

# 浦银安盛日日盈货币市场基金 2017 年年度报告 摘要

2017 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：2018 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2018 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 2017 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      | 12,746,218,830.67 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 | 24,320,086.78 份     | 9,787,955,177.60 份 | 2,933,943,566.29 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                          | 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      |

## 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<br>期间数据和指标 | 2017 年      |             |             | 2016 年      |             |             | 2015 年      |             |             |
|------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
|                  | 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       | 928,263.28    | 442,066,468.38   | 90,672,987.05    | 1,028,307.29  | 303,085,866.36    | 72,300,952.66    | 1,725,672.82  | 60,710,721.60    | 97,203,613.16    |
| 本期利润          | 928,263.28    | 442,066,468.38   | 90,672,987.05    | 1,028,307.29  | 303,085,866.36    | 72,300,952.66    | 1,725,672.82  | 60,710,721.60    | 97,203,613.16    |
| 本期净值收益率       | 3.4680%       | 3.7167%          | 3.4683%          | 2.4302%       | 2.6768%           | 2.4305%          | 3.6938%       | 3.9427%          | 3.6938%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017 年末       |                  |                  | 2016 年末       |                   |                  | 2015 年末       |                  |                  |
| 期末基金资产净值      | 24,320,086.78 | 9,787,955,177.60 | 2,933,943,566.29 | 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 |
| 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.            | 2017 年末       |                  |                  | 2016 年末       |                   |                  | 2015 年末       |                  |                  |

|                       |              |              |              |             |          |             |             |         |         |
|-----------------------|--------------|--------------|--------------|-------------|----------|-------------|-------------|---------|---------|
| 1.3<br>累计<br>期末<br>指标 |              |              |              |             |          |             |             |         |         |
| 累计<br>净值<br>收益<br>率   | 13.566<br>6% | 14.601<br>2% | 12.647<br>8% | 9.7601<br>% | 10.4944% | 8.8718<br>% | 7.156<br>0% | 7.6138% | 6.2884% |

金额单位：人民币元

- 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。

## 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<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③      | ②—④     |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去三个月          | 0.9485%      | 0.0011%             | 0.0883%            | 0.0000%               | 0.8602%  | 0.0011% |
| 过去六个月          | 1.8481%      | 0.0009%             | 0.1766%            | 0.0000%               | 1.6715%  | 0.0009% |
| 过去一年           | 3.4680%      | 0.0014%             | 0.3506%            | 0.0000%               | 3.1174%  | 0.0014% |
| 过去三年           | 9.8973%      | 0.0026%             | 1.0555%            | 0.0000%               | 8.8418%  | 0.0026% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 13.5666%     | 0.0031%             | 1.3292%            | 0.0000%               | 12.2374% | 0.0031% |

浦银安盛日日盈货币 B

| 阶段 | 份额净值<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|-----|-----|
|----|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|-----|-----|

|            |          | 准差②     | 率③      | 准差④     |          |         |
|------------|----------|---------|---------|---------|----------|---------|
| 过去三个月      | 1.0096%  | 0.0011% | 0.0883% | 0.0000% | 0.9213%  | 0.0011% |
| 过去六个月      | 1.9714%  | 0.0009% | 0.1766% | 0.0000% | 1.7948%  | 0.0009% |
| 过去一年       | 3.7167%  | 0.0014% | 0.3506% | 0.0000% | 3.3661%  | 0.0014% |
| 过去三年       | 10.6917% | 0.0026% | 1.0555% | 0.0000% | 9.6362%  | 0.0026% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.6012% | 0.0031% | 1.3292% | 0.0000% | 13.2720% | 0.0031% |

浦银安盛日日盈货币 D

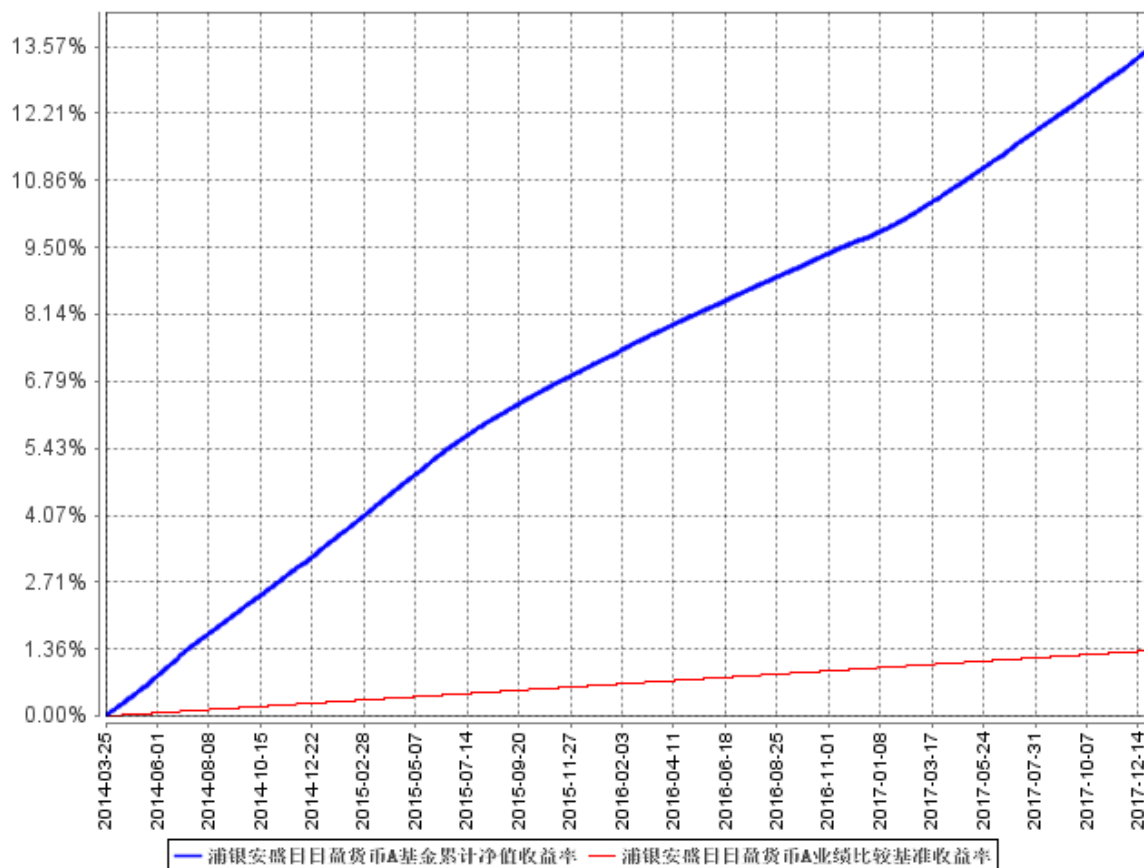
| 阶段         | 份额净值<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③      | ②—④     |
|------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去三个月      | 0.9486%      | 0.0011%             | 0.0883%            | 0.0000%               | 0.8603%  | 0.0011% |
| 过去六个月      | 1.8483%      | 0.0009%             | 0.1766%            | 0.0000%               | 1.6717%  | 0.0009% |
| 过去一年       | 3.4683%      | 0.0014%             | 0.3506%            | 0.0000%               | 3.1177%  | 0.0014% |
| 过去三年       | 9.8980%      | 0.0026%             | 1.0555%            | 0.0000%               | 8.8425%  | 0.0026% |
| 自基金合同生效起至今 | 12.6478%     | 0.0031%             | 1.2651%            | 0.0001%               | 11.3827% | 0.0030% |

