浦银安盛货币市场证券投资基金
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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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	浦银安盛货币		
基金主代码	519509		
交易代码	519509		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011 年 3 月 9 日		
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司		
基金托管人	中信银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	32,448,576,064.54 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称：	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B	浦银安盛货币 E
下属分级基金的交易代码：	519509	519510	519516
报告期末下属分级基金的份额总额	247,243,864.15 份	32,199,419,203.04 份	1,912,997.35 份

2.2 基金产品说明

投资目标	力求在保持基金资产安全性和良好流动性的基础上，获得超越业绩比较基准的稳定收益。		
投资策略	根据对短期利率变动的预测，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略，利用基本分析和数量化分析方法，通过对短期金融工具的积极投资，在控制风险和保证流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。		
业绩比较基准	银行活期存款利率（税后）		
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。		
	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B	浦银安盛货币 E

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	李修滨
	联系电话	021-23212888	4006800000
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	lixiubin@citicbank.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95558
传真		021-23212985	010-85230024

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		
	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B	浦银安盛货币 E	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B	浦银安盛货币 E	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B	浦银安盛货币 E
本期已实现收益	12,133,166.83	1,839,924,377.35	301,049.57	9,307,822.87	1,062,153,669.95	198,018.46	4,236,997.15	28,338,621.81	167,848.66
本期利润	12,133,166.83	1,839,924,377.35	301,049.57	9,307,822.87	1,062,153,669.95	198,018.46	4,236,997.15	28,338,621.81	167,848.66
本期净值收益	3.5523%	3.8012%	3.5510%	3.9113%	4.1608%	3.9098%	2.5399%	2.7863%	2.5396%

率									
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末			2017 年末			2016 年末		
期末基金资产净值	247,243,864.15	32,199,419,203.04	1,912,997.35	295,933,949.72	41,973,994,620.30	3,361,521.22	170,201,905.40	580,481,248.23	5,469,924.31
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000	-	-	-	1.0000	1.0000	1.0000

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 9 月 15 日起，本基金增加 E 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

浦银安盛货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④

过去三个月	0.6955%	0.0008%	0.0883%	0.0000%	0.6072%	0.0008%
过去六个月	1.4887%	0.0010%	0.1766%	0.0000%	1.3121%	0.0010%
过去一年	3.5523%	0.0018%	0.3506%	0.0000%	3.2017%	0.0018%
过去三年	10.3355%	0.0036%	1.0555%	0.0000%	9.2800%	0.0036%
过去五年	19.6862%	0.0060%	1.7654%	0.0000%	17.9208%	0.0060%
自基金合同生效起至今	32.9714%	0.0058%	2.9626%	0.0001%	30.0088%	0.0057%

浦银安盛货币B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.7565%	0.0008%	0.0883%	0.0000%	0.6682%	0.0008%
过去六个月	1.6118%	0.0010%	0.1766%	0.0000%	1.4352%	0.0010%
过去一年	3.8012%	0.0018%	0.3506%	0.0000%	3.4506%	0.0018%
过去三年	11.1326%	0.0036%	1.0555%	0.0000%	10.0771%	0.0036%
过去五年	21.1318%	0.0060%	1.7654%	0.0000%	19.3664%	0.0060%
自基金合同生效起至今	35.4918%	0.0058%	2.9626%	0.0001%	32.5292%	0.0057%

浦银安盛货币E

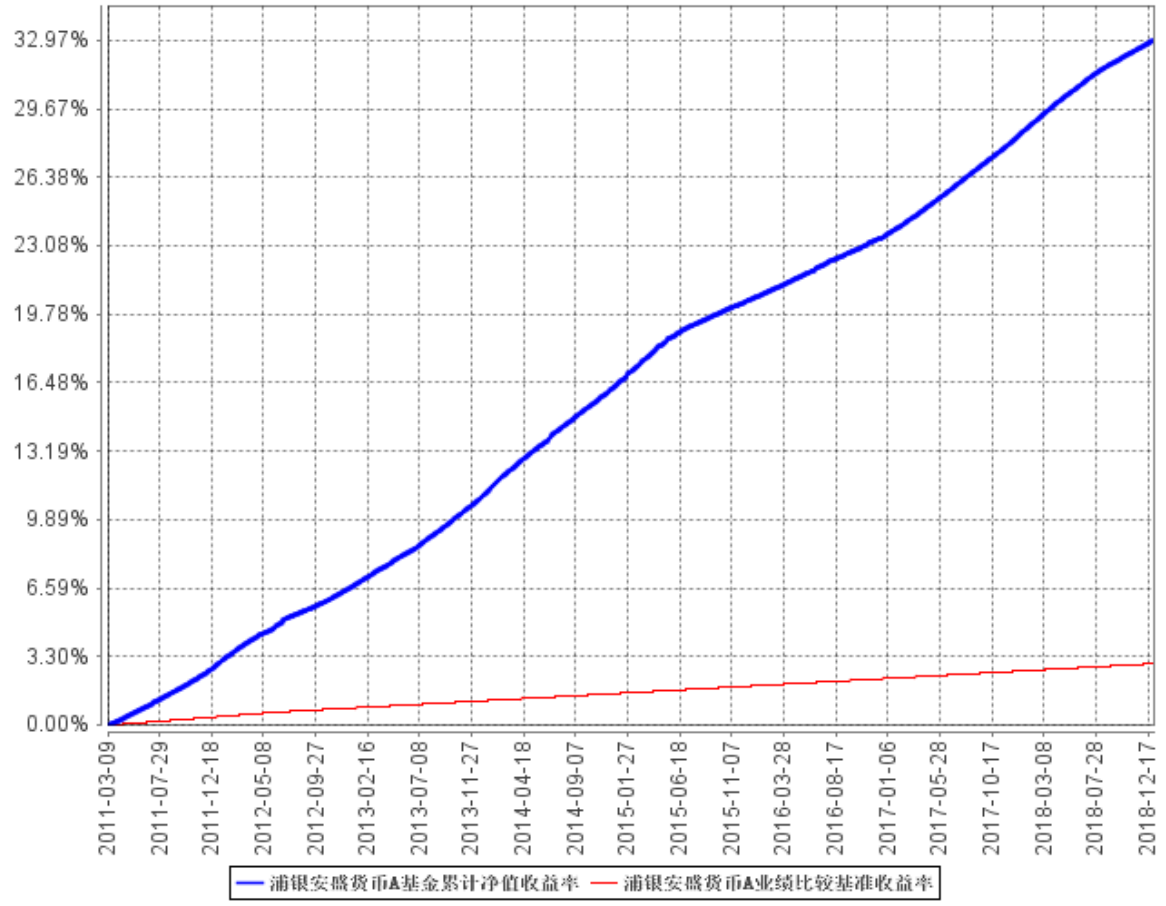
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.6946%	0.0008%	0.0883%	0.0000%	0.6063%	0.0008%
过去六个月	1.4877%	0.0010%	0.1766%	0.0000%	1.3111%	0.0010%
过去一年	3.5510%	0.0018%	0.3506%	0.0000%	3.2004%	0.0018%
过去三年	10.3324%	0.0036%	1.0555%	0.0000%	9.2769%	0.0036%
自基金合同生效起至今	15.6659%	0.0054%	1.5149%	0.0000%	14.1510%	0.0054%

