浦银安盛货币市场证券投资基金

2014 半年度报告摘要

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
送出日期:2014年8月26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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月22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。
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文 。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	浦银安盛货币	
基金主代码	519509	
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	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	640,376,658.86份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B
下属分级基金的交易代码	519509	519510
报告期末下属分级基金的份额总额	197,618,551.03	442,758,107.83

2.2 基金产品说明

投资目标	力求在保持基金资产安全性和良好流动性的基础上,获得超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	根据对短期利率变动的预测,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略,利用基本分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保证流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浦银安盛基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	朱义明
	联系电话	021-23212888	010-65556899
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	zhuyiming@cnicib.com.cn
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95558
传真		021-23212985	010-65550832

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2014年1月1日-2014年6月30日)	
	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B
本期已实现收益	8,744,134.71	16,237,840.41
本期利润	8,744,134.71	16,237,840.4100
本期净值收益率	2.5400%	2.6600%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末基金资产净值	197,618,551.03	442,758,107.83
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。
2、本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。
3、本基金收益分配按月结转份额。

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

(1)浦银安盛货币A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

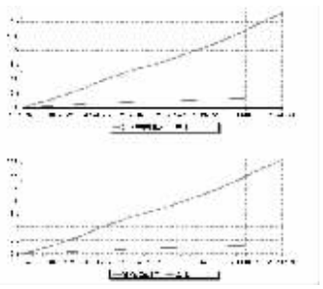
阶段(A级)	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.4434%	0.0177%	0.0288%	0%	0.4146%	0.0177%
过去三个月	1.2172%	0.0112%	0.0873%	0%	1.1299%	0.0112%
过去六个月	2.5408%	0.0089%	0.1737%	0%	2.3671%	0.0089%
过去一年	4.9451%	0.0066%	0.3506%	0%	4.5945%	0.0066%
过去三年	13.7294%	0.0062%	1.3278%	0.0002%	12.4016%	0.006%
自基金合同生效日起至今	13.9041%	0.0063%	1.3533%	0.0002%	12.5508%	0.0061%

(2)浦银安盛货币B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

阶段(B级)	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
过去一个月	0.4634%	0.0177%	0.0288%	0.0000%	0.4346%	0.0177%
过去三个月	1.2779%	0.0112%	0.0873%	0.0000%	1.1906%	0.0112%
过去六个月	2.6629%	0.0089%	0.1737%	0.0000%	2.4892%	0.0089%
过去一年	5.1961%	0.0066%	0.3506%	0.0000%	4.8455%	0.0066%
过去三年	14.6183%	0.0062%	1.3278%	0.0002%	13.2905%	0.0060%
自基金合同生效日起至今	14.8120%	0.0063%	1.3533%	0.0002%	13.4587%	0.0061%

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

浦银安盛货币市场证券投资基金
份额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-2014年6月30日)



§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,由上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A. 及上海盛融投资有限公司共同创建,公司总部设在上海,注册资本为人民币2.8亿元,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、资产管理和证监会许可的其他业务。

截至2014年6月30日止,浦银安盛旗下共管理16只基金,即浦银安盛价值成长股票型证券投资基金、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、浦银安盛红利精选股票型证券投资基金、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、浦银安盛增利分级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和浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金。

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统,这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成,之后日常的维护管理由公司负责,但与第三方服务公司签订有技术服务合同,由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户子系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统等。这些系统也主要是在公司筹建之初采购专业系统提供商的产品建设而成,建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级,升级由系统提供商负责完成,升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。业务应用系统日常的维护管理由公司负责,但与系统提供商签订有技术服务合同,由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外,我公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

另外,本公司可以根据自身发展战略的需要,委托资质良好的基金服务机构代为办理基金份额登记、估值核算等业务。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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年1月7日	-	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年6月19日	-	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。
丁进	本公司旗下固定收益基金基金经理助理	2012年8月15日	-	9	丁进先生,北京化工大学应用数学专业理学硕士。2005年7月至2010年10月期间,先后在北京顺泽锋投资咨询公司、新华信国际信息咨询公司从事交易模型开发研究、企业信用分析等工作,2010年10月起,在光大证券担任固定收益分析师,从事债券研究、信用产品以及可转债研究。2012年8月加盟浦银安盛基金公司,担任固定收益基金基金经理助理。
蒋文玲	本基金前任基金经理	2012年11月30日	2014年1月6日	8	蒋文玲女士,上海财经大学数量经济学硕士。2006年5月至2009年9月,在汇添富基金管理有限公司任债券交易员。2009年10月至2012年10月,在汇添富基金管理有限公司从事债券风控研究员工作并兼任交易员。2012年10月加盟浦银安盛基金管理有限公司固定收益投资部工作。2012年11月30日至2014年1月6日,担任本基金基金经理。

