浦银安盛优化收益债券型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一四年七月十九日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年7月17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2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛优化收益债券	
基金主代码	519111	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年12月30日	
报告期末基金份额总额	134,398,943.49份	
投资目标	本基金通过对宏观经济运行状况、金融市场的运行趋势进行自上而下的分析，通过信用分析为基础进行自下而上的精选个券，在严格控制投资风险的基础上，主要对固定收益市场各种资产定价不合理产生的投资机会进行充分挖掘，力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金在宏观经济和债券市场自上而下和自下而上分析的基础上，把握市场利率的趋势性变化与不同债券的价值差异，通过久期配置、收益率曲线策略等方法，实施积极的债券投资策略。同时，在比较债券类资产与权益类资产投资价值的基础上，通过大类资产配置的调整以获得超越业绩比较基准的投资收益。	
业绩比较基准	中信标普全债指数	
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，属于证券投资基金中的较低收益、较低风险品种。一般情形下，其风险和收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币型基金。本基金力争在科学的风险管理的前提下，谋求实现基金财产的安全和增值。	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	浦银安盛优化收益债券A	浦银安盛优化收益债券C
下属两级基金的交易代码	519111	519112
报告期末下属两级基金的份额总额	86,167,011.16份	48,231,932.33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(2014年4月1日-2014年6月30日)	
	浦银安盛优化收益债券A	浦银安盛优化收益债券C
1.本期已实现收益	2,676,847.66	1,404,479.50
2.本期利润	5,675,512.31	3,041,711.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0592	0.0570
4.期末基金资产净值	108,274,611.56	59,448,730.21
5.期末基金份额净值	1.257	1.233

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回基金等各项交易费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、浦银安盛优化收益债券A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	5.01%	0.13%	2.41%	0.04%	2.60%	0.09%

注：本基金于2009年9月22日开始分为A、C两类。

2、浦银安盛优化收益债券C：

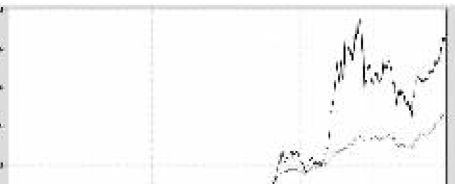
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.94%	0.13%	2.41%	0.04%	2.53%	0.09%

注：本基金于2009年9月22日开始分为A、C两类。

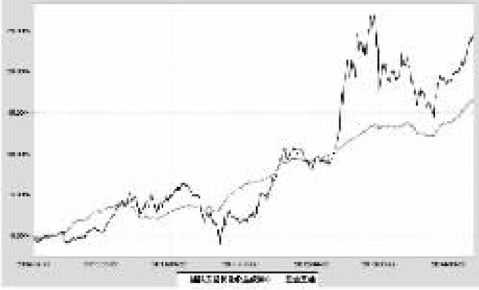
3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛优化收益债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
（2008年12月30日至2014年6月30日）

1. 浦银安盛优化收益债券A：



2. 浦银安盛优化收益债券C：



注：经中国证监会批准，本基金于2009年9月22日分为A、C两类。具体内容详见本基金管理人于2009年9月18日刊登的《关于浦银安盛优化收益债券型证券投资基金增加C类收费模式并修改基金合同的公告》。

§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		
吕栋	本基金基金经理、浦银安盛货币基金基金经理以及浦银安盛日日盈货币基金基金经理	2013-9-26	-	8	吕栋先生，复旦大学理学学士、麻省理工大学-斯隆商学院金融学硕士学位。2006年8月到2010年6月，先后在瑞银集团（UBS）旗下Dillon Read对冲基金及瑞银集团（UBS）固定收益部任分析员，承担相对价值交易策略、资产抵押证券等数量化模型的研发工作。2011年6月，加盟花旗集团（香港）任投资银行部分析员，承担新债定价、公司基本面分析和债务结构分析工作。2011年11月起加盟浦银安盛基金管理公司担任专户投资经理助理。2013年7月起，调任至公司固定收益投资部工作。2013年9月起担任浦银安盛优化收益债券基金基金经理。2014年1月起兼任浦银安盛货币基金基金经理。2014年3月25日起兼任浦银安盛日日盈货币基金基金经理。

