

# 浦银安盛日日盈货币市场基金 2019 年年度报告

2019 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：2020 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	15
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>17</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	17
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	21
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	21
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.....	22
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	23
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	23
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	31
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	31
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.....	31
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>32</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	32
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.....	32
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.....	32
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>33</b>
6.1 审计报告基本信息.....	33
6.2 审计报告的基本内容.....	33
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>36</b>
7.1 资产负债表.....	36
7.2 利润表.....	37
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	38
7.4 报表附注.....	39
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>69</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	69
8.2 债券回购融资情况.....	69
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	70
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.....	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	70
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.....	71
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	71

8.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细.....	72
8.9 投资组合报告附注.....	72
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>77</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	77
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	78
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	78
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.....	78
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>80</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>81</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	81
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.....	81
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	81
11.4 基金投资策略的改变.....	81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	81
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.....	81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	81
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	83
11.9 其他重大事件.....	83
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>86</b>
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.....	86
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>88</b>
13.1 备查文件目录.....	88
13.2 存放地点.....	88
13.3 查阅方式.....	88

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛日日盈货币市场基金		
基金简称	浦银安盛日日盈货币		
基金主代码	519566		
交易代码	519566		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014 年 3 月 25 日		
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	3,478,717,879.73 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	17,787,354.00 份	2,318,852,507.23 份	1,142,078,018.50 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>(1) 滚动配置策略 本基金将根据具体投资品种的市场特性采用持续投资的方法，既能提高基金资产变现能力的稳定性，又能保证基金资产收益率与市场利率的基本一致。</p> <p>(2) 久期控制策略 本基金将根据对货币市场利率趋势的判断来配置基金资产的久期。在预期利率上升时，缩短基金资产的久期，以规避资本损失或获得较高的再投资收益；在预期利率下降时，延长基金资产的久期，以获取资本利得或锁定较高的收益率。</p> <p>(3) 套利策略 套利策略包括跨市场套利和跨品种套利。跨市场套利是利用同一金融工具在各个子市场的不同表现进行套利。跨品种套利是利用不同金融工具的收益率差别，在满足基金自身流动性、安全性需要的基础上寻求更高的收益率。</p> <p>(4) 时机选择策略 股票、债券发行以及年末效应等因素可能会使市场资金供求情况发生暂时失衡，从而推高市场利率。充分利用这种失衡就能提高基金资产的收益率。</p>
业绩比较基准	活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浦银安盛基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	陆志俊
	联系电话	021-23212888	95559
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95559
传真		021-23212985	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 981 号 3 幢 316 室	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200020	200336
法定代表人		谢伟	任德奇

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年			2018 年			2017 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	372,392.89	163,245,937.22	30,444,884.91	627,517.88	348,285,425.89	82,658,987.14	928,263.28	442,066,468.38	90,672,987.05
本期利润	372,392.89	163,245,937.22	30,444,884.91	627,517.88	348,285,425.89	82,658,987.14	928,263.28	442,066,468.38	90,672,987.05
本期净值收益率	2.1974%	2.4429%	2.1971%	3.1010%	3.3489%	3.1009%	3.4680%	3.7167%	3.4683%
3.1.2 期末数据和	2019 年末			2018 年末			2017 年末		

指标									
期末基金资产净值	17,787,354.00	2,318,852,507.23	1,142,078,018.50	17,835,189.44	6,477,173,045.63	1,804,169,522.74	24,320,086.78	9,787,955,177.60	2,933,943,566.29
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2019 年末			2018 年末			2017 年末		
累计净值收益率	19.6612%	21.3324%	18.6926%	17.0882%	18.4391%	16.1409%	13.5666%	14.6012%	12.6478%

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 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	0.5556%	0.0014%	0.0883%	0.0000%	0.4673%	0.0014%
过去六个月	1.0981%	0.0015%	0.1766%	0.0000%	0.9215%	0.0015%
过去一年	2.1974%	0.0015%	0.3506%	0.0000%	1.8468%	0.0015%
过去三年	9.0207%	0.0022%	1.0555%	0.0000%	7.9652%	0.0022%
过去五年	15.7950%	0.0025%	1.7654%	0.0000%	14.0296%	0.0025%
自基金合同 生效起至今	19.6612%	0.0029%	2.0409%	0.0000%	17.6203%	0.0029%

浦银安盛日日盈货币 B

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.6164%	0.0014%	0.0883%	0.0000%	0.5281%	0.0014%
过去六个月	1.2204%	0.0015%	0.1766%	0.0000%	1.0438%	0.0015%
过去一年	2.4429%	0.0015%	0.3506%	0.0000%	2.0923%	0.0015%
过去三年	9.8087%	0.0022%	1.0555%	0.0000%	8.7532%	0.0022%
过去五年	17.1934%	0.0025%	1.7654%	0.0000%	15.4280%	0.0025%
自基金合同 生效起至今	21.3324%	0.0030%	2.0409%	0.0000%	19.2915%	0.0030%

浦银安盛日日盈货币 D

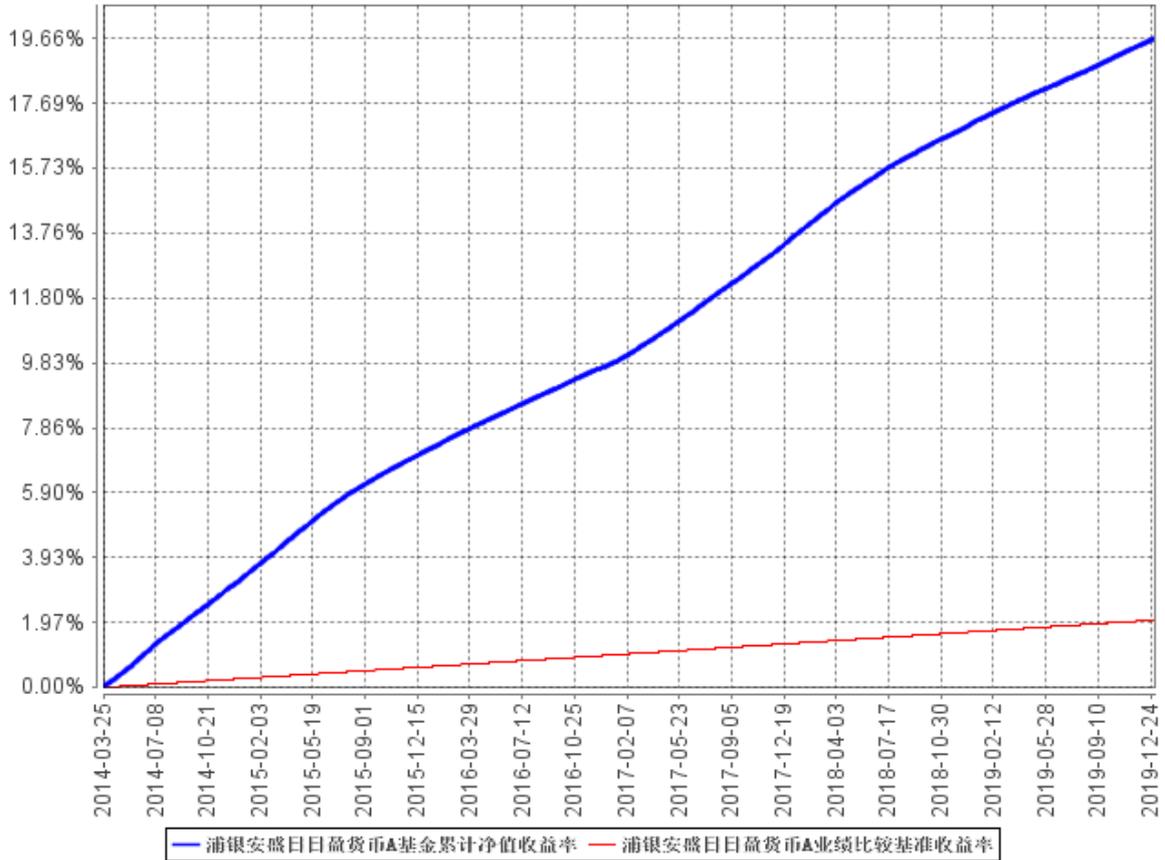
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.5556%	0.0014%	0.0883%	0.0000%	0.4673%	0.0014%
过去六个月	1.0980%	0.0015%	0.1766%	0.0000%	0.9214%	0.0015%
过去一年	2.1971%	0.0015%	0.3506%	0.0000%	1.8465%	0.0015%
过去三年	9.0205%	0.0022%	1.0555%	0.0000%	7.9650%	0.0022%
过去五年	15.7952%	0.0025%	1.7654%	0.0000%	14.0298%	0.0025%
自基金合同 生效起至今	18.6926%	0.0029%	1.9764%	0.0001%	16.7162%	0.0028%

