

安信现金管理货币市场基金2015年半年度报告

2015年6月30日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

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27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25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2015年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

| | | |
|------|-------------------------------------|----|
| 1.1 | 重要提示 | 2 |
| 1.2 | 目录 | 3 |
| §2 | 基金简介 | 5 |
| 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 | 7 |
| §3 | 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 | 基金净值表现 | 7 |
| §4 | 管理人报告 | 10 |
| 4.1 | 基金管理人及基金经理情况 | 10 |
| 4.2 | 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 13 |
| 4.3 | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 13 |
| 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 | 13 |
| 4.5 | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 14 |
| 4.6 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 14 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 15 |
| §5 | 托管人报告 | 16 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 | 16 |
| 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 | 16 |
| 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 | 16 |
| §6 | 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 | 资产负债表 | 16 |
| 6.2 | 利润表 | 18 |
| 6.3 | 所有者权益（基金净值）变动表 | 19 |
| 6.4 | 报表附注 | 21 |
| §7 | 投资组合报告 | 39 |
| 7.1 | 期末基金资产组合情况 | 39 |
| 7.2 | 债券回购融资情况 | 40 |
| 7.3 | 基金投资组合平均剩余期限 | 40 |
| 7.4 | 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 41 |
| 7.5 | 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 | 42 |
| 7.6 | “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 | 43 |
| 7.7 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 | 43 |
| 7.8 | 投资组合报告附注 | 43 |
| §8 | 基金份额持有人信息 | 44 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 44 |
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 44 |
| 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情况 | 45 |
| §9 | 开放式基金份额变动 | 45 |
| §10 | 重大事件揭示 | 45 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 | 45 |
| 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 | 45 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 46 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 | 46 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 46 |
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况 | 46 |
| 10.7 | 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 46 |

| | | |
|------|-----------------------|----|
| 10.8 | 偏离度绝对值超过 0.5%的情况..... | 46 |
| 10.9 | 其他重大事件..... | 47 |
| §11 | 备查文件目录..... | 49 |
| 11.1 | 备查文件目录..... | 49 |
| 11.2 | 存放地点..... | 49 |
| 11.3 | 查阅方式..... | 49 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---------------------|-------------------|-----------------|
| 基金名称 | 安信现金管理货币市场基金 | |
| 基金简称 | 安信现金管理货币 | |
| 基金主代码 | 750006 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2013年2月5日 | |
| 基金管理人 | 安信基金管理有限责任公司 | |
| 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 | 1,135,929,314.22份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 安信现金管理货币A | 安信现金管理货币B |
| 下属两级基金的交易代码 | 750006 | 750007 |
| 报告期末下属两级基金的份 额总额 | 173,014,482.65份 | 962,914,831.57份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，通过积极主动的投资组合，力求为投资者获得超过业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略。通过对宏观经济指标的跟踪和分析，并结合央行公开市场操作等情况，合理预测货币市场利率趋势变化，决定并动态调整投资组合平均剩余期限和比例分布。</p> <p>2、个券选择策略。考虑安全性因素，优先选择国债等高信用等级债券以规避信用风险。在满足信用评级要求的前提下，根据我公司债券评分标准对信用债券进行评分筛选，重点关注低估值品种。</p> <p>3、套利策略。在保证安全性和流动性的前提下，本基金将在充分验证套利机会可行性的基础上，适当参与市场的套利，捕捉和把握无风险套利机会。</p> <p>4、回购策略。密切跟踪不同市场和不同期限之间的利</p> |

| | |
|--------|--|
| | 率差异，在精确投资收益测算的基础上，积极采取回购杠杆操作，为基金资产增加收益。 5、流动性管理策略。在遵循流动性优先的原则下，建立流动性预警指标，动态调整基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例，确保基金资产的变现能力。 |
| 业绩比较基准 | 七天通知存款利率（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 | 安信基金管理有限责任公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 乔江晖 |
| | 联系电话 | 0755-82509999 |
| | 电子邮箱 | service@essencefund.com |
| 客户服务电话 | 4008-088-088 | 010-67595096 |
| 传真 | 0755-82799292 | 010-66275853 |
| 注册地址 | 广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层 | 北京市西城区金融大街25号 |
| 办公地址 | 广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层 | 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 |
| 邮政编码 | 518026 | 100033 |
| 法定代表人 | 牛冠兴 | 王洪章 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------|---------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 |
| 登载基金半年度报告正文的 | www.essencefund.com |

| | |
|-------------|--|
| 管理人互联网网址 | |
| 基金半年度报告备置地点 | 安信基金管理有限责任公司 地址：广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------|-----------------------------|
| 注册登记机构 | 安信基金管理有限责任公司 | 广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36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

| 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） | |
|---------------|---------------------------|----------------|
| | 安信现金管理货币A | 安信现金管理货币B |
| 本期已实现收益 | 6,140,299.67 | 18,514,021.63 |
| 本期利润 | 6,140,299.67 | 18,514,021.63 |
| 本期净值收益率 | 2.2811% | 2.4036% |
| 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 | 173,014,482.65 | 962,914,831.57 |
| 期末基金份额净值 | 1.000 | 1.000 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2015年6月30日) | |
| 累计净值收益率 | 11.0853% | 11.7282% |

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

2、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

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

(1) 安信现金管理货币A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

| 阶段(A级) | 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 | 0.2658 % | 0.0070 % | 0.1110 % | 0.0000 % | 0.1548 % | 0.0070 % |
| 过去三个月 | 1.0174 % | 0.0206 % | 0.3366 % | 0.0000 % | 0.6808 % | 0.0206 % |
| 过去六个月 | 2.2811 % | 0.0174 % | 0.6695 % | 0.0000 % | 1.6116 % | 0.0174 % |
| 过去一年 | 4.5745 % | 0.0133 % | 1.3500 % | 0.0000 % | 3.2245 % | 0.0133 % |
| 自基金合同生效日起至今(2013年02月05日-2015年06月30日) | 11.0853 % | 0.0100 % | 3.2400 % | 0.0000 % | 7.8453 % | 0.0100 % |

(2) 安信现金管理货币B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

| 阶段(B级) | 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 | 0.2859 % | 0.0070 % | 0.1110 % | 0.0000 % | 0.1748 % | 0.0070 % |
| 过去三个月 | 1.0783 % | 0.0206 % | 0.3366 % | 0.0000 % | 0.7417 % | 0.0206 % |
| 过去六个月 | 2.4036 % | 0.0174 % | 0.6695 % | 0.0000 % | 1.7341 % | 0.0174 % |
| 过去一年 | 4.8264 % | 0.0133 % | 1.3500 % | 0.0000 % | 3.4764 % | 0.0133 % |
| 自基金合同生效日起 | 11.7282 % | 0.0100 % | 3.2400 % | 0.0000 % | 8.4882 % | 0.0100 % |

