

信达澳银慧管家货币市场基金 2015 年半年度报告摘要

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：信达澳银基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 26 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 24 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 2015 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	信达澳银慧管家货币		
场内简称	-		
基金主代码	000681		
交易代码	000681		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014 年 6 月 26 日		
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	783,067,582.39 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称:	信达澳银慧管家货币 A	信达澳银慧管家货币 C	信达澳银慧管家货币 E
下属分级基金场内简称:	-	-	-
下属分级基金的交易代码:	000681	000682	000683
报告期末下属分级基金的份额总额	364,411,143.17 份	410,864,559.59 份	7,791,879.63 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力求基金资产安全性和高流动性的基础上，追求稳定的投资收益。
投资策略	本基金根据对短期利率变动的合理分析和预判，结合本基金流动性需求，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动投资策略，利用定性分析和定量相结合的分析方法，综合分析宏观经济指标对短期利率走势进行综合判断，并根据动态预期决定和调整组合的平均剩余期限。在类属配置、个券选择等投资策略的层面，本基金将在力求基金资产安全性和高流动性的基础上，追求稳定的投资收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）×1.3
风险收益特征	本基金为货币市场基金，在所有的证券投资基金中，是风险相对较低的基金产品类型。在一般情况下，本基金风险和预期收益均低于债券型基金和混合型基金。

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	信达澳银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄晖
	联系电话	0755-83172666
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com
客户服务电话	400-8888-118	010-67595096
传真	0755-83196151	010-66275853

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.fscinda.com
基金半年度报告备置地点	广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 24 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	信达澳银基金管理有限公司	广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 24 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	信达澳银慧管家货币 A	信达澳银慧管家货币 C	信达澳银慧管家货币 E
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,038,423.42	11,465,932.92	96,503.38
本期利润	4,038,423.42	11,465,932.92	96,503.38
本期净值收益率	2.6299%	2.7450%	2.4780%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)		
期末基金资产净值	364,411,143.17	410,864,559.59	7,791,879.63
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

注：1. 所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费等），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，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. 本基金收益分配为按日结转份额。

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

信达澳银慧管家货币 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	0.3598%	0.0125%	0.1442%	0.0000%	0.2156%	0.0125%
过去三个月	1.1964%	0.0151%	0.4375%	0.0000%	0.7589%	0.0151%
过去六个月	2.6299%	0.0178%	0.8703%	0.0000%	1.7596%	0.0178%
过去一年	4.5341%	0.0130%	1.7550%	0.0000%	2.7791%	0.0130%
自基金合同 生效起至今	4.5880%	0.0129%	1.7790%	0.0000%	2.8090%	0.0129%

信达澳银慧管家货币 C

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	0.3791%	0.0125%	0.1442%	0.0000%	0.2349%	0.0125%
过去三个月	1.2529%	0.0151%	0.4375%	0.0000%	0.8154%	0.0151%
过去六个月	2.7450%	0.0178%	0.8703%	0.0000%	1.8747%	0.0178%
过去一年	4.7830%	0.0130%	1.7550%	0.0000%	3.0280%	0.0130%
自基金合同 生效起至今	4.8398%	0.0129%	1.7790%	0.0000%	3.0608%	0.0129%