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

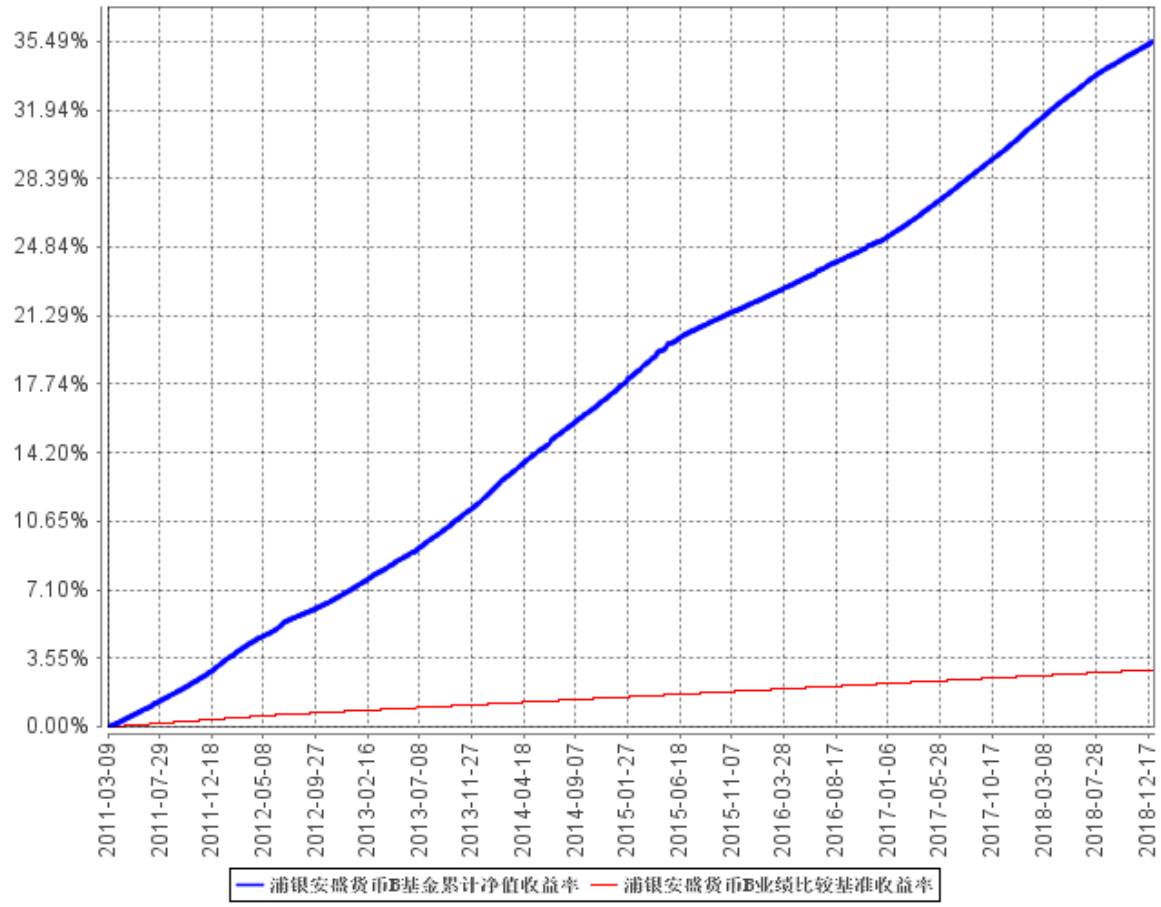
2、本基金于2014年9月15日开始分为A、B、E三类。

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

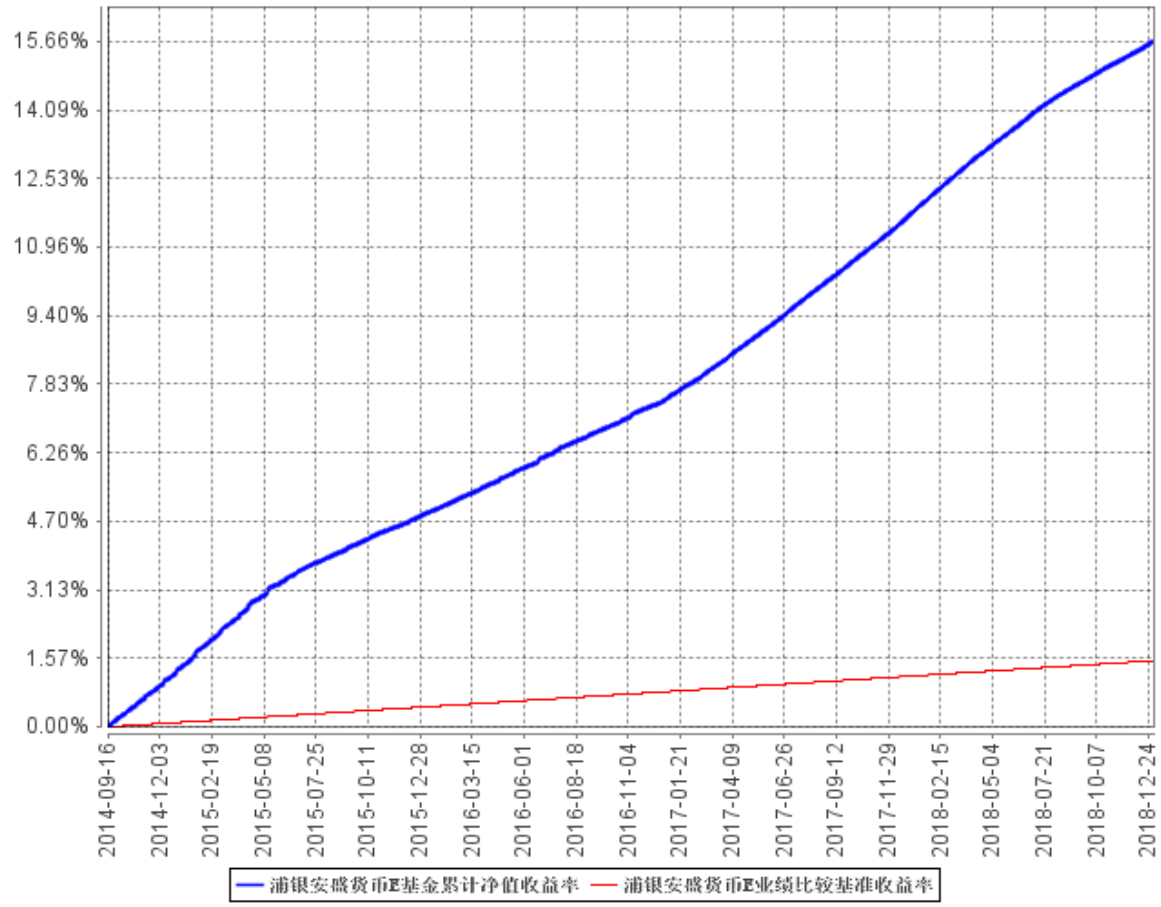
浦银安盛货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