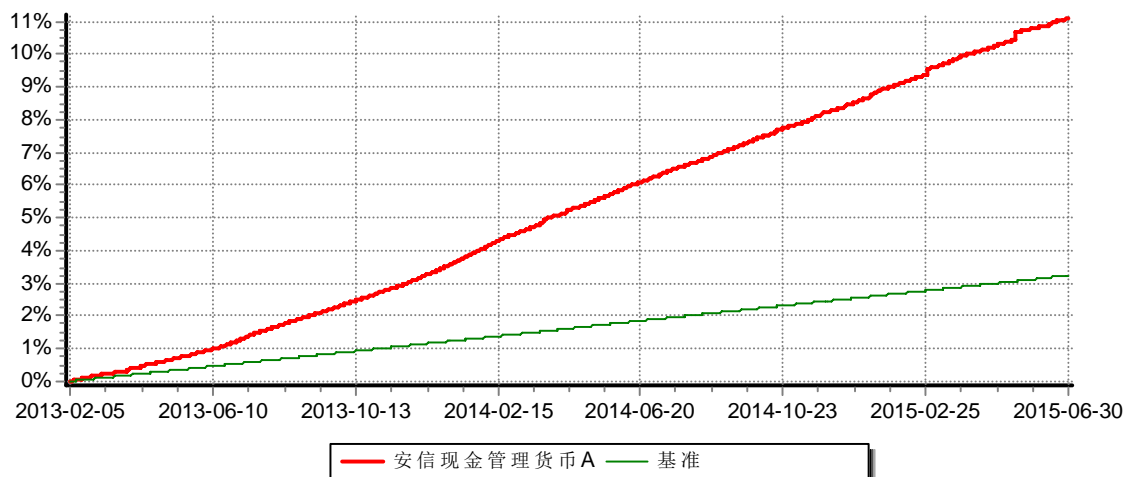
| | | | | | | |
|-----------------------------|---|---|---|---|---|---|
| 至今（2013年02月05日-2015年06月30日） | % | % | % | % | % | % |
|-----------------------------|---|---|---|---|---|---|

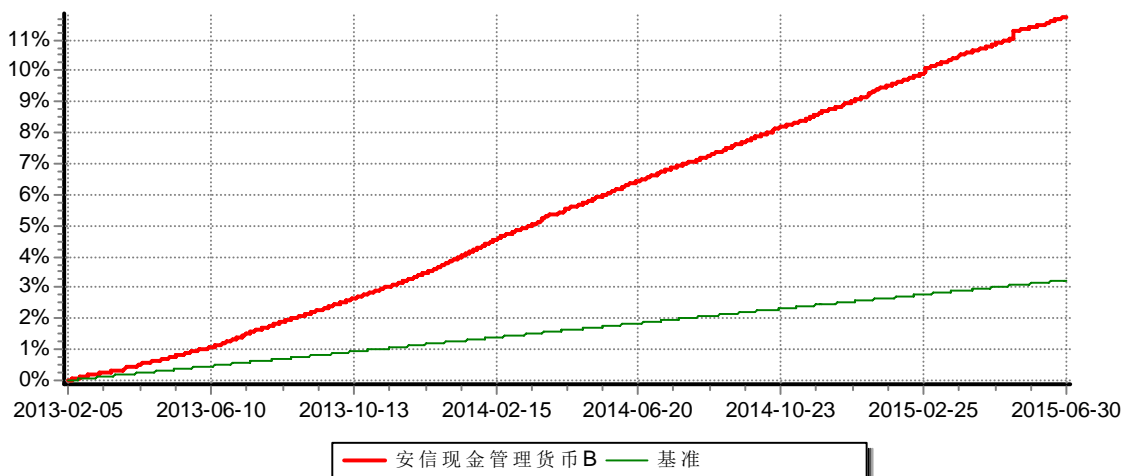
注：1、根据《安信现金管理货币市场基金基金合同》的约定，本基金收益分配为按日结转份额，业绩比较基准：七天通知存款利率(税后)。通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。

2、本基金基金合同生效日为2013年2月5日。表中所列基金及业绩比较基准的相关数值为2013年2月5日至2015年06月30日间各自的实际数值。

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

安信现金管理货币市场基金
 份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2013年2月5日-2015年6月30日）





注：1、本基金的建仓期为2013年2月5日至2013年8月4日，建仓期结束时，本基金各项资产配置比例均符合本基金合同的约定。

2、本基金基金合同生效日为2013年2月5日。图示日期为2013年2月5日至2015年06月30日。

§ 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

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于2011年12月，总部位于深圳，注册资本3.5亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有38.72%的股权，安信证券股份有限公司持有33%的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有19.71%的股权，中广核财务有限责任公司持有8.57%的股权。

截至2015年6月30日，本基金管理人共管理15只开放式基金，具体如下：从2012年6月20日起管理安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金；从2012年9月25日起管理安信目标收益债券型证券投资基金；从2012年12月18日起管理安信平稳增长混合型发起式证券投资基金；从2013年2月5日起管理安信现金管理货币市场基金；从2013年7月24日起管理安信宝利分级债券型证券投资基金；从2013年11月8日起管理安信永利信用定期开放债券型证券投资基金；从2013年12月31日起管理安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金；从2014年4月21日起管理安信价值精选股票型证券投资基金；从2014年11月24日起管理安信现金增利货币市场基金；从2015年3月19日起管理安信消费医药主题股票型证券投资基金；从2015年4月15日起管理安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金；从2015年5月14日起管理安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金；从2015年5月20日起管理安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金；从2015年5月25日起管理安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金；从2015年6月5日起管理安信鑫安得利灵活配

