

# 浦银安盛日日盈货币市场基金

## 2023 年中期报告

2023 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

送出日期：2023 年 8 月 31 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。本中期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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 30 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§4 管理人报告</b>	<b>11</b>
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遵规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	17
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	18
<b>§5 托管人报告</b>	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>18</b>
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	20
6.3 净资产（基金净值）变动表	21
6.4 报表附注	24
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>47</b>
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 债券回购融资情况	48
7.3 基金投资组合平均剩余期限	48
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	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	49

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 .....	50
7.8 期末按实际利率计算的账面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.....	50
7.9 投资组合报告附注.....	50
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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情况 .....	52
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	57
10.9 其他重大事件.....	58
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>58</b>
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 .....	58
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛日日盈货币市场基金			
基金简称	浦银安盛日日盈货币			
基金主代码	519566			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2014 年 3 月 25 日			
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			
报告期末基金份额总额	28,440,566,030.77 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	浦银安盛日日盈货币 E
下属分级基金的交易代码	519566	519567	519568	007961
报告期末下属分级基金的份额总额	24,444,078.97 份	1,560,468,174.09 份	254,053,127.41 份	26,601,600,650.30 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	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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛香	陆志俊
	联系电话	021-23212888	95559
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95559
传真		021-23212985	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区滨江大道 5189 号地下 1 层、地上 1 层至地上 4 层、地上 6 层至地上 7 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200127	200336
法定代表人		谢伟	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金中期报告备置地点	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	中国证券登记结算有限责任公司（A、B、D 类份额） 浦银安盛基金管理有限公司（E 类份额）	北京市西城区太平桥大街 17 号（A、B、D 类份额） 上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层（E 类份额）

## § 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 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	浦银安盛日日盈货 币 E
本期已实现收益	509,996.68	7,619,643.95	2,559,293.57	109,665,759.21
本期利润	509,996.68	7,619,643.95	2,559,293.57	109,665,759.21

本期净值收益率	0.9736%	1.0935%	0.9732%	0.9735%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)			
期末基金资产净值	24,444,078.97	1,560,468,174.09	254,053,127.41	26,601,600,650.30
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)			
累计净值收益率	27.8428%	30.7191%	26.8061%	3.6582%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

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

浦银安盛日日盈货币 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
过去一个月	0.1582%	0.0012%	0.0288%	0.0000%	0.1294%	0.0012%
过去三个月	0.4934%	0.0012%	0.0873%	0.0000%	0.4061%	0.0012%
过去六个月	0.9736%	0.0016%	0.1737%	0.0000%	0.7999%	0.0016%

过去一年	1.7850%	0.0039%	0.3506%	0.0000%	1.4344%	0.0039%
过去三年	5.9532%	0.0032%	1.0550%	0.0000%	4.8982%	0.0032%
自基金合同生效起至今	27.8428%	0.0034%	3.2971%	0.0000%	24.5457%	0.0034%

## 浦银安盛日日盈货币 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
过去一个月	0.1779%	0.0012%	0.0288%	0.0000%	0.1491%	0.0012%
过去三个月	0.5531%	0.0012%	0.0873%	0.0000%	0.4658%	0.0012%
过去六个月	1.0935%	0.0016%	0.1737%	0.0000%	0.9198%	0.0016%
过去一年	2.0291%	0.0039%	0.3506%	0.0000%	1.6785%	0.0039%
过去三年	6.7172%	0.0032%	1.0550%	0.0000%	5.6622%	0.0032%
自基金合同生效起至今	30.7191%	0.0034%	3.2971%	0.0000%	27.4220%	0.0034%

## 浦银安盛日日盈货币 D

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	0.1582%	0.0012%	0.0288%	0.0000%	0.1294%	0.0012%
过去三个月	0.4929%	0.0012%	0.0873%	0.0000%	0.4056%	0.0012%
过去六个月	0.9732%	0.0016%	0.1737%	0.0000%	0.7995%	0.0016%
过去一年	1.7846%	0.0039%	0.3506%	0.0000%	1.4340%	0.0039%
过去三年	5.9515%	0.0032%	1.0550%	0.0000%	4.8965%	0.0032%
自基金合同生效起至今	26.8061%	0.0034%	3.2318%	0.0000%	23.5743%	0.0034%

