

浦银安盛日日鑫货币市场基金 2022 年年度报告

2022 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 30 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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.....	19
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	20
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.....	20
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.....	20
§6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	28
§8 投资组合报告	54

8.1 期末基金资产组合情况.....	54
8.2 债券回购融资情况.....	55
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	55
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	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	56
8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	57
8.8 期末按实际利率计算账面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.....	57
8.9 投资组合报告附注.....	57
§9 基金份额持有人信息.....	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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情况	58
§10 开放式基金份额变动.....	59
§11 重大事件揭示.....	59
11.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4 基金投资策略的改变.....	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	61
11.9 其他重大事件.....	61
§12 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
§13 备查文件目录.....	64
13.1 备查文件目录.....	64
13.2 存放地点.....	64
13.3 查阅方式.....	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛日日鑫货币市场基金	
基金简称	浦银安盛日日鑫	
基金主代码	003228	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 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	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	511,954,388.51 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	浦银日日鑫 A	浦银日日鑫 B
下属分级基金的交 易代码	003228	003229
报告期末下属分级 基金的份额总额	44,274,398.28 份	467,679,990.23 份

2.2 基金产品说明

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

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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛香	龚小武
	联系电话	021-23212888	021-52629999-212056
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95561
传真		021-23212985	021-62159217
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区滨江大道 5189 号地下 1 层、地上 1 层至地上 4 层、地上 6 层至地上 7 层	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址		上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层	上海市银城路 167 号 4 楼
邮政编码		200127	200120
法定代表人		谢伟	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	浦银安盛基金管理有限公司	上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层

§ 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	2022 年		2021 年		2020 年	
	浦银日日鑫 A	浦银日日鑫 B	浦银日日鑫 A	浦银日日鑫 B	浦银日日鑫 A	浦银日日鑫 B
本期已实现收益	732,978.22	60,463,081.38	1,193,537.89	206,089,994.25	1,859,133.20	404,639,300.86
本期利润	732,978.22	60,463,081.38	1,193,537.89	206,089,994.25	1,859,133.20	404,639,300.86
本期净值	1.5761%	1.8203%	2.1226%	2.3682%	2.0922%	2.3376%

收益 率						
3.1. 2 期 末数 据和 指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
期末 基金 资产 净值	44,274,398. 28	467,679,990. 23	48,330,322. 52	3,464,018,220. 00	63,784,309. 42	10,124,740,803. 08
期末 基金 份额 净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1. 3 累 计期 末指 标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
累计 净值 收益 率	16.9018%	18.6053%	15.0878%	16.4850%	12.6957%	13.7902%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

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

浦银日日鑫 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	0.3142%	0.0044%	0.0883%	0.0000%	0.2259 %	0.0044 %

过去六个月	0.6474%	0.0034%	0.1766%	0.0000%	0.4708 %	0.0034 %
过去一年	1.5761%	0.0027%	0.3506%	0.0000%	1.2255 %	0.0027 %
过去三年	5.9024%	0.0020%	1.0555%	0.0000%	4.8469 %	0.0020 %
过去五年	12.2665 %	0.0024%	1.7654%	0.0000%	10.501 1%	0.0024 %
自基金合同生效起 至今	16.9018 %	0.0028%	2.1535%	0.0000%	14.748 3%	0.0028 %

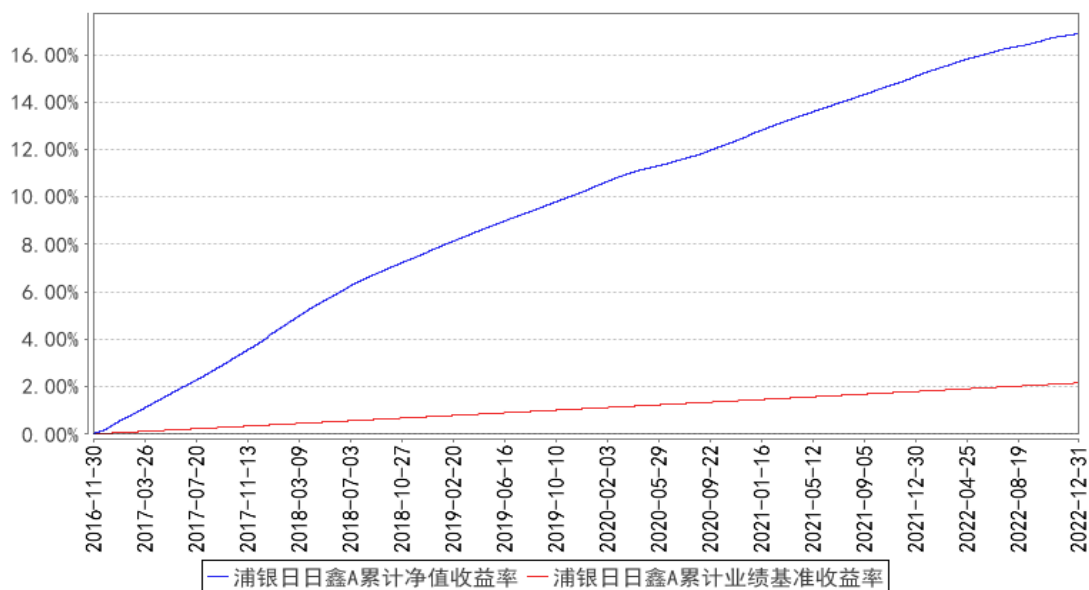
浦银日日鑫 B

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	0.3750%	0.0044%	0.0883%	0.0000%	0.2867 %	0.0044 %
过去六个月	0.7694%	0.0034%	0.1766%	0.0000%	0.5928 %	0.0034 %
过去一年	1.8203%	0.0027%	0.3506%	0.0000%	1.4697 %	0.0027 %
过去三年	6.6681%	0.0020%	1.0555%	0.0000%	5.6126 %	0.0020 %
过去五年	13.6217 %	0.0024%	1.7654%	0.0000%	11.856 3%	0.0024 %
自基金合同生效起 至今	18.6053 %	0.0028%	2.1535%	0.0000%	16.451 8%	0.0028 %

