

浦银安盛基金管理有限公司浦银安盛日日盈货币市场基金招募

说明书摘要（更新）

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

内容截止日：2016年9月25日

重要提示

本基金根据2014年2月27日中国证券监督管理委员会证监许可〔2014〕228号文进行募集。

成立日期：2014年3月25日

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

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。投资者购买本货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金管理人也不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响的市场风险，因金融市场利率的波动而导致证券市场价格和收益率变动的利率风险，因债券和票据发行主体信用状况恶化而可能产生的到期不能兑付的信用风险，因基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，因投资者连续大量赎回基金份额产生的流动性风险，因本基金管理现金头寸时有可能存在现金不足的风险或现金过多而带来的机会成本的风险，因收益分配处理的业务规则造成持有份额数较少的投资者无法获得投资收益的风险，因本基金投资的证券交易市场数据传输延迟等因素影响业务处理流程造成赎回款顺延至下一个工作日划出的风险，因本基金出现当日收益或累计未分配收益小于零的情形而暂停申购赎回的风险，因投资人申购金额或赎回份额超过基金管理人规定的上限而被拒绝的风

险等等。投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金不同于银行储蓄与债券，基金投资者有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。过往业绩并不代表将来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本次更新的招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2016年9月25日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年6月30日（财务数据未经审计）。

目 录

一、基金管理人	2
二、基金托管人	7
三、相关服务机构	9
四、基金的名称	23
五、基金的类型	23
六、基金的投资目标	23
七、基金的投资范围	23
八、基金的投资策略	23
九、业绩比较基准	25
十、风险收益特征	25
十一、投资决策依据和决策程序	26
十一、基金的投资组合报告	27
十三、基金业绩	31
十四、基金费用概览	35
十五、对招募说明书更新部分的说明	38

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：浦银安盛基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 981 号 3 幢 316 室

办公地址：中国上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼

成立时间：2007 年 8 月 5 日

法定代表人：姜明生

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2007]207 号

注册资本：2.8 亿元人民币

股权结构：上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“浦发银行”）持有 51% 的股权；法国安盛投资管理有限公司（以下简称“安盛投资”）持有 39% 的股权；上海国盛集团资产管理有限公司（以下简称“国盛资产”）持有 10% 的股权。

电话：（021）23212888

传真：（021）23212800

客服电话：400-8828-999；（021）33079999

网址：www.py-axa.com

联系人：徐薇

（二）主要人员情况

1、董事会成员

姜明生先生，董事长，本科学历。历任中国工商银行总行信托投资公司业务一部副总经理；招商银行总行信托投资部副总经理；招商银行北京分行行长助理；招商银行广州分行副行长（主持工作）；招商银行总行公司银行部总经理；招商银行上海分行党委书记、副行长（主持工作）；招商银行上海分行党委书记、行长。2007 年 4 月加入上海浦东发展银行，任总行党委委员。2007 年 9 月起任上海浦东发展银行总行副行长，2007 年 10 月至 2013 年 3 月兼任上海浦东发展银行上海分行党委书记、行长，现兼任中国银联董事。2016 年 6 月起兼任上海浦东发展银行董事。自 2009 年 11 月起兼任本公司董事长。2013 年 12 月起兼任本公司旗下子公司——上海浦银安盛资产管理有限公司执行董事。

Bruno Guilloton 先生，副董事长，法国国籍，毕业于国立巴黎工艺美术学院。于 1999 年加盟安盛投资管理（巴黎）公司，担任股票部门主管。2000 年至 2002 年，担任安盛投资管理（东京）公司首席执行官。2002 年，任职安盛罗森堡公司和安盛投资管理公司的亚洲区域董事。2005 年起，担任安盛投资管理公司内部审计全球主管。2009 年起任安盛投资管理公司亚洲股东代表。现任安盛投资管理公司亚

亚太区 CEO。自 2015 年 2 月起兼任安盛罗森堡投资管理公司亚太区董事。现另兼任 Foch Saint Cloud Versailles Sci 及 Fuji Oak Hills 公司董事。自 2009 年 3 月起兼任本公司副董事长。