置混合型证券投资基金。

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期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------------------------------|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 李勇 | 本基金的基金经理、公司固定收益投资总监兼固定收益部总经理 | 2013年2月5日 | — | 9 | 李勇先生，经济学硕士。历任中国农业银行股份有限公司总行金融市场部交易员、高级投资经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益投资总监兼固定收益部总经理。曾任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理；现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金的基金经理。 |
| 张翼飞 | 本基金的基金经理 | 2014年3月26日 | — | 4.5 | 张翼飞先生，经济学硕士。历任摩根轧机（上海）有限公司财务部会计、财务主管，上海市国有资产监督管理委员会规划发展处研究员，秦皇岛嘉隆高科实业有限公司财务总监，日盛嘉富证券国际有限公司上海代表处研究部研究员。现任职于安信基金管理有限责任公司固定收益部。曾任安信现金管理货币市场基金的基金经理助理；现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信 |

| | | | | | |
|-----|------------|-------------|-----------|---|--|
| | | | | | 永利信用定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理，安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 魏晓菲 | 本基金的基金经理助理 | 2014年2月21日 | — | 8 | 魏晓菲女士，法学硕士。先后在安信证券股份有限公司、安信基金管理有限责任公司工作，现在安信基金管理有限责任公司固定收益部从事固定收益类投资工作。现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。 |
| 刘献荣 | 本基金的基金经理助理 | 2014年11月17日 | 2015年3月9日 | 8 | 刘献荣女士，经济学硕士。历任中国建设银行青岛市分行中山路支行信贷员，联合资信评估有限公司工商企业部分析师，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部研究员。现任安信宝利分级债券型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。 |

注：1、本基金基金经理李勇的“任职日期”按基金合同生效日填写，基金经理张翼飞的“任职日期”

根据公司决定的公告（生效）日期填写，基金经理助理魏晓菲、刘献荣的“任职日期”根据公司决定的聘任日期填写。“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

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《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，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，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

本基金管理人采用T值检验等统计方法，定期对旗下管理的所有基金和投资组合之间发生的同一交易日内、三个交易日内、五个交易日内的同向交易价差进行专项分析和检查。分析结果显示，本基金与本基金管理人旗下管理的所有其他基金和投资组合之间，不存在通过相同品种的同向交易进行投资组合间利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金未发生异常交易行为。本报告期内，本公司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未超过该证券当日成交量的5%。

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

上半年债券市场整体呈现牛市格局。主要原因是：

1、经济持续不景气。主要支柱产业，例如房地产、汽车都呈现弱势格局。基建行业上半年由于地方政府债务的收缩要求等原因，也明显下滑。高端消费由于反腐等原因也出现了一定的萧条。

2、经济不景气致货币政策持续宽松，接连降准降息。

3、PPI、CPI持续低位运行。除了上述列举的经济原因抑制了消费，供给增长、需求不畅致大宗商品的走低，也部分促成了输入性通缩。

4、企业融资需求在上半年也出现了一定的下滑。影响了资金需求。

我们在整个上半年，维持了较高的债券仓位，同时适当调增了持仓久期，除了票息收益外，也为客户创造了一定的资本利得。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年06月30日，本年本基金A类份额净值收益率为2.2409%，B类份额净值收益率为2.3606%，同期比较基准份额收益率均为0.6547%，本基金A类和B类净值收益率分别超过同期业绩比较基准1.5862%和1.7059%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们在7月初二季报里坚定的看好债市。最近一个月以来，债券市场异常火爆，部分印证了我们的判断。但目前来看，债牛的进度过快，我们认为存在一定的回调风险。主要由于：

1、近期债市的火爆，主要原因有二：

一是几万亿的打新资金在IPO暂停后失去方向，其中相当部分至少暂时转向债市；

二是股市急剧降杠杆，两融资产急剧减少，场内两融资产减少1万亿（2.4万亿降到8月初的1.4万亿），场外两融资产的减少（例如银行配资机构户的平仓结束）很可能也不低于此数。原先配置这些资产的资金由于其显著的固定收益特征，近期也转向债市。

2、上述债市的增量资金，虽然也许短期内不会离开债市，但这个增量的密度（一个月2万亿）可能难以维持。

3、认为目前债市的利率相对于其他融资渠道具有显著的吸引力，未来供给大幅度增加是大概率事件。

目前主流1年AA+利率在3.5~3.8%之间，这个利率大约只有银行贷款成本的一半。我们同时看到近期发行的房地产公司债大多在5%附近，相比房企经常使用的房地产信托等融资工具更是只有1/3左右。

4、认为通胀短期内没有大幅上行的风险，但认为最迟4季度后半段，对通胀上行的担忧将会逐渐扩散。而且一些通胀将起的迹象已经有所显现，例如猪肉价格在最近1个多月时间内上涨了30%左右。

5、国际利率环境可能也面临上行的压力。

6、股市下跌等引起的资本外流，可能对国内的利率水平产生压力。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《安信基金管理有限责任公司估值管理制度》开展。

公司基金的日常估值业务由运营部负责，运营部在日常估值管理中，必须严格遵循各项法律法规及基金合同的规定，及时准确对基金资产估值事项进行基金估值。运营部

对基金所使用的估值系统进行总体规划和组织实施，建立并不断完善基金资产估值系统。另外，公司成立基金估值委员会，主任委员由公司总经理担任，成员由副总经理、运营部、研究部、监察稽核部人员组成，投资部门相关人员列席。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。

估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证公司估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会采取临时会议的方式召开会议，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时，运营部应及时提请估值委员会召开会议修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会会议决议须经全体委员半数以上投票表决同意方能通过，并形成书面文件妥善保管。对于重大事项，应在充分征求监管机构、托管银行、会计师事务所、律师事务所意见的基础上，再行表决。估值政策和程序的修订经估值委员会审批通过后方可实施。

估值委员会中各成员的职责分工如下：运营部凭借专业技能和对市场产品长期丰富的估值经验以及对相关法律法规的熟练掌握，对没有市价的投资品种的估值方法在其专业领域提供专业意见。研究部凭借丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，对没有市价的投资品种综合宏观经济、行业发展及个股状况等因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果建议应采用的估值方法及合理的估值区间。研究部根据估值委员会提出的多种估值方法预案，利用金融工程研究体系各种经济基础数据和数量化工具，针对不同的估值方法及估值模型进行演算，为估值委员会寻找公允的、操作性较强的估值方法提供数理依据。监察稽核部对估值委员会临时会议的全程讨论、做出的决议、提交的基金估值信息披露文件进行合规性审查。投资部门相关人员和基金经理有权列席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人未与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，根据法律法规及《基金合同》的约定，本基金每日计算投资人账户当日所产生的收益，每月将投资人账户累计的收益结转为其基金份额，计入该投资人账户的本基金份额中。本报告期内，本基金实施利润分配的金额为24654321.3元，其中本基金A类共分配人民币6140299.67元，B类共分配人民币18514021.63元，不存在应分配但尚未实施分配的情况。