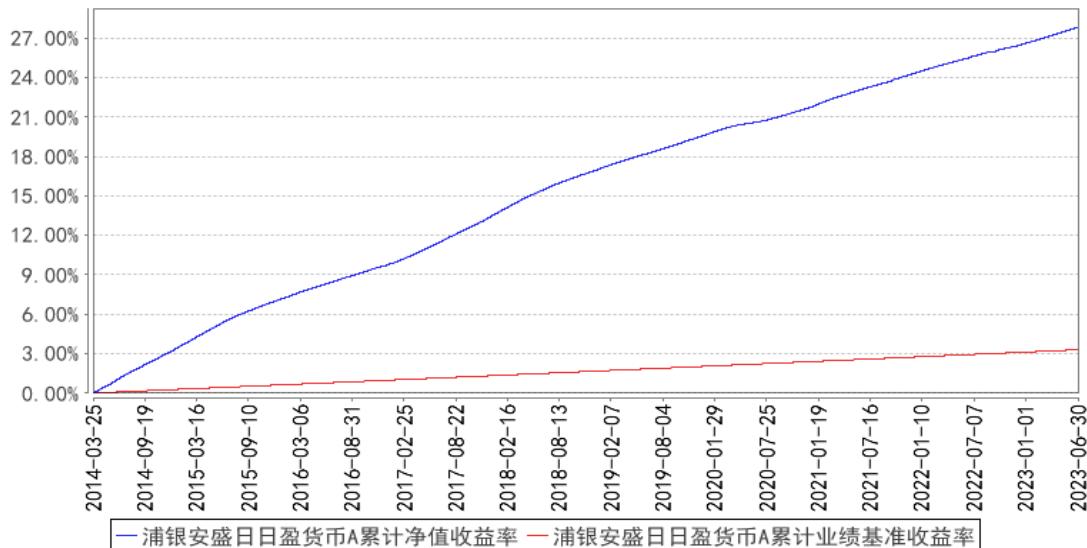
## 浦银安盛日日盈货币 E

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

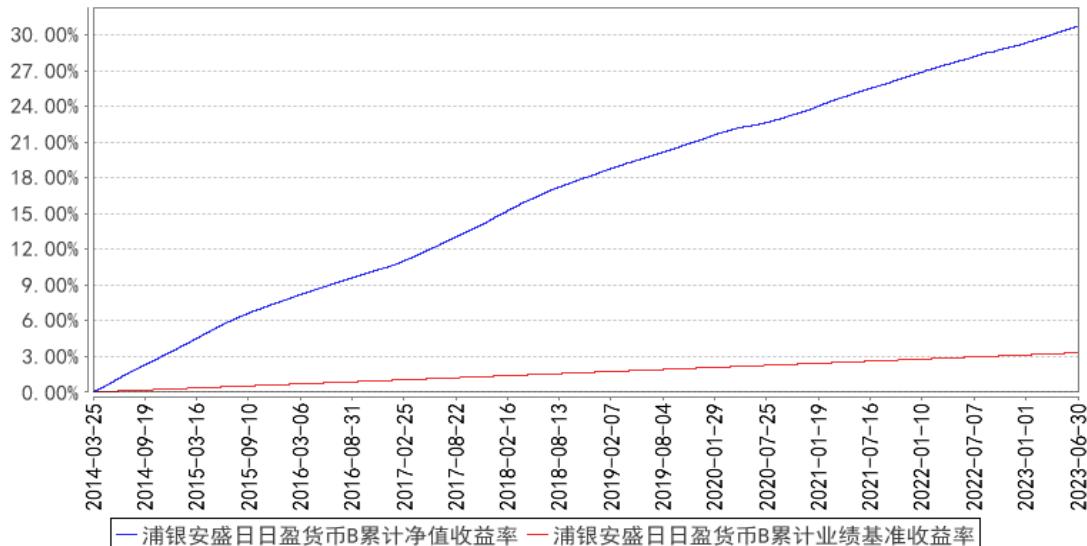
		准差②		准差④		
过去一个月	0.1586%	0.0012%	0.0288%	0.0000%	0.1298%	0.0012%
过去三个月	0.4934%	0.0012%	0.0873%	0.0000%	0.4061%	0.0012%
过去六个月	0.9735%	0.0016%	0.1737%	0.0000%	0.7998%	0.0016%
过去一年	1.7865%	0.0038%	0.3506%	0.0000%	1.4359%	0.0038%
自基金合同生效起至今	3.6582%	0.0037%	0.6918%	0.0000%	2.9664%	0.0037%

### 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

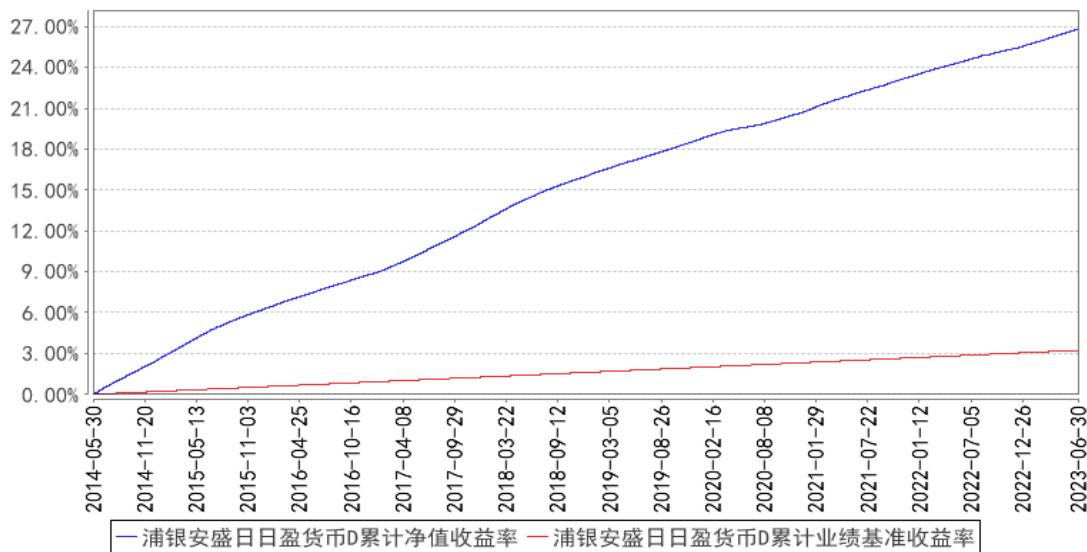
浦银安盛日日盈货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



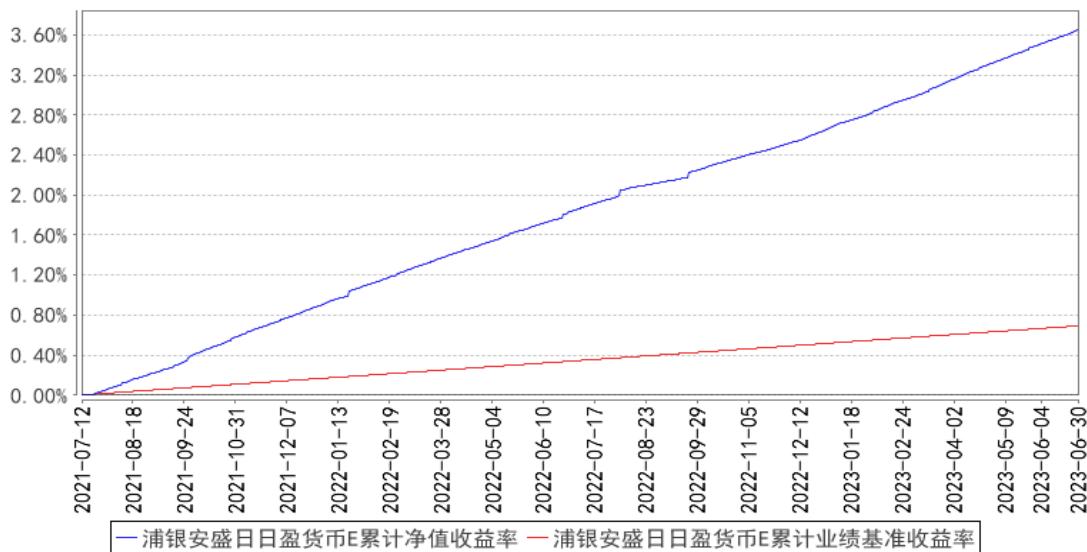
浦银安盛日日盈货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



浦银安盛日日盈货币D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



浦银安盛日日盈货币E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



注：1、自 2014 年 5 月 30 日起，本基金增加 D 级基金份额类别，具体内容详见本基金管理人于 2014 年 5 月 28 日刊登的《关于浦银安盛日日盈货币市场基金增加基金份额类别的公告》。

