

浦银安盛货币市场证券投资基金

2014 年第 2 季度报告

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年七月十九日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛货币
基金主代码	519509
基金运作方式	开放式契约型
基金合同生效日	2011年3月9日
报告期末基金份额总额	640,376,658.86份
投资目标	力求在保持基金资产安全性和良好流动性的基础上，获得超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	根据对短期利率变动的预测，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略，利用基本分析和数量化分析方法，通过对短期金融工具的积极投资，在控制风险和保证流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。

业绩比较基准	银行活期存款利率（税后）	
风险收益特征	属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B
下属两级基金的交易代码	519509	519510
报告期末下属两级基金的份额总额	197,618,551.03份	442,758,107.83份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)	
	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B
1. 本期已实现收益	3,626,764.10	10,468,659.09
2. 本期利润	3,626,764.10	10,468,659.09
3. 期末基金资产净值	197,618,551.03	442,758,107.83

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

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

3、本基金收益分配按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 浦银安盛货币 A

阶段	净值收 益率①	净值收 益率标 准差②	业绩比 较基准 收益率 ③	业绩比 较基准 收益率 标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	1.2172%	0.0112%	0.0873%	0.0000%	1.1299%	0.0112%

注：本基金收益分配按月结转份额。

2. 浦银安盛货币 B

阶段	净值收 益率①	净值收 益率标 准差②	业绩比 较基准 收益率 ③	业绩比 较基准 收益率 标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	1.2779%	0.0112%	0.0873%	0.0000%	1.1906%	0.0112%

注：本基金收益分配按月结转份额。

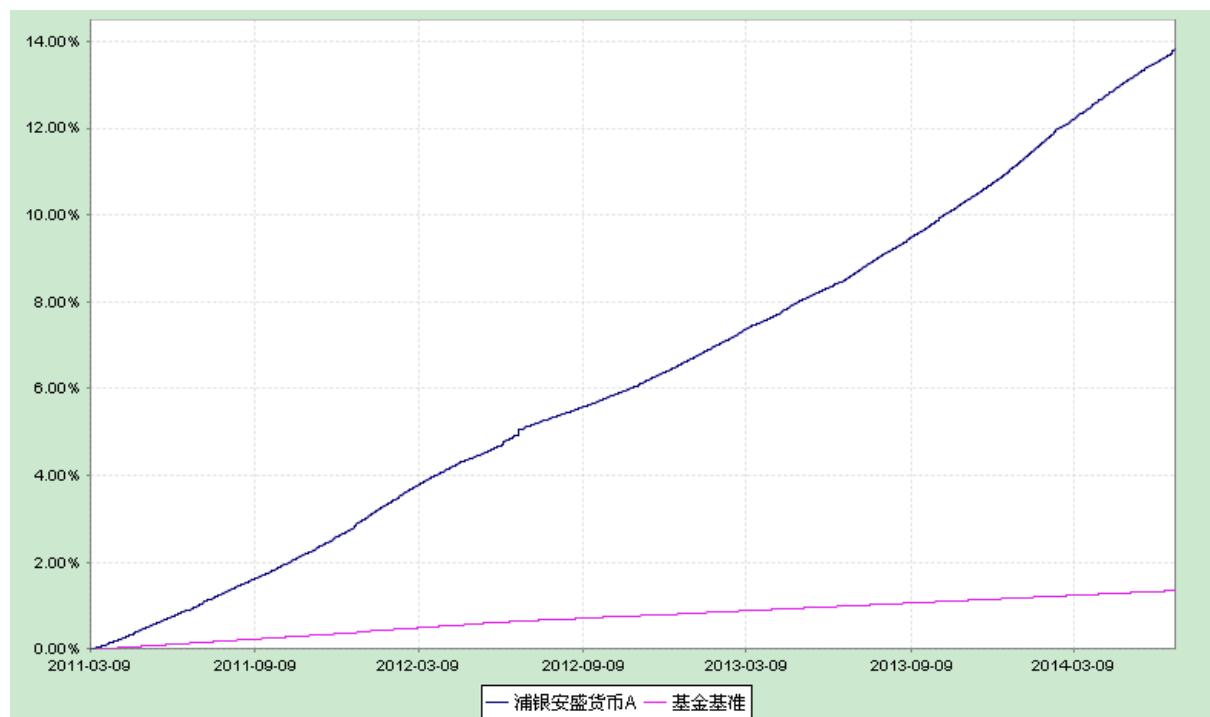
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛货币市场证券投资基金