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

本报告期内，本基金未出现连续20个工作日基金份额持有人不满200人或基金资产

净值低于5000万元人民币的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、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。本报告期内，本基金实施利润分配的金额为24654321.3元，其中本基金A类共分配人民币6140299.67元，B类共分配人民币18514021.63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：安信现金管理货币市场基金

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 | 480,495,523.14 | 609,794,986.79 |
| 结算备付金 | | | — |
| 存出保证金 | | — | — |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 605,414,061.47 | 545,166,029.15 |
| 其中：股票投资 | | — | — |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 基金投资 | | — | — |
| 债券投资 | | 605,414,061.47 | 545,166,029.15 |
| 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 | 69,300,303.95 | — |
| 应收证券清算款 | | — | — |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 10,785,766.83 | 15,224,293.79 |
| 应收股利 | | — | — |
| 应收申购款 | | 504,603.02 | 49,057,963.21 |
| 递延所得税资产 | | — | — |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | — | — |
| 资产总计 | | 1,166,500,258.41 | 1,219,243,272.94 |
| 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 | | 29,699,865.15 | 150,029,454.96 |
| 应付证券清算款 | | — | — |
| 应付赎回款 | | — | — |
| 应付管理人报酬 | | 377,408.38 | 324,418.07 |
| 应付托管费 | | 114,366.23 | 98,308.54 |
| 应付销售服务费 | | 52,748.46 | 95,507.27 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 31,861.32 | 39,178.04 |
| 应交税费 | | — | — |
| 应付利息 | | 1,135.70 | 38,015.56 |
| 应付利润 | | 83,017.50 | 110,044.15 |
| 递延所得税负债 | | — | — |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 210,541.45 | 272,333.33 |
| 负债合计 | | 30,570,944.19 | 151,007,259.92 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 1,135,929,314.22 | 1,068,236,013.02 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | — | — |
| 所有者权益合计 | | 1,135,929,314.22 | 1,068,236,013.02 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,166,500,258.41 | 1,219,243,272.94 |

注：报告截止日2015年6月30日，本基金A类基金份额净值1.0000元，B类基金份额净值1.0000元。本基金份额总额1,135,929,314.22份，其中A类基金份额173,014,482.65份；B类基金份额962,914,831.57份。

6.2 利润表

会计主体：安信现金管理货币市场基金

本报告期：2015年1月1日-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 -2015年6月30日 | 上年度可比期间2014 年01月01日-2014年06 月30日 |
|------------------|----------|----------------------------|--|
| 一、收入 | | 29,045,719.03 | 28,471,499.72 |
| 1.利息收入 | | 23,393,446.92 | 24,214,482.79 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 13,949,916.93 | 15,836,527.28 |
| 债券利息收入 | | 9,085,752.52 | 5,977,854.63 |
| 资产支持证券利息收 入 | | — | — |
| 买入返售金融资产收 入 | | 357,777.47 | 2,400,100.88 |
| 其他利息收入 | | — | — |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 5,652,272.11 | 4,257,016.93 |
| 其中：股票投资收益 | | — | — |
| 基金投资收益 | | — | — |
| 债券投资收益 | 6.4.7.12 | 5,652,272.11 | 4,257,016.93 |
| 资产支持证券投资收 | | — | — |

| | | | |
|----------------------------|----------|---------------|---------------|
| 益 | | | |
| 贵金属投资收益 | | — | — |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.13 | — | — |
| 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） | | — | — |
| 减：二、费用 | | 4,391,397.73 | 3,766,883.12 |
| 1. 管理人报酬 | | 1,813,271.95 | 1,574,057.04 |
| 2. 托管费 | | 549,476.40 | 476,987.04 |
| 3. 销售服务费 | | 385,058.38 | 477,001.05 |
| 4. 交易费用 | | — | 146.73 |
| 5. 利息支出 | | 1,395,505.33 | 1,009,191.80 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 1,395,505.33 | 1,009,191.80 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.14 | 248,085.67 | 229,499.46 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 24,654,321.30 | 24,704,616.60 |
| 减：所得税费用 | | — | — |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 24,654,321.30 | 24,704,616.60 |

注：本基金合同于2013年2月5日生效，本报告期的财务报表及报表附注上年度可比期间为2014年1月1日至2014年6月30日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信现金管理货币市场基金

本报告期：2015年1月1日-2015年6月30日

单位：人民币元

| | |
|-----|----------------------|
| 项 目 | 本期 |
| | 2015年1月1日-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) | 1,068,236,013.02 | — | 1,068,236,013.02 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | — | 24,654,321.30 | 24,654,321.30 |
| 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) | 67,693,301.20 | — | 67,693,301.20 |
| 其中：1.基金申购款 | 4,836,633,504.72 | — | 4,836,633,504.72 |
| 2.基金赎回款 | -4,768,940,203.52 | — | -4,768,940,203.52 |
| 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) | — | -24,654,321.30 | -24,654,321.30 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,135,929,314.22 | — | 1,135,929,314.22 |
| 项 目 | 上年度可比期间 2014年01月01日-2014年06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) | 777,715,710.75 | — | 777,715,710.75 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | — | 24,704,616.60 | 24,704,616.60 |
| 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) | 456,102,788.23 | — | 456,102,788.23 |
| 其中：1.基金申购款 | 4,857,991,131.19 | — | 4,857,991,131.19 |
| 2.基金赎回款 | -4,401,888,342.96 | — | -4,401,888,342.96 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 | — | -24,704,616.60 | -24,704,616.60 |

| | | | |
|-----------------|------------------|---|------------------|
| (净值减少以“-”号填列) | | | |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,233,818,498.98 | — | 1,233,818,498.98 |

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:

刘入领

廖维坤

尚尔航

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

安信现金管理货币市场基金(以下简称"本基金"),系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【2012】1649号文《关于核准安信现金管理货币市场基金募集的批复》的核准,由基金管理人安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信现金管理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。

本基金募集期间为2013年1月21日至2013年2月1日,募集结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2013)验字60962175_H01号验资报告。首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,539,965,778.37元。经向中国证监会备案,《安信现金管理货币市场基金基金合同》于2013年2月5日正式生效。截至2013年2月5日止,安信现金管理货币市场基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币1,539,965,778.37元,折合1,539,965,778.37份基金份额;有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币289,164.51元,折合289,164.51份基金份额。其中A类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币1,175,163,078.37元,折合1,175,163,078.37份基金份额;有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币221,572.92元,折合221,572.92份基金份额。B类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币364,802,700.00元,折合364,802,700.00份基金份额;有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币67,591.59元,折合67,591.59份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币1,540,254,942.88元,折合1,540,254,942.88份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司,注册登记机构为安信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称"建设银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金合同的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行、具有一定剩余期限限制的债券、央行票据、回购以及法律法规允