2、自 2021 年 7 月 12 日起，本基金增加 E 级基金份额类别，具体内容详见本基金管理人于 2021 年 7 月 8 日刊登的《关于浦银安盛日日盈货币市场基金调整托管费率并修改基金合同和托管协议及新增 E 类基金份额的公告》。

## § 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 120,000 万元人民币，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 2023 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 103 只公募基金，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 个月持有期债券型证券投资基金（原浦银安盛 6 个月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、浦银安盛盛鑫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、浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金、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、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛全球智能科技股票型证券投资基金（QDII）、浦银安盛双债增强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、浦银安盛环保新能源混合型证券投资基金、浦银安盛上海清算所高等级优选短期融资券指数证券投资基金、浦银安盛盛煊 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普丰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛诺 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛颐和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金

(FOF)、浦银安盛先进制造混合型证券投资基金、浦银安盛盛智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛晖一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛熙一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛科技创新优选混合型证券投资基金（原浦银安盛科技创新优选三年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金）、浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛普嘉 87 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、浦银安盛安远回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛价值精选混合型证券投资基金、浦银安盛普华 66 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛普天纯债债券型证券投资基金、浦银安盛普庆纯债债券型证券投资基金、浦银安盛睿和优选 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛中债 3-5 年农发行债券指数证券投资基金、浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、浦银安盛稳健丰利债券型证券投资基金、浦银安盛 ESG 责任投资混合型证券投资基金、浦银安盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛均衡优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、浦银安盛鑫福混合型证券投资基金、浦银安盛季季鑫 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银安盛嘉和稳健一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛中证 ESG 120 策略交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛双月鑫 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银安盛中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛鑫锐混合型证券投资基金、浦银安盛中证沪港深游戏及文化传媒交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛 CFETS 0-5 年期央企债券指数发起式证券投资基金、浦银安盛颐享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛盛瑞纯债债券型证券投资基金、浦银安盛品质优选混合型证券投资基金、浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛兴荣稳健一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛泰和配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛安弘回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF)、浦银安盛普裕一年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛中证沪港深消费龙头交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛兴耀优选一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛稳鑫 120 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、浦银安盛盛嘉一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普诚纯债债券型证券投资基金、浦银安盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、浦银安盛季季盈 90 天滚动持有

中短债债券型证券投资基金、浦银安盛中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛普旭 3 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛光耀优选混合型证券投资基金、浦银安盛中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛安荣回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛景气优选混合型证券投资基金、浦银安盛普兴 3 个月定期开放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。当前公司顺利完成上交所金桥机房搬迁，新职场大楼信息技术相关系统建设，结合合肥异地灾备中心，初步形成两地三中心的布局，进一步完善了公司信息技术基础设施系统建设，这些系统由公司信息技术部主导并聘请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、XBRL 系统、反洗钱系统等。这些系统也主要是采购行业内主流的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。近年，公司信息技术部以自主开发平台为基础，构建了数字化运营平台、大数据开发平台、创新研发平台、移动平台等业务应用平台，初步创建了公司自研团队。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		
曹治国	公司固定收益投资部总监助理，公司旗下部分基金经理。	2019 年 3 月 1 日	-	9 年	曹治国先生，华南理工大学经济与贸易学院金融学学士。2008 年 7 月至 2011 年 2 月先后任职农业银行广东省分行对公客户经理、资产负债管理部票据及流动性管理岗。2011 年 3 月至 2014 年 4 月先后任职浦发银行总行金融市场部票据管理岗、流动性管理主管。2014 年 4 月至 2018 年 9 月先后任职东方证券资产管理总部资金部负责人、资金管理总部总经理助理、董事等职。2018 年 9

					月加盟浦银安盛基金管理有限公司，2018年9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，现任固定收益投资部总监助理。2020年8月至2021年12月担任浦银安盛普天纯债债券型证券投资基金的基金经理。2020年3月至2022年3月担任浦银安盛盛晖一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2020年9月至2023年1月担任浦银安盛盛毅一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2020年8月至2023年2月担任浦银安盛普庆纯债债券型证券投资基金的基金经理。2019年3月起担任浦银安盛日日盈货币市场基金以及浦银安盛日日丰货币市场基金基金经理。2020年3月起担任浦银安盛盛智一年定期开放债券型发起式证券投资基金以及浦银安盛盛熙一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2021年4月起担任浦银安盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2021年6月起担任浦银安盛季季鑫90天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。2022年6月起担任浦银安盛稳鑫120天滚动持有中短债债券型证券投资基金的基金经理。2023年1月起担任浦银安盛普旭3个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2023年2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。
王 茂 青	本基金的基金经理助理	2018 年 1 月 22 日	-	12 年	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经理助理。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期。  
 2、证券从业含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和

基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 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。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，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。在交易执行环节上，详细规定了面对多个投资组合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。公司严格控制主动投资组合的同日反向交易，非经特别控制流程审批同意，不得进行。从事后监控角度上，定期对组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1 日、3 日、5 日、10 日）的季度公平性交易分析评估，对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异进行分析。公司定期对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行检查，季度公平交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 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

2023 年一季度，债券市场整体呈现区间震荡的行情，十年国债在 2.8%至 2.95%的点位来回波动。区间震荡的主要原因是来自于市场对于经济复苏斜率的考量带来的变化。春节前较为乐观，春节后喜忧参半：政府工作报告中提及的经济增速目标及财政赤字率又明显低于预期，与此同时通胀及进出口数据表明了国内整体消费内需仍不达预期，但是金融数据，特别是信贷投放好于预期。因此市场并没有走出明显的趋势。二季度债券市场利率重归下行。整个二季度，市场关注到部分行业高频数据走弱，对于经济修复韧性和速度的预期产生摇摆，利率跌破之前的横盘位置开

始下行；4月末的政治局会议表态总量政策不刺激的态度，进一步加速了利率的下行；5月部分高频数据继续走弱，利率继续下行并短暂突破了2.7%的位置；在前两个月经济数据略显疲弱的状态下，6月13日中央银行宣布降息，导致10年期国债利率创出了年内最低水平（2.60%），随着宽信用及刺激政策的预期升温，利率开始触底反弹，但反弹更多的是降息激发出的止盈盘，在基本面变化不大的情况下，利率上行幅度有限。