浦银安盛货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



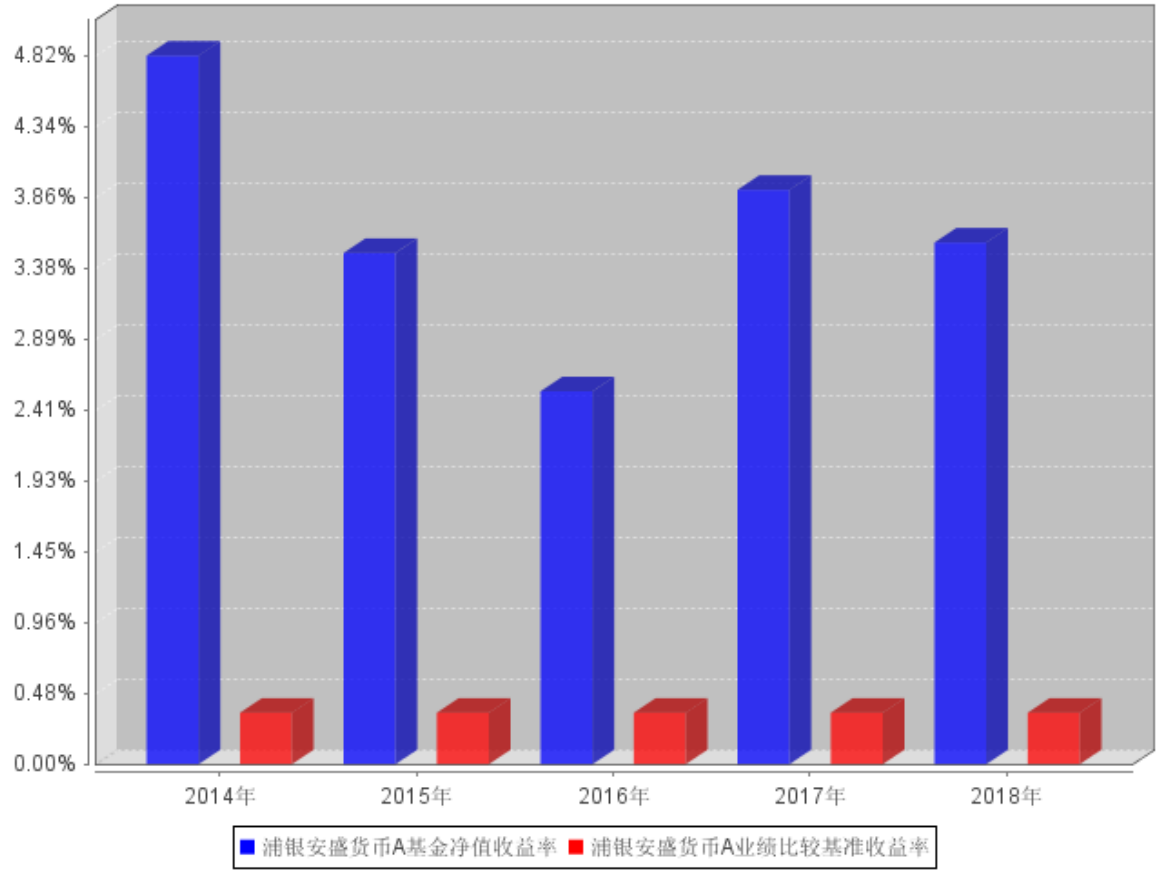
浦银安盛货币E基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