许投资的其他金融工具。本基金投资组合的平均剩余到期期限不得超过120天。

本基金的业绩比较基准：七天通知存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于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修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

本财务报表采用了若干修订后/新会计准则：2014年1至3月，财政部制定了《企业会计准则第39号--公允价值计量》和《企业会计准则第30号--财务报表列报》等7项会计准则；上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月，财政部修订了《企业会计准则第37号--金融工具列报》，在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策和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。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系自2015年1月1日起至2015年6月30日止。

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 营业税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入，免征营业税。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.2 个人所得税

个人所得税税率为20%。

基金取得的债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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 2015年6月30日 |
|------|-------------------|
| 活期存款 | 4,495,523.14 |
| 其他存款 | 476,000,000.00 |
| 合计 | 480,495,523.14 |

注：其他存款所列金额为基金投资于有存款期限但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2015年6月30日 | | | |
|----|-------|----------------|----------------|--------------|---------|
| | | 摊余成本 | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度 |
| 债券 | 交易所市场 | — | — | — | — |
| | 银行间市场 | 605,414,061.47 | 607,429,200.00 | 2,015,138.53 | 0.1774% |
| | 合计 | 605,414,061.47 | 607,429,200.00 | 2,015,138.53 | 0.1774% |

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确认的基金资产净值

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

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2015年6月30日 | |
|-------|---------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 银行间市场 | 69,300,303.95 | — |
| 合计 | 69,300,303.95 | |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年6月30日 |
|------------|----------------|
| 应收活期存款利息 | 1,893.83 |
| 应收其他存款利息 | 1,866,390.61 |
| 应收结算备付金利息 | — |
| 应收债券利息 | 8,861,928.64 |
| 应收买入返售证券利息 | 55,553.75 |
| 应收申购款利息 | — |
| 应收黄金合约拆借孳息 | — |
| 其他 | — |
| 合计 | 10,785,766.83 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年6月30日 |
|-------------|----------------|
| 交易所市场应付交易费用 | — |
| 银行间市场应付交易费用 | 31,861.32 |
| 合计 | 31,861.32 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年6月30日 |
|-------------|----------------|
| 应付券商交易单元保证金 | — |
| 应付赎回费 | — |
| 审计费 | 49,588.57 |
| 信息披露费 | 152,099.04 |
| 银行间账户维护费 | 8,853.84 |
| 合计 | 210,541.45 |

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 安信现金管理货币A

金额单位：人民币元

| 项目(A级) | 本期2015年1月1日-2015年6月30日 | |
|---------------|------------------------|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 413,836,589.61 | 413,836,589.61 |
| 本期申购 | 990,239,807.65 | 990,239,807.65 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,231,061,914.61 | -1,231,061,914.61 |
| 本期末 | 173,014,482.65 | 173,014,482.65 |

6.4.7.9.2 安信现金管理货币B

金额单位：人民币元

| 项目(B级) | 本期2015年1月1日-2015年6月30日 | |
|---------------|------------------------|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 654,399,423.41 | 654,399,423.41 |
| 本期申购 | 3,846,393,697.07 | 3,846,393,697.07 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -3,537,878,288.91 | -3,537,878,288.91 |
| 本期末 | 962,914,831.57 | 962,914,831.57 |

注：本期申购份额含红利再投、转换入份额；本期赎回份额含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 安信现金管理货币A

单位：人民币元

| 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 | 6,140,299.67 | — | 6,140,299.67 |
| 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 | -6,140,299.67 | — | -6,140,299.67 |
| 本期末 | — | — | — |

6.4.7.10.2 安信现金管理货币B

单位：人民币元

| 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 | 18,514,021.63 | — | 18,514,021.63 |
| 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 | -18,514,021.63 | — | -18,514,021.63 |
| 本期末 | — | — | — |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期2015年1月1日-2015年6月30日 |
|-----------|------------------------|
| 活期存款利息收入 | 25,142.33 |
| 其他存款利息收入 | 13,923,084.40 |
| 结算备付金利息收入 | 1,690.20 |
| 其他 | — |
| 合计 | 13,949,916.93 |

注：其他存款利息收入所列金额为基金投资于有存款期限但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无股票投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日-2015年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 5,652,272.11 |
| 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 | 5,652,272.11 |

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日-2015年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,332,398,327.52 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,297,778,253.79 |
| 减：应收利息总额 | 28,967,801.62 |
| 买卖债券差价收入 | 5,652,272.11 |

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间无股利收益。

6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期2015年1月1日-2015年6月30日 |
|----------|------------------------|
| 审计费用 | 49,588.57 |
| 信息披露费 | 148,765.71 |
| 场外基金交易费用 | — |
| 银行划款费用 | 31,317.55 |
| 银行间帐户维护费 | 17,853.84 |
| 其他 | 560.00 |
| 合计 | 248,085.67 |

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需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

本基金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 |
|----------------------------|---------------------|
| 安信基金管理有限责任公司(以下简称"安信基金") | 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(以下简称"中国建设银行") | 基金托管人、基金销售机构 |
| 安信证券股份有限公司(以下简称"安信证券") | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

| | |
|------------------|-----------|
| 五矿资本控股有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 中广核财务有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 安信乾盛财富管理（深圳）有限公司 | 基金管理人的子公司 |

注：1、本基金管理人于2013年12月2日设立了全资子公司安信乾盛财富管理（深圳）有限公司。

2、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

6.4.10.1.1 债券交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期2015年1月1日-2015年6月30日 | | 上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日 | |
|-------|------------------------|--------------|--------------------------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购总量的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购总量的比例 |
| 安信证券 | 250,400,000.00 | 100.00% | 286,781,000.00 | 100.00% |