注：1、本基金收益分配按日结转份额。

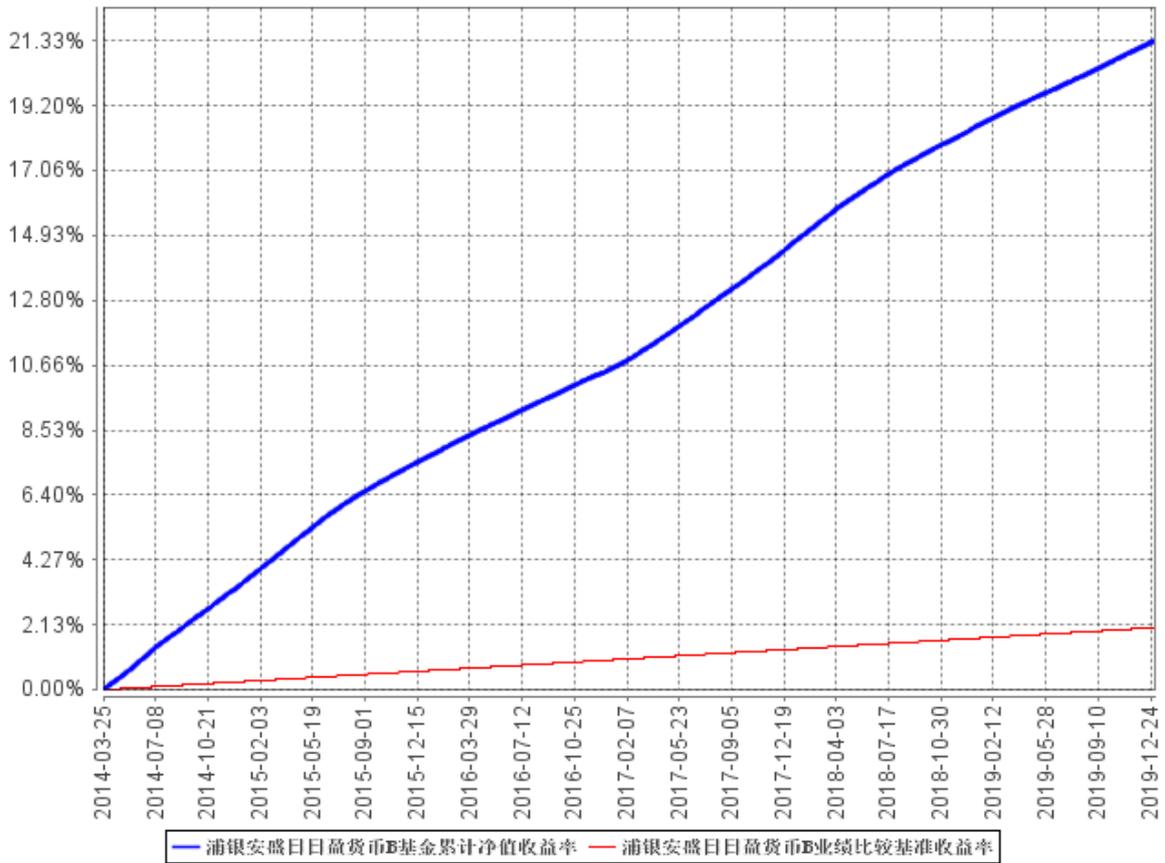
2、本基金于 2014 年 5 月 30 日开始分为 A、B、D 三类。

### 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

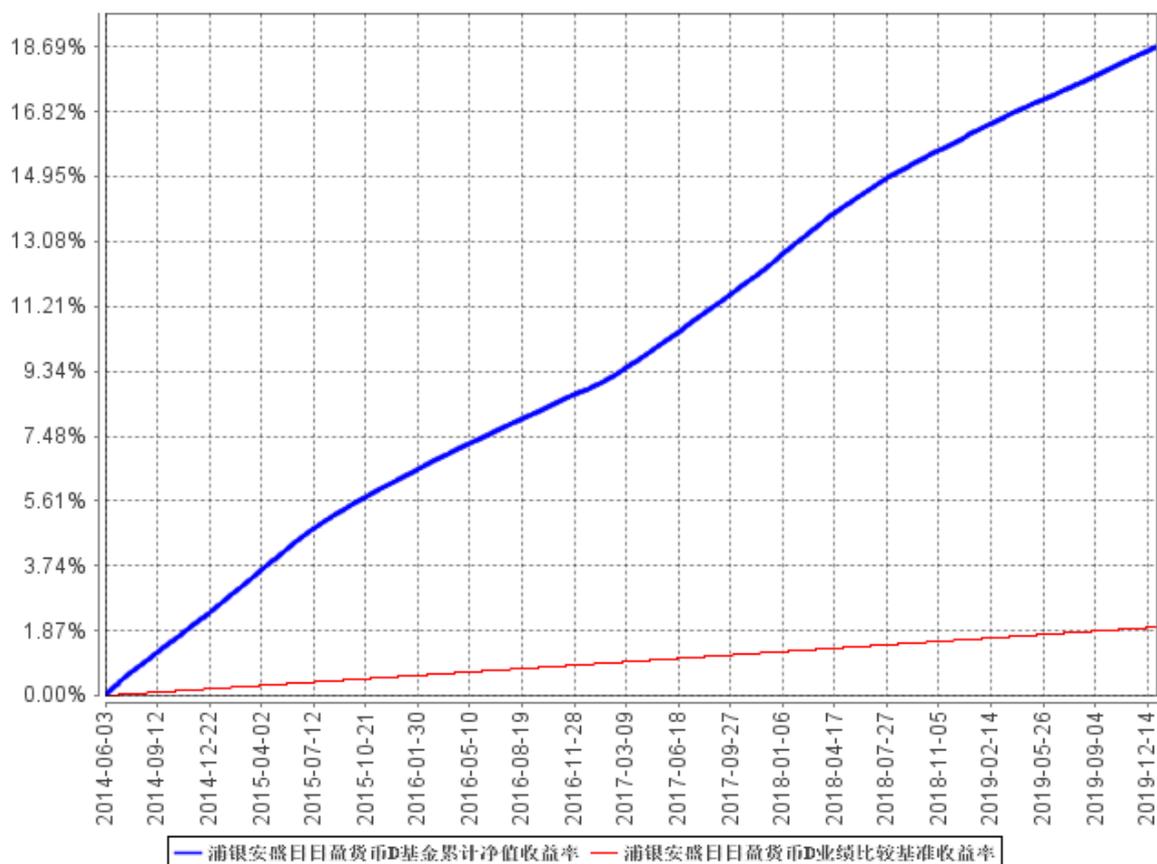
浦银安盛日日盈货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 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



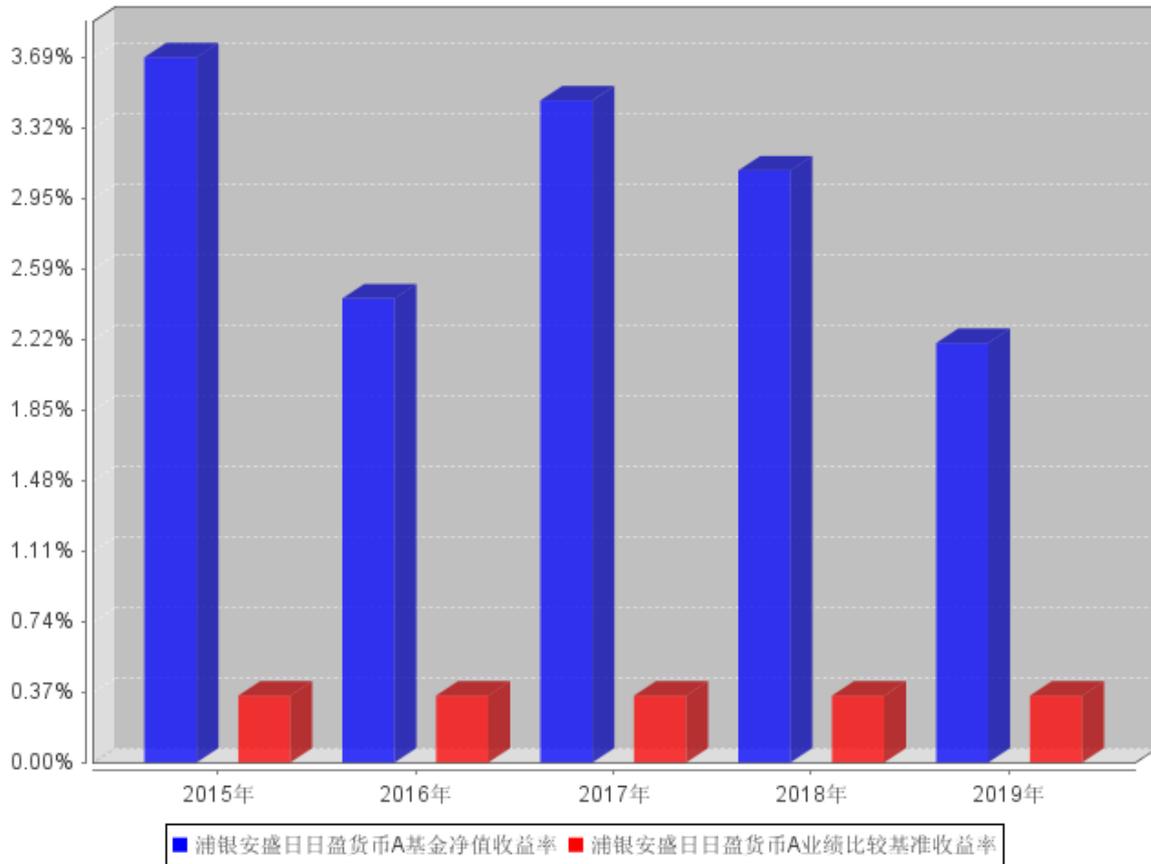
### 浦银安盛日日盈货币D基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



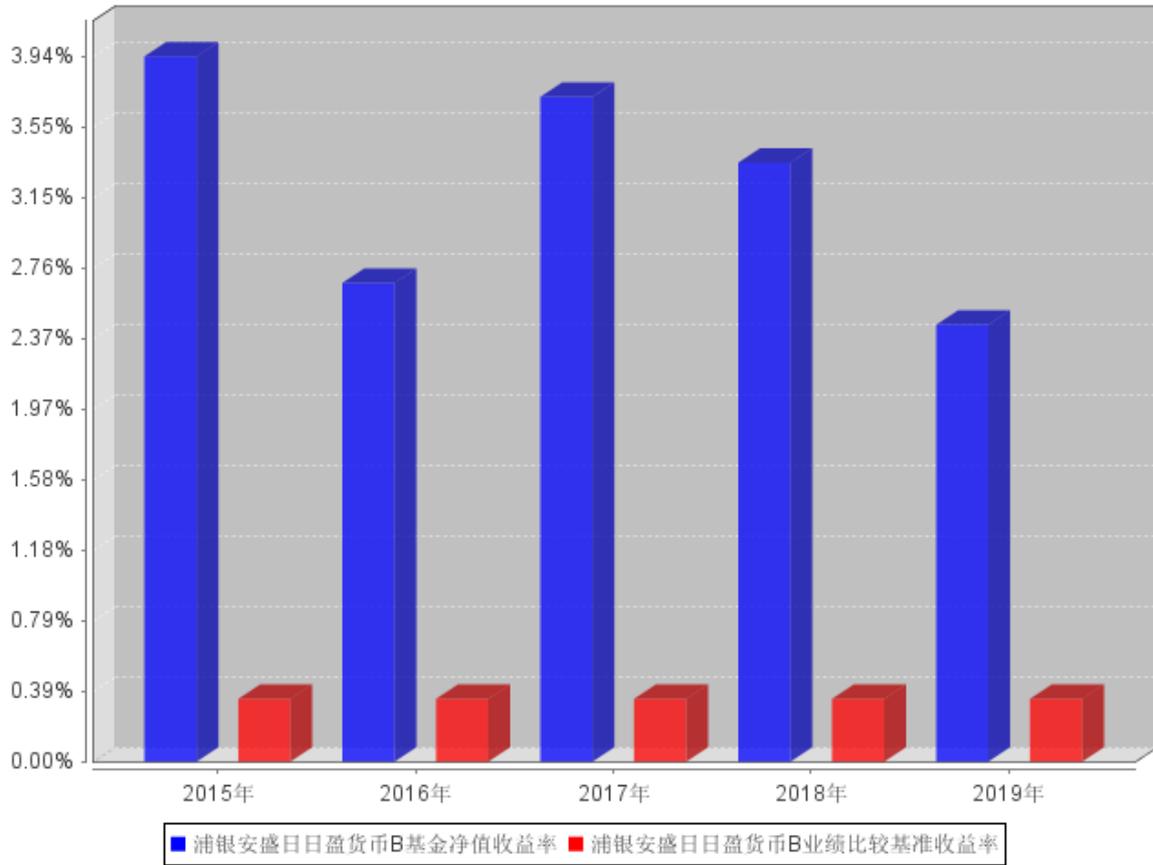
注：本基金于 2014 年 5 月 30 日开始分为 A、B、D 三类，具体内容详见本基金管理人于 2014 年 5 月 28 日刊登的《关于浦银安盛日日盈货币市场基金增加基金份额类别的公告》。