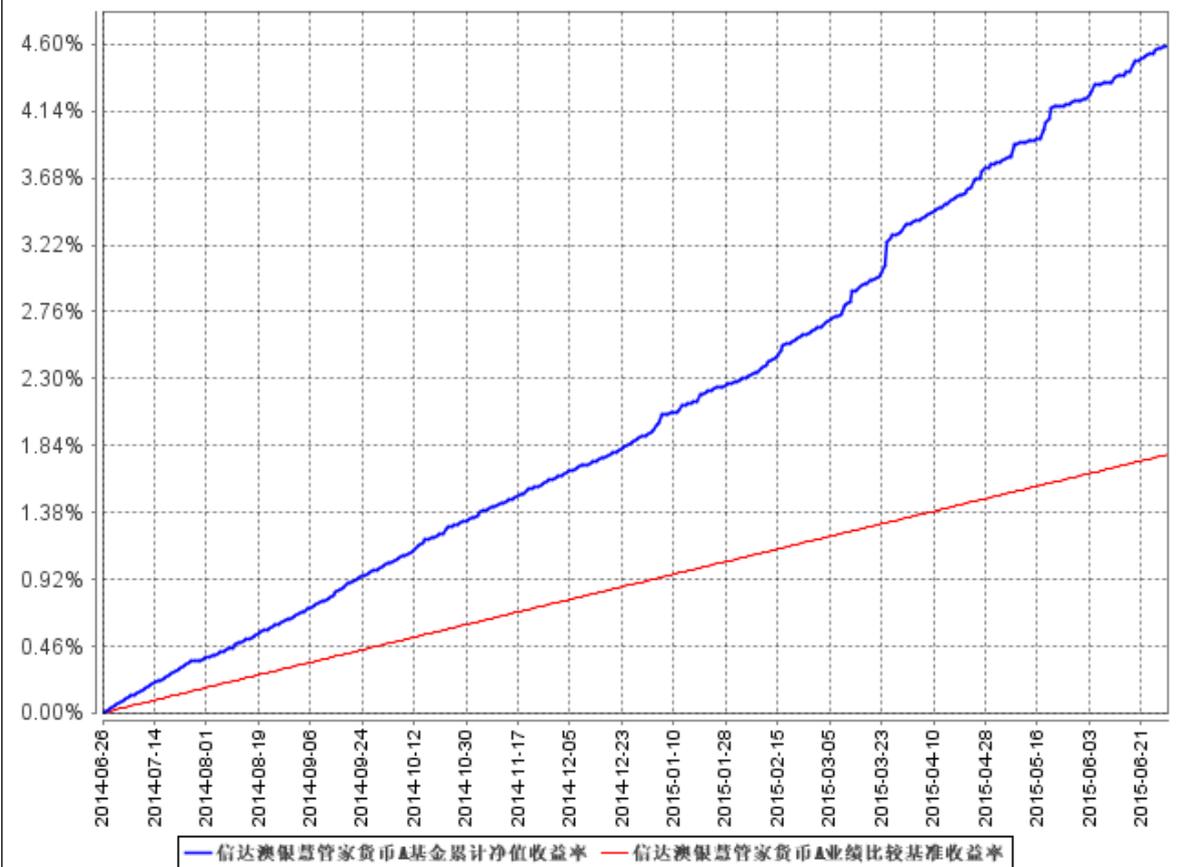
信达澳银慧管家货币 E

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
过去一个月	0.3366%	0.0124%	0.1442%	0.0000%	0.1924%	0.0124%
过去三个月	1.1205%	0.0150%	0.4375%	0.0000%	0.6830%	0.0150%
过去六个月	2.4780%	0.0177%	0.8703%	0.0000%	1.6077%	0.0177%
过去一年	4.2129%	0.0130%	1.7550%	0.0000%	2.4579%	0.0130%
自基金合同 生效起至今	4.2633%	0.0129%	1.7790%	0.0000%	2.4843%	0.0129%

