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
报告送出日期:二〇一二年八月二十九日

浦银安盛货币市场证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012年6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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年8月23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2012年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	浦银安盛货币	
基金主代码	519509	
基金运作方式	开放式契约型	
基金合同生效日	2011年3月9日	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	227,870,722.57份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B
下属分级基金的交易代码	519509	519510
报告期末下属分级基金的份额总额	152,414,335.74份	75,456,386.83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	属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浦银安盛基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	朱义明
	联系电话	021-23212812	010-65556812
	电子邮箱	guj@py-axa.com	zhuyiming@citicib.com.cn
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95558
传真		021-23212985	010-65550832

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2012年1月1日至2012年6月30日)	
	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B
本期已实现收益	3,371,719.93	3,017,472.12
本期利润	3,371,719.93	3,017,472.12
本期净值收益率	2.10%	2.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)	
	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B
期末基金资产净值	152,414,335.74	75,456,386.83
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金无持有人认购申购或交易基金的各项费用。

3、本基金收益分配按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 浦银安盛货币A:

阶段	份额净值收益率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
过去一个月	0.4261%	0.0205%	0.0348%	0.0001%	0.3913%	0.0204%
过去三个月	0.9793%	0.0121%	0.1184%	0.0001%	0.8609%	0.0120%
过去六个月	2.1034%	0.0091%	0.2433%	0.0001%	1.8601%	0.0090%
过去一年	4.0802%	0.0075%	0.4963%	0.0001%	3.5839%	0.0074%
自基金合同生效起至今	5.0544%	0.0069%	0.6445%	0.0001%	4.4099%	0.0068%

注:本基金收益分配按月结转份额。

2. 浦银安盛货币B:

阶段	份额净值收益率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
过去一个月	0.4457%	0.0205%	0.0348%	0.0001%	0.4109%	0.0204%
过去三个月	1.0395%	0.0122%	0.1184%	0.0001%	0.9211%	0.0121%
过去六个月	2.2251%	0.0091%	0.2433%	0.0001%	1.9818%	0.0090%
过去一年	4.3303%	0.0075%	0.4963%	0.0001%	3.8340%	0.0074%
自基金合同生效起至今	5.3867%	0.0069%	0.6445%	0.0001%	4.7422%	0.0068%

注:本基金收益分配按月结转份额。

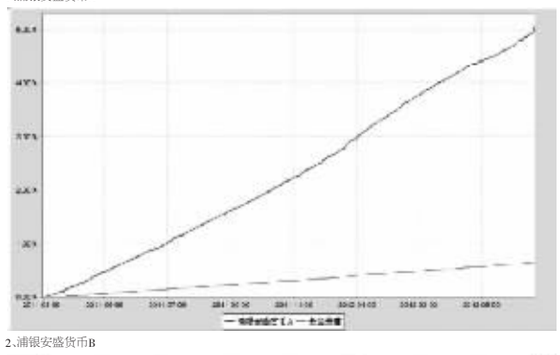
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛货币市场证券投资基金

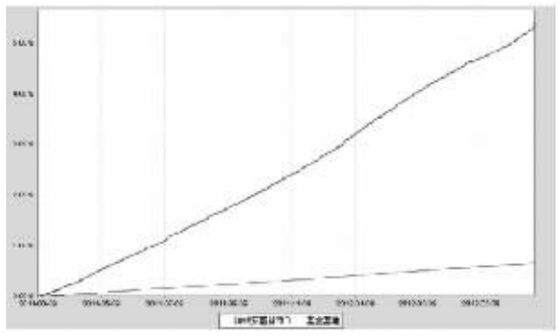
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011年3月9日至2012年6月30日)

1、浦银安盛货币A



2、浦银安盛货币B



注:根据基金合同第十二部分第六条规定:基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为2011年3月9日至2011年9月9日,截止报告期末,建仓已完成,各项资产投资比例符合基金合同要求。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浦银安盛基金管理有限公司(以下简称"浦银安盛")成立于2007年8月,由上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A. 及上海盛融投资有限公司共同创建,公司总部设在上海,注册资本为人民币2亿元,股东持股比例分别为51%、39%和10%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和证监会许可的其他业务。