注：1、本基金收益分配按日结转份额。

2、本基金于 2014 年 5 月 30 日开始分为 A、B、D 三类。

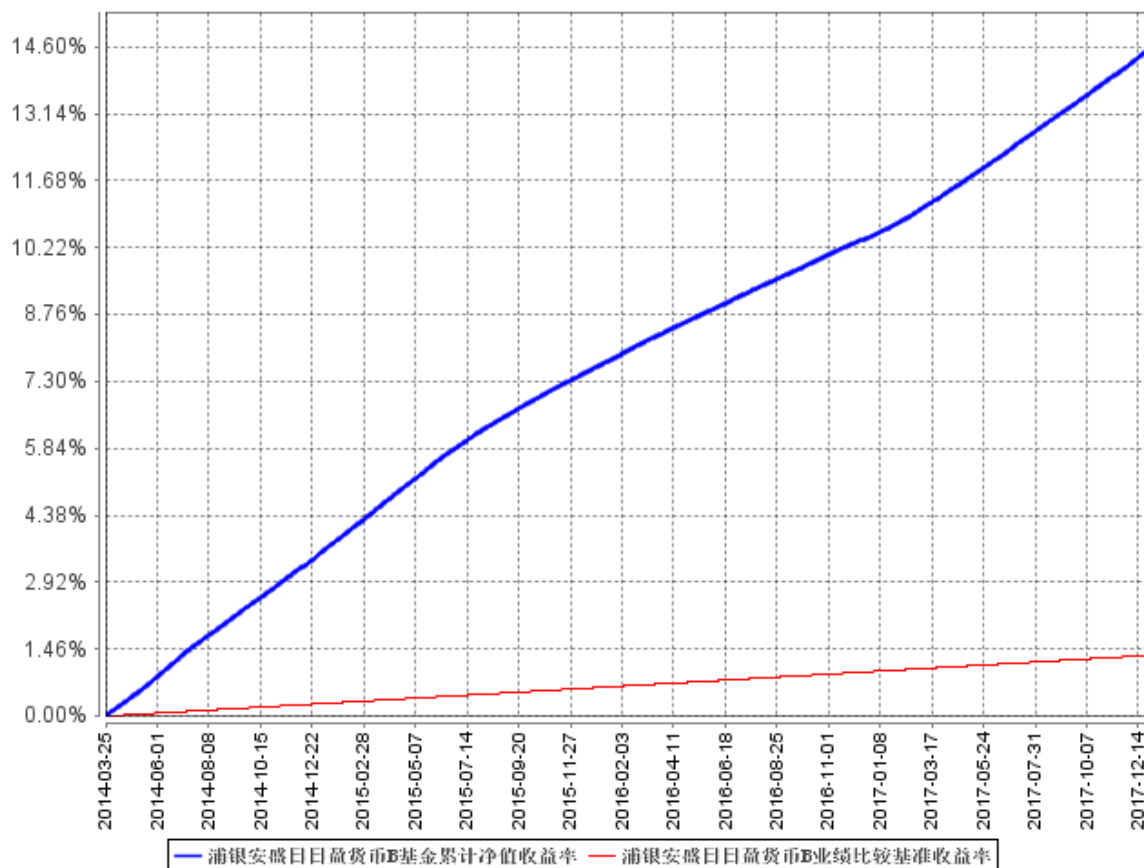
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

### 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

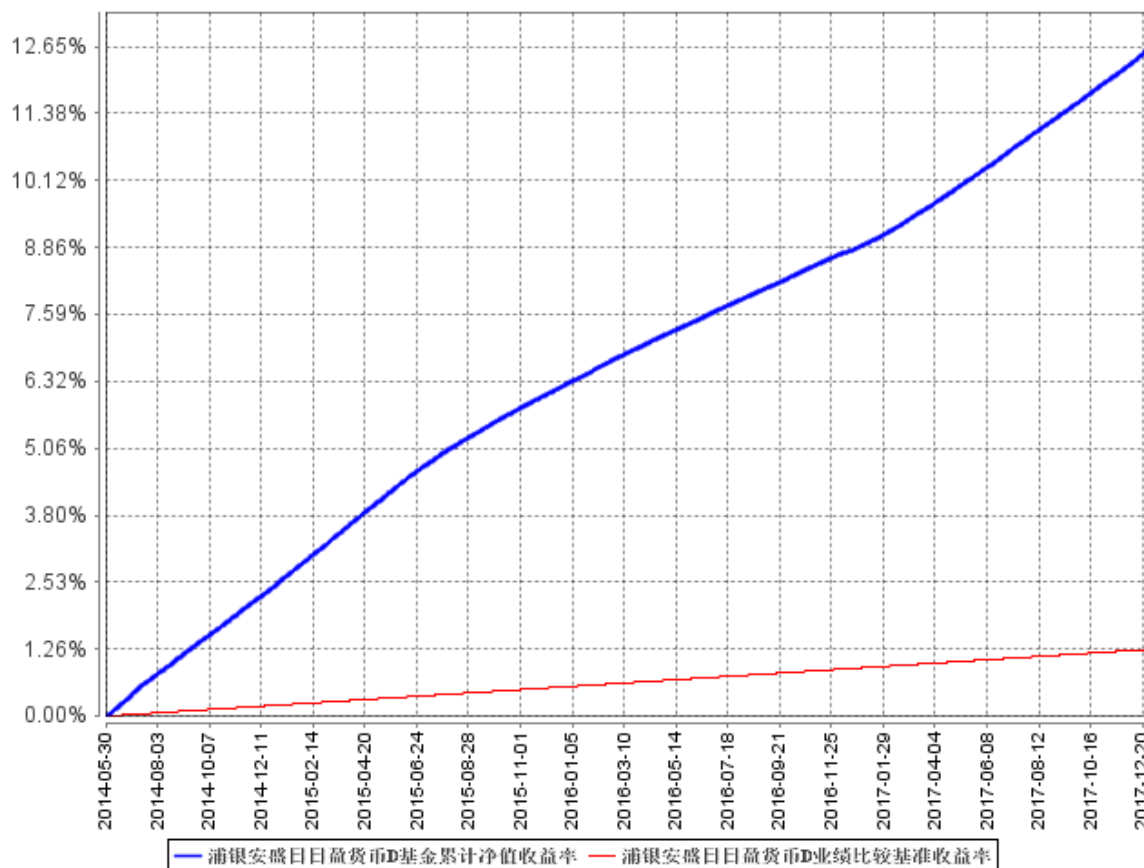




### 浦银安盛日日盈货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



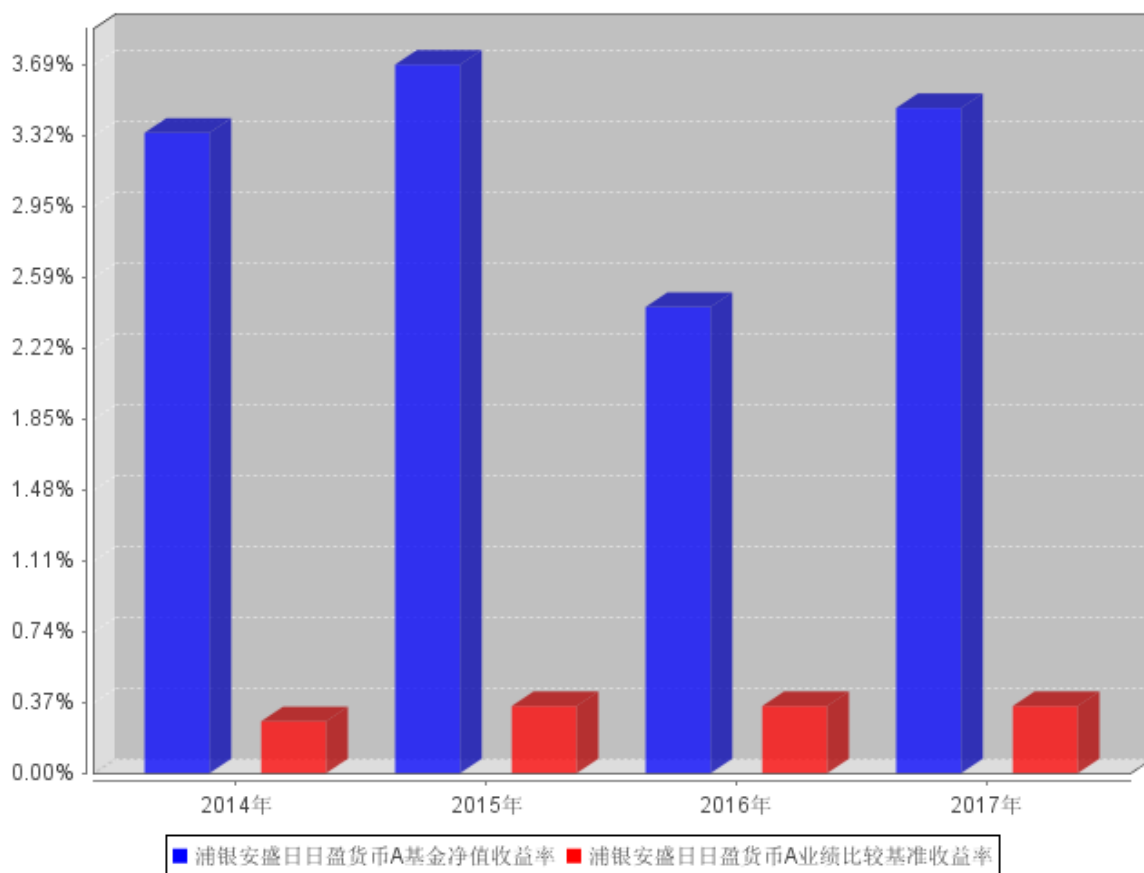
### 浦银安盛日日盈货币D基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