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

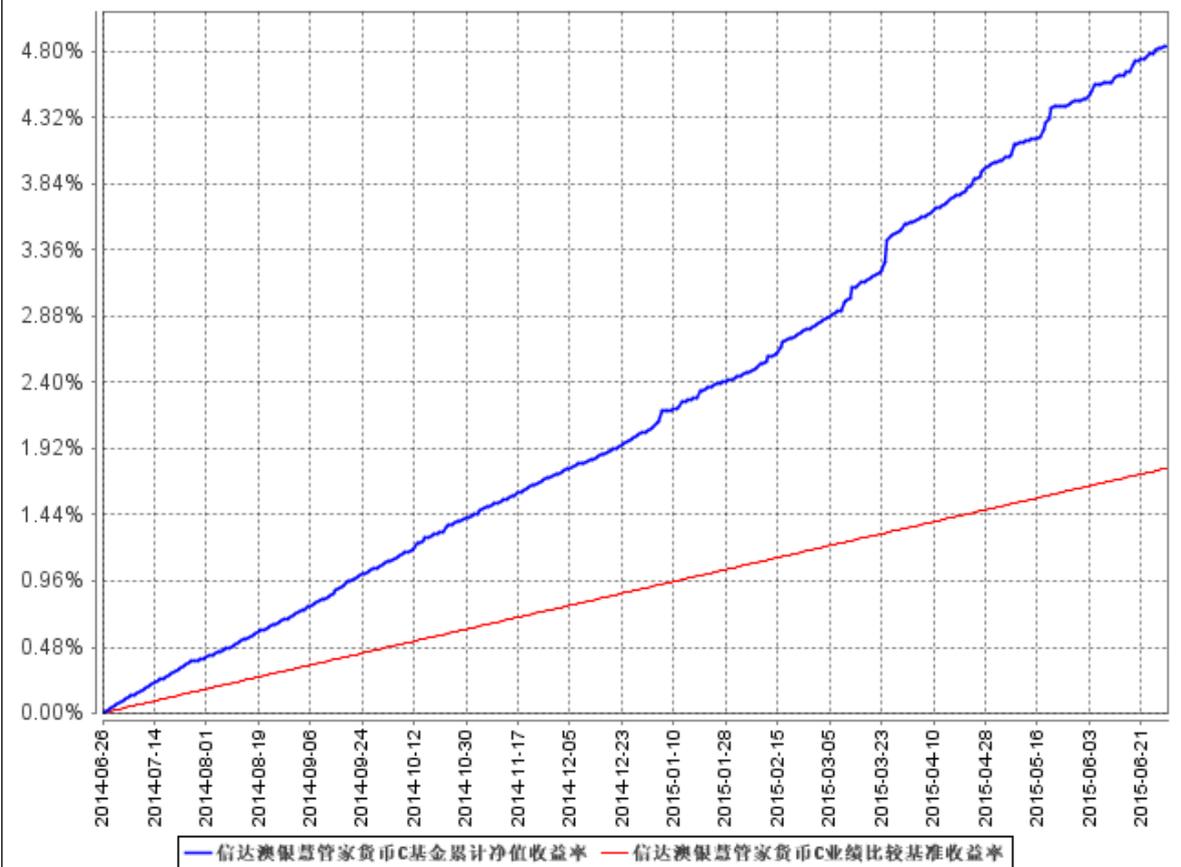
信达澳银慧管家货币 A

信达澳银慧管家货币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



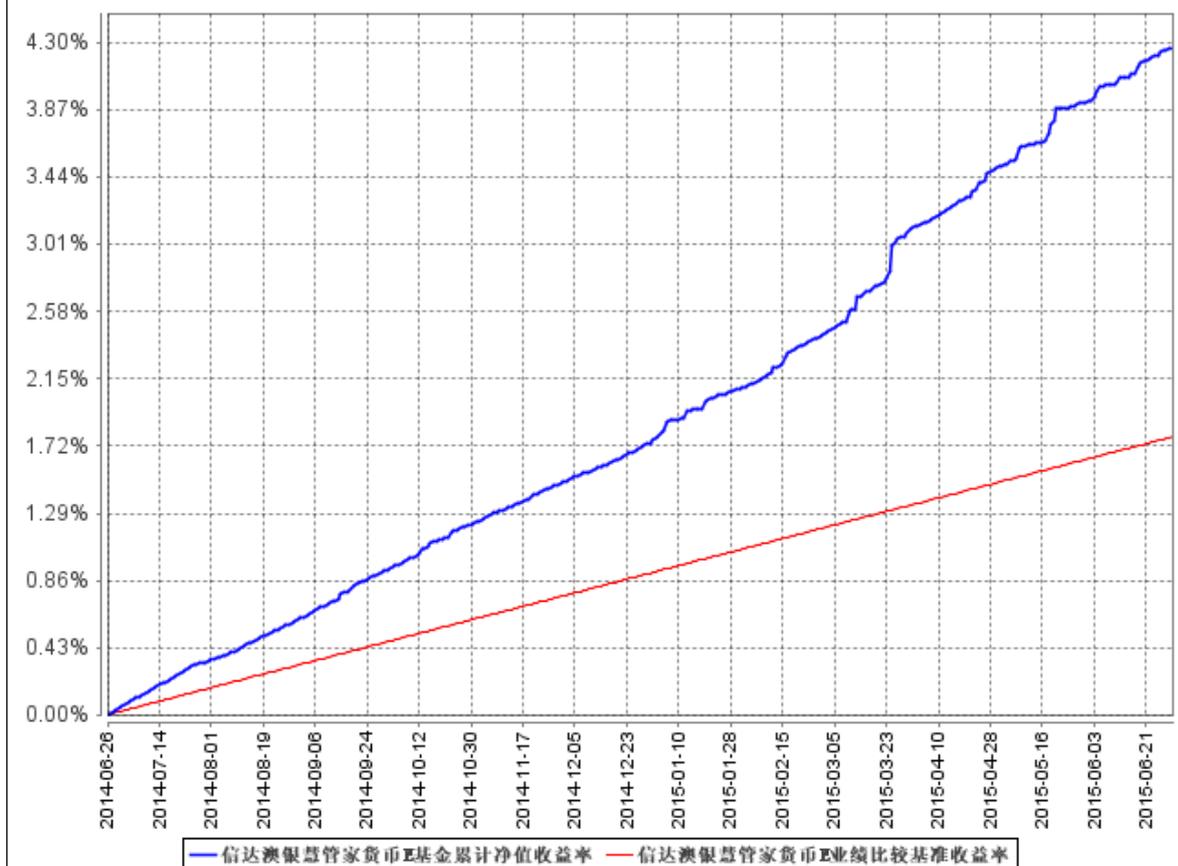
信达澳银慧管家货币 C

信达澳银慧管家货币C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



信达澳银慧管家货币 E

信达澳银慧管家货币E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



注：1、本基金投资于以下金融工具：

现金；通知存款；短期融资券；1年以内（含1年）的银行定期存款；期限在1年以内（含1年）的大额存单；期限在1年以内（含1年）的债券回购；期限在1年以内（含1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（含397天）以内的资产支持证券；剩余期限在397天以内（含397天）的中期票据；中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

对于法律法规及监管机构今后允许货币基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§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

本基金管理人信达澳银基金管理有限公司（以下简称“公司”）成立于 2006 年 6 月 5 日，由中国信达资产管理股份有限公司（原中国信达资产管理公司）和澳洲联邦银行全资附属公司康联首域集团有限公司共同发起，是经中国证监会批准设立的国内首家由国有资产管理公司控股的基金管理公司，也是澳洲在中国合资设立第一家基金管理公司。2015 年 5 月 22 日，信达证券股份有限公司受让中国信达资产管理股份有限公司持有的股权，与康联首域共同持有公司股份。公司注册资本 1 亿元人民币，总部设在深圳，在北京设有分公司。公司中方股东信达证券股份有限公司出资比例为 54%，外方股东康联首域集团有限公司出资比例为 46%。

公司建立了健全的法人治理结构，根据《中华人民共和国公司法》的规定设立了股东会、董事会和执行监事。董事会层面设立风险控制委员会和薪酬考核委员会两个专门委员会，并建立了独立董事制度。公司实行董事会领导下的总经理负责制，由总经理负责公司的日常运作，并由各委员会包括经营管理委员会、投资审议委员会、风险管理委员会、产品审议委员会、IT 治理委员会协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构，设立了公募投资总部、专户理财部、市场销售总部、产品创新部、运营管理总部、行政人事部、财务会计部、监察稽核部等部门，各部门分工协作，职责明确。