刘长江先生，董事。1998 年至 2003 年担任中国工商银行总行基金托管部副处长、处长，2003 年至 2005 年担任上海浦东发展银行总行基金托管部总经理，2005 年至 2008 年担任上海浦东发展银行总行公司及投资银行总部资产托管部总经理、期货结算部总经理，2008 年起担任上海浦东发展银行总行公司及投资银行总部副总经理，2008 年至 2012 年 11 月兼任上海浦东发展银行总行公司及投资银行总部资产托管部总经理，现任上海浦东发展银行总行金融机构部总经理。自 2011 年 3 月起兼任本公司董事。

廖正旭先生，董事，斯坦福大学理学硕士和纽约科技大学理学硕士。1999 年加盟安盛罗森堡投资管理公司，先后担任亚太区 CIO 和 CEO，安盛罗森堡日本公司 CIO。2010 年任命为安盛-Kyobo 投资管理公司 CEO。2012 年起担任安盛投资管理公司亚洲业务发展主管。自 2012 年 3 月起兼任本公司董事。2013 年 12 月起兼任本公司旗下子公司——上海浦银安盛资产管理有限公司监事。

郁蓓华女士，复旦大学工商管理硕士。自 1994 年 7 月起，在招商银行上海分行工作，历任银行职员、招商银行宝山支行副行长、招商银行上海分行会计部总经理、计财部总经理，招商银行上海分行行长助理、副行长，招商银行信用卡中心副总经理。自 2012 年 7 月起担任本公司总经理。自 2013 年 3 月起兼任本公司董事。2013 年 12 月起兼任本公司旗下子公司——上海浦银安盛资产管理有限公司监事。

汪素南先生，董事。浙江大学计算机专业博士，高级工程师、国际注册内审师。1996 年 10 月加盟浦发银行宁波分行，历任发展研究部、电脑部、分行营业部总经理。2003 年 10 月调任至浦发银行总行，历任审计部执行审计官、首席审计官助理、中小企业业务经营中心总经理。2014 年 1 月至今担任浦发银行总行零售业务总监。2014 年 3 月起兼任浦发银行总行小企业金融服务中心总经理。自 2014 年 4 月起兼任本公司董事。

金杰先生，董事。上海财经大学工商管理硕士。曾先后就职于上海三菱电气股份有限公司、上海神光科技有限公司、上海（医药）集团有限公司等公司。2011 年 5 月进入上海国盛集团资产管理有限公司，现任上海国盛集团资产管理有限公司资产管理部总经理。自 2014 年 9 月起兼任本公司董事。

王家祥女士，独立董事。1980 年至 1985 年担任上海侨办华建公司投资项目部项目经理，1985 年至 1989 年担任上海外办国际交流服务有限公司综合部副经理，

1989年至1991年担任上海国际信托投资有限公司建设部副经理，1991年至2000年担任正信银行有限公司（原正大财务有限公司）总裁助理，2000年至2002年担任上海实业药业有限公司总经理助理，2002年至2006年担任上海实业集团有限公司顾问。自2011年3月起担任本公司独立董事。

韩启蒙先生，独立董事。法国岗城大学法学博士。1995年4月加盟基德律师事务所担任律师。2001年起在基德律师事务所担任本地合伙人。2004年起担任基德律师事务所上海首席代表。2006年1月至2011年9月，担任基德律师事务所全球合伙人。2011年11月起至今，任上海启恒律师事务所合伙人。自2013年2月起兼任本公司独立董事。

董叶顺先生，独立董事。中欧国际工商学院EMBA，上海机械学院机械工程学士。现任IDG资本投资顾问（北京）有限公司合伙人及和谐成长基金投委会成员。董叶顺先生拥有7年投资行业经历，曾任上海联和投资有限公司副总经理，上海联创创业投资有限公司、宏力半导体制造有限公司、MSN（中国）有限公司、南通联亚药业有限公司等公司董事长。董叶顺先生有着汽车、电子产业近20多年的管理经验，曾任上海申雅密封件系统、中联汽车电子、联合汽车电子系统、延峰伟世通汽车内饰系统等有限公司总经理、党委书记职务。自2014年4月起兼任本公司独立董事。

霍佳震先生，独立董事。同济大学管理学博士。1987年进入同济大学工作，历任同济大学经济与管理学院讲师、副教授、教授，同济大学研究生院培养处处长、副院长。现任同济大学经济与管理学院教授、院长，同济大学中德学院教席教授。自2014年4月起兼任本公司独立董事。

