

# 浦银安盛日日盈货币市场基金 2016 年年度 报告

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 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	15
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>16</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	16
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	18
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.....	20
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	21
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	26
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	26
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.....	27
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>27</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	27
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.....	27
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.....	27
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>27</b>
6.1 审计报告基本信息.....	27
6.2 审计报告的基本内容.....	28
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>29</b>
7.1 资产负债表.....	29
7.2 利润表.....	30
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	31
7.4 报表附注.....	32
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>60</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	60
8.2 债券回购融资情况.....	61
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	61
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.....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
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.....	62

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	63
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	63
8.9 投资组合报告附注 .....	64
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>64</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	65
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的情况 .....	65
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>66</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>66</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	66
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 .....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	67
11.4 基金投资策略的改变 .....	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	67
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 .....	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	67
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	68
11.9 其他重大事件 .....	68
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>75</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>76</b>
13.1 备查文件目录 .....	76
13.2 存放地点 .....	76
13.3 查阅方式 .....	76

## § 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		
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 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 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 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 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	陆志俊
	联系电话	021-23212888	95559
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	luzj@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		中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 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.	2016 年	2015 年	2014 年 3 月 25 日(基金合同生效)
----	--------	--------	-------------------------

1. 1 期间数据和指标							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	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

资产净值									
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
3.1.3 累计期末指标	2016 年末			2015 年末			2014 年末		
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

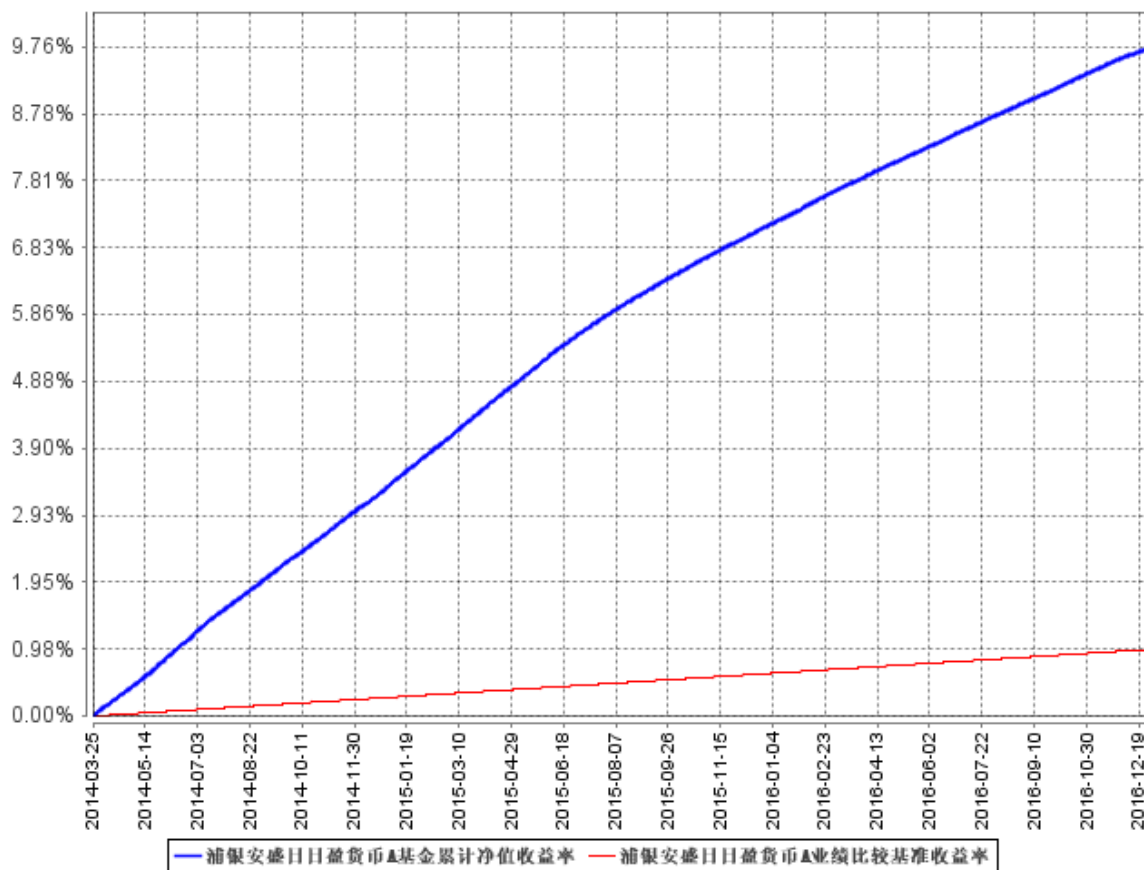
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.6274%	0.0011%	0.0880%	0.0000%	0.5394%	0.0011%
过去六个月	1.2761%	0.0009%	0.1761%	0.0000%	1.1000%	0.0009%
过去一年	2.6768%	0.0012%	0.3506%	0.0000%	2.3262%	0.0012%
自基金合同 生效起至今	10.4944%	0.0035%	0.9751%	0.0000%	9.5193%	0.0035%