截至 2015 年 6 月 30 日，公司共管理十一只基金，包括信达澳银领先增长股票型证券投资基金、信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银稳定价值债券型证券投资基金、信达澳银中小盘股票型证券投资基金、信达澳银红利回报股票型证券投资基金、信达澳银产业升级股票型证券投资基金、信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）、信达澳银消费优选股票型证券投资基金、信达澳银信用债债券型证券投资基金、信达澳银慧管家货币市场基金、信达澳银转型创新股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孔学峰	本基金的基金经理、稳定价	2014-6-26	-	11 年	中央财经大学金融学硕士。历任金元证券股份有限公司研究员、固定收益总部副总经理；2011 年 8 月加入信达澳银基金公司，历任投资研究部下固定收益部总经理、固

	值债券基金、稳定增利债券基金 (LOF) 和信用债债券基金基金经理, 固定收益总监				定收益副总监、固定收益总监、信达澳银稳定价值债券基金基金经理 (2011 年 9 月 29 日起至今)、信达澳银稳定增利债券基金 (LOF) 基金经理 (2012 年 5 月 7 日起至今)、信达澳银信用债债券基金基金经理 (2013 年 5 月 14 日起至今)、信达澳银慧管家货币市场基金基金经理 (2014 年 6 月 26 日起至今)。
綦鹏	本基金的基金经理	2014-7-4	-	8 年	上海财经大学管理学硕士。2007 年起先后在广发银行、华安基金公司任债券交易员; 2010 年起先后在万家基金公司、浦银安盛基金管理公司担任基金经理助理、专户高级投资经理等职; 2014 年 5 月加入信达澳银基金公司, 担任信达澳银慧管家货币市场基金基金经理 (2014 年 7 月 4 日起至今)。

注: 1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定, 依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产, 在严格控制投资风险的基础上, 为基金持有人谋求最大利益, 没有损害基金持有人利益的行为。

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

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度, 确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合, 维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制, 确保不同基金在买卖同一证券时, 按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同

投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，报告期内本公司所管理的投资组合未发生交易所公开竞价的对日反向交易。

