

信达澳银慧管家货币市场基金 2016 年半年度报告

2016 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：2016 年 8 月 24 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 2016 年 8 月 23 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
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合规守信情况的说明	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
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 债券回购融资情况	37
7.3 基金投资组合平均剩余期限	38
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	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
7.6 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	39
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	39
7.8 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	40
7.9 投资组合报告附注	40
§8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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	41
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	46
10.9 其他重大事件	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
§12 备查文件目录.....	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信达澳银慧管家货币市场基金		
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	6,406,692,389.09 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	723,858,039.54 份	5,681,297,864.65 份	1,536,484.90 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	田青
	联系电话	0755-83172666	010-67595096

	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-118	010-67595096
传真		0755-83196151	010-66275853
注册地址		广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 24 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深南大道 7088 号招商银行大厦 24 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518040	100033
法定代表人		于建伟	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	《上海证券报》
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

3.1.1 期间数据和指标	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
	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	10,108,008.97	87,009,131.87	21,860.35
本期利润	10,108,008.97	87,009,131.87	21,860.35
本期净值收益率	1.4701%	1.5869%	1.3286%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)		
期末基金资产净值	723,858,039.54	5,681,297,864.65	1,536,484.90
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)		
累计净值收益率	7.8327%	8.3315%	7.2066%

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	0.2342%	0.0036%	0.1439%	0.0000%	0.0903%	0.0036%
过去三个月	0.7063%	0.0044%	0.4364%	0.0000%	0.2699%	0.0044%
过去六个月	1.4701%	0.0046%	0.8727%	0.0000%	0.5974%	0.0046%
过去一年	3.1024%	0.0080%	1.7574%	0.0000%	1.3450%	0.0080%
自基金合同 生效起至今	7.8327%	0.0109%	3.5365%	0.0000%	4.2962%	0.0109%

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	0.2538%	0.0036%	0.1439%	0.0000%	0.1099%	0.0036%
过去三个月	0.7633%	0.0044%	0.4364%	0.0000%	0.3269%	0.0044%
过去六个月	1.5869%	0.0046%	0.8727%	0.0000%	0.7142%	0.0046%
过去一年	3.3305%	0.0080%	1.7574%	0.0000%	1.5731%	0.0080%
自基金合同 生效起至今	8.3315%	0.0109%	3.5365%	0.0000%	4.7950%	0.0109%

信达澳银慧管家货币 E

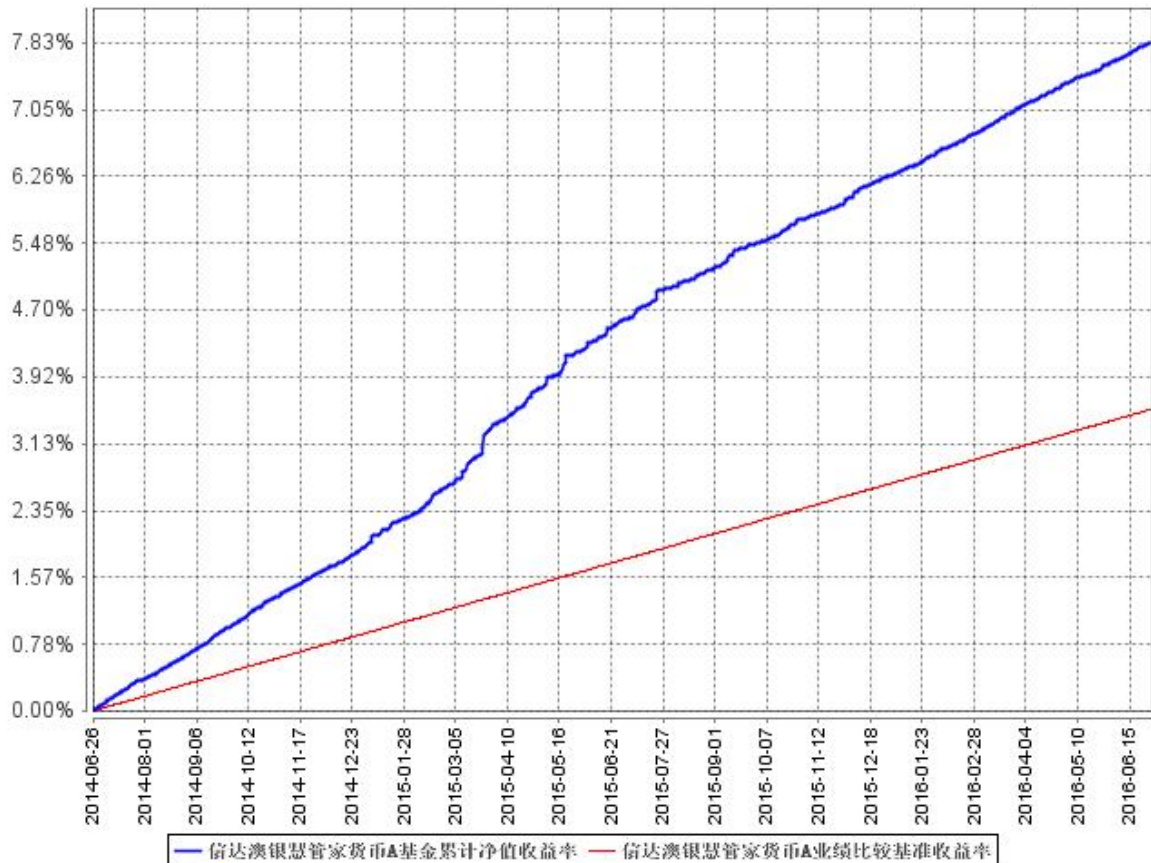
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.2115%	0.0036%	0.1439%	0.0000%	0.0676%	0.0036%
过去三个月	0.6329%	0.0045%	0.4364%	0.0000%	0.1965%	0.0045%
过去六个月	1.3286%	0.0047%	0.8727%	0.0000%	0.4559%	0.0047%
过去一年	2.8230%	0.0080%	1.7574%	0.0000%	1.0656%	0.0080%