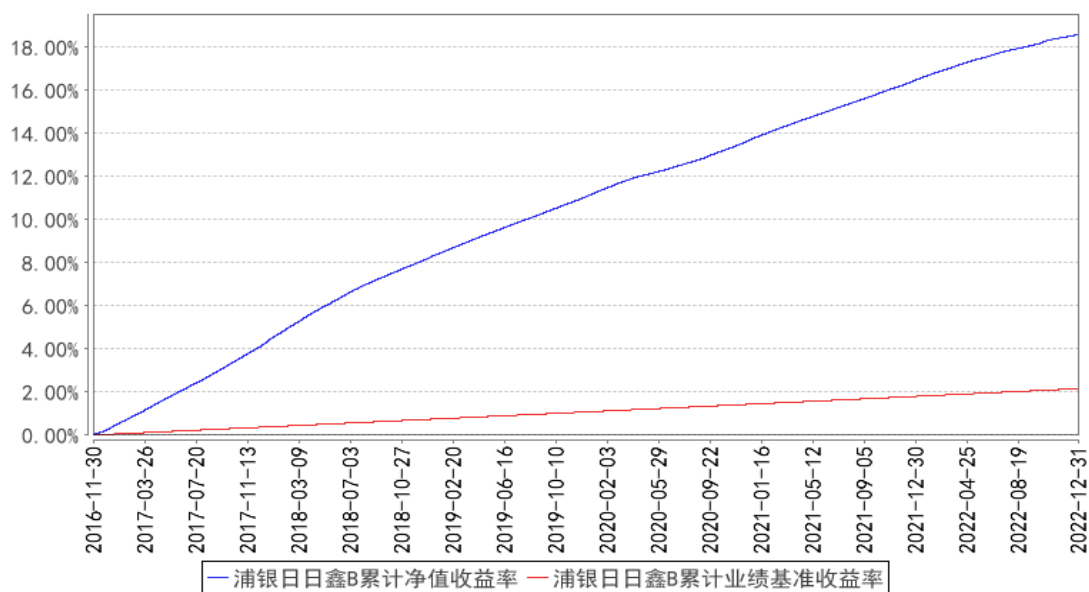
注：1、本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

浦银日日鑫A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

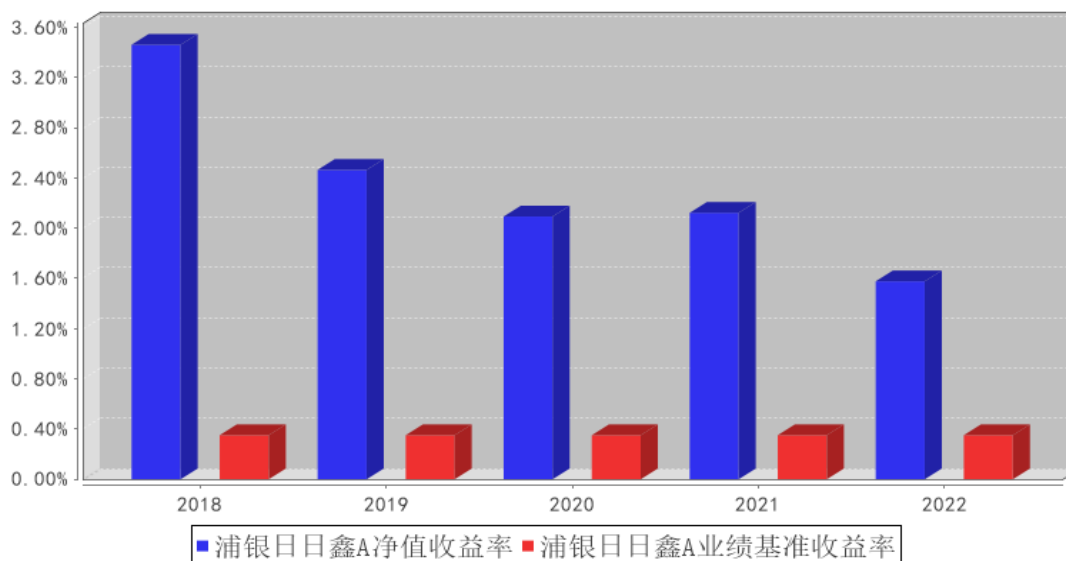


浦银日日鑫B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

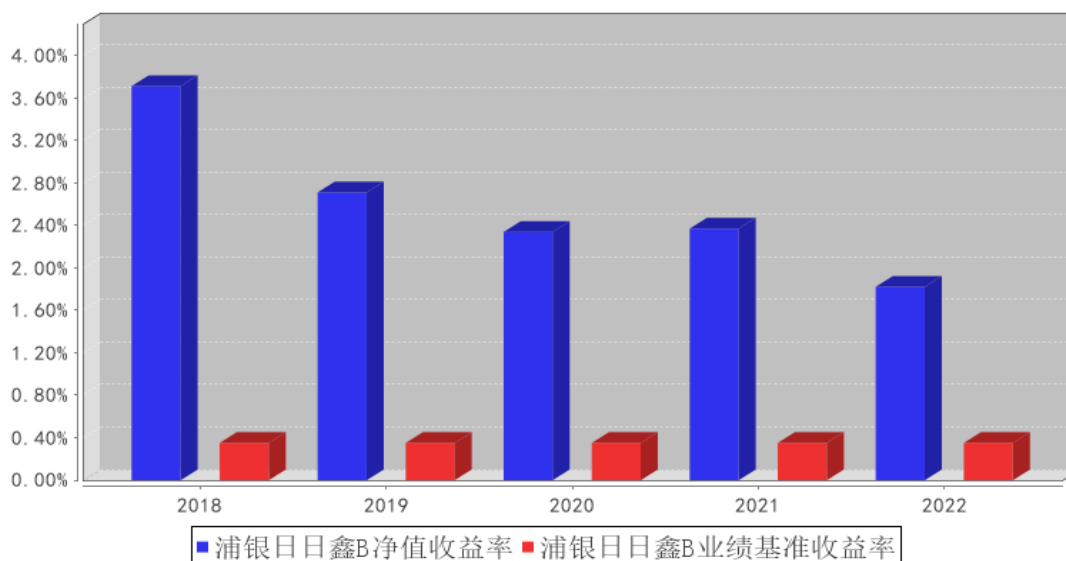


3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浦银日日鑫A基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