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

上半年固定资产投资增速下降，PPI 环比依然处于负值，经济与通胀同比下行，央行货币政策延续宽松周期，流动性充裕，资金利率水平下移。本基金在债市整体环境较好之下，着眼于高配短期融资券仓位，获得较高的持有收益及溢价差，同时对信用资质方面，加强了“债市刚兑打破”后的个券分化研究，回避较低评级债券，力求收益性与安全性、流动性的均衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，A 类基金份额：本报告期份额净值收益率为 2.6299%，同期业绩比较基准收益率为 0.8703%；

截至报告期末，C 类基金份额：本报告期份额净值收益率为 2.7450%，同期业绩比较基准收益率为 0.8703%；

截至报告期末，E 类基金份额：本报告期份额净值收益率为 2.4780%，同期业绩比较基准收益率为 0.8703%。

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，预期经济增长基本围绕 7% 目标，并比上半年略有好转，基建投资将对冲其他投资的下滑，另外宽松货币政策将有所显现积极效果，而积极财政政策使得政府部门有充足的手段、空间调控经济波动。

下半年，预期货币市场整体平稳，间或波动较小，这主要由央行货币政策的宽松基调所决定，但需警惕美联储可能的加息、人民币贬值预期的资本外流风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人设立了专项的估值小组，主要职责是决策制定估值政策和估值程序。小组成员具有估值核算、投资研究、风险管理等方面的专业经验。本小组设立基金估值小组负责人一名，

由分管基金运营的副总经理担任；基金估值小组成员若干名，由公募投资总部、专户理财部、基金运营部及监察稽核部指定专人并经经营管理委员会审议通过后担任，其中基金运营部负责组织小组工作的开展。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。估值政策和程序、估值调整等与基金估值有关的业务，由基金估值小组采用集体决策方式决定。

4.6.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人未签订任何有关本基金估值业务的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同约定，本基金的收益分配采取“每日分配、按日支付”的方式，即根据每日基金收益情况，以每万份基金单位收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，并每日以红利再投资方式支付收益。本报告期内应分配收益 15,600,859.72 元，实际分配收益 15,600,859.72 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

无。

§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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 A 类 4,038,423.42 元，C 类 11,465,932.92 元，

E 类 96,503.38 元。

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

本托管人复核审查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。

§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：信达澳银慧管家货币市场基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	350,447,444.22	179,347,397.38
结算备付金		-	319,000.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	547,770,179.29	210,508,028.77
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		547,770,179.29	210,508,028.77
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	125,439,148.16
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	9,727,936.87	5,796,829.35
应收股利		-	-
应收申购款		9,428,000.76	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		917,373,561.14	521,410,403.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		133,499,479.75	-
应付证券清算款		-	-

应付赎回款		177,448.14	5,000.00
应付管理人报酬		260,266.81	129,957.55
应付托管费		59,029.66	28,879.49
应付销售服务费		75,377.17	8,405.41
应付交易费用	6.4.7.7	35,782.96	15,543.84
应交税费		-	-
应付利息		14,641.04	-
应付利润		43,042.63	15,110.39
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	140,910.59	119,000.00
负债合计		134,305,978.75	321,896.68
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	783,067,582.39	521,088,506.98
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		783,067,582.39	521,088,506.98
负债和所有者权益总计		917,373,561.14	521,410,403.66

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，信达澳银慧管家货币 A 基金份额净值 1.0000 元，信达澳银慧管家货币 C 基金份额净值 1.0000 元，信达澳银慧管家货币 E 基金份额净值 1.0000 元。基金份额总额 783,067,582.39 份，其中信达澳银慧管家货币 A 基金份额 364,411,143.17 份，信达澳银慧管家货币 C 基金份额 410,864,559.59 份，信达澳银慧管家货币 E 基金份额 7,791,879.63 份。

6.2 利润表

会计主体：信达澳银慧管家货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 6 月 26 日(基 金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		17,833,555.84	333,100.55
1.利息收入		11,195,298.88	333,100.55
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,989,506.96	308,525.54
债券利息收入		5,982,436.65	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,223,355.27	24,575.01
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,638,256.96	-
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.12	6,638,256.96	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
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）	6.4.7.13	-	-
减：二、费用		2,232,696.12	33,275.82
1. 管理人报酬	6.4.10.2	1,349,358.81	15,377.49
2. 托管费	6.4.10.2	309,946.62	6,151.00
3. 销售服务费	6.4.10.2	241,870.59	5,406.03
4. 交易费用	6.4.7.14	-	-
5. 利息支出		213,989.19	-
其中：卖出回购金融资产支出		213,989.19	-
6. 其他费用	6.4.7.15	117,530.91	6,341.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,600,859.72	299,824.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,600,859.72	299,824.73