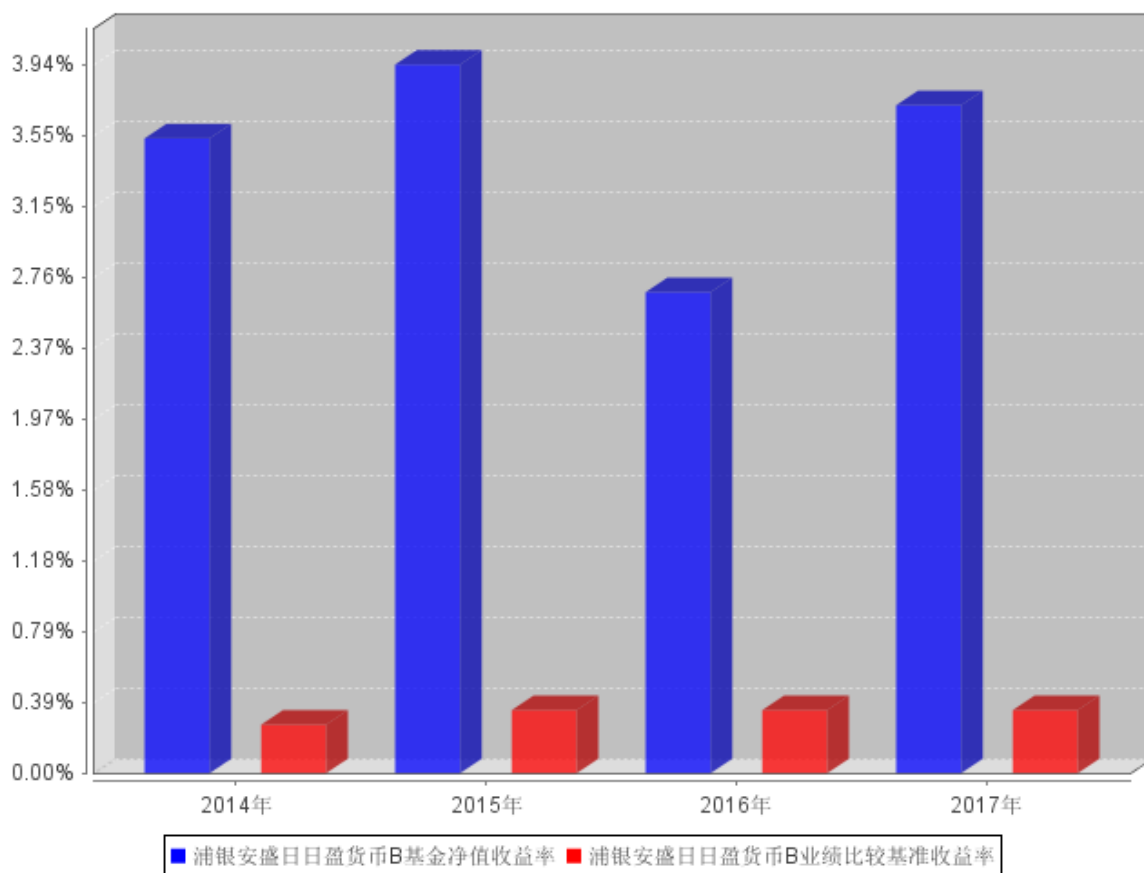
注：本基金于 2014 年 5 月 30 日开始分为 A、B、D 三类，具体内容详见本基金管理人于 2014 年 5 月 28 日刊登的《关于浦银安盛日日盈货币市场基金增加基金份额类别的公告》。

### 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

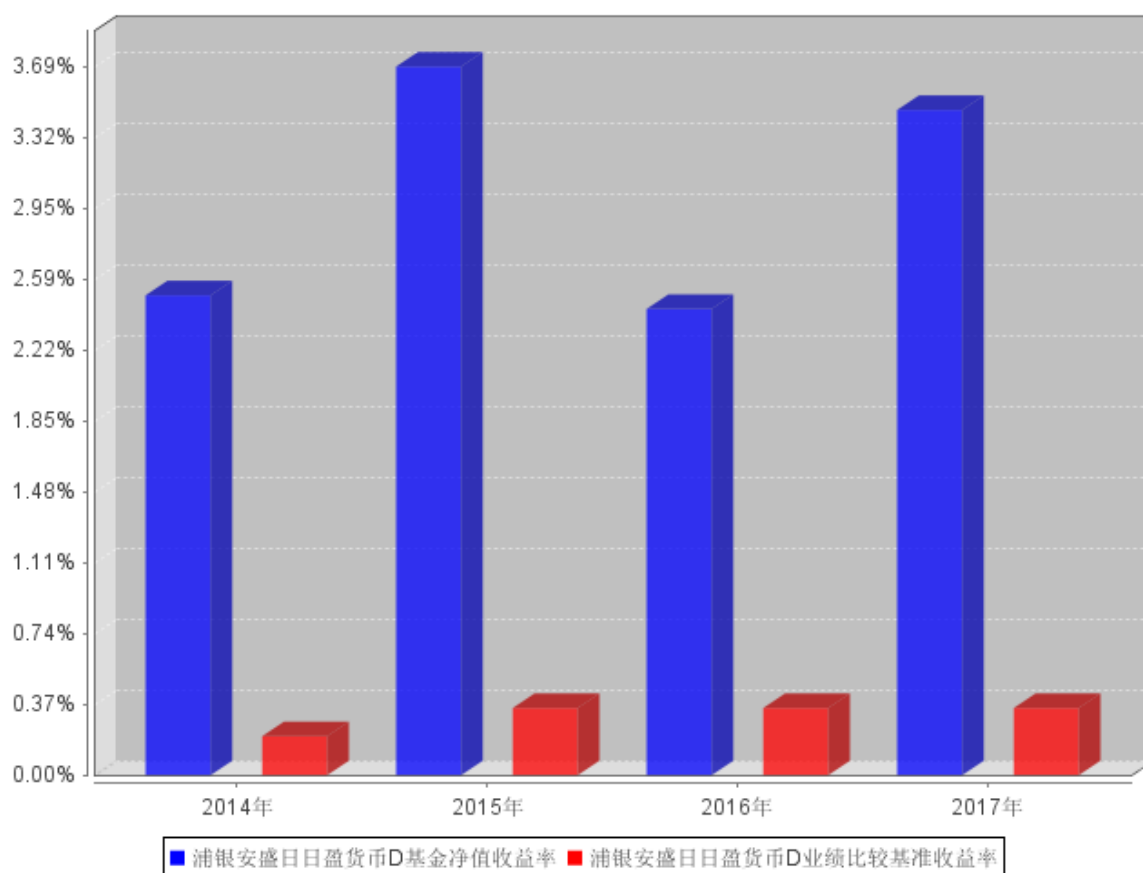
浦银安盛日日盈货币A自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