从资金面来看，一季度受降准影响，央行整体呈小量净投放姿态。但是由于经济的复苏，一些缴准、缴税的时点较去年出现了较为明显的波动。一季度DR007整体均值位于政策利率附近，市场资金面整体合理充裕，但资金日间波动较大。二季度以来，银行间资金面呈现出边际偏松的局面。但是由于非银机构的杠杆大幅增加，资金面也出现了明显的流动性分层，具体表现为流动性向大行聚集，押利率债的资金可得性明显优于押非利率债的资金可得性。

基于对经济基本面、货币政策及资金面的预判，本基金在2023年上半年灵活调整配置策略，并在关键时点保持合理的组合剩余期限和较高的杠杆水平，在类属配置方面以利率债、高等级信用债、存款、存单为主，分析适当时机，配置收益率较高的短期资产，在保证组合良好流动性的基础上，提高组合整体收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛日日盈货币A的基金份额净值为1.000，本报告期基金份额净值增长率为0.9736%，同期业绩比较基准收益率为0.1737%；截至本报告期末浦银安盛日日盈货币B的基金份额净值为1.000，本报告期基金份额净值增长率为1.0935%，同期业绩比较基准收益率为0.1737%；截至本报告期末浦银安盛日日盈货币D的基金份额净值为1.000，本报告期基金份额净值增长率为0.9732%，同期业绩比较基准收益率为0.1737%；截至本报告期末浦银安盛日日盈货币E的基金份额净值为1.000，本报告期基金份额净值增长率为0.9735%，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

下半年，市场预计将继续围绕增量政策展开预期与现实之间的博弈。截至目前，除了6月降息时点超预期以外，至今市场仍然没有感受到政策端的力度。7月是重要的政策窗口观察期。增量政策的出台力度和实施效果如何，我们认为是一个值得关注的重要因素。尽管考虑到高质量发展目标下政策出台强调延续性和协调性，进一步经济强刺激的诉求或有所减弱，但由此带动的经济金融边际修复，以至于对资金面形成的扰动也仍需警惕，但更多是在节奏和空间的约束上。预计三季度将在低位（10年国债2.60%-2.70%）产生区间震荡行情，但货币政策合理充裕的基调不易改变。目前短端利率远低于政策利率，因此短端仍需关注DR001和DR007，以及央行在关键时

点 OMO 和 MLF 上的操作变化。

#### 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。

根据投资品种条线的不同，估值委员会下设固定收益品种估值委员会和权益品种估值委员会。权益品种估值委员会由公司基金运营条线分管领导、权益投研条线分管领导、基金运营部主要负责人、风险管理部负责人、所涉及投资品种的投资部门负责人（包括但不限于权益投资部、权益专户部、指数与量化投资部、FOF 业务部等）及一名基金会计业务骨干组成。固定收益品种估值委员会由公司基金运营条线分管领导、固定收益投研条线分管领导、基金运营部主要负责人、风险管理部负责人、所涉及投资品种的投资部门负责人（包括但不限于固定收益投资部、固定收益专户部等）及一名基金会计业务骨干组成。

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规定，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盈货币 A 级基金应分配收益 509,996.68 元，实际分配收益 509,996.68 元；浦银安盛日日盈货币 B 级基金应分配收益 7,619,643.95 元，实际分配收益 7,619,643.95 元；浦银安盛日日盈货币 D 级基金应分配收益 2,559,293.57 元，实际分配收益 2,559,293.57 元；浦银安盛日日盈货币 E 级基金应分配收益 109,665,759.21 元，实际分配收益 109,665,759.21 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

本报告期内，基金托管人在浦银安盛日日盈货币市场基金的托管过程中，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、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，浦银安盛基金管理有限公司在浦银安盛日日盈货币市场基金投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由浦银安盛基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关浦银安盛日日盈货币市场基金的中期报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：浦银安盛日日盈货币市场基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6. 4. 7. 1	3,422,422,704.34	2,594,240,644.02
结算备付金		1,600,164.80	282,412.43
存出保证金		91,476.30	2,353.84
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	17,053,907,487.48	3,859,787,763.21
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		17,053,907,487.48	3,859,787,763.21
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6. 4. 7. 3	-	-
买入返售金融资产	6. 4. 7. 4	9, 565, 630, 451. 73	1, 843, 496, 722. 15
债权投资	6. 4. 7. 5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6. 4. 7. 6	-	-
其他权益工具投资	6. 4. 7. 7	-	-
应收清算款		-	136, 909. 59
应收股利		-	-
应收申购款		836, 095. 63	251, 156. 02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 8	-	-
资产总计		30, 044, 488, 380. 28	8, 298, 197, 961. 26
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		1, 594, 292, 666. 57	327, 058, 618. 04
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	2, 000. 12
应付管理人报酬		4, 076, 202. 56	1, 546, 065. 66
应付托管费		617, 606. 45	234, 252. 38
应付销售服务费		2, 779, 976. 76	1, 139, 034. 63
应付投资顾问费		-	-
应交税费		53, 617. 65	4, 999. 65
应付利润		1, 765, 964. 16	476, 294. 25
递延所得税负债		-	-
其他负债	6. 4. 7. 9	336, 315. 36	256, 008. 23
负债合计		1, 603, 922, 349. 51	330, 717, 272. 96
<b>净资产：</b>			
实收基金	6. 4. 7. 10	28, 440, 566, 030. 77	7, 967, 480, 688. 30
其他综合收益	6. 4. 7. 11	-	-
未分配利润	6. 4. 7. 12	-	-
净资产合计		28, 440, 566, 030. 77	7, 967, 480, 688. 30
负债和净资产总计		30, 044, 488, 380. 28	8, 298, 197, 961. 26

注： 报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 28, 440, 566, 030. 77 份，其中 A 类基金份额

净值 1. 000 元，份额总额 24, 444, 078. 97 份；B 类基金份额净值 1. 000 元，份额总额

1,560,468,174.09 份；D 类基金份额净值 1.000 元，份额总额 254,053,127.41 份；E 类基金份额净值 1.000 元，份额总额 26,601,600,650.30 份。

## 6.2 利润表

会计主体：浦银安盛日日盈货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		167,670,433.47	4,729,431.39
1. 利息收入		73,421,770.21	1,717,176.80
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 13	35,885,367.88	718,909.13
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息 收入		—	—
买入返售金融资产 收入		37,536,402.33	998,267.67
证券出借利息收入		—	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		94,248,663.26	3,012,254.59
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 14	—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6. 4. 7. 15	94,248,663.26	3,012,254.59
资产支持证券投资 收益	6. 4. 7. 16	—	—
贵金属投资收益	6. 4. 7. 17	—	—
衍生工具收益	6. 4. 7. 18	—	—
股利收益	6. 4. 7. 19	—	—
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		—	—
其他投资收益		—	—
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6. 4. 7. 20	—	—
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. 21	—	—
<b>减：二、营业总支出</b>		47,315,740.06	1,446,060.92
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	20,190,977.90	573,904.35
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	3,059,239.04	86,955.14