截至2012年6月30日止,浦银安盛旗下共管理8只基金,即浦银安盛价值成长股票型证券投资基金、浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛红利精选股票型证券投资基金、浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛分级增利债券型证券投资基金和浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

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		
薛铮	本基金基金经理兼浦银安盛增利分级债券型证券投资基金基金经理	2012-02-01	-	6	薛铮,上海财经大学数量经济学硕士。2006年3月至2008年5月,在红顶金融研究中心担任固定收益研究员。2008年6月至2009年6月,在上海证券有限公司固定收益部担任投资经理助理之职。2009年7月进入浦银安盛基金管理公司,任浦银安盛优化收益债券型基金基金经理助理兼固定收益研究员。2011年6月至2012年6月,担任浦银安盛优化收益债券型证券投资基金基金经理。2011年12月起,担任浦银安盛增利分级债券型证券投资基金基金经理。2012年2月起担任本基金基金经理。
周文桐	公司副总经理、首席投资官兼本基金基金经理	2011-03-09	2012-04-26	13	周文桐,美国国籍。北京大学生物学学士,美国西北大学分子生物学博士,芝加哥大学工商管理硕士。1999年至2009年任职美国奥本海默基金公司,先后担任研究员和基金经理之职。2009年10月起任职法国安盛投资管理有限公司(亚太区),2010年1月加盟浦银安盛基金公司任公司副总经理兼首席投资官。2010年6月25日到2011年6月30日,兼任浦银安盛优化收益债券型基金基金经理。2011年3月起,兼任本基金基金经理。

注:1、周文桐作为本基金的首任基金经理,其任职日期为本基金成立之日,其离任日期指公司决定确定的解聘日期。

2、薛铮的任职日期指公司决定确定的聘任日期。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已制定了《公平交易管理规定》,建立健全有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个基金组合。

在具体执行中,在投资决策流程上,构建统一的研究平台,为所有投资组合公平的提供研究支持。同时,在投资决策过程中,严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度,保证公募基金及专户业务的独立投资决策机制;在交易执行环节上,详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规定,以保证投资执行交易过程的公平性;从事后监控角度上,一方面是定期对股票交易情况进行分析,对不同时间窗口(同日、3日、5日)发生的不同组合对同一股票的同向交易及反向交易进行价差分析,并进行统计显著性的检验,以确定交易价差对相关基金的业绩差异的贡献度;同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异的分析;另一方面是公司对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查,并对发现的问题进行及时的报告。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2012年上半年,经济增速回落促使央行货币政策进入降息周期模式,2月底下调存款准备金率,5月中旬再次下调存准,6月初至7月初1个月内两次降息。下调存款准备金和央行积极的公开市场操作,使得银行间市场资金面逐步宽松,即使在传统6月末紧张时点,银行间7天质押式回购利率也未超过5%,其月平均利率由年初的4.45%回落至6月份的3.23%,3月份第一次降准是一个显著的拐点。

通胀上半年延续逐步回落趋势,仅3月份有小幅反弹,基本符合事前预期。短融收益率也随着资金面宽松一路下行,与年初相比平均下降200BP以上,其中低评级短融下降幅度最大。一年期央行票据二级市场收益率下行幅度也超过80BP。报告期内,本基金配置了部分银行存款,并对短融进行了波段操作,获取了较高的收益回报。

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2.1034%,B类净值收益率为2.2251%,同期业绩比较基准收益率为0.2433%,本基金的业绩比较基准为税后活期存款利率。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,政府稳增长为首要目标,财政和货币政策将进一步加大力度,考虑到外汇占款持续增长乏力,货币政策下半年降准和降息可能性都很大,这使得流动性整体维持略宽松局面。下半年通胀预计同比仍处于低位,对于债市不构成压力,4季度通胀可能由于基数效应和季节性因素有所反弹但幅度有限,全年通胀同比水平平均预计在2.7%。

当前货币市场利率中枢处于历史平均水平,银行间7天回购利率在3.15%附近。虽然流动性拐点已过,但利率市场化使得全社会短期资金成本上升,预计回购利率水平维持在目前水平附近。基金将采取相对积极的配置,并密切跟踪经济的各项指标,根据经济环境的变化适时调整策略。