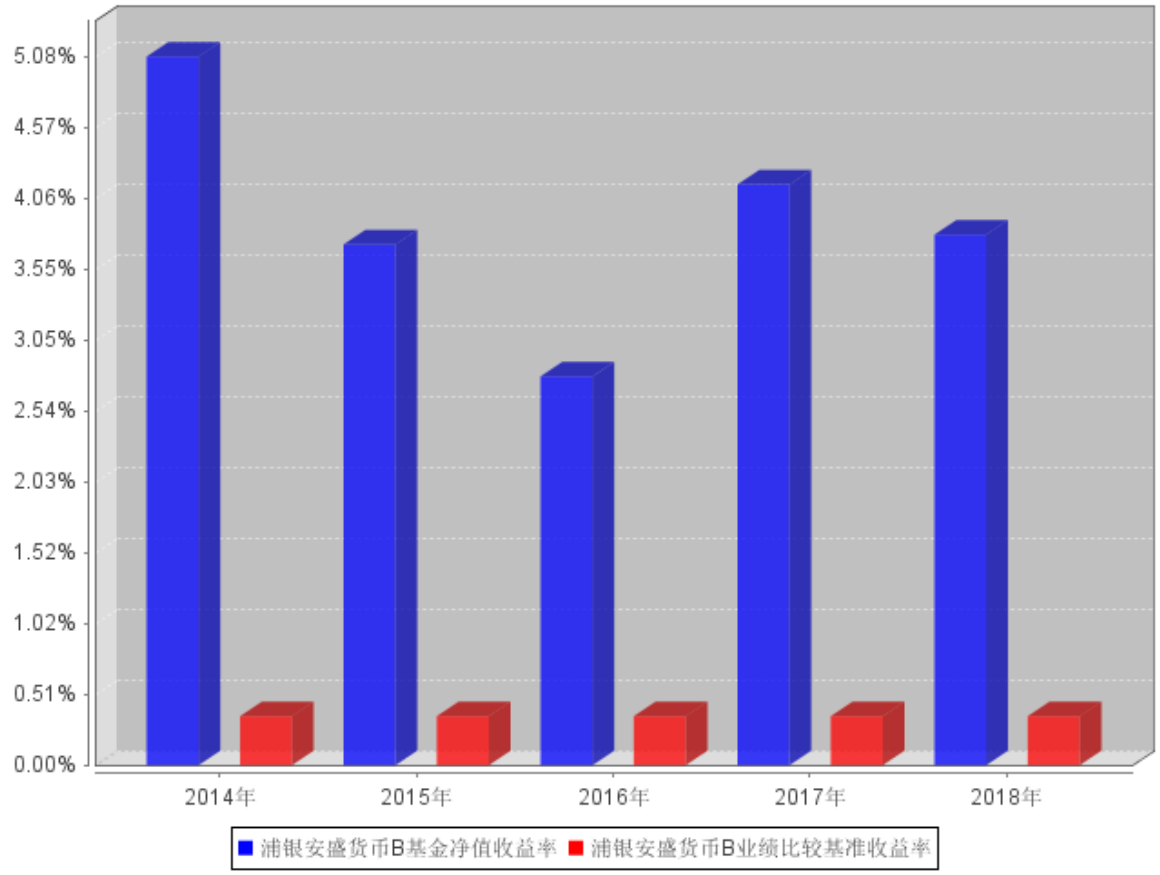
注：本基金于 2014 年 9 月 15 日开始分为 A、B、E 三类，具体内容详见本基金管理人于 2014 年 9 月 12 日刊登的《关于浦银安盛货币市场证券投资基金增加基金份额类别的公告》。

3.2.3 过去五年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

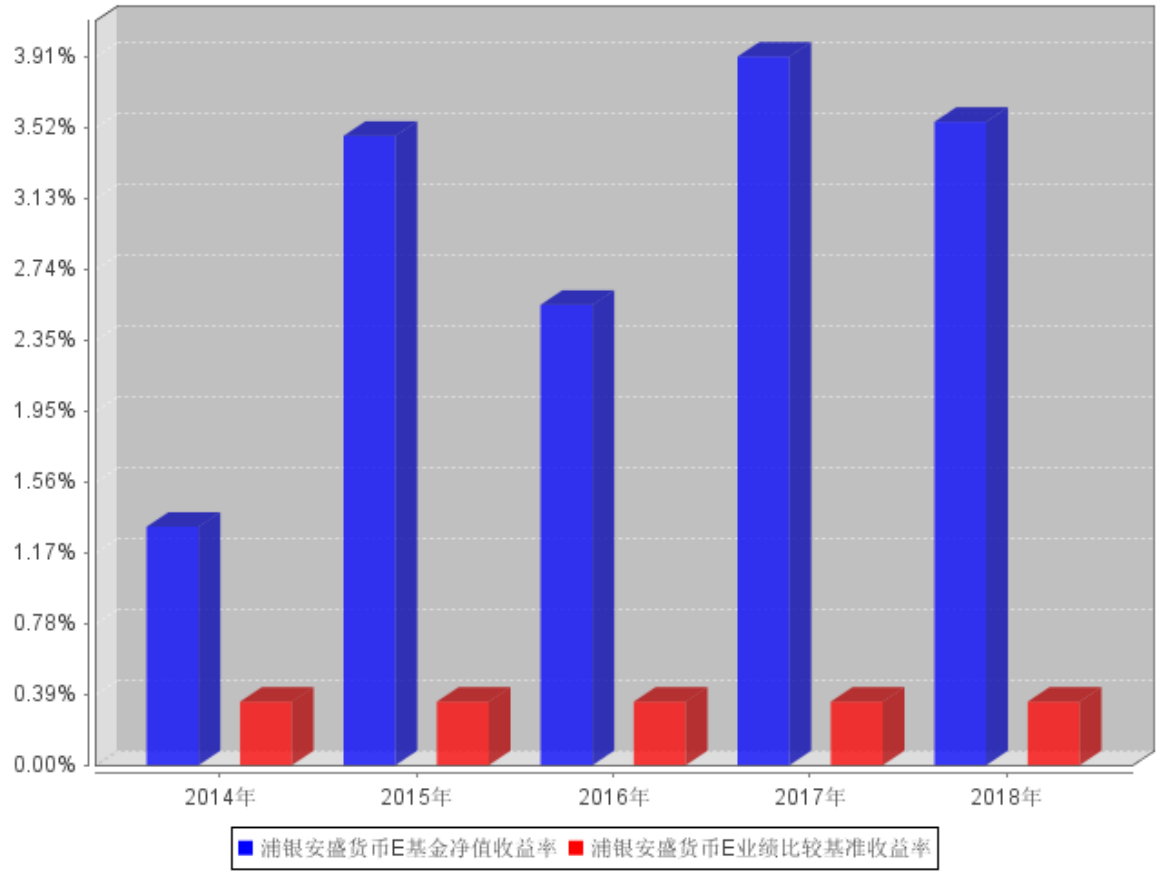
浦银安盛货币A过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



浦银安盛货币B过去五年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



浦银安盛货币E过去五年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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

浦银安盛货币 A					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2018	12,070,544.83	82,929.67	-20,307.67	12,133,166.83	
2017	9,235,677.02	245,392.83	-173,246.98	9,307,822.87	
2016	3,667,624.39	500,651.33	68,721.43	4,236,997.15	
合计	24,973,846.24	828,973.83	-124,833.22	25,677,986.85	

单位：人民币元

浦银安盛货币 B					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2018	1,830,335,431.06	12,786,216.24	-3,197,269.95	1,839,924,377.35	
2017	1,054,808,691.05	1,770,448.31	5,574,530.59	1,062,153,669.95	
2016	25,330,080.21	5,169,215.64	-2,160,674.04	28,338,621.81	