### 3.2.3 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

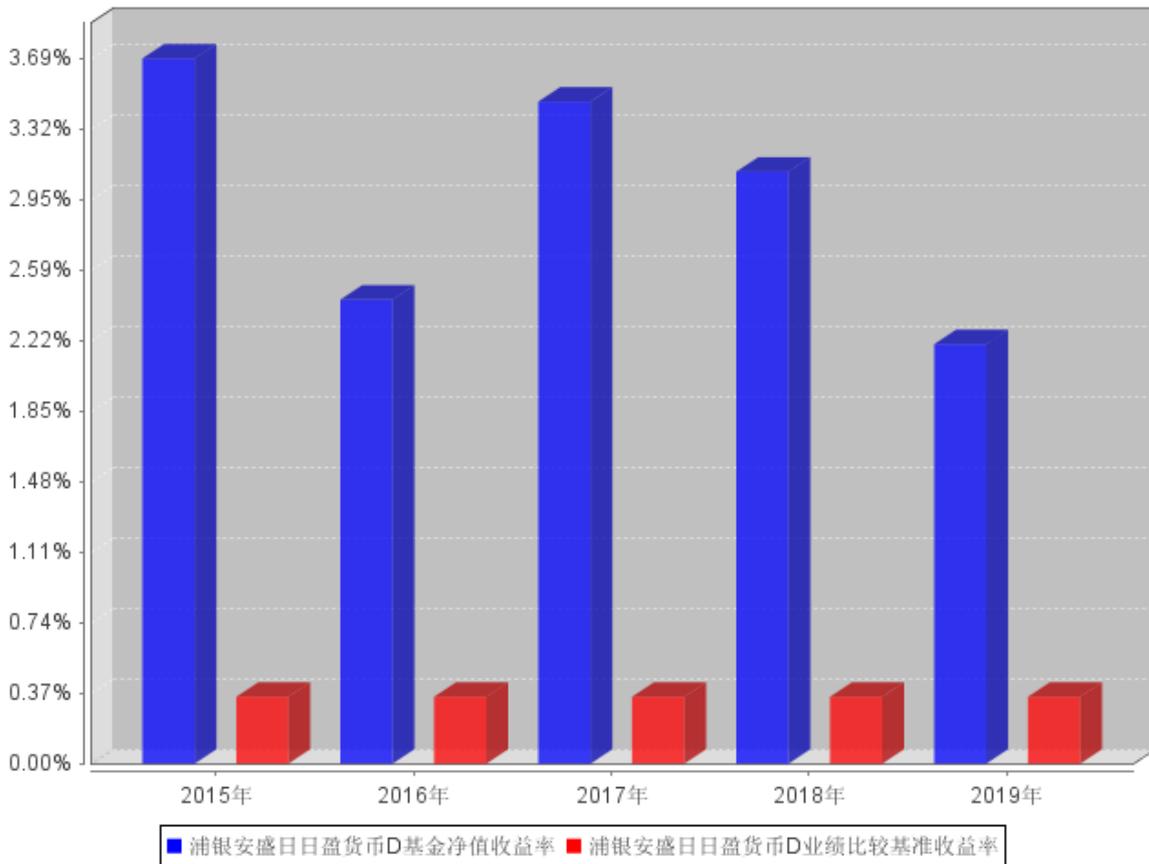
浦银安盛日日盈货币A过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



浦银安盛日日盈货币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



浦银安盛日日盈货币D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

浦银安盛日日盈货币 A					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2019	372,611.75	-	-218.86	372,392.89	
2018	629,123.27	-	-1,605.39	627,517.88	
2017	927,574.94	-	688.34	928,263.28	
合计	1,929,309.96	-	-1,135.91	1,928,174.05	

单位：人民币元

浦银安盛日日盈货币 B					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2019	163,642,342.83	-	-396,405.61	163,245,937.22	
2018	349,010,782.79	-	-725,356.90	348,285,425.89	
2017	442,118,153.14	-	-51,684.76	442,066,468.38	
合计	954,771,278.76	-	-1,173,447.27	953,597,831.49	

单位：人民币元

浦银安盛日日盈货币 D					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2019	30,513,057.09	-	-68,172.18	30,444,884.91	
2018	82,881,156.11	-	-222,168.97	82,658,987.14	
2017	90,494,700.33	-	178,286.72	90,672,987.05	
合计	203,888,913.53	-	-112,054.43	203,776,859.10	

## § 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 2019 年 12 月 31 日止，浦银安盛旗下共管理 52 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 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、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、浦银安盛全球智能科技股票型证券投资基金、浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金、浦银

安盛双债增强债券型证券投资基金、浦银安盛环保新能源混合型证券投资基金、浦银安盛上海清算所高等级优选短期融资券指数证券投资基金、浦银安盛盛煊 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛诺 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普丰纯债债券型证券投资基金和浦银安盛颐和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）。

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	公司旗下部分基金的基金经理。	2017 年 11 月 1 日	2019 年 11 月 1 日	10	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

				<p>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。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 11 月至 2019 年 11 月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 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 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。2019 年 3 月起，担任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 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金（原浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金）以及浦银安盛中短债债券型证券投资基金基金经理。2019 年 5 月起，担任浦银安盛</p>
--	--	--	--	---

					<p>双债增强债券型证券投资基金基金经理。</p> <p>2019 年 7 月起，担任浦银安盛上海清算所高等级优选短期融资券指数证券投资基金基金经理。2019 年 9 月起，担任浦银安盛盛诺 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。</p>
曹治国	公司旗下部分基金的基金经理。	2019 年 3 月 1 日	-	9	<p>曹治国先生，华南理工大学经济与贸易学院金融学学士。2008 年 7 月至 2011 年 2 月先后任职农业银行广东省分行对公客户经理、资产负债管理部票据及流动性管理岗。2011 年 3 月至 2014 年 4 月先后任职浦发银行总行金融市场部票据管理岗、流动性管理主管。2014 年 4 月至 2018 年 9 月先后任职东方证券资金管理总部资金部负责人、资金管理总部总经理助理、董事等职。2018 年 9 月加盟浦银安盛基金公司，2018 年 9 月至 2019 年 3 月在固定收益投资部任职货币基金基金经理助理。2019 年 3 月起担任浦银安盛日日盈货币市场基金以及浦银安盛日日丰货币市场基金基金经理。</p>
王茂青	货币类基金经理助理	2018 年 1 月 22 日	-	10	<p>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</p>

					<p>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。</p>
--	--	--	--	--	--

注：1、本基金基金经理的任职日期为公司决定的聘任日期, 离任日期为公司对外公告日期。

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 and 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

2019 年经济下行压力加大，央行执行了稳健的货币政策，灵活通过公开市场逆回购操作、MLF 等多种货币工具维稳资金面，2019 年整体流动性合理充裕，并没有出现传统意义上的“放松”，央行的逆周期调节更多地体现于疏通货币政策传导机制上。2019 年央行总计降准 3 次，并通过货币政策工具调节市场利率，同时推出 LPR 报价，进一步加快了贷款利率和市场利率并轨的脚步，加快降低社会实际融资成本的政策落实。

2019 年本基金维持较长的组合剩余期限，并维持一定的杠杆水平，把握年末等资金紧张时期，配置收益率较高的短期资产，在保证组合良好流动性的基础上，提高了组合整体收益。

#### 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货币 A 的基金份额净值收益率为 2.1974%，本报告期浦银安盛日日盈货币 B 的基金份额净值收益率为 2.4429%，本报告期浦银安盛日日盈货币 D 的基金份额净值收益率为 2.1971%，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

2019 年经济增速下行较快，内外需同步回落。制造业投资和消费是拖累内需的主要因素，贸易摩擦对出口的影响体现出来。在供需两弱的背景下，工业品价格指数和核心通胀持续回落，但 CPI 三季度以来有所回升，呈现出结构性通胀。2019 年货币政策基调偏宽松，社会融资存量增速企稳略上行。中央经济工作会议要求财政政策“大力提质增效，更加注重结构调整”，货币政策“灵活适度”，保持流动性合理充裕，继续降低实体融资成本。2020 年是政策目标实现的关键一年，稳增长的诉求较强，逆周期政策将会适时调节，一二季度受疫情影响，经济增速预计将会收到大幅影响，全年来看，预计经济增速小幅下行，GDP 全年增速将会下行到 5.8%附近。政策方面上半年经济回升叠加通胀高位，货币政策宽松受到制约，下半年或在地产下行压力下再度宽松。预计 2020 年货币政策维持偏宽松基调，大概率数次降准和将公开市场操作利率有所下调、降息等可能性。

