浦银安盛货币市场证券投资基金 2016年年度报告摘要

2016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:中信银行股份有限公司
送出日期:2017年3月30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2017年3月27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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2016年1月1日起至12月31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		
交易代码	519509		
基金运作方式	契约型开放式		
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	756,153,077.94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	浦银安盛货币E
下属分级基金的交易代码:	519509	519510	519516
报告期末下属分级基金的份额总额	170,201,905.40份	580,481,248.23份	5,469,924.31份

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	本基金为货币市场基金,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	方舞
	联系电话	021-23212888	4006800000
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		021-33079999或400-8828-999	95558
传真		021-23212985	010-85230024

2.4 信息披露方式

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

§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

3.1.1 期间数据和指标	2016年			2015年			2014年		
	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B	浦银安盛货币E	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B	浦银安盛货币E	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B	浦银安盛货币E
本期已实现收益	4,236,997.15	28,338,621.81	167,848.66	8,670,539.92	28,426,855.94	213,657.88	14,884,968.26	33,915,233.46	11,841.32
本期利润	4,236,997.15	28,338,621.81	167,848.66	8,670,539.92	28,426,855.94	213,657.88	14,884,968.26	33,915,233.46	11,841.32
本期净值收益率	2.5399%	2.7863%	2.5396%	3.4819%	3.7312%	3.4728%	4.8160%	5.0670%	1.3134%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末			2015年末			2014年末		
期末基金资产净值	170,201,905.40	580,481,248.23	5,469,924.31	153,132,617.19	3,295,531,280.03	4,225,931.87	317,200,484.12	588,334,941.63	8,408,787.04
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2016年末			2015年末			2014年末		
累计净值收益率	23.5766%	25.3159%	7.4964%	20.5155%	21.9190%	4.8340%	16.4314%	17.5007%	1.4029%

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,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。

4、自2014年9月15日起,本基金增加E级基金份额类别。

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

浦银安盛货币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	0.6349%	0.0058%	0.0880%	0.0000%	0.5469%	0.0058%
过去六个月	1.2573%	0.0051%	0.1761%	0.0000%	1.0812%	0.0051%
过去一年	2.5399%	0.0051%	0.3506%	0.0000%	2.1893%	0.0051%
过去三年	11.2299%	0.0076%	1.0555%	0.0000%	10.1744%	0.0076%
过去五年	20.1006%	0.0070%	1.8356%	0.0001%	18.2650%	0.0069%
自基金合同生效起至今	23.5766%	0.0067%	2.2443%	0.0002%	21.3323%	0.0065%

浦银安盛货币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	0.6958%	0.0058%	0.0880%	0.0000%	0.6078%	0.0058%
过去六个月	1.3797%	0.0051%	0.1761%	0.0000%	1.2036%	0.0051%
过去一年	2.7863%	0.0051%	0.3506%	0.0000%	2.4357%	0.0051%
过去三年	12.0345%	0.0076%	1.0555%	0.0000%	10.9790%	0.0076%
过去五年	21.5511%	0.0070%	1.8356%	0.0001%	19.7155%	0.0069%
自基金合同生效起至今	25.3159%	0.0067%	2.2443%	0.0002%	23.0716%	0.0065%

浦银安盛货币E

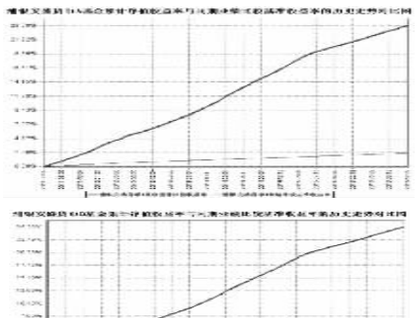
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6350%	0.0058%	0.0880%	0.0000%	0.5470%	0.0058%
过去六个月	1.2573%	0.0051%	0.1761%	0.0000%	1.0812%	0.0051%
过去一年	2.5396%	0.0051%	0.3506%	0.0000%	2.1890%	0.0051%
自基金合同生效起至今	7.4964%	0.0072%	0.8068%	0.0000%	6.6896%	0.0072%