浦银安盛日日盈货币 D

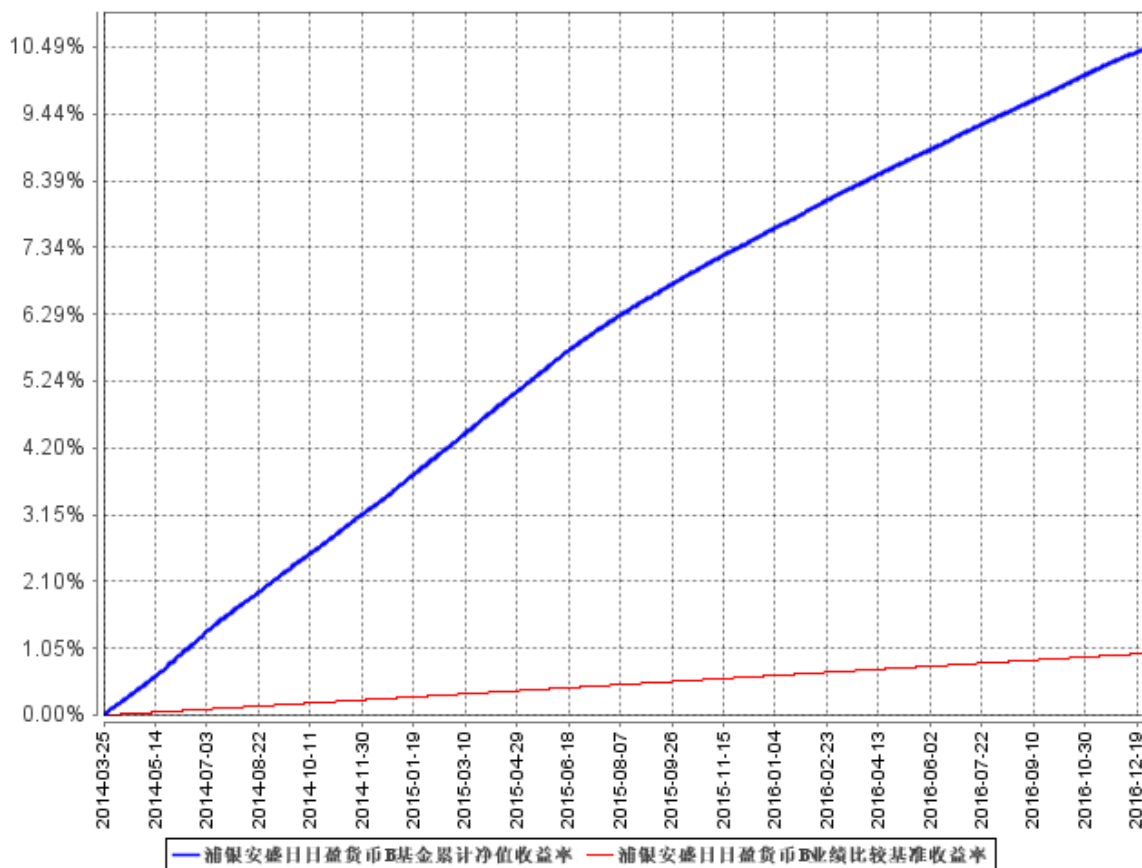
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.5666%	0.0011%	0.0880%	0.0000%	0.4786%	0.0011%
过去六个月	1.1538%	0.0009%	0.1761%	0.0000%	0.9777%	0.0009%
过去一年	2.4305%	0.0012%	0.3506%	0.0000%	2.0779%	0.0012%
自基金合同 生效起至今	8.8718%	0.0036%	0.9112%	0.0000%	7.9606%	0.0036%

### 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

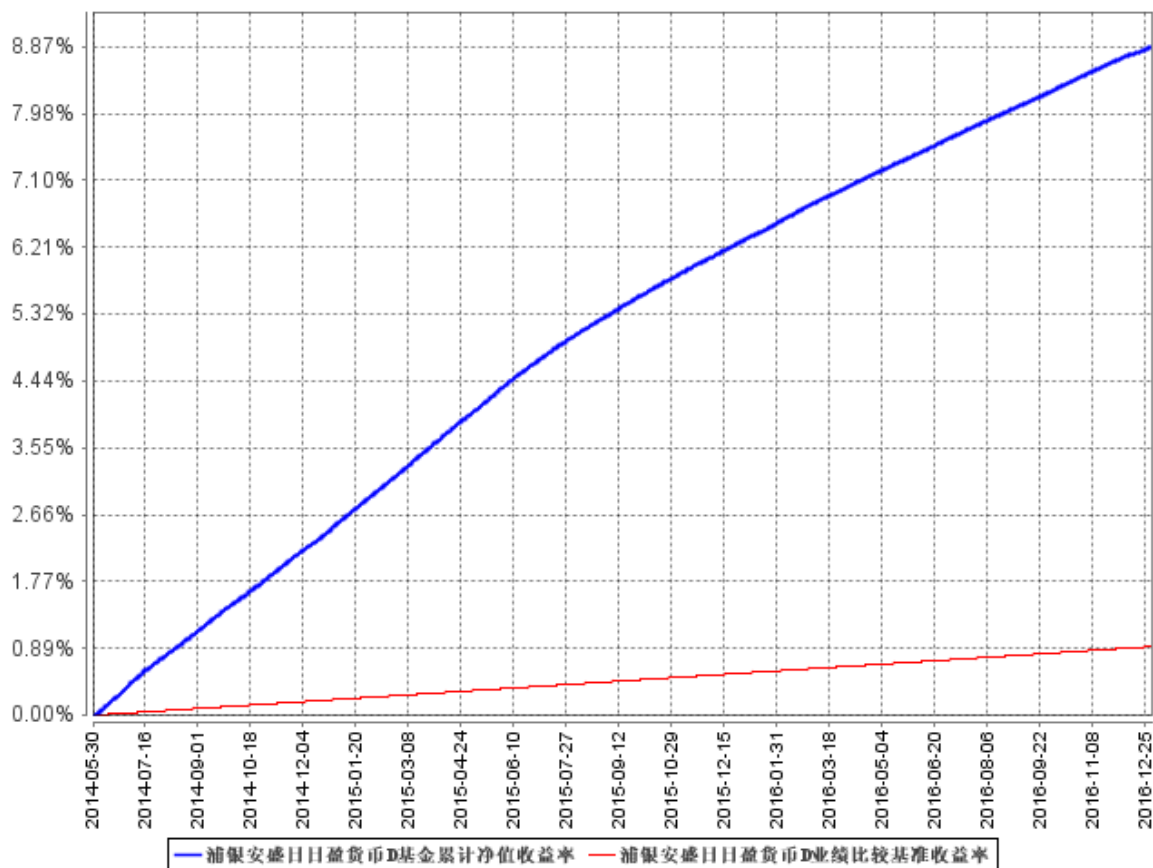
浦银安盛日日盈货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 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