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银慧管家货币市场基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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）	521,088,506.98	-	521,088,506.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,600,859.72	15,600,859.72
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	261,979,075.41	-	261,979,075.41

填列)			
其中: 1. 基金申购款	2, 917, 293, 107. 68	-	2, 917, 293, 107. 68
2. 基金赎回款	-2, 655, 314, 032. 27	-	-2, 655, 314, 032. 27
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)	-	-15, 600, 859. 72	-15, 600, 859. 72
五、期末所有者权益(基金净值)	783, 067, 582. 39	-	783, 067, 582. 39
项目	上年度可比期间 2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 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)	561, 144, 771. 73	-	561, 144, 771. 73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	299, 824. 73	299, 824. 73
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)	299, 824. 73	-	299, 824. 73
其中: 1. 基金申购款	27, 173, 290. 14	-	27, 173, 290. 14
2. 基金赎回款	-26, 873, 465. 41	-	-26, 873, 465. 41
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)	-	-299, 824. 73	-299, 824. 73
五、期末所有者权益(基金净值)	561, 444, 596. 46	-	561, 444, 596. 46

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:

于建伟

基金管理人负责人

于鹏

主管会计工作负责人

刘玉兰

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信达澳银慧管家货币市场基金(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]第 538 号《关于核准信达澳银慧管家货币市场基金募集的批复》核准,由信达澳银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《信达澳银慧管

家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证券投资基金，存续期限不定，自 2014 年 6 月 18 日起至 2014 年 6 月 24 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 561,096,569.18 元(其中 A 类份额为 190,447,578.19 元，C 类份额为 365,400,000.00 元，E 类份额为 5,248,990.99 元)，业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)北京分所德师京报(验)字(14)第 0004 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《信达澳银慧管家货币市场基金基金合同》于 2014 年 6 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 561,144,771.73 份(其中 A 类份额为 190,456,853.84 份，C 类份额为 365,438,800.00 份，E 类份额为 5,249,117.89 份)，其中认购资金利息折合 48,202.55 份基金份额(其中 A 类份额为 9,275.65 份，C 类份额为 38,800.00 份，E 类份额为 126.90 份)。本基金的基金管理人为信达澳银基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据《信达澳银慧管家货币市场基金基金合同》和《信达澳银慧管家货币市场基金招募说明书》，本基金分设三类基金份额：A 类基金份额、C 类基金份额和 E 类基金份额。三类基金份额分设不同的基金代码，收取不同的销售服务费和管理费，并分别公布每万份基金已实现收益和 7 日年化收益率。投资人可自行选择认购、申购的基金份额类别，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换，但依据基金合同或招募说明书约定因认购、申购、赎回、基金转换等交易而发生基金份额自动升级或者降级的除外。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信达澳银慧管家货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于现金、通知存款、短期融资券、1 年以内(含 1 年)的银行定期存款、期限在 1 年以内(含 1 年)的大额存单、期限在 1 年以内(含 1 年)的债券回购、期限在 1 年以内(含 1 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(含 397 天)以内的资产支持证券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的中期票据、中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率(税后)×1.3。

本财务报表由本基金的基金管理人信达澳银基金管理有限公司于 2015 年 8 月 24 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以及 2014 年新颁布及经修订的准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金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一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局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，主要税收优惠项目列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
- (2) 对证券投资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，暂不缴纳企业所得税。
- (3) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

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

经本基金管理人股东会决议通过，并中国证券监督管理委员会（证监许可[2015]339 号）批准，信达证券股份有限公司受让中国信达资产管理股份有限公司持有的本公司 54% 的股权。上述股东变更的工商变更手续已于 2015 年 5 月 22 日办理完毕。

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
信达澳银基金管理有限公司 （“信达澳银基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
信达证券股份有限公司（“信达证券”）	基金管理人的控股股东
康联首域集团有限公司	基金管理人的股东

(Colonial First State Group Limited)	
信达新兴财富（北京）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股 20%以上的股东，原基金管理人的控股股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

无。

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 6 月 26 日(基金合同生效 日)至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,349,358.81	15,377.49
其中：支付销售机构的客户维护费	243,978.89	1,444.54

注：根据基金合同，基金在封闭运作期（合同生效日到首个开放申购、赎回日）实行固定管理费率。基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。