自基金合同 生效起至今	7.2066%	0.0109%	3.5365%	0.0000%	3.6701%	0.0109%
----------------	---------	---------	---------	---------	---------	---------

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

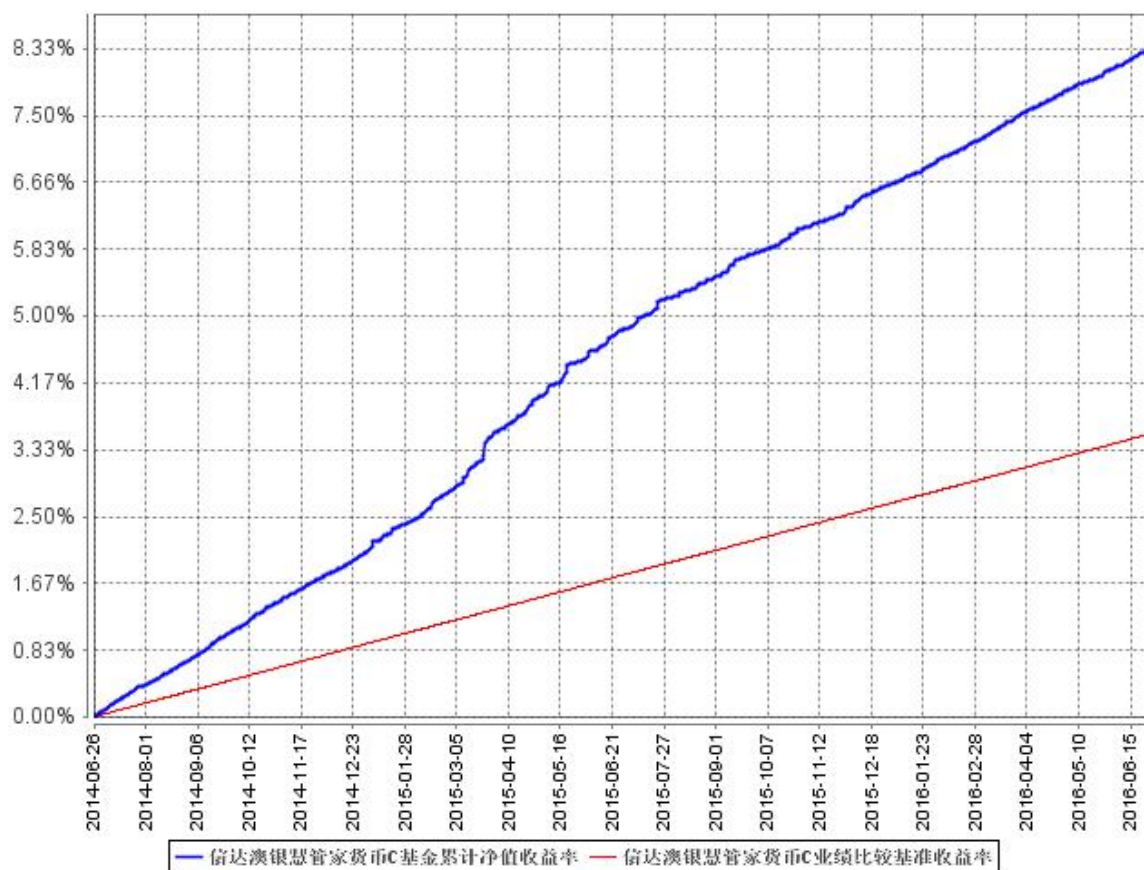
信达澳银慧管家货币 A

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



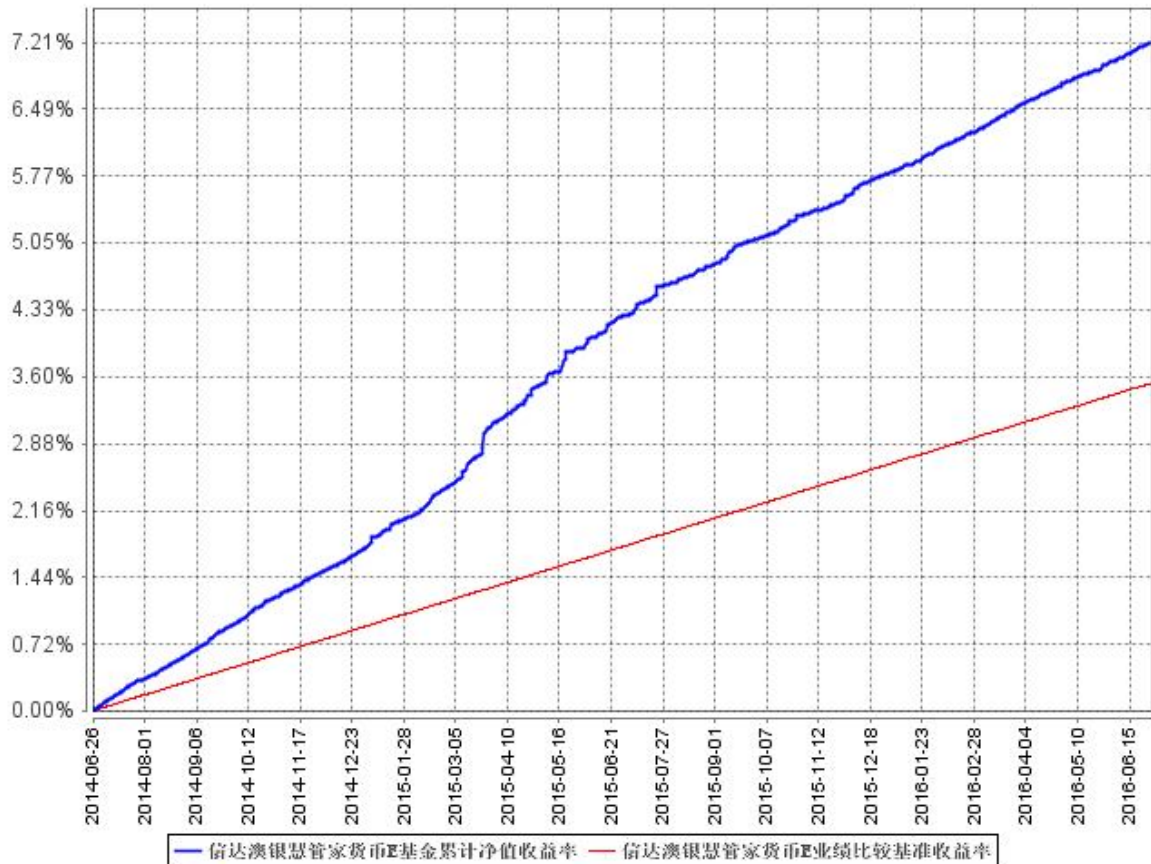
信达澳银慧管家货币 C

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、本基金基金合同于 2014 年 6 月 26 日生效，2014 年 7 月 28 日开始办理申购、赎回业务。

2、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。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

§ 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、董事会办公室等部门，各部门分工协作，职责明确。

截至 2016 年 6 月 30 日，公司共管理十三只基金，包括信达澳银领先增长混合型证券投资基金、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、信达澳银中小盘混合型证券投资基金、信达澳银红利回报混合型证券投资基金、信达澳银产业升级混合型证券投资基金、信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）、信达澳银消费优选混合型证券投资基金、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、信达澳银新能源产业股票型证券投资基金、信达澳银纯债债券型证券投资基金。

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) 期限		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、稳定价值	2014-6-26	-	12 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、固定

	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，公募投资总部副总监				收益副总监、固定收益总监、公募投资总部副总监，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	-	9 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）。
郑少波	原本基金的基金经理助理、原信用债债券基金的基金经理助理	2015 年 9 月 10 日	2016 年 2 月 23 日	3 年	四川大学金融学硕士。曾就职于前海人寿资产管理中心任信用债研究员；2013 年 12 月加入信达澳银基金公司，历任固定收益部债券研究员，信达澳银信用债债券基金及慧管家货币市场基金基金经理助理（2015 年 9 月 10 日起至 2016 年 2 月 23 日）。

