

浦银安盛日日鑫货币市场基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 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

送出日期：2019 年 8 月 23 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 21 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§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合规守信情况的说明.....	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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21

6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 债券回购融资情况.....	45
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	45
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 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.....	47
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	47
7.8 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.....	48
7.9 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.4 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的情况.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
10.2 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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	53
10.9 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
11.1 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.....	55
§12 备查文件目录.....	56

12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§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	
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	29,237,262,265.79 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	65,876,551.17 份	29,171,385,714.62 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 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 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 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 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	顾佳	曾麓燕
	联系电话	021-23212888	021-52629999-212040
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	zengluyan@cib.com.cn
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95561
传真		021-23212985	021-62535823
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 981 号 3 幢 316 室	福州市湖东路 154 号
办公地址		上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼	上海市银城路 167 号 4 楼
邮政编码		200020	200041
法定代表人		谢伟	高建平

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	浦银安盛基金管理有限公司	上海市淮海中路 381 号 38 楼

§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

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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	638,129.64	462,368,725.59
本期利润	638,129.64	462,368,725.59
本期净值收益率	1.2534%	1.3735%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末基金资产净值	65,876,551.17	29,171,385,714.62
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
累计净值收益率	9.0826%	9.7451%

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 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	0.2029%	0.0006%	0.0288%	0.0000%	0.1741%	0.0006%
过去三个月	0.6106%	0.0005%	0.0873%	0.0000%	0.5233%	0.0005%
过去六个月	1.2534%	0.0006%	0.1737%	0.0000%	1.0797%	0.0006%
过去一年	2.7054%	0.0009%	0.3506%	0.0000%	2.3548%	0.0009%
自基金合同生效起至今	9.0826%	0.0021%	0.9083%	0.0000%	8.1743%	0.0021%

