

# 浦银安盛日日盈货币市场基金 2016 年年 度报告 摘要

2016 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：2017 年 3 月 30 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 2017 年 3 月 27 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	浦银安盛日日盈货币		
基金主代码	519566		
交易代码	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	18,686,515,241.34 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	30,901,832.30 份	16,164,383,839.66 份	2,491,229,569.38 份

### 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
	联系电话	021-23212888
	电子邮箱	compliance@py-axa.com
客户服务电话	021-33079999 或 400-8828-999	95559
传真	021-23212985	021-62701216

## 2.4 信息披露方式

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

## § 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	2016 年			2015 年			2014 年 3 月 25 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日		
	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	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	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	1,028,307.29	303,085,866.36	72,300,952.66	1,725,672.82	60,710,721.60	97,203,613.16	3,235,118.73	53,396,391.37	46,193,206.86
本期利润	1,028,307.29	303,085,866.36	72,300,952.66	1,725,672.82	60,710,721.60	97,203,613.16	3,235,118.73	53,396,391.37	46,193,206.86
本期净值收益率	2.4302%	2.6768%	2.4305%	3.6938%	3.9427%	3.6938%	3.3388%	3.5318%	2.5022%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末			2015 年末			2014 年末		
期末基金资产净值	30,901,832.30	16,164,383,839.66	2,491,229,569.38	55,102,593.17	7,100,114,682.10	2,825,283,121.20	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	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.	2016 年末			2015 年末			2014 年末		

1.3 累计期末指标									
累计净值收益率	9.7601%	10.4944%	8.8718%	7.1560%	7.6138%	6.2884%	3.3388%	3.5318%	2.5022%

- 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、本基金收益分配按日结转份额。
- 4、自 2014 年 5 月 30 日起，本基金增加 D 级基金份额类别。
- 5、本基金成立于 2014 年 3 月 25 日生效。以上财务指标中“2014 年度可比期间”为 2014 年 3 月 25 日（基金成立日）至 2014 年 12 月 31 日止期间。

## 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

浦银安盛日日盈货币 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
过去三个月	0.5666%	0.0011%	0.0880%	0.0000%	0.4786%	0.0011%
过去六个月	1.1536%	0.0009%	0.1761%	0.0000%	0.9775%	0.0009%
过去一年	2.4302%	0.0012%	0.3506%	0.0000%	2.0796%	0.0012%
自基金合同生效起至今	9.7601%	0.0035%	0.9751%	0.0000%	8.7850%	0.0035%

浦银安盛日日盈货币 B

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较基	①—③	②—④
----	------	------	------	-------	-----	-----

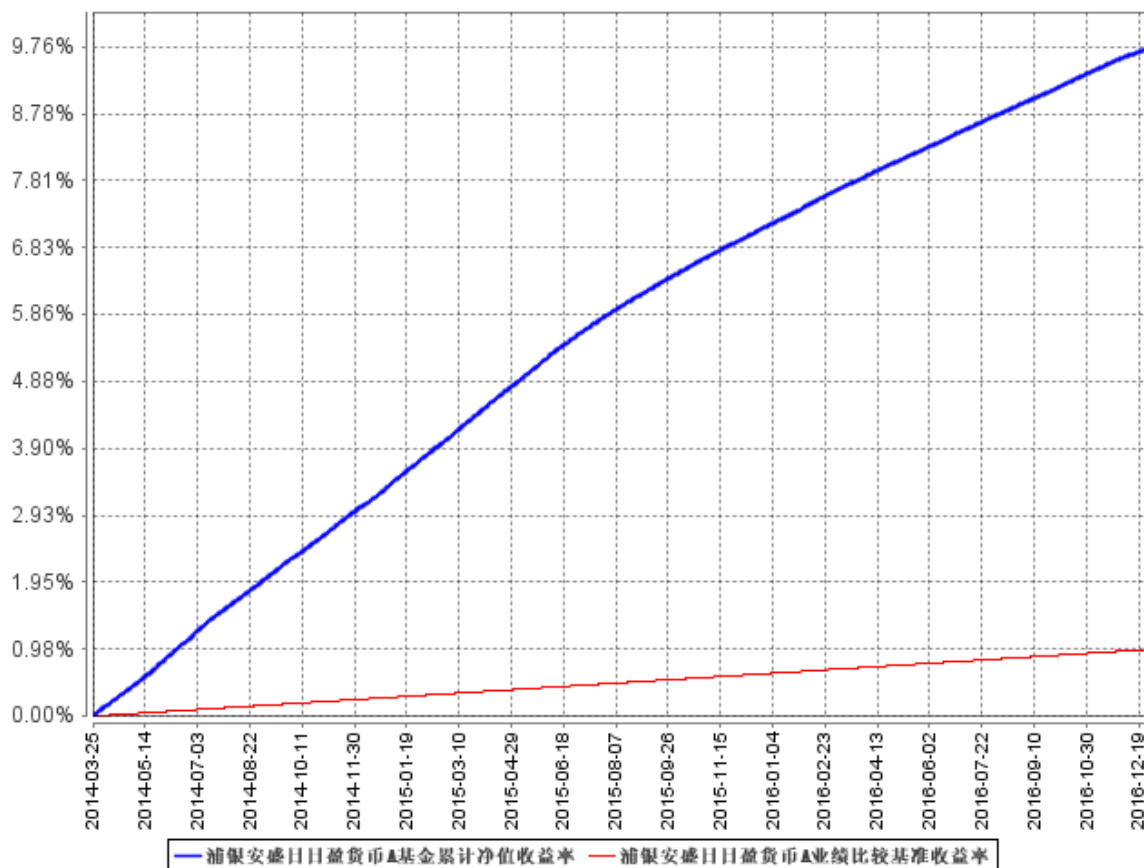
	收益率①	收益率标准差②	基准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	0.6274%	0.0011%	0.0880%	0.0000%	0.5394%	0.0011%
过去六个月	1.2761%	0.0009%	0.1761%	0.0000%	1.1000%	0.0009%
过去一年	2.6768%	0.0012%	0.3506%	0.0000%	2.3262%	0.0012%
自基金合同生效起至今	10.4944%	0.0035%	0.9751%	0.0000%	9.5193%	0.0035%

