

浦银安盛货币市场证券投资基金 2017 年第 3 季度报告

2017 年 9 月 30 日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 10 月 25 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛货币		
基金主代码	519509		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011 年 3 月 9 日		
报告期末基金份额总额	31,712,595,526.35 份		
投资目标	力求在保持基金资产安全性和良好流动性的基础上，获得超越业绩比较基准的稳定收益。		
投资策略	根据对短期利率变动的预测，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略，利用基本分析和数量化分析方法，通过对短期金融工具的积极投资，在控制风险和保证流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。		
业绩比较基准	银行活期存款利率（税后）		
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。		
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司		
基金托管人	中信银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B	浦银安盛货币 E
下属分级基金的交易代码	519509	519510	519516
报告期末下属分级基金的份额总额	462,150,134.26 份	31,245,577,695.04 份	4,867,697.05 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年7月1日—2017年9月30日）		
	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B	浦银安盛货币 E
1. 本期已实现收益	2,535,684.48	370,114,328.10	57,402.56
2. 本期利润	2,535,684.48	370,114,328.10	57,402.56
3. 期末基金资产净值	462,150,134.26	31,245,577,695.04	4,867,697.05

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金收益分配按日结转份额。浦银安盛货币市场证券投资基金于 2014 年 9 月 12 日刊登公告，自 2014 年 9 月 15 日起为指定的特定销售渠道增加浦银安盛货币市场证券投资基金 E 类份额，该类份额仅能通过特定的销售渠道办理申购、赎回等业务。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浦银安盛货币 A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.0038%	0.0004%	0.0883%	0.0000%	0.9155%	0.0004%

浦银安盛货币 B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.0644%	0.0004%	0.0883%	0.0000%	0.9761%	0.0004%

浦银安盛货币 E

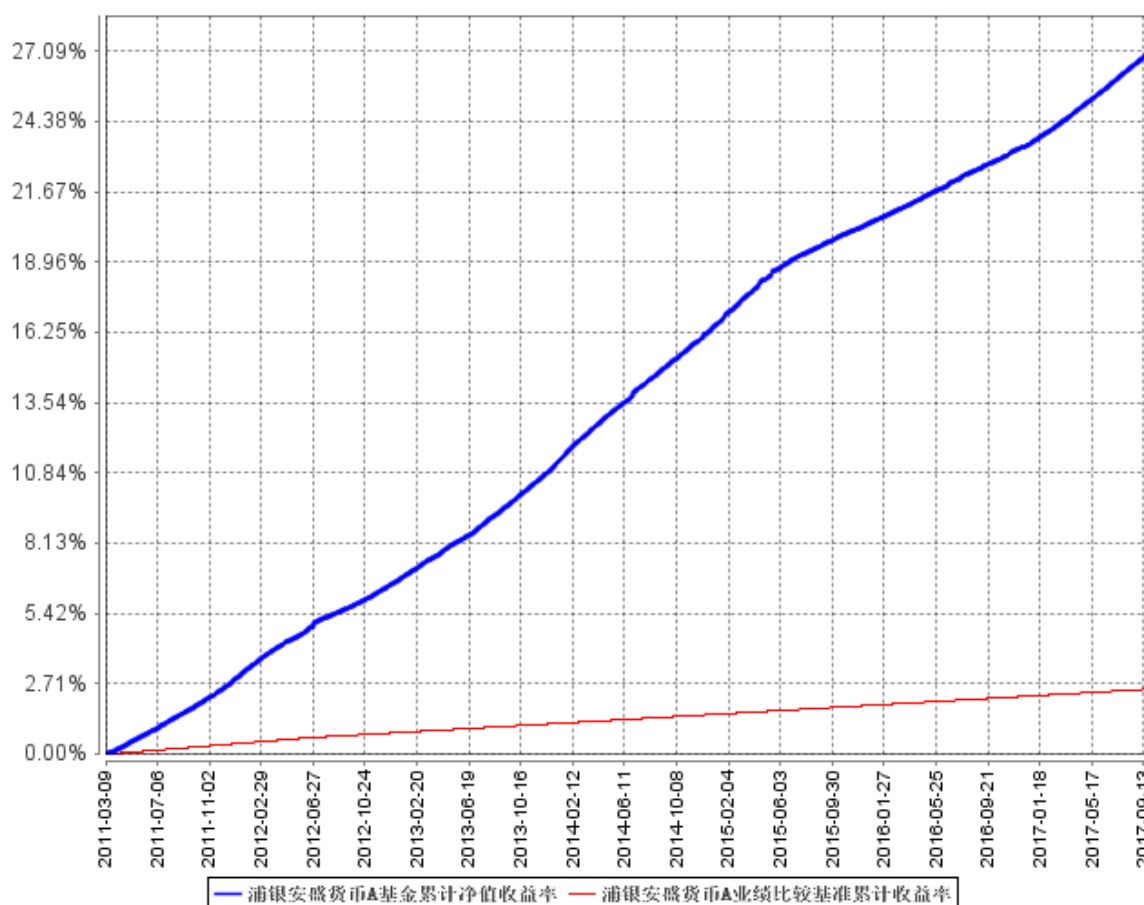
阶段	净值收益率 ①	净值收益率标准 偏差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①—③	②—④
过去三个 月	1.0030%	0.0004%	0.0883%	0.0000%	0.9147%	0.0004%

