

# 浦银安盛日日丰货币市场基金 2018 年年度报告摘要

2018 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 27 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本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 2018 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	浦银安盛日日丰货币		
基金主代码	003534		
交易代码	003534		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016 年 11 月 7 日		
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司		
基金托管人	中国民生银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	408,939,937.78 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称:	浦银安盛日日丰 A	浦银安盛日日丰 B	浦银安盛日日丰 D
下属分级基金的交易代码:	003534	003535	003536
报告期末下属分级基金的份额总额	19,066,215.58 份	314,539,770.52 份	75,333,951.68 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	人民币活期存款利率（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。		
	浦银安盛日日丰 A	浦银安盛日日丰 B	浦银安盛日日丰 D

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浦银安盛基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	罗菲菲
	联系电话	021-23212888	010-58560666
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95568
传真		021-23212985	010-58560798

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1 .1 期间 数据 和 指标	2018 年			2017 年			2016 年 11 月 7 日(基金合同 生效日)-2016 年 12 月 31 日		
	浦银安盛 日日丰 A	浦银安盛 日日丰 B	浦银安盛 日日丰 D	浦银安 盛日日 丰 A	浦银安盛 日日丰 B	浦银安盛 日日丰 D	浦银安 盛日日 丰 A	浦银安盛 日日丰 B	浦银 安盛 日日 丰 D
本期已实现收益	277,944.94	10,936,597.82	770,682.10	86,500.71	9,293,845.05	348,696.39	4,788.74	467,705.09	89.79
本期利润	277,944.94	10,936,597.82	770,682.10	86,500.71	9,293,845.05	348,696.39	4,788.74	467,705.09	89.79
本期净值收益率	3.4950%	3.7430%	3.4948%	3.5334%	3.7824%	3.5364%	0.2829%	0.3209%	0.2856%
3.1 .2 期末 数据 和 指	2018 年末			2017 年末			2016 年末		

标									
期									
末									
基									
金									
资									
产									
净									
值									
期									
末									
基									
金									
份									
额									
净									
值									

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。

## 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

浦银安盛日日丰 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	0.7690%	0.0050%	0.0888%	0.0000%	0.6802%	0.0050%
过去六个月	1.5768%	0.0051%	0.1776%	0.0000%	1.3992%	0.0051%
过去一年	3.4950%	0.0039%	0.3520%	0.0000%	3.1430%	0.0039%
自基金合同生效起至今	7.4550%	0.0031%	0.7554%	0.0000%	6.6996%	0.0031%

浦银安盛日日丰 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	0.8298%	0.0050%	0.0888%	0.0000%	0.7410%	0.0050%

过去六个月	1.6990%	0.0051%	0.1776%	0.0000%	1.5214%	0.0051%
过去一年	3.7430%	0.0039%	0.3520%	0.0000%	3.3910%	0.0039%
自基金合同生效起至今	8.0124%	0.0031%	0.7554%	0.0000%	7.2570%	0.0031%

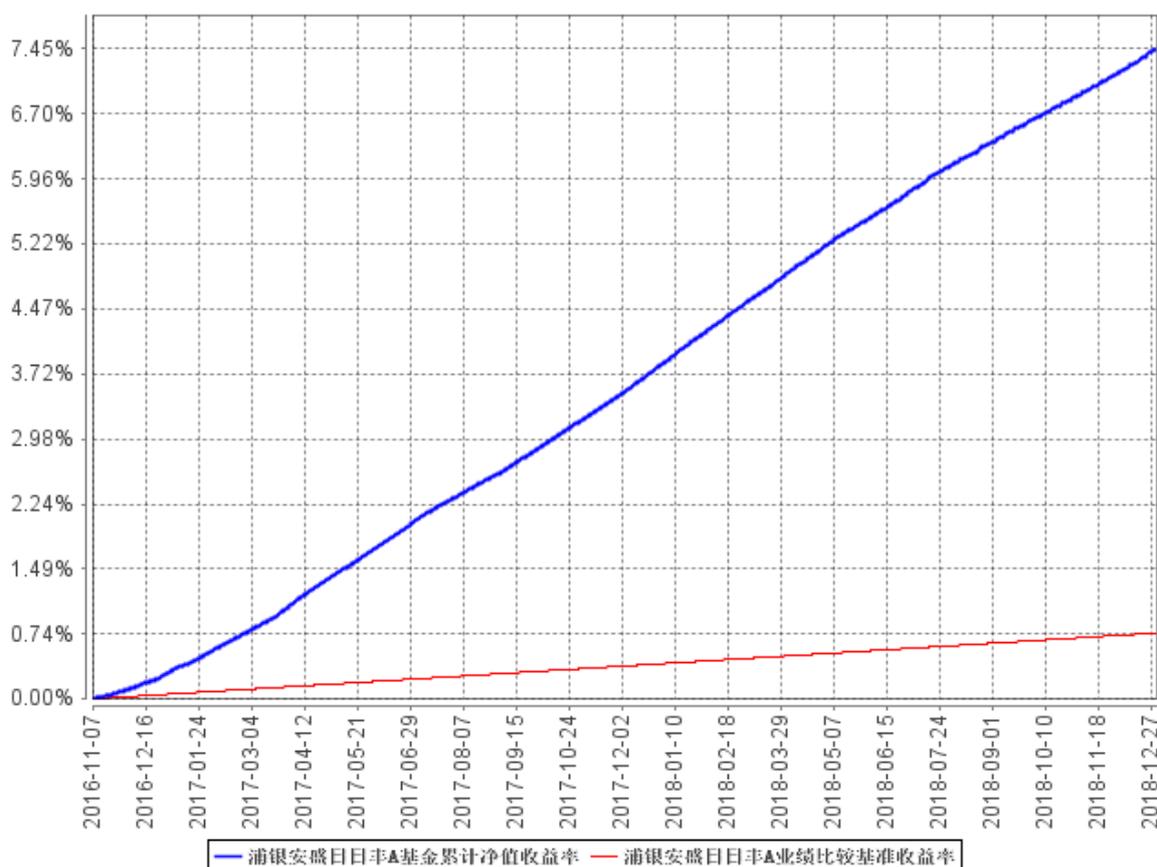
浦银安盛日日丰 D

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	0.7695%	0.0050%	0.0888%	0.0000%	0.6807%	0.0050%
过去六个月	1.5766%	0.0051%	0.1776%	0.0000%	1.3990%	0.0051%
过去一年	3.4948%	0.0039%	0.3520%	0.0000%	3.1428%	0.0039%
自基金合同生效起至今	7.4607%	0.0031%	0.7554%	0.0000%	6.7053%	0.0031%