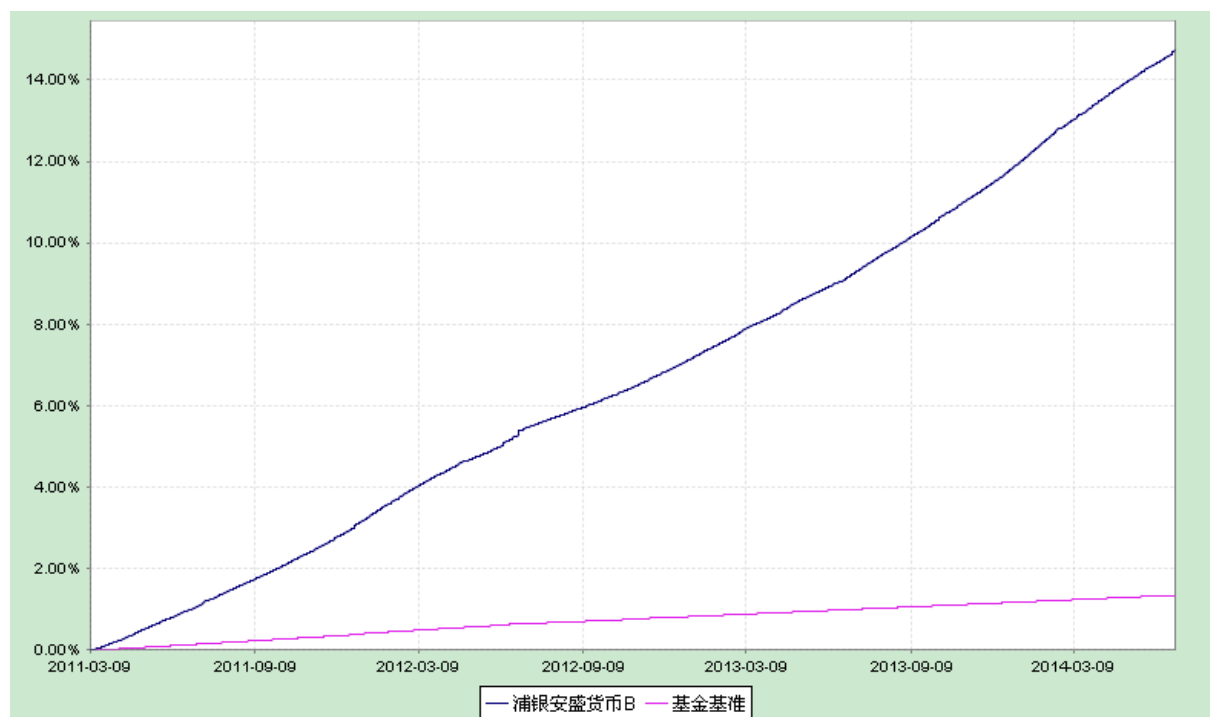
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011 年 3 月 9 日至 2014 年 6 月 30 日)

1、浦银安盛货币 A



2、浦银安盛货币 B



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
吕栋	本基金基金经理、浦银安盛优化收益债券基金基金经理以及浦银安盛日日盈货币基金基金经理	2014-1-7	-	8	吕栋先生，复旦大学理学学士、麻省理工大学-斯隆商学院金融学硕士学位。2006年8月到2010年6月，先后在瑞银集团（UBS）旗下Dillon Read对冲基金及瑞银集团(UBS)固定收益部任分析员，承担相对价值交易策略、资产抵押证券等数量化模型的研发工作。2011年6月，加盟花旗集团（香港）任投资银行部分析员，承担新债定价、公司基本面分析和债务结构分析工作。2011年11月起加盟浦银安盛基金管理公司担任专户投资经理助理。2013年7月起，调任至公司固定收益投资部工作。2013年9月起担任浦银安盛优化收益债券基金基金经理。2014年1月起兼任浦银安盛货币基金基金经理。2014年3月25日起兼任浦银安盛日日盈货币基金基金经理。
康佳燕	本基金基金经理	2014-6-19	-	8	康佳燕女士，香港大学工商管理硕士。2007年6月加盟浦银安盛基金管理有限公司，先后在基金会计部、交易部、固定收益部从事基金估值、债券交易、固定收益投资工作。2013年12月起在专户管理部担任