合计	2,910,474,202.32	19,725,880.19	216,586.60	2,930,416,669.11	

单位：人民币元

浦银安盛货币E					
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	299,083.29	2,275.83	-309.55	301,049.57	
2017	202,490.97	2,117.61	-6,590.12	198,018.46	
2016	152,752.56	12,468.92	2,627.18	167,848.66	
合计	654,326.82	16,862.36	-4,272.49	666,916.69	

§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		
钟明	公司旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基	2017 年 11 月 1 日	-	14	钟明女士，复旦大学 MBA。2005 年至 2017 年就职于兴全基金管理有限公司，先后从事基金会计岗位、债券交易员岗位、基金经理助理岗位和基金经理岗位。2017 年 5 月加盟浦银安盛基金管理有限公司，担任固定收益投资部副总监之职。2017 年 11 月起，担任公司旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资

	金、浦银安盛日日鑫货币市场基金、浦银安盛中短债债券型证券投资基金以及浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金基金经理。				基金、浦银安盛货币市场证券投资基金以及浦银安盛日日鑫货币市场基金基金经理。2018年10月起担任浦银安盛中短债债券型证券投资基金的基金经理。2018年12月起担任浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金的基金经理。
廉素君	货币类基金经理助理	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。
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。
曹治国	货币类基	2018年9月	-	11	曹治国先生，华南理

	金经理助理	3日			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中认定的异常交易行为。报告期内未发生旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年，国内经济基本面和国际经济环境均发生较为复杂的变化，经过 2017 年去杠杆和强监管的调整，债市收益率处于历史高位，催生债券牛市行情，10Y 国债较 2017 年底下行 65.42BP 至 3.23%，10Y 国开债下行 118BP 至 3.64%。基本面来看，去杠杆的后期影响-非标和委托贷款等规模的持续压缩，使得社融规模断崖式下降，基建投资、制造业投资和房地产投资持续放缓；金融监管使得银行受制于监管指标，信贷投放意愿明显减弱，实体经济活力受到压制；3 月由美国挑起的贸易摩擦持续发酵，引发人民币快速贬值，贸易顺差减少，国内经济增速由一季度 6.8% 逐步回落至四季度 6.4%。国际来看，美国经济增速一枝独秀，前三季度增速强劲，但随着美联储连续 4 次加息，经济动能已有趋弱迹象；欧洲经济增速疲软，且欧盟内部英国脱欧、意大利政府预算等问题仍未解决，间接影响中国出口对经济的拉动。内外承压，央行在一季度将货币政策立足点由“去杠杆” 转变为“稳增长、防风险”，后期随着 PMI 的不断走低，货币政策宽松力度亦逐步加大，一方面为疏通货币政策传导机制，缓解中小企业融资难，另一方面兼顾外汇市场平衡。从政策工具来看，2018 年央行 4 次降准，同时实施 17 次 MLF 投放 4.95 万亿流动性，银行间 7 天回购利率 R007 由上半年的 2.9-3.2%，中枢回落至 2.5-2.6%，同时较上半年波动明显降低。在资金面宽松的预期下，货币市场各类资产收益率大幅下行，1Y 国开债收益率下行 193BP 至 2.75%、1Y 同业存单收益率下行 167BP 至 3.38%，3MAAA 同业存单下行 215BP 至 3.15%；货币基金作为流动性管理工具，规模也较 2017 年继续增长。报告期内，本基金运作过程中紧盯资金面变化，在货币政策及市场趋势变化节点，灵活调整账户的大类资产切换、长短久期切换、杠杆操作等，以获取相对较高投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期浦银安盛货币 A 的基金份额净值收益率为 3.5523%，本报告期浦银安盛货币 B 的基金份额净值收益率为 3.8012%，本报告期浦银安盛货币 E 的基金份额净值收益率为 3.5510%，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

展望 2019 年，宏观层面，海外美国经济增速大概率高点已过，或将转而温和回落，欧洲经济动能趋弱，整体海外对国内出口的拉动力度或将继续减弱。国内随着央行降准、地方债提前发行、推动银行发行永续债等一系列措施，银行信贷投放意愿将加大，市场风险偏好或将提升。在金融数据、经济数据未明显触底回升之前，货币政策仍将维持宽松环境，债市或将维持震荡行情，随着风险偏好的提升，利率面临波动加大的压力，优质信用债券利差可能收窄。在风险偏好

未明显提升之前，货币基金仍对机构具有相对吸引力，但在运作过程中需紧盯社融数据和经济数据变动、关注央行货币政策的细微变化，灵活调整久期和杠杆比例，获取相对较高收益。

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

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、按日支付”的方式，即为投资者每日计算当日收益并分配，每日支付。本报告期浦银货币A级基金应分配收益12,133,166.83元，实际分配收益12,133,166.83元；浦银货币B级基金应分配收益1,839,924,377.35元，实际分配收益1,839,924,377.35元；浦银货币E级基金应分配收益301,049.57元，实际分配收益301,049.57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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对浦银安盛货币市场证券投资基金 2018 年度的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，浦银安盛基金管理有限公司在浦银安盛货币市场证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，浦银安盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的浦银安盛货币市场证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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 22213 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	浦银安盛货币市场证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了浦银安盛货币市场证券投资基金(以下简称“浦银安盛货币市场基金”)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。 (二)我们的意见 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货币市场基金 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。
形成审计意见的基础	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。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于浦银安盛货币市场基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
管理层和治理层对财务报表的责任	浦银安盛货币市场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。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估浦银安盛货币市

	场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货币市场基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督浦银安盛货币市场基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： (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。 (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。 (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。 (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货币市场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

	可能导致浦银安盛货币市场基金不能持续经营。 (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。 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	2019 年 3 月 26 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛货币市场证券投资基金

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
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	10,023,422,477.93	27,042,659,512.44
结算备付金		93,859,999.99	-
存出保证金		2,719,626.61	-
交易性金融资产	7.4.7.2	14,733,720,328.47	9,884,299,092.40
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		14,395,720,328.47	9,884,299,092.40
资产支持证券投资		338,000,000.00	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	7,938,433,295.16	5,182,323,333.49
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	165,775,308.92	177,811,658.23
应收股利		-	-
应收申购款		21,056,100.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		32,978,987,137.08	42,287,093,596.56
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2018 年 12 月 31 日**	**上年度末 2017 年 12 月 31 日**
负 债：			
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		518,798,701.80	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,264,097.03	5,076,802.60
应付托管费		1,754,698.99	1,692,267.54
应付销售服务费		402,743.49	397,581.29
应付交易费用	7.4.7.7	250,046.79	107,176.64
应交税费		81,976.80	-