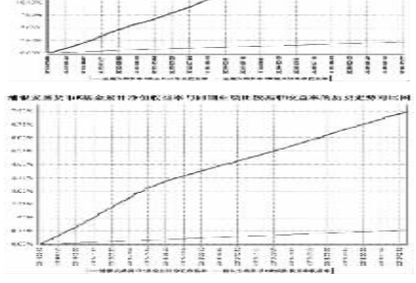
注:

1、本基金收益分配按月结转份额。

2、本基金于2014年9月15日开始分为A、B、E三类。

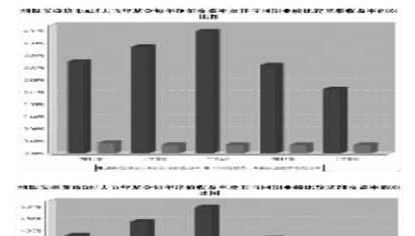
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

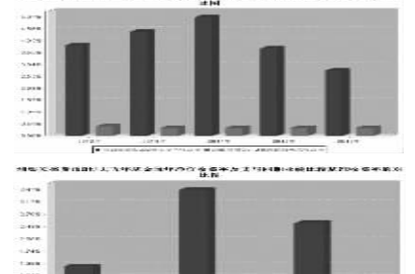




注:本基金于2014年9月15日开始分为A、B、E三类,具体内容详见本基金管理人于2014年9月12日刊登的《关于浦银安盛货币市场证券投资基金增加基金份额类别的公告》。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注:本基金合同于2011年3月9日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

浦银安盛货币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
2016	3,667,624.39	500,651.33	68,721.43	4,236,997.15	
2015	7,204,998.65	1,966,196.16	-500,654.89	8,670,539.92	
2014	11,975,143.14	3,009,092.01	-99,266.89	14,884,968.26	
合计	22,847,766.18	5,475,939.50	-531,200.35	27,792,505.33	
浦银安盛货币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
2016	25,330,080.21	5,169,215.64	-2,160,674.04	28,338,621.81	
2015	20,486,499.69	5,958,174.10	1,982,182.15	28,426,855.94	
2014	24,829,331.43	8,954,721.50	131,180.53	33,915,233.46	
合计	70,645,911.33	20,082,111.24	-47,311.36	90,680,711.21	
浦银安盛货币E					
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
2016	152,752.56	12,468.92	2,627.18	167,848.66	
2015	148,797.57	70,279.12	-5,418.81	213,657.88	
2014	1,872.65	108.87	9,859.80	11,841.32	
合计	303,422.78	82,856.91	7,068.17	393,347.86	

§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、境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务。

截至2016年12月31日止,浦银安盛旗下共管理28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)、浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金、浦银安盛半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、浦银安盛日日益货币市场基金、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、浦银安盛月月盈安心养老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、浦银安盛半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、浦银安盛半福聚益18个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金以及浦银安盛盛达纯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。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		
康佳燕	公司旗下浦银安盛货币基金、浦银安盛日益货币基金、浦银安盛日丰货币基金以及浦银安盛日鑫货币基金基金经理	2014年6月19日	-	10	康佳燕女士,香港大学工商管理硕士。2005年6月至2007年5月,先后就职于金盛人寿保险公司、泰信基金管理公司从事基金会计工作。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。2014年7月起,兼任浦银安盛日日益货币基金基金经理。2016年11月起,兼任浦银安盛日日丰货币基金以及浦银安盛日日鑫货币基金基金经理。
杨晶	公司旗下货币收益基金经理助理	2016年1月1日	-	3	杨晶女士,伦敦大学玛丽皇后学院金融投资硕士。2013年4月1日加盟我司曾任交易部固定收益交易员,2016年1月调岗至固定收益投资部任货币基金经理助理。