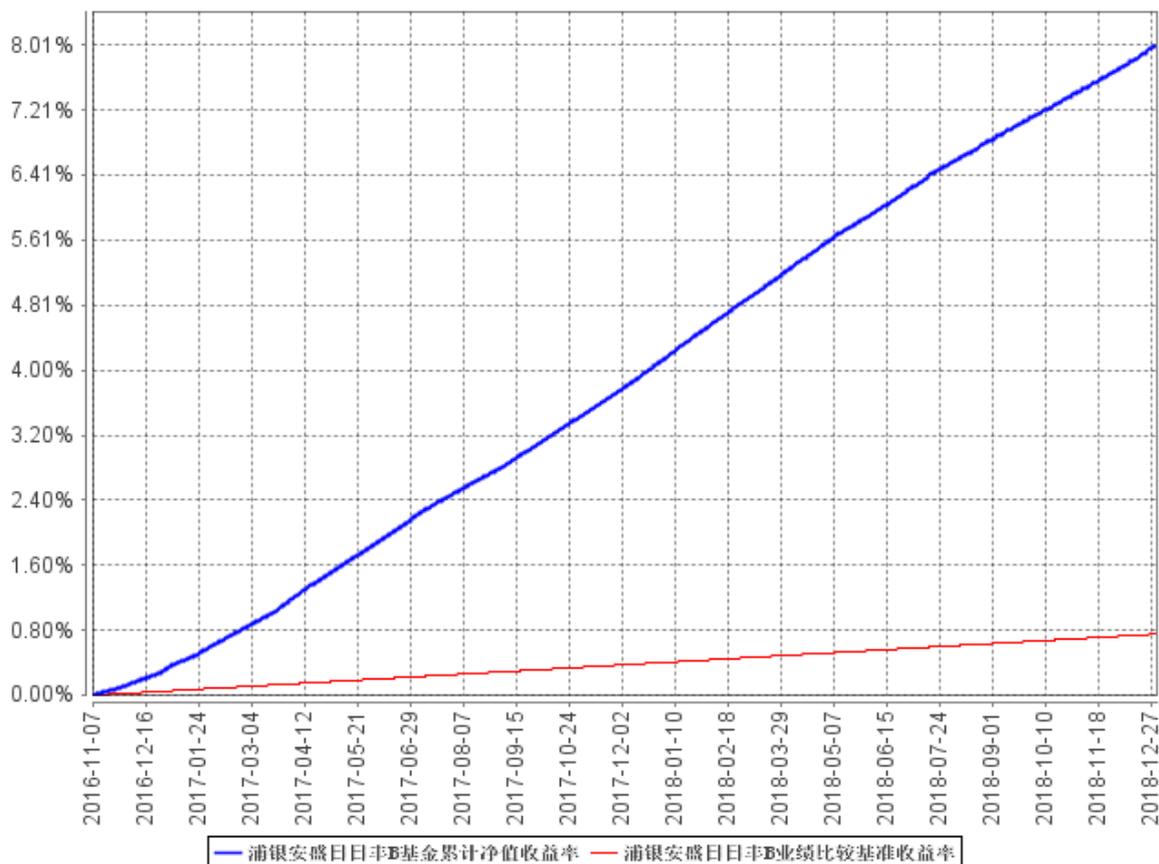
注：1、本基金收益分配按日结转份额。

### 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

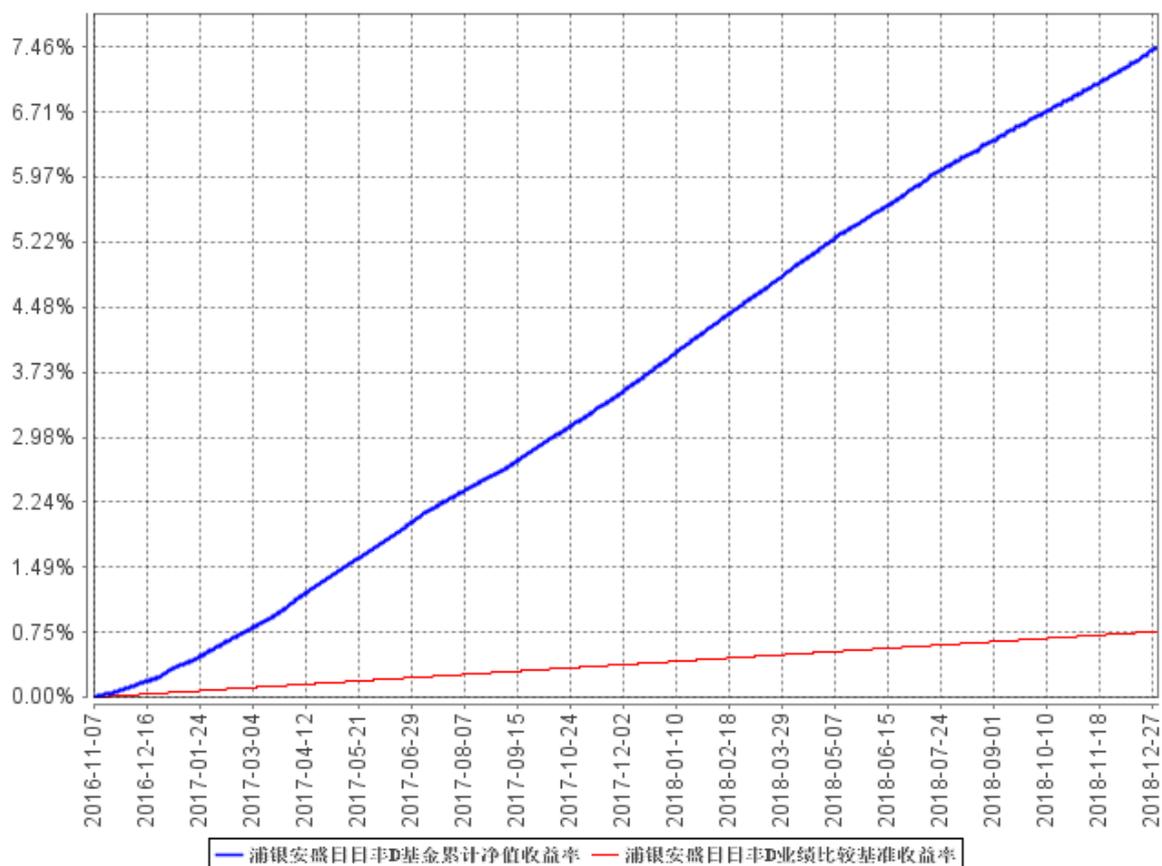
浦银安盛日日丰A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