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无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2015年1月1日-2015年6月30日 | 上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日 |
|------------------|------------------------|--------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,813,271.95 | 1,574,057.04 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 506,620.40 | 618,680.42 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.33%的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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-2015年6月30日 | 上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日 |
|----------------|------------------------|--------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 549,476.40 | 476,987.04 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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-2015年6月30日 | | |
|----------------|--------------------------------|---------------|------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 安信现金管理货币 A | 安信现金管理货币 B | 合计 |
| 中国建设银行 | 178,368.80 | 11,932.42 | 418,682.50 |
| 安信基金直销 | 7,080.97 | 19,059.70 | 14,417.40 |
| 安信证券 | 38,068.15 | 260.56 | 93,667.96 |
| 合计 | 223,517.92 | 31,252.68 | 526,767.86 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 安信现金管理货币 A | 安信现金管理货币 B | 合计 |
| 中国建设银行 | 240,313.70 | 10,638.97 | 250,952.67 |
| 安信基金直销 | 7,336.43 | 9,560.27 | 16,896.70 |

| | | | |
|------|------------|-----------|------------|
| 安信证券 | 55,599.81 | 573.53 | 56,173.34 |
| 合计 | 303,249.94 | 20,772.77 | 324,022.71 |

注：本基金A类基金份额的销售服务费年费率为0.25%，对于由B类降级为A类的基金份额持有人，年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。B类基金份额的销售服务费年费率为0.01%，对于由A类升级为B类的基金份额持有人，年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。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日该类基金份额应计提的销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

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

单位：人民币元

| 本期2015年1月1日-2015年6月30日 | | | | | | |
|------------------------------------|---------------|------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国建设银行 | — | — | — | — | — | — |
| 上年度可比期间 2014年01月01日-2014年06月30日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国建设银行 | 49,987,500.00 | — | — | — | — | — |

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2015年1月1日-2015年6月30日 | | 上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日 | |
|-----------|------------------------|-----------|--------------------------------|-----------|
| | 安信现金管理货币A | 安信现金管理货币B | 安信现金管理货币A | 安信现金管理货币B |
| 期初持有的基金份额 | — | — | — | — |

| | | | | |
|-------------------|----------|---|---|---|
| 期间申购/买入总份额 | 1,600.00 | — | — | — |
| 期间因拆分变动份额 | 23.7 | — | — | — |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | -400.00 | — | — | — |
| 期末持有的基金份额 | 1,223.70 | — | — | — |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.0007% | — | — | — |

6.4.10.2 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

本基金的其他关联方本期末及上年度末未持有本基金份额。

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2015年1月1日-2015年6月30日 | | 上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日 | |
|--------------|------------------------|-----------|--------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期存款利息收入 | 期末余额 | 当期存款利息收入 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 4,495,523.14 | 25,142.33 | 4,331,265.50 | 113,753.09 |

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。上述当期利息收入中包含了本基金资金托管账户利息收入和对手方为中国建设银行的协议存款利息收入。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 已按再投资形式转实收基金(A级) | 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 |
|------------------|---------------|------------|--------------|----|
| 6,169,772.61 | — | -29,472.94 | 6,140,299.67 | |

| | | | | |
|----------------------|-----------------------|--------------|---------------|----|
| 已按再投资形式转 实收基金(B级) | 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 |
| 18,511,575.34 | — | 2,446.29 | 18,514,021.63 | |

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.2.1 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余额为29699865.15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 |
|--------|------------|------------|--------|------------|---------------|
| 150301 | 15进出 01 | 2015-07-01 | 99.86 | 300,000.00 | 29,957,254.75 |
| 合计 | | | | 300,000.00 | 29,957,254.75 |

6.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券余额为0元，无质押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具主要为包括在国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、公司债、企业债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券、可分离债券、回购和银行存款等金融工具，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制

在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。
 本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，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

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了严格的债券备选池制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截止2015年06月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券按成本计价占基金资产净值的比例为41.267%（2014年12月31日为42.9154%）。

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 2015年6月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 383,583,812.24 | 412,751,291.60 |
| A-1以下 | — | — |
| 未评级 | 91,061,814.80 | 55,401,967.90 |
| 合计 | 474,645,627.04 | 468,153,259.50 |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

3. 债券价值为以摊余成本法计价的账面价值。

4. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2 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 2015年6月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | — | — |
| AAA以下 | — | — |
| 未评级 | 139,630,363.07 | 88,966,927.72 |
| 合计 | 139,630,363.07 | 88,966,927.72 |

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金流动性风险来自于兑付赎回资金的流动性风险和投资品种变现的流动性风险两方面。

兑付赎回资金的流动性风险是指本基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，因而对本基金的投资运作产生额外的流动性风险。针对该类流动性风险，本基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行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。同时本基金的基金合同中设计了巨额赎回条款，约定了在巨额赎回发生时对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。

投资品种变现的流动性风险是指因投资品种不存在活跃的交易市场而难以变现，或因投资品种集中度高而无法在不对市场价格产生重大影响的情况下变现的流动性风险。本基金采用控制流通受限证券比例、监控投资品种的成交活跃度和分散投资等方式防范投资品种变现的流动性风险。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，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。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，截止本报告期末本基金所持债券均可在银行间同业市场交易并及时变现，本基金所承担的其他金融负债的合同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。

6.4.13.4 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

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。银行存款、结算备付金及债券投资等品种的公允价值均面临在市场利率上升时出现下降的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，采用久期、凸度、VAR（在险价值）等量化风险指标评估基金的利率风险，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2015年6月30日 | 6个月以内 | 6个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|---------------|----------------|----------------|------|------|---------------|------------------|
| 资产 | | | | | | |
| 银行存款 | 480,495,523.14 | — | — | — | — | 480,495,523.14 |
| 交易性金融资产 | 224,381,824.32 | 381,032,237.15 | — | — | — | 605,414,061.47 |
| 买入返售金融资产 | 69,300,303.95 | — | — | — | — | 69,300,303.95 |
| 应收利息 | — | — | — | — | 10,785,766.83 | 10,785,766.83 |
| 应收申购款 | — | — | — | — | 504,603.02 | 504,603.02 |
| 资产总计 | 774,177,651.41 | 381,032,237.15 | — | — | 11,290,369.85 | 1,166,500,258.41 |
| 负债 | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 29,699,865.15 | — | — | — | — | 29,699,865.15 |
| 应付管理人报酬 | — | — | — | — | 377,408.38 | 377,408.38 |
| 应付托管费 | — | — | — | — | 114,366.23 | 114,366.23 |
| 应付销售服 | — | — | — | — | 52,748.4 | 52,748.4 |