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 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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已制定了《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和规定,以保证投资执行交易过程的公平性;从事后监控角度上,一方面是定期对股票交易情况进行分析,对不同时间窗口(同日、3日、5日)发生的不同组合对同一股票的同向交易及反向交易进行价差分析,并进行统计显著性的检验,以确定交易价差对相关基金的业绩差异的贡献度;同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异的分析;另一方面是公司对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查,并对发现的问题进行及时的报告。

4.3.2 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 管理人对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

上半年的宏观经济走势可以概括为6个字,即“微刺激,弱复苏”。在经历了多重刺激之后,二季度经济有所反弹,各类经济数据较为亮眼,但短期内仍难言企稳。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,市场出现调整,但预计债券市场行情仍将持续,后期仍有下行空间,但过程可能有所波折。在报告期内,基金年初提高短期融资券的配置比例,借力较为宽松的资金面,获取稳定的息差,并受益于上半年债券收益率整体下行获取资本利得。同时,基金结合市场利率波动情况,配置了部分期限较长、收益较高的同业存款,以取得较高收益。

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2.5408%,B类净值收益率为2.6629%,同期业绩比较基准收益率为0.1737%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前经济的核心问题在于房地产,我们认为房地产仍未见底,房地产的进一步调整将使下半年经济下行压力明显。我们预计接下来仍将陆续会有政策出台,政策放松的力度仍有加大的可能。总的来说,下半年的GDP仍将处在走廊之中,预计走势会相对稳定。稳中偏弱的宏观经济和相对低位的资金利率将有助于下半年债券市场行情的开展。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益,设立了浦银安盛基金管理有限公司估值委员会(以下简称“估值委员会”),制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由公司分管高管、金融工程部负责人、研究部负责人、合规风控部负责人、基金运营部负责人组成。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签订了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书等有关约定,本基金的收益分配采用“每日分配、按月支付”的方式,即为投资者每日计算当日收益并分配,每月支付。

本报告期浦银货币A级基金应分配收益8,744,134.71元,实际分配收益8,744,134.71元;浦银货币B级基金应分配收益16,237,840.41元,实际分配收益16,237,840.41元。

§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

本报告期内,本基金托管人在对浦银安盛货币市场基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,浦银安盛货币市场基金的管理人——浦银安盛基金管理有限公司在浦银安盛货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上,严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对浦银安盛基金管理有限公司编制和披露的浦银安盛货币市场基金2014年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:浦银安盛货币市场证券投资基金
报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:			
银行存款		189,035,070.34	728,599,138.71
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		590,163,236.75	209,502,768.75
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		590,163,236.75	209,502,768.75
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	119,300,598.95
应收证券清算款		30,052,875.62	-
应收利息		11,417,223.38	6,717,534.00
应收股利		-	-
应收申购款		4,422,992.41	36,614,243.90
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		825,091,398.50	1,100,734,284.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		182,423,388.79	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		6,532.28	-
应付管理人报酬		339,058.38	273,576.38
应付托管费		102,744.96	82,901.94
应付销售服务费		65,661.90	120,680.18
应付交易费用		30,769.26	15,926.91
应交税费		-	-
应付利息		17,295.09	-
应付利润		1,636,034.78	1,464,427.30
递延所得税负债		-	-
其他负债		93,254.20	161,000.00
负债合计		184,714,739.64	2,118,512.71
所有者权益:			
实收基金		640,376,658.86	1,098,615,771.60
未分配利润		-	-
所有者权益合计		640,376,658.86	1,098,615,771.60
负债和所有者权益总计		825,091,398.50	1,100,734,284.31

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.000元,基金份额总额640,376,658.86份。其中浦银货币A级的基金份额为197,618,551.03份,浦银货币B级的基金份额为442,758,107.83份。

6.2 利润表

会计主体:浦银安盛货币市场证券投资基金
本报告期:2014年1月1日-2014年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期2014年1月1日-2014年6月30日	上年度可比期间2013年01月01日-2013年06月30日
一、收入		28,336,377.93	13,721,245.33
1.利息收入		24,357,195.64	11,729,793.33
其中:存款利息收入		10,251,335.69	6,216,751.14
债券利息收入		13,668,170.87	4,261,893.37
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		437,689.08	1,251,148.82
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		3,979,182.29	1,991,452.00
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		3,979,182.29	1,991,452.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		-	-
减:二、费用		3,354,402.81	2,300,894.35
1.管理人报酬		1,669,921.58	1,019,618.74
2.托管费		506,036.83	308,975.21
3.销售服务费		475,508.75	230,657.45
4.交易费用		-	-
5.利息支出		578,881.06	619,223.05
其中:卖出回购金融资产支出		578,881.06	619,223.05
6.其他费用		124,054.59	122,419.90
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		24,981,975.12	11,420,350.98
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		24,981,975.12	11,420,350.98

