# 浦银安盛日日盈货币市场基金

## 2018年第三季度报告

2018年 9 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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2018 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 浦银安盛日日盈货币 |
| 基金主代码 | 519566 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年 3 月 25 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 10,212,912,382.03 份 |
| 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<br>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。<br>(2)久期控制策略<br>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。<br>(3)套利策略<br>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。<br>(4)时机选择策略<br>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 | 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。 |
| 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 |
| 下属分级基金的基金简称 | 浦银安盛日日盈货币A / 浦银安盛日日盈货币B / 浦银安盛日日盈货币D |
| 下属分级基金的交易代码 | 519566 / 519567 / 519568 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 19,170,673.66 份 / 7,984,360,688.66 份 / 2,209,381,019.71 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2018 年 7 月 1 日 - 2018 年 9 月 30 日) | | |
|---|---|---|---|
| | 浦银安盛日日盈货币A | 浦银安盛日日盈货币B | 浦银安盛日日盈货币D |
| 1.本期已实现收益 | 136,469.26 | 59,297,790.75 | 16,647,233.67 |
| 2. 本期利润 | 136,469.26 | 59,297,790.75 | 16,647,233.67 |
| 3. 期末基金资产净值 | 19,170,673.66 | 7,984,360,688.66 | 2,209,381,019.71 |

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浦银安盛日日盈货币 A

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.6857% | 0.0016% | 0.0883% | 0.0000% | 0.5974% | 0.0016% |

浦银安盛日日盈货币 B

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.7467% | 0.0016% | 0.0883% | 0.0000% | 0.6584% | 0.0016% |

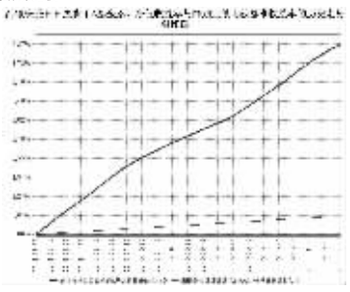
浦银安盛日日盈货币 D

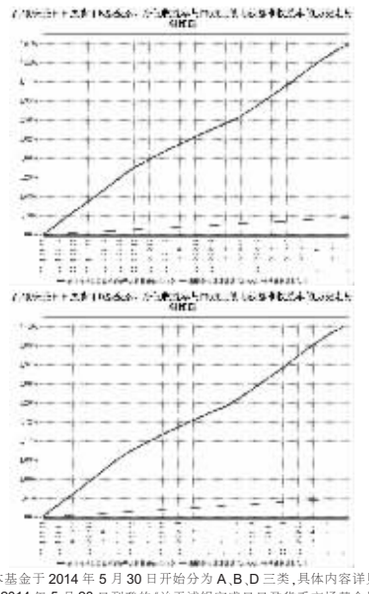
| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.6857% | 0.0016% | 0.0883% | 0.0000% | 0.5974% | 0.0016% |

注:1、本基金收益分配按日结转份额。

2、本基金于 2014 年 5 月 30 日开始分为 A、B、D 三类。

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





注:本基金于 2014 年 5 月 30 日开始分为 A、B、D 三类,具体内容详见本基金管理人于 2014 年 5 月 28 日刊登的《关于浦银安盛日日盈货币市场基金增加基金份额类别的公告》。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 刘大巍 | 公司旗下浦银安盛 6 个月债券基金、浦银安盛季季添利债券基金、浦银安盛月月盈债券基金、浦银安盛幸福聚利债券基金、浦银安盛盛跃纯债债券基金、浦银安盛日日盈货币市场基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛盛通定开债券基金基金经理。 | 2017年 11 月 1 日 | - | - | 刘大巍先生,上海财经大学经济学博士。加盟浦银安盛基金前,曾在万家基金、泰信基金工作,先后从事固定收益研究、基金经理助理、债券投资经理等工作。2014 年 4 月加盟浦银安盛基金公司,从事固定收益专户产品的投资工作。2016 年 8 月转岗至固定收益投资 部,担任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 6 个月定期开放债券型证券投资基金以及浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月起,担任公司旗下浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金及浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月 8 日起,担任浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 11 月 1 日起,担任浦银安盛日日盈货币市场基金及浦银安盛日日丰货币市场基金基金经理。2017 年 12 月 28 日起,担任浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2018 年 7 月 5 日起停止担任浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)基金经理。 |