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。

3、綦鹏自 2016 年 8 月 12 日起离任本基金基金经理。

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

本基金管理人对报告期内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）本基金管理人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，未发现本基金管理人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同日反向交易。

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

报告期内，本基金囿于短债期限利差的平坦化，降低了组合的平均期限，优化了组合的流动性；同时，在信用风险分化的背景下，降低了短融的持仓，提高了高评级短融的占比，并大幅增加了存单的投资，力求货币基金整体的安全性与流动性明显优化。最后，为了增强收益，不断捕捉资金利率高点的投资与提高仓位。

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 1.4701%，同期业绩比较基准收益率为 0.8727%；

截至报告期末，C 类基金份额：本报告期份额净值收益率为 1.5869%，同期业绩比较基准收益率为 0.8727%；

截至报告期末，E 类基金份额：本报告期份额净值收益率为 1.3286%，同期业绩比较基准收益

率为 0.8727%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前经济运行总体平稳，有喜有忧。随着一方面市场需求有所改善，另一方面过剩行业去产能调整，经济运行仍有不稳定因素值得关注。区间波动、脉冲加大会是经济中长期运行的特点。物价方面，下半年通胀可能温和中略有回落，但是总体难现高通胀，不会对货币政策形成压力。下半年货币政策预计仍然趋于稳健，但是为托底供给侧改革，有可能仍然会营造一个适宜的货币环境，央行仍然会继续使用组合工具灵活操作维护流动性。外部环境主要关注美联储加息节奏。

下半年投资策略，利率债方面，以抓住“震荡市”中的波段机会为主，需要把握波动幅度、踩准节奏。信用债方面，首要目标仍是防范违约风险。配置城投债主要关注区域风险，排除资源枯竭型地区和财政收入下滑明显的地区，同时水利、棚改、地下管廊等公益性的城投平台相较经营性的产业平台获得的政府支持更为安全。配置产业债关注行业风险分化，上游周期性行业信用债短期回避；中游行业配置对于与采矿相关的机械设备制造企业采取谨慎态度；下游行业可选取 TMT、公用事业、休闲服务以及交运中的航空、机场。主要仍以精选个券为主。

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，由分管基金运营的高管担任；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 97,139,001.19 元，实际分配收益 97,139,001.19 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 10,108,008.97 元，C 类 87,009,131.87 元，E 类 21,860.35 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	1, 005, 294, 352. 26	1, 169, 488, 814. 71
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	5, 000, 838, 496. 77	3, 362, 537, 400. 42
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5, 000, 838, 496. 77	3, 362, 537, 400. 42
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	682, 790, 949. 31	1, 699, 915, 869. 87
应收证券清算款		30, 305, 342. 47	-
应收利息	6.4.7.5	45, 679, 455. 92	37, 095, 919. 57
应收股利		-	-
应收申购款		4, 102, 844. 70	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	21, 150, 766. 08	-
资产总计		6, 790, 162, 207. 51	6, 269, 038, 004. 57
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 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		379, 179, 211. 23	199, 999, 500. 00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		156, 080. 99	-
应付管理人报酬		2, 717, 356. 45	1, 331, 428. 46
应付托管费		603, 859. 94	295, 874. 47
应付销售服务费		214, 186. 25	140, 491. 06
应付交易费用	6.4.7.7	52, 975. 57	50, 173. 46
应交税费		-	-
应付利息		32, 255. 05	41, 755. 71
应付利润		398, 245. 46	397, 713. 37
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	115, 647. 48	74, 000. 00
负债合计		383, 469, 818. 42	202, 330, 936. 53
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	6, 406, 692, 389. 09	6, 066, 707, 068. 04

未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		6,406,692,389.09	6,066,707,068.04
负债和所有者权益总计		6,790,162,207.51	6,269,038,004.57

注：报告截止日 2016 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 6,406,692,389.09 份，其中信达澳银慧管家货币 A 基金份额 723,858,039.54 份，信达澳银慧管家货币 C 基金份额 5,681,297,864.65 份，信达澳银慧管家货币 E 基金份额 1,536,484.90 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		116,753,999.23	17,833,555.84
1.利息收入		111,409,407.50	11,195,298.88
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,419,442.29	2,989,506.96
债券利息收入		83,845,219.02	5,982,436.65
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		14,144,746.19	2,223,355.27
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,314,128.72	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	5,314,128.72	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	30,463.01	-
减：二、费用		19,614,998.04	2,232,696.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2	13,987,164.57	1,349,358.81
2. 托管费	6.4.10.2	3,114,888.56	309,946.62
3. 销售服务费	6.4.10.2	1,143,157.20	241,870.59
4. 交易费用	6.4.7.14	-	-
5. 利息支出		1,211,877.30	213,989.19
其中：卖出回购金融资产支出		1,211,877.30	213,989.19
6. 其他费用	6.4.7.15	157,910.41	117,530.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		97,139,001.19	15,600,859.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		97,139,001.19	15,600,859.72

