浦银安盛日日鑫货币市场基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
送出日期:2018年8月27日

§1 重要提示

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2018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2018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	浦银安盛日日鑫	
基金主代码	003228	
交易代码	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	23,389,386,797.92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	3,993,170.40份	23,385,393,627.52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	(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,在满足基金日身流动性、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。
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	顾佳	张志永
	联系电话	021-23212888	021-52629999-212004
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95561
传真		021-23212985	021-62159217

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

基金级别	浦银日日鑫A	浦银日日鑫B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	66,451.49	507,356,578.58
本期利润	66,451.49	507,356,578.58
本期净值收益率	1.9979%	2.1197%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末基金资产净值	3,993,170.40	23,385,393,627.52
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

金额单位:人民币元

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

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

3、本基金收益分配按日结转份额。

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

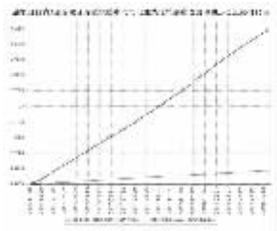
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3138%	0.0008%	0.0288%	0.0000%	0.2850%	0.0008%
过去三个月	0.9276%	0.0007%	0.0873%	0.0000%	0.8403%	0.0007%
过去六个月	1.9979%	0.0012%	0.1737%	0.0000%	1.8242%	0.0012%
过去一年	4.0678%	0.0013%	0.3506%	0.0000%	3.7172%	0.0013%
自基金合同生效起至今	6.2092%	0.0017%	0.5557%	0.0000%	5.6535%	0.0017%

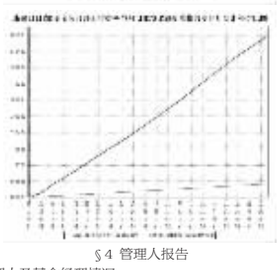
浦银日日鑫B

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
过去一个月	0.3341%	0.0008%	0.0288%	0.0000%	0.3053%	0.0008%
过去三个月	0.9886%	0.0007%	0.0873%	0.0000%	0.9013%	0.0007%
过去六个月	2.1197%	0.0012%	0.1737%	0.0000%	1.9460%	0.0012%
过去一年	4.3182%	0.0012%	0.3506%	0.0000%	3.9676%	0.0012%
自基金合同生效起至今	6.5988%	0.0018%	0.5557%	0.0000%	6.0431%	0.0018%

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





§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浦银安盛基金管理有限公司(以下简称“浦银安盛”)成立于2007年8月,股东为上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A. 及上海国盛集团资产有限公司,公司总部设在上海,注册资本为人民币19.1亿元,股东持股比例分别为51%、39%和10%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理、境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务。

截至2018年6月30日止,浦银安盛旗下共管理36只基金,即浦银安盛价值成长混合型证券投资基金、浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛红利精选混合型证券投资基金、浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金、浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金、浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛日日盈货币市场基金、浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金、浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金、浦银安盛幸福聚益18个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金、浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金、浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金、浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)、浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安久回报定期开放混合型证券投资基金。

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

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

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钟明	公司旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金、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基金经理。	2017年11月1日	-	13	钟明女士,复旦大学MBA。2005年至2017年就职于兴全基金管理有限公司,先后从事基金会计岗位、债券交易员岗位、基金经理助理岗位和基金经理岗位。2017年5月加盟浦银安盛基金管理有限公司,担任固定收益投资部副总监之职。2017年11月1日起,担任公司旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金、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基金经理。
王茂青	货币类基金经理助理	2018年1月22日	-	8	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。
赓素君	货币类基金经理助理	2017年11月28日	-	6	赓素君女士,华中科技大学金融学硕士。2012年3月至2017年11月先后就职于第一创业证券股份有限公司和郑州银行金融市场部北京中心,分别从事糖核与风险管理和投资交易等工作。2017年11月28日加盟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、本基金基金经理的任职日期为公司决定的聘任日期。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人根据《公平交易管理规定》,建立健全有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个投资组合。