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在具体执行中,在投资决策流程上,构建统一的研究平台,为所有投资组合公平的提供研究支持。同时,在投资决策过程中,严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度,保证公募基金及专户业务的独立投资决策机制;在交易执行环节上,详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规定,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 日和 10 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。

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在违反法律、法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件中认定的异常交易行为。报告期内未发生旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度,为鼓励商业银行支持中小企业融资需求以及配合地方政府债大量发行的需要，央行的货币政策较上半年有所放松，银行间资金利率进一步回落,R001 最低至 1.45%、R007 最低至 2.26%,后央行虽然开始回笼银行间过剩资金,但整个报告期银行间资金面都较为充裕，同时受到货币市场基金大幅扩张的带动，短端利率债和银行同业存单收益率明显下行，1Y 国债收益率下行 19.33BP 至 2.9657%、1Y 国开债收益率下行 60BP 至 3.0783%、1YAAA 同业存单下行 118BP 至 3.52%、3MAAA 同业存单下行 105BP 至 2.75%，市场利率曲线呈现明显的陡峭化。

报告期内,本组合以哑铃型配置为主,充分获取长久期品种利率回落的资本利得机会,组合回报率较为稳定。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期浦银安盛日日盈货币 A 的基金份额净值收益率为 0.6857%,本报告期浦银安盛日日盈货币 B 的基金份额净值收益率为 0.7467%,本报告期浦银安盛日日盈货币 D 的基金份额净值收益率为 0.6857%，同期业绩比较基准收益率为 0.0883%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 固定收益投资 | 3,393,421,431.43 | 31.65 |
| | 其中:债券 | 3,393,421,431.43 | 31.65 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 3,445,224,062.85 | 32.13 |
| | 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 | 3,808,890,452.30 | 35.52 |
| 4 | 其他资产 | 74,743,658.52 | 0.70 |
| 5 | 合计 | 10,722,279,605.10 | 100.00 |

5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 3.12 |
| | 其中:买断式回购融资 | - |
| 序号 | 项目 | 金额(元) / 占基金资产净值的比例(%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 503,499,044.75 / 4.93 |
| | 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。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 54 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 60 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 39 |

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。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 63.02 | 4.93 |
| | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)-60 天 | 14.33 | - |
| | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)-90 天 | 4.30 | - |
| | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)-120 天 | 6.10 | - |
| | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120天(含)-397 天(含) | 16.97 | - |
| | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 104.72 | 4.93 |

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

5.5 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 | 920,447,258.50 | 9.01 |
| | 其中:政策性金融债 | 870,446,556.08 | 8.52 |
| 4 | 企业债券 | 16,239,604.70 | 0.16 |
| 5 | 企业短期融资券 | 780,938,246.03 | 7.65 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 1,675,796,322.20 | 16.41 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 3,393,421,431.43 | 33.23 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 160402 | 16农发 02 | 5,200,000 | 519,875,045.04 | 5.09 |
| 2 | 111803165 | 18农业银行CD165 | 1,900,000 | 188,791,996.67 | 1.85 |
| 3 | 011801436 | 18申能股SCP002 | 1,500,000 | 150,002,202.58 | 1.47 |
| 4 | 111803138 | 18农业银行CD138 | 1,500,000 | 147,920,616.10 | 1.45 |
| 5 | 111821304 | 18融海银行CD304 | 1,500,000 | 147,744,684.26 | 1.45 |
| 6 | 180207 | 18国开 07 | 1,400,000 | 140,115,264.69 | 1.37 |
| 7 | 111882406 | 18苏州银行CD070 | 1,400,000 | 139,602,152.26 | 1.37 |
| 8 | 011800647 | 18国新控股SCP004 | 1,000,000 | 100,192,336.52 | 0.98 |
| 9 | 180305 | 18进出 05 | 1,000,000 | 100,037,304.84 | 0.98 |
| 10 | 111885489 | 18厦山农商银行CD114 | 1,000,000 | 99,852,327.29 | 0.98 |

5.7"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 | 0 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.1032% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0291% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0558% |

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

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金所持有的债券(包括票据)采用摊余成本法进行估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。

5.9.2

本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,164.50 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 50,020,728.82 |
| 4 | 应收申购款 | 24,721,765.20 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 74,743,658.52 |