注：1、自 2017 年 6 月 8 日起，本基金收益分配由原“月结转份额”变更为“日结转份额”。具体内容详见基金管理人于 2017 年 5 月 2 日发布的《关于浦银安盛货币市场证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告》及其后续公告。

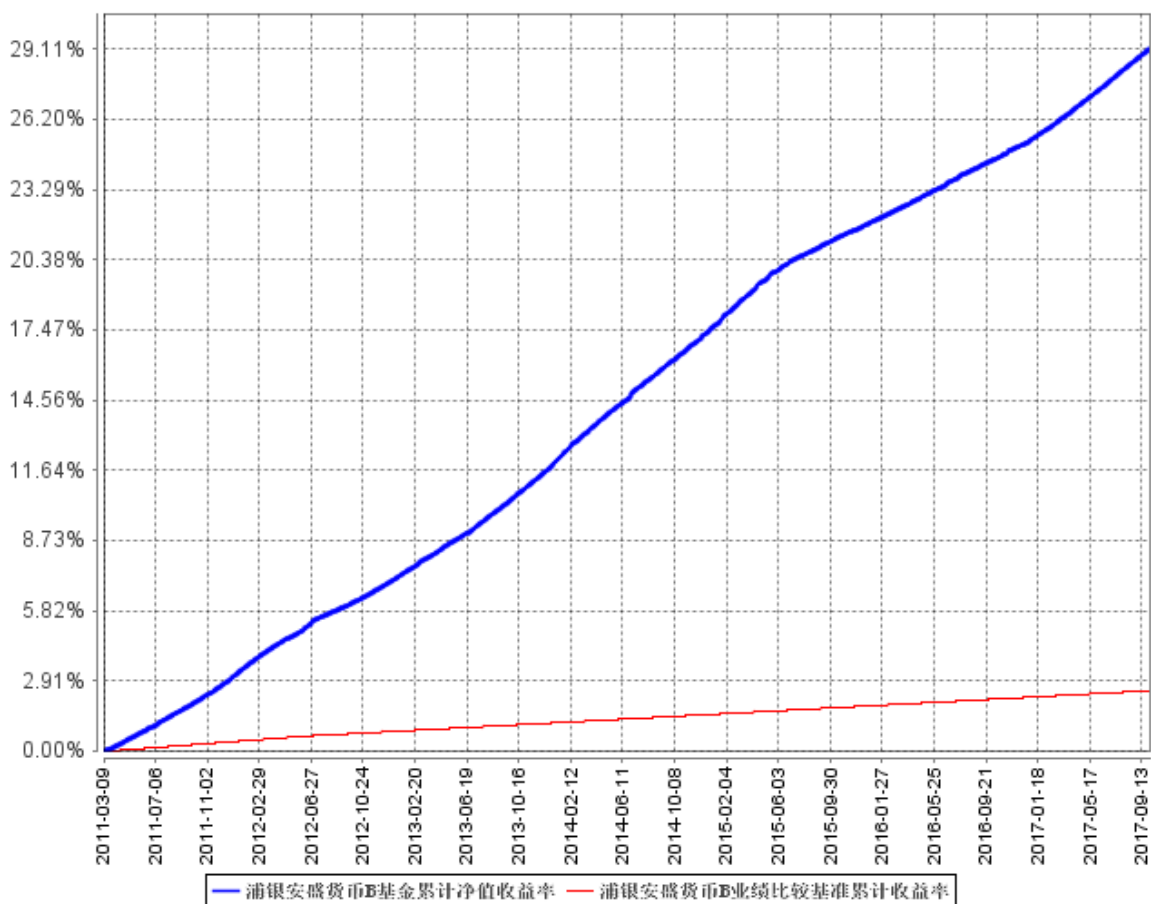