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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年债券市场面临的国内外经济环境较2017年更加复杂。国内来看,随着供给侧改革、环保限产、国企去杠杆的深入推进、加之3月由美国挑起的中美贸易摩擦等因素影响,使得前期由供给侧改革缓慢积累起的经济韧性开始减弱,给长端利率的下行提供了基本面支持;与此同时,在紧信用的环境下,随着金融监管各项配套制度逐项落地,商业银行的信贷投放和投资偏好倾向于高评级企业,中小企业融资需求被严重挤压,进而对实体经济增长形成拖累。国外来看,美国发起的中美贸易摩擦持续发酵,对中国贸易顺差和汇率将产生长期负面影响,进一步降低出口对经济的拉动。汇总来看,国内经济增速承压明显,融资渠道和政紧和信用环境的恶化,进一步影响投资支出,未来下行压力仍明显。

在上述因素影响下,货币政策在坚持稳健中性的原则下,逐步增大边际宽松力度,采取1次定向降准置换MLF、1次普降准备金、扩充MLF抵质押品范畴等多项措施增加市场流动性,期望定向引导资金用途支持实体。但商业银行作为理性投资人,在信贷投放和债券投资的主体选择上有严格的准入和筛选标准,信用环境的恶化使得信贷投放力度放缓,进而致使银行间市场短期集聚大量流动性,利率债、高等级信用债和货币市场各资产收益率大幅下行,且短端利率下行幅度远大于中长端。具体来看10Y国开下行57BP至4.25%、1Y国债下行100BP至3.68%、3M同业存单下行150BP至3.8%,且有继续下行的趋势。

本报告期内,货币基金以流动性安全为首要前提,一季度主要增加对处于历史高分位数的利率债和同业存单等品种的配置,同时根据资金面的短时波动增加逆回购资产比例以提高收益。二季度在定向降准市场收益整体下行时尽量控制久期,在银行填补跨季负债缺口时,择时增加同业存单投资额度,在满足半年底流动性需求的同时拉长久期锁定收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期浦银日日鑫A的基金份额净值收益率为1.9979%,本报告期浦银日日鑫B的基金份额净值收益率为2.1197%,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

后期基本面仍支持收益率下行,但预期基本已体现在价格中,三季度利率债和地方政府债供给增大、非标缓解对于利率债的分流、交易盘退出等因素将扰动利率走势,长端利率或震荡下行但空间有限;短端利率债仍受资金面波动影响,静待央行引导信贷投放的效果,短端利率波动会增大。资金面短期来看,虽然理财征求意见稿明显放松,但机构改变投资偏好仍谨慎,资金仍聚集在银行间市场,表现为货币市场各期限利率继续下行,R007继续处于历史较低水平,银行负债端压力小因而各期限NCD价格继续回落等。后续随着央行疏导资金投放效果显现,银行间流动性边际有收紧可能。

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、风险管理部负责人、产品估值部和注册登记部负责人组成。估值委员会成员均具有5年以上专业工作经历,具备良好的专业经验、胜任能力和独立性。估值委员会的职责主要包括:保证基金估值的公平、合理;制订健全、有效的估值政策和程序;确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性;定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金基金经理未参与或决定基金的估值。

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司以及中债金融估值中心有限公司签订了《中债信息产品服务三方协议》。

本基金管理人与中证指数有限公司签订了《债券估值数据服务协议》。

4.7 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66,451.49元,实际分配收益66,451.49元;浦银安盛日日鑫货币B级基金应分配收益507,356,578.58元,实际分配收益507,356,578.58元。