2、监事会成员

檀静女士，监事长，澳大利亚悉尼大学人力资源管理和劳资关系硕士研究生，加拿大不列颠哥伦比亚大学国际工商管理硕士。2010年4月至2014年6月就职于上海盛融投资有限公司，曾先后担任人力资源部副总经理，监事。2011年1月起至今就职于上海国盛集团资产管理有限公司任行政人事部总经理、本部党支部书记。自2015年3月起兼任本公司监事长。

Simon Lopez先生，澳大利亚/英国国籍。澳大利亚莫纳什大学法学学士、文学学士。2003年8月加盟安盛投资管理公司（英国伦敦），历任固定收益产品专家、固定收益产品经理、基金会计师和组合控制、首席运营官。现任安盛投资管理有限公司亚太区首席运营官。自2013年2月起兼任本公司监事。

陈士俊先生，清华大学管理学博士。2001年7月至2003年6月，任国泰君安证券有限公司研究所金融工程研究员。2003年7月至2007年9月，任银河基金管

理有限公司金融工程部研究员、研究部主管。2007年10月至今，任浦银安盛基金管理有限公司金融工程部总监，2010年12月10日起兼任浦银安盛沪深300增强型指数证券投资基金基金经理，2012年5月14日起兼任浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金基金经理。自2012年3月起兼任本公司职工监事。

朱敏奕女士，本科学历。2000年至2007年就职于上海东新投资管理有限公司资产管理部任客户主管。2007年4月加盟浦银安盛基金管理有限公司担任市场策划经理，现任本公司市场策划部经理。自2013年3月起，兼任本公司职工监事。

3、公司总经理及其他高级管理人员

郁蓓华女士，复旦大学工商管理硕士。自1994年7月起，在招商银行上海分行工作，历任银行职员、招商银行宝山支行副行长、招商银行上海分行会计部总经理、计财部总经理，招商银行上海分行行长助理、副行长，招商银行信用卡中心副总经理。自2012年7月23日起担任本公司总经理。自2013年3月起，兼任本公司董事。2013年12月起兼任本公司旗下子公司——上海浦银安盛资产管理有限公司监事。

喻庆先生，中国政法大学经济法专业硕士和法务会计专业研究生学历，中国人民大学应用金融学硕士研究生学历。历任申银万国证券有限公司国际业务总部高级经理；光大证券有限公司（上海）投资银行部副总经理；光大保德信基金管理有限公司副督察长、董事会秘书和监察稽核总监。2007年8月起，担任本公司督察长。

李宏宇先生，西南财经大学经济学博士。1997年起曾先后就职于中国银行、道勤集团和上海东新国际投资管理有限公司分别从事联行结算、产品开发以及基金研究和投资工作。2007年3月起加盟本公司，历任公司产品开发部总监、市场营销部总监、首席市场营销官。自2012年5月2日起，担任本公司副总经理兼首席市场营销官。

4、本基金基金经理

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月至2014年6月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市场基金基金经理。2014年7月起担任本基金基金经理。

历任基金经理吕栋先生，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月至2015年2月，担任公司浦银安盛优化收益债券基金基金经理。2014年1月至2015年2月，兼任公司浦银安盛货币市场基金经理。2014年3月至2015年2月，兼任本基金经理。吕栋先生拥有8年金融行业工作经验。

5、投资决策委员会成员

郁蓓华女士，本公司总经理，董事，并任投资决策委员会主席。

李宏宇先生，本公司副总经理兼首席市场营销官。陈士俊先生，本公司金融工程部总监，公司旗下浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金及浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金基金经理并兼任本公司职工监事。

吴勇先生，本公司投资总监兼权益投资部总监，公司旗下浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金、浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金以及浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

薛铮先生，本公司固定收益投资部总监，公司旗下浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金、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及浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金基金经理。

黄列先生，本公司研究部总监。

蒋建伟先生，本公司权益投资部副总监兼旗下浦银安盛价值成长混合型证券投资基金及浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

顾佳女士，本公司合规风控部总经理。

督察长、其他基金经理及基金经理助理列席投资决策委员会会议。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：牛锡明

住 所：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

邮政编码：200120

注册时间：1987年3月30日

注册资本：742.62亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：汤嵩彦

电话：95559

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2015年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第17位，较上年上升2位；根据2015年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜，交通银行营业收入位列第190位，较上年上升27位。