浦银安盛日日盈货币 D

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
过去三个月	0.5666%	0.0011%	0.0880%	0.0000%	0.4786%	0.0011%
过去六个月	1.1538%	0.0009%	0.1761%	0.0000%	0.9777%	0.0009%
过去一年	2.4305%	0.0012%	0.3506%	0.0000%	2.0799%	0.0012%
自基金合同生效起至今	8.8718%	0.0036%	0.9112%	0.0000%	7.9606%	0.0036%

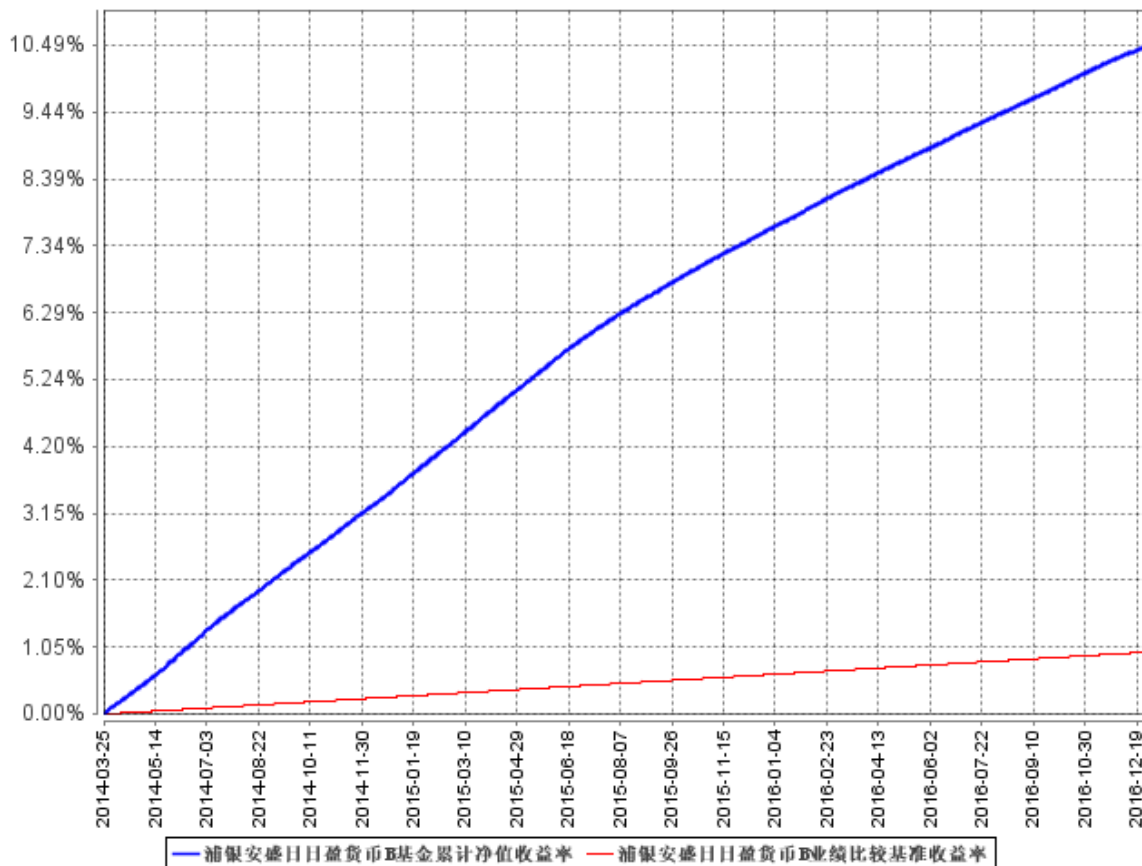
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