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	6,066,707,068.04	-	6,066,707,068.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	97,139,001.19	97,139,001.19
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）	339,985,321.05	-	339,985,321.05
其中：1. 基金申购款	14,514,389,021.61	-	14,514,389,021.61
2. 基金赎回款	-14,174,403,700.56	-	-14,174,403,700.56
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）	-	-97,139,001.19	-97,139,001.19
五、期末所有者权益（基金净值）	6,406,692,389.09	-	6,406,692,389.09

项目	上年度可比期间 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“-”号填列)	261,979,075.41	-	261,979,075.41
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

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》、基金合同及招募说明书的有关规定,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) $\times 1.3$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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、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,也参考了中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定及中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《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》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (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。证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。
- (2) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。
- (3) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
- (4) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；自 2013 年 1 月 1 日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。自 2014 年 9 月 8 日起，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。
- (5) 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) 对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 9 月 19 日起，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。
- (7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	294,352.26
定期存款	1,005,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	1,005,000,000.00
其他存款	-
合计：	1,005,294,352.26

注：根据定期存款协议的规定，上述定期存款若提前支取，利息收入仍然按照原协议利率与实际天数计算。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 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	5,000,838,496.77	5,004,744,000.00	3,905,503.23	0.0610%
	合计	5,000,838,496.77	5,004,744,000.00	3,905,503.23	0.0610%

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

本基金本期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	503,250,000.00	-
买入返售证券_银行间	179,540,949.31	-

合计	682,790,949.31	-
----	----------------	---

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	553.82
应收定期存款利息	314,069.41
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	4,504.58
应收债券利息	44,164,334.09
应收买入返售证券利息	1,195,994.02
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	45,679,455.92

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
其他应收款	21,150,766.08
待摊费用	-
合计	21,150,766.08

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 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	52,975.57
合计	52,975.57

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,221.34
预提费用	113,426.14

合计	115,647.48
----	------------

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

信达澳银慧管家货币 A		
项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	659,439,389.09	659,439,389.09
本期申购	1,591,708,815.71	1,591,708,815.71
本期赎回(以“-”号填列)	-1,527,290,165.26	-1,527,290,165.26
本期末	723,858,039.54	723,858,039.54

金额单位：人民币元

信达澳银慧管家货币 C		
项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,405,307,330.40	5,405,307,330.40
本期申购	12,914,054,703.48	12,914,054,703.48
本期赎回(以“-”号填列)	-12,638,064,169.23	-12,638,064,169.23
本期末	5,681,297,864.65	5,681,297,864.65

金额单位：人民币元

信达澳银慧管家货币 E		
项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,960,348.55	1,960,348.55
本期申购	8,625,502.42	8,625,502.42
本期赎回(以“-”号填列)	-9,049,366.07	-9,049,366.07
本期末	1,536,484.90	1,536,484.90

注：本期申购中包含红利再投资、转入、级别调整入份额，本期赎回中包含转出、级别调整出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

信达澳银慧管家货币 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	10,108,008.97	-	10,108,008.97

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	-10,108,008.97	-	-10,108,008.97
本期末	-	-	-

单位：人民币元

信达澳银慧管家货币 C			
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	87,009,131.87	-	87,009,131.87
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	-87,009,131.87	-	-87,009,131.87
本期末	-	-	-

单位：人民币元

信达澳银慧管家货币 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	21,860.35	-	21,860.35
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	-21,860.35	-	-21,860.35
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	22,134.06
定期存款利息收入	13,392,098.55
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,209.68
其他	-
合计	13,419,442.29

6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,601,100,293.31
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,504,099,305.10
减：应收利息总额	91,686,859.49
买卖债券差价收入	5,314,128.72

6.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	—
其他	30,463.01
合计	30,463.01

6.4.7.14 交易费用

本期无交易费用。

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	54,700.10
信息披露费	49,726.04
银行手续费	35,284.27
债券托管账户维护费	18,200.00
其他	—
合计	157,910.41

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

截至财务报告批准报出日，本期无需要说明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

本基金本报告期内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
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 (Colonial First State Group Limited)	基金管理人的股东
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

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**

注：本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	13,987,164.57	1,349,358.81
其中：支付销售机构的客户维护费	1,240,912.17	243,978.89