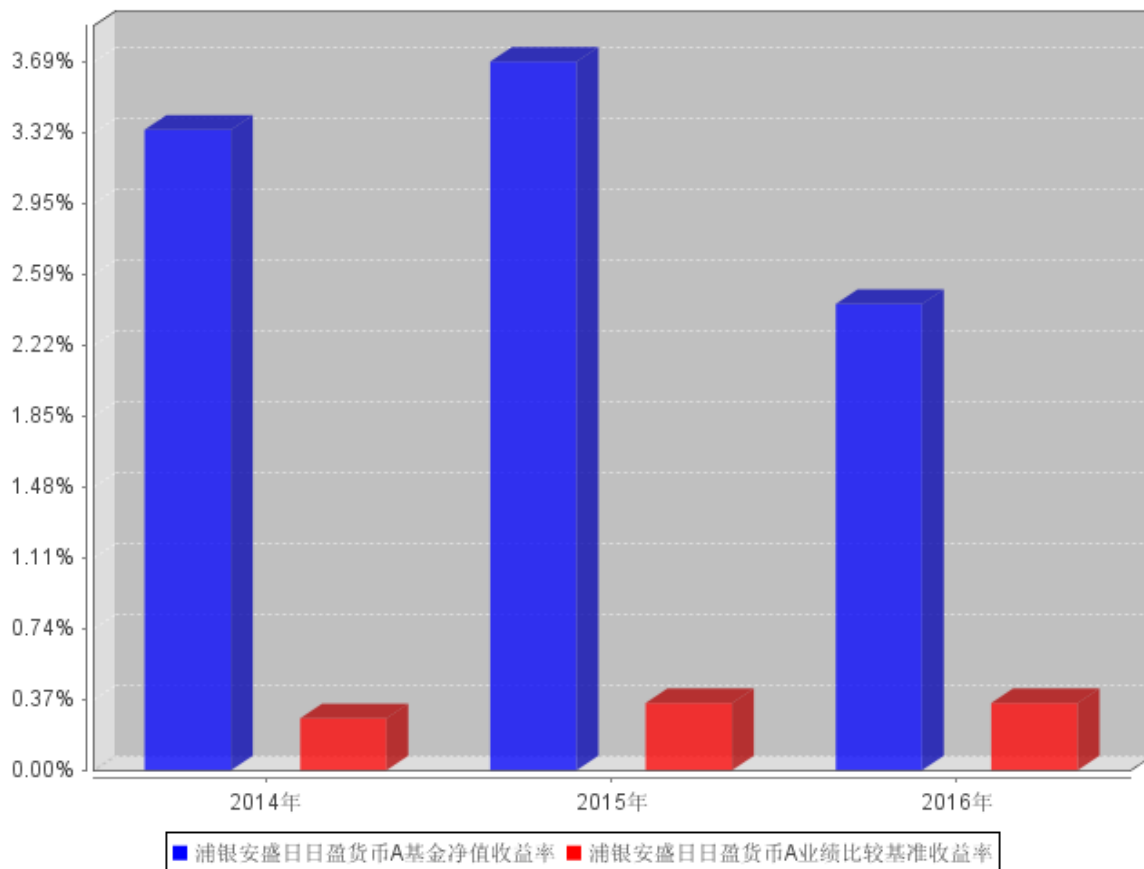
### 浦银安盛日日盈货币D基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



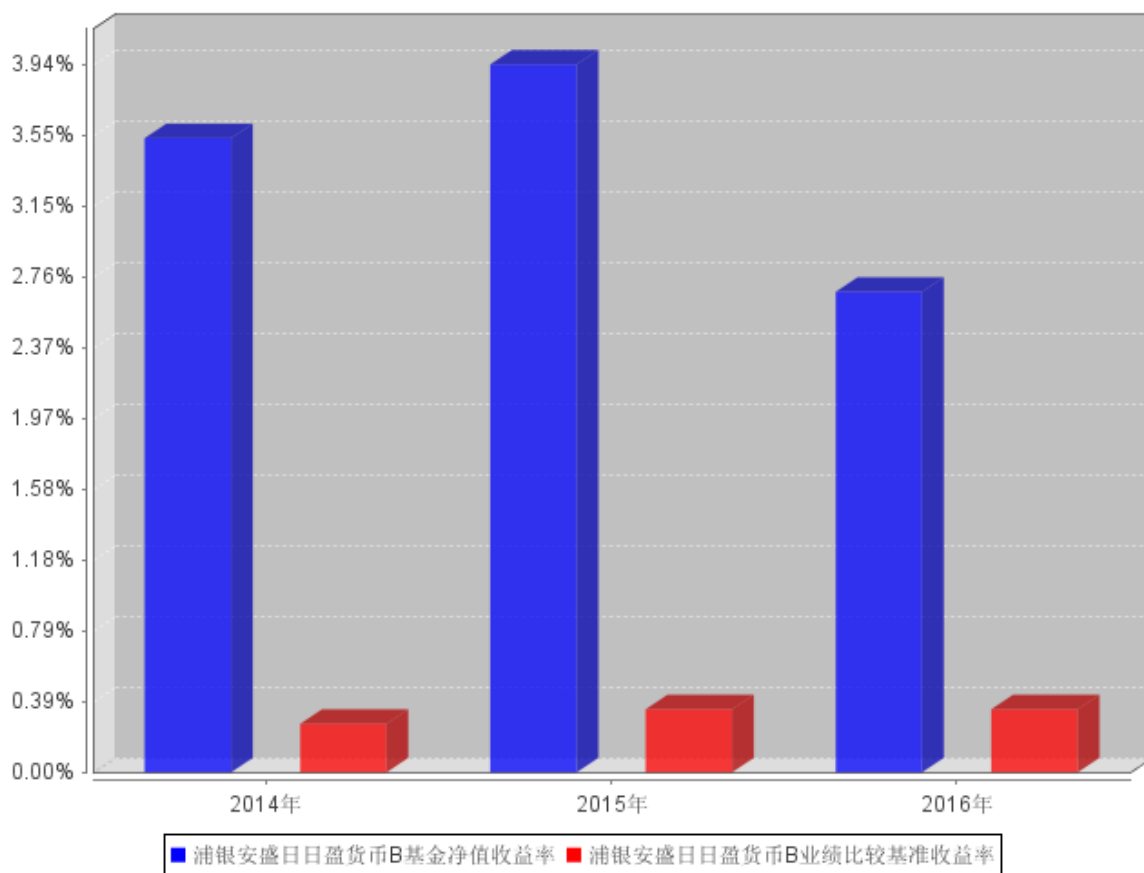
注：本基金于 2014 年 5 月 30 日开始分为 A、B、D 三类，具体内容详见本基金管理人于 2014 年 5 月 28 日刊登的《关于浦银安盛日日盈货币市场基金增加基金份额类别的公告》。