注：1、此处的"任职日期"和"离任日期"分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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）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 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

受资金市场宽松和定向刺激政策影响，上半年债券市场各品种收益率均出现了较大幅度的下行，债券市场经历了一轮牛市。在经历了前期的下行后，近期债券市场进入盘整阶段。上半年资金面、基本面和政策面的利好因素已被市场反应，下半年市场走向将取决于政策的宽松预期和新的催化剂。目前来看，政策仍有进一步放松的空间，但政策出台的时间和力度具有很大的不确定性。近期利多利空因素互现，市场虽陷入胶着但仍属于牛市格局，预计债券市场行情将温和持续，后期仍有下行空间，但过程可能有所波折。

二季度内，本基金主要以配置短久期债券和波段操作可转债为主。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金A类净值增长率5.01%，C类净值增长率4.94%，业绩比较基准收益率为2.41%。

§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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	266,933,657.03	87.01
	其中：债券	266,933,657.03	87.01
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	22,016,135.96	7.18
7	其他资产	17,849,889.32	5.82
8	合计	306,799,682.31	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（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	10,230,000.00	6.10
	其中：政策性金融债	10,230,000.00	6.10
4	企业债券	170,689,617.00	101.77
5	企业短期融资券	10,022,000.00	5.98
6	中期票据	41,019,000.00	24.46
7	可转债	34,973,040.03	20.85
8	其他	-	-
9	合计	266,933,657.03	159.15

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	101364016	13连普湾MTN001	100,000	10,623,000.00	6.33
2	1480062	14甘公投债01	100,000	10,286,000.00	6.13
3	018001	国开1301	100,000	10,230,000.00	6.10
4	101353011	13西永MTN003	100,000	10,184,000.00	6.07
5	101461001	14株国投MTN001	100,000	10,175,000.00	6.07

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金为债券型基金，不参与股指期货交易。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为债券型基金，不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金为债券型基金，不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金为债券型基金，不参与国债期货交易。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金为债券型基金，不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体不存在本期被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 报告期内，本基金不存在超出基金合同规定备选股票库投资的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	24,805.24
2	应收证券清算款	11,020,500.23
3	应收股利	-
4	应收利息	5,947,322.30
5	应收申购款	857,261.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,849,889.32

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	127001	海直转债	7,141,526.13	4.26
2	113003	重工转债	5,734,780.00	3.42
3	110016	川投转债	3,925,552.00	2.34
4	110023	民生转债	2,320,000.00	1.38
5	110018	国电转债	2,087,200.00	1.24
6	128003	华天转债	2,076,482.00	1.24
7	113005	平安转债	1,709,120.00	1.02
8	110022	同仁转债	1,449,194.60	0.86
9	110012	海运转债	1,024,500.00	0.61
10	110011	歌华转债	970,206.60	0.58
11	125887	中鼎转债	969,206.00	0.58
12	125089	深机转债	868,779.00	0.52
13	110024	隧道转债	863,200.00	0.51
14	113006	深燃转债	780,063.70	0.47
15	110017	中海转债	702,300.00	0.42
16	110020	南山转债	475,200.00	0.28

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银安盛优化收益债券A	浦银安盛优化收益债券C
报告期期初基金份额总额	105,177,249.81	58,520,869.69
报告期期间基金总申购份额	2,919,320.82	3,468,263.06
减：报告期期间基金总赎回份额	21,929,559.47	13,757,200.42
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	86,167,011.16	48,231,932.33