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、监察稽核部负责人、基金会计部负责人组成。估值委员会成员五分之三以上具有5年以上专业工作经历,具备良好的专业经验、胜任能力和独立性。估值委员会的职责主要包括:保证基金估值的公平、合理;制订健全、有效的估值政策和程序;确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性;定期对估值政策和程序进行评价等。

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

本基金基金经理未参与或决定基金的估值。

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签订了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书等有关约定,本基金的收益分配采用"每日分配、按月支付"的方式,即为投资者每日计算当日收益并分配,每月支付。本报告期浦银货币A级基金应分配收益3,371,719.93元,实际分配收益3,371,719.93元;浦银货币B级基金应分配收益3,017,472.12元,实际分配收益3,017,472.12元。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2012年上半年,本基金托管人在对浦银安盛货币市场基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2012年上半年,浦银安盛货币市场基金的管理人——浦银安盛基金管理有限公司在浦银安盛货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上,严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对浦银安盛基金管理有限公司编制和披露的浦银安盛货币市场基金2012年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:浦银安盛货币市场证券投资基金

报告截止日:2012年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资 产:		
银行存款	118,235,417.83	354,642,557.74
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	70,024,060.61	20,002,521.66
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	70,024,060.61	20,002,521.66
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	39,800,379.70	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	518,286.83	1,084,527.82
应收股利	-	-
应收申购款	53,100.00	55,460,136.97
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	228,631,244.97	431,189,744.19
负债和所有者权益	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011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	-	-
应付管理人报酬	73,792.41	55,818.62
应付托管费	22,361.36	16,914.74
应付销售服务费	35,563.36	25,253.87
应付交易费用	16,071.95	11,180.52
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	528,247.20	435,592.05
递延所得税负债	-	-
其他负债	84,486.12	199,000.00
负债合计	760,522.40	743,759.80
所有者权益:		
实收基金	227,870,722.57	430,445,984.39
未分配利润	-	-
所有者权益合计	227,870,722.57	430,445,984.39
负债和所有者权益总计	228,631,244.97	431,189,744.19

注:报告截止日2012年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额227,870,722.57份。其中浦银货币A级的基金份额为152,414,335.74份,浦银货币B级的基金份额为75,456,386.83份。

6.2 利润表

会计主体:浦银安盛货币市场证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年3月9日(基金合同生效日)至2011年6月30日
一、收入	7,348,186.52	14,313,554.80
1.利息收入	6,449,977.51	13,391,173.07
其中:存款利息收入	4,518,868.12	4,895,711.99
债券利息收入	914,969.71	5,467,494.34
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,016,139.68	3,027,966.74
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	897,064.90	903,736.56
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	897,064.90	903,736.56
资产支持证券投资收益	-	-
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)	1,144.11	18,645.17
减:二、费用	958,994.47	2,533,740.31
1.管理人报酬	495,236.48	1,399,887.50
2.托管费	150,071.63	424,208.30
3.销售服务费	209,401.10	606,031.64
4.交易费用	-	-
5.利息支出	833.09	13,887.51
其中:卖出回购金融资产支出	833.09	13,887.51
6.其他费用	103,452.17	89,725.36
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	6,389,192.05	11,779,814.49
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	6,389,192.05	11,779,814.49

注:本基金上年度可比期间为2011年3月9日(基金合同生效日)至2011年6月30日。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:浦银安盛货币市场证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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)	430,445,984.39	-	430,445,984.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,389,192.05	6,389,192.05
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)	-202,575,261.82	-	-202,575,261.82
其中:1.基金申购款	1,469,001,858.61	-	1,469,001,858.61
2.基金赎回款	-1,671,577,120.43	-	-1,671,577,120.43
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)	-	-6,389,192.05	-6,389,192.05
五、期末所有者权益(基金净值)	227,870,722.57	-	227,870,722.57
项目	上年度可比期间 2011年3月9日(基金合同生效日)至2011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)	3,774,407,616.02	-	3,774,407,616.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,779,814.49	11,779,814.49
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)	-3,286,472,974.77	-	-3,286,472,974.77
其中:1.基金申购款	1,404,726,154.40	-	1,404,726,154.40
2.基金赎回款	-4,691,199,129.17	-	-4,691,199,129.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-11,779,814.49	-11,779,814.49
五、期末所有者权益(基金净值)	487,934,641.25	-	487,934,641.25