应付利息		530,017.56	-
应付利润		3,069,790.08	6,287,677.25
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	259,000.00	242,000.00
负债合计		530,411,072.54	13,803,505.32
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	32,448,576,064.54	42,273,290,091.24
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		32,448,576,064.54	42,273,290,091.24
负债和所有者权益总计		32,978,987,137.08	42,287,093,596.56

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 32,448,576,064.54 份，其中 A 类基金份额 247,243,864.15 份，B 类基金份额 32,199,419,203.04 份， E 类基金份额 1,912,997.35 份。

7.2 利润表

会计主体：浦银安盛货币市场证券投资基金

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
一、收入		1,986,539,547.63	1,152,303,152.37
1.利息收入		1,979,696,517.09	1,153,393,156.94
其中：存款利息收入	7.4.7.11	988,314,528.87	727,674,061.45
债券利息收入		468,476,210.77	257,629,082.53
资产支持证券利息收入		6,417,196.10	-
买入返售金融资产收入		516,488,581.35	168,090,012.96
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,842,020.04	-1,090,004.57
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	6,842,061.14	-1,090,004.57
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-41.10	-
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	1,010.50	-
减：二、费用		134,180,953.88	80,643,641.09
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	73,716,663.24	48,574,842.61
2．托管费	7.4.10.2.2	24,572,220.98	15,612,192.88
3．销售服务费	7.4.10.2.3	5,748,511.46	3,130,378.23
4．交易费用	7.4.7.19	-	-
5．利息支出		29,617,096.54	12,818,172.77
其中：卖出回购金融资产支出		29,617,096.54	12,818,172.77
6．税金及附加		71,026.58	-
7．其他费用	7.4.7.20	455,435.08	508,054.60
三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列）		1,852,358,593.75	1,071,659,511.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,852,358,593.75	1,071,659,511.28

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛货币市场证券投资基金

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）	42,273,290,091.24	-	42,273,290,091.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,852,358,593.75	1,852,358,593.75
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）	-9,824,714,026.70	-	-9,824,714,026.70
其中：1.基金申购款	78,380,629,856.85	-	78,380,629,856.85
2.基金赎回款	-88,205,343,883.55	-	-88,205,343,883.55
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）	-	-1,852,358,593.75	-1,852,358,593.75

五、期末所有者权益（基金净值）	32,448,576,064.54	-	32,448,576,064.54
项目	**上年度可比期间 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）	756,153,077.94	-	756,153,077.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,071,659,511.28	1,071,659,511.28
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）	41,517,137,013.30	-	41,517,137,013.30
其中：1.基金申购款	76,694,622,715.08	-	76,694,622,715.08
2.基金赎回款	-35,177,485,701.78	-	-35,177,485,701.78
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）	-	-1,071,659,511.28	-1,071,659,511.28
五、期末所有者权益（基金净值）	42,273,290,091.24	-	42,273,290,091.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

郁蓓华	郁蓓华	钱琨
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

浦银安盛货币市场证券投资基金(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[2010]1479 号文批准，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《浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,773,820,436.52 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 073 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同》于

2011 年 3 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,774,407,616.02 份，其中认购资金利息折合 587,179.50 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，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同》和《浦银安盛货币市场证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据单个账户持有的基金份额数量和销售服务费率的不同，将基金份额分为 A 类基金份额和 B 类基金份额。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。自 2014 年 9 月 15 日起，本基金管理人为指定的特定销售渠道增加本基金的 E 类基金份额，该类份额仅能通过特定的销售渠道办理申购、赎回等业务，且不适用基金份额自动升降级机制，其余业务规则及基金费率与 A 类基金份额的业务规则相同。本基金 A 类基金份额和 E 类基金份额年销售服务费率为 0.25%， B 类基金份额年销售服务费率为 0.01%，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《浦银安盛货币市场证券投资基金招募说明书》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、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券、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。本基金业绩比较基准为银行活期存款利率(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》、《浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同》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
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	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	73,716,663.24	48,574,842.61
其中：支付销售机构的客户维护费	1,438,141.96	793,771.15

注：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 0.15%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 × 0.15%/ 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	24,572,220.98	15,612,192.88

注：支付基金托管人中信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			
	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B	浦银安盛货币 E	合计
中信银行股份有限公司	19,022.18	804.71	0.00	19,826.89
上海浦东发展银行股份有限公司	60,561.72	5,133.36	0.00	65,695.08
浦银安盛基金管理有限公司	58,532.49	4,701,729.83	0.00	4,760,262.32
合计	138,116.39	4,707,667.90	0.00	4,845,784.29
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			
	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B	浦银安盛货币 E	合计
中信银行股份有限公司	21,636.78	780.57	0.00	22,417.35
上海浦东发展银行股份有限公司	40,741.72	29.64	0.00	40,771.36
浦银安盛基金管理有限公司	39,578.73	2,475,368.08	0.00	2,514,946.81
合计	101,957.23	2,476,178.29	0.00	2,578,135.52

注：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。本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率。 B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受 B 类基金份额的费率。本基金 E 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，且不适用基金份额的自动升降级机制。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 E 类基金份额销售服务费＝前一日 E 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

本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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

中信银行	292,347,000.00	149,535,474.59	-	-	-	-
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
中信银行	-	-	-	-	-	-

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		
	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B	浦银安盛货币E
期初持有的基金份额	1,039,249.87	-	-
期间申购/买入总份额	37,314.48	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	315.63	-	-
期末持有的基金份额	1,076,248.72	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.44%	-	-

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B	浦银安盛货币E
期初持有的基金份额	-	94,413,092.02	-
期间申购/买入总份额	1,039,249.87	1,606,907.46	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	96,019,999.48	-
期末持有的基金份额	1,039,249.87	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.35%	-	-

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，本基金无申购赎回手续费。

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

浦银安盛货币 A

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	-	-	4,626,707.48	1.56%

浦银安盛货币 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	5,797,951.12	0.02%	-	-
上海浦东发展银行股份有限公司	18,496,634,061.48	57.44%	20,708,683,738.48	49.34%
中信银行股份有限公司	-	-	3,034,087,393.57	7.23%