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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 公平交易制度和控制方法

管理人于2009年颁布了《浦银安盛基金管理有限公司公平交易管理规定》(以下简称公平交易管理规定),并分别于2011年及2012年进行了两次修订。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;
- 证券投资基金经理及其助理和特定客户资产投资组合经理及其助理相互隔离,不得相互兼任、互为备份;
- 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)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

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。

4.3.3 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

2016年,国内GDP增长6.7%、CPI同比上涨2.0%、PPI同比下降1.4%,整体看,2016年央行执行了中性偏紧的货币政策,上半年主要是受春节假日、汇率及缴税多重因素引起资金面短期紧张,其余时间均较为宽松。下半年8月份开始央行重启14及28天逆回购,拉长了逆回购和MLF的久期,通过"锁短放长"拉长融资期限,间接抬高综合资金成本,渐进式地执行了偏紧的货币政策,自8月份以来,每月中下旬资金面都较为紧张,第四季度尤为明显,短端利率在第四季度上行200bp。在报告期内,本基金大部分资产配置类别为同业存款,其余均衡配置了短融、存单和回购。

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2.5399%、B类净值收益率为2.7863%、E类净值收益率为2.5396%,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

2016年末中央经济工作会议提出,要把防控金融风险放到更加重要的位置,下决心处置一批风险点,着力防控资产泡沫,提高和改进监管能力,确保不发生系统性金融风险,这决定了2017年倩市的主基调。首先,金融去杠杆,这表明货币政策总体上一定是中性甚至偏紧的,17年时点性的流动性紧张可能比16年发生的更频繁,非存款类金融机构借入资金的中枢可能在利率走廊上沿震荡。其次,抑制房价上涨,甚至持开放的态度面对经济增速可能低于6.5%,这表明稳增长不再是首要目标,房地产投资回落是大概率事件,基建投资等财政政策也不会像市场想的那么积极,经济下台阶中长期看利好债市。其他如通胀和美国等因素目前还不甚明朗,减产协议如能进一步加码,石油持续上涨会带来输入性通胀,但美国的新增供给加大以及能源政策变化也给石油价格带来了不确定性;美国方面,总统权力过度后,特朗普的积极财政政策和贸易保护政策能否顺利推行且真正推动经济和通胀上行仍存较大疑问。2017年将是充满不确定性和机遇的一年,短期来看4月以前市场仍将由资金面主导,央行偏紧的态度叠加去年末大跌后脆弱的市场情绪,债市仍有可能再次寻底,保持好组合的高流动性和偏高信用资质是重中之重。中长期来看高负债率下企业难以承受利率持续上行,经济增速可能下台阶将利好债市。

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。

本基金管理人已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》。

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4,236,997.15元,实际分配收益4,236,997.15元;浦银货币B级基金应分配收益28,338,621.81元,实际分配收益28,338,621.81元;浦银货币E级基金应分配收益167,848.66元,实际分配收益167,848.66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

作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《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,对浦银安盛货币市场证券投资基金2016年度基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,不存在任何损害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

本托管人认为,浦银安盛基金管理有限公司在浦银安盛货币市场证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;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