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:浦银安盛货币市场证券投资基金
本报告期:2014年1月1日-2014年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2014年1月1日-2014年6月30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)	1,098,615,771.60	-	1,098,615,771.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	24,981,975.12	24,981,975.12
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)	-458,239,112.74	-	-458,239,112.74
其中:1.基金申购款	4,616,505,187.12	-	4,616,505,187.12
2.基金赎回款	-5,074,744,299.86	-	-5,074,744,299.86
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)	-	-24,981,975.12	-24,981,975.12
五、期末所有者权益(基金净值)	640,376,658.86	-	640,376,658.86
项 目	上年度可比期间 2013年01月01日-2013年06月30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)	1,144,600,282.66	-	1,144,600,282.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,420,350.98	11,420,350.98
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)	-656,922,948.05	-	-656,922,948.05
其中:1.基金申购款	2,288,503,865.50	-	2,288,503,865.50
2.基金赎回款	-2,945,426,813.55	-	-2,945,426,813.55
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-11,420,350.98	-11,420,350.98
五、期末所有者权益(基金净值)	487,677,334.61	-	487,677,334.61

报表附注为财务报表的组成部分。
本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

项 目	郁蓓华	钱琨
	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

浦银安盛货币市场证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]1479号文批准,由浦银安盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《浦银安盛货币市场投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集3,773,820,436.52元(其中A类份额净认购金额为2,574,133,436.52元,B类份额净认购金额为1,199,687,000.00元),已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(2011)第073号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《浦银安盛货币市场投资基金基金合同》于2011年3月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,774,407,616.02份(其中A类份额为2,574,555,555.18份,B类份额为1,199,852,060.84份),其中认购资金利息折合587,179.50份基金份额(其中A类份额产生的利息为422,118.66份,B类份额产生的利息为165,060.84份)。本基金的基金管理人为浦银安盛基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛货币市场投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于法律法规允许投资的金融工具,具体如下:1.现金;2.通知存款;3.短期融资券;4.一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;5.期限在一年以内(含一年)的债券回购;6.期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;7.剩余期限在397天以内(含397天)的债券;8.剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券;9.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货币市场基金投资的其他产品,基金管理人在履行适当的程序后,可以将其纳入投资范围。本基金业绩比较基准为银行活期存款利率(税后)。

6.4.2 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日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年1月1日至2014年6月30日期间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2014年6月30日的财务状况以及2014年1月1日至2014年6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错。

6.4.6 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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。2013年1月1日以前,对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。自2013年1月1日起,对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
浦银安盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金代销机构
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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期与上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期2014年1月1日-2014年6月30日	上年度可比期间2013年01月01日-2013年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,669,921.58	1,019,618.74
其中:应支付销售机构的客户维护费	616,752.33	252,252.26

注:支付基金管理人浦银安盛基金管理有限公司的基金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:
日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.33% / 当年天数

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期2014年1月1日-2014年6月30日	上年度可比期间2013年01月01日-2013年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	506,036.83	308,975.21

注:支付基金托管人中信银行股份有限公司的基金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:
日基金托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014年1月1日-2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B	合计
中信银行股份有限公司	235,534.48	2,626.81	238,161.29
上海浦东发展银行股份有限公司	45,403.42	1,097.00	46,500.42
浦银安盛基金管理有限公司	15,023.70	14,013.97	29,037.67
合计	295,961.60	17,737.78	313,699.38
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2013年01月01日-2013年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B	合计
中信银行股份有限公司	21,335.02	67.60	21,402.62
上海浦东发展银行股份有限公司	65,213.12	1,821.14	67,034.26
浦银安盛基金管理有限公司	3,127.17	16,702.97	19,830.14
合计	89,675.31	18,591.71	108,267.02

注:浦银货币A级基金份额的销售服务费按前一日该级基金资产净值0.25%的年费率计提;浦银货币B级基金份额的销售服务费按前一日该级基金资产净值0.01%的年费率计提;各级基金份额的销售服务费逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日销售服务费=前一日该级基金份额的基金资产净值 X R / 当年天数
其中:R为该级基金份额的年销售服务费率。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期2014年1月1日-2014年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中信银行	29,974,890.00	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2013年01月01日-2013年06月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中信银行	10,001,413.70	-	-	-	-	-

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

浦银安盛货币A
基金管理人在本报告期与上年度可比期间均未持有浦银安盛货币A。
浦银安盛货币B
基金管理人在本报告期与上年度可比期间均未持有浦银安盛货币B。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称		本期末 2014年6月30日		上年度末 2013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
B类	上海浦银安盛资产管理有限公司	14127601.18	3.19%	0	0.00%

注:浦银安盛货币A
除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有浦银安盛货币A。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期2014年1月1日-2014年6月30日		上年度可比期间2013年01月01日-2013年06月30日	
	期末余额	当期存款利息收入	期末余额	当期存款利息收入
中信银行-活期	1,035,070.34	36,129.95	920,745.32	128,964.69
中信银行-定期	-	243,200.00	100,000,000.00	701,976.41

注:本基金的活期银行存款及部分定期银行存款由基金托管人中信银行保管,按约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期与上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/