4.8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:浦银安盛日日鑫货币市场基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款		8,437,165,743.52	7,664,727,207.24
结算备付金		32,347,727.28	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		8,065,060,932.98	5,815,223,005.35
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		8,065,060,932.98	5,815,223,005.35
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		7,108,774,957.06	4,955,395,513.10
应收证券清算款		-	-
应收利息		109,016,546.56	80,894,902.10
应收股利		-	-
应收申购款		38,000.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		23,752,403,907.40	18,516,240,627.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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		354,579,148.13	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,722,187.51	3,136,311.84
应付托管费		930,546.89	784,077.97
应付销售服务费		186,956.20	157,243.87
应付交易费用		189,506.90	61,864.31
应交税费		67,146.47	-
应付利息		230,057.28	-
应付利润		2,887,664.99	3,296,505.86
递延所得税负债		-	-
其他负债		223,895.11	362,790.57
负债合计		363,017,109.48	7,798,794.42
所有者权益:			
实收基金		23,389,386,797.92	18,508,441,833.37
未分配利润		-	-
所有者权益合计		23,389,386,797.92	18,508,441,833.37
负债和所有者权益总计		23,752,403,907.40	18,516,240,627.79

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.000元,基金份额总额23,389,386,797.92份。其中A类基金份额为3,993,170.40份;B类基金份额为23,385,393,627.52份。

6.2 利润表

会计主体:浦银安盛日日鑫货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		551,346,625.35	65,246,311.71
1.利息收入		548,709,803.41	64,995,852.36
其中:存款利息收入		238,156,226.22	11,480,274.10
债券利息收入		180,625,151.32	49,630,007.73
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		129,928,425.87	3,885,570.53
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		2,636,821.94	250,459.35
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		2,636,821.94	250,459.35
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		43,923,595.28	4,280,083.77
1. 管理人报酬		24,063,299.86	3,140,642.72
2. 托管费		6,015,825.00	785,160.68
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	1,207,169.37	158,391.60
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		12,278,874.17	-
其中:卖出回购金融资产支出		12,278,874.17	-
6. 其他费用		333,136.71	195,888.77
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		507,423,030.07	60,966,227.94
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		507,423,030.07	60,966,227.94

6.3 所有者权益(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:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	18,508,441,833.37	-	18,508,441,833.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	507,423,030.07	507,423,030.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	4,880,944,964.55	-	4,880,944,964.55
其中:1.基金申购款	43,229,873,493.35	-	43,229,873,493.35
2.基金赎回款	-38,348,928,528.80	-	-38,348,928,528.80
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)	-	-507,423,030.07	-507,423,030.07
五、期末所有者权益(基金净值)	23,389,386,797.92	-	23,389,386,797.92
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	2,001,022,267.63	-	2,001,022,267.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	60,966,227.94	60,966,227.94
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)	2,001,389,594.22	-	2,001,389,594.22
其中:1.基金申购款	5,562,577,241.73	-	5,562,577,241.73
2.基金赎回款	-3,561,187,647.51	-	-3,561,187,647.51
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)	-	-60,966,227.94	-60,966,227.94
五、期末所有者权益(基金净值)	4,002,411,861.85	-	4,002,411,861.85

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:

_____郁蓓华_____ _____郁蓓华_____ _____钱琨_____

基金管理人负责人 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》核准,由浦银安盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛日日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基金,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,本基金根据单个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。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。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%。各类基金份额按照不同的费率计提费用,分别公布每万份基金已实现收益和7日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛日日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)。

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日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月1日至2018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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018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、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 会计差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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[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行税额抵扣等增值税政策的通知》、《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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。

(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)本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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、基金代销机构
兴业银行股份有限公司“兴业银行”	基金管理人、基金代销机构

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

注: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

注: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

注: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 权证交易

注: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权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注: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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	24,063,299.86	3,140,642.72
其中:支付销售机构的客户维护费	36,738.18	0.00

注:支付基金管理人浦银安盛的基金管理费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算方法如下:

H=E×0.2%/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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,015,825.00	785,160.68

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:

H=E×0.05%/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

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 2018年1月1日至2018年6月30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
浦银安盛基金管理有限公司	3,399.82	1,199,324.46	1,202,724.28
合计	3,399.82	1,199,324.46	1,202,724.28
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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
浦银安盛基金管理有限公司	1,416.00	156,975.60	158,391.60
合计	1,416.00	156,975.60	158,391.60

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 X 0.25 % / 当年天数。

日B 类基金份额销售服务费=前一日 B 类基金资产净值 X 0.01 % / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市