本托管人认为,浦银安盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的浦银安盛货币市场证券投资基金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、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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(2017)第21533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	浦银安盛货币市场证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的浦银安盛货币市场证券投资基金(以下简称"浦银安盛货币市场基金")的财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表、2016年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是浦银安盛货币市场基金的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")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,并使其实现公允反映; (2)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。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 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。
审计意见段	我们认为,上述浦银安盛货币市场基金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,公允反映了浦银安盛货币市场基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛竞 / 张振波
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)
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
审计报告日期	2017年3月27日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表
会计主体:浦银安盛货币市场证券投资基金
报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产:			
银行存款		278,316,564.22	1,596,674,761.89
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		256,170,595.64	818,503,286.46
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		256,170,595.64	818,503,286.46
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		216,895,005.35	1,032,125,802.46
应收证券清算款		-	-
应收利息		3,752,381.88	9,675,474.41
应收股利		-	-
应收申购款		2,377,035.18	134.32
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		757,511,582.27	3,456,979,459.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	10,857.27
应付管理人报酬		172,253.99	647,406.80
应付托管费		52,198.17	196,183.88
应付销售服务费		46,767.09	48,053.97
应付交易费用		14,301.32	26,665.59
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		892,983.76	2,982,309.19
递延所得税负债		-	-
其他负债		180,000.00	178,153.75
负债合计		1,358,504.33	4,089,630.45
所有者权益:			
实收基金		756,153,077.94	3,452,889,829.09
未分配利润		-	-
所有者权益合计		756,153,077.94	3,452,889,829.09
负债和所有者权益总计		757,511,582.27	3,456,979,459.54

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.000元,基金份额总额为756,153,077.94份。其中浦银货币A级的基金份额为170,201,905.40份,浦银货币B级的基金份额为580,481,248.23份,浦银货币E级的基金份额为5,469,924.31份。

7.2 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:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入		39,546,896.72	43,862,943.85
1.利息收入		39,419,418.69	40,461,628.67
其中:存款利息收入		14,603,078.16	18,329,388.13
债券利息收入		18,390,257.59	16,435,328.58
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,426,082.94	5,696,911.96
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		127,403.03	3,401,315.18
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		127,403.03	3,401,315.18
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)		75.00	-
减:二、费用		6,803,429.10	6,551,890.11
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	4,080,951.53	3,816,923.55
2. 托管费	7.4.8.2.2	1,236,651.99	1,156,643.58
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	549,161.27	709,634.11
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		665,157.28	583,231.09
其中:卖出回购金融资产支出		665,157.28	583,231.09
6. 其他费用		271,507.03	285,457.78
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		32,743,467.62	37,311,053.74
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		32,743,467.62	37,311,053.74

7.3 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:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31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)	3,452,889,829.09	-	3,452,889,829.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	32,743,467.62	32,743,467.62
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)	-2,696,736,751.15	-	-2,696,736,751.15
其中:1.基金申购款	3,750,397,674.41	-	3,750,397,674.41
2.基金赎回款	-6,447,134,425.56	-	-6,447,134,425.56
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)	-	-32,743,467.62	-32,743,467.62
五、期末所有者权益(基金净值)	756,153,077.94	-	756,153,077.94

项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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)	913,944,212.79	-	913,944,212.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	37,311,053.74	37,311,053.74
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)	2,538,945,616.30	-	2,538,945,616.30
其中:1.基金申购款	9,486,943,585.22	-	9,486,943,585.22
2.基金赎回款	-6,947,997,968.92	-	-6,947,997,968.92
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)	-	-37,311,053.74	-37,311,053.74
五、期末所有者权益(基金净值)	3,452,889,829.09	-	3,452,889,829.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告-至-财务报表由下列负责人签署:

郁蓉华 郁蓉华 钱聚

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》和《浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同》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3,773,820,436.52元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第073号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同》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,其中认购资金利息折合587,179.50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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同》和《浦银安盛货币市场证券投资基金招募说明书》的规定,本基金自募集期起根据投资者认(申)购金额,对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,将基金份额分为不同的类别。最低申购金额为1,000.00元且按照0.25%年费率计提销售服务费的,称为A类基金份额;最低申购金额为5,000,000.00元且按照0.01%年费率计提销售服务费的,称为B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《关于浦银安盛货币市场证券投资基金增加基金份额类别的公告》,本基金管理人自2014年9月15日起为指定的特定销售渠道增加本基金的E类基金份额,该类份额仅能通过特定的销售渠道办理申购、赎回等业务,且不适用基金