截至2016年6月30日，交通银行资产总额为人民币79,563.22亿元。2016年1-6月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币376.61亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心(下文简称“托管中心”)。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

(二) 主要人员情况

牛锡明先生，董事长、执行董事。

牛先生2013年10月至今任本行董事长、执行董事，2013年5月至2013年10月任本行董事长、执行董事、行长，2009年12月至2013年5月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生1983年毕业于中央财经大学金融系，获学士学位，1997年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业，获硕士学位，1999年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生，副董事长、执行董事、行长。

彭先生2013年11月起任本行副董事长、执行董事，2013年10月起任本行行长；2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长；2004年9月至2005年8月任本行副行长；2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助理；2001年9月至2004年6月任本行行长助理；1994年至

2001 年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生 1986 年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁。

袁女士 2015 年 8 月起任本行资产托管业务中心总裁；2007 年 12 月至 2015 年 8 月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999 年 12 月至 2007 年 12 月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士 1992 年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005 年于新疆财经学院获硕士学位。

（三）基金托管业务经营情况

截至 2016 年 6 月 30 日，交通银行共托管证券投资基金 175 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产和 QDLP 资金等产品。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）浦银安盛基金管理有限公司上海直销中心

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 981 号 3 幢 316 室

办公地址：中国上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼

电话：（021）23212899

传真：（021）23212890

客服电话：400-8828-999；（021）33079999

联系人：徐薇

网址：www.py-axa.com

（2）电子直销

浦银安盛基金管理有限公司电子直销（目前支持上海浦东发展银行借记卡、中国建设银行借记卡、中国农业银行借记卡、兴业银行借记卡、中信银行借记卡、广发银行借记卡、上海农商银行借记卡、中国工商银行借记卡、交通银行借记卡、中国银行借记卡、光大银行借记卡、民生银行借记卡、平安银行借记卡、邮政储蓄银行借记卡、上海银行借记卡、华夏银行借记卡、招商银行借记卡）

交易网站：www.py-axa.com

微信服务号：浦银安盛微理财（AXASPDB-E）

客服电话：400-8828-999；（021）33079999

2、场外代销机构

（1）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

客户服务热线：95559

网址：www.bankcomm.com

（2）上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

客户服务热线：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

（3）中信银行股份有限公司

地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：常振明

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

（4）宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

客服电话：95574

公司网址：www.nbc.com.cn

（5）申万宏源证券有限公司

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

客服电话：95523

网址：www.swhysc.com

（6）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦

法定代表人：万建华

客户服务热线：95521

公司网址：www.gtja.com

（7）中国银河证券股份有限公司

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

客服电话：95551

公司网站：www.chinastock.com.cn

（8）兴业证券股份有限公司

地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：兰荣

客户服务热线：95562

公司网站：www.xyzq.com.cn

（9）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

咨询电话：95587

公司网站：www.csc108.com

（10）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客户服务热线：95548

网址：www.cs.ecitic.com

（11）光大证券股份有限公司

地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

客服电话：95525

网址：www.ebscn.com

（12）信达证券股份有限公司

地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

客户服务热线：95321

网址：www.cindasc.com

（13）中航证券有限公司

地址：南昌市红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

法定代表人：王宜四

客户服务热线：400-8866-567

网址：www.avicsec.com

（14）中泰证券股份有限公司

办公地址：济南市经七路 86 号证券大厦 2001

法定代表人：李玮

客户服务热线：95538

网址：www.zts.com.cn

（15）万联证券有限责任公司

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 18、19 层

法定代表人：张建军

客户服务电话：400-88880133

网址：www.wlzq.cn

（16）天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人：林义相

客户服务热线：010-66045678

天相投顾网址：www.txsec.com

天相基金网网址：www.txjijin.com

（17）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

（18）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

网址: www.ehowbuy.com

(19) 北京展恒基金销售股份有限公司

办公地址: 北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人: 闫振杰

服务热线: 400-888-6661

网址: www.myfp.cn

(20) 众升财富(北京)基金销售有限公司

办公地址: 北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 04-08

法定代表人: 李招弟

服务热线: 400-059-8888

网址: www.wy-fund.com

(21) 北京增财基金销售有限公司

办公地址: 北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

法定代表人: 罗细安

服务热线: 400-001-8811

网址: www.zcvc.com.cn

(22) 浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址: 杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人: 凌顺平