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,114,888.56	309,946.62

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	675,087.66	20,413.49	-	695,501.15
信达澳银基金公司	11,355.73	209,570.75	2,231.88	223,158.36
信达证券	11,543.65	-	14.14	11,557.79
合计	697,987.04	229,984.24	2,246.02	930,217.30
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 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	138,879.72	15,681.48	4,893.81	159,455.01
----	------------	-----------	----------	------------

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

银行间市场各关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日					
	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	209,954,407.82	-	-	-	-	-
信达证券	-	31,715,503.28	-	-	-	-
合计	209,954,407.82	31,715,503.28	-	-	-	-
银行间市场各关联方名称	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日					
	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	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

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

本期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金。

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 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 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
信达证券	-	-	100,013,690.38	1.65%

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	294,352.26	22,134.06	947,444.22	4,669.82

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

本基金本期及上年度可比期间无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需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

信达澳银慧管家货币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
10,105,992.69		2,016.28	10,108,008.97	-

信达澳银慧管家货币C

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
87,010,584.12		-1,452.25	87,009,131.87	-

信达澳银慧管家货币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
21,892.29		-31.94	21,860.35	-

6.4.12 期末（2016 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

本基金本期末无持有的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 2016 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 379,179,211.23 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
111690751	16 杭州银行 CD027	2016 年 7 月 1 日	99.62	1,030,000	102,608,600.00
160201	16 国开 01	2016 年 7 月 4 日	99.84	2,000,000	199,680,000.00
160401	16 农发 01	2016 年 7 月 4 日	100.07	820,000	82,057,400.00
合计				3,850,000	384,346,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，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款余额为 0 元。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金为货币市场基金，风险收益水平较低，长期预期风险收益低于股票型、混合型和债券

型基金。本基金的投资范围包括：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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金的基金管理人建立了由董事会风险控制委员会、经营层风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等问题向总经理提供咨询意见和建议；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。

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产生的可能损失。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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行及其他股份制银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，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 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1 以上	49,635,098.24	
A-1	1,179,681,806.53	1,814,616,462.45
A-1 以下		-
未评级	3,771,521,592.00	1,377,727,413.94
合计	5,000,838,496.77	3,192,343,876.39

注：未评级债券为政策性金融债。

短期债券为债券发行日至到期日的期间在 1 年以内(含 1 年)的债券。

6.4.13.2.2 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 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	170,193,524.03
合计	-	170,193,524.03

注：未评级债券为政策性金融债。

长期债券为债券发行日至到期日的期间在 1 年以上的债券。

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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的监察稽核部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分交易性金融资产均为银行间同业市场交易，未持有其他有重大流动性风险的投资品种。此外，本基金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，其上限不超过法律法规的相关规定。

除卖出回购金融资产款余额 379,179,211.23 元将在一个月内到期且计息外，本基金所持有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，因此账面余额即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

利率风险是指金融工具的公允价值或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，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。

本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	1,005,294,352.26	-	-	-	1,005,294,352.26
交易性金融资产	5,000,838,496.77	-	-	-	5,000,838,496.77
买入返售金融资产	682,790,949.31	-	-	-	682,790,949.31
应收证券清算款				30,305,342.47	30,305,342.47
应收利息	-	-	-	45,679,455.92	45,679,455.92
应收申购款				4,102,844.70	4,102,844.70
其他资产	-	-	-	21,150,766.08	21,150,766.08
资产总计	6,688,923,798.34	-	-	101,238,409.17	6,790,162,207.51
负债					
卖出回购金融资产款	379,179,211.23	-	-	-	379,179,211.23
应付赎回款	-	-	-	156,080.99	156,080.99
应付管理	-	-	-		

人报酬				2,717,356.45	2,717,356.45
应付托管费	-	-	-	603,859.94	603,859.94
应付销售服务费	-	-	-	214,186.25	214,186.25
应付交易费用	-	-	-	52,975.57	52,975.57
应付利息	-	-	-	32,255.05	32,255.05
应付利润	-	-	-	398,245.46	398,245.46
其他负债	-	-	-	115,647.48	115,647.48
负债总计	379,179,211.23	-	-	4,290,607.19	383,469,818.42
利率敏感度缺口	6,309,744,587.11	-	-	不适用	不适用

上年度末 2015 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	1,169,488,814.71	-	-	-	1,169,488,814.71
交易性金融资产	3,362,537,400.42	-	-	-	3,362,537,400.42
买入返售金融资产	1,699,915,869.87	-	-	-	1,699,915,869.87
应收利息	-	-	-	37,095,919.57	37,095,919.57
资产总计	6,231,942,085.00	-	-	37,095,919.57	6,269,038,004.57
负债					
卖出回购金融资产款	199,999,500.00	-	-	-	199,999,500.00
应付管理人报酬	-	-	-	1,331,428.46	1,331,428.46
应付托管费	-	-	-	295,874.47	295,874.47
应付销售服务费	-	-	-	140,491.06	140,491.06
应付交易费用	-	-	-	50,173.46	50,173.46
应付利息	-	-	-	41,755.71	