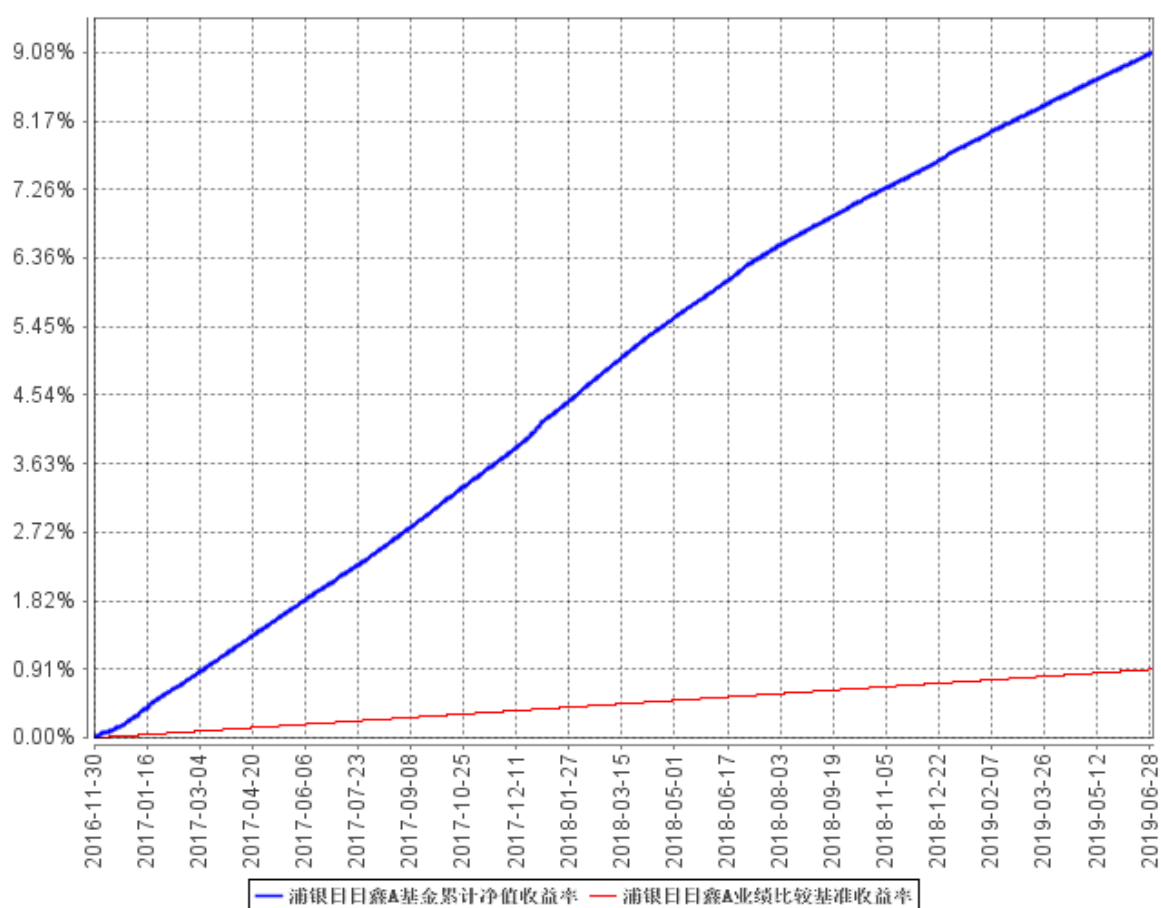
浦银日日鑫 B

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	0.2226%	0.0006%	0.0288%	0.0000%	0.1938%	0.0006%
过去三个月	0.6706%	0.0005%	0.0873%	0.0000%	0.5833%	0.0005%
过去六个月	1.3735%	0.0006%	0.1737%	0.0000%	1.1998%	0.0006%
过去一年	2.9515%	0.0009%	0.3506%	0.0000%	2.6009%	0.0009%
自基金合同 生效起至今	9.7451%	0.0021%	0.9083%	0.0000%	8.8368%	0.0021%