服务热线: 4008-773-772

网址: www.5ifund.com

(23) 和讯信息科技有限公司

办公地址: 上海市浦东新区东方路 18 号保利大厦 18 楼

法定代表人: 王莉

服务热线: 400-920-0022

网址: licaike.hexun.com

(24) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址: 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址: 上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人: 张跃伟

客户服务电话: 400-820-2899

网址: www.erichfund.com

(25) 上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

服务热线：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

(26) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

客户服务热线：95577

网址：www.hxb.com.cn

(27) 海通证券股份有限公司

地址：上海市广东路 689 号 1001A 1001B 室

法定代表人：王开国

客服电话：95553

公司网址：www.htsec.com.cn

(28) 上海证券有限责任公司

地址：上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：龚德雄

客户服务热线：4008-918-918 021-962518

网址：www.962518.com

(29) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

法定代表人：黄金琳

客户服务热线：400-88-96326

网址：www.hfzq.com.cn

(30) 中信证券（山东）有限责任公司

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 20 层

法定代表人：杨宝林

客服电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

(31) 中国国际金融有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

客服电话：410-910-1166

公司网站: www.cicc.com.cn

(32) 东北证券股份有限公司

地址: 长春市自由大路 1138 号

法定代表人: 李福春

服务热线: 400-600-0686

网址: www.nesc.cn

(33) 广州证券股份有限公司

办公地址: 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人: 邱三发

服务热线: 020-961303

网址: www.gzs.com.cn

(34) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址: 北京市经济技术开发区宏达北路 10 号 5 层 5122 室

办公地址: 北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人: 梁越

服务热线: 400-786-88685

网址: www.chtfund.com

(35) 北京钱景财富投资管理有限公司

办公地址: 北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人: 赵荣春

客服电话: 400-893-688

网址: www.qianjing.com

(36) 南洋商业银行(中国)有限公司

注册地址: 上海市浦东新区世纪大道 800 号三层、六层至九层(不含六层 A 座)

法定代表人: 和广北

客户服务热线: 800-830-2066

网址: www.ncbchina.cn

(37) 广发证券股份有限公司

地址: 广州市天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼

法定代表人: 孙树明

客户服务热线: 95575

公司网站: www.gf.com.cn

(38) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦
20楼2005室

法定代表人：韩志谦

客户服务热线：400—800—0562

网址：www.hysec.com

(39) 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702室

法定代表人：吴雪秀

客服电话：400-001-1566

网址：www.yilucaifu.com

(40) 深圳宜投基金销售有限公司

办公地址：深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心2405

法定代表人：华建强

客服电话：4008-955-811

公司网站：www.yitfund.com

(41) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦7层、8层

法定代表人：黄扬录

客服电话：4001022011

公司网站：www.zszq.com.cn

(42) 上海汇付金融服务有限公司

办公地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼

法定代表人：冯修敏

客服电话：400-820-2819

公司网站：<https://tty.chinapnr.com>

(43) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

法定代表人：沈继伟

客服电话：400-067-6266

公司网站：m.leadfund.com.cn，admin.leadfund.com.cn

(44) 大泰金石投资管理有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室

办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

客服电话：021-22267995

公司网站：www.dtfunds.com

（45）珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

公司网站：www.yingmi.cn

（46）上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

客服电话：4000 178 000

公司网站：www.lingxianfund.com

（47）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

公司网站：www.noah-fund.com

（48）上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

客服电话：4008219031

公司网站：www.lufunds.com

（49）北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 1603

办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层

法定代表人：董浩

客服电话：400-068-1176

公司网站：www.jimufund.com

(50) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

公司网站：www.zlfund.cn www.jjmmw.com

(51) 深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室

法定代表人：齐小贺

客服电话：0755-83999907

公司网站：www.jinqianwo.cn

(52) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115 室，1116 室及 1307 室

法定代表人：TAN YIK KUAN

客服电话：400-684-0500

公司网站：www.ifastps.com.cn

(53) 爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 层

法定代表人：钱华

客服电话：4001962502

公司网站：www.ajzq.com

(54) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

客服电话：4000-466-788

公司网站：www.66zichan.com

(55) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法定代表人：杨懿

客服电话：400-166-1188

公司网站：8.jrj.com.cn

(56) 名称：中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

客服电话：4008909998

公司网站：www.jnlc.com

(57) 名称：北京创金启富投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号中水大厦 215A

办公地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社 A 综合楼 712 室

法定代表人：梁蓉

客服电话：400-6262-818

公司网站：www.5irich.com

(58) 平安证券有限责任公司

注册地址：广东省深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：广东省深圳市福田区金田路 4306 号荣超大厦 18 楼