### 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

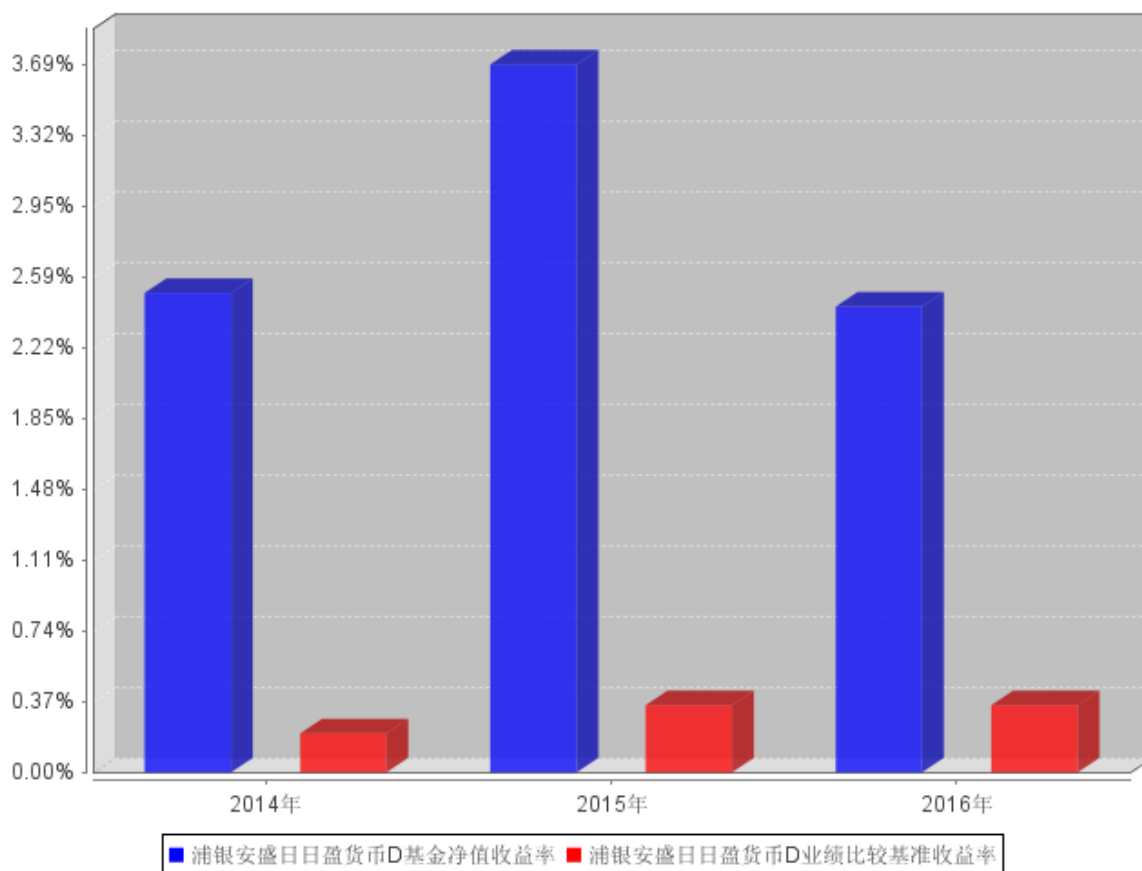
浦银安盛日日盈货币A自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



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	

单位：人民币元

浦银安盛日日盈货币 B					
-------------	--	--	--	--	--

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	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	

单位：人民币元

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	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

	银安盛日日鑫货币基金基金经理				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。2016 年，合规风控工作仍然是对公司进行全面风险管理，涵盖了制度内控、法律合规、信息披露、风险监控、绩效评估、内部稽核及反洗钱等工作。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。合规法律方面，在公司全体同仁的共同努力下，公司合规及信披记录良好，为公司各项业务的开展打下了坚实基础；风险管理方面，进一步开发并优化量化风险评估模型，利用数字化、专业化管理提升风险评估、监测及预警效能，并提升风险化解及处置能力；稽核方面，根据监管要求及行业热议风险点，有针对的开展了计划外专项稽核，及时查找和发现的潜在风险，提出了完善制度流程及加强执行的有效建议。

### 1、进一步健全合规风控团队，提高团队的专业素养

2016 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，合规风控团队不断加强自身专业素质的提升，全面提高专业素质，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、互相协同、勤奋上进的良好局面。

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 workflows，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。

对外沟通上，持续与监管机构、交易所、自律协会、外部律师、外部会计师及双方股东对口部门保持密切良好的沟通，同时与公司其他部门保持良好协作，配合和支持部门间需求接洽。

### 2、进一步建立健全风险控制体系

#### (1) 引入独立买方信评机构，初步建立第二层级的信用风险防范机制

2016 年，债券市场信用风险事件频发，公司合规风控部严格执行投资级（AA 级以上）监控，并引入了中债资信（市场上唯一的买方评级机构）的信用风险关注债券三级预警名单，建立灰名单机制并每周向固收部发送监控周报；固收部根据自主评估，同时参考合规风控部固收监控周报，再次回顾持仓及债券库，发现存在信用风险隐患的债券，立即进行卖出及出库处理，在稳健管控信用风险的基础上追求积极回报。建立上述机制后，公司固收投资的信用风险得到良好的控制。