3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	14, 477, 549. 98	395, 120. 64
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		9, 426, 188. 35	273, 989. 94
其中：卖出回购金融资产 支出		9, 426, 188. 35	273, 989. 94
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		26, 132. 97	1, 110. 11
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	135, 651. 82	114, 980. 74
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		120, 354, 693. 41	3, 283, 370. 47
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		120, 354, 693. 41	3, 283, 370. 47
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		120, 354, 693. 41	3, 283, 370. 47

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛日日盈货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期 期末净 资产(基 金净值)	7, 967, 480, 688. 30	-	-	7, 967, 480, 688. 30
加：会计 政策变 更	-	-	-	-
前 期差错 更正	-	-	-	-
其 他	-	-	-	-
二、本期 期初净 资产(基 金净值)	7, 967, 480, 688. 30	-	-	7, 967, 480, 688. 30
三、本期 增减变 动额(减 少以“-”)	20, 473, 085, 342. 47	-	-	20, 473, 085, 342. 47

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	120,354,693.41	120,354,693.41
(二)、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)	20,473,085,342.47	-	-	20,473,085,342.47
其中:1.基金申购款	151,875,761,659.78	-	-	151,875,761,659.78
2.基金赎回款	-131,402,676,317.31	-	-	-131,402,676,317.31
(三)、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)	-	-	-120,354,693.41	-120,354,693.41
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	28,440,566,030.77	-	-	28,440,566,030.77
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期 期末净资产(基金净值)	338,285,991.90	-	-	338,285,991.90
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	338,285,991.90	-	-	338,285,991.90
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	23,484,058.23	-	-	23,484,058.23
(一)、综合收益总额	-	-	3,283,370.47	3,283,370.47
(二)、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)	23,484,058.23	-	-	23,484,058.23
其中:1.基金申购款	227,397,302.38	-	-	227,397,302.38
2.基金赎回款	-203,913,244.15	-	-	-203,913,244.15
(三)、本期向基金份额持有	-	-	-3,283,370.47	-3,283,370.47

人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金份额)	361,770,050.13	-	-	361,770,050.13

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

顾佳

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

浦银安盛日日盈货币市场基金(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[2014]228 号文《关于核准浦银安盛日日盈货币市场基金募集的批复》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《浦银安盛日日盈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 2,030,248,334.26 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(2014)第 154 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《浦银安盛日日盈货币市场基金基金合同》于 2014 年 3 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,030,603,326.51 份，其中认购资金利息折合 354,992.25 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《浦银安盛日日盈货币市场基金基金合同》和《浦银安盛日日盈货币市场基金招募说明书》的规定，本基金根据单个账户持有的基金份额数量和销售服务费率的不同，将基金份额分为 A 类基金份额和 B 类基金份额。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。自 2014 年 5 月 30 日起，本基金管理人为指定的特定销售渠道增加本基金的 D 类基金份额，该类份额仅能通过特定销售渠道办理申购、赎回等业务，且不适用基金份额自动升降级机制，其余业务规则及基金费率与 A 类基金份额的业务规则相同。自 2021 年 7 月 12 日起，本基金管理人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销售渠道办理申购、赎回等业务，且不适用基金份额自动升降级机制，并且仅 E 类基金份额的注册登记机构为浦银安盛基金管理有限公司，其余业务规则及基金费率与 D 类基金份额的业务规则相同。本基金 A 类基金份额、D 类基金份额和 E 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%，各类基金份额按照不同的费率计提费用，分别公布每万份基金已实现收益和 7 日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛日日盈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：现金，期限在 1 年以内（含 1 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，以及中国证监会、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。本基金业绩比较基准为活期存款利率（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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金管理信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、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》、《浦银安盛日日盈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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止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[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[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 2023年6月30日
活期存款	4,679,483.03
等于：本金	4,678,890.88
加：应计利息	592.15

减：坏账准备		-
定期存款		3,417,743,221.31
等于：本金		3,400,000,000.00
加：应计利息		17,743,221.31
减：坏账准备		-
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		3,417,743,221.31
其他存款		-
等于：本金		-
加：应计利息		-
减：坏账准备		-
合计		3,422,422,704.34

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 6 月 30 日			
		按实际利率计算的账 面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	17,053,907,487.48	17,063,163,466.28	9,255,978.80	0.0325
	合计	17,053,907,487.48	17,063,163,466.28	9,255,978.80	0.0325
资产支持证券		-	-	-	-
合计		17,053,907,487.48	17,063,163,466.28	9,255,978.80	0.0325

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

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 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 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,001,443.84	-
银行间市场	9,560,629,007.89	-
合计	9,565,630,451.73	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期末未按预期信用损失一般模型计提减值准备。
-----------------------------

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金报告期内未计提债权投资减值准备。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金报告期内未计提其他债权投资减值准备。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	233,475.54
其中：交易所市场	-
银行间市场	233,475.54
应付利息	-
其他	4,279.67
预提费用	98,560.15
合计	336,315.36

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 浦银安盛日日盈货币 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	29,322,167.64	29,322,167.64
本期申购	133,840,815.42	133,840,815.42
本期赎回(以“-”号填列)	-138,718,904.09	-138,718,904.09
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	24,444,078.97	24,444,078.97

##### 浦银安盛日日盈货币 B

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	50,132,570.50	50,132,570.50
本期申购	1,645,635,164.58	1,645,635,164.58
本期赎回(以“-”号填列)	-135,299,560.99	-135,299,560.99
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,560,468,174.09	1,560,468,174.09

##### 浦银安盛日日盈货币 D

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	254,398,047.37	254,398,047.37
本期申购	61,487,820.01	61,487,820.01
本期赎回(以“-”号填列)	-61,832,739.97	-61,832,739.97
基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	254,053,127.41	254,053,127.41

## 浦银安盛日日盈货币 E

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	7,633,627,902.79	7,633,627,902.79
本期申购	150,034,797,859.77	150,034,797,859.77
本期赎回(以“-”号填列)	-131,066,825,112.26	-131,066,825,112.26
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	26,601,600,650.30	26,601,600,650.30