浦银日日鑫B基金每年净值收益率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

浦银日日鑫 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
2022 年	733,307.70	-	-329.48	732,978.22	-
2021 年	1,195,147.46	-	-1,609.57	1,193,537.89	-
2020 年	1,859,698.53	-	-565.33	1,859,133.20	-
合计	3,788,153.69	-	-2,504.38	3,785,649.31	-

浦银日日鑫 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
2022 年	60,676,166.74	-	-213,085.36	60,463,081.38	-
2021 年	206,659,500.05	-	-569,505.80	206,089,994.25	-
2020 年	405,285,182.80	-	-645,881.94	404,639,300.86	-
合计	672,620,849.59	-	-1,428,473.10	671,192,376.49	-

§ 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 120,000 万元人民币，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 2022 年 12 月 31 日止，浦银安盛旗下共管理 101 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（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、浦银安盛盛鑫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、浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金、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、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银

安盛全球智能科技股票型证券投资基金 (QDII)、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、浦银安盛盛焯 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、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、浦银安盛颐和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛先进制造混合型证券投资基金、浦银安盛盛智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛晖一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛熙一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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联接基金、浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛科技创新优选三年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛普嘉 87 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、浦银安盛安远回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛价值精选混合型证券投资基金、浦银安盛普华 66 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛普天纯债债券型证券投资基金、浦银安盛普庆纯债债券型证券投资基金、浦银安盛睿和优选 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛中债 3-5 年农发行债券指数证券投资基金、浦银安盛盛毅一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、浦银安盛稳健丰利债券型证券投资基金、浦银安盛 ESG 责任投资混合型证券投资基金、浦银安盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛均衡优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、浦银安盛鑫福混合型证券投资基金、浦银安盛季季鑫 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银安盛嘉和稳健一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛中证 ESG 120 策略交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛双月鑫 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银安盛中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛鑫锐混合型证券投资基金、浦银安盛中证沪港深游戏及文化传媒交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛 CFETS 0-5 年期央企债券指数发起式证券投资基金、浦银安盛颐享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛盛瑞纯债债券型证券投资基金、浦银安盛品质优选混合型证券投资基金、浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛兴荣稳健一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛泰和配置 6 个月持有期混合型基金中

基金（FOF）、浦银安盛安弘回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金（FOF）、浦银安盛普裕一年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛中证沪港深消费龙头交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛兴耀优选一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛稳鑫 120 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、浦银安盛盛嘉一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普诚纯债债券型证券投资基金、浦银安盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、浦银安盛季季盈 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金。

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。当前公司顺利完成上交所金桥机房搬迁，新职场大楼信息技术相关系统建设，结合合肥异地灾备中心，初步形成两地三中心的布局，进一步完善了公司信息技术基础设施系统建设，这些系统由公司信息技术部主导并聘请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、XBRL 系统、反洗钱系统等。这些系统也主要是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。近年，公司信息技术部以自主开发平台为基础，构建了数字化运营平台、大数据开发平台、创新研发平台、移动平台等业务应用平台，初步创建了公司自研团队。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		
廉素君	本基金的基金经理	2019 年 3 月 4 日	-	10 年	廉素君女士，华中科技大学金融学硕士。2012 年 3 月至 2013 年 6 月在第一创业证券股份有限公司任职稽核与风险管理岗；2013 年 7 月至 2017 年 11 月在郑州银行股份有限公司

					公司金融市场部，担任投资交易岗。2017年11月加盟浦银安盛基金管理有限公司，2017年11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，现在固定收益投资部担任固定收益类基金经理。2019年3月起担任浦银安盛货币市场证券投资基金以及浦银安盛日日鑫货币市场基金经理。2021年10月起担任浦银安盛双月鑫60天滚动持有短债债券型证券投资基金基金经理。2022年9月起担任浦银安盛中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理。2022年11月起担任浦银安盛季季盈90天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理。
王茂青	本基金的基金助理	2018年1月22日	-	12年	王茂青女士，上海财经大学工商管理学硕士。2008年9月至2010年3月在普华永道会计事务所担任审计员。2010年12月至2018年1月间在农银汇理基金、上银基金和兴银基金担任过基金会计、交易员、高级交易员和基金经理助理。2018年1月22日加入浦银安盛基金管理有限公司担任货币基金基金经理助理。

注：1、首任基金经理及基金经理助理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理及基金经理助理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理及基金经理助理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期。

2、证券从业含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

管理人制定了《浦银安盛基金管理有限公司公平交易管理规定》，并进行了多次修订。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；
- 要求同一基金经理管理的多个组合下达投资指令应尽量“同时同价”；
- 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、10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

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。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，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。在交易执行环节上，详细规定了面对多个投资组合交易执行的流程和规定，以保证投资执行交易过程的公平性。公司严格控制主动投资组合的同日反向交易，非经特别控制流程审批同意，不得进行。从事后监控角度上，定期对组合同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日、10日）的季度公平性交易分析评估，对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异进行分析。公司定期对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行检查，季度公平交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

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。报告期内未发生本基金与旗下其他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

2022 年上半年国内资产先后经历地缘政治风险、疫情冲击、经济修复和稳增长政策影响宏观定价的四个阶段。一季度，疫情对世界经济的深层次影响逐步显现，全球通胀压力陡升，两大资源国俄乌的地缘政治冲突，进一步加剧了能源和农产品的供需矛盾，石油等能源价格持续历史新高；同时各经济体所处的经济周期不同步，美国已启动加息进程，各国外汇市场压力增大，一定程度上掣肘了国内货币政策的空间。国内来看，1-2 月份稳增长的措施陆续实施，多地地产政策逐步放松，PMI 数据好于预期，但社融结构显示实体需求一般，债市震荡缓慢上行；但 3 月中下旬，Omicron 新冠病毒在国内多地散点式爆发，深圳上海等一线城市亦中招，随着疫情管控力度的不断加码，将对当地及周边实体经济形成拖累，进而影响经济复苏的节奏和步伐。流动性方面，一季度整体央行持续保持银行间流动性合理充足，并在 1 月份实施了公开市场利率的下调，整个季度内 DR007 维持在政策利率 2.1% 附近，对债市流动性形成支撑。市场走势上，10Y 国债收益率震荡，维持 2.79% 附近，收益率绝对水平处于历史低位；1Y 国股存单收益率整体震荡，全季度维持在 2.40-2.60% 宽幅震荡。