浦银安盛日日丰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

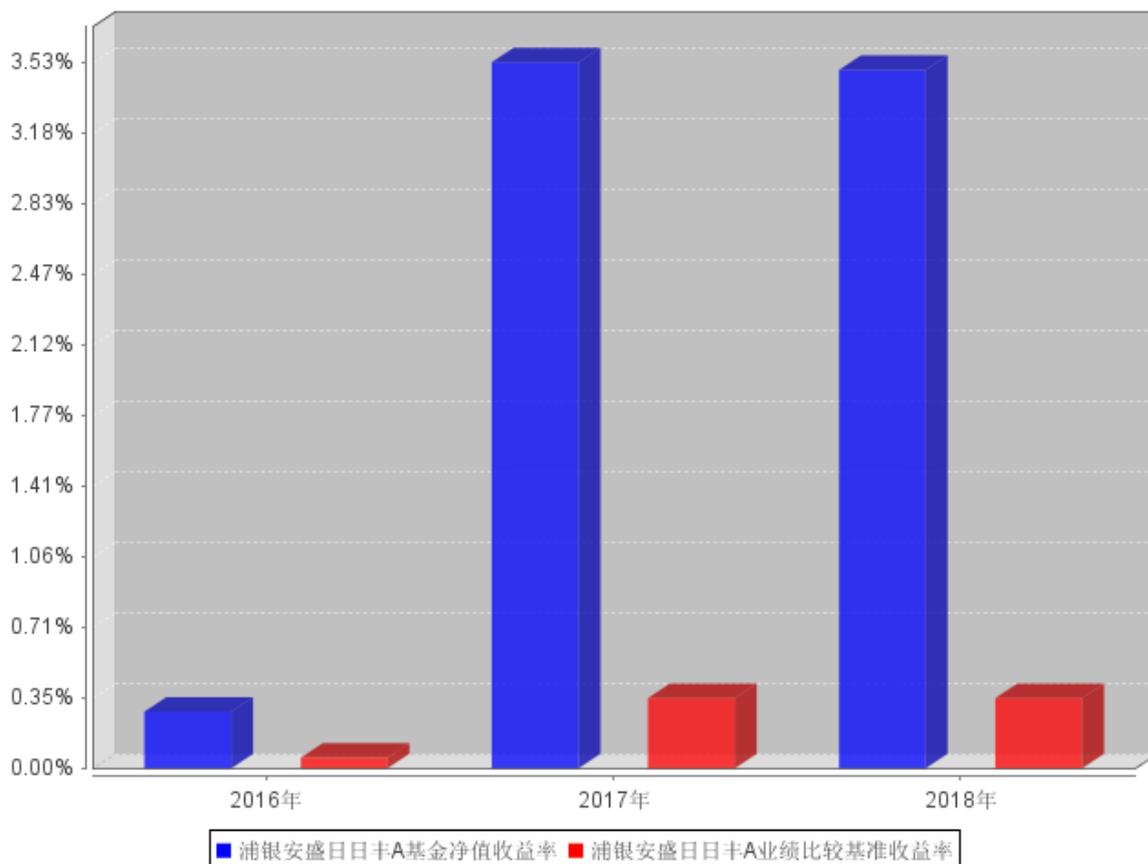


浦银安盛日日丰D基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

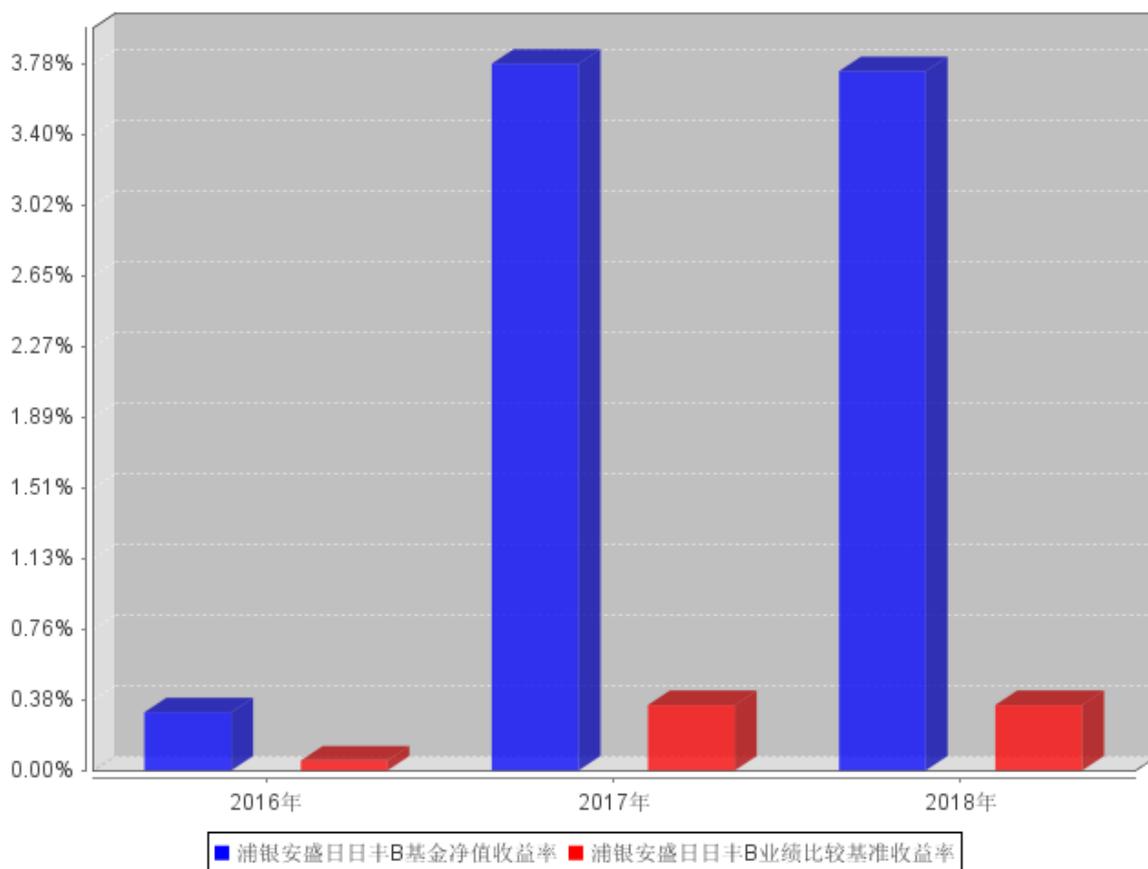


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

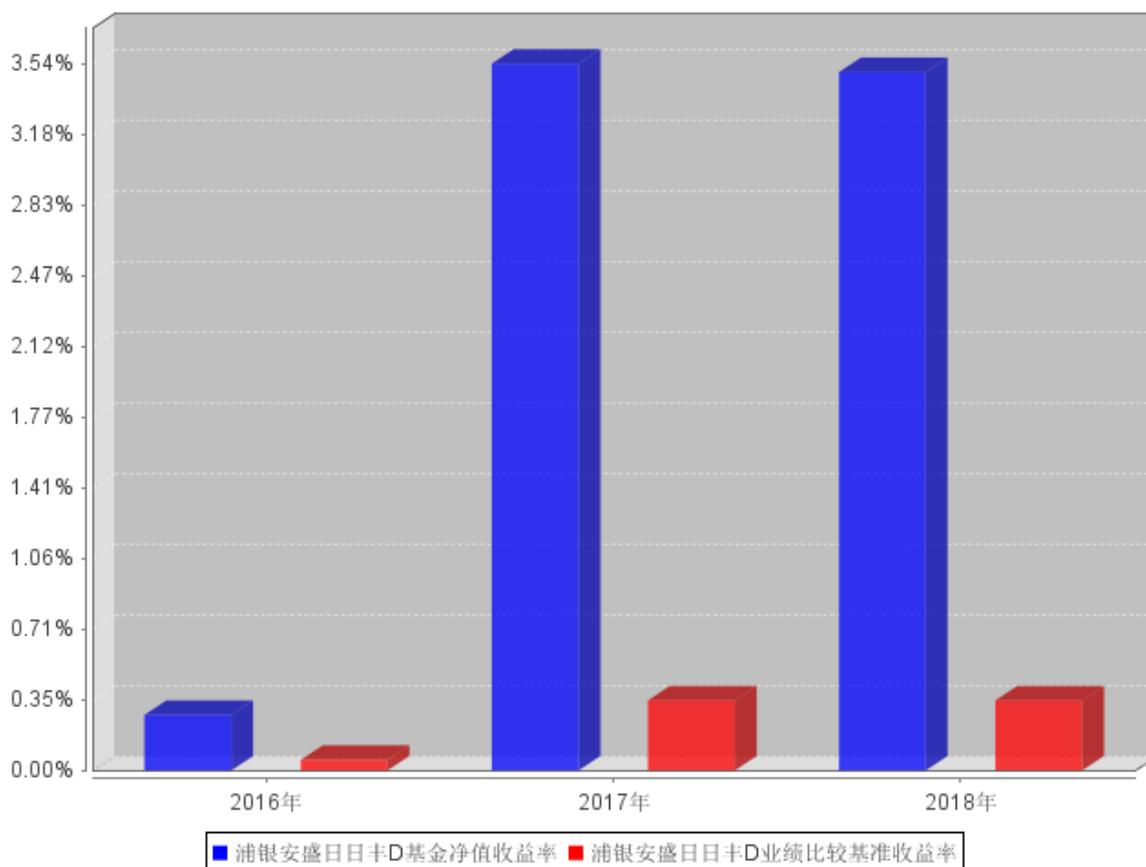
浦银安盛日日丰A自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



浦银安盛日日丰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



### 浦银安盛日日丰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：本基金合同于 2016 年 11 月 7 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。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

浦银安盛日日丰 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
2018	276,477.09	-	1,467.85	277,944.94	
2017	86,305.73	-	194.98	86,500.71	
2016	4,604.82	-	183.92	4,788.74	
合计	367,387.64	-	1,846.75	369,234.39	

单位：人民币元

浦银安盛日日丰 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
2018	10,935,844.24	-	753.58	10,936,597.82	
2017	9,271,686.76	-	22,158.29	9,293,845.05	

2016	458,082.61	-	9,622.48	467,705.09	
合计	20,665,613.61	-	32,534.35	20,698,147.96	