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<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金<br>额 | 应付利润<br>本年变动 | 年度利润<br>分配合计 | 备注 |
| 2017        | 927,574.94       | -                     | 688.34       | 928,263.28   |    |
| 2016        | 1,029,889.95     | -                     | -1,582.66    | 1,028,307.29 |    |
| 2015        | 1,725,906.18     | -                     | -233.36      | 1,725,672.82 |    |
| 合计          | 3,683,371.07     | -                     | -1,127.68    | 3,682,243.39 |    |
| 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<br>额           | 本年变动         | 分配合计           |    |
|-------------|------------------|-----------------------|--------------|----------------|----|
| 2017        | 442,118,153.14   | -                     | -51,684.76   | 442,066,468.38 |    |
| 2016        | 302,293,624.90   | -                     | 792,241.46   | 303,085,866.36 |    |
| 2015        | 60,285,303.25    | -                     | 425,418.35   | 60,710,721.60  |    |
| 合计          | 804,697,081.29   | -                     | 1,165,975.05 | 805,863,056.34 |    |
| 浦银安盛日日盈货币 D |                  |                       |              |                |    |
| 年度          | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金<br>额 | 应付利润<br>本年变动 | 年度利润<br>分配合计   | 备注 |
| 2017        | 90,494,700.33    | -                     | 178,286.72   | 90,672,987.05  |    |
| 2016        | 72,312,883.65    | -                     | -11,930.99   | 72,300,952.66  |    |
| 2015        | 97,235,703.97    | -                     | -32,090.81   | 97,203,613.16  |    |
| 合计          | 260,043,287.95   | -                     | 134,264.92   | 260,177,552.87 |    |

## § 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 2017 年 12 月 31 日止，浦银安盛旗下共管理 34 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、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、浦银安盛日日鑫货币市场基金、浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金、浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金、浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金(LOF)、浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基金。

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 |        |   |
| 刘大巍 | 公司旗下浦银安盛 6 个月债券基金、浦银安盛季季添利债券基金、浦银安盛稳健增利债券基金 | 2017 年 11 月 1 日 | -    | 7      | 刘大巍先生，上海财经大学经济学博士。加盟浦银安盛基金前，曾在万家基金、泰信基金工作，先后从事固定收益研究、基金经理助理、债券投资经理等工作。2014 年 4 月加盟浦 |

|     |   |                  |   |   |  |
|-----|---|------------------|---|---|--|
|     | (LOF)、浦银安盛月月盈债券基金、浦银安盛幸福聚利债券基金、浦银安盛盛跃纯债债券基金、浦银安盛日日盈货币市场基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。 |                  |   |   | 银安盛基金公司，从事固定收益专户产品的投资工作。2016 年 8 月转岗至固定收益投资部，担任公司旗下浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 (LOF)、浦银安盛 6 个月定期开放债券型证券投资基金以及浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月起，担任公司旗下浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金及浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月 8 日起，担任浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 11 月 1 日起，担任浦银安盛日日盈货币市场基金及浦银安盛日日丰货币市场基金基金经理。2017 年 12 月 28 日起，担任浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。 |
| 廉素君 | 公司旗下货币类基金基金经理助理   | 2017 年 11 月 28 日 | - | 6 | 廉素君女士，华中科技大学金融学硕士。2012 年 3 月至 2017 年 11 月先后就职于第一创业证券股份有限公司和郑州银行金融市场  |



|     |               |                 |                  |    |   |
|-----|---------------|-----------------|------------------|----|---|
|     |               |                 |                  |    | 部北京中心，分别从事稽核与风险管理和投资交易等工作。2017 年 11 月加盟浦银安盛基金管理有限公司担任货币基金基金经理助理。  |
| 康佳燕 | 原公司旗下货币基金基金经理 | 2014 年 7 月 21 日 | 2017 年 12 月 25 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。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 月起担任固定收益投资经理。2014 年 6 月至 2017 年 12 月 25 日担任浦银安盛货币基金基金经理。2014 年 7 月至 2017 年 12 月 25 日，兼任浦银安盛日日盈货币基金基金经理。2016 年 11 月至 2017 年 12 月 25 日，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。2017 年 12 月 25 日转岗至研究部担任固定收益研究员。 |

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

纵观 2017 年，经济基本面在总量和结构上的变化令市场预期多次扭转。供给侧改革成为主线，需求稳定是基础，供给的压缩成为价格上涨的主要因素。PPI 高企，对 CPI 形成一定的压力。此外，央行的态度也在变化，通过各种货币投放工具，央行掌握了货币政策绝对的主动权，从流动性投放渠道分析，央行公开市场操作更加谨慎和精确，与 2017 年设立的稳健中性货币政策总基调和维持流动性紧平衡的原则相一致，配合金融去杠杆以及防范系统性金融风险的总基调，整个一年央行都切实贯彻稳健中性偏紧的货币政策。基于对市场的分析和资金面偏紧预期，报告期内本基金采取了短久期零杠杆和择时反击策略，平衡各类资产的分布，在市场调整充分机会显现时，快速调整资产分布以获取较高的投资收益。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

本报告期浦银安盛日日盈 A 的基金份额净值收益率为 3.4680%，本报告期浦银安盛日日盈 B 的基金份额净值收益率为 3.7167%，本报告期浦银安盛日日盈 D 的基金份额净值收益率为 3.4683%，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

下半年经济增速将缓慢下行，补库存接近尾声拖累制造业投资冲动，基建投资受财政空间及资金来源限制增长乏力，房地产投资在销量拐头向下和持续打压政策下大概率会逐步回落，房地产产业链及汽车销量下行将对内需形成拖累，但外需改善趋势较为确定，可以在一定程度上对冲内需回落。基本面缓慢回落增强了货币政策调整空间，去杠杆、防风险将成为主要政策目标，货币政策难以显著放松，但随着美元逐步走弱，人民币重回升值预期背景下，外汇占款有望恢复，银行(尤其是中小银行)资金成本会相应下降。

经济增速向下叠加金融机构负债成本稳中趋降，中期来看对债券市场形成利好；供需方面看，下半年债券供给将有所增加，但在增加直接融资的政策取向下，货币政策也会给与相应的支持，监管政策和资金面可能会给市场带来一定短期扰动，但方向上我们认为收益率将会震荡回落，债券市场仍然处于慢牛行情中。

#### 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。在公司董事会的指导、管理层的支持和各部门的密切配合下，合规风控工作紧紧围绕公司的经营目标和计划，以及公司的特点和现状，扎扎实实地开展。2017 年，合规风控工作内容涵盖了制度内控、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。合规法务方面，在部门同事和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，同时各类仲裁程序和违约债券法律处置程序顺畅；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，借助中债资信买方评级服务，信用风险管控能力大幅提升；稽核内审方面，根据监管要求及行业热议风险点，针对性地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。

### （一）进一步健全合规风控团队，提高团队的专业素养

2017 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。

### （二）进一步建立健全风险控制体系

#### 1、完善公司风险控制制度体系的建设

风险管理部牵头落实了中国证券监督管理委员会颁布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》，组织各相关部门根据《规定》的要求建立或更新了相关制度和流程，完善了交易对手和质押券管理的相关制度。在流动性相关指标的调整方面，风险管理部定期监控并提示，督促投资部门对未达标的指标进行正向改善。同时，风险管理部对新增或修订的投资相关制度，从内控措施的合理性和有效性等方面提出了修改意见，加强了公司内控建设。

此外，风险管理部组织牵头实施了 BCP 的 Call Tree 应急演练，组织风险偏好制度和偏好限额制定，对五级风险热图进行更新，并对投资者适当性风险等级划分方法的调整等工作。