进入二季度，疫情的持续散点式小范围出现，市场开始重新审视宽信用政策的效果，以及宽松货币政策的时效性可能有所延续，债券收益率开始快速下行，但由于外围通胀预期的不断上升以及中美利差倒挂带来的压力，长端利率波动明显。直到 5 月底，美债收益率有见顶回落迹象开始，长端利率才又经历了一波下行，进入 6 月，上海疫情基本告一段落，金融数据和地产销售数据开始走强，市场对于基本面好转有较强的预期，长端收益率开始震荡上行；期间受益于宽松的货币政策，中短端收益率始终保持震荡下行的走势，表现好于长端。

进入三季度，虽然 6 月金融和经济数据显示经济开始有复苏势头，但进入 7 月经济又受到新的干扰，包括疫情在国内多个城市散发、高温天气阻碍开工和出行、地产产业链投资和销售数据继续低迷等，导致 7 月份官方制造业 PMI 较上月转弱，再度落回枯荣线以下，显示今年的疫后复苏过程比 2020 年的疫后复苏更加曲折。基于此，8 月 15 日央行下调 MLF 与 OMO 政策利率 10 个基

点，并带动 LPR 报价下调；8 月末国务院决定再实施 19 项稳经济接续政策，增加 3000 亿政策金融工具，用好 5000 亿专项债结存限额，允许地方“一城一策”运用信贷等政策等，在央行上述降息行动的影响下，债市收益率开始出现了明显的下行。随后市场开始预期各项稳增长政策将发挥效力，收益率下行的斜率在月末已放缓。9 月稳增长宽信用政策要求应出进出，信贷数据可能会明显好转，长端利率走势对利好钝化、利空敏感，调整压力明显。但在月底随着社融超预期公布，短期利空落地，收益率转而下行 5-7BP。

进入四季度，10 月国庆假期结束后，资金面短暂回归宽松局面，1Y 以内各期限收益率小幅回落，但考虑到 7 月以来月度资金利率加权连续缓慢上行，加之四季度银行发行长期限存单的意愿明显会增大；同时各项稳增长措施会加速推出和实施落地，基本面预期转向、债市情绪偏利空。10 月底开始，资金面重回紧张，利率中枢明显持续上行，带动短端各期限收益率快速上行，进而导致部分净值型银行理财产品和公募基金出现赎回和负反馈效应；同时银行理财现金管理类产品临近整改截止日，进一步加剧了短端各类型资产的收益率上行节奏和幅度，1Y 国股存单利率上行超 60BP。12 月中下旬随着央行开始投放跨年资金，理财赎回压力逐步缓解，债市跨年行情正式开启，短端各期限收益率开始大幅下行。

在 2022 年的年度账户运作过程中，大的原则还是基于对资金面波动的判断，灵活调整组合久期和资产属类占比，预期宽松时适度降低组合久期和杠杆、交易盘获利了结；待到月末、年末等流动性紧张时期主动提高杠杆比例，同时大量配置受资金冲击较大导致绝对收益率较高的同业存单和高等级信用债资产。此外，合理安排资产到期日，保证本组合良好流动性的同时，为投资者增厚收益。整体在 1 月-8 月久期和杠杆比例相对较高，进入 9 月份由于资金利率中枢抬升明显，开始转向防守，进行减仓和降低杠杆，腾出指标空间等待资金中枢稳定后择机配置，因而在 10 月-11 月的市场大幅且快速上行过程中，账户回撤控制尚可，同时也预留出了资产置换的空间。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银日日鑫 A 的基金份额净值为 1.0000 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.5761%，同期业绩比较基准收益率为 0.3506%，截至本报告期末浦银日日鑫 B 的基金份额净值为 1.0000 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.8203%，同期业绩比较基准收益率为 0.3506%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望明年，国内经济运行情况大概率好于今年，“宽信用”政策将持续推出，但过程将一波三折。尽管疫情管控及地产修复均迎来了重要的政策转折，但疫情管控措施边际放松的初期阶段，疫情反复或对经济形势形成冲击。地产方面，居民收入与房价预期的弱势难以快速修复，地产调控传导难度大于以往，基建投资继续发力，出口下行压力或将增强。因此，在政策的持续刺激下，

2023 年稳增长政策效果大概率在经济数据上进一步验证，促使“稳信用”阶段向“宽信用”阶段过渡，但经济修复的程度或较为有限，多因素叠加，2023 年经济大概率将是弱修复的状态。

货币政策方面，由于处于经济复苏阶段，预期明年的货币政策不存在转向的可能，稳健的货币政策仍应该是主旋律，但由于宽信用、扩内需、降成本的结构性的政策，我们判断 23 年全年资金价格中枢小幅抬升，宽货币对债市的利好驱动弱于 2022 年。

债券收益率方面，经济复苏、消费回暖的预期会持续发酵，收益率会有所抬升，但仍因关注一些意外的事件，例如央行超预期宽松，银行负债成本超预期下降，经济数据不如预期等事件所产生的交易机会。

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》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》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。

2022 年以来，公司进一步强化合规风险底线意识，塑造良好的合规风控文化，打造“纵向到底，横向到边”的合规风控机制，促进公司持续、健康、平稳地高质量发展，充分保护投资者的利益，维护公司股东的合法权益，依照法律法规及监管部门的要求，结合公司实际业务开展情况，制定和修订了一系列制度流程体系，进一步完善了全面合规和风险管理机制。今年以来，公司各项合规风控审计管理方面总体上得到了良好的控制，各项控制措施切实而有效，年内未发生重大违规及重大风险事件。

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。2022 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、法律事务、合规审核、合规培训、合规检查、信息披露、反洗钱、客户投诉处理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，对投资合规风险、信用风险、流动性风险、市场风险、操作风险、信息科技风险、声誉风险和 Innovation 产品/业务风险等均建立了完善的二层风险监控机制，平时注重加强对基金经理的培训，提升前台人员风险意识，同时进一步开发并优化量化风险评估模型，前置化风险预警能力，智能化分析各项风险并向投研人员提供线上支持，努力提升风险化解及处置能力。

审计方面，按照审计计划完成了法规要求的常规审计项目和根据风险导向开展的重要业务领域的专项审计项目，配合会计师事务所开展了重要的外部审计工作，另外还协调公司各业务部门

