末 MPA 首次考核对资金面有所扰动，但央行 3 月初进行一次降准并及时使用多种货币市场工具稳定货币市利率。年初以来，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 1.2667%，B 类净值收益率为 1.3874%，E 类净值收益率为 1.2664%，同期业绩比较基准收益率 A 类和 B 类为 0.1742%，E 类为 0.1750%。

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 2016 年下半年，从基本面看，经济增长可能进一步下行，通货膨胀有望继续保持在低位，从政策面看，货币政策将继续保持稳健，继续使用 OMO、MLF 来维持市场资金面的平衡，但不排除降准的可能性，而财政扩张的程度和效果可能不及预期。整体看，下半年基本面和政策面有利于债市，但是配置的节奏和行情的波动性需要把握好。

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、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》。

本基金管理人与中证指数有限公司签订了《债券估值数据服务协议》。

4.7 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 1,645,714.45 元，实际分配收益 1,645,714.45 元；浦银货币 B 级基金应分配收益 20,825,528.05 元，实际分配收益 20,825,528.05 元；浦银货币 E 级基金应分配收益 90,579.19 元，实际分配收益 90,579.19 元。

4.8 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

本报告期内，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，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 2016 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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
|------------|-----|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | | 300,554,354.13 | 1,596,674,761.89 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | | 619,130,187.84 | 818,503,286.46 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 619,130,187.84 | 818,503,286.46 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | 197,300,855.95 | 1,032,125,802.46 |
| 应收证券清算款 | | - | - |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 应收利息 | | 7,929,393.70 | 9,675,474.41 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 21,720,737.39 | 134.32 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 1,146,635,529.01 | 3,456,979,459.54 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016年6月30日 | 上年度末 2015年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 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 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 16,155.12 | 10,857.27 |
| 应付管理人报酬 | | 222,036.14 | 647,406.80 |
| 应付托管费 | | 67,283.72 | 196,183.88 |
| 应付销售服务费 | | 42,690.50 | 48,053.97 |
| 应付交易费用 | | 12,206.94 | 26,665.59 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | 1,228,373.15 | 2,982,309.19 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 169,713.88 | 178,153.75 |
| 负债合计 | | 1,758,459.45 | 4,089,630.45 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 1,144,877,069.56 | 3,452,889,829.09 |
| 未分配利润 | | - | - |
| 所有者权益合计 | | 1,144,877,069.56 | 3,452,889,829.09 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,146,635,529.01 | 3,456,979,459.54 |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额

1,144,877,069.56 份。其中 A 级的基金份额为 226,351,751.99 份，B 级的基金份额为

911,164,768.27 份，E 级的基金份额为 7,360,549.30 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2016年1月1日至 2016年6月30日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日 |
|-----|-----|--------------------------------|-------------------------------------|
| | | | |

| | | | |
|----------------------------|-----------|---------------|---------------|
| 一、收入 | | 27,037,417.03 | 19,657,463.15 |
| 1.利息收入 | | 26,832,452.55 | 16,634,456.89 |
| 其中：存款利息收入 | | 11,325,116.57 | 7,742,445.93 |
| 债券利息收入 | | 11,007,227.21 | 7,912,303.97 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 4,500,108.77 | 979,706.99 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 204,889.48 | 3,023,006.26 |
| 其中：股票投资收益 | | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 204,889.48 | 3,023,006.26 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | - | - |
| 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） | | 75.00 | - |
| 减：二、费用 | | 4,475,595.34 | 2,584,497.96 |
| 1. 管理人报酬 | | 2,815,668.30 | 1,269,131.65 |
| 2. 托管费 | | 853,232.84 | 384,585.43 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.8.2.3 | 249,348.26 | 401,645.11 |
| 4. 交易费用 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 422,838.81 | 393,594.55 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 422,838.81 | 393,594.55 |
| 6. 其他费用 | | 134,507.13 | 135,541.22 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 22,561,821.69 | 17,072,965.19 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 22,561,821.69 | 17,072,965.19 |