2、本基金于 2014 年 9 月 15 日开始分为 A、B、E 三类。

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

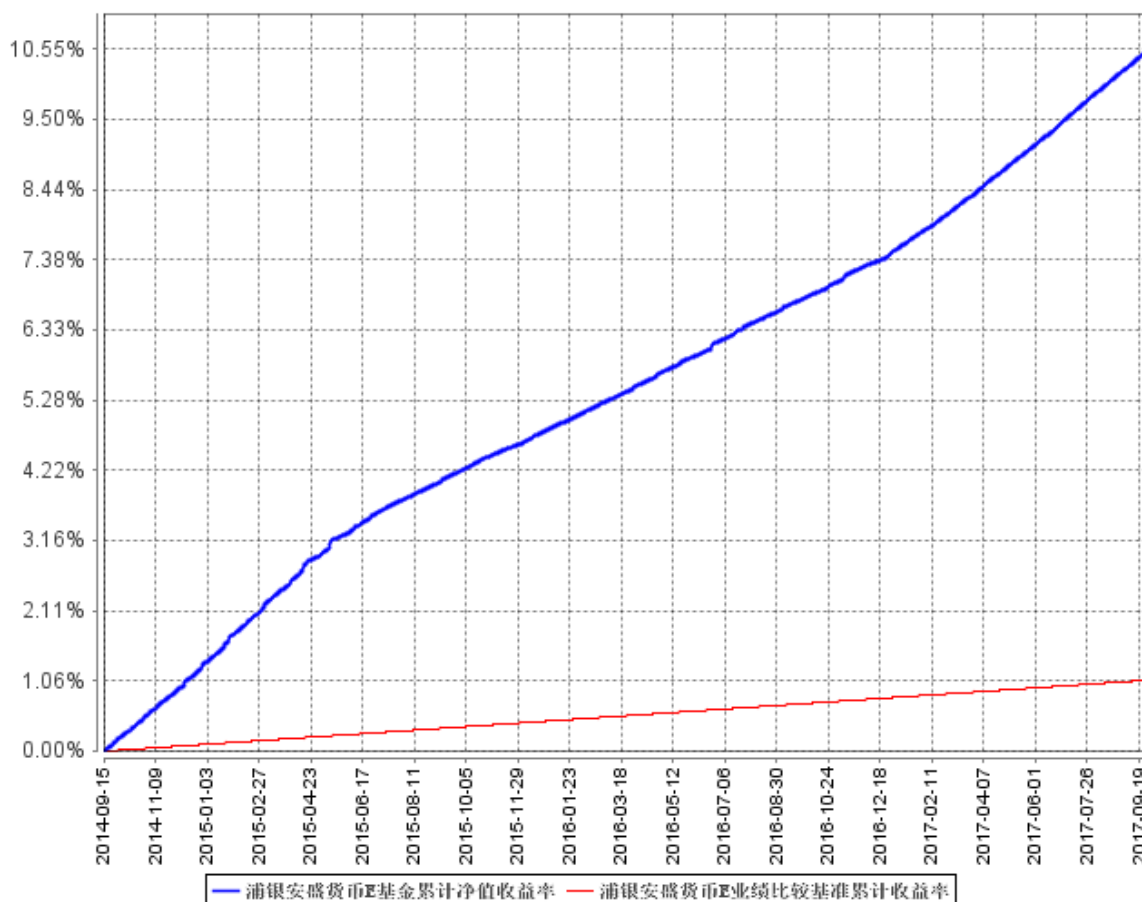
浦银安盛货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