单位：人民币元

浦银安盛日日丰 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
2018	765,874.62	-	4,807.48	770,682.10	
2017	346,210.52	-	2,485.87	348,696.39	
2016	86.29	-	3.50	89.79	
合计	1,112,171.43	-	7,296.85	1,119,468.28	

注：本基金收益分配按日结转份额。

## §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 19.1 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 2018 年 12 月 31 日止，浦银安盛旗下共管理 43 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、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、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、浦银安盛港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安久回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛中短债债券型证券投资基金、浦银安盛普益纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛融定期开放

债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普瑞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		
刘大巍	公司旗下浦银安盛 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、浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金、浦银安盛幸福	2017 年 11 月 1 日	-	9	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 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

	聚利定期开放债券型证券投资基金、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以及浦银安盛盛融定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。				金经理。2016 年 8 月至 2018 年 7 月担任浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2017 年 4 月起，担任公司旗下浦银安盛月月盈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。2018 年 12 月起，担任浦银安盛盛融定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
王茂青	货币类基金经理助理	2018 年 1 月 22 日	-	9	王茂青女士，上海财经大学工商管理学硕士。2008 年 9 月至 2010 年 3 月在普华永道会计事务所担任审计员。2010 年 12 月至 2018 年 1 月间在农银汇理基金、上银基金和兴银基金担任过基金会计、交易员、高级交易员和基金经理助理。2018 年 1 月 22 日加入浦银安盛基金管理有限公司担任货币基金基金经理助理。

廉素君	货币类基金基金经理助理	2017 年 11 月 28 日	-	7	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 28 日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。
曹治国	货币类基金基金经理助理	2018 年 9 月 3 日	-	11	曹治国先生，华南理工大学金融学学士。2008 年 7 月至 2018 年 8 月先后就职于农业银行、浦发银行和东方证券，从事资产负债管理和金融市场等岗位。2018 年 9 月 3 日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。

注：1、本基金基金经理的任职日期为公司决定的聘任日期。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《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

公司对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查，并对发现的问题进行及时的报告。

### 4.3.3 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

2018 年国内实体经济平稳收官，GCP 增速稳中趋降，PMI 跌破荣枯线。在全球贸易增速持续下降、欧洲经济全面放缓、世界银行和 IMF 下调经济预期的背景下，2018 年全国 GDP90 万亿元，同比增长 6.6%，全年规模以上工业增加值同比增长 6.2%，固定资产投资完成额累计同比增速 5.9%。2018 年社融总共新增 19.26 万亿，同比降幅明显，主要原因是在表外融资收缩等因素的影响下，2018 年商业银行信贷投放加码，但企业中长期贷款增长仍然相对乏力。

进入 2018 年下半年，稳健的货币政策强调了相对宽松的、保持流动性合理充裕；同时在改善货币政策传导机制方面，中央经济工作会议也要求各大商业银行提高直接融资比重，解决好民营企业和小微企业融资难融资贵的问题。这也直接导致了资金利率的进一步下滑。

报告期内，本基金规模保持稳定，在期限利差过小甚至倒挂行情下，考虑到资金面波动较大，以短久期滚动续作为主，同时增加资产灵活性和流动性，便于适时调仓。大类资产配置上综合考虑资产的流动性及信用风险，优选收益风险性价比高的品种，并在各类资产收益率出现波动时，灵活进行调整。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期浦银安盛日日丰 A 的基金份额净值收益率为 3.4950%，本报告期浦银安盛日日丰 B 的基金份额净值收益率为 3.7430%，本报告期浦银安盛日日丰 D 的基金份额净值收益率为 3.4948%，同期业绩比较基准收益率为 0.3520%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年，中美贸易谈判，美联储加息节奏，国内房地产开发投资走向以及货币政策取向将会是主要影响资本市场波动的因素。

2018 年四季度以来，OECD 综合领先指标出现连续三个季度放缓。IMF 预测 2019 年全球 GDP 实际增长率为 3.65%，较 2018 年预测增长率调低 0.08%。美联储加息缩表加剧美国金融市场波动率，标准普尔 500VIX 指数由年初 9.7 上升到 12 月 30.4，美国股市下行压力增大，四季度三大股指均出现明显回落，道琼斯工业指数下滑 11.83%，标准普尔 500 指数下滑 13.97%，纳斯达克综合指数下滑 17.54%。国际原油价格在 10 月创新高后暴跌逾 40%，全球通胀预期明显减缓。

房地产开发投资自 2015 年见底，已连续 4 年向上，目前仍稳定在 9%以上的水平，而从销售数据来看，已显露出明显的下行趋势，房地产已经进入被动补库存的阶段，作为两大终端需求之一，我们认为基建投资难以大幅增长的背景下，房地产投资的疲弱将会进一步影响经济增速。

货币政策来看，疲弱的基本面并不支持货币政策从宽松状态转向，而美国加息预期减弱的背景下，汇率压力也会有所缓解，整体来看，宽松的货币政策仍将维系。

综上所述，我们认为债券市场的牛市行情尚未终结，收益率的再次大幅下行仍然可期，但在 18 年大量交易盘参与的情况下，债券市场波动性较 18 年可能会有所加大；同时在货币政策难以收紧，产业政策持续发力的支持下，权益市场相对于 18 年应该会有更好的表现；但在经济下行环境下，违约风险仍然值得关注。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了浦银安盛基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由公司副总经理暨首席运营官、风险管理部负责人、指数与量化投资部负责人、研究部负责人、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。