#### 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，合规风控审计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。2019 年，合规风控工作内容涵盖了制度内控、法律合规、信息披露、反洗钱、风险监控、绩效评估、内部审计等工作。

法律合规方面，新规落实、法律审核、合规审核、信息披露、合规检查、反洗钱等各项工作均有序开展，公司各项合规记录良好，为公司各项业务的开展打下了坚实基础。

风险管理方面，对信用风险、流动性风险、市场风险、操作风险均建立了完善的二层风险监控机制，进一步开发并优化量化风险评估模型，利用数字化、专业化管理提升风险评估、监测及

预警效能，并提升风险化解及处置能力。

审计方面，在完成法规要求的常规审计项目和根据风险导向开展的自主开展的专项审计项目外，还配合总行审计、会计师事务所等开展了重要的外部审计工作。今后将继续秉持以风险为导向的重点专项审计，同时尽力兼顾对公司所有业务循环的审计覆盖面。

#### （一）进一步健全内控管理团队，提高团队的专业素养

2019 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，各内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审计人员参与相关的专业考试和学习。目前各内控团队内部及互相之间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，各内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）完善公司内控制度体系的建设

2019 年监管机关发布了《证券期货经营机构管理人中管理人（MOM）产品指引（试行）》、《监管部门关于基金参与科创板投资的相关监管要求》、《公开募集证券投资基金参与转融通证券出借业务指引（试行）》等法规或文件。我司也根据相关法规的要求，对我司的制度进行了修订和完善。同时，公司新增和修订了《压力测试管理办法》、《投资授权管理规定》、《股票库管理规定》、《投资组合关联交易管理规定》、《2019 年风险偏好示例》、《质押券管理规定》、《固定收益券库管理规定》、《异常交易管理规定》、《投资顾问管理规定》、《固定收益投资管理制度》、《基金转融通证券出借业务投资管理规定》、《基金库管理规定》等规章制度和业务流程，满足未来业务开展的需要，并进一步提高我司业务开展的规范性。

#### （三）法律合规工作

##### 1、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) 2019 年，与公司专业法律顾问一起，对公司发行的公募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;

4) 相关三会程序及法律文件审核, 互联网营销等创新业务合规论证。

## 2、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, 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。

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现象, 较好地控制了法律风险。

## 3、合规和法律培训

根据工作安排, 法律合规部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、反洗钱培训、违法违规案例通报等。现场培训前, 法律合规部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形成月度法律监管资讯汇编, 并向董事、监事及股东方传达, 同时通过在月度风控会上介绍新法规及监管政策内容, 向管理层持续传达合规信息、进行合规培训。

2) 公司 2019 年对新入职员工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) 2019 全年为业务人员提供了 9 次现场合规培训, 内容包括公司《合规及风险绩效考核管理规定》培训、专兼合规人员岗位培训、廉洁从业培训、反洗钱培训等。同时在公司培训系统中以各类案例形式, 进行了 70 余次的线上合规培训。

4) 2019 年, 公司积极对协会下发的《公募基金行业合规管理手册》进行学习及宣导, 并继续对《浦银安盛基金管理有限公司合规手册》、《浦银安盛基金管理有限公司宣传销售工作合规指南》进行修订, 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。

## 4、反洗钱工作

1) 健全组织机构。2019 年, 公司及时根据内设部门调整和人事变动对反洗钱工作领导小组进行了更新调整。召开反洗钱工作领导小组会议 1 次, 传递监管要求和思路, 针对各项监管新要求进行贯彻落实部署, 明确反洗钱工作任务措施及分工。

2) 完善内控制度。2019 年, 公司根据业务实际对《浦银安盛基金管理有限公司洗钱风险自

评估管理规定》、《浦银安盛基金管理有限公司洗钱风险管理策略》等相关反洗钱制度进行了修订完善。对反洗钱可疑交易认定规则进行了评估、调整，并向反洗钱监测分析中心及中国人民银行上海分行进行了报备。

3) 贯彻落实各项监管要求。2019 年，公司积极学习中国人民银行、证监会等监管部门的各项通知精神，认真落实监管部门的各项通知要求，有序开展各项客户身份识别、可疑交易报送、洗钱风险管理等各项反洗钱工作，无洗钱风险事件或其他重大洗钱违规事项的发生。根据监管要求，进一步加强受益所有人识别，认真配合做好扫黑除恶专项斗争工作，完成非居民金融账户涉税信息尽职调查工作，积极履行反洗钱工作人员调整、年度报告等报备报告工作。

#### 4) 积极推进内外部检查评估

一是根据中国人民银行上海分行关于反洗钱分类评级的有关通知要求，对公司 2018 年度反洗钱工作开展情况进行了自评估，形成报告和相关证明材料并向中国人民银行上海分行进行了报送。

二是根据浦发银行总行下发的《关于印发〈浦发银行 2019 年度反洗钱内控检查方案〉的通知》，协同市场部、互联网金融部、零售业务部等相关部门及分支机构积极开展相应自查，并已就检查发现的问题督促相关部门积极进行整改。

三是积极接受母公司反洗钱检查。公司积极接受浦发银行总行反洗钱现场检查，并协同其他反洗钱相关部门对检查事实确认书进行了事实确认和意见反馈。通过本次检查，浦发银行法律合规部对我司反洗钱工作给予肯定评价，从内控机制、人员配备到客户身份识别、风险等级划分、可疑交易审核等，均严格按照证券基金业相关法规建立控制，各业务部门执行情况良好，但也存在个别问题可参照银行反洗钱经验进行进一步优化和完善。

5) 多元化开展或参与反洗钱专题培训。公司总经理、督察长及反洗钱专职工作人员等参加了基金业协会组织的反洗钱工作系列培训班。公司法律合规部于培训结束后积极组织反洗钱工作领导小组会议和反洗钱工作小组成员再次对培训内容进行了学习。此外，公司通过内部培训系统开展了 18 场反洗钱合规培训（现场培训 3 次，非现场培训 15 次），丰富反洗钱培训内容和方式。

6) 主动开展行业反洗钱业务研究。公司法律合规部结合工作实践，主动对基金行业反洗钱业务面临的问题及应对对策进行研究分析，并根据人民银行有关要求，向人民银行上海分行供稿 1 篇。

#### 5、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法律合规部负责，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) 落实相关法规的检查工作，组织、协调和督导公司的专项自查，据此发现未及时控制的内控点，通过修订制度流程的方式完善内控机制；

3) 代表公司参与上海基金同业公会的相关会议。

#### 6、信息披露和文件报送

由于公司信息披露的负责人设在法律合规部，因此法律合规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等。

信息披露工作是一项繁杂的事务性工作，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。

2019 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文件报备事宜。2019 年全年共审核并安排指定报刊和指定网站披露数百份公告，并通过电子邮件、证监会信息系统报送平台、证监会 XBRL 报送平台、上海证监局数据报送平台等向中国证监会及上海证监局报送数百份报告。未出现重大迟、漏等现象。

#### 7、员工行为管理工作

报告期内，公司要求员工严格执行《从业人员投资限制及申报管理规定》、《通讯管制办法》，以频繁组织合规培训、定期签署案防责任书、严格申报管理、定期检查提示、纳入绩效考核等方式对员工行为进行多维度、全方位的要求和管控。员工整体道德风险防范意识和制度遵循程度有所提升，但仍存在个别员工制度遵循性有待加强。

#### 8、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，法律合规部负责指导、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。

#### 9、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，定期或不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。

#### （四）风险管理工作

##### 1、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、流动性风险和创新产品/业务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、波动率等进行提示。2019 年面对股票市场的整体上涨，公司也把握住机会，大幅提升权益类产品整体收益水平；对公司战略性布局的各类主题型产品，投资仍坚持遵守产品的主题风格，差异化投资。

在信用风险方面，公司已经打造一只人员充沛的资深的信评团队，以支持公司体量占比较大的固定收益类品种的投资，已构建了用于信用评分体系的系统工程，通过固化信用评分模型保证研究质量，提高工作效率；风险管理部专注于公司各组合信用风险的二层管控，为了更好的管理信用类固定收益产品，把控整体信用风险，风险管理部在每年年初根据市场环境，结合公司风险偏好，制定全年固收类投向政策指引，宏观上设定总体风险框架，其中明确了对所投资行业的要求，对高风险行业限制投资，通过名单制进行管理。定期或不定期对持仓情况进行信用风险排查，建立了信用风险日常提示与反馈机制、债券的灰名单机制及持仓债券风险排查机制，每日针对市场上发生的负面事件进行监控，对于在库主体和持仓主体及时向投研团队提示风险，并商定处理措施。此外，不定期的针对市场上发生的负面事件开展持仓和在库主体的专项风险排查，对于移出灰名单或者加入白名单的企业，风险管理部仍会持续跟踪企业信用资质变动情况，若后续公司资质出现恶化或者出现重大不利的负面舆情，仍将对企业进行负面预警，并重新加入灰名单或者移出“白名单”。

在流动性风险管控方面，公司 2019 年在明确的流动性风险管理的组织架构和职责划分下，在特殊市场时点或产品开放时点，要求市场销售团队时刻与机构客户保持密切沟通，做到提前预估以应对赎回；投资经理以流动性风险防控为组合管理重要任务之一，不断调整组合结构，优化指标以加强流动性应对能力；交易部紧盯市场，每日提前做好交易安排，协助投资经理确保及时平头寸；风险管理部根据最新情况完善压力测试模型，加大货币基金及持有人集中度较高产品的压力测试频度，关注各项合规指标，实时监控，及时提醒。各环节协作，保证流动性风险的管控到位及汇报路线顺畅，流动性风险缓释机制有效。

##### 2、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。

### 3、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。目前，风险管理部异常交易分析的频率为每月一次，并根据《关于规范债券市场参与者债券交易业务的通知》的要求及时报送异常交易行为，进一步确保投资组合的投资过程中的合法合规。

### 4、对公司新产品提供高效、有力的支持

2019 年，公司新发行了 6 只专户产品，9 只公募基金及开发中的产品 40 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。

在创新产品/业务风险管控方面，公司 2019 年继续完善创新产品/业务风险评估流程，使创新业务的发起部门和配合部门均能在创新业务开展前较早的参与该业务的风险识别，并提出相应的控制措施建议，对于识别出的无法控制的风险，尽早向公司提出资源支持或通过部门间的交叉控制措施来化解相应风险。同时，在创新产品上线前，风险管理部会统筹各部门再次评估创新产品/业务风险评估报告中曾识别的风险的控制措施是否有效落实。