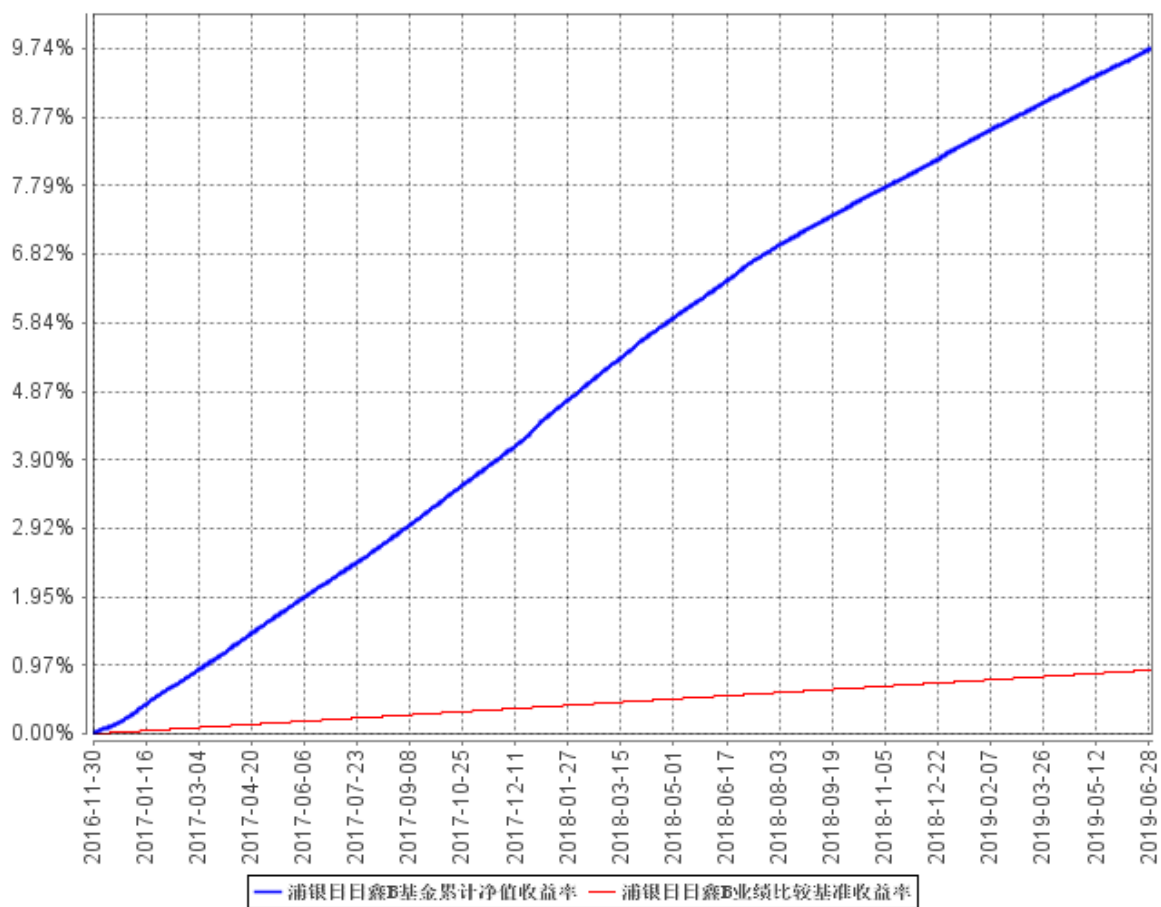
注：1、本基金收益分配按日结转份额。

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

浦银日日鑫A基金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基金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



§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 2019 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 46 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、浦银安盛鑫鑫定期开放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 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、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、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。

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	2017年11月1日	-	14	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

	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、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金、浦银安盛中短债债券型证券投资基金、浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金以及浦银安盛双债增强债券型证券投资基金基金经理。				期开放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。2018 年 10 月起担任浦银安盛中短债债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 12 月起担任浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 5 月起担任浦银安盛双债增强债券型证券投资基金的基金经理。
廉素君	公司旗下浦银安盛货	2019 年 3 月 4 日	-	7	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

	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				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。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基金经理。
王茂青	货币类 基金经 理助理	2018年1月22 日	-	9	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、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 and 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

经过一季度信贷投放刺激，市场预计二季度经济增速较一季度会放缓，货币政策将继续保持合理宽松水平，利好债市。实际情况看，二季度银行间资金面整体边际上虽然在 4 月略有上行，但随着后期经济数据趋弱和外围贸易战再次升级，资金面再次回归宽松态势；加之 5 月下旬包商事件引发的银行间流动性分层，预计将对市场产生长期影响，央行再次加码宽松力度。整体看，二季度银行间全市场隔夜质押式回购加权利率较一季度下行明显，货币市场各类资产大幅下行，尤其高评级短久期资产受到追捧。

报告期，货币基金操作上采取高杠杆和交易策略，提高高等级流动性高的存单占比，结合资金面的波动获取短期交易机会，灵活调整久期空间和交易品种，获取稳定超额回报。

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 1.2534%，本报告期浦银日日鑫 B 的基金份额净值收益率为 1.3735%，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

上半年经济总体稳中有进，稳增长政策令 GDP 季度表现呈现前高后低之势，整体下行压力仍存；局部经济结构出现改善：其中 6 月工业增加值同比增长高于 5 月；2019 年上半年固定资产投资累计同比为 5.8%，扭转了 3 月以来自增速高点持续回落的势头；6 月社会消费品零售总额累计同比增速为 8.4%，相比前月，增速出现加速上行的情况，且好于一季度 8.3% 的增速表现。市场方面，资金面整体平稳，部分时点出现了流动性分层现象，对资金面造成了一定的影响，但在央行的呵护下，资金利率平稳向下，二季度银行间 7 天质押式回购加权利率均值为 2.43% 相比一季度下行 22bp；上半年 7 天质押式回购利率整体平稳，资金面波动较小。1 年内短期资产先上后下，一年利率债收于 2.69%，一年国股存单收于 3.07% 与今年年初持平。预期三季度经济仍有缓慢下行压力，货币政策仍需维持合理宽裕水平。