从首个开放申购赎回日（含）开始，实施浮动管理费率。本基金设 A、C、E 三类份额类别，从首个开放申购赎回日开始，对三类份额类别分别计提浮动管理费。

D 日管理费率根据 D-1 日 7 日年化收益率确定：

(1) D-1 日 7 日年化收益率 < 比较基准收益率

D 日管理费率=0%。

(2) D-1 日 7 日年化收益率 ≥ 比较基准收益率

D 日基金管理费率 = $\min\{\max(D-1 \text{ 日 } 7 \text{ 日年化收益率} - \text{比较基准收益率}, 0\%), 0.45\%$

其中，D 为自然日。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 6 月 26 日(基金合同生效 日)至 2014 年 6 月 30 日
----	--	--

当期发生的基金应支付的托管费	309,946.62	6,151.00
----------------	------------	----------

注：支付基金托管人中国建设银行的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：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	信达澳银慧管家 货币 A	信达澳银慧管家 货币 C	信达澳银慧管家 货币 E	合计
中国建设银行	129,709.78	5,612.18	-	135,321.96
信达澳银基金公司	2,934.40	10,004.53	4,887.95	17,826.88
信达证券	6,235.54	64.77	5.86	6,306.17
合计	138,879.62	15,681.48	4,893.81	159,454.91
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014 年 6 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	信达澳银慧管家 货币 A	信达澳银慧管家 货币 C	信达澳银慧管家 货币 E	合计
信达澳银基金公司	288.86	291.00	102.72	682.58
信达证券	238.20	10.96	-	249.16
合计	527.06	301.96	102.72	931.74

注：信达澳银慧管家货币 A 的年销售服务费率为 0.25%，信达澳银慧管家货币 C 的年销售服务费率为 0.01%，信达澳银慧管家货币 E 的年销售服务费率为 0.55%。销售服务费每日计提，按月支付，在次月初支付给信达澳银基金公司，再由信达澳银基金公司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 = 前一日该类份额（扣除当日该类份额升级的部分）的基金资产净值 × 约定年费率 / 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

无。

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

无。

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

信达澳银慧管家货币 C				
关联方名称	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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
幸福人寿	10,442,710.58	1.33%	10,164,026.05	1.95%

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日) 至 2014 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
中国建设银行	947,444.22	4,669.82	1,142,663.23	9,914.38

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.12 期末（2015 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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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 2015 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 133,499,479.75 元，是以如下债券作为质押：

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
041451055	14 八钢 CP004	2015 年 7 月 2 日	100.82	300,000	30,246,136.65
041452038	14 云煤化 CP002	2015 年 7 月 2 日	101.18	300,000	30,354,852.96
041453087	14 恒逸 CP003	2015 年 7 月 2 日	100.55	300,000	30,164,155.30
041460077	14 润华 CP001	2015 年 7 月 2 日	101.37	80,000	8,109,871.50
041460098	14 汉当科 CP001	2015 年 7 月 2 日	100.83	300,000	30,247,935.56
071545003	15 瑞银 CP003	2015 年 7 月 7 日	99.98	55,000	5,498,822.93
合计				1,335,000	134,621,774.90

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款及应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(c) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是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；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层次的余额为 547,770,179.29 元，无属于第一层次、第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第二层次 210,508,028.77 元，无属于第一层次、第三层次的余额)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，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	547,770,179.29	59.71
	其中：债券	547,770,179.29	59.71
	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	350,447,444.22	38.20
4	其他各项资产	19,155,937.63	2.09
5	合计	917,373,561.14	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额		2.48
	其中：买断式回购融资		0.00
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	133,499,479.75	17.05
	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比例 (%)	原因	调整期
1	2015 年 3 月 25 日	23.36	2015 年 3 月 25 日发生巨额赎回, 导致 3 月 25 日净值下降	3 月 26 日调整完毕

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	99
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	57

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

注：本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 180 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	25.73	17.05
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	25.10	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	34.37	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	7.73	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	21.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	114.70	17.05

7.4 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	50,116,736.89	6.40
	其中：政策性金融债	50,116,736.89	6.40
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	497,653,442.40	63.55
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	547,770,179.29	69.95
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	041452038	14 云煤化 CP002	300,000	30,354,852.96	3.88
2	041559007	15 安钢集 CP001	300,000	30,303,015.86	3.87
3	041460098	14 汉当科 CP001	300,000	30,247,935.56	3.86
4	041451055	14 八钢 CP004	300,000	30,246,136.65	3.86
5	041453087	14 恒逸 CP003	300,000	30,164,155.30	3.85
6	071511005	15 国信证券 CP005	300,000	29,996,577.19	3.83
7	071543004	15 金元证券 CP004	300,000	29,993,857.69	3.83
8	041556016	15 东特钢 CP002	300,000	29,987,416.54	3.83
9	041566010	15 淮南矿业 CP002	300,000	29,985,787.41	3.83
10	071503007	15 中信 CP007	300,000	29,965,358.25	3.83