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 浦银安盛日日盈货币A | 浦银安盛日日盈货币B | 浦银安盛日日盈货币D |
|---|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 21,164,402.26 | 2,781,594,221.99 | 2,609,287,622.79 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 6,896,757.05 | 14,423,253,172.99 | 1,661,960,748.19 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 8,890,485.65 | 9,220,486,706.32 | 2,061,867,351.27 |
| 报告期期末基金份额总额 | 19,170,673.66 | 7,984,360,688.66 | 2,209,381,019.71 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 红利发放 | 2018年 7 月 2 日 | 217.52 | 217.52 | 0.00% |
| 2 | 红利发放 | 2018年 7 月 3 日 | 72.64 | 72.64 | 0.00% |
| 3 | 红利发放 | 2018年 7 月 4 日 | 69.61 | 69.61 | 0.00% |
| 4 | 红利发放 | 2018年 7 月 5 日 | 65.61 | 65.61 | 0.00% |
| 5 | 红利发放 | 2018年 7 月 6 日 | 86.18 | 86.18 | 0.00% |
| 6 | 红利发放 | 2018年 7 月 9 日 | 180.13 | 180.13 | 0.00% |
| 7 | 红利发放 | 2018年 7 月 10 日 | 59.74 | 59.74 | 0.00% |
| 8 | 红利发放 | 2018年 7 月 11 日 | 58.99 | 58.99 | 0.00% |
| 9 | 红利发放 | 2018年 7 月 12 日 | 58.59 | 58.59 | 0.00% |
| 10 | 红利发放 | 2018年 7 月 13 日 | 80.55 | 80.55 | 0.00% |
| 11 | 红利发放 | 2018年 7 月 16 日 | 170.94 | 170.94 | 0.00% |
| 12 | 红利发放 | 2018年 7 月 17 日 | 63.67 | 63.67 | 0.00% |
| 13 | 红利发放 | 2018年 7 月 18 日 | 57.50 | 57.50 | 0.00% |
| 14 | 红利发放 | 2018年 7 月 19 日 | 57.31 | 57.31 | 0.00% |
| 15 | 红利发放 | 2018年 7 月 20 日 | 73.38 | 73.38 | 0.00% |
| 16 | 红利发放 | 2018年 7 月 23 日 | 168.55 | 168.55 | 0.00% |
| 17 | 红利发放 | 2018年 7 月 24 日 | 56.59 | 56.59 | 0.00% |
| 18 | 红利发放 | 2018年 7 月 25 日 | 55.80 | 55.80 | 0.00% |
| 19 | 红利发放 | 2018年 7 月 26 日 | 56.91 | 56.91 | 0.00% |
| 20 | 红利发放 | 2018年 7 月 27 日 | 71.77 | 71.77 | 0.00% |
| 21 | 红利发放 | 2018年 7 月 30 日 | 199.08 | 199.08 | 0.00% |
| 22 | 红利发放 | 2018年 7 月 31 日 | 55.62 | 55.62 | 0.00% |
| 23 | 红利发放 | 2018年 8 月 1 日 | 61.39 | 61.39 | 0.00% |
| 24 | 红利发放 | 2018年 8 月 2 日 | 53.43 | 53.43 | 0.00% |
| 25 | 红利发放 | 2018年 8 月 3 日 | 51.79 | 51.79 | 0.00% |
| 26 | 红利发放 | 2018年 8 月 6 日 | 163.14 | 163.14 | 0.00% |
| 27 | 红利发放 | 2018年 8 月 7 日 | 49.13 | 49.13 | 0.00% |
| 28 | 红利发放 | 2018年 8 月 8 日 | 48.71 | 48.71 | 0.00% |