#### (2) 对投资组合进行定期风险评估

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。同时，2016 年公司发布实施了《流动性风险管理制度》及《流动性风险应急预案》，对流动性风险监控体系进行了进一步完善，通过日常流动性监测及定期、不定期的压力测试，对流动性风险进行有效的防范。

(3) 建立健全业绩归因分析及评估模型，助力绩效考核及业绩持续改善

合规风控部位绩效考核委员会提供了量化绩效考核的数据支持，同时不断完善业绩归因模型，直观体现业绩和风险来源及风险调整后收益，帮助投研部门回顾投资成功经验及有待改善之处。

(4) 对投资组合的公平交易及异常交易进行事前控制和事后分析

合规风控部继续着力于对公平交易、异常交易相关工作的提高，对公平交易及异常交易事后分析进行了进一步的完善，以进一步确保投资组合的合法合规。

(5) 对公司新产品提供高效、有力的支持

2016 年，公司新发行了 14 只专户产品，9 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。

(6) 进一步完善子公司内部控制体系

2016 年，子公司内部控制体系得到进一步完善：

业务部门的一线风险控制。子公司设金融机构部、运营管理部、投资管理部、资金管理部、财富管理中心等业务部门，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。子公司在总经理领导下设立执行委员会，并在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。母公司对子公司的内控管理正在从事前评审和事中审核，逐步转向事前咨询及讨论以及事后稽核，力争在保持子公司独立性、实现母子公司风险隔离的基础上，有效发挥母公司对子公司风险内控方面的监督管理作用。

(7) 协助人力资源部完善了合规风控考核体系

2016 年，公司进一步加大对各部门、各岗位的风险事件考核力度。公司继续按照《加强日常风险考核管理办法》，依照不同等级风险事件，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，责任明确、落实到人，并根据中风险及以上事件对责任人员采取扣除部分季度工资的惩处，有力地督促了相关人员对公司制度的执行，有效地推动了公司全体员工合规意识的提高。

### 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。

2016 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) 完成了对子公司业务的专项审计；
- (3) 根据监管部门要求，对子公司开展了风险管理专项自查与评估工作；
- (4) 根据监管部门要求，公司及子公司开展了互联网金融风险整治的自查工作；
- (5) 根据监管部门要求，公司开展了中小投资者合法权益保护的专项自查工作；
- (6) 根据监管部门要求，公司开展了私募资管业务合规性专项审计工作。

总体来说，2016 年度由于人员配置有限，稽核工作的深度及广度还有待进一步提高。2017 年，合规风控部将在公司预算内进一步完善人员配置，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) 2016 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。

2016 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。2016 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) 公司 2016 年对新入职员工分四场进行了入职合规培训，内容包括道德规范、业务运作、公司利益冲突管理、市场营销、投资及交易行为等相关合规要求；



(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, 2016 全年为业务人员提供了两场现场专项合规培训(不含反洗钱合规培训), 并通过邮件发送等方式持续对全体员工进行合规教育;

(3) 对反洗钱相关人员开展了一场反洗钱合规培训, 共计 2.5 个小时 17 人次。

2016 年, 公司制定下发了《浦银安盛基金管理有限公司合规手册》, 将作为员工合规培训教育的一个新的有效方式, 从而进一步丰富和完善公司合规培训教育体系, 全方位推进公司合规水平的进一步提高。

#### 8、督导和推动公司的制度建设和完善

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) 客户识别和客户风险等级划分;(3) 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;(4) 向中国人民银行定期报送可疑交易;(5) 定期根据监管要求向贵局及人民银行报送报告报表等各项材料;(6) 进行反洗钱合规培训;(7) 进行反洗钱的专项审计及自评估。

#### 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同业公会的相关会议。

#### 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 2016 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》。

## 4.8 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 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。

#### 4.9 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

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	7.4.7.1	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	7.4.7.2	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	2,182,783,062.00	2,723,122,531.65
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	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	7.4.7.6	-	-
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	7.4.7.3	-	-
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	7.4.7.7	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	7.4.7.8	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	7.4.7.9	18,686,515,241.34	9,980,500,396.47
未分配利润	7.4.7.10	-	-
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	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
<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	7.4.7.11	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	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,607,368.07	20,610,813.16
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	19,288.89	-
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）	7.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	-	-
<b>减: 二、费用</b>		83,280,632.92	28,054,727.72
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	48,121,838.43	14,728,989.27
2. 托管费	7.4.10.2.2	14,582,375.35	4,463,330.11
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	8,788,143.21	7,120,226.23
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
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	7.4.7.20	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(净值减少以“-”号填列)	8,706,014,844.87	-	8,706,014,844.87
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	18,686,515,241.34	-	18,686,515,241.34

项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
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：

                    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(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 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。

##### **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和资产支持证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 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别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。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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，本基金确定以下类别股票投资和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：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的

指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 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。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

## 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

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末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 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	16,579,513.87	10,319,482.19
定期存款	12,339,000,000.00	4,583,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	7,979,000,000.00	1,663,000,000.00
存款期限 1 个月以内	3,100,000,000.00	1,510,000,000.00
存款期限 3 个月以上	1,260,000,000.00	1,410,000,000.00
其他存款	-	-
合计：	12,355,579,513.87	4,593,319,482.19

注：1、定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 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	4,050,688,357.33	4,036,228,500.00	-14,459,857.33	-0.0774%
	合计	4,050,688,357.33	4,036,228,500.00	-14,459,857.33	-0.0774%
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债	交易所市场	-	-	-	-

券	银行间市场	2,516,316,051.95	2,525,122,000.00	8,805,948.05	0.0882%
	合计	2,516,316,051.95	2,525,122,000.00	8,805,948.05	0.0882%