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货币 E。

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
中信银行-活期	83,422,477.93	3,612,534.73	659,512.44	803,965.83
上海浦东发展银行-定期	750,000,000.00	133,576,221.94	3,500,000,000.00	27,571,361.15
中信银行-定	300,000,000.00	43,894,583.32	4,100,000,000.00	55,076,366.51

期				
合计	1,133,422,477.93	181,083,339.99	7,600,659,512.44	83,451,693.49

注：本基金的活期银行存款和部分定期存款由基金托管人中信银行保管，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

金额单位：人民币元

本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
中信银行	111808251	18 中信银行 CD251	报价发行	3,000,000	292,347,000.00
上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
中信银行	-	-	-	-	-

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

1、2018 年 1 月 3 日浦发银行协定存款一笔，金额 50000 万元，到期日 2018 年 4 月 3 日。

2、2018 年 1 月 5 日浦发银行协定存款一笔，金额 50000 万元，到期日 2018 年 4 月 2 日。

3、2018 年 1 月 19 日中信银行协定存款一笔，金额 100000 万元，到期日 2018 年 4 月 19 日。

4、2018 年 1 月 22 日中信银行协定存款一笔，金额 50000 万元，到期日 2018 年 4 月 18 日。

5、2018 年 1 月 22 日中信银行协定存款一笔，金额 50000 万元，到期日 2018 年 4 月 19 日。

6、2018 年 1 月 29 日浦发银行协定存款一笔，金额 20000 万元，到期日 2018 年 4 月 27 日。

7、2018 年 1 月 30 日浦发银行协定存款一笔，金额 50000 万元，到期日 2018 年 4 月 27 日。

8、2018 年 1 月 30 日浦发银行协定存款一笔，金额 42000 万元，到期日 2018 年 4 月 27 日。

9、2018年3月7日浦发银行协定存款一笔，金额200000万元，到期日2018年3月14日。

10、2018年3月14日浦发银行协定存款一笔，金额200000万元，到期日2018年3月21日。

11、2018年3月21日浦发银行协定存款一笔，金额200000万元，到期日2018年3月28日。

12、2018年3月28日浦发银行协定存款一笔，金额200000万元，到期日2018年4月4日。

13、2018年4月4日浦发银行协定存款一笔，金额200000万元，到期日2018年4月11日。

14、2018年4月10日浦发银行协定存款一笔，金额230000万元，到期日2018年4月17日。

15、2018年4月11日浦发银行协定存款一笔，金额200000万元，到期日2018年4月18日。

16、2018年4月17日浦发银行协定存款一笔，金额230000万元，到期日2018年4月24日。

17、2018年4月18日浦发银行协定存款一笔，金额200000万元，到期日2018年4月25日。

18、2018年4月24日浦发银行协定存款一笔，金额230000万元，到期日2018年5月2日。

19、2018年4月25日浦发银行协定存款一笔，金额200000万元，到期日2018年5月2日。

20、2018年5月2日浦发银行协定存款一笔，金额200000万元，到期日2018年5月9日。

21、2018年5月2日浦发银行协定存款一笔，金额230000万元，到期日2018年5月8日。

22、2018年5月8日浦发银行协定存款一笔，金额230000万元，到期日2018年5月15日。

23、2018年5月9日浦发银行协定存款一笔，金额200000万元，到期日2018年5月16日。

24、2018年5月15日浦发银行协定存款一笔，金额230000万元，到期日2018年5月22日。

25、2018年5月16日浦发银行协定存款一笔，金额200000万元，到期日2018年5月23日。

26、2018年5月17日浦发银行协定存款一笔，金额60000万元，到期日2018年8月22日。

27、2018年5月18日浦发银行协定存款一笔，金额50000万元，到期日2018年8月20日。

28、2018年5月22日浦发银行协定存款一笔，金额50000万元，到期日2018年9月6日。

29、2018年5月22日浦发银行协定存款一笔，金额230000万元，到期日2018年5月29日。

30、2018年5月23日浦发银行协定存款一笔，金额200000万元，到期日2018年5月30日。

31、2018年5月29日浦发银行协定存款一笔，金额230000万元，到期日2018年6月5日。

32、2018年5月30日浦发银行协定存款一笔，金额200000万元，到期日2018年6月6日。

33、2018年6月1日中信银行协定存款一笔，金额50000万元，到期日2018年6月14日。

34、2018年6月5日浦发银行协定存款一笔，金额230000万元，到期日2018年6月12日。

35、2018年6月6日浦发银行协定存款一笔，金额200000万元，到期日2018年6月11日。

36、2018年6月8日浦发银行协定存款一笔，金额50000万元，到期日2018年8月9日。

37、2018年6月11日浦发银行协定存款一笔，金额40000万元，到期日2018年8月10日。

38、2018年6月12日浦发银行协定存款一笔，金额230000万元，到期日2018年6月19日。

39、2018年6月14日浦发银行协定存款一笔，金额15000万元，到期日2018年8月10

日。

40、2018年6月15日浦发银行协定存款一笔，金额20000万元，到期日2018年8月6日。

41、2018年6月19日浦发银行协定存款一笔，金额230000万元，到期日2018年6月26日。

42、2018年6月26日浦发银行协定存款一笔，金额230000万元，到期日2018年7月3日。

43、2018年7月3日浦发银行协定存款一笔，金额230000万元，到期日2018年7月10日。

44、2018年7月3日浦发银行协定存款一笔，金额50000万元，到期日2018年10月9日。

45、2018年8月22日浦发银行协定存款一笔，金额33200万元，到期日2018年8月29日。

46、2018年9月3日浦发银行协定存款一笔，金额200000万元，到期日2018年11月30日。

47、2018年9月10日浦发银行协定存款一笔，金额100000万元，到期日2018年9月17日。

48、2018年9月10日浦发银行协定存款一笔，金额110000万元，到期日2018年9月17日。

49、2018年9月18日浦发银行协定存款一笔，金额100000万元，到期日2018年9月25日。

50、2018年9月18日中信银行协定存款一笔，金额30000万元，到期日2019年2月26日。

51、2018年9月19日浦发银行协定存款一笔，金额50000万元，到期日2018年9月26日。

52、2018年9月19日浦发银行协定存款一笔，金额100000万元，到期日2018年9月26日。

53、2018年9月19日浦发银行协定存款一笔，金额100000万元，到期日2018年9月26日。

54、2018年10月9日浦发银行协定存款一笔，金额100000万元，到期日2018年11月8

日。

55、2018 年 10 月 15 日浦发银行协定存款一笔，金额 40000 万元，到期日 2019 年 4 月 17 日。

56、2018 年 12 月 3 日浦发银行协定存款一笔，金额 30000 万元，到期日 2019 年 3 月 6 日。

57、2018 年 12 月 5 日浦发银行协定存款一笔，金额 5000 万元，到期日 2019 年 3 月 13 日。

58、2018 年 10 月 8 日浦银安盛货币买入中信银行同业存单 2.95 亿，占基金净资产 0.75%

59、2018 年 10 月 16 日浦银安盛货币承销买入中信银行同业存单 2.92 亿，占基金净资产 0.70%

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

截止本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金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 518,798,701.80 元，是以如下债券作为抵押。