					41,755.71
应付利润	-	-	-	397,713.37	397,713.37
其他负债	-	-	-	74,000.00	74,000.00
负债总计	199,999,500.00	-	-	2,331,436.53	202,330,936.53
利率敏感度缺口	6,031,942,585.00	-	-	不适用	不适用

注：上表按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者对金融资产和金融负债的期限予以分类。

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：人民币万元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	上升约 328	上升约 281
	2. 市场利率上升 25 个基点	下降约 328	下降约 280

6.4.13.4.2 外汇风险

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债券，与二级市场股票指数波动的相关性较弱，故本基金不基于股票指数进行其他价格风险的敏感性分析。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.2 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。

6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 8 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	5,000,838,496.77	73.65
	其中: 债券	5,000,838,496.77	73.65
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	682,790,949.31	10.06
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,005,294,352.26	14.81
4	其他各项资产	101,238,409.17	1.49
5	合计	6,790,162,207.51	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	1.96	
	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	379,179,211.23	5.92
	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

注: 在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

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	86
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	114
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

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比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	27.36	5.92
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	10.45	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	19.74	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	20.46	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	26.86	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		104.87	5.92

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	409,674,928.92	6.39
	其中：政策性金融债	409,674,928.92	6.39
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,539,463,697.09	39.64
6	中期票据	49,635,098.24	0.77
7	同业存单	2,002,064,772.52	31.25
8	其他	-	-
9	合计	5,000,838,496.77	78.06
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 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	160201	16 国开 01	2,000,000	199,683,860.79	3.12
2	111619024	16 恒丰银行 CD024	2,000,000	197,552,576.26	3.08
3	011699728	16 首旅 SCP004	1,600,000	159,987,399.42	2.50
4	111694270	16 宁波银行 CD116	1,600,000	159,098,552.48	2.48
5	111694278	16 威海银行 CD013	1,600,000	159,068,735.43	2.48
6	111694253	16 内蒙古银行 CD021	1,600,000	159,068,494.96	2.48
7	111611238	16 平安 CD238	1,600,000	158,905,436.69	2.48
8	111694767	16 桂林银行 CD034	1,600,000	158,862,532.82	2.48
9	111612110	16 北京银行 CD110	1,600,000	158,822,886.74	2.48
10	111694926	16 九江银行 CD044	1,600,000	158,792,232.05	2.48

7.7 “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	25
报告期内偏离度的最高值	0.2915%

报告期内偏离度的最低值	-0.2897%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1449%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
1	2016-03-25	-0.2897%	由于东北特钢集团于 2016 年 3 月 25 日发布了 15 东特钢 CP001 兑付不确定性风险提示公告,并最终违约,导致东北特钢的相关债券中债估值大幅下调。本基金当日因持有东北特钢的债券而导致当日估值偏离超过-0.25%。	5 个交易日

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%情况

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	-
2	应收证券清算款	30,305,342.47
3	应收利息	45,679,455.92
4	应收申购款	4,102,844.70

5	其他应收款	21,150,766.08
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	101,238,409.17

7.9.4 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	8674	83,451.47	32,266,287.11	4.46%	691,591,752.43	95.54%
信达澳银慧管家货币 C	78	72,837,152.11	5,495,143,577.95	96.72%	186,154,286.70	3.28%
信达澳银慧管家货币 E	1379	1,114.20	-	0.00%	1,536,484.90	100.00%
合计	10131	632,385.00	5,527,409,865.06	86.28%	879,282,524.03	13.72%

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	-	-
	信达澳银慧管家货币 C	-	-
	信达澳银慧管家货币 E	2,396.38	0.16%
	合计	2,396.38	0.00%

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负责	信达澳银慧管家货币 A	0
	信达澳银慧管家货币 C	0

人持有本开放式基金	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	659,439,389.09	5,405,307,330.40	1,960,348.55
本报告期基金总申购份额	1,591,708,815.71	12,914,054,703.48	8,625,502.42
减：本报告期基金总赎回份额	1,527,290,165.26	12,638,064,169.23	9,049,366.07
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	723,858,039.54	5,681,297,864.65	1,536,484.90