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2014年4月25日发布《浦银安盛基金管理有限公司关于董事会换届的公告》，披露公司第三届董事会成员情况，其中新增霍佳震先生、董叶顺先生为公司独立董事，新增汪素南先生为公司董事，原董事林道峰先生、独立董事谢百三先生不再连任。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、 中国证监会批准浦银安盛优化收益债券型证券投资基金设立的文件
2、 浦银安盛优化收益债券型证券投资基金基金合同
3、 浦银安盛优化收益债券型证券投资基金招募说明书
4、 浦银安盛优化收益债券型证券投资基金托管协议
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
二〇一四年七月十九日

浦银安盛货币市场证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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：中信银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一四年七月十九日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年7月17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2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

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	
报告期末基金份额总额	640,376,658.86份	
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。	
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	
下属两级基金的基金简称	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B
下属两级基金的交易代码	519509	519510
报告期末下属两级基金的份额总额	197,618,551.03份	442,758,107.83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(2014年4月1日-2014年6月30日)	
	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B
1.本期已实现收益	3,626,764.10	10,468,659.09
2.本期利润	3,626,764.10	10,468,659.09
3.期末基金资产净值	197,618,551.03	442,758,107.83

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、本基金收益分配按月结转份额。

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

1. 浦银安盛货币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	1.2172%	0.0112%	0.0873%	0.0000%	1.1299%	0.0112%

注：本基金收益分配按月结转份额。

2. 浦银安盛货币B

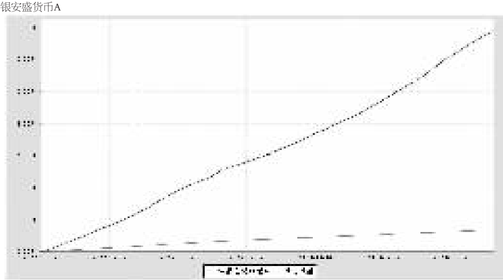
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.2779%	0.0112%	0.0873%	0.0000%	1.1906%	0.0112%

注：本基金收益分配按月结转份额。

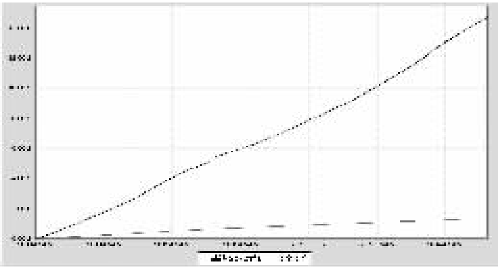
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛货币市场证券投资基金
累计净值收益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2014年6月30日）

1、 浦银安盛货币A



2、 浦银安盛货币B



§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		
吕栋	本基金基金经理、浦银安盛优化收益债券基金基金经理以及浦银安盛日日盈货币基金基金经理	2014-1-7	-	8	吕栋先生，复旦大学理学学士、麻省理工大学-斯隆商学院金融学硕士学位。2006年8月到2010年6月，先后在瑞银集团（UBS）旗下Dillon Read 对冲基金及瑞银集团(UBS)固定收益部任分析员，承担相对价值交易策略、资产抵押证券等数量化模型的研发工作。2011年6月，加盟花旗集团（香港）任投资银行部分析员，承担新债定价、公司基本面分析和债务结构分析工作。2011年11月起加盟浦银安盛基金管理公司担任专户投资经理助理。2013年7月起，调任至公司固定收益投资部工作。2013年9月起担任浦银安盛优化收益债券基金基金经理。2014年1月起兼任浦银安盛货币基金基金经理。2014年3月25日起兼任浦银安盛日日盈货币基金基金经理。
康佳燕	本基金基金经理	2014-6-19	-	8	康佳燕女士，香港大学工商管理硕士。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。

注：1、此处的任职日期和离任日期分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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）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 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