法定代表人：谢永林

客服电话：95511-8

(59) 上海银行股份有限公司：

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：金煜

客户服务热线：95594

网址：www.bankofshanghai.com

(60) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号 26 楼

法定代表人：姚文平

客户服务电话：400888128

网址：www.tebon.com.cn

3、场内代销机构

投资者可通过“上证基金通”办理本基金 A 类份额（基金代码：519566）和 B 类份额（基金代码：519567）的上海证券交易所场内申购与赎回，可办理“上证基金通”业务的证券公司的具体名单可在上海证券交易所网站查询。如果上海证券交易所增加或减少具有“上证基金通”业务资格的证券公司，请以上海证券交易所的具体规定为准。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系人：赵亦清

电话：（010）50938782

传真：（010）50938991

（三）出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：国浩律师（上海）事务所

办公地址：上海市静安区南京西路 580 号南证大厦 45-46 层

负责人：倪俊骥

电话：021-52341668

传真：021-62676960

联系人：丁媛

经办律师：宣伟华、丁媛

（四）审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

电话：（021）23238888

联系人：张振波

经办注册会计师：薛竞、张振波

（五）其他服务机构及委托办理业务的有关情况

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，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。

四、基金的名称

浦银安盛日日盈货币市场基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资范围

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。如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。

1、本基金的投资策略将基于以下研究分析：

（1）市场利率研究

A、宏观经济趋势宏观经济状况是央行制定货币政策的基础，也是影响经济总体货币需求的关键因素，因此宏观经济趋势基本上确定了未来较长时期内的利率水平。在分析宏观经济趋势时，本基金重点关注两个因素。一是经济增长前景；二是通货膨胀率及其预期。

B、央行的货币政策取向包括基准存、贷款利率，法定存款准备金率，公开市场操作的方向、力度，以及央行的窗口指导等。央行的货币政策取向是影响货币市场利率的最直接因素。在央行紧缩货币、提高基准利率时，市场利率一般会相应上升；而央行放松货币、降低基准利率时，市场利率则相应下降。

C、商业银行的信贷扩张

商业银行的信贷扩张是央行实现其货币政策目标的重要途径，也是经济总体货币需求的体现。因此商业银行的信贷扩张对货币市场利率具有举足轻重的影响。一般来说，商业银行信贷扩张越快，表明经济总体的货币需求越旺盛，货币市场利率也越高；反之，信贷扩张越慢，货币市场利率也越低。

D、国际资本流动

中国日益成为一个开放的国家，国际资本进出也更加频繁，并导致央行被动的投放或收回基础货币，造成货币市场利率的波动。在人民币汇率制度已经从钉住美元转为以市场供求为基础、参考一篮子货币进行调节、有管理的浮动汇率制度的情况下，国际资本流动对国内市场利率的影响也越发重要。

E、其他影响短期资金供求关系的因素

包括财政存款的短期变化，市场季节性、突发性的资金需求等。

（2）市场结构研究

银行间市场与交易所市场在资金供给者和需求者结构上均存在差异，利率水平因此有所不同。不同类型市场工具由于存在税负、流动性、信用风险上的差异，其收益率水平也略有不同。资金供给者、需求者结构的变化也会引起利率水平的变化。积极利用这些利率差异、利率变化就可能在保证流动性、安全性的基础上为基金资产带来更高的收益率。

（3）企业信用分析

直接融资的发展是一个长期趋势，企业债、企业短期融资券因此也将成为货币市

场基金重要的投资对象。为了保障基金资产的安全，本基金将按照相关法规仅投资于具有满足信用等级要求的企业债券、短期融资券。与此同时，本基金还将深入分析发行人的财务稳健性，判断发行人违约的可能性，严格控制企业债券、短期融资券的违约风险。

2、本基金具体投资策略

（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。

（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。

（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。

（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。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：活期存款利率（税后）