					固定收益投资经理。2014年6月起担任浦银安盛货币基金基金经理。
--	--	--	--	--	----------------------------------

注：1、此处的任职日期和离任日期分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在具体执行中，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平的提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度，保证公募基金及专户业务的独立投资决策机制；在交易执行环节上，详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程 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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在违反法律、法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

受资金市场宽松和定向刺激政策影响，上半年债券市场各品种收益率均出现了较大幅度的下行，债券市场经历了一轮牛市。在经历了前期的下行后，近期债券市场进入盘整阶段。上半年资金面、基本面和政策面的利好因素已被市场反应，下半年市场走向将取决于政策的宽松预期和新的催化剂。目前来看，政策仍有进一步放松的空间，但政策出台的时间和力度具有很大的不确定性。近期利多利空因素互现，市场虽陷入胶着但仍属于牛市格局，预计债券市场行情将温和持续，后期仍有下行空间，但过程可能有所波折。

本基金在二季度配置了部分银行存款，增持中高评级短融。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期 A 类净值收益率为 1.2172%，B 类净值收益率为 1.2779%，同期业绩比较基准收益率为 0.0873%。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	590,163,236.75	71.53
	其中：债券	590,163,236.75	71.53
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	189,035,070.34	22.91

4	其他资产	45,893,091.41	5.56
5	合计	825,091,398.50	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	5.67	
	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	182,423,388.79	28.49
	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的比例（%）	原因	调整期
1	2014-06-30	28.39	巨额赎回	4 个交易日

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	123
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	126
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	90

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期
1	2014-06-26	124	巨额赎回	6 个交易日
2	2014-06-27	126	巨额赎回	5 个交易日
3	2014-06-30	123	巨额赎回	4 个交易日

注：本基金基金合同约定投资组合的平均剩余期限不超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	21.72	28.49
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	17.18	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	20.30	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	21.84	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.06	-
5	180天(含)—397天（含）	45.33	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	126.37	28.49

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例 （%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	89,729,360.76	14.01
	其中：政策性金融债	89,729,360.76	14.01
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	500,433,875.99	78.15
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	590,163,236.75	92.16
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	19,620,764.29	3.06

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	041356039	13 陕 交 建 CP001	500,000	50,175,983.49	7.84
2	011481001	14 淮 南 矿 SCP001	500,000	50,006,885.10	7.81
3	011488002	14 豫 投 资 SCP002	500,000	50,001,358.73	7.81
4	011467003	14 神 华 能 源 SCP003	500,000	49,943,689.05	7.80

5	140204	14国开04	400,000	40,117,343.77	6.26
6	041464034	14 鄂 联 投 CP001	400,000	40,001,255.50	6.25
7	011489001	14 鞍 钢 股 SCP001	300,000	30,001,942.74	4.69
8	011494001	14 风 传 媒 SCP001	300,000	30,000,941.13	4.68
9	011420005	14中铝SCP005	300,000	30,000,917.29	4.68
10	041453010	14天原CP001	300,000	30,000,314.34	4.68

5.6 “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	6 次
报告期内偏离度的最高值	0.3601%
报告期内偏离度的最低值	0.1174%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2100%

5.7 报告期末按公允价值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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券，但未发生其摊余成本超过当日基金资产净值 20%的情况。

5.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体不存在本期被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	30,052,875.62
3	应收利息	11,417,223.38
4	应收申购款	4,422,992.41
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	45,893,091.41

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银安盛货币 A	浦银安盛货币 B
报告期期初基金份额总额	318,990,663.49	643,351,685.04
报告期期间基金总申购份额	508,670,465.22	1,592,095,924.28
减：报告期期间基金总赎回份额	630,042,577.68	1,792,689,501.49
报告期期末基金份额总额	197,618,551.03	442,758,107.83

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2014 年 4 月 25 日发布《浦银安盛基金管理有限公司关于董事会换

届的公告》，披露公司第三届董事会成员情况，其中新增霍佳震先生、董叶顺先生为公司独立董事，新增汪素南先生为公司董事，原董事林道峰先生、独立董事谢百三先生不再连任。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 存放地点

上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼基金管理人办公场所。

9.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

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

浦银安盛基金管理有限公司

二〇一四年七月十九日