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司以及中债金融估值中心有限公司签订了《中

债信息产品服务三方协议》。

本基金管理人与中证指数有限公司签订了《债券估值数据服务协议》。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金《基金合同》约定，收益分配采用“每日分配、按日支付”的方式，即根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并全部分配，且于次一工作日进行支付。本报告期浦银安盛日日丰 A 级基金应分配收益 277,944.94 元，实际分配收益 277,944.94 元；浦银安盛日日丰 B 级基金应分配收益 10,936,597.82 元，实际分配收益 10,936,597.82 元，浦银安盛日日丰 D 级基金应分配收益 770,682.10 元，实际分配收益 770,682.10 元。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期浦银安盛日日丰 A 级基金应分配收益 277,944.94 元，实际分配收益 277,944.94 元；浦银安盛日日丰 B 级基金应分配收益 10,936,597.82 元，实际分配收益 10,936,597.82 元，浦银安盛日日丰 D 级基金应分配收益 770,682.10 元，实际分配收益 770,682.10 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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## §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(2019)第 22192 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	浦银安盛日日丰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丰货币市场基金(以下简称“浦银安盛日日丰货币基金”)的财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表,2018 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丰货币基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 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丰货币基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>浦银安盛日日丰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丰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</p>

	<p>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丰货币基金、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丰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，就可能导致对浦银安盛日日丰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</p>

	<p>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丰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)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>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。</p>
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	2019 年 3 月 26 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛日日丰货币市场基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	140,300,498.71	214,183,339.52
结算备付金		90,909.09	82,874.62
存出保证金		69.11	228.36
交易性金融资产	7.4.7.2	136,081,306.28	110,048,037.98
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		136,081,306.28	110,048,037.98
资产支持证券投资		-	-
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	129,455,034.20	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,372,419.90	2,518,252.88
应收股利		-	-
应收申购款		2,075,850.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	45,457.27	-
资产总计		409,421,544.56	326,832,733.36
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 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		-	9,999,795.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		77,522.30	87,333.89
应付托管费		14,355.98	13,232.41
应付销售服务费		9,607.61	7,434.21
应付交易费用	7.4.7.7	29,043.20	5,649.15
应交税费		399.74	-

应付利息		-	11,660.61
应付利润		41,677.95	34,649.04
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	309,000.00	315,000.00
负债合计		481,606.78	10,474,754.31
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	408,939,937.78	316,357,979.05
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		408,939,937.78	316,357,979.05
负债和所有者权益总计		409,421,544.56	326,832,733.36

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额为 408,939,937.78 份，其中 A 类基金份额 19,066,215.58 份，B 类基金份额 314,539,770.52 份，D 类基金份额 75,333,951.68 份。

## 7.2 利润表

会计主体：浦银安盛日日丰货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		14,353,535.52	11,160,550.14
1.利息收入		13,280,583.23	11,206,699.89
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,785,232.94	6,349,137.49
债券利息收入		4,444,415.95	2,192,358.12
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,050,934.34	2,665,204.28
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,072,952.29	-46,149.75
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	1,072,952.29	-46,149.75
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
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>		2,368,310.66	1,431,507.99
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,060,890.94	845,019.75
2. 托管费	7.4.10.2.2	164,247.99	128,033.30
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	105,657.16	54,855.25
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
5. 利息支出		692,019.33	53,695.67
其中：卖出回购金融资产支出		692,019.33	53,695.67
6. 税金及附加		1,752.51	-
7. 其他费用	7.4.7.20	343,742.73	349,904.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		11,985,224.86	9,729,042.15
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		11,985,224.86	9,729,042.15

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛日日丰货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	316,357,979.05	-	316,357,979.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,985,224.86	11,985,224.86
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）	92,581,958.73	-	92,581,958.73
其中：1. 基金申购款	511,960,695.81	-	511,960,695.81
2. 基金赎回款	-419,378,737.08	-	-419,378,737.08
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）	-	-11,985,224.86	-11,985,224.86



安盛日日丰货币市场基金基金合同》于 2016 年 11 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 206,530,330.40 份基金份额，其中认购资金利息折合 15,857.55 份基金份额。本基金的基金管理人为浦银安盛基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司（以下简称“民生银行”）。

根据《浦银安盛日日丰货币市场基金基金合同》和《浦银安盛日日丰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，本基金根据单个账户持有的基金份额数量、销售服务费收取方式和销售渠道的不同，将基金份额分为 A 类基金份额、B 类基金份额和 D 类基金份额。A 类基金份额和 D 类基金份额年销售服务率为 0.25%，B 类基金份额年销售服务率为 0.01%。在基金存续期内，若 A 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过 500 万份时，该基金账户持有的 A 类基金份额将升级为 B 类基金份额；若 B 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于 500 万份时，该基金账户持有的 B 类基金份额将降级为 A 类基金份额。D 类基金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《浦银安盛日日丰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：法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金；期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率(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 2019 年 3 月 26 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》、《浦银安盛日日丰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 2018 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 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[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》、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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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
中国民生银行股份有限公司（“民生银行”）	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：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

### 7.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

### 7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有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 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,060,890.94	845,019.75
其中：支付销售机构的客户维护费	44,005.50	54,125.64

注：自 2017 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 18 日，支付基金管理人浦银安盛的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.33% / 当年天数。

根据基金份额持有人大会表决通过的《关于浦银安盛日日丰货币市场基金降低管理费率有关事项的议案》，自 2018 年 11 月 19 日起，支付基金管理人浦银安盛的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.27% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.27% / 当年天数。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	164,247.99	128,033.30

注：支付基金托管人民生银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

## 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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 日日丰 A	浦银安盛日 日丰 B	浦银安盛 日日丰 D	合计
民生银行股份有限公司	3,223.83	167.91	0.00	3,391.74
上海浦东发展银行股份有限公司	6,872.55	0.00	53,149.79	60,022.34
浦银安盛基金管理有限公司	2,412.96	29,395.26	30.00	31,838.22
合计	12,509.34	29,563.17	53,179.79	95,252.30
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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 日日丰 A	浦银安盛日 日丰 B	浦银安盛日 日丰 D	合计
民生银行股份有限公司	1,255.28	0.00	0.00	1,255.28
上海浦东发展银行股份有限公司	2,454.32	0.00	24,306.93	26,761.25
浦银安盛基金管理有限公司	2,002.88	21,764.56	28.63	23,796.07
合计	5,712.48	21,764.56	24,335.56	51,812.60

注：本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，本基金 D 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%。三类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