### 5、股东风险管理部现场检查

2019 年，公司控股股东浦发银行风险管理部对公司进行现场检查，内容包括风险管理体系建设、风险管理机制和运行情况等，并出具了检查意见书。检查认为公司治理架构完整，经营发展平稳良好，各部门风险管理职能总体明确，基础管理制度完备；公司主动管理类资产质量良好，重视第一道防线的风险管理机制，具有积极主动的风控意识；也在进一步落实监管新规要求、优化风险管理系统、加大与委托方沟通力度等方面提出了整改建议。公司将根据该检查意见书的内容，对发现问题进行针对性整改，提高公司整体风险管理水平。

## （五）审计工作

根据相关法规要求、公司的实际运作情况及审计计划，审计团队有重点、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审计，并在审计后督促整改和跟踪检查，作为公司风险管控的第三道防线方面发挥了积极的作用。

2019 年审计部开展的内部专项审计包括投资交易研究专项审计、反洗钱审计、投资者适当性专项审计、两次子公司审计、信息技术采购及信息技术资产管理、投研人员员工行为专项审计、5

次投资管理人员离任审查工作；此外，审计部配合股东方浦发银行完成常规审计后续审计工作，配合会计师事务所完成反洗钱分类评级工作、年度内控评价工作等。审计工作的结果主要体现在月度审计报告、专项审计报告及季度监察稽核报告中。对于审计检查中发现的问题与业务部门及时沟通，督促各部门及时完善和改进工作。

此外，审计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、信息技术专项审计、反洗钱分类评级的会计师事务所联系和沟通，配合公司的业务开展。

2020 年，公司审计部将进一步加强审计人员专业能力的培训和提升，不断深化审计工作的深度和提高审计建议的高度和前瞻性。

#### （六）进一步完善子公司内部控制体系

2019 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。

子公司对公司的风险管理条线进行了调整和优化，风险管理部更名为风控合规部，并下设风险管理团队、质量控制团队、法律合规团队三个团队，从而更加充分、合理地进行风险管控、检查和评价，更为有效地风险管理工作。

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，同时根据业务特征，设立资产证券化业务内核委员会，采取集体决策制，管理和监督各个部门和各项业务进行，并不断对各个委员会适用的议事规则进行优化，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。

#### （七）协助人力资源部完善了合规风控考核体系

2019 年，公司进一步加大对各部门、各岗位的风险事件考核力度。公司于年底建立完善了《合规及风险绩效考核管理规定》，依照问题或风险事件的不同等级和影响程度，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，通过下发合规风控函并进行合规考核扣分的形式有力地督促了相关人员对公司制度的执行；同时对于中级以上的合规及风险事件，将交由执委会审议并最终处理，从薪酬、职级甚至劳动关系等层面，合法合规的对员工进行相应奖惩，有效地推动了公司全体员工合规意识的提高。

回顾过去的 2019 年，从股东、董事会、管理层到员工，对合规风控审计工作都比以前有了更

多的重视和理解、支持，合规风控审计团队与公司各部门的联系日益紧密和协调，这为公司合规风控审计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》。

#### 4.8 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 372,392.89 元，实际分配收益 372,392.89 元；浦银安盛日日盈货币 B 级基金应分配收益 163,245,937.22 元，实际分配收益 163,245,937.22 元，浦银安盛日日盈货币 D 级基金应分配收益 30,444,884.91 元，实际分配收益 30,444,884.91 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

2019 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

2019 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：372,392.89 元，向 B 级份额持有人分配利润：163,245,937.22 元，向 D 级份额持有人分配利润：30,444,884.91 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

2019 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(2020)第 22154 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 2019 年 12 月 31 日的资产负债表,2019 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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 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	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

	<p>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>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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(包括披露)、结构和内容，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	2020 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛日日盈货币市场基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	750,745,172.44	2,928,389,177.04
结算备付金		-	3,863,636.36
存出保证金		704.25	1,045.56
交易性金融资产	7.4.7.2	2,238,842,930.84	2,967,378,919.65
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,238,842,930.84	2,967,378,919.65
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	731,014,056.52	2,416,158,414.30
应收证券清算款		49,716,121.98	-
应收利息	7.4.7.5	14,988,359.83	26,535,801.03
应收股利		-	-
应收申购款		12,048,407.74	18,659,386.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,797,355,753.60	8,360,986,380.44
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2018 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		316,031,325.95	55,799,796.30
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,302.09	248,973.00
应付管理人报酬		1,261,166.64	2,965,425.79
应付托管费		382,171.73	898,613.90
应付销售服务费		281,088.19	470,102.09
应付交易费用	7.4.7.7	78,739.62	164,637.22
应交税费		12,036.62	81,079.43
应付利息		26,485.43	30,444.18

应付利润		258,503.03	723,299.68
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	304,054.57	426,251.04
负债合计		318,637,873.87	61,808,622.63
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	3,478,717,879.73	8,299,177,757.81
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		3,478,717,879.73	8,299,177,757.81
负债和所有者权益总计		3,797,355,753.60	8,360,986,380.44

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额为 3,478,717,879.73 份，其中 A 类基金份额 17,787,354.00 份，B 类基金份额 2,318,852,507.23 份，D 类基金份额 1,142,078,018.50 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		246,317,604.74	506,905,639.36
1.利息收入		238,090,632.04	496,762,164.27
其中：存款利息收入	7.4.7.11	64,912,746.54	200,766,845.07
债券利息收入		98,043,020.36	176,818,548.58
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		75,134,865.14	119,176,770.62
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,226,972.70	10,143,475.09
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	8,226,972.70	10,143,475.09
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	-	-

列)			
<b>减：二、费用</b>		52,254,389.72	75,333,708.45
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	27,044,422.95	42,881,417.03
2. 托管费	7.4.10.2.2	8,195,279.61	12,994,368.73
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	4,216,570.17	7,663,288.98
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
5. 利息支出		12,381,153.86	11,208,247.10
其中：卖出回购金融资产支出		12,381,153.86	11,208,247.10
6. 税金及附加		44,264.84	80,555.20
7. 其他费用	7.4.7.20	372,698.29	505,831.41
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		194,063,215.02	431,571,930.91
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		194,063,215.02	431,571,930.91

### 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	8,299,177,757.81	-	8,299,177,757.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	194,063,215.02	194,063,215.02
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）	-4,820,459,878.08	-	-4,820,459,878.08
其中：1. 基金申购款	36,469,583,256.35	-	36,469,583,256.35
2. 基金赎回款	-41,290,043,134.43	-	-41,290,043,134.43
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）	-	-194,063,215.02	-194,063,215.02
五、期末所有者权益（基金净值）	3,478,717,879.73	-	3,478,717,879.73

项目	上年度可比期间 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）	12,746,218,830.67	-	12,746,218,830.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	431,571,930.91	431,571,930.91
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）	-4,447,041,072.86	-	-4,447,041,072.86
其中：1. 基金申购款	54,330,274,672.59	-	54,330,274,672.59
2. 基金赎回款	-58,777,315,745.45	-	-58,777,315,745.45
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）	-	-431,571,930.91	-431,571,930.91
五、期末所有者权益（基金净值）	8,299,177,757.81	-	8,299,177,757.81

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：

<u>          郁蓓华          </u>	<u>          郁蓓华          </u>	<u>          钱琨          </u>
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》核准,由浦银安盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛日日盈货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,030,248,334.26 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 154 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《浦银安盛日日盈货币市场基金基金合同》于 2014 年 3 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,030,603,326.51 份,其中认购资金利息折合 354,992.25 份基金份额。本基金的基金管理人为浦银安盛基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《浦银安盛日日盈货币市场基金基金合同》和《浦银安盛日日盈货币市场基金招募说明书》的规定，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 5 月 30 日起，本基金管理人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，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 D 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 2020 年 3 月 27 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<年度报告和中期报告>》、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 2019 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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

- (1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最

近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A、B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### **7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量**

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资或资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，于下一工作日以红利再投资方式集中支付累计收益。

#### 7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、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 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	745,172.44	8,389,177.04
定期存款	750,000,000.00	2,920,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-	1,920,000,000.00
存款期限 1-3 个月	200,000,000.00	800,000,000.00
存款期限 3 个月以上	550,000,000.00	200,000,000.00
其他存款	-	-
合计：	750,745,172.44	2,928,389,177.04

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	2,238,842,930.84	2,239,944,000.00	1,101,069.16	0.0317%
	合计	2,238,842,930.84	2,239,944,000.00	1,101,069.16	0.0317%
资产支持证券		-	-	-	0.0000%
合计		2,238,842,930.84	2,239,944,000.00	1,101,069.16	0.0317%
项目		上年度末 2018年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	11,043,109.51	11,014,603.80	-28,505.71	-0.0003%
	银行间市场	2,956,335,810.14	2,958,243,400.00	1,907,589.86	0.0230%
	合计	2,967,378,919.65	2,969,258,003.80	1,879,084.15	0.0226%
资产支持证券		-	-	-	0.0000%
合计		2,967,378,919.65	2,969,258,003.80	1,879,084.15	0.0226%

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	731,014,056.52	-

合计	731,014,056.52	-
项目	上年度末 2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	2,416,158,414.30	-
合计	2,416,158,414.30	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	450.84	10,819.43
应收定期存款利息	1,166,458.33	5,294,166.45
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	64,125.00	1,912.46
应收债券利息	12,530,302.13	18,982,349.07
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	1,227,023.20	2,246,553.07
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	0.33	0.55
合计	14,988,359.83	26,535,801.03

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	78,739.62	164,637.22
合计	78,739.62	164,637.22

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	1,196.47
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	298,000.00	419,000.00
其他	6,054.57	6,054.57
-	-	-
合计	304,054.57	426,251.04

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

浦银安盛日日盈货币 A		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,835,189.44	17,835,189.44
本期申购	33,533,076.18	33,533,076.18
本期赎回(以“-”号填列)	-33,580,911.62	-33,580,911.62
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	17,787,354.00	17,787,354.00