### 浦银安盛日日盈货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

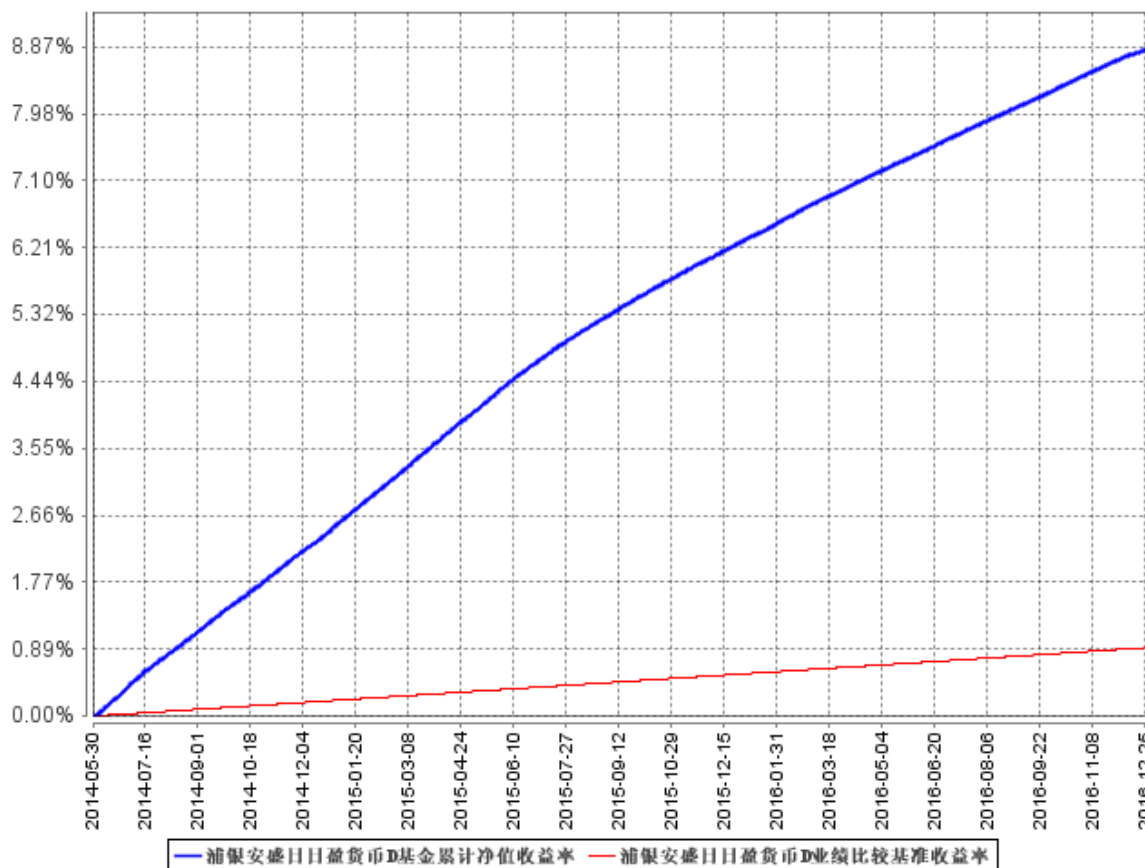




### 浦银安盛日日盈货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



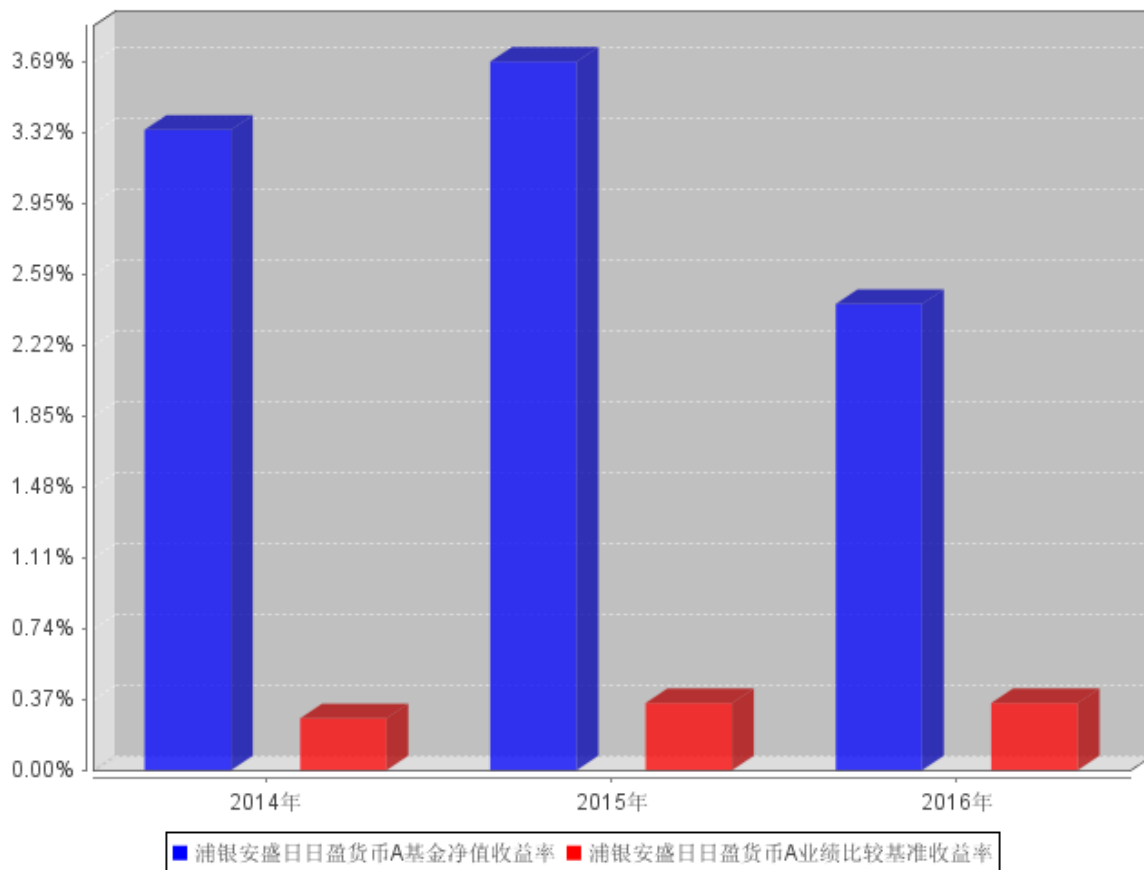
### 浦银安盛日日盈货币D基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