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

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

日 D 类基金份额销售服务费 = 前一日 D 类基金资产净值 X 0.25 % / 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日					
	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
民生银行	-	149,535,474.59	-	-	39,050,000.00	9,238.48
上年度可比期间 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
-	-	-	-	-	-	-

#### 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	浦银安盛日日丰 A	浦银安盛日日丰 B	浦银安盛日日丰 D
基金合同生效日（2016 年 11 月 7 日）持有的基金份额	-	0.00	-
期初持有的基金份额	-	154,310,936.80	-
期间申购/买入总份额	-	5,660,074.56	-
期间因拆分变动份额	-	0.00	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	20,000,000.00	-
期末持有的基金份额	-	139,971,011.36	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	44.50%	-

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	浦银安盛日日丰 A	浦银安盛日日丰 B	浦银安盛日日丰 D
基金合同生效日（2016 年 11 月 7 日）持有的基金份额	-	0.00	-
期初持有的基金份额	-	0.00	-
期间申购/买入总份额	-	154,310,936.80	-
期间因拆分变动份额	-	0.00	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	0.00	-
期末持有的基金份额	-	154,310,936.80	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	53.46%	-

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，本基金无申赎手续费。

#### 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

浦银安盛日日丰 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 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	149,347,894.11	47.48%	134,277,654.55	46.52%

注：浦银安盛日日丰 A

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度均未持有浦银安盛日日丰 A。

浦银安盛日日丰 D

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度均未持有浦银安盛日日丰 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

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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
民生银行—活期存款	5,300,498.71	22,951.39	183,339.52	49,558.05
民生银行—定期存款	49,000,000.00	1,025,070.81	25,000,000.00	1,500,636.95
上海浦东发展银行—定期存款	10,000,000.00	408,673.61	—	—

注：本基金的活期银行存款和部分定期存款由基金托管人民生银行保管，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：本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内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、2018 年 1 月 19 日民生银行协定存款一笔，金额 1500 万元，到期日 2018 年 4 月 18 日。
- 2、2018 年 1 月 23 日民生银行协定存款一笔，金额 1500 万元，到期日 2018 年 2 月 6 日。
- 3、2018 年 1 月 29 日民生银行协定存款一笔，金额 1000 万元，到期日 2018 年 4 月 17 日。
- 4、2018 年 4 月 20 日民生银行协定存款一笔，金额 1000 万元，到期日 2018 年 7 月 20 日。
- 5、2018 年 5 月 10 日民生银行协定存款一笔，金额 5000 万元，到期日 2018 年 5 月 17 日。
- 6、2018 年 5 月 18 日民生银行协定存款一笔，金额 2200 万元，到期日 2018 年 7 月 18 日。
- 7、2018 年 5 月 21 日民生银行协定存款一笔，金额 1000 万元，到期日 2018 年 8 月 21 日。
- 8、2018 年 5 月 22 日民生银行协定存款一笔，金额 1000 万元，到期日 2018 年 7 月 23 日。
- 9、2018 年 5 月 25 日民生银行协定存款一笔，金额 900 万元，到期日 2018 年 7 月 24 日。
- 10、2018 年 6 月 5 日浦发银行协定存款一笔，金额 800 万元，到期日 2018 年 9 月 6 日。
- 11、2018 年 6 月 11 日浦发银行协定存款一笔，金额 400 万元，到期日 2018 年 8 月 10 日。
- 12、2018 年 7 月 23 日民生银行协定存款一笔，金额 1500 万元，到期日 2018 年 8 月 1 日。
- 13、2018 年 7 月 31 日民生银行协定存款一笔，金额 1000 万元，到期日 2018 年 10 月 31 日。
- 14、2018 年 9 月 5 日浦发银行协定存款一笔，金额 1000 万元，到期日 2019 年 3 月 5 日。
- 15、2018 年 9 月 6 日民生银行协定存款一笔，金额 2000 万元，到期日 2018 年 9 月 20 日。
- 16、2018 年 9 月 10 日浦发银行协定存款一笔，金额 1000 万元，到期日 2018 年 9 月 17 日。
- 17、2018 年 9 月 11 日浦发银行协定存款一笔，金额 900 万元，到期日 2018 年 9 月 18 日。
- 18、2018 年 9 月 19 日浦发银行协定存款一笔，金额 1300 万元，到期日 2018 年 9 月 26 日。
- 19、2018 年 9 月 21 日浦发银行协定存款一笔，金额 2500 万元，到期日 2018 年 9 月 28 日。
- 20、2018 年 9 月 25 日民生银行协定存款一笔，金额 1000 万元，到期日 2018 年 11 月 26 日。
- 21、2018 年 9 月 28 日浦发银行协定存款一笔，金额 1400 万元，到期日 2018 年 12 月 28 日。
- 22、2018 年 9 月 28 日浦发银行协定存款一笔，金额 1000 万元，到期日 2018 年 10 月 29 日。

23、2018 年 10 月 18 日浦发银行协定存款一笔，金额 1000 万元，到期日 2018 年 11 月 15 日。

24、2018 年 12 月 28 日民生银行协定存款一笔，金额 3000 万元，到期日 2019 年 1 月 28 日。

25、2018 年 12 月 28 日民生银行协定存款一笔，金额 1900 万元，到期日 2019 年 1 月 28 日。

#### **7.4.9 期末（2018 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：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### **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 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

###### **7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事银行间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**

本基金本报告期末无从事交易所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 2018 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 136,081,306.28 元，无属于第一或第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第二层次 110,048,037.98 元，无第一或第三层次)。

(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

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 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) 其他

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	136,081,306.28	33.24
	其中：债券	136,081,306.28	33.24
2	买入返售金融资产	129,455,034.20	31.62
3	银行存款和结算备付金合计	140,391,407.80	34.29
4	其他各项资产	3,493,796.28	0.85
5	合计	409,421,544.56	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	7.13	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)

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	2018 年 5 月 29 日	20.38	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	54
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	23