本基金定位为现金管理工具，注重基金资产的流动性和安全性，因此采用活期存款利率（税后）作为业绩比较基准。活期存款利率由中国人民银行公布，如果活期存款利率或利息税发生调整，则新的业绩比较基准将从调整当日起开始生效。如果今后法律法规发生变化，或者中国人民银行调整或停止该基准利率的发布，或者市场中出现其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，经基金管理人和基金托管人协商一致后，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十、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。

十一、投资决策依据和决策程序

为了保证整个投资组合计划的顺利贯彻实施，本基金遵循以下投资决策依据以及具体的决策程序：

（一）投资决策依据

- 1、国家有关法律法规和《基金合同》的有关规定；
- 2、宏观经济发展态势和证券市场运行环境和趋势的研究和判断；

（二）决策程序

投资决策程序分为投资研究、投资决策、投资执行、投资跟踪与反馈、投资核对与监督、风险控制六个环节，具体如下：

1、投资研究

固定收益团队负责宏观经济和货币政策的分析研究以及各类投资策略有效性研究，定期提交分析报告。

2、投资决策

投资决策委员会是公司最高的投资决策机构。

基金经理根据固定收益团队的研究成果，应用各种投资策略，制定具体的投资方案，报投资决策委员会审批。

3、投资执行

基金经理根据经投资决策委员会批准的投资方案，结合市场流动性情况，构建投资组合。

基金经理在其权限范围内向集中交易室下达交易命令。集中交易室负责具体的交易执行，同时对基金投资的日常交易行为进行实时监控。

4、投资跟踪与反馈

基金经理应用固定收益团队内部研究及风险管理部的风险指标衡量密切跟踪基金的流动性风险和信用风险，对投资组合进行动态监控和调整。

5、投资核对与监督

基金交易清算人员通过交易数据的核对，对当日交易操作进行复核。

6、风险控制

基金投资管理过程中的风险控制包括两个层次，一个层面是由金融工程人员定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并对投资组合提出优化建议报告；另一个层面是外部独立的风险管理机构（包括风险控制委员会、监察部、风险管理部）对投资管理过程的风险监控。

十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2015 年 12 月 31 日（财务数据未经审计）。

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 6,316,731,224.51 35.38

其中：债券 6,316,731,224.51 35.38

资产支持证券 -

-

2 买入返售金融资产 1,994,051,071.08

11.17

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 9,373,755,644.19 52.50

4 其他资产 171,314,215.65 0.96

5 合计 17,855,852,155.43 100.00

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 1.12

其中：买断式回购融资 -

序号 项目 金额 占基金资产净值比例（%）

2 报告期末债券回购融资余额 - -

其中：买断式回购融资 - -

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本报告期内本基金未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况。

3. 基金投资组合平均剩余期限

(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 101

报告期内投资组合平均剩余期限最高值 101

报告期内投资组合平均剩余期限最低值 60

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。本基金基金合同约定投资组合的平均剩余期限不超过 120 天。

(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 17.25 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 - -

2 30 天(含)—60 天 14.00 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 - -

3 60 天(含)—90 天 16.79 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 - -

4 90 天(含)—180 天 38.64 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 - -

5 180 天(含)—397 天(含) 12.41 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 - -

合计 99.08 -

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 1,989,487,974.30 11.15

其中：政策性金融债 1,879,502,803.22 10.53

4 企业债券 - -

5 企业短期融资券 799,335,712.72 4.48

6 中期票据 - -

7 同业存单 3,527,907,537.49 19.77

8 其他 --

9 合计 6,316,731,224.51 35.39

10 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 --

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

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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 130244 13 国开 44 3,900,000 392,945,170.95 2.20

2 150222 15 国开 22 2,500,000 250,008,564.61 1.40

3 111693000 16 西安银行 CD010 2,000,000 199,418,155.09 1.12

4 111619022 16 恒丰银行 CD022 2,000,000 199,174,097.65 1.12

5 111592942 15 贵阳银行 CD041 2,000,000 198,735,518.17 1.11

6 111694733 16 成都农商银行 CD009 2,000,000 198,600,557.12 1.11

7 111692121 16 杭州银行 CD057 2,000,000 198,520,766.97 1.11

8 111693524 16 广州农村商业银行 CD063 2,000,000 197,617,496.18 1.11

9 111693844 16 重庆银行 CD020 2,000,000 197,454,468.66 1.11

10 111694877 16 东莞农村商业银行 CD049 2,000,000 196,929,865.30 1.10

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 --

报告期内偏离度的最高值 0.0627%

报告期内偏离度的最低值 0.0068%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 0.0247%

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8. 投资组合报告附注

(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。

(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 天的浮动利率债券说明

本报告期内本基金未持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券。

(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。

(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	-
3	应收利息	76,548,884.57
4	应收申购款	52,685,331.08
5	其他应收款	42,080,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	171,314,215.65