接受了股东方浦发银行对公司开展的后续审计工作。今后将继续秉持以风险为导向的重点业务领域专项审计，同时兼顾对公司所有业务循环的审计覆盖面。

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产品估值条线分管领导、风险管理部负责人、指数与量化投资部负责人、产品估值部负责人以及所涉及投资品种的投研部门负责人（包括但不限于权益投资部、研究部、权益专户部、固定收益投资部、固定收益专户部、信用研究部等）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鑫货币 A 级基金应分配收益 732,978.22 元，实际分配收益 732,978.22 元；浦银安盛日日鑫货币 B 级基金应分配收益 60,463,081.38 元，实际分配收益 60,463,081.38 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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(2023)第 25802 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	浦银安盛日日鑫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鑫货币市场基金(以下简称“浦银安盛日日鑫基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(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鑫基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>

<p>形成审计意见的基础</p>	<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。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鑫基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>浦银安盛日日鑫基金的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估浦银安盛日日鑫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鑫基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督浦银安盛日日鑫基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对浦银安盛日日鑫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</p>

	<p>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鑫基金不能持续经营。</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	赵钰 沈俐
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2023 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛日日鑫货币市场基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	101,610,192.77	602,272,052.46
结算备付金		363,816.32	10,117,382.25
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	210,570,368.74	2,613,617,011.85
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		210,570,368.74	2,613,617,011.85
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	200,058,710.44	593,911,730.87
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-

应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	14,160,198.36
资产总计		512,603,088.27	3,834,078,375.79
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	319,999,320.00
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		239,835.41	795,206.16
应付托管费		59,958.86	198,801.56
应付销售服务费		21,461.90	48,979.96
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,353.34	51,856.21
应付利润		35,199.25	248,614.09
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	286,891.00	387,055.29
负债合计		648,699.76	321,729,833.27
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	511,954,388.51	3,512,348,542.52
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-	-
净资产合计		511,954,388.51	3,512,348,542.52
负债和净资产总计		512,603,088.27	3,834,078,375.79

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额为 511,954,388.51 份，其中浦银安盛日日鑫货币 A 类的基金份额为 44,274,398.28 份，浦银安盛日日鑫货币 B 类的基金份额为 467,679,990.23 份。

7.2 利润表

会计主体：浦银安盛日日鑫货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
一、营业总收入		73,102,489.01	243,904,474.50
1. 利息收入		29,238,828.60	241,802,922.52

其中：存款利息收入	7.4.7.13	6,874,182.27	36,463,796.24
债券利息收入		-	139,190,679.97
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		22,364,646.33	66,148,446.31
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		43,863,660.41	2,101,551.98
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	43,863,660.41	2,101,551.98
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		11,906,429.41	36,620,942.36
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,590,834.50	17,743,617.90
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,647,708.60	4,435,904.50
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	440,742.30	1,024,014.88
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,885,909.50	12,947,366.00
其中：卖出回购金融资产支出		2,885,909.50	12,947,366.00
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		14,026.05	81,494.43
8. 其他费用	7.4.7.23	327,208.46	388,544.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		61,196,059.60	207,283,532.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		61,196,059.60	207,283,532.14

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		61,196,059.60	207,283,532.14

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛日日鑫货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	3,512,348,542.52	-	-	3,512,348,542.52
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	3,512,348,542.52	-	-	3,512,348,542.52
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,000,394,154.01	-	-	-3,000,394,154.01
(一)、综合收益总额	-	-	61,196,059.60	61,196,059.60
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以	-3,000,394,154.01	-	-	-3,000,394,154.01

“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	11,262,115,372.43	-	-	11,262,115,372.43
2. 基金赎回款	-14,262,509,526.44	-	-	-14,262,509,526.44
(三)、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)	-	-	-61,196,059.60	-61,196,059.60
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	511,954,388.51	-	-	511,954,388.51
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	10,188,525,112.50	-	-	10,188,525,112.50
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值)	10,188,525,112.50	-	-	10,188,525,112.50
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“-” 号填列)	-6,676,176,569.98	-	-	-6,676,176,569.98
(一)、 综合收 益总额	-	-	207,283,532.14	207,283,532.14
(二)、 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)	-6,676,176,569.98	-	-	-6,676,176,569.98
其中:1. 基金申 购款	11,228,187,074.12	-	-	11,228,187,074.12
2 .基金 赎回 款	-17,904,363,644.10	-	-	-17,904,363,644.10
(三)、 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)	-	-	-207,283,532.14	-207,283,532.14
(四)、 其他综 合收益 结转留	-	-	-	-

存收益				
四、本期期末净资产(基金净值)	3,512,348,542.52	-	-	3,512,348,542.52

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

浦银安盛日日鑫货币市场基金(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[2016]1772 号《关于准予浦银安盛日日鑫货币市场基金注册的批复》准予注册,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《浦银安盛日日鑫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人民币 200,002,658.31 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(2016)第 1573 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《浦银安盛日日鑫货币市场基金基金合同》于 2016 年 11 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,006,658.43 份基金份额,其中认购资金利息折合 4,000.12 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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《浦银安盛日日鑫货币市场基金基金合同》和《浦银安盛日日鑫货币市场基金招募说明书》的规定,本基金根据销售服务费率和单个基金账户持有的基金份额数量的不同,将基金份额分为 A 类基金份额和 B 类基金份额。A 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%。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。本基金 A 类、B 类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额分别计算每万份基金净收益和七日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛日日鑫货币市场基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为:法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金;期限在

一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司于 2023 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《浦银安盛日日鑫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 2022 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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的金融资产主要为债务工具，是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，

分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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在初始确认时，以公允价值计量。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投资起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资或资产支持证券投资的账面价值中。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（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率每日计提应计利息，同时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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期

信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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投资收益。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用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。