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本货币基金投资组合平均剩余期限未超过 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比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	61.82	-
2	30 天(含)—60 天	3.67	-
3	60 天(含)—90 天	9.05	-
4	90 天(含)—120 天	0.17	-
5	120 天(含)—397 天(含)	24.55	-
	合计	99.26	-

### 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 (%)
3	金融债券	20,057,928.32	4.90
	其中：政策性金融债	20,057,928.32	4.90
4	企业债券	704,875.78	0.17
5	企业短期融资券	46,081,546.41	11.27
7	同业存单	69,236,955.77	16.93
9	合计	136,081,306.28	33.28

### 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	011801696	18 大唐发电 SCP006	360,000	36,078,185.79	8.82

2	111821369	18 渤海银行 CD369	300,000	29,558,175.23	7.23
3	111897793	18 杭州银行 CD036	200,000	19,720,251.10	4.82
4	180407	18 农发 07	100,000	10,030,546.79	2.45
5	011801582	18 中车 SCP003	100,000	10,003,360.62	2.45
6	111890501	18 重庆银行 CD004	100,000	9,982,440.00	2.44
7	111819313	18 恒丰银行 CD313	100,000	9,976,089.44	2.44
8	120231	12 国开 31	50,000	5,025,042.45	1.23
9	160301	16 进出 01	50,000	5,002,339.08	1.22
10	124690	14 中电建	7,000	704,875.78	0.17

### 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
报告期内偏离度的最高值	0.1645%
报告期内偏离度的最低值	-0.0059%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0353%

#### 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 基金计价方法说明

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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	69.11
3	应收利息	1,372,419.90
4	应收申购款	2,075,850.00
6	待摊费用	45457.27
8	合计	3,493,796.28

## §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
浦银安盛日日丰 A	1,514	12,593.27	1,095,169.91	5.74%	17,971,045.67	94.26%
浦银安盛日日丰 B	7	44,934,252.93	309,484,991.54	98.39%	5,054,778.98	1.61%
浦银安盛日日丰 D	7,126	10,571.70	0.00	0.00%	75,333,951.68	100.00%
合计	8,647	47,292.70	310,580,161.45	75.95%	98,359,776.33	24.05%

### 9.2 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	基金类机构	149,347,894.11	36.52%
2	基金类机构	139,971,011.36	34.23%
3	其他机构	5,053,989.56	1.24%
4	个人	5,053,331.95	1.24%
5	其他机构	5,023,502.83	1.23%
6	其他机构	5,000,000.00	1.22%
7	基金类机构	5,000,000.00	1.22%
8	个人	2,701,884.12	0.66%
9	个人	1,356,263.42	0.33%
10	个人	1,331,424.50	0.33%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	浦银安盛日日丰 A	765,701.56	4.02%
	浦银安盛日日丰 B	0.00	0.00%
	浦银安盛日日丰 D	655,117.26	0.87%
	合计	1,420,818.82	0.35%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	浦银安盛日日丰 A	10~50
	浦银安盛日日丰 B	0
	浦银安盛日日丰 D	10~50
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	浦银安盛日日丰 A	0
	浦银安盛日日丰 B	0
	浦银安盛日日丰 D	0~10
	合计	0~10

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

	浦银安盛日日 丰 A	浦银安盛日日 丰 B	浦银安盛日日 丰 D
基金合同生效日（2016 年 11 月 7 日）基金份额总额	6,495,027.60	200,015,300.00	20,002.80
本报告期期初基金份额总额	3,659,949.28	288,652,130.30	24,045,899.47
本报告期期间基金总申购 份额	59,904,692.60	200,936,844.32	251,119,158.89
减:本报告期期间基金总赎回 份额	44,498,426.30	175,049,204.10	199,831,106.68
本报告期期末基金份额总额	19,066,215.58	314,539,770.52	75,333,951.68

注：总申购份额含红利再投、分级份额调增份额，总赎回份额含分级份额调减份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

2018 年 10 月 19 日至 2018 年 11 月 18 日，浦银安盛日日丰货币市场基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，并审议通过了《关于浦银安盛日日丰货币市场基金降低管理费率事项的议案》，详见本基金管理人于 2018 年 10 月 17 日发布的《关于浦银安盛日日丰货币市场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。

### 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

- 1、报告期内基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、本基金托管人中国民生银行股份有限公司于 2018 年 4 月 19 日公告，根据工作需要，任命张庆先生担任本公司资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。

### 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 60,000 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	
光大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	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：

本基金本报告期无新增交易单元。

**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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	6,440,180.10	90.05%	16,000,000.00	7.57%	-	-
招商证券	711,351.89	9.95%	195,300,000.00	92.43%	-	-

**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	2018 年 1 月 17 日-2018 年 1 月 18 日	0.00	150,024,877.05	150,024,877.05	0.00	0.00%
	2	2018 年 1 月 1 日-2018 年 12 月 31 日	154,310,936.80	5,660,074.56	20,000,000.00	139,971,011.36	34.23%
	3	2018 年 1 月 1 日-2018 年 12 月 31 日	134,277,654.55	15,070,239.56	0.00	149,347,894.11	36.52%
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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等相关规定，经与基金托管人协商一致，浦银安盛基金管理有限公司对旗下所涉及的公开募集证券投资基金的基金合同有关条款进行了修改。详见本基金管理人于 2018 年 3 月 30 日发布的《关于根据〈公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定〉修改基金合同的公告》。

2、经公司董事会决议通过，浦银安盛基金管理有限公司在上海、北京和深圳设立分公司。相关工商登记注册手续已办理完毕，并取得营业执照。详见基金管理人于 2018 年 6 月 6 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告》和 2019 年 1 月 8 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于设立北京、深圳分公司的公告》。

3、根据相关决议，浦银安盛日日丰货币市场基金由刘大巍管理，变更为曹治国、刘大巍共同管理。详见本基金管理人于 2019 年 3 月 1 日发布的《浦银安盛日日丰货币市场基金基金经理变更公告》。

浦银安盛基金管理有限公司

2019 年 3 月 27 日