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

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
康佳燕	公司旗下 浦银安盛 货币基金、 浦银安盛 日日盈货	2014 年 6 月 19 日	-	11	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。

	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 基金经理				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。
--	--	--	--	--	---

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《公平交易管理规定》，建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个基金组合。

在具体执行中，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平的提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度，保证公

募基金及专户业务的独立投资决策机制；在交易执行环节上，详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规定，以保证投资执行交易过程的公平性；从事后监控角度上，一方面是定期对股票交易情况进行分析，对不同时间窗口（同日，3 日，5 日和 10 日）发生的不同组合对同一股票的同向交易及反向交易进行价差分析，并进行统计显著性的检验，以确定交易价差对相关基金的业绩差异的贡献度；同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异的分析；另一方面是公司公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查，并对发现的问题进行及时的报告。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年三季度资金面整体偏紧，7 月中下旬由于受到逆回购集中到期，上市公司海外派息和财政存款季节性上升的影响，资金面骤然收紧，至 19 号开始缓和，月末时点冲击又再度收紧。8 月资金面前松后紧，央行共净回笼 4080 亿元，“削峰”操作对市场宽松预期打击较大。9 月资金面一波三折，主要受到 9 月份巨量同业存单到期、跨季跨节时点冲击的影响。同时在货币新规对资金面产生结构性冲击以及超储率偏低背景下，资金扰动被放大。9 月 30 日央行宣布定向降准，预计释放 2000-4000 亿资金，可缓解春节流动性压力，但对短期资金面改善可能有限。

报告期内，本基金整体久期较短，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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期浦银安盛货币 A 的基金份额净值收益率为 1.0038%，本报告期浦银安盛货币 B 的基金份额净值收益率为 1.0644%，本报告期浦银安盛货币 E 的基金份额净值收益率为 1.0030%，同期业绩比较基准收益率为 0.0883%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

- 1、本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形；
- 2、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	8,146,292,017.25	25.28
	其中：债券	8,146,292,017.25	25.28
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,243,192,051.04	10.06
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	20,478,008,757.26	63.54
4	其他资产	359,734,059.26	1.12
5	合计	32,227,226,884.81	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	1.06	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	503,909,004.13	1.59
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

注：本报告期内本基金未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	91
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

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。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	18.13	1.59
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	19.00	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	41.45	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	4.53	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	17.37	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		100.49	1.59

5.4 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。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,759,952,390.85	8.70
	其中：政策性金融债	2,759,952,390.85	8.70
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,386,339,626.40	16.98
8	其他	-	-
9	合计	8,146,292,017.25	25.69
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111710313	17 兴业银行 CD313	14,000,000	1,385,509,433.67	4.37
2	170410	17 农发 10	5,000,000	498,563,904.16	1.57
3	111710403	17 兴业银行 CD403	5,000,000	497,683,444.91	1.57
4	111780206	17 广东华兴银行 CD061	4,700,000	464,940,847.92	1.47
5	170204	17 国开 04	4,200,000	418,767,374.97	1.32
6	170207	17 国开 07	4,100,000	409,109,903.31	1.29
7	111721116	17 渤海银行 CD116	4,000,000	398,086,400.16	1.26
8	170408	17 农发 08	3,000,000	299,467,526.09	0.94
9	111710400	17 兴业银行 CD400	3,000,000	298,645,625.66	0.94
10	111780147	17 广东华兴银行 CD060	3,000,000	296,816,766.51	0.94