金额单位：人民币元

浦银安盛日日盈货币 B		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,477,173,045.63	6,477,173,045.63
本期申购	33,542,312,797.49	33,542,312,797.49
本期赎回(以“-”号填列)	-37,700,633,335.89	-37,700,633,335.89
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-

本期末	2,318,852,507.23	2,318,852,507.23
-----	------------------	------------------

金额单位：人民币元

浦银安盛日日盈货币 D		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,804,169,522.74	1,804,169,522.74
本期申购	2,893,737,382.68	2,893,737,382.68
本期赎回(以“-”号填列)	-3,555,828,886.92	-3,555,828,886.92
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,142,078,018.50	1,142,078,018.50

注：申购含红利再投、分级份额调增和转换入份额，赎回含分级份额调减和转换出份额。

**7.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

浦银安盛日日盈货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	372,392.89	-	372,392.89
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-372,392.89	-	-372,392.89
本期末	-	-	-

单位：人民币元

浦银安盛日日盈货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	163,245,937.22	-	163,245,937.22
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-163,245,937.22	-	-163,245,937.22
本期末	-	-	-

单位：人民币元

浦银安盛日日盈货币 D			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	30,444,884.91	-	30,444,884.91
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-30,444,884.91	-	-30,444,884.91
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	322,141.66	505,271.55
定期存款利息收入	64,207,030.74	199,955,909.21
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	383,566.93	305,658.20
其他	7.21	6.11
合计	64,912,746.54	200,766,845.07

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益-买卖股票差价收入。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	8,226,972.70	10,143,475.09
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	8,226,972.70	10,143,475.09

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	48,293,882,342.84	35,210,485,180.46
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	48,084,099,762.98	35,025,262,407.32
减：应收利息总额	201,555,607.16	175,079,298.05
买卖债券差价收入	8,226,972.70	10,143,475.09

**7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-赎回差价收入。

**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-申购差价收入。

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益****7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-赎回差价收入。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

#### 7.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无其他收入。

#### 7.4.7.19 交易费用

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无交易费用。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
审计费用	169,000.00	170,000.00
信息披露费	120,000.00	240,000.00
证券出借违约金	-	-
中债登债券托管帐户服务费	18,000.00	18,000.00
上清所债券托管帐户维护费	18,000.00	18,000.00
银行费用	46,498.29	58,631.41
其他	1,200.00	1,200.00
合计	372,698.29	505,831.41

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金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。

##### 7.4.10.1.2 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。

##### 7.4.10.1.3 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。

##### 7.4.10.1.4 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。

##### 7.4.10.1.5 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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	27,044,422.95	42,881,417.03
其中：支付销售机构的客户维护费	1,890,123.94	3,540,643.27

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 0.33% 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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,195,279.61	12,994,368.73

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2019年1月1日至2019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	4,917.80	0.00	0.00	4,917.80
上海浦东发展银行股份有限公司	10,810.39	7.29	3,495,591.10	3,506,408.78
浦银安盛基金管理有限公司	23,531.26	674,268.56	0.00	697,799.82
合计	39,259.45	674,275.85	3,495,591.10	4,209,126.40
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	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			
	浦银安盛日日盈货币	浦银安盛日日盈货币 B	浦银安盛日日盈货币 D	合计

	A			
交通银行股份有限公司	5,274.84	0.00	0.00	5,274.84
上海浦东发展银行股份有限公司	13,471.01	2.91	6,578,082.82	6,591,556.74
浦银安盛基金管理有限公司	27,749.60	1,025,191.37	0.00	1,052,940.97
合计	46,495.45	1,025,194.28	6,578,082.82	7,649,772.55

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 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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	-	-	-
报告期初持有的基金份额	765,613.05	-	-
报告期间申购/买入总份额	18,027.43	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-

报告期末持有的基金份额	783,640.48	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.41%	-	-

项目	上年度可比期间		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 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	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	20,397,071.67	-
报告期间申购/买入总份额	765,613.05	357,739.96	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	20,754,811.63	-
报告期末持有的基金份额	765,613.05	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.29%	-	-

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。

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

浦银安盛日日盈货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 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
上海浦东发展银行股份	101,100.90	0.57%	98,901.17	0.55%

有限公司				
上海浦银安盛资产管理 有限公司	245,762.51	1.38%	240,415.43	1.35%

## 浦银安盛日日盈货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 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
上海浦东发 展银行股份 有限公司	-	-	1,002,236,762.09	15.47%

注：浦银安盛日日盈货币 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末均未持有浦银安盛日日盈货币 D。

**7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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-活 期存款	745,172.44	322,141.66	8,389,177.04	505,271.55
交通银行-定 期存款	-	1,001,111.45	100,000,000.00	1,535,499.66
上海浦东发 展银行-定期存 款	-	11,882,749.65	100,000,000.00	8,352,680.92
合计	745,172.44	13,206,002.76	208,389,177.04	10,393,452.13

注：本基金的活期银行存款和部分定期存款由基金托管人交通银行和股东上海浦东发展银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金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。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

1、2019 年 2 月 1 日上海浦东发展银行协定存款一笔，金额 12,000 万元，到期日 2019 年 4 月 22 日。

2、2019 年 3 月 28 日上海浦东发展银行协定存款一笔，金额 8,000 万元，到期日 2019 年 4

月 29 日。

3、2019 年 4 月 8 日上海浦东发展银行协定存款一笔，金 50,000 万元，到期日 2019 年 10 月 14 日。

4、2019 年 9 月 17 日上海浦东发展银行协定存款一笔，金额 50,000 万元，到期日 2019 年 11 月 15 日。

#### 7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

浦银安盛日日盈货币A

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
372,611.75	-	-218.86	372,392.89	-

浦银安盛日日盈货币B

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
163,642,342.83	-	-396,405.61	163,245,937.22	-

浦银安盛日日盈货币D

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
30,513,057.09	-	-68,172.18	30,444,884.91	-

注：本基金在本年度累计分配收益 194,063,215.02 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 194,528,011.67 元，计入应付收益科目-464,796.65 元。

#### 7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 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。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 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 316,031,325.95 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
150203	15 国开 03	2020 年 1 月 2 日	100.10	700,000	70,070,000.00
170402	17 农发 02	2020 年 1 月 2 日	100.02	2,200,000	220,044,000.00
190201	19 国开 01	2020 年 1 月 2 日	100.00	392,000	39,200,000.00
合计				3,292,000	329,314,000.00

#### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为货币市场基金，预期风险和预期收益均低于股票型基金、混合型基金及债券型基金，属证券投资基金中的较低风险收益品种。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，通知存款，短期融资券，一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单，期限在一年以内（含一年）的债券回购，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、中期票据，以及中国证监会及中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在科学的风险管理的前提下，实现基金财产的安全和增值。

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理，设立了三层次的风险控制体系：第一层次为各业务部门对各自部门潜在风险的自我管理和检查；第二层次为公司总经理领导的管理层、风险控制委员会、风险管理部和法律合规部的风险管理；第三层次为董事会层面对公司的风险管理，包括董事会、合规及审计委员会、督察长。

本基金管理人下设的各业务部门是公司第一线风险控制的实施者，均备有符合法律法规、公

司政策的业务流程，其中包含与其业务相关的风险控制措施、风险管理计划、工作流程和管理责任。这些流程均得到公司管理层的批准。

本基金管理人设立的风险控制委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权利机构，主要负责制定公司的风险管理政策，并监督实施，确保公司整体风险暴露得到有效的识别、评估、监控和控制。公司设立风险管理部与法律合规部监控公司面临的各类风险。风险管理部建立了定性和数量化分析模型进行基金投资风险和绩效评估，法律合规部根据基金相关法律法规、公司基本制度及业务流程，对信息披露、法律文件等进行事中审核，并对基金管理人经营活动及各职能部门履职情况的合法合规性进行监督和检查。

董事会下属的合规及审计委员会，负责对公司整体风险管理和内部控制的有效性进行审议和评估。同时，督察长及合规及审计委员会负责检查、评价公司风险控制的充分性和有效性，并向董事会报告。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险可能产生的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和部分定期存款存放在本基金的托管人交通银行股份有限公司；其他定期存款存放在具有基金托管资格的徽商银行股份有限公司、广发银行股份有限公司以及中国银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净值的 10%。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	400,004,655.84	50,008,413.41
A-1 以下	-	-
未评级	50,000,281.45	894,782,814.63
合计	450,004,937.29	944,791,228.04

注：于 2019 年 12 月 31 日，未评级部分为政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,498,736,377.98	1,816,182,827.46
合计	1,498,736,377.98	1,816,182,827.46

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	-	16,102,359.27
AAA 以下	-	-

未评级	290,101,615.57	190,302,504.88
合计	290,101,615.57	206,404,864.15

注：于 2019 年 12 月 31 日，未评级部分为政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2019 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 316,031,325.95 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高

流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于 2019 年 12 月 31 日，本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为 67.20%，本基金投资组合的平均剩余期限为 58 天，平均剩余存续期为 58 天。本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年12 月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年 以上	不计息	合计
资产						
银行存款	750,745,172.44	-	-	-	-	750,745,172.44
存出保证金	704.25	-	-	-	-	704.25
交易性金融 资产	2,141,758,130.70	97,084,800.14	-	-	-	2,238,842,930.84
买入返售金 融资产	731,014,056.52	-	-	-	-	731,014,056.52
应收证券清 算款	-	-	-	-	49,716,121.98	49,716,121.98
应收利息	-	-	-	-	14,988,359.83	14,988,359.83
应收申购款	-	-	-	-	12,048,407.74	12,048,407.74
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,623,518,063.91	97,084,800.14	-	-	76,752,889.55	3,797,355,753.60
负债						
卖出回购金 融资产款	316,031,325.95	-	-	-	-	316,031,325.95
应付赎回款	-	-	-	-	2,302.09	2,302.09