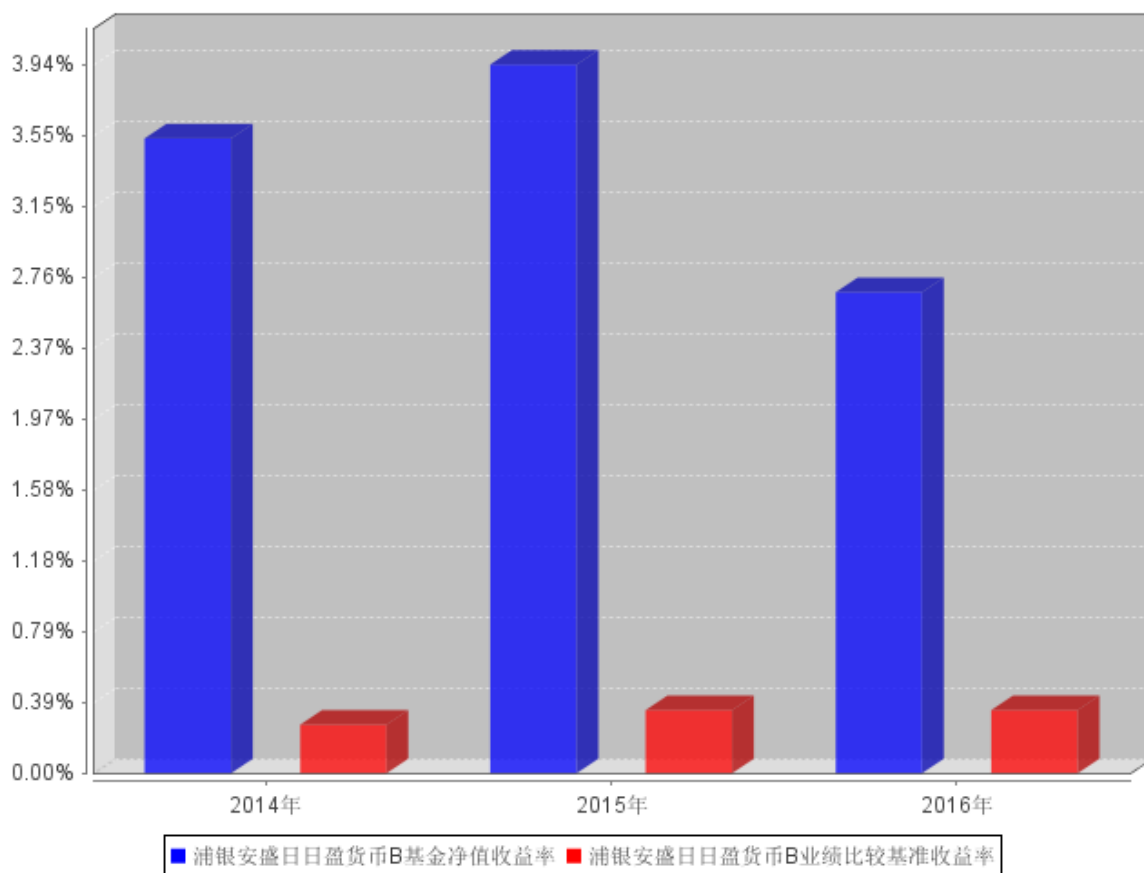
注：本基金于 2014 年 5 月 30 日开始分为 A、B、D 三类，具体内容详见本基金管理人于 2014 年 5 月 28 日刊登的《关于浦银安盛日日盈货币市场基金增加基金份额类别的公告》。