受资金市场宽松和定向刺激政策影响，上半年债券市场各品种收益率均出现了较大幅度的下行，债券市场经历了一轮牛市。在经历了前期的下行后，近期债券市场进入盘整阶段。上半年资金面、基本面和政策面的利好因素已被市场反应，下半年市场走向将取决于政策的宽松预期和新的催化剂。目前来看，政策仍有进一步放松的空间，但政策出台的时间和力度具有很大的不确定性。近期利多利空因素互现，市场虽陷入胶着但仍属于牛市格局，预计债券市场行情将温和持续，后期仍有下行空间，但过程可能有所波折。

本基金在二季度配置了部分银行存款，增持中高评级短融。

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1.2172%，B类净值收益率为1.2779%，同期业绩比较基准收益率为0.0873%。

§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	590,163,236.75	71.53
	其中：债券	590,163,236.75	71.53
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	189,035,070.34	22.91
4	其他资产	45,893,091.41	5.56
5	合计	825,091,398.50	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额		5.67
	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	182,423,388.79	28.49
	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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例（%）	原因	调整期
1	2014-06-30	28.39	巨额赎回	4个交易日

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	123
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	126
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	90

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期
1	2014-06-26	124	巨额赎回	6个交易日
2	2014-06-27	126	巨额赎回	5个交易日
3	2014-06-30	123	巨额赎回	4个交易日

注：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。

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	21.72	28.49
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	17.18	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	20.30	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	21.84	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.06	-
5	180天(含)—397天（含）	45.33	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	126.37	28.49

5.4 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	89,729,360.76	14.01
	其中：政策性金融债	89,729,360.76	14.01
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	500,433,875.99	78.15
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	590,163,236.75	92.16
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	19,620,764.29	3.06

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	041356039	13陕交建CP001	500,000	50,175,983.49	7.84
2	011481001	14淮南矿SCP001	500,000	50,006,885.10	7.81
3	011488002	14豫投资SCP002	500,000	50,001,358.73	7.81
4	011467003	14神华能源SCP003	500,000	49,943,689.05	7.80
5	140204	14国开04	400,000	40,117,343.77	6.26
6	041464034	14鄂联投CP001	400,000	40,001,255.50	6.25
7	011489001	14鞍钢股SCP001	300,000	30,001,942.74	4.69
8	011494001	14凤传媒SCP001	300,000	30,000,941.13	4.68
9	011420005	14中铝SCP005	300,000	30,000,917.29	4.68
10	041453010	14天原CP001	300,000	30,000,314.34	4.68

5.6 "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	6次
报告期内偏离度的最高值	0.3601%
报告期内偏离度的最低值	0.1174%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2100%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

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。

5.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券，但未发生其摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体不存在本期被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	30,052,875.62
3	应收利息	11,417,223.38
4	应收申购款	4,422,992.41
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	45,893,091.41

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银安盛货币A	浦银安盛货币B
报告期期初基金份额总额	318,990,663.49	643,351,685.04
报告期期间基金总申购份额	508,670,465.22	1,592,095,924.28
减：报告期期间基金总赎回份额	630,042,577.68	1,792,689,501.49
报告期期末基金份额总额	197,618,551.03	442,758,107.83

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2014年4月25日发布《浦银安盛基金管理有限公司关于董事会换届的公告》，披露公司第三届董事会成员情况，其中新增霍佳震先生、董叶顺先生为公司独立董事，新增汪素南先生为公司董事，原董事林道峰先生、独立董事谢百三先生不再连任。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准浦银安盛货币市场证券投资基金设立的文件
2、浦银安盛货币市场证券投资基金基金合同
3、浦银安盛货币市场证券投资基金招募说明书
4、浦银安盛货币市场证券投资基金托管协议
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
二〇一四年七月十九日