§ 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

本基金管理人 2016 年 4 月 12 日发布公告，经信达澳银基金管理有限公司第四届董事会审议通过，聘任焦巍先生为信达澳银基金管理有限公司副总经理。

本基金管理人双方股东于 2016 年 3 月 28 日作出决议，一致同意黄慧玲女士不再担任信达澳银基金管理有限公司董事。

本基金管理人双方股东于 2016 年 5 月 14 日作出决议，一致同意选举潘广建先生担任信达澳

银基金管理有限公司第四届董事会董事。

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

报告期内，本基金管理人继续聘任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	-	-	-	-	-
方正证券	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	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
申万宏源西部 证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	新增
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	退租 1 个
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	退租 1 个
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、本报告期东吴证券席位退租。

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	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部 证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-6,688,882,000.00	100%	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本报告期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	日期
1	信达澳银基金管理有限公司旗下基金年度净值公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 1 月 4 日
2	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 1 月 5 日
3	信达澳银基金管理有限公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况变更的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 1 月 6 日
4	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 1 月 6 日
5	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 1 月 8 日
6	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 1 月 9 日
7	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 1 月 12 日
8	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 1 月 20 日
9	信达澳银慧管家货币市场基金 2015 年第 4 季度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 1 月 22 日

10	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 1 月 27 日
11	关于信达澳银慧管家货币基金 2016 年“春节”假期前暂停申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 2 月 1 日
12	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 2 月 3 日
13	关于信达澳银慧管家货币基金暂停快速赎回业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 2 月 5 日
14	信达澳银慧管家货币市场基金招募说明书（更新）及摘要 2015 年第 2 期	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 2 月 6 日
15	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 2 月 17 日
16	信达澳银基金管理有限公司关于增加南商（中国）为代销机构、参加基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 2 月 24 日
17	信达澳银基金管理有限公司关于增加利得基金为代销机构、参加基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 2 月 24 日
18	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 2 月 26 日
19	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 2 月 27 日
20	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 3 月 1 日
21	信达澳银基金网上交易升级公告	公司网站	2016 年 3 月 4 日
22	信达澳银基金管理有限公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况变更的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 3 月 10 日
23	信达澳银基金管理有限公司关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为代销机构、开通转换和定投业务、参加基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 3 月 23 日

24	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 3 月 25 日
25	信达澳银慧管家货币市场基金 2015 年年度报告及摘要	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 3 月 26 日
26	关于信达澳银慧管家货币市场基金 2016 年“清明节”假期前暂停申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 3 月 29 日
27	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 4 月 6 日
28	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 4 月 7 日
29	关于高级管理人员变更的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 4 月 12 日
30	信达澳银基金公司关于暂停中国银行广东省分行银行卡网上直销业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 4 月 13 日
31	信达澳银慧管家货币市场基金 2016 年第 1 季度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 4 月 21 日
32	信达澳银基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为代销机构、开通转换和定投业务、参加基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 4 月 23 日
33	关于信达澳银慧管家货币市场基金 2016 年“劳动节”假期前暂停申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 4 月 26 日
34	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 5 月 10 日
35	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 5 月 20 日
36	信达澳银基金管理有限公司关于增加创金启富为代销机构、开通转换和定投业务、参加基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 5 月 25 日
37	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 6 月 1 日

38	关于信达澳银慧管家货币基金 2016 年“端午节”假期前暂停申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 6 月 3 日
39	关于信达澳银基金管理有限公司 E 达通网上交易平台建行卡暂停快捷开户服务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 6 月 20 日
40	信达澳银基金管理有限公司关于在京东金融官方旗舰店开展申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 6 月 30 日
41	信达澳银慧管家货币市场基金基金经理变更公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 8 月 12 日
42	信达澳银基金管理有限公司关于修改信达澳银慧管家货币市场基金基金合同及托管协议的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 8 月 19 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

1. 本基金管理人于 2016 年 8 月 12 日发布公告，自 2016 年 8 月 12 日起，綦鹏离任本基金基金经理。
2. 为保护基金持有人利益，根据相关法律法规，本基金管理人的中方股东信达证券于 2016 年 4 月 25 日以不低于本基金持有的账面价值的价格通过银行间市场从本基金账户买入 30 万张 15 东特钢 CP002。
3. 本基金管理人于 2016 年 8 月 19 日发布《关于修改信达澳银慧管家货币市场基金基金合同托管协议的公告》，本基金《基金合同》与《托管协议》的修改内容系根据中国证监会 2015 年 12 月 17 日颁布的证监会令【第 120 号】《货币市场基金监督管理办法》的规定修改，相关修改内容对基金持有人利益无实质性不利影响，且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化，无需召开基金份额持有人大会。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信达澳银慧管家货币市场基金基金合同》；

- 3、《信达澳银慧管家货币市场基金托管协议》;
- 4、法律意见书;
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照;
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告;
- 8、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询信达澳银基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：www.fscinda.com