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副总经理暨首席运营官、风险管理部负责人、指数与量化投资部负责人、研究部负责人、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 638,129.64 元，实际分配收益 638,129.64 元；浦银安盛日日鑫货币 B 级基金应分配收益 462,368.725.59 元，实际分配收益 462,368,725.59 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半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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	9,346,431,089.93	11,577,373,186.27
结算备付金		76,229,264.98	28,747,727.26
存出保证金		-	8,219.73
交易性金融资产	6.4.7.2	8,499,115,764.65	11,276,030,544.48
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		8,499,115,764.65	11,276,030,544.48
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	11,624,644,770.42	8,366,552,481.80
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	105,671,441.29	115,707,748.00
应收股利		-	-
应收申购款		21,536,393.70	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		29,673,628,724.97	31,364,419,907.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		427,279,586.36	949,047,376.42
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,897,834.88	5,277,906.59
应付托管费		1,224,458.74	1,319,476.62
应付销售服务费		257,155.30	269,231.13
应付交易费用	6.4.7.7	278,527.43	230,261.20

应交税费		75,522.01	80,162.72
应付利息		49,580.11	515,083.09
应付利润		2,130,360.62	3,011,945.22
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	173,433.73	445,580.63
负债合计		436,366,459.18	960,197,023.62
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	29,237,262,265.79	30,404,222,883.92
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		29,237,262,265.79	30,404,222,883.92
负债和所有者权益总计		29,673,628,724.97	31,364,419,907.54

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，浦银日日鑫 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 65,876,551.17 份；浦银日日鑫 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 29,171,385,714.62 份。浦银安盛日日鑫基金份额总额合计为 29,237,262,265.79 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		514,940,850.50	551,346,625.35
1.利息收入		512,441,983.22	548,709,803.41
其中：存款利息收入	6.4.7.11	188,761,592.71	238,156,226.22
债券利息收入		156,865,611.99	180,625,151.32
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		166,814,778.52	129,928,425.87
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,498,867.28	2,636,821.94
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,498,867.28	2,636,821.94
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、费用		51,933,995.27	43,923,595.28
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	33,693,633.44	24,063,299.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	8,423,408.36	6,015,825.00
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,745,710.01	1,207,169.37
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		7,758,380.65	12,278,874.17
其中：卖出回购金融资产支出		7,758,380.65	12,278,874.17
6. 税金及附加		65,752.33	25,290.17
7. 其他费用	6.4.7.20	247,110.48	333,136.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		463,006,855.23	507,423,030.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		463,006,855.23	507,423,030.07

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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	30,404,222,883.92	-	30,404,222,883.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	463,006,855.23	463,006,855.23
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）	-1,166,960,618.13	-	-1,166,960,618.13
其中：1. 基金申购款	36,736,821,283.16	-	36,736,821,283.16
2. 基金赎回款	-37,903,781,901.29	-	-37,903,781,901.29
四、本期向基金份额持	-	-463,006,855.23	-463,006,855.23

有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	29,237,262,265.79	-	29,237,262,265.79
项目	上年度可比期间 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

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，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(以下简称“兴业银行”)。

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)。

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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[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费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	6,431,089.93
定期存款	3,700,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	5,640,000,000.00
合计：	9,346,431,089.93

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日				
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	8,499,115,764.65	8,504,360,000.00	5,244,235.35	0.0179%
	合计	8,499,115,764.65	8,504,360,000.00	5,244,235.35	0.0179%
资产支持证券	-	-	-	0.0000%	
合计	8,499,115,764.65	8,504,360,000.00	5,244,235.35	0.0179%	

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。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2019年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	231,000,000.00	-
银行间市场	11,393,644,770.42	-
合计	11,624,644,770.42	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	32,796,452.73
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	34,303.10
应收债券利息	59,580,973.72
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	13,259,711.74
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	105,671,441.29

6.4.7.6 其他资产

注：本基金在本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	278,527.43
合计	278,527.43

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
手续费	16,557.28
预提费用	156,876.45
合计	173,433.73

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

浦银日日鑫 A		
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,695,700.44	30,695,700.44
本期申购	197,270,155.09	197,270,155.09
本期赎回(以“-”号填列)	-162,089,304.36	-162,089,304.36
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	65,876,551.17	65,876,551.17