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
140202	14 国开 02	2019 年 1 月 2 日	100.09	1,200,000	120,108,000.00
180404	18 农发 04	2019 年 1 月 2 日	100.27	550,000	55,148,500.00
180407	18 农发 07	2019 年 1 月 2 日	100.37	2,600,000	260,962,000.00
120202	12 国开 02	2019 年 1 月 3 日	100.07	900,000	90,063,000.00
140422	14 农发 22	2019 年 1 月 3 日	100.56	200,000	20,112,000.00

合计				5,450,000	546,393,500.00

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14,733,720,328.47元，无属于第一或第三层次的余额(2017年12月31日：第二层次9,884,299,092.40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	14,733,720,328.47	44.68
	其中：债券	14,395,720,328.47	43.65
	资产支持证券	338,000,000.00	1.02
2	买入返售金融资产	7,938,433,295.16	24.07
3	银行存款和结算备付金合计	10,117,282,477.92	30.68
4	其他各项资产	189,551,035.53	0.57
5	合计	32,978,987,137.08	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	2.26	
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	518,798,701.80	1.60

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 12 月 27 日	21.44	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	64
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	67
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。

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	40.38	1.60
2	30 天(含)—60 天	18.64	-
3	60 天(含)—90 天	13.79	-
4	90 天(含)—120 天	14.54	-
5	120 天(含)—397 天（含）	13.72	-
合计		101.06	1.60

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	50,021,700.33	0.15
3	金融债券	2,687,809,744.86	8.28
	其中：政策性金融债	2,687,809,744.86	8.28
4	企业债券	49,912,977.66	0.15
5	企业短期融资券	620,141,508.11	1.91
6	中期票据	30,210,160.24	0.09
7	同业存单	10,957,624,237.27	33.77
9	合计	14,395,720,328.47	44.36

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	111895838	18 盛京银行 CD157	8,000,000	789,837,758.44	2.43
2	111815613	18 民生银行 CD613	5,000,000	497,474,898.14	1.53
2	111810569	18 兴业银行 CD569	5,000,000	497,474,898.14	1.53
3	111821376	18 渤海银行 CD376	5,000,000	496,969,509.09	1.53
4	111814225	18 江苏银行 CD225	5,000,000	489,790,592.11	1.51
5	111814270	18 江苏银行 CD270	4,000,000	397,960,393.05	1.23
6	111884300	18 盛京银行 CD386	4,000,000	397,604,703.20	1.23
7	111816312	18 上海银行 CD312	4,000,000	396,411,620.13	1.22
8	111887618	18 宁波银行 CD208	4,000,000	395,785,776.66	1.22
9	140202	14 国开 02	3,900,000	390,362,693.01	1.20
10	160412	16 农发 12	3,800,000	379,817,457.09	1.17

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	0.0846%
报告期内偏离度的最低值	-0.0120%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0226%

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	149553	宁远04A1(总价)	2,400,000.00	240,000,000.00	0.74
2	156288	宁远07A1(总价)	980,000.00	98,000,000.00	0.30

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	2,719,626.61
3	应收利息	165,775,308.92
4	应收申购款	21,056,100.00
8	合计	189,551,035.53

§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
浦银安盛货币A	16,444	15,035.51	27,875,536.63	11.27%	219,368,327.52	88.73%
浦银安盛货币B	75	429,325,589.37	32,145,915,573.75	99.83%	53,503,629.29	0.17%
浦银安盛货币E	2,251	849.84	1,551,590.67	81.11%	361,406.68	18.89%
合计	18,770	1,728,746.73	32,175,342,701.05	99.16%	273,233,363.49	0.84%

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	银行类机构	18,496,634,061.48	57.00%
2	其他机构	2,262,670,657.00	6.97%
3	券商类机构	1,206,460,279.98	3.72%
4	银行类机构	1,096,386,597.92	3.38%
5	其他机构	800,613,898.25	2.47%

6	银行类机构	718,645,389.15	2.21%
7	银行类机构	600,461,931.94	1.85%
8	银行类机构	500,383,686.39	1.54%
9	券商类机构	500,053,396.88	1.54%
10	保险类机构	481,516,583.63	1.48%

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	浦银安盛货币 A	658,687.62	0.27%
	浦银安盛货币 B	0.00	0.00%
	浦银安盛货币 E	0.00	0.00%
	合计	658,687.62	0.00%

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	浦银安盛货币 A	0
	浦银安盛货币 B	0
	浦银安盛货币 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	浦银安盛货币 A	0
	浦银安盛货币 B	0
	浦银安盛货币 E	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B	浦银安盛货币 E
基金合同生效日（2011年3月9日）基金份额总额	2,574,555,555.18	1,199,852,060.84	-
本报告期期初基金份额总额	295,933,949.72	41,973,994,620.30	3,361,521.22
本报告期期间基金总申购份额	756,831,122.63	77,605,502,674.29	18,296,059.93
减:本报告期期间基金总赎回份额	805,521,208.20	87,380,078,091.55	19,744,583.80
本报告期期末基金份额总额	247,243,864.15	32,199,419,203.04	1,912,997.35

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

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，未有改聘情况发生。本报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 170,000 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 8 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	

国信证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	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新时代证券交易单元。

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
国信证券	49,823,998.63	100.00%	146,681,500,000.00	98.97%	-	-
国泰君安	-	-	1,532,978,000.00	1.03%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-

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	2018年1月1日-2018年12月31日	20,708,683,738.48	2,827,535,319.14	5,039,584,996.14	18,496,634,061.48	57.00%
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，浦银安盛货币市场证券投资基金由钟明管理，变更为廉素君、钟明共同管理。详见本基金管理人于2019年3月5日发布的《浦银安盛货币市场证券投资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