#### 2、对投资组合进行定期风险评估

风险管理部进一步完善了在市场风险、信用风险及流动性风险等方面的风险评估及提示机制。在市场风险方面，从市场趋势和宏观政策方面，对我司产品的股票仓位、板块配置、行业配置、债券组合久期、杠杆、VaR 等进行提示；在信用风险方面，风险管理部从中债资信的风险预警名单、债券分层清单、负面信息清单和及时获取公司市场新闻入手，定期和不定期对组合持仓的信用风险情况进行排查，并及时提示基金经理和研究员；在流动性风险方面，风险管理部针对不同产品类型制定流动性监控方案，并根据市场情况或时间节点定期或不定期进行流动性压力测试，并提示基金经理，监督反馈及调整事宜。

#### 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

风险管理部至少每月会对公司旗下管理全部公募及专户产品的业绩表现、相对市场其他类似

产品的表现、主要收益来源及风险暴露情况进行分析，帮助基金经理明明白白赚钱，同时为绩效考核委员会提供了量化绩效考核的数据支持。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

风险管理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，同时，为了更加及时的发现疑似异常交易的情形，风险管理部提高了异常交易分析的频率至每月一次，以进一步确保投资组合的投资过程中的合法合规。

#### 5、对公司新产品提供高效、有力的支持

2017 年，公司新发行了 16 只专户产品，6 只公募基金及开发中的产品 20 余只。风险管理部与投资团队、产品团队、运营团队合作，就各产品的投资合规风险、流动性风险、市场风险、信用风险、操作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

2017 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、另类投资部、投资管理部、财富管理部（筹）、及运营管理部等业务部门，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；

基金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。2017 年，公司按照相关法律法规建立完善了《浦银安盛基金管理有限公司子公司管理规定》，对子公司实行风控合规垂直管理，明确了子公司重大事项报告机制，并建立了对子公司的稽核评估机制，年内按照相关法规要求对子公司开展了两次审计工作。母公司对子公司的内控管理主要以事后稽核及重大事件报告为主，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

2017 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。

### （三）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，稽核团队有重点、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稽核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稽核报告及整改进展情况表中。

此外，稽核团队还负责协助接受外部检查、对股东审计团队的定期报告工作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。

2017 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工作；
- 2、完成了对子公司业务的两次专项审计工作；
- 3、根据监管部门要求，完成了《投资者适当性管理办法》实施准备情况自查及 2017 年下半年投资者适当性自查工作；
- 4、根据监管部门要求，完成了子公司新规落实及自查评估工作；
- 5、根据行业内近期监管通报问题进行了专项审计工作；
- 6、根据基金公司最新监管处罚问题进行了自查工作；
- 7、协助普华永道完成了公司信息技术审计专项工作；
- 8、完成了数次投资管理人员离任审查工作及协助外审完成高管离任审计工作；
- 9、完成其他自查工作包括子公司参与地方政府举债事项自查、“八项规定”自查、“三套利”自查、重大事项报告制度执行情况自查等内容；

另外稽核团队建立了根据监管部门历次通报问题、公司新制度等持续更新扩充监察稽核项目

表的长效机制，2017 年监察稽核项目表共增加了 108 项检查点。

总体来说，2017 年度由于稽核队伍得到进一步的扩充，稽核工作的深度及广度有了进一步提高。2018 年，公司监察稽核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。

#### （四）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、2017 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；

4、参与公司增资及设立分公司相关三会程序及法律文件审核；

5、基金互认审核、互联网营销等创新业务合规论证。

#### （五）信息披露和文件报送

由于公司信息披露的负责人设在监察稽核部，因此监察稽核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法务团队很多时间，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。

2017 年，按时按质完成基金及其他定期报告（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。2017 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。

#### （六）法律事务

对公司签署的上千份协议、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，根据中国证监会及中国基金业协会发布的关于投资者适当性等



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，合规法务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。年内，合规法务团队还协助进行中国保险监督管理委员会投资管理人受托管理保险资金资格申请，进行员工劳动仲裁法律程序等。

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，公司未发生重大诉讼或仲裁现象，较好地控制了法律风险。

#### （七）组织开展合规培训

根据工作安排，合规法务团队负责公司的合规培训工作，合规培训采取现场和非现场方式，内容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、反洗钱培训、违法违规案例通报等。现场培训前，合规法务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、合规法务团队每日登陆各监管官网及报备平台，搜集新法律法规、监管动态及行业违规案例，邮件发业务部门学习参考，并向管理层、董事及股东方传达，持续进行合规教育。

2、公司 2017 年对新入职员工分两场进行了入职合规现场培训，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、反洗钱等相关合规要求；

3、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，2017 全年为业务人员提供了三场现场专项合规培训（投资者适当性新规培训、合规管理新规培训、流动性新规培训）；

4、公司 2017 年对反洗钱相关人员及公司其他员工开展了 5 场反洗钱合规培训（现场培训 4 次，非现场培训 1 次），共计 9.5 个小时 234 人次。

2017 年，公司对《浦银安盛基金管理有限公司合规手册》进行了修订，作为员工合规培训教育的一个有效方式，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。

#### （八）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团队的重要工作之一。合规法务团队全年推动公司所有新订、修订制度、流程的工作。

#### （九）组织进行反洗钱工作

公司反洗钱工作由合规法务团队组织和牵头。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）定期或

不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。

（十）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监察稽核部负责，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。

（十一）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，合规法务团队负责指导、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。

（十二）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。

（十三）与中介机构的协调

监察稽核部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 2017 年，从董事会、管理层到员工，对监察稽核部工作都比以前有了更多的重视和理解、支持，监察稽核部与公司各部门的联系日益紧密和协调，这为公司监察稽核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、风险管理部负责人、产品估值部和注册登记部负责人组成。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 928,263.28 元，实际分配收益 928,263.28 元；浦银安盛日日盈货币 B 级基金应分配收益 442,066,468.38 元，实际分配收益 442,066,468.38 元，浦银安盛日日盈货币 D 级基金应分配收益 90,672,987.05 元，实际分配收益 90,672,987.05 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

2017 年度，基金托管人在浦银安盛日日盈货币市场基金的托管过程中，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

2017 年度，浦银安盛基金管理有限公司在浦银安盛日日盈货币市场基金投资运作、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。

本基金本报告期内向 A 级份额持有人分配利润：928,263.28 元，向 B 级份额持有人分配利润：442,066,468.38 元，向 D 级份额持有人分配利润：90,672,987.05 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

2017 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市场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（2018）第 22051 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：   |
| 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：   |
| 审计意见            | <p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了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 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 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。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为，后附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，公允反映了浦银安盛日日盈货币基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础       | <p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于浦银安盛日日盈货币基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>   |
| 强调事项            | —   |
| 其他事项            | —   |
| 其他信息            | —   |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>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（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、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> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估浦银安盛日日盈货币基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算浦银安盛日日盈货币基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p>   |

|                        |   |
|------------------------|---|
|                        | <p>基金管理人治理层负责监督浦银安盛日日盈货币基金的财务报告过程。</p>  |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对浦银安盛日日盈货币基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致浦银安盛日日盈货币基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价</p> |

|           |   |    |
|-----------|---|----|
|           | 财务报表是否公允反映相关交易和事项。<br>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 |    |
| 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）  |    |
| 注册会计师的姓名  | 张振波   | 罗佳 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼   |    |
| 审计报告日期    | 2018 年 3 月 29 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：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号 | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|------------|-----|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |     |                         |                          |
| 银行存款       |     | 8,606,792,933.86        | 12,355,579,513.87        |
| 结算备付金      |     | 909,090.91              | -                        |
| 存出保证金      |     | -                       | -                        |
| 交易性金融资产    |     | 3,105,605,810.71        | 4,050,688,357.33         |
| 其中：股票投资    |     | -                       | -                        |
| 基金投资       |     | -                       | -                        |
| 债券投资       |     | 3,105,605,810.71        | 4,050,688,357.33         |
| 资产支持证券投资   |     | -                       | -                        |
| 贵金属投资      |     | -                       | -                        |
| 衍生金融资产     |     | -                       | -                        |
| 买入返售金融资产   |     | 910,970,526.45          | 2,182,783,062.00         |
| 应收证券清算款    |     | -                       | -                        |
| 应收利息       |     | 73,770,075.83           | 62,283,621.93            |
| 应收股利       |     | -                       | -                        |
| 应收申购款      |     | 55,458,974.89           | 42,454,710.44            |
| 递延所得税资产    |     | -                       | -                        |
| 其他资产       |     | -                       | -                        |