金额单位：人民币元

浦银日日鑫 B	
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,373,527,183.48	30,373,527,183.48
本期申购	36,539,551,128.07	36,539,551,128.07
本期赎回(以“-”号填列)	-37,741,692,596.93	-37,741,692,596.93
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	29,171,385,714.62	29,171,385,714.62

注：申购含红利再投、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。

6.4.7.10 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
上年度末	-	-	-
本期利润	638,129.64	-	638,129.64
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	-638,129.64	-	-638,129.64
本期末	-	-	-

单位：人民币元

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
上年度末	-	-	-
本期利润	462,368,725.59	-	462,368,725.59
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	-462,368,725.59	-	-462,368,725.59
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,454,965.99
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	837,599.08
其他	185,469,027.64
合计	188,761,592.71

注：此处其他列示的是基金上交所与深交所结算保证金利息以及基金申购款滞留利息。

6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	2,498,867.28
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	2,498,867.28

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	22,629,572,677.02
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	22,509,570,300.70
减：应收利息总额	117,503,509.04
买卖债券差价收入	2,498,867.28

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

注：本基金本报告期内无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

注：本基金本报告期内无交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	84,300.75
信息披露费	63,575.70
上清所债券托管账户维护费	4,500.00
中债登债券托管帐户服务费	4,500.00
银行费用	89,634.03
其他	600.00
合计	247,110.48

注：此处其他费用列示的是上清所费用。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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	基金托管人、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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	33,693,633.44	24,063,299.86
其中：支付销售机构的客户维护费	116,884.78	36,738.18

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	8,423,408.36	6,015,825.00

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。

6.4.10.2.3 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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
上海浦东发展银行股份有限公司	455.69	0.00	455.69
浦银安盛基金管理有限公司	5,680.28	1,674,707.59	1,680,387.87
合计	6,135.97	1,674,707.59	1,680,843.56
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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
上海浦东发展银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
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

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期
----	----

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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
期初持有的基金份额	0.00	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	141,245,166.29
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	80,000,000.00
期末持有的基金份额	0.00	61,245,166.29
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.21%

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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
期初持有的基金份额	0.00	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	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。

6.4.10.4.2 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

浦银日日鑫 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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	5,430,762,958.94	18.62%	3,358,421,410.06	11.06%
上海浦东发 展银行股份 有限公司	9,195,223,959.72	31.52%	12,092,257,083.46	39.81%
上海浦银安 盛资产管理 有限公司	152,326,770.71	0.52%	1,120,535,191.34	3.69%

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相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.10.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	6,431,089.93	2,454,965.99	37,165,743.52	959,200.35
兴业银行协议 存款	-	2,831,000.00	-	36,708,437.52
浦发银行协议 存款	-	22,663,569.46	-	29,501,250.00

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期与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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

- 1、2019年3月20日兴业银行协定存款1笔，金额20000万元，到期日2019年6月20日。
- 2、2019年3月25日兴业银行协定存款1笔，金额57000万元，到期日2019年4月25日。
- 3、2019年2月28日浦发银行协定存款1笔，金额30000万元，到期日2019年5月20日。
- 4、2019年2月28日浦发银行协定存款1笔，金额30000万元，到期日2019年5月20日。

日。

5、2019 年 3 月 13 日浦发银行协定存款 1 笔，金额 50000 万元，到期日 2019 年 6 月 14

日。

6、2019 年 3 月 13 日浦发银行协定存款 1 笔，金额 37000 万元，到期日 2019 年 6 月 14

日。

7、2019 年 4 月 08 日浦发银行协定存款 1 笔，金额 30000 万元，到期日 2019 年 10 月 29

日。

8、2019 年 4 月 08 日浦发银行协定存款 1 笔，金额 30000 万元，到期日 2019 年 10 月 29

日。

9、2019 年 4 月 24 日浦发银行协定存款 1 笔，金额 30000 万元，到期日 2019 年 5 月 28

日。

10、2019 年 4 月 24 日浦发银行协定存款 1 笔，金额 30000 万元，到期日 2019 年 5 月 28

日。

11、2019 年 6 月 03 日浦发银行协定存款 1 笔，金额 30000 万元，到期日 2019 年 6 月 18

日。

12、2019 年 6 月 03 日浦发银行协定存款 1 笔，金额 30000 万元，到期日 2019 年 6 月 17

日。

13、2019 年 6 月 13 日浦发银行协定存款 1 笔，金额 30000 万元，到期日 2019 年 9 月 06

日。

14、2019 年 6 月 17 日浦发银行协定存款 1 笔，金额 30000 万元，到期日 2019 年 8 月 19

日。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：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
636,600.93	-	1,528.71	638,129.64	-