以摊余成本计量的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，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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》、《企业会计准则第24号——套期会计》及《企业会计准则第37号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，财政部于2022年颁布了《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》(财会[2022]14号)，中国证监会于2022年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和应收利息，金额分别为 602,272,052.46 元、10,117,382.25 元、593,911,730.87 元和 14,160,198.36 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和其他资产-应收利息，金额分别为 603,400,646.26 元、10,122,390.44 元、594,369,974.36 元和 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 2,613,617,011.85 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 2,626,185,364.73 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付利润、应付交易费用、应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 319,999,320.00 元、795,206.16 元、198,801.56 元、48,979.96 元、248,614.09 元、84,043.96 元、22,087.81 元和 6,852.24 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付利润、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 320,021,407.81 元、795,206.16 元、198,801.56 元、48,979.96 元、248,614.09 元、84,043.96 元、0.00 元和 6,852.24 元。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	1,589,359.45	2,272,052.46
等于：本金	1,566,000.40	2,272,052.46
加：应计利息	23,359.05	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	100,020,833.32	600,000,000.00
等于：本金	100,000,000.00	600,000,000.00

加：应计利息	20,833.32	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	100,020,833.32	-
存款期限 3 个月以上	-	600,000,000.00
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	101,610,192.77	602,272,052.46

注：1、定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

2、本基金报告期内未提前支取部分定期存款，根据约定，原定期存款利率不变，提前支取未造成利息损失。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	210,570,368.74	210,686,087.67	115,718.93	0.0226
	合计	210,570,368.74	210,686,087.67	115,718.93	0.0226
资产支持证券		-	-	-	-
合计		210,570,368.74	210,686,087.67	115,718.93	0.0226
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	2,613,617,011.85	2,614,907,000.00	1,289,988.15	0.0367
	合计	2,613,617,011.85	2,614,907,000.00	1,289,988.15	0.0367
资产支持证券		-	-	-	-
合计		2,613,617,011.85	2,614,907,000.00	1,289,988.15	0.0367

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

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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 2022 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	200,058,710.44	-
合计	200,058,710.44	-
项目	上年度末 2021 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	593,911,730.87	-
合计	593,911,730.87	-

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。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期末未按预期信用损失一般模型计提减值准备。

7.4.7.5 债权投资**7.4.7.5.1 债权投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内未计提债权投资减值准备。

7.4.7.6 其他债权投资**7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内未计提其他债权投资减值准备。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	14,160,198.36
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	14,160,198.36

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	49,800.46	84,043.96
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	49,800.46	84,043.96
应付利息	-	22,087.81
手续费	5,790.54	6,852.24
预提费用	231,300.00	274,071.28
合计	286,891.00	387,055.29

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

浦银日日鑫 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,330,322.52	48,330,322.52
本期申购	169,324,602.37	169,324,602.37
本期赎回（以“-”号填列）	-173,380,526.61	-173,380,526.61
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	44,274,398.28	44,274,398.28
-----	---------------	---------------

浦银日日鑫 B

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	3,464,018,220.00	3,464,018,220.00
本期申购	11,092,790,770.06	11,092,790,770.06
本期赎回 (以“-”号填列)	-14,089,128,999.83	-14,089,128,999.83
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	467,679,990.23	467,679,990.23

注：申购含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。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期内无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

浦银日日鑫 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	732,978.22	-	732,978.22
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	-732,978.22	-	-732,978.22
本期末	-	-	-

浦银日日鑫 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	60,463,081.38	-	60,463,081.38
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	-60,463,081.38	-	-60,463,081.38
本期末	-	-	-

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	84,667.68	66,709.73
定期存款利息收入	6,769,797.38	36,253,388.71
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	19,717.21	143,697.80
其他	-	-
合计	6,874,182.27	36,463,796.24

7.4.7.14 股票投资收益

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。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	42,879,133.84	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	984,526.57	2,101,551.98
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	43,863,660.41	2,101,551.98

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	16,067,544,887.72	33,868,755,660.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	16,015,284,308.51	33,764,564,905.29
减：应计利息总额	51,276,052.64	102,089,202.73
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	984,526.57	2,101,551.98

7.4.7.15.3 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。

7.4.7.15.4 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。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

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-买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——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资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——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资产支持证券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 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。

7.4.7.17.2 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。

7.4.7.17.3 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。

7.4.7.17.4 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。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 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。

7.4.7.18.2 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。

7.4.7.19 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。

7.4.7.20 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。

7.4.7.21 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。

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	102,000.00	145,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	37,428.72	37,271.28
其他	67,779.74	86,273.37
合计	327,208.46	388,544.65

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、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
法国安盛投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海国盛集团资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海浦银安盛资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,590,834.50	17,743,617.90
其中：支付销售机构的客户维护费	519,076.22	1,048,932.57

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 0.20%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 × 0.20% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,647,708.60	4,435,904.50

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

7.4.10.2.3 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 2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浦银日日鑫 A	浦银日日鑫 B	合计
兴业银行股份有限公司	0.00	5,373.55	5,373.55

上海浦东发展银行股份有限公司	8,890.65	1,770.49	10,661.14
浦银安盛基金管理有限公司	31,324.93	237,302.55	268,627.48
合计	40,215.58	244,446.59	284,662.17
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浦银日日鑫 A	浦银日日鑫 B	合计
兴业银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
上海浦东发展银行股份有限公司	7,093.97	2,825.09	9,919.06
浦银安盛基金管理有限公司	50,952.66	698,310.79	749,263.45
合计	58,046.63	701,135.88	759,182.51

注：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自然日起适用 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自然日起享受 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：

日 A 类基金份额销售服务费 = 前一日 A 类基金资产净值 × 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 × 0.01 % / 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
	浦银日日鑫 A	浦银日日鑫 B
基金合同生效日（2016 年 11 月 30 日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
	浦银日日鑫 A	浦银日日鑫 B
基金合同生效日（2016 年 11 月 30 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	0.00
报告期间申购/买入总份额	-	100,663,854.03
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	100,663,854.03
报告期末持有的基金份额	-	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.00%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投、分级份额调增份额和转换入份额，期间赎回/卖出总份额含分级份额调减份额和转换出份额。

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。

7.4.10.5.2 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

份额单位：份

份额单位：份

浦银日日鑫 B

关联方名称	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021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 (%)
兴业银行 股份有限 公司	222,620,441.30	47.60	-	-

注：1、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鑫 A。

2、除基金管理人之外的其他关联方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。

7.4.10.6 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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
上海浦东发展银行——定期存款	-	1,965,416.68	300,000,000.00	3,371,777.76
兴业银行——定期存款	100,000,000.00	20,833.32	-	8,134,000.00
兴业银行——活期存款	1,589,359.45	84,667.74	2,272,052.46	66,709.73