|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 资产总计            |            | 12,753,507,412.65          | 18,693,789,265.57           |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2016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           |            | 3,200.37                   | 100,492.69                  |
| 应付管理人报酬         |            | 3,414,183.84               | 3,456,334.39                |
| 应付托管费           |            | 1,034,601.15               | 1,047,374.09                |
| 应付销售服务费         |            | 688,227.84                 | 678,857.93                  |
| 应付交易费用          |            | 59,877.15                  | 83,243.18                   |
| 应交税费            |            | -                          | -                           |
| 应付利息            |            | -                          | -                           |
| 应付利润            |            | 1,672,430.94               | 1,545,140.64                |
| 递延所得税负债         |            | -                          | -                           |
| 其他负债            |            | 416,060.69                 | 362,581.31                  |
| 负债合计            |            | 7,288,581.98               | 7,274,024.23                |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金            |            | 12,746,218,830.67          | 18,686,515,241.34           |
| 未分配利润           |            | -                          | -                           |
| 所有者权益合计         |            | 12,746,218,830.67          | 18,686,515,241.34           |
| 负债和所有者权益总计      |            | 12,753,507,412.65          | 18,693,789,265.57           |

注：1、报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额

12,746,218,830.67 份。其中浦银安盛日日盈货币 A 级的基金份额为 24,320,086.78 份，浦银安盛日日盈货币 B 级的基金份额为 9,787,955,177.60 份，浦银安盛日日盈货币 D 级的基金份额为 2,933,943,566.29 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目    | 附注号 | 本期<br>2017年1月1日至<br>2017年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至<br>2016年12月31日 |
|--------|-----|---------------------------------|--------------------------------------|
| 一、收入   |     | 614,768,061.48                  | 459,695,759.23                       |
| 1.利息收入 |     | 624,011,045.12                  | 456,069,102.27                       |



|                            |           |                |                |
|----------------------------|-----------|----------------|----------------|
| 其中：存款利息收入                  |           | 400,501,106.66 | 252,385,573.01 |
| 债券利息收入                     |           | 143,907,128.69 | 147,858,494.72 |
| 资产支持证券利息收入                 |           | -              | 324,535.77     |
| 买入返售金融资产收入                 |           | 79,602,809.77  | 55,500,498.77  |
| 其他利息收入                     |           | -              | -              |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |           | -9,242,983.64  | 3,626,656.96   |
| 其中：股票投资收益                  |           | -              | -              |
| 基金投资收益                     |           | -              | -              |
| 债券投资收益                     |           | -9,242,983.64  | 3,607,368.07   |
| 资产支持证券投资                   |           | -              | 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>              |           | 81,100,342.77  | 83,280,632.92  |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.8.2.1 | 49,138,586.83  | 48,121,838.43  |
| 2. 托管费                     | 7.4.8.2.2 | 14,890,480.76  | 14,582,375.35  |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.8.2.3 | 7,908,803.87   | 8,788,143.21   |
| 4. 交易费用                    |           | -              | -              |
| 5. 利息支出                    |           | 8,650,862.62   | 11,343,268.25  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |           | 8,650,862.62   | 11,343,268.25  |
| 6. 其他费用                    |           | 511,608.69     | 445,007.68     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |           | 533,667,718.71 | 376,415,126.31 |
| 减：所得税费用                    |           | -              | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |           | 533,667,718.71 | 376,415,126.31 |

### 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：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期                    |
|----|-----------------------|
|    | 2017年1月1日至2017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）                        | 18,686,515,241.34                           | -               | 18,686,515,241.34  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -   | 533,667,718.71  | 533,667,718.71     |
| 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）      | -5,940,296,410.67                           | -               | -5,940,296,410.67  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 72,984,210,340.57                           | -               | 72,984,210,340.57  |
| 2. 基金赎回款                               | -78,924,506,751.24                          | -               | -78,924,506,751.24 |
| 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） | -   | -533,667,718.71 | -533,667,718.71    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 12,746,218,830.67                           | -               | 12,746,218,830.67  |
|  | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |                 |                    |
| 项目                                     | 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（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（基金净值）                        | 18,686,515,241.34                           | -               | 18,686,515,241.34  |

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：

|              |              |             |
|--------------|--------------|-------------|
| _____<br>郁蓓华 | _____<br>郁蓓华 | _____<br>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基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 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招募说明书》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)。

本财务报表由本基金的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司于 2018 年 3 月 29 日批准报出。

## 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 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，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称                      | 与本基金的关系         |
|----------------------------|-----------------|
| 浦银安盛基金管理有限公司（“浦银安盛”）       | 基金管理人、基金销售机构    |
| 交通银行股份有限公司（“交通银行”）         | 基金托管人、基金销售机构    |
| 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、基金销售机构 |
| 法国安盛投资管理有限公司               | 基金管理人的股东        |
| 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

##### 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                               | 上年度可比期间                          |
|-----------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 49,138,586.83                    | 48,121,838.43                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,510,249.88                     | 4,015,323.00                     |

注：支付基金管理人浦银安盛的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，逐日累计至每月月底，按月支付。

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                          |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 14,890,480.76                    | 14,582,375.35                    |

注：支付基金托管人交通银行的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，逐日累计至每月月底，按月支付。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                               |             |             |    |
|----------------|----------------------------------|-------------|-------------|----|
|                | 2017 年 1 月 1 日至 2017 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     | 5,331.97                         | 1.60         | 0.00         | 5,333.57     |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 16,872.63                        | 64.54        | 6,618,713.58 | 6,635,650.75 |
| 浦银安盛基金管理有限公司   | 40,218.09                        | 1,221,408.30 | 0.00         | 1,261,626.39 |
| 合计             | 62,422.69                        | 1,221,474.44 | 6,618,713.58 | 7,902,610.71 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>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 |

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<br>2017年1月1日至2017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                             | -      | -    | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间<br>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 | -    | -     | -    | -     | -    |

#### 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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                         | 本期<br>2017年1月1日至2017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                  | 5,736.25                    | 0.00          | 0.00        |
| 期间申购/买入总份额                 | 90.97                       | 20,397,071.67 | 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               | 5,827.22                    | -             | 0.00        |
| 期末持有的基金份额                  | 0.00                        | 20,397,071.67 | 0.00        |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例          | 0.00%                       | 0.21%         | 0.00%       |

| 项目                         | 上年度可比期间<br>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%       |

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



2. 基金管理人固有资金投资本基金费用按照本基金法律文件约定收取，本基金无申购手续费。

#### 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<br>2017 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |                          |
|------------------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
|                        | 持有的<br>基金份额             | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 |
| 上海浦东发展<br>银行股份有限<br>公司 | 95,921.21               | 0.39%                    | 0.00                     | 0.00%                    |
| 上海浦银安盛<br>资产管理有限<br>公司 | 0.00                    | 0.00%                    | 855,089.91               | 2.77%                    |

##### 浦银安盛日日盈货币 B

份额单位：份

| 关联方名称                  | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |                          |
|------------------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
|                        | 持有的<br>基金份额             | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 |
| 上海浦东发展<br>银行股份有限<br>公司 | 6,001,532,799.56        | 61.32%                   | 9,507,328,688.59         | 58.82%                   |
| 上海浦银安盛<br>资产管理有限<br>公司 | 59,226,081.50           | 0.61%                    | -                        | -                        |