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

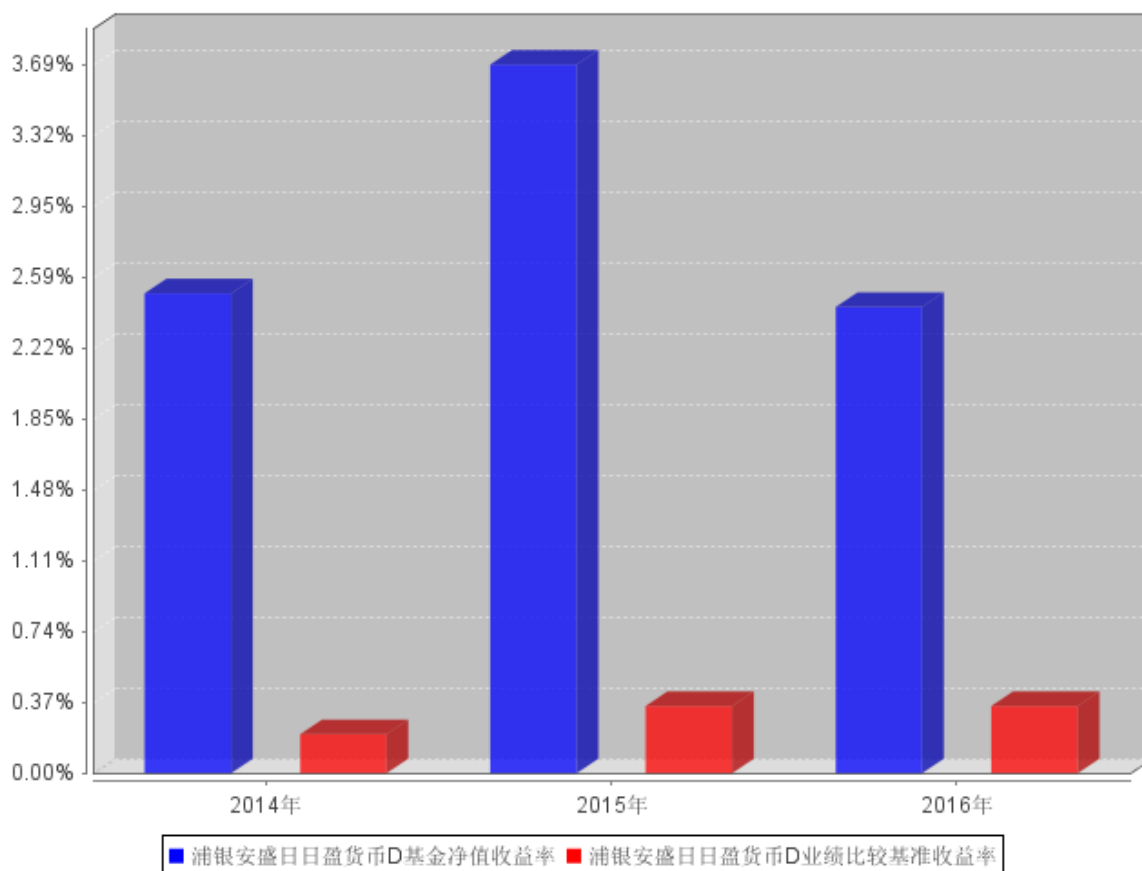
浦银安盛日日盈货币A自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



浦银安盛日日盈货币B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对比图



浦银安盛日日盈货币D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对比图



注：

- 1、本基金 A, B 份额于 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。
- 2、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

浦银安盛日日盈货币 A					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2016	1,029,889.95	-	-1,582.66	1,028,307.29	
2015	1,725,906.18	-	-233.36	1,725,672.82	
2014	3,230,922.79	-	4,195.94	3,235,118.73	
合计	5,986,718.92	-	2,379.92	5,989,098.84	
浦银安盛日日盈货币 B					
年度	已按再投资形式	直接通过应付	应付利润	年度利润	备注

	转实收基金	赎回款转出金 额	本年变动	分配合计	
2016	302,293,624.90	-	792,241.46	303,085,866.36	
2015	60,285,303.25	-	425,418.35	60,710,721.60	
2014	53,263,153.95	-	133,237.42	53,396,391.37	
合计	415,842,082.10	-	1,350,897.23	417,192,979.33	
浦银安盛日日盈货币 D					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2016	72,312,883.65	-	-11,930.99	72,300,952.66	
2015	97,235,703.97	-	-32,090.81	97,203,613.16	
2014	45,957,321.57	-	235,885.29	46,193,206.86	
合计	215,505,909.19	-	191,863.49	215,697,772.68	

## § 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 12 月 31 日止，浦银安盛旗下共管理 28 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、浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金、

浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛幸福聚益 18 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金以及浦银安盛盛达纯债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、浦银安盛日日盈货币基金、浦银安盛日日丰货币基金以及浦银安盛日日鑫货币基金经理	2014 年 7 月 21 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。2016 年 11 月起，兼任浦银安盛日日丰货币基金以及浦银安盛日日鑫货币基金基金经理。
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上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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组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

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，国内 GDP 增长 6.7%，CPI 同比上涨 2.0%，PPI 同比下降 1.4%。整体看，2016 年央行执行了中性偏紧的货币政策，上半年主要是受春节假日、汇率及缴税多重因素引起资金面短期紧张，其余时间均较为宽松。下半年 8 月份开始央行重启 14 及 28 天逆回购，拉长了逆回购和 MLF 的久期，通过“锁短放长”拉长融资期限，间接抬高综合资金成本，渐进式地执行了偏紧的货币政策，自 8 月份以来，每月中下旬资金面都较为紧张，第四季度尤为明显，短端利率在第四季度上行 200bp。在报告期内，本基金大部分资产配置类别为同业存款，其余均衡配置了短融、存单和回购。

### 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 2.4302%，B 类净值收益率为 2.6768%，D 类净值收益率为 2.4305%，同期业绩比较基准收益率为 0.3506%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年末中央经济工作会议提出，要把防控金融风险放到更加重要的位置，下决心处置一批风险点，着力防控资产泡沫，提高和改进监管能力，确保不发生系统性金融风险，这决定了 2017 年债市的主基调。首先，金融去杠杆，这表明货币政策总体上一一定是中性甚至偏紧的，17 年时点性的流动性紧张可能比 16 年发生的更频繁，非存款类金融机构借入资金的中枢可能在利率走廊上沿震荡。其次，抑制房价上涨，甚至持开放的态度面对经济增速可能低于 6.5%，这表明稳增长不再是首要目标，房地产投资回落是大概率事件，基建投资等财政政策也不会像市场想的那么积极，经济下台阶中长期看好利好债市。其他如通胀和美国等因素目前还不甚明朗，减产协议如能进一步加码，石油持续上涨会带来输入性通胀，但美国的新增供给加大以及能源政策变化也给石油价格带来了不确定性；美国方面，总统权力过度后，特朗普的积极财政政策和贸易保