注：本基金的活期银行存款和部分定期存款由基金托管人兴业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。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

1、2021年12月28日上海浦东发展银行协定存款一笔，金额30,000.00万元，到期日2022年3月31日。

2、2022年12月29日兴业银行协定存款一笔，金额10,000.00万元，到期日2023年3月28日。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

浦银日日鑫 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
733,307.70	-	-329.48	732,978.22	-
浦银日日鑫 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
60,676,166.74	-	-213,085.36	60,463,081.38	-

注：本基金在本年度累计分配收益 61,196,059.60 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 61,409,474.44 元，计入应付收益科目-213,414.84 元。

7.4.12 期末（2022 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：本基金本报告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

注：本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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；期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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存放在本基金的托管兴业银行，其余定期存款存放在具有基金托管资格的上海浦东发展银行、华夏银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、南京银行股份有

限公司以及上海银行股份有限公司，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。本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。且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资产的 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	50,472,570.70	819,574,952.59
合计	50,472,570.70	819,574,952.59

注：未评级部分为国债、政策性金融债、短期融资券。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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	139,570,360.29	1,724,017,743.01
合计	139,570,360.29	1,724,017,743.01

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
--------	-------------------------	--------------------------

AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	20,527,437.75	70,024,316.25
合计	20,527,437.75	70,024,316.25

注：未评级部分为国债、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 2022 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部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(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即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 2022 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 92.85%，本基金投资组合的平均剩余期限为 49 天，平均剩余存续期为 49 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%。

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未来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 2022年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款		-101,610,192.77	-	-	101,610,192.77
结算备付金		363,816.32	-	-	363,816.32
交易性金融资产		-210,570,368.74	-	-	210,570,368.74
买入返售金融资产		-200,058,710.44	-	-	200,058,710.44
资产总计		-512,603,088.27	-	-	512,603,088.27
负债					
应付管理人报酬		-	-	239,835.41	239,835.41
应付托管费		-	-	59,958.86	59,958.86
应付销售服务费		-	-	21,461.90	21,461.90
应付利润		-	-	35,199.25	35,199.25
应交税费		-	-	5,353.34	5,353.34
其他负债		-	-	286,891.00	286,891.00
负债总计		-	-	648,699.76	648,699.76
利率敏感度缺口		-512,603,088.27	-	-648,699.76	511,954,388.51
上年度末 2021年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款		-602,272,052.46	-	-	602,272,052.46
结算备付金		10,117,382.25	-	-	10,117,382.25
交易性金融资产		2,613,617,011.85	-	-	2,613,617,011.85
买入返售金融资产		-593,911,730.87	-	-	593,911,730.87
其他资产		-	-	14,160,198.36	14,160,198.36
资产总计		3,819,918,177.43	-	14,160,198.36	3,834,078,375.79
负债					
应付管理人报酬		-	-	795,206.16	795,206.16
应付托管费		-	-	198,801.56	198,801.56
卖出回购金融资产款		-319,999,320.00	-	-	319,999,320.00
应付销售服务费		-	-	48,979.96	48,979.96
应付利润		-	-	248,614.09	248,614.09
应交税费		-	-	51,856.21	51,856.21
其他负债		-	-	387,055.29	387,055.29

负债总计	-319,999,320.00	-	1,730,513.27	321,729,833.27
利率敏感度缺口	3,499,918,857.43	-	12,429,685.09	3,512,348,542.52

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		
	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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升 25 基点	-104,763.33	-846,675.28
	市场利率下降 25 基点	104,898.58	847,537.73

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 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	210,570,368.74	2,613,617,011.85
第三层次	-	-
合计	210,570,368.74	2,613,617,011.85

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有第三层次以公允价值计量的金融工具（2021 年 12 月 31 日：同）。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金无使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况（2021 年 12 月 31 日：同）。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 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（2021 年 12 月 31 日：同）。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	210,570,368.74	41.08
	其中：债券	210,570,368.74	41.08
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	200,058,710.44	39.03
	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	101,974,009.09	19.89
4	其他各项资产	-	-
5	合计	512,603,088.27	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	4.21	
	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	-	-
	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

注：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。

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	49
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	59
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

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	39.44	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	27.26	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	23.45	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	9.75	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	99.90	-

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本货币基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	71,000,008.45	13.87
	其中：政策性 金融债	71,000,008.45	13.87
4	企业债券	-	-
5	企业短期融 资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	139,570,360.29	27.26
8	其他	-	-
9	合计	210,570,368.74	41.13
10	剩余存续期 超过 397 天的 浮动利率债 券	-	-

8.6 期末按实际利率计算账面价值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）	按实际利率计 算的账面价值 （元）	占基金资产净值比例（%）
1	220206	22 国开 06	500,000	50,472,570.70	9.86
2	112217014	22 光大银行	500,000	49,865,982.82	9.74

		CD014			
3	112211025	22 平安银行 CD025	500,000	49,826,262.35	9.73
4	112218025	22 华夏银行 CD025	400,000	39,878,115.12	7.79
5	210312	21 进出 12	200,000	20,527,437.75	4.01

8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0
报告期内偏离度的最高值	0.2006%
报告期内偏离度的最低值	-0.0272%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0271%

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 期末按实际利率计算账面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。

8.9 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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚；平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚；华夏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。本基金投资的前十名证券中，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.3 期末其他各项资产构成

注：本基金本报告期末未持有其他各项资产。

§ 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 (%)
浦银日日鑫 A	3,119	14,195.06	28,446,938.06	64.25	15,827,460.22	35.75
浦银日日鑫 B	8	58,459,998.78	467,679,990.23	100.00	0.00	0.00
合计	3,127	163,720.62	496,126,928.29	96.91	15,827,460.22	3.09

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	222,620,441.30	43.48
2	银行类机构	200,608,522.20	39.18
3	基金类机构	11,165,730.69	2.18
4	信托类机构	10,126,425.39	1.98
5	券商类机构	7,015,049.84	1.37
6	信托类机构	6,016,253.03	1.18
7	其他机构	5,082,307.44	0.99
8	券商类机构	5,013,026.51	0.98
9	基金类机构	4,167,665.53	0.81
10	信托类机构	3,456,487.31	0.68