注：申购含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。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期内无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 浦银安盛日日盈货币 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	509,996.68	-	509,996.68
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	-509,996.68	-	-509,996.68
本期末	-	-	-

## 浦银安盛日日盈货币 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	7,619,643.95	-	7,619,643.95
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	-7,619,643.95	-	-7,619,643.95
本期末	-	-	-

## 浦银安盛日日盈货币 D

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	2,559,293.57	-	2,559,293.57
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	-2,559,293.57	-	-2,559,293.57
本期末	-	-	-

## 浦银安盛日日盈货币 E

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	109,665,759.21	-	109,665,759.21
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	-109,665,759.21	-	-109,665,759.21
本期末	-	-	-

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	144,306.29
定期存款利息收入	35,652,415.89
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	87,931.75
其他	713.95
合计	35,885,367.88

## 6.4.7.14 股票投资收益

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	88,162,835.40
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	6,085,827.86
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	94,248,663.26

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	29,651,799,277.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	29,499,663,936.53
减：应计利息总额	146,049,513.58
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	6,085,827.86

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

#### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

#### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

### 6.4.7.17 贵金属投资收益

#### 6.4.7.17.1 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。

#### 6.4.7.17.2 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。

#### 6.4.7.17.3 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。

**6.4.7.17.4 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。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 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。

**6.4.7.18.2 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。

**6.4.7.19 股利收益**

注：本基金本报告期内无股利收益。

**6.4.7.20 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。

**6.4.7.21 其他收入**

注：本基金本报告期内无其他收入。

**6.4.7.22 信用减值损失**

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	27,641.67
账户维护费	18,750.00
合计	135,651.82

**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**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表报出日，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（“浦银安盛”）	基金管理人、注册登记机构（E 类份额）、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
上海浦银安盛资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	20,190,977.90	573,904.35
其中：支付销售机构的客户维护费	9,460,706.06	205,285.21

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 0.33% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.33% / 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
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,059,239.04	86,955.14

注：支付基金托管人交通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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	浦银安盛日日 盈货币 E	合计
交通银行	3,847.09	20.62	-	-	3,867.71
浦银安盛	38,537.26	31,698.61	0.00	16,494.36	86,730.23
上海浦东发展银 行	6,295.37	328.12	322,500.24	6,300.96	335,424.69
合计	48,679.72	32,047.35	322,500.24	22,795.32	426,022.63
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	浦银安盛日日 盈货币 E	合计
交通银行	2,067.26	12.42	-	-	2,079.68
上海浦东发展银 行	7,416.17	361.05	354,734.78	-	362,512.00
浦银安盛	7,314.98	167.30	-	9,372.98	16,855.26
合计	16,798.41	540.77	354,734.78	9,372.98	381,446.94

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给浦银安盛基金管理有限公司，再由浦银安盛基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A/D 类基金份额和 B 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25% 和 0.01%。对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额持有人的费率；对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其达到 B 类条件的开放日后的下一个工作日起享受 B 类基金份额持有人的费率。销售服务费的计算公式为：日 A 类基金份额销售服务费 = 前一日 A 类基金资产净值 × 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。 日 D 类基金份额销售服务费=前一日 D 类基金资产净值 X 0.25 % / 当年天数。

2、根据《关于浦银安盛日日盈货币市场基金调整托管费率并修改基金合同和托管协议及新增 E 类基金份额的公告》，自 2021 年 7 月 12 日起，支付基金销售机构的销售服务费按前一日 E 类基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给浦银安盛基金，再由浦银安盛基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为： 日销售服务费=前一日 E 类基金资产净值 ×0.25%/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：本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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	浦银安盛日日 盈货币 E
基金合同生效日 ( 2014 年 3 月 25 日 ) 持有的基金份 额	-	0.00	-	-
报告期初持有的 基金份额	-	0.00	-	-
报告期内申购/买 入总份额	-	80,304,771.21	-	-
报告期内因拆分 变动份额	-	-	-	-
减：报告期内赎回 /卖出总份额	-	0.00	-	-
报告期末持有的 基金份额	-	80,304,771.21	-	-
报告期末持有的 基金份额 占基金总份额比 例	-	5.15%	-	-

项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6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	浦银安盛日日盈货币 E
基金合同生效日 ( 2014年3月25日)持有的基金份额	-	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-	-	-

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投、分级份额调增和转换入份额，期间赎回/卖出总份额含分级份额调减和转换出份额。

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

份额单位：份

浦银安盛日日盈货币 A

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	占基金总份额的比例(%)	持有的基金份额	占基金总份额的比例(%)

上海浦东发展银行股份有限公司	-	-	106,968.83	0.36
----------------	---	---	------------	------

份额单位：份

## 浦银安盛日日盈货币 B

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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(%)
上海浦银安盛资产管理有限公司	25,073,389.20	1.61	-	-

注：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盈货币 D 及浦银安盛日日盈货币 E 份额。

**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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
交通银行	4,679,483.03	144,306.29	173,120.21	2,082.06

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，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：本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

单位：人民币元

浦银安盛日日盈货币 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
503,384.59	6,880.51	-268.42	509,996.68	-
浦银安盛日日盈货币 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
7,506,278.80	11,740.25	101,624.90	7,619,643.95	-

浦银安盛日日盈货币 D				
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
2,554,764.23	4,311.56	217.78	2,559,293.57	-
浦银安盛日日盈货币 E				
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
108,477,663.56	-	1,188,095.65	109,665,759.21	-

注：本基金在本年度累计分配收益 120,354,693.41 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 119,042,091.18 元，包含于赎回款的已分配未支付收益 22,932.32 元，计入应付收益科目 1,289,669.91 元。

#### 6.4.12 期末(2023 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：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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暂时停牌等流通受限股票。

##### 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

截至本报告期末 2023 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 1,594,292,666.57 元，是以如下债券作为抵押：

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
170201	17 国开 01	2023 年 7 月 3 日	102.69	500,000	51,345,000.00
170404	17 农发 04	2023 年 7 月 3 日	102.51	500,000	51,255,000.00
190203	19 国开 03	2023 年 7 月 3 日	102.02	1,400,000	142,828,000.00
210202	21 国开 02	2023 年 7 月 3 日	101.85	3,685,000	375,317,250.00
210213	21 国开 13	2023 年 7 月 3 日	100.46	3,300,000	331,518,000.00
210409	21 农发 09	2023 年 7 月 3 日	100.03	73,000	7,302,190.00
220217	22 国开 17	2023 年 7 月 3 日	99.77	3,100,000	309,287,000.00
220306	22 进出 06	2023 年 7 月 3 日	101.50	1,000,000	101,500,000.00