应付管理人报酬	-	-	-	-	1,261,166.64	1,261,166.64
应付托管费	-	-	-	-	382,171.73	382,171.73
应付销售服务费	-	-	-	-	281,088.19	281,088.19
应付交易费用	-	-	-	-	78,739.62	78,739.62
应付利息	-	-	-	-	26,485.43	26,485.43
应交税费	-	-	-	-	12,036.62	12,036.62
应付利润	-	-	-	-	258,503.03	258,503.03
其他负债	-	-	-	-	304,054.57	304,054.57
负债总计	316,031,325.95	-	-	-	2,606,547.92	318,637,873.87
利率敏感度缺口	3,307,486,737.96	97,084,800.14	-	-	-74,146,341.63	3,478,717,879.73
上年度末 2018年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	2,928,389,177.04	-	-	-	-	-2,928,389,177.04
结算备付金	3,863,636.36	-	-	-	-	3,863,636.36
存出保证金	1,045.56	-	-	-	-	1,045.56
交易性金融资产	2,803,474,728.50	163,904,191.15	-	-	-	-2,967,378,919.65
买入返售金融资产	2,416,158,414.30	-	-	-	-	-2,416,158,414.30
应收利息	-	-	-	-	-26,535,801.03	26,535,801.03
应收申购款	-	-	-	-	-18,659,386.50	18,659,386.50
资产总计	8,151,887,001.76	163,904,191.15	-	-	-45,195,187.53	8,360,986,380.44
负债						
卖出回购金融资产款	55,799,796.30	-	-	-	-	55,799,796.30
应付赎回款	-	-	-	-	248,973.00	248,973.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,965,425.79	2,965,425.79
应付托管费	-	-	-	-	898,613.90	898,613.90
应付销售服务费	-	-	-	-	470,102.09	470,102.09
应付交易费用	-	-	-	-	164,637.22	164,637.22
应付利息	-	-	-	-	30,444.18	30,444.18
应交税费	-	-	-	-	81,079.43	81,079.43
应付利润	-	-	-	-	723,299.68	723,299.68
其他负债	-	-	-	-	426,251.04	426,251.04
负债总计	55,799,796.30	-	-	-	6,008,826.33	61,808,622.63

利率敏感度缺口	8,096,087,205.46	163,904,191.15	-	-	-39,186,361.20	8,299,177,757.81
---------	------------------	----------------	---	---	----------------	------------------

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率上升 25 基点	-1,075,158.90	-1,939,238.60
	市场利率下降 25 基点	1,077,167.45	1,942,361.04

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 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 2,238,842,930.84 元，无属于第一或第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第二层次 2,967,378,919.65 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 2019 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(2018 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	2,238,842,930.84	58.96
	其中:债券	2,238,842,930.84	58.96
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	731,014,056.52	19.25
	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	750,745,172.44	19.77
4	其他各项资产	76,753,593.80	2.02
5	合计	3,797,355,753.60	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	5.99	
	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	316,031,325.95	9.08
	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	2019 年 5 月 29 日	20.05	大额赎回	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	58
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	64
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	27

#### 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	34.82	9.08
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	23.59	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	37.27	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	7.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	5.63	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	108.78	9.08

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	740,106,552.86	21.28

	其中：政策性金融债	340,101,897.02	9.78
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,498,736,377.98	43.08
8	其他	-	-
9	合计	2,238,842,930.84	64.36
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	111911286	19 平安银行 CD286	3,000,000	297,971,232.37	8.57
2	071900160	19 东方证券 CP005	2,500,000	250,003,511.80	7.19
3	111912019	19 北京银行 CD019	2,500,000	248,901,352.38	7.15
4	170402	17 农发 02	2,200,000	220,033,702.21	6.33
5	111915598	19 民生银行 CD598	2,000,000	198,796,405.53	5.71
6	111976842	19 上海农商银行 CD139	1,500,000	149,055,666.96	4.28
7	071900122	19 中信 CP010	1,000,000	100,000,904.86	2.87
8	111910059	19 兴业银行 CD059	1,000,000	99,661,462.02	2.86
9	111910062	19 兴业银行 CD062	1,000,000	99,651,816.64	2.86
10	111915054	19 民生银行 CD054	1,000,000	99,650,531.39	2.86

### 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	0.0490%
报告期内偏离度的最低值	-0.0160%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0158%

### 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 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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

平安银行：

2019-12-24 因未依法履行其他职责，分支行高管孙宇 被中国银行业监督管理委员会大连监管局于 2019-12-16 依据相关法规给予：公开批评处分决定。

2019-11-18 因未依法履行其他职责，分支行高管解朋崐被中国银行保险监督管理委员会北京监管局于 2019-11-15 依据相关法规给予：公开处罚，公开批评处分决定。

2019-10-11 因未依法履行其他职责，分支行高管何晓红被中国银行保险监督管理委员会金华监管分局于 2019-09-29 依据相关法规给予：公开批评处分决定。

2019-08-26 因未依法履行其他职责，分支行高管平安银行股份有限公司南昌分行被中国银行业监督管理委员会江西监管局于 2019-08-16 依据相关法规给予：公开处罚处分决定。

2019-07-08 因未依法履行其他职责，全国银行间同业拆借中心于 2019-07-08 依据相关法规给予：内部通报批评处分决定

2019-04-10 因未依法履行其他职责，分支行高管马健被中国银行业监督管理委员会天津监管局于 2019-03-25 依据相关法规给予：公开批评处分决定。

2019-04-04 因未依法履行其他职责，公司高管平安银行股份有限公司大连分行被中国银行业监督管理委员会大连监管局于 2019-04-01 依据相关法规给予：公开处罚处分决定。

2019-01-07 因未依法履行其他职责，分支行高管程磊被中国银行业监督管理委员会湖北监管局于 2018-12-28 依据相关法规给予：公开批评处分决定。

北京银行：

2019-10-08 因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会北京监管局于 2019-09-25 依据相关法规给予：公开处罚，责令改正处分决定

2019-09-11 因未依法履行其他职责，中国银行业监督管理委员会北京监管局于 2019-09-03 依据相关法规给予：公开处罚，责令改正处分决定

2019-02-01 因未依法履行其他职责，分支行高管唐国宏被中国银行业监督管理委员会北京监管局于 2019-02-01 依据相关法规给予：公开处罚，公开批评处分决定。

中国农业发展银行：

2019-12-17 因未依法履行其他职责，分支行高管王鑫被中国银行业监督管理委员会安康监管分局于 2019-11-29 依据相关法规给予：公开批评处分决定。

2019-09-12 因未依法履行其他职责，分支行高管尚广军被中国银行业监督管理委员会许昌监管分局于 2019-09-06 依据相关法规给予：公开处罚，公开批评处分决定。

2019-07-15 因未依法履行其他职责，分支行高管李向华被中国银行业监督管理委员会三门峡监管分局于 2019-07-08 依据相关法规给予：市场禁入处分决定。

2019-05-20 因未依法履行其他职责，分支行高管何国胜被中国银行业监督管理委员会渭南监管分局于 2019-04-23 依据相关法规给予：公开处罚处分决定。

2019-04-28 因未依法履行其他职责，分支行高管宋园被中国银行业监督管理委员会临汾监管分局于 2018-08-20 依据相关法规给予：公开批评处分决定。

2019-04-09 因未依法履行其他职责，分支行高管廖艰生被中国银行业监督管理委员会合川监管分局于 2019-03-28 依据相关法规给予：公开处罚，公开批评处分决定。

2019-02-27 因未依法履行其他职责，分支行高管黄建被中国银行业监督管理委员会四川监管局于 2019-01-29 依据相关法规给予：公开处罚，公开批评处分决定。

2019-01-25 因未依法履行其他职责，分支行高管帅骥被中国银行业监督管理委员会文山监管分局于 2019-01-09 依据相关法规给予：公开批评处分决定。

2019-01-11 因未依法履行其他职责，分支行高管吴清松被中国银行业监督管理委员会宜昌监管分局于 2018-12-13 依据相关法规给予：公开处罚处分决定。

2019-01-04 因未依法履行其他职责，分支行高管茅飞龙被中国银行业监督管理委员会盐城监管分局于 2018-12-10 依据相关法规给予：公开批评处分决定。

民生银行：

2019-12-20 因未依法履行其他职责，中国银行业监督管理委员会北京监管局于 2019-12-14 依据相关法规给予：公开处罚，责令改正处分决定

2019-12-20 因未依法履行其他职责，公司高管顾立辉被中国银行业监督管理委员会北京监管局于 2019-12-14 依据相关法规给予：公开批评，公开处罚处分决定。

2019-08-02 因未依法履行其他职责，分支行高管陈诗全被中国银行业监督管理委员会福建监管局于 2019-07-26 依据相关法规给予：公开处罚，公开批评处分决定。

2019-06-26 因未依法履行其他职责，分支行高管廖海被中国银行业监督管理委员会四川监管局于 2019-04-17 依据相关法规给予：公开处罚，公开批评处分决定。

2019-06-20 因未依法履行其他职责，分支行高管王嘉华被中国银行业监督管理委员会大连监管局于 2019-06-13 依据相关法规给予：市场禁入处分决定。

2019-06-18 因未依法履行其他职责，公司高管夏斌被中国银行业监督管理委员会山西监管局于 2019-06-06 依据相关法规给予：公开批评处分决定。

2019-04-24 因未依法履行其他职责，分支行高管李晖被中国银行保险监督管理委员会河北监管局于 2019-04-10 依据相关法规给予：公开处罚，公开批评处分决定。

2019-04-16 因未依法履行其他职责，中国银行业监督管理委员会大连监管局于 2019-04-02 依据相关法规给予：公开处罚处分决定

2019-04-16 因未依法履行其他职责，分支行高管李枫被中国银行业监督管理委员会大连监管局于 2019-04-02 依据相关法规给予：公开批评处分决定。

2019-04-03 因未依法履行其他职责，中国银行业监督管理委员会大连监管局于 2019-04-02 依据相关法规给予：公开处罚处分决定

2019-04-03 因未依法履行其他职责，分支行高管李枫被中国银行业监督管理委员会大连监管局于 2019-04-02 依据相关法规给予：公开批评处分决定。

2019-04-02 因未依法履行其他职责，中国银行业监督管理委员会大连监管局于 2019-04-02 依据相关法规给予：公开处罚处分决定

2019-04-02 因未依法履行其他职责，公司高管中国民生银行股份有限公司大连分行被中国银行业监督管理委员会大连监管局于 2019-04-02 依据相关法规给予：公开处罚处分决定。