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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) | 3,452,889,829.09 | - | 3,452,889,829.09 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 22,561,821.69 | 22,561,821.69 |
| 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) | -2,308,012,759.53 | - | -2,308,012,759.53 |
| 其中: 1.基金申购款 | 2,086,797,883.41 | - | 2,086,797,883.41 |
| 2.基金赎回款 | -4,394,810,642.94 | - | -4,394,810,642.94 |
| 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) | - | -22,561,821.69 | -22,561,821.69 |
| 五、期末所有者权益 (基金净值) | 1,144,877,069.56 | - | 1,144,877,069.56 |
| 项目 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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) | 913,944,212.79 | - | 913,944,212.79 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 17,072,965.19 | 17,072,965.19 |
| 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) | -312,524,971.08 | - | -312,524,971.08 |
| 其中: 1.基金申购款 | 3,206,789,812.62 | - | 3,206,789,812.62 |
| 2.基金赎回款 | -3,519,314,783.70 | - | -3,519,314,783.70 |
| 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) | - | -17,072,965.19 | -17,072,965.19 |
| 五、期末所有者权益 (基金净值) | 601,419,241.71 | - | 601,419,241.71 |

报表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：

| | | |
|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|
| <u> 郁蓓华 </u> | <u> 郁蓓华 </u> | <u> 钱琨 </u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

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》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。本基金管理人自 2014 年 9 月 15 日起为指定的特定销售渠道增加本基金的 E 类基金份额,该类份额仅能通过特定的销售渠道办理申购、赎回等业务,该类份额不适用基金份额自动升降级机制,其余业务规则及基金费率与浦银安盛货币 A 的业务规则相同。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)。

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》、《浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 1 月 1 日至 2016 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 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 会计差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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 |
|----------------|-------------------|
| 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 |
| 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 |
| 上海浦银安盛资产管理有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.8.1.1 股票交易**

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬**6.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至 2016年6月30日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,815,668.30 | 1,269,131.65 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 236,805.44 | 566,510.20 |

注：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|------------------------------------|------------------------------------|
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 853,232.84 | 384,585.43 |

注：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

6.4.8.2.3 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 | | | |
|----------------|---------------------------------|-----------|----------|------------|
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 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 | 浦银安盛货币 E | 合计 |
| 中信银行股份有限公司 | 11,786.64 | 609.34 | 0.00 | 12,395.98 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 17,629.83 | 1,406.36 | 0.00 | 19,036.19 |
| 浦银安盛基金管理有限公司 | 12,706.45 | 71,634.91 | 0.00 | 84,341.36 |
| 合计 | 42,122.92 | 73,650.61 | 0.00 | 115,773.53 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | | |
| | 2015 年 1 月 1 日至 2015 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 | 浦银安盛货币 E | 合计 |
| 中信银行股份有限公司 | 62,249.78 | 1,044.54 | - | 63,294.32 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 29,838.28 | 682.40 | - | 30,520.68 |
| 浦银安盛基金管理有限公 | 20,515.51 | 8,125.18 | - | 28,640.69 |

| | | | | |
|----|------------|----------|---|------------|
| 司 | | | | |
| 合计 | 112,603.57 | 9,852.12 | - | 122,455.69 |

注：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。本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受 B 类基金份额的费率。本基金 E 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，且不适用基金份额的自动升降级机制。三类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

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

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

6.4.8.3 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 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 | 30,149,203.97 | - | - | - | - | - |

注：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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 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 |
| 基金合同生效日（ 2011 年 3 月 9 日）持有的 基金份额 | - | - | - |

| | | | |
|-----------------------|---|----------------|---|
| 期初持有的基金份额 | - | 50,650,892.76 | - |
| 期间申购/买入总份额 | - | 72,116,596.66 | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - | - |
| 期末持有的基金份额 | - | 122,767,489.42 | - |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | - | 13.47% | - |

| 项目 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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 |
| 基金合同生效日（ 2011 年 3 月 9 日）持有的 基金份额 | - | - | - |
| 期初持有的基金份额 | - | - | - |
| 期间申购/买入总份额 | - | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - | - |
| 期末持有的基金份额 | - | - | - |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | - | - | - |

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投、分级份额调增和转换入份额，期间赎回/卖出总份额含分级份额调减和转换出份额。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：浦银安盛货币 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

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在本报告期末持有浦银安盛货币 B 54,692,054.21 份。

浦银安盛货币 E

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 E。

6.4.8.5 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 |
|-----------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 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 |
|-------------------|--------------|--------------|--------------|------------|
| 中信银行股份有 限公司-活期 | 5,554,354.13 | 67,371.04 | 1,530,988.75 | 118,952.98 |
| 中信银行股份有 限公司-定期 | - | 1,074,031.94 | - | - |

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，按约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期与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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金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。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金在本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无因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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2016 年 6 月 30 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 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 | 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 | 其他各项资产 | 29,650,131.09 | 2.59 |
| 5 | 合计 | 1,146,635,529.01 | 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 | 3.47 | |
| | 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。

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 3 月 15 日 | 22.48 | 巨额赎回 | 1 个工作日 |
| 2 | 2016 年 4 月 25 日 | 35.27 | 巨额赎回 | 1 个工作日 |
| 3 | 2016 年 4 月 26 日 | 35.44 | 巨额赎回 | 1 个工作日 |
| 4 | 2016 年 4 月 27 日 | 35.07 | 巨额赎回 | 1 个工作日 |
| 5 | 2016 年 4 月 28 日 | 22.17 | 巨额赎回 | 1 个工作日 |

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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 | 31 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 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。

7.3.2 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比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------------|--------------------|--------------------|
| 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)—120 天 | 24.41 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 1.72 | - |
| 5 | 120 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 | - |

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 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存续期未超过 240 天。

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 | 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 |

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 | 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 农村商业银行 CD017 | 500,000 | 49,700,059.18 | 4.34 |
| 4 | 111693524 | 16 广州农村 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 |

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 | - |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.2116% |

| | |
|------------------------|---------|
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0678% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1336% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本报告期内无负偏离度绝对值达到 0.25%的情况

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本报告期内无正偏离度绝对值达到 0.5%的情况

7.8 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

注：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

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 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 |

§ 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 | 6,686 | 33,854.58 | 16,968,851.36 | 7.50% | 209,382,900.63 | 92.50% |
| 浦银安盛货币 B | 19 | 47,956,040.44 | 868,431,100.90 | 95.31% | 42,733,667.37 | 4.69% |
| 浦银安盛货币 E | 2,177 | 3,381.05 | 7,128,409.18 | 96.85% | 232,140.12 | 3.15% |
| 合计 | 8,882 | 128,898.57 | 892,528,361.44 | 77.96% | 252,348,708.12 | 22.04% |

8.3 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 | 浦银安盛货币 A | 165,560.96 | 0.07% |
| | 浦银安盛货币 B | 0.00 | 0.00% |
| | 浦银安盛货币 E | 0.00 | 0.00% |
| | 合计 | 165,560.96 | 0.01% |

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|-------------|----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基 | 浦银安盛货币 A | 0 |

| | | |
|---------------------|----------|---|
| 金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 浦银安盛货币 B | 0 |
| | 浦银安盛货币 E | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 浦银安盛货币 A | 0 |
| | 浦银安盛货币 B | 0 |
| | 浦银安盛货币 E | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 浦银安盛货币 A | 浦银安盛货币 B | 浦银安盛货币 E |
|-------------------------------|------------------|------------------|---------------|
| 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 | 153,132,617.19 | 3,295,531,280.03 | 4,225,931.87 |
| 本报告期基金总申购份额 | 315,673,464.38 | 1,759,031,995.70 | 12,092,423.33 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 242,454,329.58 | 4,143,398,507.46 | 8,957,805.90 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 226,351,751.99 | 911,164,768.27 | 7,360,549.30 |

注：总申购份额含红利再投、分级份额调增和转换入份额，总赎回份额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

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

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。

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

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。

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 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 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：

本基金本报告期新增安信证券交易单元。

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 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 国信证券 | - | - | 150,000,000.00 | 100.00% | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本报告期内无偏离度绝对值超过0.5%的情况

浦银安盛基金管理有限公司
2016年8月29日