5.7 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0207%
报告期内偏离度的最低值	-0.0133%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0092%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本报告期内无负偏离度绝对值达到 0.25%的情况

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本报告期内无正偏离度绝对值达到 0.5%的情况

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	144,083,438.28

4	应收申购款	215,650,620.98
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	359,734,059.26

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B	浦银安盛货币 E
报告期期初基金份额总额	185,229,348.00	22,076,769,257.10	4,550,266.94
报告期期间基金总申购份额	546,868,875.58	29,633,587,638.58	9,008,209.42
报告期期间基金总赎回份额	269,948,089.32	20,464,779,200.64	8,690,779.31
报告期期末基金份额总额	462,150,134.26	31,245,577,695.04	4,867,697.05

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	红利发放	2017年7月 3日	17,949.70	17,949.70	0.00%
2	红利发放	2017年7月 4日	5,883.08	5,883.08	0.00%
3	红利发放	2017年7月 5日	5,926.86	5,926.86	0.00%
4	红利发放	2017年7月 6日	5,867.39	5,867.39	0.00%
5	红利发放	2017年7月 7日	5,741.28	5,741.28	0.00%
6	红利发放	2017年7月 10日	16,964.45	16,964.45	0.00%
7	赎回	2017年7月 11日	-45,000,000.00	-45,005,583.00	0.00%
8	红利发放	2017年7月 11日	126.60	126.60	0.00%
9	红利发放	2017年7月 12日	112.90	112.90	0.00%
10	红利发放	2017年7月 13日	113.57	113.57	0.00%
11	红利发放	2017年7月 14日	112.61	112.61	0.00%

12	红利发放	2017 年 7 月 17 日	338.01	338.01	0.00%
13	红利发放	2017 年 7 月 18 日	111.11	111.11	0.00%
14	红利发放	2017 年 7 月 19 日	112.17	112.17	0.00%
15	红利发放	2017 年 7 月 20 日	110.65	110.65	0.00%
16	红利发放	2017 年 7 月 21 日	110.60	110.60	0.00%
17	红利发放	2017 年 7 月 24 日	333.09	333.09	0.00%
18	红利发放	2017 年 7 月 25 日	110.90	110.90	0.00%
19	红利发放	2017 年 7 月 26 日	110.03	110.03	0.00%
20	红利发放	2017 年 7 月 27 日	111.04	111.04	0.00%
21	红利发放	2017 年 7 月 28 日	111.71	111.71	0.00%
22	红利发放	2017 年 7 月 31 日	333.49	333.49	0.00%
23	红利发放	2017 年 8 月 1 日	111.20	111.20	0.00%
24	红利发放	2017 年 8 月 2 日	111.04	111.04	0.00%
25	红利发放	2017 年 8 月 3 日	111.38	111.38	0.00%
26	红利发放	2017 年 8 月 4 日	110.80	110.80	0.00%
27	红利发放	2017 年 8 月 7 日	327.42	327.42	0.00%
28	红利发放	2017 年 8 月 8 日	109.57	109.57	0.00%
29	红利发放	2017 年 8 月 9 日	108.35	108.35	0.00%
30	红利发放	2017 年 8 月 10 日	108.17	108.17	0.00%
31	红利发放	2017 年 8 月 11 日	107.90	107.90	0.00%
32	红利发放	2017 年 8 月 14 日	324.03	324.03	0.00%
33	红利发放	2017 年 8 月 15 日	108.96	108.96	0.00%