护政策能否顺利推行且真正推动经济和通胀上行仍存较大疑问。2017 年将是充满不确定性和机遇的一年，短期来看 4 月以前市场仍将由资金面主导，央行偏紧的态度叠加去年末大跌后脆弱的市场情绪，债市仍有可能再次寻底，保持好组合的高流动性和偏高信用资质是重中之重。中长期来看高负债率下企业难以承受利率持续上行，经济增速可能下台阶将利好债市。

#### 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。

本基金管理人已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 1,028,307.29 元，实际分配收益 1,028,307.29 元；浦银安盛日日盈货币 B 级基金应分配收益 303,085,866.36 元，实际分配收益 303,085,866.36 元，浦银安盛日日盈货币 D 级基金应分配收益 72,300,952.66 元，实际分配收益 72,300,952.66 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

2016 年度，托管人在浦银安盛日日盈货币型证券投资基金的托管过程中，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2016 年度，浦银安盛基金管理有限公司在浦银安盛日日盈货币型证券投资基金投资运作、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 A 级份额持有人分配利润：1,028,307.29 元，向 B 级份额持有人分配利润：303,085,866.36 元，向 D 级份额持有人分配利润：72,300,952.66 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

2016 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型证券投资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（2017）第 21536 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 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度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	<p>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> <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”)、 中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)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	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、中国基金业协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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	薛竞	张振波
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	2017 年 3 月 27 日

## § 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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		12,355,579,513.87	4,593,319,482.19
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		4,050,688,357.33	2,546,316,051.95
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,050,688,357.33	2,516,316,051.95
资产支持证券投资		-	30,000,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		2,182,783,062.00	2,723,122,531.65
应收证券清算款		-	-
应收利息		62,283,621.93	46,076,007.15
应收股利		-	-
应收申购款		42,454,710.44	76,693,491.54
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		18,693,789,265.57	9,985,527,564.48
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		100,492.69	1,140,278.80

应付管理人报酬		3,456,334.39	1,593,304.34
应付托管费		1,047,374.09	482,819.49
应付销售服务费		678,857.93	639,010.91
应付交易费用		83,243.18	38,397.06
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		1,545,140.64	766,412.83
递延所得税负债		-	-
其他负债		362,581.31	366,944.58
负债合计		7,274,024.23	5,027,168.01
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		18,686,515,241.34	9,980,500,396.47
未分配利润		-	-
所有者权益合计		18,686,515,241.34	9,980,500,396.47
负债和所有者权益总计		18,693,789,265.57	9,985,527,564.48

注：1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额

18,686,515,241.34 份。其中浦银安盛日日盈货币 A 级的基金份额为 30,901,832.30 份，浦银安盛日日盈货币 B 级的基金份额为 16,164,383,839.66 份，浦银安盛日日盈货币 D 级的基金份额为 2,491,229,569.38 份。

## 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		459,695,759.23	187,694,735.30
1.利息收入		456,069,102.27	167,083,922.14
其中：存款利息收入		252,385,573.01	94,841,825.36
债券利息收入		147,858,494.72	61,314,979.68
资产支持证券利息收入		324,535.77	471,125.34
买入返售金融资产收入		55,500,498.77	10,455,991.76
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,626,656.96	20,610,813.16
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		3,607,368.07	20,610,813.16

资产支持证券投资收益		19,288.89	-
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）		-	-
<b>减：二、费用</b>		83,280,632.92	28,054,727.72
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	48,121,838.43	14,728,989.27
2. 托管费	7.4.8.2.2	14,582,375.35	4,463,330.11
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	8,788,143.21	7,120,226.23
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		11,343,268.25	1,306,007.89
其中：卖出回购金融资产支出		11,343,268.25	1,306,007.89
6. 其他费用		445,007.68	436,174.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		376,415,126.31	159,640,007.58
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		376,415,126.31	159,640,007.58

### 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：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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）	9,980,500,396.47	-	9,980,500,396.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	376,415,126.31	376,415,126.31
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	8,706,014,844.87	-	8,706,014,844.87



(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	67,964,692,339.77	-	67,964,692,339.77
2. 基金赎回款	-59,258,677,494.90	-	-59,258,677,494.90
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)	-	-376,415,126.31	-376,415,126.31
五、期末所有者权益(基金净值)	18,686,515,241.34	-	18,686,515,241.34
	<b>上年度可比期间</b>		
	<b>2015年1月1日至2015年12月31日</b>		
<b>项目</b>	<b>实收基金</b>	<b>未分配利润</b>	<b>所有者权益合计</b>
一、期初所有者权益(基金净值)	3,087,573,893.16	-	3,087,573,893.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	159,640,007.58	159,640,007.58
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)	6,892,926,503.31	-	6,892,926,503.31
其中：1. 基金申购款	26,597,339,799.11	-	26,597,339,799.11
2. 基金赎回款	-19,704,413,295.80	-	-19,704,413,295.80
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)	-	-159,640,007.58	-159,640,007.58
五、期末所有者权益(基金净值)	9,980,500,396.47	-	9,980,500,396.47

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：

<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

## 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(以下简称“中国基金业协会”)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、中国基金业协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 2016 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 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。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 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[2004]78号《财政部、国家税务总局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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，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 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
上海国盛集团资产管理有限公司	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
----------------	-------------