注:本基金上年度可比期间为2011年3月9日(基金合同生效日)至2011年6月30日。

报告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:

基金管理公司负责人:郁蓓华,主管会计工作负责人:郁蓓华,会计机构负责人:赵迎华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人于2012年8月29日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和138项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2012年1月1日至2012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2012年6月30日的财务状况以及2012年1月1日至2012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 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

2、基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

3、对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。

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
上海浦东发展银行股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金代销机构
浦银安盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

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

无。

6.4.8.1.2权证交易

无。

6.4.8.1.3债券交易

无。

6.4.8.1.4债券回购交易

无。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

无。

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 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年3月9日(基金合同生效日)至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	495,236.48	1,399,887.50
其中:支付销售机构的客户维护费	181,337.73	503,836.31

注:1、本基金上年度可比期间为2011年3月9日(基金合同生效日)至2011年6月30日。

2、支付基金管理人浦银安盛基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.33%/当年天数

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年3月9日(基金合同生效日)至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	150,071.63	424,208.30

注:1、本基金上年度可比期间为2011年3月9日(基金合同生效日)至2011年6月30日。

2、支付基金托管人中信银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金托管费=前一日基金资产净值 X 0.10%/当年天数

6.4.8.2.3销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B	合计
中信银行股份有限公司	45,988.69	318.68	46,307.37
上海浦东发展银行股份有限公司	76,665.02	1,224.33	77,889.35
浦银安盛基金管理有限公司	1,768.83	3,031.59	4,800.42
合计	124,422.54	4,574.60	128,997.14
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2011年3月9日(基金合同生效日)至2011年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B	合计
中信银行股份有限公司	205,975.83	5,353.40	211,329.23
上海浦东发展银行股份有限公司	355,912.12	4,871.34	360,783.46
浦银安盛基金管理有限公司	292.53	3,451.85	3,744.38
合计	562,180.48	13,676.59	575,857.07

注:1、本基金上年度可比期间为2011年3月9日(基金合同生效日)至2011年6月30日。

2、浦银货币A级基金份额的销售服务费按前一日该级基金资产净值0.25%的年费率计提;浦银货币B级基金份额的销售服务费按前一日该级基金资产净值0.01%的年费率计提;各级基金份额的销售服务费逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:

日销售服务费=前一日该级基金份额的基金资产净值 X R/当年天数

其中:R为该级基金份额的年销售服务费率。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2012年1月1日至2012年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2011年3月9日(基金合同生效日)至2011年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中信银行	-	50,591,972.22	-	-	-	-

注:本基金上年度可比期间为2011年3月9日(基金合同生效日)至2011年6月30日。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

浦银安盛货币A

基金管理人在本报告期与上年度可比期间均未持有浦银安盛货币A。

浦银安盛货币B

基金管理人在本报告期与上年度可比期间均未持有浦银安盛货币B。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

浦银安盛货币A

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有浦银安盛货币A。

浦银安盛货币B

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有浦银安盛货币B。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年3月9日(基金合同生效日)至2011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
中信银行-活期存款	20,235,417.83	224,139.20	626,905.64	943,770.07
中信银行-定期存款	15,000,000.00	766,895.91	-	3,296,123.33

注:1、本基金的活期银行存款及部分定期银行存款由基金托管人中信银行保管,按约定利率计息。

2、本基金上年度可比期间为2011年3月9日(基金合同生效日)至2011年6月30日。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2012年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金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。

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他事项。

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	70,024,060.61	30.63
	其中:债券	70,024,060.61	30.63
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	39,800,379.70	17.41
	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	118,235,417.83	51.71
4	其他各项资产	571,386.83	0.25
5	合计	228,631,244.97	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	0.01	
	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	-	-
	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。

7.3 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内,本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

7.4 基金投资组合平均剩余期限

7.4.1 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	94
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	130
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	15

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金基金合同约定投资组合的平均剩余期限不超过120天,本基金本报告期内投资组合平均剩余期限有4次超过120天的记录,主要是由于基金赎回导致的被动超标。

7.4.2 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	32.93	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	17.55	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	32.04	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	-	-
	其中:剩