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有浦银安盛日日盈货币 D。

#### 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<br>名称               | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |               | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 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<br>限公司-活期存<br>款 | 792,933.86                             | 216,139.39    | 16,579,513.87                               | 107,861.57    |
| 交通银行股份有<br>限公司-定期存<br>款 | -                                      | 33,544,097.21 | 200,000,000.00                              | 15,449,583.33 |
| 上海浦东发展银                 | 1,500,000,000.00                       | 52,760,920.92 | 3,600,000,000.00                            | 2,990,277.68  |

|                  |                  |               |                  |               |
|------------------|------------------|---------------|------------------|---------------|
| 行股份有限公司<br>-定期存款 |                  |               |                  |               |
| 合计               | 1,500,792,933.86 | 86,521,157.66 | 3,816,579,513.87 | 18,547,722.58 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管，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、2017年2月6日浦发银行定期存款1笔，金额109000万元，到期日2017年2月21日。
- 2、2017年2月6日浦发银行定期存款1笔，金额100000万元，到期日2017年2月22日。
- 3、2017年2月23日浦发银行定期存款1笔，金额20000万元，到期日2017年5月22日。
- 4、2017年2月23日浦发银行定期存款1笔，金额30000万元，到期日2017年5月26日。
- 5、2017年2月23日浦发银行定期存款1笔，金额10000万元，到期日2017年3月31日。
- 6、2017年2月23日浦发银行定期存款1笔，金额20000万元，到期日2017年3月30日。
- 7、2017年2月23日浦发银行定期存款1笔，金额30000万元，到期日2017年3月28日。
- 8、2017年3月1日浦发银行定期存款1笔，金额6000万元，到期日2017年6月15日。
- 9、2017年3月3日浦发银行定期存款1笔，金额22000万元，到期日2017年6月19日。
- 10、2017年3月23日浦发银行定期存款1笔，金额17500万元，到期日2017年3月30日。
- 11、2017年5月5日浦发银行定期存款1笔，金额8000万元，到期日2017年5月12日。
- 12、2017年6月28日浦发银行定期存款1笔，金额5000万元，到期日2017年7月28日。
- 13、2017年6月29日浦发银行定期存款1笔，金额2000万元，到期日2017年7月27日。
- 14、2017年2月14日交通银行协定存款1笔，金额28500万元，到期日2017年3月

24 日。

15、2017 年 4 月 7 日交通银行协定存款 1 笔，金额 28000 万元，到期日 2017 年 4 月 19 日。

16、2017 年 4 月 25 日交通银行协定存款 1 笔，金额 49000 万元，到期日 2017 年 5 月 19 日。

17、2017 年 4 月 24 日交通银行协定存款 1 笔，金额 2500 万元，到期日 2017 年 5 月 24 日。

18、2017 年 4 月 27 日交通银行协定存款 1 笔，金额 30000 万元，到期日 2017 年 5 月 25 日。

19、2017 年 5 月 23 日交通银行协定存款 1 笔，金额 53000 万元，到期日 2017 年 6 月 13 日。

20、2017 年 5 月 11 日交通银行协定存款 1 笔，金额 17500 万元，到期日 2017 年 6 月 14 日。

21、2017 年 5 月 12 日交通银行协定存款 1 笔，金额 20000 万元，到期日 2017 年 6 月 19 日。

22、2017 年 5 月 19 日交通银行协定存款 1 笔，金额 11000 万元，到期日 2017 年 6 月 19 日。

23、2017 年 5 月 31 日交通银行协定存款 1 笔，金额 10000 万元，到期日 2017 年 6 月 19 日。

24、2017 年 5 月 31 日交通银行协定存款 1 笔，金额 17000 万元，到期日 2017 年 6 月 19 日。

25、2017 年 5 月 16 日交通银行协定存款 1 笔，金额 10000 万元，到期日 2017 年 6 月 22 日。

26、2017 年 6 月 22 日交通银行协定存款 1 笔，金额 42000 万元，到期日 2017 年 8 月 18 日。

27、2017 年 7 月 14 日浦发银行协定存款 1 笔，金额 50000 万元，到期日 2017 年 10 月 17 日。

28、2017 年 7 月 14 日浦发银行协定存款 1 笔，金额 50000 万元，到期日 2017 年 10 月 16 日。

29、2017 年 7 月 14 日交通银行协定存款 1 笔，金额 51000 万元，到期日 2017 年 8 月 14 日。

- 30、2017 年 7 月 24 日交通银行协定存款 1 笔，金额 5000 万元，到期日 2017 年 10 月 18 日。
- 31、2017 年 8 月 11 日交通银行协定存款 1 笔，金额 100000 万元，到期日 2017 年 9 月 14 日。
- 32、2017 年 9 月 13 日浦发银行协定存款 1 笔，金额 70000 万元，到期日 2017 年 12 月 15 日。
- 33、2017 年 9 月 14 日交通银行协定存款 1 笔，金额 8700 万元，到期日 2017 年 12 月 13 日。
- 34、2017 年 9 月 15 日浦发银行协定存款 1 笔，金额 30000 万元，到期日 2017 年 12 月 18 日。
- 35、2017 年 9 月 18 日浦发银行协定存款 1 笔，金额 100000 万元，到期日 2017 年 9 月 25 日。
- 36、2017 年 9 月 19 日浦发银行协定存款 1 笔，金额 20000 万元，到期日 2017 年 9 月 26 日。
- 37、2017 年 9 月 19 日交通银行协定存款 1 笔，金额 27000 万元，到期日 2017 年 12 月 19 日。
- 38、2017 年 9 月 20 日交通银行协定存款 1 笔，金额 20000 万元，到期日 2017 年 12 月 20 日。
- 39、2017 年 9 月 25 日交通银行协定存款 1 笔，金额 54000 万元，到期日 2017 年 12 月 22 日。
- 40、2017 年 10 月 27 日浦发银行协定存款 1 笔，金额 50000 万元，到期日 2017 年 11 月 30 日。
- 41、2017 年 10 月 30 日浦发银行协定存款 1 笔，金额 33000 万元，到期日 2017 年 11 月 29 日。
- 42、2017 年 10 月 31 日浦发银行协定存款 1 笔，金额 5500 万元，到期日 2017 年 11 月 30 日。
- 43、2017 年 12 月 28 日浦发银行协定存款 1 笔，金额 150000 万元，到期日 2018 年 1 月 11 日。

## 7.4.9 期末（2017 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：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2017 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 2017 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 2017 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资产中属于第二层次的余额为 3,105,605,810.71 元，无属于第一层次和第三层次的余额（2016 年 12 月 31 日：第二层次 4,050,688,357.33 元，无属于第一层次和第三层次的余额）。

##### (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

无。

#### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 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（2017 年 12 月 31 日：同）。

(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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，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            | 3,105,605,810.71 | 24.35         |
|    | 其中：债券             | 3,105,605,810.71 | 24.35         |
|    | 资产支持证券            | -                | -             |
| 2  | 买入返售金融资产          | 910,970,526.45   | 7.14          |
|    | 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 | 8,607,702,024.77  | 67.49  |
| 4 | 其他各项资产       | 129,229,050.72    | 1.01   |
| 5 | 合计           | 12,753,507,412.65 | 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 | 2.11           |                |
|    | 其中:买断式回购融资   | -              |                |
| 序号 | 项目           | 金额             | 占基金资产净值的比例 (%) |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | -              | -              |
|    | 其中:买断式回购融资   | -              | -              |

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

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

| 序号 | 发生日期       | 融资余额占基金资产净值比例 (%) | 原因   | 调整期    |
|----|------------|-------------------|------|--------|
| 1  | 2017年6月19日 | 21.23             | 巨额赎回 | 五个工作日内 |

## 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    | 55 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 90 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 25 |

### 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

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                 | 56.23               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天(含)—60 天           | 10.15               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天(含)—90 天           | 16.90               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天(含)—120 天          | 1.54                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天(含)—397 天(含)      | 14.79               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
|    | 合计                     | 99.61               | -                   |