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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.8.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期及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。

###### 7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	48,121,838.43	14,728,989.27
其中：支付销售机构的客户维护费	4,015,323.00	3,688,644.20

注：1、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

###### 7.4.8.2.2 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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	14,582,375.35	4,463,330.11

注：1、本基金《基金合同》生效日为 2014 年 3 月 25 日，以上财务指标中“上年度可比期间”为 2014 年 3 月 25 日（基金成立日）至 2014 年 12 月 31 日止期间。

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

#### 7.4.8.2.3 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 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	11,348.63	20.30	0.00	11,368.93
上海浦东发展银行股份有限公司	23,309.34	789.25	7,528,700.74	7,552,799.33
浦银安盛基金管理有限公司	62,140.49	1,151,001.43	0.00	1,213,141.92
合计	96,798.46	1,151,810.98	7,528,700.74	8,777,310.18
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 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	19,825.68	729.11	0.00	20,554.79
上海浦东发展银行股份有限公司	26,890.31	1,739.03	6,828,052.89	6,856,682.23
浦银安盛基金管理有限公司	55,376.32	164,286.54	0.00	219,662.86
合计	102,092.31	166,754.68	6,828,052.89	7,096,899.88

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。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。

### 7.4.8.3 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 12 月 31 日						
银行间市场交易 的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	103,633,185.25	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日						
银行间市场交易 的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

注：本基金上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自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 12 月 31 日		
	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）持有的基金份额	0.00	0.00	0.00
期初持有的基金份额	0.00	100,332,716.01	0.00
期间申购/买入总份额	5,736.25	855,959.35	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	101,188,675.36	0.00
期末持有的基金份额	5,736.25	0.00	0.00

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.02%	0.00%	0.00%
-----------------------	-------	-------	-------

项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	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）持有的 基金份额	0.00	0.00	0.00
期初持有的基金份额	0.00	0.00	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	100,332,716.01	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00	0.00
期末持有的基金份额	0.00	100,332,716.01	0.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.00%	1.41%	0.00%

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

#### 7.4.8.4.2 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

##### 浦银安盛日日盈货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 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	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
上海浦银安盛 资产管理有限 公司	855,089.91	2.77%	0.00	0.00%

##### 浦银安盛日日盈货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 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	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
上海浦银安盛 资产管理有限 公司	0.00	0.00%	12,531,707.10	0.18%
上海浦东发展	9,507,328,688.59	58.82%	1,000,292,732.92	14.09%

银行股份有限 公司				
--------------	--	--	--	--

浦银安盛日日盈货币 D

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 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	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例

**7.4.8.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有 限公司-活期存 款	16,579,513.87	107,861.57	10,319,482.19	20,112.05
交通银行股份有 限公司-定期存 款	200,000,000.00	15,449,583.33	-	-
上海浦东发展银 行股份有限公司 -定期存款	3,600,000,000.00	2,990,277.68	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金在本报告期及上年度可比期间承销期内均未参与关联方承销的证券。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

1、2016 年 5 月 5 日交通银行上海分行定期存款 1 笔，金额 9300 万元，到期日 2016 年 5 月 26 日。

2、2016 年 5 月 30 日交通银行上海分行定期存款 1 笔，金额 16000 万元，到期日 2016 年 11 月 28 日。

3、2016 年 5 月 30 日交通银行上海分行定期存款 1 笔，金额 30000 万元，到期日 2016 年 11 月 30 日。

4、2016 年 6 月 30 日交通银行上海分行定期存款 1 笔，金额 15000 万元，到期日 2016 年 9 月 23 日。



5、2016 年 6 月 30 日交通银行上海分行定期存款 1 笔，金额 40000 万元，到期日 2016 年 9 月 30 日。

6、2016 年 6 月 30 日交通银行上海分行定期存款 1 笔，金额 30000 万元，到期日 2016 年 7 月 25 日。

7、2016 年 7 月 6 日交通银行上海分行定期存款 1 笔，金额 11000 万元，到期日 2016 年 9 月 20 日。

8、2016 年 8 月 30 日交通银行上海分行定期存款 1 笔，金额 36000 万元，到期日 2016 年 11 月 25 日。

9、2016 年 12 月 23 日交通银行上海分行定期存款 1 笔，金额 20000 万元，到期日 2017 年 6 月 23 日。

10、2016 年 12 月 20 日浦发银行定期存款 1 笔，金额 100000 万元，到期日 2017 年 2 月 3 日。

11、2016 年 12 月 21 日浦发银行定期存款 1 笔，金额 100000 万元，到期日 2017 年 2 月 6 日。

12、2016 年 12 月 23 日浦发银行定期存款 1 笔，金额 50000 万元，到期日 2017 年 2 月 7 日。

13、2016 年 12 月 27 日浦发银行定期存款 1 笔，金额 40000 万元，到期日 2017 年 2 月 6 日。

14、2016 年 12 月 29 日浦发银行定期存款 1 笔，金额 70000 万元，到期日 2017 年 1 月 5 日。

#### **7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**

##### **7.4.9.1 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。

##### **7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：本基金本报告期末未持有股票。

##### **7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截止本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

##### **7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截止本报告期末 2016 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。

#### 7.4.10 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 2016 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 4,050,688,357.33 元，无属于第一层次和第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第二层次 2,516,316,051.95 元，第三层次余额为 30,000,000.00 元，无属于第一层次的余额)。