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。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金在本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	2,182,783,062.00	289,299,341.78
合计	2,182,783,062.00	289,299,341.78
项目	上年度末 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	2,723,122,531.65	868,816,710.20
合计	2,723,122,531.65	868,816,710.20

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日						
	债券代码	债券名称	约定 返售日	估值单价	数量（张）	估值 总额	其中：已出 售 或再质押总 额
银行 间	111614218	16 江苏银 行 CD218	2017年1 月3日	96.39	1,000,000	96,390,000.00	-
银行 间	111615363	16 民生 CD363	2017年1 月3日	96.43	1,000,000	96,430,000.00	-
银行 间	111616243	16 上海银 行 CD243	2017年1 月3日	96.76	1,000,000	96,760,000.00	-
合计					3,000,000	289,580,000.00	-
上年度末							

	2015 年 12 月 31 日						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量 (张)	估值总额	其中: 已出售或再质押总额
银行间	011599883	15 红狮 SCP004	2016 年 1 月 4 日	100.98	500,000	50,490,000.00	-
银行间	041564093	15 瓯交投 CP002	2016 年 1 月 7 日	100.74	500,000	50,370,000.00	-
银行间	011599943	15 山钢 SCP008	2016 年 1 月 7 日	100.49	2,000,000	200,980,000.00	-
银行间	041572003	15 青投 CP001	2016 年 1 月 11 日	104.53	300,000	31,359,000.00	-
银行间	011599821	15 森工集 SCP002	2016 年 1 月 14 日	101.02	1,000,000	101,020,000.00	-
银行间	011518003	15 铁物资 SCP003	2016 年 1 月 15 日	103.53	1,000,000	103,530,000.00	-
银行间	011599527	15 宏图 SCP002	2016 年 1 月 19 日	101.36	600,000	60,816,000.00	-
银行间	011599486	15 南京医药 SCP002	2016 年 1 月 19 日	101.72	400,000	40,688,000.00	-
银行间	011598124	15 均瑶 SCP002	2016 年 1 月 25 日	100.30	800,000	80,240,000.00	-
银行间	041573005	15 丹东港 CP001	2016 年 1 月 26 日	101.27	1,000,000	101,270,000.00	-
银行间	041573005	15 丹东港 CP001	2016 年 1 月 26 日	101.27	500,000	50,635,000.00	-
合计					8,600,000	871,398,000.00	-

#### 7.4.7.5 应收利息

单位: 人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	7,434.05	1,393.08
应收定期存款利息	14,748,655.48	3,495,313.22
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	18,450.00	3,150.00
应收债券利息	41,729,730.98	39,892,918.94
应收买入返售证券利息	5,779,351.42	2,683,231.91
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-



合计	62,283,621.93	46,076,007.15
----	---------------	---------------

注：此处其他列示的是基金存于上交所与深交所的结算保证金的期末应收利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金在本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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	83,243.18	38,397.06
合计	83,243.18	38,397.06

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	151.74	6,944.58
预提费用	357,000.00	360,000.00
其他	5,429.57	-
合计	362,581.31	366,944.58

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

浦银安盛日日盈货币 A		
项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	55,102,593.17	55,102,593.17
本期申购	165,977,292.76	165,977,292.76
本期赎回(以“-”号填列)	-190,178,053.63	-190,178,053.63
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	30,901,832.30	30,901,832.30

金额单位：人民币元

浦银安盛日日盈货币 B		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,100,114,682.10	7,100,114,682.10
本期申购	53,628,016,996.44	53,628,016,996.44
本期赎回(以“-”号填列)	-44,563,747,838.88	-44,563,747,838.88
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	16,164,383,839.66	16,164,383,839.66

金额单位：人民币元

浦银安盛日日盈货币 D		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,825,283,121.20	2,825,283,121.20
本期申购	14,170,698,050.57	14,170,698,050.57
本期赎回(以“-”号填列)	-14,504,751,602.39	-14,504,751,602.39
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	2,491,229,569.38	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。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

浦银安盛日日盈货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	1,028,307.29	-	1,028,307.29
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	-1,028,307.29	-	-1,028,307.29
本期末	-	-	-

单位：人民币元

浦银安盛日日盈货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	303,085,866.36	-	303,085,866.36
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	-303,085,866.36	-	-303,085,866.36
本期末	-	-	-

单位：人民币元

浦银安盛日日盈货币 D			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	72,300,952.66	-	72,300,952.66
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	-72,300,952.66	-	-72,300,952.66
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	107,861.57	20,112.05
定期存款利息收入	252,233,489.22	94,615,971.42
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	44,222.22	205,741.89
其他	-	-
合计	252,385,573.01	94,841,825.36

注：此处其他列示的是基金上交所与深交所结算保证金利息以及基金申购款滞留利息。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

### 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 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
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	3,607,368.07	20,610,813.16
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	3,607,368.07	20,610,813.16

#### 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 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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	14,096,575,866.91	4,267,923,044.91
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	13,957,371,883.27	4,120,576,255.84
减：应收利息总额	135,596,615.57	126,735,975.91
买卖债券差价收入	3,607,368.07	20,610,813.16

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期间及上年度可比期间均无赎回差价债券投资收益。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期间及上年度可比期间均无申购差价债券投资收益。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

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
卖出资产支持证券成交总额	30,450,419.18	-
减：卖出资产支持证券成本总额	30,000,000.00	-

减：应收利息总额	431,130.29	-
资产支持证券投资收益	19,288.89	-

注：本基金上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间收益金 额 2015年1月1日至2015 年12月31日
权证投资收益	-	-
股指期货-投资收益	-	-

#### 7.4.7.16 股利收益

注：1、本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无公允价值变动损益。

#### 7.4.7.18 其他费用

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
审计费用	117,000.00	120,000.00
信息披露费	240,000.00	240,000.00
上清所债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
中债登债券托管帐户服务费	18,000.00	18,000.00
银行费用	50,407.68	39,324.22
其他	1,600.00	850.00
合计	445,007.68	436,174.22