| 29 | 红利发放 | 2018年 8 月 9 日 | 48.28 | 48.28 | 0.00% |
| 30 | 红利发放 | 2018年 8 月 10 日 | 60.86 | 60.86 | 0.00% |
| 31 | 红利发放 | 2018年 8 月 13 日 | 138.62 | 138.62 | 0.00% |
| 32 | 红利发放 | 2018年 8 月 14 日 | 45.59 | 45.59 | 0.00% |
| 33 | 红利发放 | 2018年 8 月 15 日 | 53.22 | 53.22 | 0.00% |
| 34 | 红利发放 | 2018年 8 月 16 日 | 49.43 | 49.43 | 0.00% |
| 35 | 红利发放 | 2018年 8 月 17 日 | 93.96 | 93.96 | 0.00% |
| 36 | 红利发放 | 2018年 8 月 20 日 | 141.67 | 141.67 | 0.00% |
| 37 | 红利发放 | 2018年 8 月 21 日 | 45.87 | 45.87 | 0.00% |
| 38 | 红利发放 | 2018年 8 月 22 日 | 46.25 | 46.25 | 0.00% |
| 39 | 红利发放 | 2018年 8 月 23 日 | 78.28 | 78.28 | 0.00% |
| 40 | 红利发放 | 2018年 8 月 24 日 | 56.40 | 56.40 | 0.00% |
| 41 | 红利发放 | 2018年 8 月 27 日 | 141.75 | 141.75 | 0.00% |
| 42 | 红利发放 | 2018年 8 月 28 日 | 46.97 | 46.97 | 0.00% |
| 43 | 红利发放 | 2018年 8 月 29 日 | 49.65 | 49.65 | 0.00% |
| 44 | 红利发放 | 2018年 8 月 30 日 | 49.76 | 49.76 | 0.00% |
| 45 | 红利发放 | 2018年 8 月 31 日 | 55.18 | 55.18 | 0.00% |
| 46 | 红利发放 | 2018年 9 月 3 日 | 141.91 | 141.91 | 0.00% |
| 47 | 红利发放 | 2018年 9 月 4 日 | 51.73 | 51.73 | 0.00% |
| 48 | 红利发放 | 2018年 9 月 5 日 | 45.50 | 45.50 | 0.00% |
| 49 | 红利发放 | 2018年 9 月 6 日 | 45.91 | 45.91 | 0.00% |
| 50 | 红利发放 | 2018年 9 月 7 日 | 57.82 | 57.82 | 0.00% |
| 51 | 红利发放 | 2018年 9 月 10 日 | 141.31 | 141.31 | 0.00% |
| 52 | 红利发放 | 2018年 9 月 11 日 | 80.60 | 80.60 | 0.00% |
| 53 | 红利发放 | 2018年 9 月 12 日 | 93.55 | 93.55 | 0.00% |
| 54 | 红利发放 | 2018年 9 月 13 日 | 43.61 | 43.61 | 0.00% |
| 55 | 红利发放 | 2018年 9 月 14 日 | 66.40 | 66.40 | 0.00% |
| 56 | 红利发放 | 2018年 9 月 17 日 | 139.75 | 139.75 | 0.00% |
| 57 | 红利发放 | 2018年 9 月 18 日 | 55.90 | 55.90 | 0.00% |
| 58 | 红利发放 | 2018年 9 月 19 日 | 53.68 | 53.68 | 0.00% |
| 59 | 红利发放 | 2018年 9 月 20 日 | 82.30 | 82.30 | 0.00% |
| 60 | 红利发放 | 2018年 9 月 21 日 | 54.90 | 54.90 | 0.00% |
| 61 | 红利发放 | 2018年 9 月 25 日 | 215.31 | 215.31 | 0.00% |
| 62 | 红利发放 | 2018年 9 月 26 日 | 47.47 | 47.47 | 0.00% |
| 63 | 红利发放 | 2018年 9 月 27 日 | 47.65 | 47.65 | 0.00% |
| 64 | 红利发放 | 2018年 9 月 28 日 | 46.89 | 46.89 | 0.00% |
| 合计 | | | 5,178.20 | 5,178.20 | |