| | | | | | | |
|-------------------------|----------------|----------------|------|------|---------------|------------------|
| 务费 | | | | | 6 | 6 |
| 应付交易费用 | — | — | — | — | 31,861.32 | 31,861.32 |
| 应付利息 | — | — | — | — | 1,135.70 | 1,135.70 |
| 应付利润 | — | — | — | — | 83,017.50 | 83,017.50 |
| 其他负债 | — | — | — | — | 210,541.45 | 210,541.45 |
| 负债总计 | 29,699,865.15 | — | — | — | 871,079.04 | 30,570,944.19 |
| 利率敏感度缺口 | 744,477,786.26 | 381,032,237.15 | — | — | 10,419,290.81 | 1,135,929,314.22 |
| 上年度末 2014年12月 31日 | 6个月以内 | 6个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | |
| 银行存款 | 609,794,986.79 | — | — | — | — | 609,794,986.79 |
| 交易性金融资产 | 252,933,926.73 | 292,232,102.42 | — | — | — | 545,166,029.15 |
| 应收利息 | — | — | — | — | 15,224,293.79 | 15,224,293.79 |
| 应收申购款 | — | — | — | — | 49,057,963.21 | 49,057,963.21 |
| 资产总计 | 862,728,913.52 | 292,232,102.42 | — | — | 64,282,257.00 | 1,219,243,272.94 |
| 负债 | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 150,029,454.96 | — | — | — | — | 150,029,454.96 |
| 应付管理人报酬 | — | — | — | — | 324,418.07 | 324,418.07 |
| 应付托管费 | — | — | — | — | 98,308.5 | 98,308.5 |

| | | | | | | |
|---------|----------------|----------------|---|---|---------------|------------------|
| | | | | | 4 | 4 |
| 应付销售服务费 | — | — | — | — | 95,507.27 | 95,507.27 |
| 应付交易费用 | — | — | — | — | 39,178.04 | 39,178.04 |
| 应付利息 | — | — | — | — | 38,015.56 | 38,015.56 |
| 应付利润 | — | — | — | — | 110,044.15 | 110,044.15 |
| 其他负债 | — | — | — | — | 272,333.33 | 272,333.33 |
| 负债总计 | 150,029,454.96 | — | — | — | 977,804.96 | 151,007,259.92 |
| 利率敏感度缺口 | 712,699,458.56 | 292,232,102.42 | — | — | 63,304,452.04 | 1,068,236,013.02 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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 | | |
|---------------|--------------------|-----------------------------|---------------------|
| 分析 | 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） | |
| | | 本期末 2015年6月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
| 1、市场利率下降25个基点 | | 831,479.38 | 645,756.90 |
| 2、市场利率上升25个基点 | | -828,509.59 | -643,889.55 |

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。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年6月30日 | | 上年度末2014年12月31日 | |
|---------------|-------------------|---------------|-----------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | — | — | — | — |
| 交易性金融资产-债券投资 | 605,414,061.47 | 53.30 | 545,166,029.15 | 51.03 |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | — | — | — | — |
| 衍生金融资产—权证投资 | — | — | — | — |
| 其他 | — | — | — | — |
| 合计 | 605,414,061.47 | 53.30 | 545,166,029.15 | 51.03 |

§ 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 | 605,414,061.47 | 51.90 |
| | 其中：债券 | 605,414,061.47 | 51.90 |
| | 资产支持证券 | — | — |
| 2 | 买入返售金融资产 | 69,300,303.95 | 5.94 |
| | 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 | 480,495,523.14 | 41.19 |
| 4 | 其他各项资产 | 11,290,369.85 | 0.97 |

| | | | |
|---|----|------------------|--------|
| 5 | 合计 | 1,166,500,258.41 | 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 | 9.45 | |
| | 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 | 29,699,865.15 | 2.61 |
| | 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

金额单位：人民币元

| 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 | 2015-03-02 | 22.01 | 大额赎回 | 2个交易日 |
| 2 | 2015-03-03 | 21.19 | 大额赎回 | 1个交易日 |

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 | 115 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 133 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 59 |

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（天数） | 原因 | 调整期 |
|----|------------|------------|------|-----|
| 1 | 2015-01-04 | 125 | 大额赎回 | 4天 |
| 2 | 2015-01-05 | 126 | 大额赎回 | 3天 |

| | | | | |
|---|------------|-----|------|----|
| 3 | 2015-01-06 | 133 | 大额赎回 | 2天 |
| 4 | 2015-01-07 | 125 | 大额赎回 | 1天 |
| 5 | 2015-02-05 | 122 | 大额赎回 | 2天 |
| 6 | 2015-02-06 | 123 | 大额赎回 | 1天 |

注：本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况，但根据本基金基金合同的约定，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。

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 | 41.37 | 2.61 |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | — | — |
| 2 | 30天(含)—60天 | 14.88 | — |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | — | — |
| 3 | 60天(含)—90天 | 1.76 | — |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | — | — |
| 4 | 90天(含)—180天 | 10.15 | — |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | — | — |
| 5 | 180天(含)—397天（含） | 33.54 | — |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | — | — |
| | 合计 | 101.70 | 2.61 |

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 | 137,454,065.00 | 12.10 |
| | 其中：政策性金融债 | 137,454,065.00 | 12.10 |
| 4 | 企业债券 | — | — |
| 5 | 企业短期融资券 | 467,959,996.47 | 41.20 |
| 6 | 中期票据 | — | — |
| 7 | 其他 | — | — |
| 8 | 合计 | 605,414,061.47 | 53.30 |
| 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 | 占基金资产净值 比例 (%) |
|----|-----------|-------------|-------------|---------------|-------------------|
| 1 | 041561022 | 15阳泉CP003 | 600,000 | 59,973,075.48 | 5.28 |
| 2 | 011524001 | 15中冶SCP001 | 600,000 | 59,968,400.15 | 5.28 |
| 3 | 041469034 | 14铜陵化工CP001 | 500,000 | 50,119,926.86 | 4.41 |
| 4 | 041560006 | 15昌源水务CP001 | 400,000 | 40,379,856.44 | 3.55 |
| 5 | 140311 | 14进出11 | 300,000 | 30,439,901.56 | 2.68 |
| 6 | 041560012 | 15津建材CP001 | 300,000 | 30,359,168.35 | 2.67 |
| 7 | 011599103 | 15厦翔业SCP002 | 300,000 | 30,208,660.55 | 2.66 |
| 8 | 071511004 | 15国信证券CP004 | 300,000 | 29,999,649.22 | 2.64 |
| 9 | 041556021 | 15渝文资CP001 | 300,000 | 29,994,936.13 | 2.64 |

| | | | | | |
|----|---------------|-----------|---------|---------------|------|
| 10 | 0415690 16 | 15新兴CP001 | 300,000 | 29,986,190.87 | 2.64 |
|----|---------------|-----------|---------|---------------|------|