十三、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

1、浦银安盛日日盈货币 A：

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差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

2014/03/25-2014/12/31 3.3388% 0.0034% 0.2708% 0.0000% 3.0680% 0.0034%

2015/01/01-2015/12/31 3.6938% 0.0034% 0.3506% 0.0000% 3.3432% 0.0034%

2016/01/01-2016/06/30 1.2620% 0.0013% 0.1742% 0.0000% 1.0878% 0.0013%
2014/03/25-2016/06/30 8.5083% 0.0035% 0.7976% 0.0000% 7.7107% 0.0035%

2、浦银安盛日日盈货币 B:

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差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

2014/03/25-2014/12/31 3.5318% 0.0034% 0.2708% 0.0000% 3.2610% 0.0034%
2015/01/01-2015/12/31 3.9427% 0.0034% 0.3506% 0.0000% 3.5921% 0.0034%
2016/01/01-2016/06/30 1.3831% 0.0013% 0.1742% 0.0000% 1.2089% 0.0013%
2014/03/25-2016/06/30 9.1022% 0.0035% 0.7976% 0.0000% 8.3046% 0.0035%

3、浦银安盛日日盈货币 D:

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差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

2014/06/03-2014/12/31 2.5022% 0.0038% 0.2035% 0.0000% 2.2987% 0.0038%
2015/01/01-2015/12/31 3.6938% 0.0034% 0.3506% 0.0000% 3.3432% 0.0034%
2016/01/01-2016/06/30 1.2622% 0.0013% 0.1742% 0.0000% 1.0880% 0.0013%
2014/06/03-2016/06/30 2.8183% 0.0023% 0.3511% 0.0000% 2.4672% 0.0023%

(二) 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长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

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

1、浦银安盛日日盈货币 A:

2014年3月25日至2016年6月30日

2、浦银安盛日日盈货币 B:

2014年3月25日至2016年6月30日

3、浦银安盛日日盈货币 D:

2014年6月03日至2016年6月30日

十四、基金费用概览

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金开户费和银行账户维护费；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

(三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费率最高不超过0.33%。本基金可以对不同份额类别设定不同的管理费率，管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3. 基金销售服务费

本基金年销售服务费率最高不超过0.25%，本基金可以对不同份额类别设定不同的销售服务费率。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。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$

H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给管理人，由管理人付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

上述“（一）基金费用的种类中第4—10项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（四）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（五）费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和基金份额销售服务费率等相关费率。降低基金管理费率、基金托管费率和基金份额销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

基金管理人和基金托管人协商一致后，可按照基金发展情况，并根据法律法规规定和基金合同约定，调整基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等相关费率。

（六）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，更新了部分内容；
- 2、在“第三部分 基金管理人”部分，对基金管理人概况、基金管理人主要人员情况进行了更新；
- 3、在“第四部分 基金托管人”部分，更新了基金托管人基本情况；
- 4、在“第五部分 相关服务机构”部分，对基金份额发售机构、注册登记机构及审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师部分内容进行了更新；
- 5、在“第九部分 基金份额的申购与赎回”部分，对基金转换和定期定额投资计划部分内容进行了更新；
- 6、在“第十部分 基金的投资”部分，补充了本基金最近一期公开披露的投资组合报告的内容和 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日的投资业绩；
- 7、在“第二十部分 基金托管协议的内容摘要”部分，更新了托管协议当事人；
- 8、在“第二十一部分 对基金份额持有人的服务”部分，对电子化服务及服务渠道部分内容进行了更新；
- 9、在“第二十二部分 其他应披露事项”部分，更新了基金管理 2016 年 3 月 26 日至 2016 年 9 月 25 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的与本基金相关的公告及基金管理人和基金管理人子公司投资本基金的情况。

浦银安盛基金管理有限公司

二〇一六年十一月七日