浦银安盛日日盈货币市场基金

2014 第二季度 报告

2014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：交通银行股份有限公司
报告送出日期：2014年07月19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2014年7月17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2014年4月1日起至6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03月25日		
报告期末基金份额总额	2,403,473,912.99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 本基金将根据具体投资品种的市场特性采用持续投资的方法，既能提高基金资产变现能力的稳定性，又能保证基金资产收益率与市场利率的基本一致。 （2）久期控制策略 本基金将根据对货币市场利率趋势的判断来配置基金资产的久期。在预期利率上升时，缩短基金资产的久期，以规避资本损失或获得较高的再投资收益；在预期利率下降时，延长基金资产的久期，以获取资本利得或锁定较高的收益率。 （3）套利策略 套利策略包括跨市场套利和跨品种套利。跨市场套利是利用同一金融工具在各个子市场的不同表现进行套利。跨品种套利是利用不同金融工具的收益率差别，在满足基金自身流动性、安全性需要的基础上寻求更高的收益率。 （4）时机选择策略 股票、债券发行以及年末效应等因素可能会使市场资金供求情况发生暂时失衡，从而推高市场利率。充分利用这种失衡就能提高基金资产的收益率。		
业绩比较基准	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		
下属三级基金的基金简称	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
下属三级基金的交易代码	519566	519567	519568
报告期末下属三级基金的份额总额	83,331,014.22	2,314,540,339.67	5,602,559.10

§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（2014年04月01日-2014年06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	1,700,895.09	31,610,918.85	20,577.85
2.本期利润	1,700,895.09	31,610,918.85	20,577.85
3.期末基金资产净值	83,331,014.22	2,314,540,339.67	5,602,559.10

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

1、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	1.1304%	0.0029%	0.0873%	0.0000%	1.0431%	0.0029%

2、浦银安盛日日盈货币B

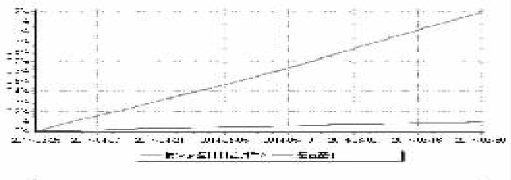
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1920%	0.0029%	0.0873%	0.0000%	1.1047%	0.0029%

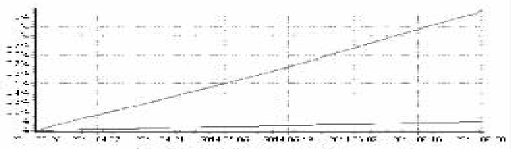
3、浦银安盛日日盈货币D

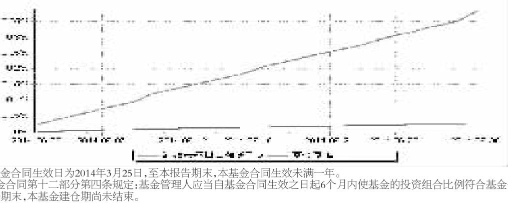
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效日起至今（2014年06月03日-2014年06月30日）	0.3832%	0.0044%	0.0269%	0.0000%	0.3563%	0.0044%

注：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







注：1、本基金合同生效日为2014年3月25日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

2、根据基金合同第十二部分第四条规定：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。截止报告期末，本基金建仓期尚未结束。

§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		
吕栋	本基金基金经理、浦银安盛优化收益债券基金基金经理以及浦银安盛货币基金基金经理	2014年03月25日	-	8	吕栋先生，复旦大学理学学士、麻省理工大学-斯隆商学院金融学硕士学位。2006年8月到2010年6月，先后在瑞银集团（UBS）旗下Dillon Read 对冲基金及瑞银集团(UBS)固定收益部任分析员，承担相对价值交易策略、资产抵押证券等数量化模型的研发工作。2011年6月，加盟花旗集团（香港）任投资银行部分析员，承担新债定价、公司基本面分析和债务结构分析工作。2011年11月起加盟浦银安盛基金管理公司担任专户投资经理助理。2013年7月起，调任至公司固定收益投资部工作。2013年9月起担任浦银安盛优化收益债券基金基金经理。2014年1月起兼任浦银安盛货币基金基金经理。2014年3月25日起兼任浦银安盛日日盈货币基金基金经理。