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	浦银日日鑫 A	55,058.03	0.12
	浦银日日鑫 B	-	-
	合计	55,058.03	0.01

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	浦银日日鑫 A	0~10

金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	浦银日日鑫 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	浦银日日鑫 A	0
	浦银日日鑫 B	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银日日鑫 A	浦银日日鑫 B
基金合同生效日 (2016 年 11 月 30 日) 基金份额总额	2,658.43	200,004,000.00
本报告期期初基金份额总额	48,330,322.52	3,464,018,220.00
本报告期基金总申购份额	169,324,602.37	11,092,790,770.06
减：本报告期基金总赎回份额	173,380,526.61	14,089,128,999.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	44,274,398.28	467,679,990.23

注：总申购份额含红利再投、分级份额调增份额和转换入份额，总赎回份额含分级份额调减份额和转换出份额。

§ 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，本基金管理人重大人事变动如下：

2022 年 2 月 19 日，本基金管理人发布了《浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》，经本基金管理人董事会审议通过，聘任陈阳先生担任本基金管理人副总经理。

报告期内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 102,000.00 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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人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。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国盛证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

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国盛证券交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国盛证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	1,523,020,000.00	100.00	-	-

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	浦银安盛日日鑫货币市场基金 2021 年第 4 季度报告	规定网站	2022 年 1 月 24 日
2	关于浦银安盛日日鑫货币市场基金于 2022 年春节假期前暂停 A 类及 B 类份额的申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及规定网站	2022 年 1 月 26 日
3	关于浦银安盛日日鑫货币市场基金于 2022 年清明假期前暂停 A 类及 B 类份额的申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及规定网站	2022 年 3 月 30 日
4	浦银安盛日日鑫货币市场基金 2021 年年度报告	规定网站	2022 年 3 月 31 日
5	浦银安盛日日鑫货币市场基金 2022 年第 1 季度报告	规定网站	2022 年 4 月 22 日

6	关于浦银安盛日日鑫货币市场基金于2022年劳动节假期前暂停A类及B类份额的申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及规定网站	2022年4月27日
7	关于浦银安盛日日鑫货币市场基金新增上海万得基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务的公告	报刊及规定网站	2022年5月12日
8	关于浦银安盛日日鑫货币市场基金于2022年端午节假期前暂停A类及B类份额的申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及规定网站	2022年5月31日
9	关于浦银安盛日日鑫货币市场基金调整在非直销销售机构大额申购、转换转入及定期定额投资限制的公告	报刊及规定网站	2022年6月16日
10	浦银安盛日日鑫货币市场基金招募说明书(更新)2022年第1号	规定网站	2022年7月13日
11	浦银安盛日日鑫货币市场基金基金产品资料概要更新	规定网站	2022年7月13日
12	关于浦银安盛日日鑫货币市场基金新增光大证券为代销机构并开通基金定投业务、参加其费率优惠活动的公告	报刊及规定网站	2022年7月18日
13	浦银安盛日日鑫货币市场基金2022年第2季度报告	规定网站	2022年7月21日
14	关于旗下部分基金新增东吴证券为代销机构并开通基金定投业务、参加其费率优惠活动的公告	报刊及规定网站	2022年7月22日
15	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金在嘉实财富管理有限公司开通基金定投、参加其费率优惠活动的公告	报刊及规定网站	2022年7月30日
16	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增五矿证券为代销机构并开通基金定投业务、参加其费率优惠活动的公告	报刊及规定网站	2022年8月10日
17	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大连银行为代销机构并开通基金定投业务、参加其费率优惠活动的公告	报刊及规定网站	2022年8月12日
18	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金在兴业银行银银平台新增代销并参加其费率优惠活动的公告	报刊及规定网站	2022年8月24日
19	浦银安盛日日鑫货币市场基金2022年中期报告	规定网站	2022年8月31日
20	关于浦银安盛日日鑫货币市场基金于	报刊及规定网站	2022年9月7日

	2022 年中秋节假期前暂停 A 类及 B 类份额的申购、定投及转换转入业务的公告		
21	关于浦银安盛日日鑫货币市场基金于 2022 年国庆节假期前暂停 A 类及 B 类份额的申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及规定网站	2022 年 9 月 28 日
22	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增泰信财富基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务、参加其费率优惠活动的公告	报刊及规定网站	2022 年 10 月 20 日
23	浦银安盛日日鑫货币市场基金 2022 年第 3 季度报告	规定网站	2022 年 10 月 26 日
24	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海通证券为代销机构并开通基金定投业务、参加其费率优惠活动的公告	报刊及规定网站	2022 年 11 月 4 日
25	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华泰证券为代销机构并开通基金定投业务、参加其费率优惠活动的公告	报刊及规定网站	2022 年 11 月 8 日
26	关于浦银安盛日日鑫货币市场基金于 2023 年元旦节假期前暂停 A 类及 B 类份额的申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及规定网站	2022 年 12 月 28 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	20220101-20220126, 20220317-20220320	1,040,802,476.29	305,395,115.78	1,346,197,592.07	0.00	0.00
	2	20220101-20220119, 20220124-20220125, 20220321-20220927	921,127,998.50	12,685,592.56	933,813,591.06	0.00	0.00
	3	20220328-20220411, 202209	515,423,611.55	208,519,855.36	723,943,466.91	0.00	0.00

		01-20221011, 20221129-202 21206					
4		20220921-202 20926, 202210 12	0.00	771,316, 731.28	771,316,7 31.28	0.00	0.00
5		20221011	0.00	200,148, 889.92	200,148,8 89.92	0.00	0.00
6		20221011, 202 21129-202212 06, 20221228- 20221231	13,157.20	401,153, 341.07	200,557,9 76.07	200,608,522.2 0	39.18
7		20221207-202 21231	0.00	922,620, 441.30	700,000,0 00.00	222,620,441.3 0	43.48
产品特有风险							
<p>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。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、 中国证监会批准浦银安盛日日鑫货币市场基金募集的文件
- 2、 浦银安盛日日鑫货币市场基金基金合同
- 3、 浦银安盛日日鑫货币市场基金招募说明书
- 4、 浦银安盛日日鑫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规定媒介上披露的各项公告
- 8、 中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层 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）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

2023 年 3 月 31 日