34	红利发放	2017 年 8 月 16 日	107.70	107.70	0.00%
35	红利发放	2017 年 8 月 17 日	107.44	107.44	0.00%
36	红利发放	2017 年 8 月 18 日	108.33	108.33	0.00%
37	红利发放	2017 年 8 月 21 日	323.99	323.99	0.00%
38	红利发放	2017 年 8 月 22 日	108.75	108.75	0.00%
39	红利发放	2017 年 8 月 23 日	108.11	108.11	0.00%
40	红利发放	2017 年 8 月 24 日	108.27	108.27	0.00%
41	红利发放	2017 年 8 月 25 日	108.34	108.34	0.00%
42	红利发放	2017 年 8 月 28 日	324.65	324.65	0.00%
43	红利发放	2017 年 8 月 29 日	108.47	108.47	0.00%
44	红利发放	2017 年 8 月 30 日	107.50	107.50	0.00%
45	红利发放	2017 年 8 月 31 日	109.73	109.73	0.00%
46	红利发放	2017 年 9 月 1 日	109.43	109.43	0.00%
47	红利发放	2017 年 9 月 4 日	326.40	326.40	0.00%
48	红利发放	2017 年 9 月 5 日	108.38	108.38	0.00%
49	红利发放	2017 年 9 月 6 日	108.45	108.45	0.00%
50	红利发放	2017 年 9 月 7 日	107.30	107.30	0.00%
51	红利发放	2017 年 9 月 8 日	107.52	107.52	0.00%
52	红利发放	2017 年 9 月 11 日	323.78	323.78	0.00%
53	红利发放	2017 年 9 月 12 日	107.60	107.60	0.00%
54	红利发放	2017 年 9 月 13 日	108.27	108.27	0.00%
55	红利发放	2017 年 9 月 14 日	108.32	108.32	0.00%

56	红利发放	2017 年 9 月 15 日	109.30	109.30	0.00%
57	红利发放	2017 年 9 月 18 日	332.51	332.51	0.00%
58	红利发放	2017 年 9 月 19 日	110.36	110.36	0.00%
59	红利发放	2017 年 9 月 20 日	107.62	107.62	0.00%
60	红利发放	2017 年 9 月 21 日	109.84	109.84	0.00%
61	红利发放	2017 年 9 月 22 日	109.34	109.34	0.00%
62	红利发放	2017 年 9 月 25 日	330.45	330.45	0.00%
63	红利发放	2017 年 9 月 26 日	111.81	111.81	0.00%
64	红利发放	2017 年 9 月 27 日	113.67	113.67	0.00%
65	红利发放	2017 年 9 月 28 日	112.98	112.98	0.00%
66	红利发放	2017 年 9 月 29 日	112.48	112.48	0.00%
合计			-44,932,762.85	-44,938,345.85	

注：1、截至本报告期末，本基金管理人持有浦银货币 A 1,028,777.27 份。

2、截至本报告期末，本基金管理人的全资子公司上海浦银安盛资产管理有限公司持有本基金浦银货币 A 4,580,084.25 份。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

机构	1	20170701-20170930	20,274,011,888.87	213,690,248.52	0.00	20,487,702,137.39	64.60%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

基金管理人提示投资者注意：当特定的机构投资者进行大额赎回操作时，基金管理人需通过对基金持有证券的快速变现以支付赎回款，该等操作可能会产生基金仓位调整的困难，产生冲击成本的风险，并造成基金净值的波动；同时，该等大额赎回将可能产生（1）单位净值尾差风险；（2）基金净值大幅波动的风险；（3）因引发基金本身的巨额赎回而导致中小投资者无法及时赎回的风险；以及（4）因基金资产净值低于 5000 万元从而影响投资目标实现或造成基金终止等风险。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、 中国证监会批准基金募集的文件
- 2、 浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同
- 3、 浦银安盛货币市场证券投资基金招募说明书
- 4、 浦银安盛货币市场证券投资基金托管协议
- 5、 基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 6、 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、 本报告期内在中国证监会指定报刊上披露的各项公告
- 8、 中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼基金管理人办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（www.py-axa.com）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

客户服务中心电话：400-8828-999 或 021-33079999 。

浦银安盛基金管理有限公司

2017 年 10 月 25 日