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 | 16 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.4089% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0474% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1627% |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 基金计价方法说明。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

7.8.2 本报告期内本基金不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

7.8.3 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存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 | 10,785,766.83 |
| 4 | 应收申购款 | 504,603.02 |
| 5 | 其他应收款 | — |

| | | |
|---|------|---------------|
| 6 | 待摊费用 | — |
| 7 | 其他 | — |
| 8 | 合计 | 11,290,369.85 |

§ 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 |
| 安信现 金管理 货币A | 3,725 | 46,446.84 | 4,866,291.8 4 | 2.81% | 168,148,190 .81 | 97.19% |
| 安信现 金管理 货币B | 14 | 68,779,630. 83 | 755,476,965 .04 | 78.46% | 207,437,866 .53 | 21.54% |
| 合计 | 3,739 | 303,805.65 | 760,343,256 .88 | 66.94% | 375,586,057 .34 | 33.06% |

注：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 |
|-----------------------|---------------|--------------|----------|
| 基金管理公司所有从业人 员持有本基金 | 安信现金管 理货币A | 1,772,610.25 | 1.02% |
| | 安信现金管 理货币B | — | — |
| | 合计 | 1,772,610.25 | 0.16% |

注：管理人的从业人员持有基金占基金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）。

8.3 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 | 安信现金管理货币A | 0~10 |
| | 安信现金管理货币B | 0 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 安信现金管理货币A | 0 |
| | 安信现金管理货币B | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 安信现金管理货币A | 安信现金管理货币B |
|--------------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2013年2月5日)基金份额总额 | 1,175,384,651.29 | 364,870,291.59 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 413,836,589.61 | 654,399,423.41 |
| 本报告期基金总申购份额 | 990,239,807.65 | 3,846,393,697.07 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,231,061,914.61 | 3,537,878,288.91 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 173,014,482.65 | 962,914,831.57 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

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

1.本基金管理人于2015年1月9日发布公告，聘任乔江晖女士为安信基金管理有限责任公司督察长，孙晓奇先生不再担任安信基金管理有限责任公司督察长；聘任孙晓奇先生为安信基金管理有限责任公司副总经理，汪建先生不再担任安信基金管理有限责任公

司副总经理。

2.本基金托管人2015年1月4日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本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

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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

本报告期内本基金管理人和托管人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 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 债券成交金额 | 债券交易占当期成交总额的比例 | 债券回购成交金额 | 债券回购交易占当期成交总额的比例 | 权证交易成交金额 | 权证交易占当期成交总额的比例 | 应支付券商的佣金 | 应支付券商的佣金占当期佣金总量的比例 | 备注 |
|------|--------|--------|----------------|----------------|------------------|----------|----------------|----------|--------------------|----|
| 安信证券 | 1 | — | — | 250,400,000.00 | 100.00% | — | — | — | — | — |

注：公司制定《安信基金管理有限责任公司券商交易单元选择标准及佣金分配办法》，对选择证券公司的标准和程序、以及佣金分配规则进行了规定。

根据上述制度，由公司基金投资部、固定收益部、研究部、特定资产管理部、分管投资的副总经理及交易室于每季度末对券商进行综合评分，评价标准包括研究及投资建议的质量、报告的及时性、服务质量、交易成本等，由公司基金投资决策委员会根据评分结果对下一季度的证券公司名单及佣金分配比例做出决议。首只基金成立后最初半年的券商选择及佣金分配由基金投资决策委员会决定。

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 信息披露方式 | 披露日期 |
|----|---|----------------------|------------|
| 1 | 2015年度安信基金管理有限责任公司高级管理人员（副总经理）变更公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-01-09 |
| 2 | 2015年度安信基金管理有限责任公司高级管理人员（督察长）变更公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-01-09 |
| 3 | 关于安信基金管理有限责任公司从业人员在子公司兼任职务情况变更的公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-01-13 |
| 4 | 安信现金管理货币市场基金变更大额申购限额的公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-01-14 |
| 5 | 关于安信基金管理有限责任公司从业人员在子公司兼任职务情况变更的公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-01-17 |
| 6 | 安信现金管理货币市场基金2014年第4季度报告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-01-21 |
| 7 | 安信现金管理货币市场基金春节前两个工作日暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-02-11 |
| 8 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持长安汽车估值调整的公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-03-17 |
| 9 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持东莞控股估值调整的公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-03-18 |
| 10 | 安信现金管理货币市场基金更新招募说明书摘要（2015年第1号） | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-03-19 |
| 11 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持华域汽车估值调整的公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-03-24 |
| 12 | 安信现金管理货币市场基金2014 | 上海证券报、中国证券报、 | 2015-03-28 |

| | 年年度报告摘要 | 证券时报 | |
|----|--|----------------------|------------|
| 13 | 关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-03-31 |
| 14 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持阳光城估值调整的公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-03-31 |
| 15 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持华仁药业估值调整的公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-04-03 |
| 16 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持复星医药估值调整的公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-04-04 |
| 17 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持招商地产估值调整的公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-04-09 |
| 18 | 安信现金管理货币市场基金2015年第1季度报告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-04-20 |
| 19 | 关于安信基金管理有限责任公司从业人员在子公司兼任职务情况变更的公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-05-13 |
| 20 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持科陆电子估值调整的公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-05-13 |
| 21 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持康恩贝估值调整的公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-05-28 |
| 22 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下部分公募基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-05-29 |
| 23 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持新洋丰估值调整的 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-06-12 |

| | 公告 | | |
|----|-----------------------------------|----------------------|------------|
| 24 | 关于安信基金管理有限责任公司从业人员在子公司兼任职务情况变更的公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-06-18 |
| 25 | 安信基金管理有限责任公司关于公司股权变更的公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-06-26 |
| 26 | 安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持华东医药估值调整的公告 | 上海证券报、中国证券报、 证券时报 | 2015-06-27 |

注：本基金管理人2015年01月09日发布公告，自2015年01月05日起聘任孙晓奇为公司副总经理，汪建不再担任公司副总经理；聘任乔江晖为公司督察长，孙晓奇不再担任公司督察长。

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准安信现金管理货币市场基金募集的文件；
- 2、《安信现金管理货币市场基金基金合同》；
- 3、《安信现金管理货币市场基金托管协议》；
- 4、《安信现金管理货币市场基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

11.2 存放地点

安信基金管理有限责任公司

地址：广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层

11.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

二〇一五年八月二十七日