7.6 “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	12
报告期内偏离度的最高值	0.3485%
报告期内偏离度的最低值	0.0139%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1648%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 本基金采用“摊余成本法”计价，即计价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，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。

7.8.2 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，但不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20% 的情况。

7.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内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、处罚的情形及相关投资决策程序说明。

15 国信证券 CP005（071511005）于 2015 年 4 月 8 日发布《国信证券股份有限公司关于中国证监会对公司融资融券业务采取行政监管措施的公告》，公告称 2015 年 4 月 2 日，中国证监会作出《关于对国信证券股份有限公司采取责令增加内部合规检查次数措施的决定》，公司在开展融资融券业务中，存在向在公司从事证券交易时间连续计算不足半年的客户融资融券等问题，情节较重，中国证监会对公司采取责令增加内部合规检查次数的行政监管措施。

15 中信 CP007（071503007）于 2015 年 1 月 18 日发布公告称，公司因存在为到期融资融券合约展期的问题（根据相关规定，融资融券合约期限最长为 6 个月），被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。

国信证券、中信证券主要是由于融资融券业务不合规而收到证监会的行政监管措施，15 国信证券 CP005、15 中信 CP007 的主体信用评级均为 AAA 级，是市场最高评级；且经过研究决策，基金管理人经审慎分析，认为该类行为对其自身信用基本面影响很小，对其公司短期流动性影响可以忽略不计。

除 15 国信证券 CP005（071511005）、15 中信 CP007（071503007）外，其余的本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.8.4 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	9,727,936.87
4	应收申购款	9,428,000.76
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	19,155,937.63

7.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§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
信达澳银慧管家货币 A	3,428	106,304.30	28,343.47	0.01%	364,382,799.70	99.99%
信达澳银慧管家货币 C	17	24,168,503.51	328,990,680.08	80.07%	81,873,879.51	19.93%
信达澳银慧管家货币 E	1,049	7,427.91	-	-	7,791,879.63	100.00%
合计	4,494	174,247.35	329,019,023.55	42.02%	454,048,558.84	57.98%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 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	信达澳银慧管家货币 A	51,940.99	0.01%
	信达澳银慧管家货币 C	-	-

信达澳银慧管家货币 E	3,418.43	0.04%
合计	55,359.42	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	信达澳银慧管家货币 A	0
	信达澳银慧管家货币 C	0
	信达澳银慧管家货币 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	信达澳银慧管家货币 A	0
	信达澳银慧管家货币 C	0
	信达澳银慧管家货币 E	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	信达澳银慧管家货币 A	信达澳银慧管家货币 C	信达澳银慧管家货币 E
基金合同生效日（2014 年 6 月 26 日）基金份额总额	190,456,853.84	365,438,800.00	5,249,117.89
本报告期期初基金份额总额	34,685,830.56	485,374,822.96	1,027,853.46
本报告期基金总申购份额	1,415,852,964.43	1,462,837,937.48	38,602,205.77
减：本报告期基金总赎回份额	1,086,127,651.82	1,537,348,200.85	31,838,179.60
本报告期基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-	-	-
本报告期末基金份额总额	364,411,143.17	410,864,559.59	7,791,879.63

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，未召开基金份额持有人大会，未有相关决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人、基金托管人未发生重大人事变动。

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，未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人 2015 年 5 月 27 日发布公告，改聘安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的外部审计机构。

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

报告期内，未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-

海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	新增
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	新增
申万宏源	3	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	新增
信达证券	3	-	-	-	-	新增 1 个
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	55,600,000.00	100.00%	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

注：根据《交易单元及佣金管理办法》、《投资审议委员会议事规则》的规定，交易单元开设、增设或退租由投资研究部提议，经公司投资审议委员会审议后，报经营管理委员会决定。在分配交易量方面，公司制订合理的评分体系，投资研究部和产品开发中心于每个季度最后 10 个工作日组织相关人员对提供研究报告的证券公司的研究水平、服务质量等综合情况通过投研管理系统进行评比打分。交易管理部根据上季度研究服务评分结果安排研究机构交易佣金分配，每半年佣金分配排名应与上两个季度研究服务评分排名基本匹配，并确保重点券商研究机构年度佣金排名应与全年合计研究服务评分排名相匹配。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：无。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

无。