注：1、吕栋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。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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）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 报告期内基金的投资策略和运作分析

受资金市场宽松和定向刺激政策影响，二季度债券市场各品种收益率延续了一季度下行的趋势。在经历了前期的下行后，基本面和政策面的利好因素已被市场反应，下一季度市场走向将取决于货币政策的宽松预期、基本面的边际变化和新的催化剂。值得注意的是，由于房地产行业前景仍尚不明朗，经济的触底回升只能说是阶段性。若下半年房地产行业进一步恶化，经济不排除出现再次探底的可能性，政策仍有进一步放松的空间，但政策出台的时间和力度具有很大的不确定性。本季度本基金根据货币基金自身规模和市场情况进行配置及调整，在关键时点进行了高收益同业存款，同时配置了部份中高等级短融，在满足流动性的情况下，实现收益的最大化。

4.5 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1.1304%，B类净值收益率为1.1920%，同期业绩比较基准收益率为0.0873%；D类净值收益率为0.3832%，同期业绩比较基准收益率为0.0269%。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	1,111,997,517.23	39.32
	其中：债券	1,111,997,517.23	39.32
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	80,000,320.00	2.83
	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	1,604,828,163.59	56.74
4	其他资产	31,479,553.04	1.11
5	合计	2,828,305,553.86	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额		4.95
	其中：买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	422,899,171.45	17.60
	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

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	106
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	121
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	63

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期
1	2014年05月13日	121.00	赎回	1个交易日

注：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。

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	65.94	17.60
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	2.08	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	8.74	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	5.41	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天（含）	34.20	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	116.37	17.60

5.4 报告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	260,030,109.95	10.82
	其中：政策性金融债	210,036,274.12	8.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	851,967,407.28	35.45
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,111,997,517.23	46.27
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	140207	14国开07	1,300,000	130,114,064.33	5.41
2	110418	11农发18	600,000	59,877,361.78	2.49
3	041454010	14洋河CP001	500,000	50,375,108.54	2.10
4	041460013	14鲁信CP001	500,000	50,370,855.86	2.10
5	041456014	14中铝业CP002	500,000	50,264,645.30	2.09
6	041451024	14青岛港CP001	500,000	50,123,484.11	2.09
7	011470001	14赣高速SCP001	500,000	50,084,284.06	2.08
8	011481001	14淮南矿SCP001	500,000	50,007,992.44	2.08
9	011415005	14中铝业SCP005	500,000	50,004,239.84	2.08
10	041456007	14奇瑞CP001	300,000	30,273,554.26	1.26

5.6 "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	0.1211%
报告期内偏离度的最低值	0.0001%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0733%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明。

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。

5.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券说明

本报告期内本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

5.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体不存在本期被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.4 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	26,186,008.67
4	应收申购款	5,293,544.37
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	31,479,553.04

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	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
基金合同生效日基金份额总额	809,224,203.79	1,221,379,122.72	-
本报告期期初基金份额总额	348,976,781.75	2,825,301,267.03	-
本报告期基金总申购份额	247,323,776.52	903,526,019.99	13,549,545.41
减：本报告期基金总赎回份额	512,969,544.05	1,414,286,947.35	7,946,986.31
本报告期期末基金份额总额	83,331,014.22	2,314,540,339.67	5,602,559.10

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2014年4月25日发布《浦银安盛基金管理有限公司关于董事会换届的公告》，披露公司第三届董事会成员情况，其中新增霍佳震先生、董叶顺先生为公司独立董事，新增汪素南先生为公司董事，原董事林道峰先生、独立董事谢百三先生不再续任。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准浦银安盛日日盈货币市场基金设立的文件
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
二〇一四年七月十九日