### 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

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                | 99,663,195.02    | 0.78          |
| 2  | 央行票据                | -                | -             |
| 3  | 金融债券                | 1,073,268,674.53 | 8.42          |
|    | 其中：政策性金融债           | 1,073,268,674.53 | 8.42          |
| 4  | 企业债券                | -                | -             |
| 5  | 企业短期融资券             | 300,128,756.10   | 2.35          |
| 6  | 中期票据                | -                | -             |
| 7  | 同业存单                | 1,632,545,185.06 | 12.81         |
| 8  | 其他                  | -                | -             |
| 9  | 合计                  | 3,105,605,810.71 | 24.36         |
| 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  | 111711515 | 17 平安银行 CD515   | 3,000,000 | 297,448,040.64 | 2.33          |
| 2  | 170207    | 17 国开 07        | 2,550,000 | 254,527,159.09 | 2.00          |
| 3  | 111770419 | 17 汉口银行 CD160   | 2,000,000 | 199,827,393.15 | 1.57          |
| 4  | 170410    | 17 农发 10        | 2,000,000 | 199,747,274.77 | 1.57          |
| 5  | 111720295 | 17 广发银行 CD295   | 2,000,000 | 199,413,979.19 | 1.56          |
| 6  | 111716296 | 17 上海银行 CD296   | 2,000,000 | 199,391,490.64 | 1.56          |
| 7  | 111711518 | 17 平安银行 CD518   | 2,000,000 | 195,822,686.58 | 1.54          |
| 8  | 111785644 | 17 厦门国际银行 CD185 | 2,000,000 | 195,664,627.70 | 1.54          |
| 9  | 111771244 | 17 广州银行 CD098   | 2,000,000 | 195,411,891.90 | 1.53          |
| 10 | 150418    | 15 农发 18        | 1,500,000 | 149,902,212.48 | 1.18          |

## 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 | -        |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.0201%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0797% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0263%  |

### 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

## 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    | 73,770,075.83  |
| 4  | 应收申购款   | 55,458,974.89  |
| 5  | 其他应收款   | -              |
| 6  | 待摊费用    | -              |
| 7  | 其他      | -              |
| 8  | 合计      | 129,229,050.72 |

## § 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<br>额 | 持有人<br>户数(户) | 户均持有的基金<br>份额 | 持有人结构 |       |
|--------|--------------|---------------|-------|-------|
|        |              |               | 机构投资者 | 个人投资者 |
|        |              |               |       |       |

| 级别          |         |                | 持有份额             | 占总份<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
|-------------|---------|----------------|------------------|------------|------------------|------------|
| 浦银安盛日日盈货币 A | 19,390  | 1,254.26       | 2,904,673.04     | 11.94%     | 21,415,413.74    | 88.06%     |
| 浦银安盛日日盈货币 B | 13      | 752,919,629.05 | 9,782,748,409.56 | 99.95%     | 5,206,768.04     | 0.05%      |
| 浦银安盛日日盈货币 D | 411,217 | 7,134.78       | 131,074.89       | 0.00%      | 2,933,812,491.40 | 100.00%    |
| 合计          | 430,620 | 29,599.69      | 9,785,784,157.49 | 76.77%     | 2,960,434,673.18 | 23.23%     |

### 9.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额（份）          | 占总份额比例 |
|----|-------|------------------|--------|
| 1  | 银行类机构 | 6,001,532,799.56 | 47.10% |
| 2  | 保险类机构 | 1,500,193,198.00 | 11.77% |
| 3  | 银行类机构 | 1,002,885,462.73 | 7.87%  |

|    |       |                |       |
|----|-------|----------------|-------|
| 4  | 银行类机构 | 510,199,373.50 | 4.00% |
| 5  | 银行类机构 | 300,110,727.51 | 2.36% |
| 6  | 银行类机构 | 200,083,080.30 | 1.57% |
| 7  | 信托类机构 | 101,041,401.94 | 0.79% |
| 8  | 银行类机构 | 79,477,935.11  | 0.62% |
| 9  | 基金类机构 | 59,226,081.50  | 0.46% |
| 10 | 基金类机构 | 20,397,071.67  | 0.16% |

#### 9.4 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 | 531,407.84   | 2.19%    |
|                  | 浦银安盛日日盈货币 B | 0.00         | 0.00%    |
|                  | 浦银安盛日日盈货币 D | 1,445,153.62 | 0.05%    |
|                  | 合计          | 1,976,561.46 | 0.02%    |

#### 9.5 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   | 0                 |

|  |    |   |
|--|----|---|
|  | D  |   |
|  | 合计 | 0 |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                   | 浦银安盛日日<br>盈货币 A | 浦银安盛日日<br>盈货币 B   | 浦银安盛日日<br>盈货币 D   |
|-----------------------------------|-----------------|-------------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2014 年<br>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                      | 30,901,832.30   | 16,164,383,839.66 | 2,491,229,569.38  |
| 本报告期基金总申购份额                       | 58,881,477.78   | 60,710,108,574.28 | 12,215,220,288.51 |
| 减:本报告期基金总赎回份<br>额                 | 65,463,223.30   | 67,086,537,236.34 | 11,772,506,291.60 |
| 本报告期基金拆分变动份<br>额（份额减少以“-”填列）      | -               | -                 | -                 |
| 本报告期期末基金份额总<br>额                  | 24,320,086.78   | 9,787,955,177.60  | 2,933,943,566.29  |

注：总申购含红利再投、分级份额调增和转换入份额，总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

2017 年 4 月 26 日，谢伟先生担任浦银安盛基金管理有限公司董事长，详见本公司于 2017 年 4 月 28 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》。

### 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 161,000 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 4 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 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 光大证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国信证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

|              |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 西藏东方财富<br>证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券         | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投         | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券         | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券         | 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海通证券、天风证券、中信证券交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |                      | 债券回购交易         |                            | 权证交易 |                      |
|------|------|----------------------|----------------|----------------------------|------|----------------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券<br>成交总额的比<br>例 | 成交金额           | 占当期债<br>券回购<br>成交总额<br>的比例 | 成交金额 | 占当期权证<br>成交总额的<br>比例 |
| 招商证券 | -    | -                    | 760,000,000.00 | 100.00%                    | -    | -                    |
| 东方证券 | -    | -                    | -              | -                          | -    | -                    |
| 平安证券 | -    | -                    | -              | -                          | -    | -                    |
| 川财证券 | -    | -                    | -              | -                          | -    | -                    |
| 爱建证券 | -    | -                    | -              | -                          | -    | -                    |

|              |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 东北证券         | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券         | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券         | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券         | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券         | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券         | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券         | - | - | - | - | - | - |
| 西藏东方财富证<br>券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券         | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投         | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券         | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券         | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源         | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券         | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业         | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券         | - | - | - | - | - | - |

## 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%的情况

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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              | 20170101-20170628;<br>20170630-20171231 | 9,507,328,688.59 | 20,396,847,654.20 | 23,902,547,622.02 | 6,001,628,720.77 | 47.09% |
|       | 2              | 20170101-20170104;                      | 4,056,387,702.84 | 16,091,337,314.84 | 20,067,943,167.85 | 79,781,849.83    | 0.63%  |



|   |   |   |   |   |   |   |   |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
|   |   | 20170118;<br>20170406-<br>20170620;<br>20170629;<br>20170705-<br>20170913 |   |   |   |   |   |
| 个人  | - | -   | - | - | - | - | - |
| -   | - | -   | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险  |   |   |   |   |   |   |   |
| <p>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。</p> |   |   |   |   |   |   |   |

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、因浦银安盛基金管理有限公司（以下简称“公司”）第三届董事会任期届满，根据《公司章程》的规定，经公司 2017 年第一次股东会会议审议通过，选举产生公司第四届董事会成员，共 11 名董事。详见本基金管理人于 2017 年 3 月 23 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于董事会换届的公告》。

2、2017 年 4 月 26 日，谢伟先生担任浦银安盛基金管理有限公司董事长，详见本公司于 2017 年 4 月 28 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》。

浦银安盛基金管理有限公司  
2018 年 3 月 29 日