注:1、截至本报告期末,本基金管理人持有浦银日日盈 A 761,030.00 份。

2、截至本报告期末,本基金管理人的全资子公司上海浦银安盛资产管理有限公司持有本基金浦银日日盈 A 238,976.24 份。

3、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。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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 | 序号 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 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 | 2018年 7 月 3 日-2018年 9 月 30 日 | 128,372,455.29 | 5,523,182,500.04 | 1,502,199,964.64 | | 4,149,354,990.69 | 40.63% |
| | 2 | 2018年 7 月 1 日-2018年 8 月 1 日<br>2018年 8 月 29 日-2018年 9 月 11 日 | 1,841,066,953.19 | 2,714,869,012.30 | 4,555,935,965.49 | | 0.00 | 0.00% |
| 个人 | - | - | - | - | - | | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | | |

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。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准基金募集的文件

2、浦银安盛日日盈货币市场基金基金合同

3、浦银安盛日日盈货币市场基金招募说明书

4、浦银安盛日日盈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指定报刊上披露的各项公告

8、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼基金管理人办公场所。

9.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问,可咨询基金管理人。

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

浦银安盛基金管理有限公司

2018 年 10 月 26 日

# 浦银安盛日日丰货币市场基金

## 2018年第三季度报告

2018年 9 月 30 日
基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2018 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 浦银安盛日日丰货币 |
| 基金主代码 | 003534 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年 11 月 7 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 336,781,604.47 份 |
| 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<br>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。<br>(2)久期控制策略<br>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。<br>(3)套利策略<br>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。<br>(4)时机选择策略<br>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。 |
| 基金管理人 | 浦银安盛基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 |
| 下属分级基金的基金简称 | 浦银安盛日日丰A / 浦银安盛日日丰B / 浦银安盛日日丰D |
| 下属分级基金的交易代码 | 003534 / 003535 / 003536 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 13,219,218.04 份 / 307,030,322.68 份 / 16,532,063.75 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2018 年 7 月 1 日 - 2018 年 9 月 30 日) | | |
|---|---|---|---|
| | 浦银安盛日日丰A | 浦银安盛日日丰B | 浦银安盛日日丰D |
| 1.本期已实现收益 | 85,301.94 | 2,566,714.16 | 146,562.44 |
| 2. 本期利润 | 85,301.94 | 2,566,714.16 | 146,562.44 |
| 3. 期末基金资产净值 | 13,219,218.04 | 307,030,322.68 | 16,532,063.75 |

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浦银安盛日日丰 A

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.8016% | 0.0053% | 0.0883% | 0.0000% | 0.7133% | 0.0053% |

浦银安盛日日丰 B

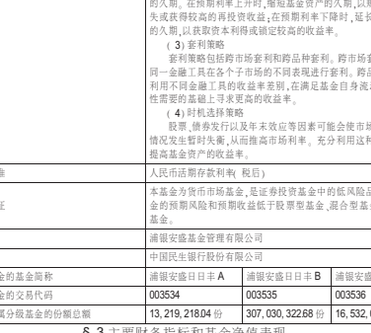
| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.8620% | 0.0053% | 0.0883% | 0.0000% | 0.7737% | 0.0053% |

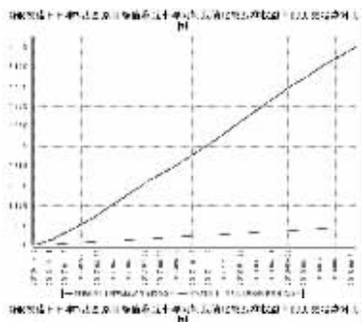
浦银安盛日日丰 D

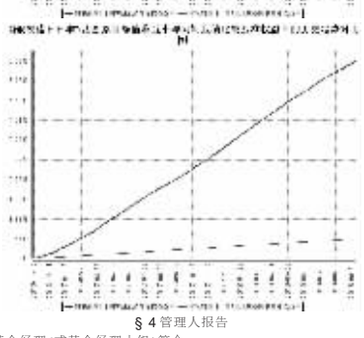
| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.8009% | 0.0053% | 0.0883% | 0.0000% | 0.7126% | 0.0053% |

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 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 刘大巍 | 公司旗下浦银安盛 6 个月债券基金、浦银安盛季季添利债券基金、浦银安盛月月盈债券基金、浦银安盛幸福聚利债券基金、浦银安盛盛跃纯债债券基金、浦银安盛日日盈货币市场基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛盛通定开债券基金基金经理。 | 2017年 11 月 1 日 | - | 8 | 刘大巍先生,上海财经大学经济学博士。加盟浦银安盛基金前,曾在万家基金、泰信基金工作,先后从事固定收益研究、基金经理助理、债券投资经理等工作。2014 年 4 月加盟浦银安盛基金公司,从事固定收益专户产品的投资工作。2016 年 8 月转岗至固定收益投资 部,担任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 6 个月定期开放债券型证券投资基金以及浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月起,担任公司旗下浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金及浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月 8 日起,担任浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 11 月 1 日起,担任浦银安盛日日盈货币市场基金及浦银安盛日日丰货币市场基金基金经理。2017 年 12 月 28 日起,担任浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。 |

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在具体执行中,在投资决策流程上,构建统一的研究平台,为所有投资组合公平的提供研究支持。同时,在投资决策过程中,严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度,保证公募基金及专户业务的独立投资决策机制;在交易执行环节上,详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规定,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 日和 10 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