注：1、此处其他费用列示的是上清所费用。

## 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

财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自2016年5月1日起执行。

根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)，2017年7月1日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## 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	基金管理人的股东、基金代销机构

浦东发展银行")	
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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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。

###### 7.4.10.1.4 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。

###### 7.4.10.1.5 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。

##### 7.4.10.2 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	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

**7.4.10.2.2 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

**7.4.10.2.3 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			
	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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 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。

#### 7.4.10.4 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

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

#### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

##### 浦银安盛日日盈货币 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 银行股份有限 公司	9,507,328,688.59	58.82%	1,000,292,732.92	14.09%

**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 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。

**7.4.10.6 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。

**7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

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	本期利润分配合计	备注
1,029,889.95	-	-1,582.66	1,028,307.29	-

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	本期利润分配合计	备注
302,293,624.90	-	792,241.46	303,085,866.36	-

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	本期利润分配合计	备注
72,312,883.65	-	-11,930.99	72,300,952.66	-

注：本基金在本年度累计分配收益 376,415,126.31 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 375,636,398.50 元(附注 7.4.7.9)，计入应付收益科目 778,727.81 元。

#### 7.4.12 期末（2016 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

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。

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 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。

##### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.13 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，主要负责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，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可能产生的损失。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中国交通银行和其他商业信誉良好的股份制银行，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。

##### 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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
A-1	299,784,800.18	980,357,109.89
A-1 以下	-	-
未评级	2,785,181,844.07	810,547,076.15
合计	3,084,966,644.25	1,790,904,186.04

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。

### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	965,721,713.08	280,518,093.56
合计	965,721,713.08	280,518,093.56

注：持有发行期限在一年以上的债券按其债项评级作为长期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为短期信用评级进行列示。

### 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%。

本基金所承担的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。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	12,355,579,513.87	-	-	-	12,355,579,513.87
交易性金融资产	4,050,688,357.33	-	-	-	4,050,688,357.33
买入返售金融资产	2,182,783,062.00	-	-	-	2,182,783,062.00
应收利息	-	-	-	62,283,621.93	62,283,621.93
应收申购款	-	-	-	42,454,710.44	42,454,710.44
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	18,589,050,933.20	-	-	104,738,332.37	18,693,789,265.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	100,492.69	100,492.69
应付管理人报酬	-	-	-	3,456,334.39	3,456,334.39
应付托管费	-	-	-	1,047,374.09	1,047,374.09
应付销售服务费	-	-	-	678,857.93	678,857.93
应付交易费用	-	-	-	83,243.18	83,243.18
应付利润	-	-	-	1,545,140.64	1,545,140.64
其他负债	-	-	-	362,581.31	362,581.31
负债总计	-	-	-	7,274,024.23	7,274,024.23
利率敏感度缺口	18,589,050,933.20	-	-	97,464,308.14	18,686,515,241.34
上年度末 2015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	4,593,319,482.19	-	-	-	4,593,319,482.19
交易性金融资产	2,546,316,051.95	-	-	-	2,546,316,051.95
买入返售金融资产	2,723,122,531.65	-	-	-	2,723,122,531.65
应收利息	-	-	-	46,076,007.15	46,076,007.15



应收申购款	-	-	-	76,693,491.54	76,693,491.54
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,862,758,065.79	-	-	122,769,498.69	9,985,527,564.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,140,278.80	1,140,278.80
应付管理人报酬	-	-	-	1,593,304.34	1,593,304.34
应付托管费	-	-	-	482,819.49	482,819.49
应付销售服务费	-	-	-	639,010.91	639,010.91
应付交易费用	-	-	-	38,397.06	38,397.06
应付利润	-	-	-	766,412.83	766,412.83
其他负债	-	-	-	366,944.58	366,944.58
负债总计	-	-	-	5,027,168.01	5,027,168.01
利率敏感度缺口	9,862,758,065.79	-	-	-117,742,330.68	9,980,500,396.47

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。

#### 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（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率上升 25 基点	-4,077,427.43	-1,846,138.14
	市场利率下降 25 基点	4,088,563.11	1,850,393.00

#### 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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	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	4,050,688,357.33	21.68	2,516,316,051.95	25.21
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	30,000,000.00	0.30
合计	4,050,688,357.33	21.68	2,546,316,051.95	25.51

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2016 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%（2015 年 12 月 31 日同），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（2015 年 12 月 31 日同）。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

#### 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 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量为零元，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	各期限负债占基金资
----	--------	------------	-----------

		净值的比例 (%)	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所有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	20,185	1,530.93	3,380,634.07	10.94%	27,521,198.23	89.06%



货币 A						
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%

## 9.2 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	708,730.70	2.29%
	浦银安盛日日盈货币 B	1,359,105.32	0.01%
	浦银安盛日日盈货币 D	685,005.63	0.03%
	合计	2,752,841.65	0.01%

## 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、基金投资和研究部门负责人持	浦银安盛日日盈货币 A	0~10

有本开放式基金	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。

### 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	浦银安盛基金管理有限公司关	报刊及公司网站	2016 年 1 月 5

	于调整长期停牌股票估值方法 的公告		日
2	浦银安盛基金管理有限公司关于 于调整长期停牌股票估值方法 的公告	报刊及公司网站	2016 年 1 月 8 日
3	浦银安盛基金管理有限公司关于 于调整长期停牌股票估值方法 的公告	报刊及公司网站	2016 年 1 月 12 日
4	浦银安盛日日盈货币市场基金 2015 年第 4 季度报告	报刊及公司网站	2016 年 1 月 21 日
5	关于旗下部分基金在上海凯石 财富基金销售有限公司开通基 金转换业务的公告	报刊及公司网站	2016 年 1 月 27 日
6	浦银安盛基金管理有限公司关于 于浦银安盛消费升级混合基金 C 类在公司直销柜台和电子直销 平台开通日常转换、定期定额投 资业务的公告	报刊及公司网站	2016 年 1 月 27 日
7	浦银安盛基金管理有限公司关于 于调整长期停牌股票估值方法 的公告	报刊及公司网站	2016 年 1 月 28 日
8	浦银安盛基金管理有限公司关于 于调整长期停牌股票估值方法 的公告	报刊及公司网站	2016 年 1 月 29 日
9	关于浦银安盛日日盈货币市场 基金于春节假期前两个工作日 暂停 A 类及 B 类份额的申购、 定投及转换转入业务的公告	报刊及公司网站	2016 年 2 月 2 日
10	关于从业人员在子公司兼职情	报刊及公司网站	2016 年 2 月 5