2019-03-22 因未依法履行其他职责，分支行高管关启明被中国银行业监督管理委员会山西监管局于 2019-01-28 依据相关法规给予：市场禁入处分决定。

2019-01-18 因未依法履行其他职责，分支行高管孙敏被中国银行业监督管理委员会无锡监管

分局于 2018-12-26 依据相关法规给予:公开批评处分决定。

2019-01-08 因未依法履行其他职责,分支行高管杨晨晨被中国银行业监督管理委员会安徽监管局于 2018-12-21 依据相关法规给予:公开批评处分决定。

上海农商银行:

2019-08-06 因未依法履行其他职责,分支行高管吴启政被中国银行业监督管理委员会上海监管局于 2019-07-31 依据相关法规给予:市场禁入处分决定。

2019-07-09 因未依法履行其他职责,中国银行业监督管理委员会上海监管局于 2019-07-08 依据相关法规给予:公开处罚,责令改正处分决定

2019-05-18 因未依法履行其他职责,中国银行业监督管理委员会上海监管局于 2019-05-07 依据相关法规给予:公开处罚,责令改正处分决定

2019-05-17 因未依法履行其他职责,中国银行业监督管理委员会上海监管局于 2019-05-07 依据相关法规给予:公开处罚,责令改正处分决定

2019-05-16 因未依法履行其他职责,中国银行业监督管理委员会上海监管局于 2019-05-07 依据相关法规给予:公开处罚,责令改正处分决定

兴业银行:

2019-01-17 因未依法履行其他职责,分支行高管崔立峰被中国银行业监督管理委员会襄阳监管分局于 2018-12-19 依据相关法规给予:公开批评处分决定

2019-03-14 因未依法履行其他职责,分支行高管刘宏被中国银行业监督管理委员会湖北监管局于 2019-02-26 依据相关法规给予:公开批评处分决定。

2019-08-02 因未依法履行其他职责,分支行高管章立被中国银行业监督管理委员会福建监管局于 2019-07-26 依据相关法规给予:公开批评,公开处罚处分决定。

2019-08-19 兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)作为北京粮食集团有限责任公司(以下简称“京粮集团”)相关债务融资工具的主承销商,在债务融资工具存续期间未能对京粮集团资产无偿划转重大事项进行有效监测,及时督导京粮集团进行存续期重大事项披露,也未及时召开持有人会议。依据相关自律规定,经 2019 年第 9 次自律处分会议审议,给予兴业银行诫勉谈话处分,责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

2019-10-18 因未依法履行其他职责,分支行高管刘淼被中国银行业监督管理委员会辽宁监管局于 2019-10-15 依据相关法规给予:公开批评处分决定。

### 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	704.25
2	应收证券清算款	49,716,121.98
3	应收利息	14,988,359.83
4	应收申购款	12,048,407.74
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	76,753,593.80

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
浦银安盛日日盈货币 A	19,172	927.78	2,889,340.14	16.24%	14,898,013.86	83.76%
浦银安盛日日盈货币 B	9	257,650,278.58	2,316,602,521.28	99.90%	2,249,985.95	0.10%
浦银安盛日日盈货币 D	395,631	2,886.73	23,460.06	0.00%	1,142,054,558.44	100.00%
合计	414,812	8,386.25	2,319,515,321.48	66.68%	1,159,202,558.25	33.32%

## 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	1,461,665,902.82	42.02%
2	银行类机构	402,217,526.54	11.56%
3	银行类机构	300,409,003.86	8.64%
4	保险类机构	100,536,021.50	2.89%
5	信托类机构	49,197,160.97	1.41%
6	个人	5,303,564.58	0.15%
7	个人	4,997,037.29	0.14%
8	个人	4,907,522.93	0.14%
9	个人	4,328,908.26	0.12%
10	个人	4,133,004.21	0.12%

## 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	浦银安盛日日盈货币 A	706,097.75	3.97%
	浦银安盛日日盈货币 B	0.00	0.00%
	浦银安盛日日盈货币 D	7,194.73	0.00%
	合计	713,292.48	0.02%

## 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	0

	B	
	浦银安盛日日盈货币 D	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	浦银安盛日日 盈货币 A	浦银安盛日日 盈货币 B	浦银安盛日日 盈货币 D
基金合同生效日（2014 年 3 月 25 日）基金份额总额	809,224,203.79	1,221,379,122.72	-
本报告期期初基金份额总额	17,835,189.44	6,477,173,045.63	1,804,169,522.74
本报告期基金总申购份额	33,533,076.18	33,542,312,797.49	2,893,737,382.68
减:本报告期基金总赎回份额	33,580,911.62	37,700,633,335.89	3,555,828,886.92
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	17,787,354.00	2,318,852,507.23	1,142,078,018.50

注：总申购份额含红利再投、分级份额调增和转换入份额，总赎回份额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 169,000 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人、托管人及其高级管理人员未受到有权机关调查、司法纪检部门采取强制措施、被移送司法机关或追究刑事责任、中国证监会稽查、中国证监会行政处罚、证券市场禁入、认定为不适当人选、被其他行政管理部门处罚及证券交易所公开谴责的情形。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

申港证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
东北证券	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：

本基金本报告期内新增申万宏源证券、中信建投证券、申港证券、平安证券、华宝证券、减少爱建证券交易单元。

### 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
招商证券	20,102,863.01	100.00%	23,066,459,000.00	100.00%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

### 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

### 11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京百度	报刊及公司官网	2019 年 1 月 5 日

	百盈基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告		
2	浦银安盛日日盈货币市场基金 2018 年第 4 季度报告	报刊及公司官网	2019 年 1 月 21 日
3	关于浦银安盛日日盈货币市场基金于春节假期前一个工作日暂停 A 类及 B 类份额的申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及公司官网	2019 年 1 月 30 日
4	浦银安盛日日盈货币市场基金基金经理变更公告	报刊及公司官网	2019 年 3 月 1 日
5	浦银安盛日日盈货币市场基金 2018 年年度报告摘要	报刊及公司官网	2019 年 3 月 27 日
6	浦银安盛日日盈货币市场基金 2018 年年度报告	公司官网	2019 年 3 月 27 日
7	关于浦银安盛日日盈货币市场基金于清明节假期前一个工作日暂停 A 类及 B 类份额的申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及公司官网	2019 年 4 月 3 日
8	浦银安盛日日盈货币市场基金 2019 年第 1 季度报告	报刊及公司官网	2019 年 4 月 19 日
9	关于浦银安盛日日盈货币市场基金于劳动节假期前一个工作日暂停 A 类及 B 类份额的申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及公司官网	2019 年 4 月 27 日
10	浦银安盛日日盈货币市场基金招募说明书摘要（更新）2019 年第 1 号	报刊及公司官网	2019 年 5 月 8 日
11	浦银安盛日日盈货币市场基金招募说明书正文（更新）2019 年第 1 号	公司官网	2019 年 5 月 8 日
12	浦银安盛基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在上海天天基金销售有限公司基金定投业务定投起点的公告	报刊及公司官网	2019 年 5 月 15 日
13	关于浦银安盛日日盈货币市场基金于端午节假期前一个工作日暂停 A 类及 B 类份额的申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及公司官网	2019 年 6 月 5 日
14	关于旗下部分基金新增西藏东方财富证券有限公司为代销机构及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司官网	2019 年 6 月 27 日
15	浦银安盛日日盈货币市场基金	报刊及公司官网	2019 年 7 月 16 日

	2019 年第 2 季度报告		日
16	浦银安盛日日盈货币市场基金 2019 年半年度报告	公司官网	2019 年 8 月 23 日
17	浦银安盛日日盈货币市场基金 2019 年半年度报告摘要	报刊及公司官网	2019 年 8 月 23 日
18	关于浦银安盛日日盈货币市场 基金于中秋节假期前一个工作 日暂停 A 类及 B 类份额的申 购、定投及转换转入业务的公告	报刊及指定网站	2019 年 9 月 11 日
19	关于浦银安盛日日盈货币市场 基金于国庆假期前一个工作日 暂停 A 类及 B 类份额的申购、 定投及转换转入业务的公告	报刊及指定网站	2019 年 9 月 26 日
20	浦银安盛基金管理有限公司关于 旗下部分基金新增江苏汇林 保大基金销售有限公司为代销 机构并开通定投业务及参加其 费率优惠活动的公告	报刊及指定网站	2019 年 10 月 14 日
21	浦银安盛日日盈货币市场基金 2019 年第 3 季度报告	指定网站	2019 年 10 月 25 日
22	浦银安盛日日盈货币市场基金 基金经理变更公告	报刊及指定网站	2019 年 11 月 2 日
23	浦银安盛日日盈货币市场基金 招募说明书摘要（更新）2019 年第 2 号	指定网站	2019 年 11 月 2 日
24	浦银安盛日日盈货币市场基金 招募说明书正文（更新）2019 年第 2 号	指定网站	2019 年 11 月 2 日
25	浦银安盛日日盈货币市场基金 基金合同	指定网站	2019 年 11 月 2 日
26	浦银安盛日日盈货币市场基金 托管协议	指定网站	2019 年 11 月 2 日
27	关于浦银安盛日日盈货币市场 基金于元旦前一个工作日暂停 A 类及 B 类份额的申购、定投及转 换转入业务的公告	报刊及指定网站	2019 年 12 月 30 日

## § 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	2019 年 4 月 15 日 -2019 年 4 月 16 日	0.00	4,940,019,458.07	4,940,019,458.07	0.00	0.00%
	2	2019 年 6 月 28 日 -2019 年 07 月 03 日、2019 年 09 月 26 日	1,002,335,663.26	3,007,122,115.85	4,009,356,678.21	101,100.90	0.00%
	3	2019 年 1 月 1 日 -2019 年 12 月	4,176,843,013.74	3,585,668,228.51	6,300,845,339.43	1,461,665,902.82	42.02%

		31 日					
4		2019 年 1 月 22 日 -201 9 年 1 月 30 日	0.00	4,507,598,616. 82	4,507,598,616. 82	0.00	0.00%
5		2019 年 6 月 24 日 -201 9 年 6 月 25 日、 2019 年 09 月 24 日	0.00	3,011,131,660. 22	3,011,131,660. 22	0.00	0.00%
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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼基金管理人办公场所。

### 13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

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

浦银安盛基金管理有限公司

2020 年 3 月 31 日