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
463,251,838.90	-	-883,113.31	462,368,725.59	-

6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金在本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 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股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截止本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 427,279,586.36 元，于 2019 年 7 月 1 日到期。

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
180209	18 国开 09	2019 年 7 月 1 日	100.03	2,060,000	206,061,800.00
180410	18 农发 10	2019 年 7 月 1 日	100.07	2,300,000	230,161,000.00
合计				4,360,000	436,222,800.00

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

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。

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，通知存款，短期融资券，一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单，期限在一年以内(含一年)的债券回购，期限在一年以内(含一年)的中央银行票据，剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券、中期票据，以及中国证监会及中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。

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。

6.4.13.1 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，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。

6.4.13.2 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。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行兴业银行和其他资质较好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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，因此违约风险可能性很小；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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，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。

6.4.13.2.1 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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	150,372,697.73
A-1 以下	-	-
未评级	2,401,319,072.69	990,735,425.07
合计	2,401,319,072.69	1,141,108,122.80

注：于 2019 年 6 月 30 日，未评级部分为政策性金融债、短期融资券。债券信用评级取自第三方评级机构

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.2.3 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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-

未评级	1,011,766,731.79	8,483,502,612.70
合计	1,011,766,731.79	8,483,502,612.70

6.4.13.2.4 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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	-	140,311,548.52
AAA 以下	-	-
未评级	1,011,766,731.79	1,511,108,260.46
合计	1,011,766,731.79	1,651,419,808.98

注：于 2019 年 6 月 30 日，未评级部分为政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.5 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。

6.4.13.2.6 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。

6.4.13.3 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 2019 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 427,279,586.36 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未

折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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 2019 年 6 月 30 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 87.84%，本基金投资组合的平均剩余期限为 37 天，平均剩余存续期为 37 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%。于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金的基金管理人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。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	9,346,431,089.93	-	-	-	-	9,346,431,089.93
结算备付金	76,229,264.98	-	-	-	-	76,229,264.98

交易性金融资产	7,734,307,443.68	764,808,320.97	-	-	-	8,499,115,764.65
买入返售金融资产	11,624,644,770.42	-	-	-	-	11,624,644,770.42
应收利息	-	-	-	-	-105,671,441.29	105,671,441.29
应收申购款	-	-	-	-	-21,536,393.70	21,536,393.70
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	28,781,612,569.01	764,808,320.97	-	-	-127,207,834.99	29,673,628,724.97
负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	427,279,586.36	-	-	-	-	427,279,586.36
应付管理人报酬	-	-	-	-	-4,897,834.88	4,897,834.88
应付托管费	-	-	-	-	-1,224,458.74	1,224,458.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-257,155.30	257,155.30
应付交易费用	-	-	-	-	-278,527.43	278,527.43
应付利息	-	-	-	-	-49,580.11	49,580.11
应交税费	-	-	-	-	-75,522.01	75,522.01
应付利润	-	-	-	-	-2,130,360.62	2,130,360.62
其他负债	-	-	-	-	-173,433.73	173,433.73
负债总计	427,279,586.36	-	-	-	-9,086,872.82	436,366,459.18
利率敏感度缺口	28,354,332,982.65	764,808,320.97	-	-	-118,120,962.17	29,237,262,265.79
上年度末 2018 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	10,977,373,186.27	600,000,000.00	-	-	-	11,577,373,186.27
结算备付金	28,747,727.26	-	-	-	-	28,747,727.26
存出保证金	8,219.73	-	-	-	-	8,219.73
交易性金融资产	10,512,521,328.09	763,509,216.39	-	-	-	11,276,030,544.48
买入返售金融资产	8,366,552,481.80	-	-	-	-	8,366,552,481.80
应收利息	-	-	-	-	-115,707,748.00	115,707,748.00
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	29,885,202,943.15	1,363,509,216.39	-	-	-115,707,748.00	31,364,419,907.54
负债						
卖出回购金融资产款	949,047,376.42	-	-	-	-	949,047,376.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-5,277,906.59	5,277,906.59
应付托管费	-	-	-	-	-1,319,476.62	1,319,476.62
应付销售服务费	-	-	-	-	-269,231.13	269,231.13
应付交易费用	-	-	-	-	-230,261.20	230,261.20
应付利息	-	-	-	-	-515,083.09	515,083.09
应交税费	-	-	-	-	-80,162.72	80,162.72
应付利润	-	-	-	-	-3,011,945.22	3,011,945.22
其他负债	-	-	-	-	-445,580.63	445,580.63
负债总计	949,047,376.42	-	-	-	-11,149,647.20	960,197,023.62
利率敏感度缺口	28,936,155,566.73	1,363,509,216.39	-	-	-104,558,100.80	30,404,222,883.92

