

浦银安盛日日鑫货币市场基金

2020 年第 2 季度报告

2020 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

报告送出日期：2020 年 7 月 21 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 7 月 20 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 2020 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛日日鑫
基金主代码	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
报告期末基金份额总额	9,760,204,875.64 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	<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</p>

	利用这种失衡就能提高基金资产的收益率。	
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。	
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	
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	135,425,498.63 份	9,624,779,377.01 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（2020 年 4 月 1 日 — 2020 年 6 月 30 日）	
	浦银日日鑫 A	浦银日日鑫 B
1. 本期已实现收益	586,888.64	114,453,325.71
2. 本期利润	586,888.64	114,453,325.71
3. 期末基金资产净值	135,425,498.63	9,624,779,377.01

- 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

浦银日日鑫 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	0.3904%	0.0009%	0.0871%	0.0000%	0.3033%	0.0009%
过去六个 月	0.9854%	0.0014%	0.1742%	0.0000%	0.8112%	0.0014%
过去一年	2.1923%	0.0012%	0.3511%	0.0000%	1.8412%	0.0012%

过去三年	9.2264%	0.0024%	1.0560%	0.0000%	8.1704%	0.0024%
自基金合 同生效起 至今	11.4741%	0.0024%	1.2625%	0.0000%	10.2116%	0.0024%

浦银日日鑫 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	0.4499%	0.0009%	0.0871%	0.0000%	0.3628%	0.0009%
过去六个 月	1.1056%	0.0014%	0.1742%	0.0000%	0.9314%	0.0014%
过去一年	2.4377%	0.0012%	0.3511%	0.0000%	2.0866%	0.0012%
过去三年	10.0152%	0.0024%	1.0560%	0.0000%	8.9592%	0.0024%
自基金合 同生效起 至今	12.4203%	0.0024%	1.2625%	0.0000%	11.1578%	0.0024%

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

