

安信保证金交易型货币市场基金 2016 年第 4 季度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

报告送出日期：2017 年 1 月 21 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 1 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信货币
场内简称	安信货币
交易代码	511680
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 9 日
报告期末基金份额总额	14,919,966.17 份
投资目标	在力争保持基金资产相对低风险和相对高流动性的前提下，追求高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	久期配置上，本基金根据对未来利率变动的合理预判，结合基金未来现金流的综合预期，动态决定和调整投资组合平均剩余期限。类属配置上，通过对各类别金融工具政策倾向、税收政策、信用等级、收益率水平、资金供求、流动性等因素的研究判断，来确定并动态调整投资组合国债、央行票据、债券回购、非金融企业债务融资工具及现金等各类属品种的配置比例。个券选择上，优先选择高信用等级的流动性好的债券品种，并对低估值品种进行重点关注。此外，本基金还会采用套利策略、回购策略、流动性管理策略，在保持高流动性的基础上，把握无风险套利机会，获取安全的超额收益。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率

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较低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商证券股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年10月1日－2016年12月31日）
1. 本期已实现收益	15,360,350.55
2. 本期利润	15,360,350.55
3. 期末基金资产净值	1,491,996,612.57

注：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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

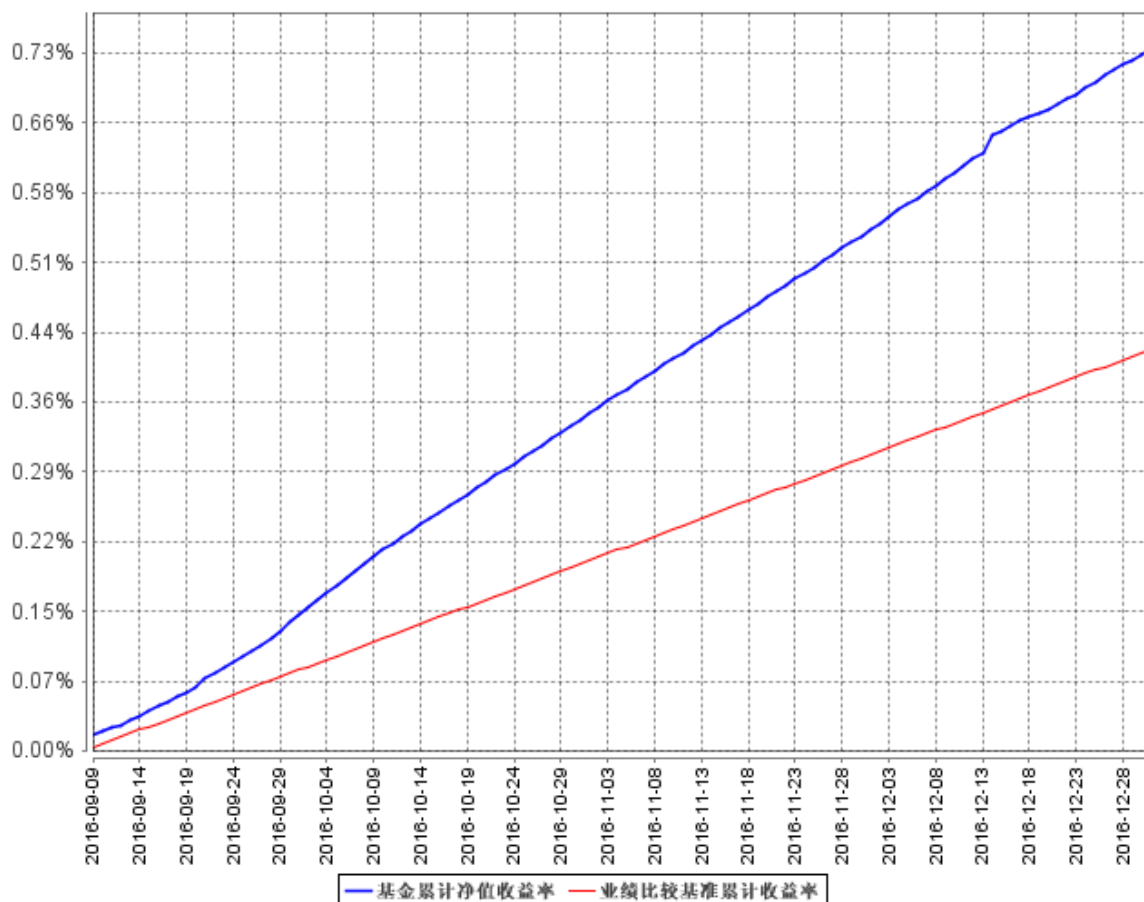
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5994%	0.0015%	0.3393%	0.0000%	0.2601%	0.0015%