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-4,054,994.16	-7,113,355.68
	市场利率下降 25 个基点	4,062,502.50	7,125,056.40

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；同时采用“自下而上”的策略通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金

所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00% (2018 年 12 月 31 日：0.00%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2018 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00% (2018 年 12 月 31 日同)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2018 年 12 月 31 日同)。

§7 投资组合报告

7.1 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	8,499,115,764.65	28.64
	其中: 债券	8,499,115,764.65	28.64
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	11,624,644,770.42	39.18
	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	9,422,660,354.91	31.75
4	其他各项资产	127,207,834.99	0.43
5	合计	29,673,628,724.97	100.00

7.2 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	2.37	
	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	427,279,586.36	1.46
	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

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	39
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	53
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

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。

7.3.2 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	62.92	1.46
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	15.68	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	14.29	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	1.56	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	6.61	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		101.06	1.46

7.4 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。

7.5 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,152,174,692.80	7.36
	其中：政策性金融债	2,152,174,692.80	7.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,260,911,111.68	4.31
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,086,029,960.17	17.40
8	其他	-	-
9	合计	8,499,115,764.65	29.07
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	180312	18 进出 12	3,700,000	370,510,061.23	1.27
2	011901174	19 中电信 SCP006	3,100,000	309,916,378.51	1.06
3	111811294	18 平安银行 CD294	3,000,000	299,595,685.11	1.02
4	111916163	19 上海银行 CD163	3,000,000	299,510,668.50	1.02
5	111808277	18 中信银行 CD277	3,000,000	299,141,935.29	1.02
6	111907092	19 招商银行 CD092	3,000,000	298,277,943.88	1.02
7	180209	18 国开 09	2,900,000	290,073,536.11	0.99
8	111811206	18 平安银行 CD206	2,800,000	279,368,308.17	0.96
9	180410	18 农发 10	2,300,000	230,086,640.36	0.79
10	011900048	19 东航股 SCP001	2,200,000	220,159,019.81	0.75

7.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0454%
报告期内偏离度的最低值	-0.0024%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0221%

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

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

平安银行因未及时披露公司重大事项,未依法履行其他职责,中国人民银行于 2018-07-26 依据相关法规给予:公开处罚处分决定;因未依法履行其他职责,中国银行业监督管理委员会天津监管局于 2018-06-28 依据相关法规给予:公开处罚处分决定。上海银行因未依法履行其他职责,中国银行业监督管理委员会上海监管局于 2018-10-18 依据相关法规给予:公开处罚,责令改正处分决定;因未依法履行其他职责,中国银行业监督管理委员会上海监管局于 2018-10-08 依据相关法规给予:公开处罚,责令改正处分决定。中信银行因信息披露虚假或严重误导性陈述,未依法履行其他职责,中国银行保险监督管理委员会于 2018-11-19 依据相关法规给予:公开处罚处分决定。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-

2	应收证券清算款	-
3	应收利息	105,671,441.29
4	应收申购款	21,536,393.70
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	127,207,834.99