	况的公告		日
11	浦银安盛基金管理有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2016年2月26日
12	浦银安盛基金管理有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2016年3月1日
13	浦银安盛关于旗下部分基金新增深圳众禄金融控股股份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	2016年3月10日
14	浦银安盛关于旗下部分基金新增深圳富济财富管理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	2016年3月17日
15	浦银安盛基金管理有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2016年3月17日
16	浦银安盛基金管理有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2016年3月18日
17	浦银安盛关于旗下部分基金新增奕丰金融服务（深圳）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	2016年3月22日
18	关于浦银安盛日日盈货币市场基金于清明节假期前两个工作日暂停 A 类及 B 类份额的申	报刊及公司网站	2016年3月29日

	购、定投及转换转入业务的公告		
19	浦银安盛关于旗下部分基金新增上海联泰资产管理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	2016年3月30日
20	浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	报刊及公司网站	2016年3月30日
21	浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告（正文）	公司网站	2016年3月30日
22	浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告（摘要）	报刊及公司网站	2016年3月30日
23	关于浦银安盛睿智精选灵活配置混合型基金在浦发银行开通基金定投及基金转换业务的公告	报刊及公司网站	2016年4月5日
24	关于浦银安盛睿智精选灵活配置混合基金在交通银行开通基金定投和基金转换业务及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2016年4月5日
25	关于新增中信银行为浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金代销机构并开通基金定投及基金转换业务的公告	报刊及公司网站	2016年4月7日
26	浦银安盛日日盈货币市场基金 2016 年第 1 季度报告	报刊及公司网站	2016年4月20日

27	关于变更公司经营范围及修订 《公司章程》的公告	报刊及公司网站	2016年4月26 日
28	关于浦银安盛日日盈货币市场 基金于劳动节假期前两个工作 日暂停 A 类及 B 类份额的申 购、定投及转换转入业务的公告	报刊及公司网站	2016年4月27 日
29	浦银安盛日日盈货币市场基金 招募说明书摘要更新	报刊及公司网站	2016年5月6 日
30	浦银安盛日日盈货币市场基金 招募说明书正文更新	公司网站	2016年5月6 日
31	关于从业人员在子公司兼职情 况的公告	报刊及公司网站	2016年5月10 日
32	浦银安盛关于旗下部分基金新 增深圳市新兰德证券投资咨询 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	公司网站	2016年5月12 日
33	浦银安盛基金管理有限公司关 于旗下部分基金在上海联泰资 产管理有限公司开通基金转换 业务的公告	公司网站	2016年5月12 日
34	浦银安盛关于旗下部分基金新 增平安证券为代销机构并开通 基金定投业务和基金转 换业务 并参加其费率优惠活动的公告	公司网站	2016年5月31 日
35	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 A 类及 B 类份额的申 购、定投及转换转入业务的公告	公司网站	2016年6月6 日



36	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	公司网站	2016年6月13日
37	浦银安盛基金管理有限公司关于电子直销平台通联支付渠道新增招商银行卡和交通银行卡的公告	公司网站	2016年6月17日
38	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海银行为代销机构并开通基金定投业务和基金转换业务的公告	公司网站	2016年7月19日
39	浦银安盛日日盈货币市场基金2016年第2季度报告	报刊及公司网站	2016年7月21日
40	浦银安盛关于旗下部分基金新增北京创金启富投资管理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	2016年7月22日
41	浦银安盛关于旗下部分基金新增中证金牛（北京）投资咨询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	2016年7月22日
42	浦银安盛关于旗下部分基金新增申万宏源西部为代销机构的公告	报刊及公司网站	2016年7月22日
43	浦银安盛关于旗下部分基金在	报刊及公司网站	2016年7月22日

	申万宏源及申万宏源西部开通基金定投及基金转换业务并参加费率优惠活动的公告		日
44	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信建投证券开通基金定投业务并参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2016年8月3日
45	浦银安盛日日盈货币市场基金2016年半年度报告正文	公司网站	2016年8月29日
46	浦银安盛日日盈货币市场基金2016年半年度报告摘要	报刊及公司网站	2016年8月29日
47	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增德邦证券为代销机构并开通基金定投及基金转换业务和参加申购费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2016年9月5日
48	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 类及 B 类份额的申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及公司网站	2016年9月9日
49	浦银安盛关于旗下部分基金新增北京晟视天下投资管理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	2016年9月26日
50	关于浦银安盛日日盈货币市场基金于国庆节假期前两个工作日暂停 A 类及 B 类份额的申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及公司网站	2016年9月27日

51	浦银安盛日日盈货币市场基金 2016 年第 3 季度报告	报刊及公司网站	2016 年 10 月 25 日
52	浦银安盛日日盈货币市场基金 招募说明书正文（更新）	公司网站	2016 年 11 月 7 日
53	浦银安盛日日盈货币市场基金 招募说明书摘要（更新）	报刊及公司网站	2016 年 11 月 7 日
54	浦银安盛关于旗下部分基金新 增乾道金融信息服务（北京）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	2016 年 12 月 2 日
55	浦银安盛关于旗下部分基金新 增北京新浪仓石基金销售有限 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	2016 年 12 月 16 日
56	浦银安盛关于旗下部分基金新 增北京汇成基金销售有限公司 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	2016 年 12 月 24 日
57	浦银安盛基金管理有限公司关 于电子直销平台开展现金宝转 换（含 定期定额转换）业务补 差费率优惠的公告	报刊及公司网站	2016 年 12 月 28 日

## § 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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  
2017 年 3 月 30 日