220308	22 进出 08	2023 年 7 月 3 日	101.01	1,000,000	101,010,000.00
220411	22 农发 11	2023 年 7 月 3 日	101.13	300,000	30,339,000.00
230201	23 国开 01	2023 年 7 月 3 日	100.92	1,000,000	100,920,000.00
2304105	23 农发贴现 05	2023 年 7 月 3 日	99.70	1,000,000	99,700,000.00
合计				16,858,000	1,702,321,440.00

#### 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。

本基金的投资范围为：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、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券、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、法律合规部的风险管理；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、督察长和审计。

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常设的议事决策机构和公司经营层面的最高风险管理机构，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、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，法律合规部根据基金相关法律

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与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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人交通银行；定期存款存放在具有基金托管资格的中国银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司以及杭州银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，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。本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净资产的 10%。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### **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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	895, 241, 031. 98	582, 707, 827. 06
合计	895, 241, 031. 98	582, 707, 827. 06

注：未评级部分为国债、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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	14, 568, 685, 451. 76	2, 198, 901, 276. 42
合计	14, 568, 685, 451. 76	2, 198, 901, 276. 42

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	154, 286, 547. 80	507, 695, 948. 21
AAA 以下	-	-
未评级	1, 435, 694, 455. 94	570, 482, 711. 52
合计	1, 589, 981, 003. 74	1, 078, 178, 659. 73

注：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于约定开放日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于开放期内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。

于 2023 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 1594292666.57 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约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管理规定》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 2023 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 5.5%，本基金投资组合的平均剩余期限为 85 天，平均剩余存续期为 94 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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

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 2023 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。

#### 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未来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。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，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。

###### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,422,422,704 .34	-	-	-	3,422,422,704.34
结算备付金	1,600,164.80	-	-	-	1,600,164.80
存出保证金	91,476.30	-	-	-	91,476.30
交易性金融资产	17,053,907,48 7.48	-	-	-	17,053,907,487.48
买入返售金融资产	9,565,630,451 .73	-	-	-	9,565,630,451.73
应收申购款	-	-	-	836,095.63	836,095.63
资产总计	30,043,652,28 4.65	-	-	836,095.63	30,044,488,380.28
负债					

应付管理人报酬	-	-	-	4,076,202.56	4,076,202.56
应付托管费	-	-	-	617,606.45	617,606.45
卖出回购金融资产款	1,594,292,666.57	-	-	-	1,594,292,666.57
应付销售服务费	-	-	-	2,779,976.76	2,779,976.76
应付利润	-	-	-	1,765,964.16	1,765,964.16
应交税费	-	-	-	53,617.65	53,617.65
其他负债	-	-	-	336,315.36	336,315.36
负债总计	1,594,292,666.57	-	-	9,629,682.94	1,603,922,349.51
利率敏感度缺口	28,449,359,618.08	-	-	-8,793,587.31	28,440,566,030.77
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,594,240,644.02	-	-	-	2,594,240,644.02
结算备付金	282,412.43	-	-	-	282,412.43
存出保证金	2,353.84	-	-	-	2,353.84
交易性金融资产	3,859,787,763.21	-	-	-	3,859,787,763.21
买入返售金融资产	1,843,496,722.15	-	-	-	1,843,496,722.15
应收申购款	-	-	-	251,156.02	251,156.02
应收清算款	-	-	-	136,909.59	136,909.59
资产总计	8,297,809,895.65	-	-	388,065.61	8,298,197,961.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,000.12	2,000.12
应付管理人报酬	-	-	-	1,546,065.66	1,546,065.66
应付托管费	-	-	-	234,252.38	234,252.38
卖出回购金融资产款	327,058,618.04	-	-	-	327,058,618.04
应付销售服务费	-	-	-	1,139,034.63	1,139,034.63
应付利润	-	-	-	476,294.25	476,294.25
应交税费	-	-	-	4,999.65	4,999.65
其他负债	-	-	-	256,008.23	256,008.23
负债总计	327,058,618.04	-	-	3,658,654.92	330,717,272.96

利率敏感度缺口 .61	7,970,751,277	-	-3,270,589. 31	7,967,480,688.30
----------------	---------------	---	-------------------	------------------

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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）	
分析		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
市场利率上升25基点	-13,519,946.15	-2,210,692.70	
	市场利率下降25基点	13,546,246.81	2,214,210.34

#### 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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.13.5 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.13.6 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.13.6.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	—	—
第二层次	17,053,907,487.48	3,859,787,763.21
第三层次	—	—
合计	17,053,907,487.48	3,859,787,763.21

#### 6.4.13.6.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 6.4.13.7 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.8 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	17,053,907,487.48	56.76
	其中：债券	17,053,907,487.48	56.76
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	9,565,630,451.73	31.84
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
3	银行存款和结算备付金合计	3,424,022,869.14	11.40
4	其他各项资产	927,571.93	0.00

5	合计	30,044,488,380.28	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	8.67	
	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	1,594,292,666.57	5.61
	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：本报告期内本货币市场基金未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值 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	85
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	104
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	52

### 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	33.65	5.61
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	7.08	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.08	-
3	60 天（含）—90 天	14.35	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.11	-
4	90 天（含）—120 天	19.93	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	30.48	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	105.49	5.61

#### 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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,869,164,203.54	6.57
	其中：政策性 金融债	1,869,164,203.54	6.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融 资券	461,771,284.38	1.62
6	中期票据	154,286,547.80	0.54
7	同业存单	14,568,685,451.76	51.23
8	其他	-	-
9	合计	17,053,907,487.48	59.96
10	剩余存续期 超过 397 天的 浮动利率债 券	339,307,011.02	1.19

#### 7.6 期末按实际利率计算账面价值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)	按实际利率计算的 账面价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	112311096	23 平安银行 CD096	15,000,000	1,492,018,304.70	5.25
2	112381947	23 南京银行 CD083	13,000,000	1,292,989,450.84	4.55
3	112311098	23 平安银行 CD098	10,000,000	988,898,972.38	3.48
4	112381880	23 广州银行 CD047	7,000,000	696,208,156.47	2.45
5	210202	21 国开 02	5,100,000	519,437,292.02	1.83
6	112381752	23 杭州银行 CD162	5,000,000	497,369,250.11	1.75
7	112303070	23 农业银行	5,000,000	496,367,614.97	1.75