注：1、业绩比较基准收益率=七天通知存款税后利率；

2、本基金收益分配为按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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、本基金基金合同生效日为 2016 年 9 月 9 日，图示日期为 2016 年 9 月 9 日至 2016 年 12 月 31 日；

2、本基金的建仓期为 2016 年 9 月 9 日至 2017 年 3 月 8 日，本基金目前仍然处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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		
杨凯玮	本基金的基金经理、固定收益部总经理	2016 年 9 月 9 日	-	10	杨凯玮先生，台湾大学土木工程学、新竹交通大学管理学双硕士。历任台湾国泰人寿保险股份有限公司研究员，台湾新光人寿保险股份有限公司投资组合高级专员，台湾中华开发工业

				<p>银行股份有限公司自营交易员，台湾元大宝来证券投资信托股份有限公司基金经理，台湾宏泰人寿保险股份有限公司科长，华润元大基金管理有限公司固定收益部总经理，安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部总经理。现任安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信安盈保本混合型证券投资基金、安信新视野灵活配置混合型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信现金管理货币市场基金、安信保证金交易型货币市场基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：1、此处的“任职日期”、“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 公平交易专项说明

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度经济好转，央行收紧货币政策，重心转向去杠杆，资金面长期呈现紧平衡，月末、季末还时常出现“钱荒”现象。短端收益率一路上行，尤其 12 月急速大涨使得短期资产利率已回到历史中高位，具有较高配置价值。

本货币基金在报告期内保持了较低的久期和较好的流动性以满足客户的需求。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.0000 元，本报告期份额净值增长率为 0.5994%，同期业绩比较基准增长率为 0.3393%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	942,665,805.51	57.09
	其中：债券	882,665,805.51	53.46
	资产支持证券	60,000,000.00	3.63
2	买入返售金融资产	196,800,535.20	11.92
	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	488,875,380.51	29.61
4	其他资产	22,887,887.63	1.39
5	合计	1,651,229,608.85	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	5.34	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	153,799,791.80	10.31
	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	2016 年 12 月 19 日	23.45	巨额赎回	6 个工作日
2	2016 年 12 月 20 日	29.73	巨额赎回	5 个工作日
3	2016 年 12 月 21 日	27.53	巨额赎回	4 个工作日
4	2016 年 12 月 22 日	31.43	巨额赎回	3 个工作日
5	2016 年 12 月 23 日	27.20	巨额赎回	2 个工作日
6	2016 年 12 月 26 日	25.82	巨额赎回	1 个工作日

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	72
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	99
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金未出现投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

5.3.2 报告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	24.48	3.94
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	5.33	-
2	30 天(含)-60 天	32.78	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	16.72	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	2.03	-
4	90 天(含)-120 天	20.68	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	15.15	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	109.81	3.94

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期未出现投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	97,048,586.77	6.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	109,839,059.70	7.36
	其中：政策性金融债	109,839,059.70	7.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	80,216,596.43	5.38
6	中期票据	-	-
7	同业存单	595,561,562.61	39.92
8	其他	-	-
9	合计	882,665,805.51	59.16
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	109,839,059.70	7.36

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019539	16 国债 11	870,280	87,088,093.39	5.84
2	160202	16 国开 02	800,000	79,548,809.94	5.33
3	111694110	16 福建海峡	800,000	78,912,832.13	5.29

		银行 CD025			
4	111699256	16 长安银行 CD046	700,000	69,798,714.87	4.68
5	111690848	16 温州银行 CD024	700,000	69,691,271.96	4.67
6	111691727	16 绍兴银行 CD022	600,000	59,592,494.51	3.99
7	111692373	16 郑州银行 CD030	600,000	59,470,774.69	3.99
8	111699000	16 合肥科技 农村商行 CD027	600,000	59,397,871.73	3.98
9	111690841	16 湖北银行 CD005	500,000	49,765,062.69	3.34
10	111690880	16 贵州花溪 农商行 CD003	500,000	49,750,814.95	3.33

5.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0306%
报告期内偏离度的最低值	-0.2478%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0666%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期未出现负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

5.8 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净 值比例(%)
1	142333	花呗 11 优 先级	600,000.00	60,000,000.00	4.02

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	20,405.37
2	应收证券清算款	9,997,626.06
3	应收利息	7,044,379.24
4	应收申购款	-
5	其他应收款	5,825,476.96
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	22,887,887.63

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	17,286,338.05
报告期期间基金总申购份额	30,506,733.50
报告期期间基金总赎回份额	32,873,105.38
报告期期末基金份额总额	14,919,966.17

注：申购含红利再投份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准安信保证金交易型货币市场基金募集的文件；
- 2、《安信保证金交易型货币市场基金基金合同》；
- 3、《安信保证金交易型货币市场基金托管协议》；
- 4、《安信保证金交易型货币市场基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

8.2 存放地点

安信基金管理有限责任公司

地址：中国广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

8.3 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
2017 年 1 月 21 日