##### (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

本基金本期净转入第三层次的金额为零元，无计入损益的第三层次金融工具公允价值变动(2015 年度：同)。

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产		合计
	交易性金融资产- 资产支持证券投资	权益工具投资	
2016 年 1 月 1 日	30,000,000.00	-	30,000,000.00
购买	-	-	-
出售	30,000,000.00	-	30,000,000.00
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	19,288.89	-	19,288.89
计入损益的利得或损失	19,288.89	-	19,288.89

2016 年 12 月 31 日	-	-	-
------------------	---	---	---

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

	交易性金融资产		合计
	资产支持证券投资	权益工具投资	
2015 年 1 月 1 日	-	-	-
购买	30,000,000.00	-	30,000,000.00
出售	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
计入损益的利得或损失	-	-	-
2015 年 12 月 31 日	30,000,000.00	-	30,000,000.00

于 2015 年 12 月 31 日仍持有的第三层次金融资产中计入 2015 年度损益的利得为零元。

#### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 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	4,050,688,357.33	21.67
	其中：债券	4,050,688,357.33	21.67
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,182,783,062.00	11.68
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	289,299,341.78	1.55
3	银行存款和结算备付金合计	12,355,579,513.87	66.09

4	其他各项资产	104,738,332.37	0.56
5	合计	18,693,789,265.57	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	3.34	
	其中:买断式回购融资	0.01	
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 11 月 29 日	25.82	巨额赎回	五个工作日内
2	2016 年 12 月 6 日	24.79	巨额赎回	五个工作日内
3	2016 年 12 月 1 日	22.46	巨额赎回	五个工作日内
4	2016 年 11 月 30 日	22.41	巨额赎回	五个工作日内

注: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	60
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	101
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	52

### 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。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	35.04	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	41.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	3.68	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	3.67	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	15.62	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.48	-

### 8.4 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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,465,530,175.67	7.84
	其中：政策性金融债	1,465,530,175.67	7.84
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	299,784,800.18	1.60
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,285,373,381.48	12.23
8	其他	-	-
9	合计	4,050,688,357.33	21.68

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

## 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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	140220	14 国开 20	2,900,000	293,824,647.42	1.57
2	160308	16 进出 08	2,400,000	239,730,544.16	1.28
3	111690997	16 泉州银行 CD013	2,000,000	199,054,460.34	1.07
4	111698436	16 浙江泰隆商行 CD037	2,000,000	198,277,946.12	1.06
5	111692568	16 长沙银行 CD046	2,000,000	198,241,709.96	1.06
6	111697256	16 东莞农村商业银行 CD069	2,000,000	195,928,115.17	1.05
7	150302	15 进出 02	1,700,000	170,140,520.27	0.91
8	111697820	16 贵阳银行 CD044	1,400,000	139,044,418.40	0.74
9	150417	15 农发 17	1,100,000	110,664,427.68	0.59
10	111697525	16 包商银行 CD049	1,100,000	109,297,604.80	0.58

## 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	3
报告期内偏离度的最高值	0.1120%
报告期内偏离度的最低值	-0.2818%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0538%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
-	2016 年 12 月 15 日	-0.25%	市场形势动荡	5 日内调整完毕

-	2016 年 12 月 16 日	-0.27%	市场形势动荡	5 日内调整完毕
-	2016 年 12 月 19 日	-0.28%	市场形势动荡	5 日内调整完毕

### 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

## 8.8 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。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1

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。

**8.9.2** 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。

### 8.9.3 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	62,283,621.93
4	应收申购款	42,454,710.44
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	104,738,332.37

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
浦银安盛日日盈货币 A	20,185	1,530.93	3,380,634.07	10.94%	27,521,198.23	89.06%
浦银安盛日日盈货币 B	25	646,575,353.59	16,156,175,787.63	99.95%	8,208,052.03	0.05%
浦银安盛日日盈货币 D	349,579	7,126.37	105,720.62	0.00%	2,491,123,848.76	100.00%
合计	369,789	50,532.91	16,159,662,142.32	86.48%	2,526,853,099.02	13.52%

### 9.3 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	浦银安盛日日盈货币 A	708,730.70	2.29%
	浦银安盛日	1,359,105.32	0.01%



	日盈货币 B		
	浦银安盛日日盈货币 D	685,005.63	0.03%
	合计	2,752,841.65	0.01%

#### 9.4 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	浦银安盛日日盈货币 A	0~10
	浦银安盛日日盈货币 B	0
	浦银安盛日日盈货币 D	0~10
	合计	0~10
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

	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	1,221,379,122.72	-
本报告期期初基金份额总额	55,102,593.17	7,100,114,682.10	2,825,283,121.20
本报告期基金总申购份额	165,977,292.76	53,628,016,996.44	14,170,698,050.57
减：本报告期基金总赎回份额	190,178,053.63	44,563,747,838.88	14,504,751,602.39

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	30,901,832.30	16,164,383,839.66	2,491,229,569.38

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

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。

### 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 117,000 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 3 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、托管人及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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
长江证券	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申万宏源证券、东方证券、海通证券、安信证券、国信证券、第一创业证券和西藏东方财富证券交易单元。

## 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本年度无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

## § 12 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 日发布浦银安盛基金管理有限公司关于变更公司经营范围及修订《公司章程》的公告，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，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。

浦银安盛基金管理有限公司  
2017 年 3 月 30 日