		CD070			
8	112322031	23 邮储银行 CD031	5,000,000	494,552,290.49	1.74
9	112310040	23 兴业银行 CD040	4,500,000	446,421,657.76	1.57
10	112303008	23 农业银行 CD008	3,800,000	378,672,620.75	1.33

### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0900%
报告期内偏离度的最低值	-0.0065%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0357%

#### 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 期末按实际利率计算的账面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

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

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。

#### 7.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行间市场交易商协会的处罚；兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行间市场交易商协会的处罚；中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。本基金投资的前十名证券中，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查、或

在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 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	91,476.30
2	应收清算款	—
3	应收利息	—
4	应收申购款	836,095.63
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	927,571.93

## § 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 (%)
浦银安 盛日日 盈货币 A	20,752	1,177.91	1,374,305.56	5.62	23,069,773.41	94.38
浦银安 盛日日 盈货币 B	278	5,613,194.87	1,521,170,322.75	97.48	39,297,851.34	2.52
浦银安 盛日日 盈货币 D	334,268	760.03	100.98	0.00	254,053,026.43	100.00
浦银安 盛日日 盈货币 E	2,642,347	10,067.41	—	—	26,601,600,650.30	100.00
合计	2,997,645	9,487.64	1,522,544,729.29	5.35	26,918,021,301.48	94.65

### 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	1,306,217,402.15	4.59
2	信托类机构	100,380,963.99	0.35
3	基金类机构	80,304,771.21	0.28
4	基金类机构	25,073,389.20	0.09
5	个人	11,013,779.98	0.04
6	个人	10,055,795.22	0.04
7	个人	9,009,232.12	0.03
8	个人	8,291,409.50	0.03
9	个人	7,037,212.17	0.02
10	个人	6,767,409.07	0.02

### 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	浦银安盛日日盈货币 A	27,207.15	0.11
	浦银安盛日日盈货币 B	-	-
	浦银安盛日日盈货币 D	22.16	0.00
	浦银安盛日日盈货币 E	1,966,975.87	0.01
	合计	1,994,205.18	0.01

### 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、基金经理和研究部门负责人持有本开放式基金	浦银安盛日日盈货币 A	0~10
	浦银安盛日日盈货币 B	0
	浦银安盛日日盈货币 D	0~10
	浦银安盛日日盈货币 E	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	浦银安盛日日盈货币 A	0
	浦银安盛日日盈货币 B	0
	浦银安盛日日盈货币 D	0
	浦银安盛日日盈货币 E	0~10
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银安盛日日盈货币 A	浦银安盛日日盈货币 B	浦银安盛日日盈货币 D	浦银安盛日日盈货币 E
基金合同生效日 (2014年3)	809,224,203.79	1,221,379,122.72	-	-

月 25 日) 基金份额 总额				
本报告期 期初基金 份额总额	29,322,167.64	50,132,570.50	254,398,047.37	7,633,627,902.79
本报告期 基金总申 购份额	133,840,815.42	1,645,635,164.58	61,487,820.01	150,034,797,859. 77
减: 本报告 期基金总 赎回份额	138,718,904.09	135,299,560.99	61,832,739.97	131,066,825,112. 26
本报告期 基金拆分 变动份额	-	-	-	-
本报告期 期末基金 份额总额	24,444,078.97	1,560,468,174.09	254,053,127.41	26,601,600,650.3 0

注：总申购份额含红利再投、分级份额调增和转换入份额，总赎回份额含分级份额调减和转换出份额。

## § 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，本基金管理人重大人事变动如下：

2023年4月4日，本基金管理人发布了《浦银安盛基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，经本基金管理人董事会审议通过，聘任顾佳女士担任本基金管理人副总经理兼财务负责人，聘任蒋佳良先生担任本基金管理人总经理助理兼首席权益投资官。

报告截止日至报告批准送出日之间，本基金管理人重大人事变动如下：

2023年8月12日，本基金管理人发布了《浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》，经本基金管理人董事会审议通过，邓列军先生不再担任本基金管理人副总经理兼首席信息官。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人及其高级管理人员无受到有权机关调查、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。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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 (%)	
安信证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方财富 证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-

国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	4	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	3	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
野村东方国际	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

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：

本基金本报告期内新增华福证券、中邮证券、山西证券交易单元。

### 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 额的比例(%)	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例(%)
安信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华泰证	-	-	-	-	-	-

券						
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际	-	-	-	-	-	-
招商证券	516,355,910 .51	100.00	929,389,000. 00	100.00	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

### 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	关于浦银安盛日日盈货币市场基金于2023年春节假期前暂停A类、B类和E类份额通过部分销售机构的申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及规定网站	2023年1月18日
2	浦银安盛日日盈货币市场基金2022年第4季度报告	规定网站	2023年1月20日
3	关于浦银安盛日日盈货币市场基金取消基金份额自动升级业务并调整B类基金份额最低申购金额的公告	报刊及规定网站	2023年2月23日
4	浦银安盛日日盈货币市场基金招募说明书(更新)2023年第1号	规定网站	2023年2月27日
5	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增邮储银行邮你同赢平台为代销平台并参加其费率优惠活动的公告	报刊及规定网站	2023年3月22日
6	浦银安盛日日盈货币市场基金2022年年度报告	规定网站	2023年3月31日
7	浦银安盛日日盈货币市场基金2023年第1季度报告	规定网站	2023年4月22日
8	关于浦银安盛日日盈货币市场基金于2023年劳动节假期前暂停A类、B类、D类份额的申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及规定网站	2023年4月26日
9	浦银安盛日日盈货币市场基金基金产品资料概要更新	规定网站	2023年5月5日
10	浦银安盛日日盈货币市场基金招募说明书(更新)2023年第2号	规定网站	2023年5月5日
11	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金在浦发银行调整定投最低金额限制的公告	报刊及规定网站	2023年5月25日
12	关于浦银安盛日日盈货币市场基金于2023年端午节假期前暂停A类、B类、D类份额的申购、定投及转换转入业务的公告	报刊及规定网站	2023年6月19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

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

## § 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盈货币市场基金募集的文件
- 2、浦银安盛日日盈货币市场基金基金合同
- 3、浦银安盛日日盈货币市场基金招募说明书
- 4、浦银安盛日日盈货币市场基金托管协议
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、本报告期内在中国证监会规定媒介上披露的各项公告
- 8、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层 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

2023 年 8 月 31 日