§8 基金份额持有人信息

8.1 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	6,323	10,418.56	5,967,480.50	9.06%	59,909,070.67	90.94%
浦银日日鑫 B	37	788,415,830.12	29,171,385,714.62	100.00%	0.00	0.00%
合计	6,360	4,597,053.82	29,177,353,195.12	99.80%	59,909,070.67	0.20%

8.2 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	6,152,844,843.47	21.04%
2	银行类机构	5,862,140,197.12	20.05%
3	银行类机构	4,902,290,299.68	16.77%

4	银行类机构	3,042,379,116.25	10.41%
5	银行类机构	2,307,029,213.65	7.89%
6	银行类机构	1,000,483,354.13	3.42%
7	银行类机构	728,005,921.69	2.49%
8	银行类机构	604,125,409.98	2.07%
9	银行类机构	551,764,551.97	1.89%
10	银行类机构	528,472,659.26	1.81%

8.3 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	41,096.58	0.06%
	浦银日日鑫 B	0.00	0.00%
	合计	41,096.58	0.00%

8.4 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的情况

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	浦银日日鑫 A	0~10
	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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	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	30,695,700.44	30,373,527,183.48
本报告期期间基金总申购份额	197,270,155.09	36,539,551,128.07
减:本报告期期间基金总赎回份额	162,089,304.36	37,741,692,596.93
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	65,876,551.17	29,171,385,714.62

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。

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

报告期内基金管理人未发生重大人事变动。

自 2019 年 1 月 22 日起,叶文煌先生担任基金托管人资产托管部总经理,全面主持资产托管部相关工作,吴若曼女士不再担任基金托管人资产托管部总经理。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人、托管人及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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
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：

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元的变更情况。

10.7.2 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	成交金额	占当期权证成交总额

				的比例		的比例
招商证券	-	-	112,376,532,000.00	100.00%	-	-

10.8 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

10.9 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招募说明书正文（更新）2018年第2号	公司官网	2019年1月14日
2	浦银安盛日日鑫货币市场基金招募说明书摘要（更新）2018年第2号	报刊及公司官网	2019年1月14日
3	浦银安盛日日鑫货币市场基金2018年第4季度报告	报刊及公司官网	2019年1月21日
4	关于浦银安盛日日鑫货币市场基金于春节假期前一个工作日暂停A类及B类份额的申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及公司官网	2019年1月30日
5	浦银安盛日日鑫货币市场基金基金经理变更公告	报刊及公司官网	2019年3月5日
6	浦银安盛日日鑫货币市场基金2018年年度报告摘要	报刊及公司官网	2019年3月27日
7	浦银安盛日日鑫货币市场基金2018年年度报告	公司官网	2019年3月27日
8	关于浦银安盛日日鑫货币市场基金于清明节假期前一个工作日暂停A类及B类份额的申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及公司官网	2019年4月3日
9	浦银安盛日日鑫货币市场基金2019年第1季度报告	报刊及公司官网	2019年4月19日
10	关于浦银安盛日日鑫货币市场基金于劳动节假期前一个工作日暂停A类及B类份额的申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及公司官网	2019年4月27日
11	浦银安盛基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在上海天	报刊及公司官网	2019年5月15日

	天基金销售有限公司基金定投业务定投起点的公告		
12	浦银安盛基金管理公司关于旗下浦银安盛日日鑫货币市场基金新增上海联泰基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务的公告	报刊及公司官网	2019 年 5 月 15 日
13	关于浦银安盛日日鑫货币市场基金于端午节假期前一个工作日暂停 A 类及 B 类份额的申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及公司官网	2019 年 6 月 5 日
14	关于旗下部分基金新增西藏东方财富证券有限公司为代销机构及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司官网	2019 年 6 月 27 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日	12,092,257,083.46	135,698,604.63	3,032,731,728.37	9,195,223,959.72	31.45 %
	2	2019 年 6 月 18 日-2019 年 6 月 30 日	0.00	5,862,140,197.12	0.00	5,862,140,197.12	20.05 %
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
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 备查文件目录

12.1 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设立的文件
- 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

12.2 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。

12.3 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

2019 年 8 月 23 日