

安信保证金交易型货币市场基金 2017 年半年度报告

2017 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：招商证券股份有限公司

送出日期：2017 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 21 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 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§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	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§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.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
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.....	41
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.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	43
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.....	43
7.9 投资组合报告附注.....	43
§8 基金份额持有人信息.....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.4 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.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	50
10.9 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	53

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§12 备查文件目录.....	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信保证金交易型货币市场基金
基金简称	安信货币
场内简称	安信货币
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	2,334,500.43 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016 年 9 月 27 日

2.2 基金产品说明

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。

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	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江晖	郭杰
	联系电话	0755-82509999	0755-82943666
	电子邮箱	service@essencefund.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95565
传真		0755-82799292	0755-82960794
注册地址		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	广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38 层至 45 层
办公地址		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	广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38 层至 45 层
邮政编码		518026	518026
法定代表人		刘入领	霍达

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管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人住所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	10,966,095.44
本期利润	10,966,095.44
本期净值收益率	1.3953%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末基金资产净值	233,450,036.70
期末基金份额净值	100.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
累计净值收益率	2.1410%

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、本基金为货币市场基金，无认(申)购或交易基金的各项费用。

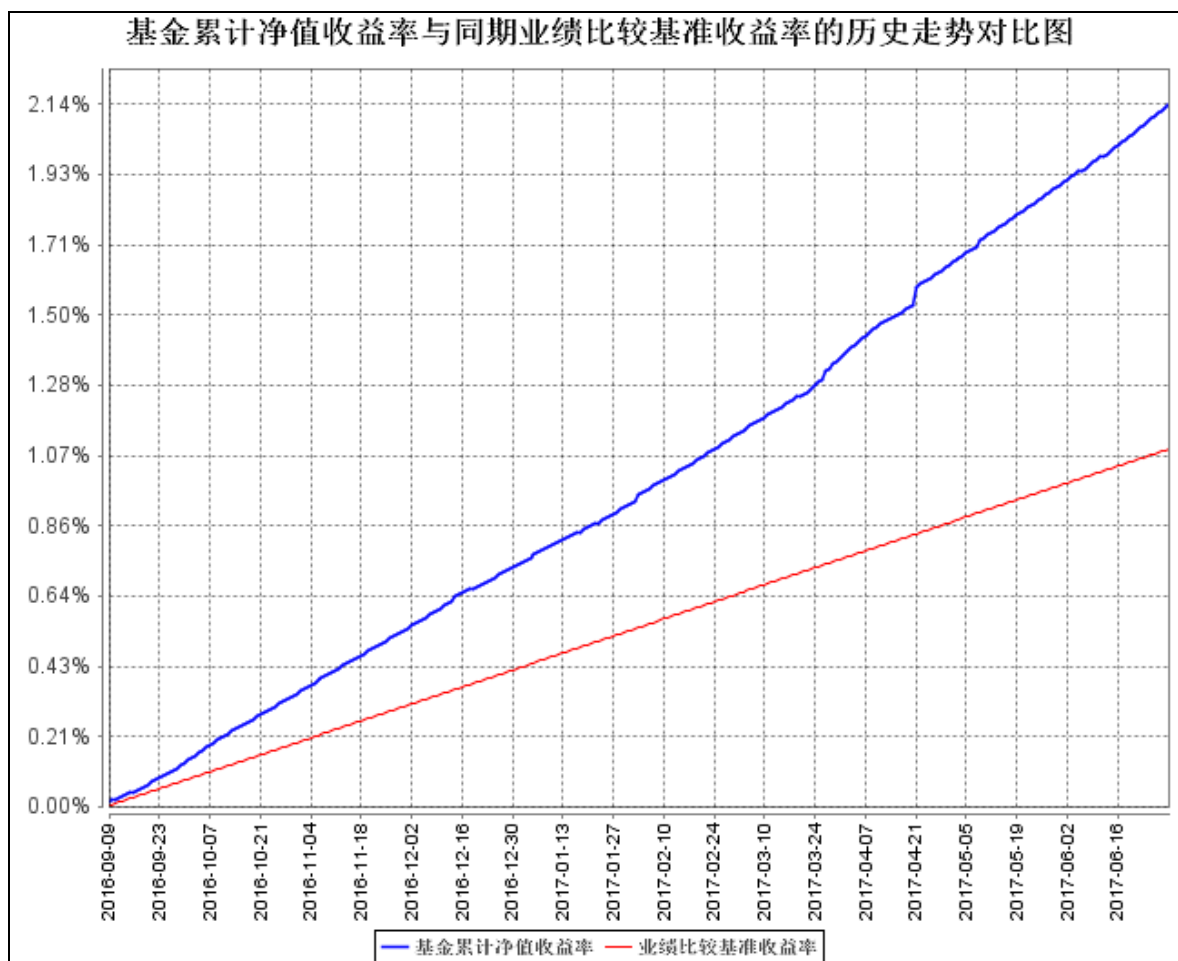
3、本基金收益分配为按日结转份额。

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

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	0.2408%	0.0018%	0.1110%	0.0000%	0.1298%	0.0018%
过去三个月	0.7624%	0.0054%	0.3366%	0.0000%	0.4258%	0.0054%
过去六个月	1.3953%	0.0043%	0.6695%	0.0000%	0.7258%	0.0043%
自基金合同 生效起至今	2.1410%	0.0036%	1.0911%	0.0000%	1.0499%	0.0036%

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



注：1、本基金合同生效日为 2016 年 9 月 9 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年；
 2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 34 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 日起管理安信宝利债券型证券投资基金(LOF)(原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；从 2015 年 8 月 7 日起管理安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金；从 2015 年 11 月 24 日起管理安信新动力灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 3 月 9 日起管理安信安盈保本混合型证券投资基金；从 2016 年 5 月 9 日起管理安信新回报灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 7 月 28 日起管理安信新优选灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 8 月 9 日起管理安信新目标灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 8 月 19 日起管理安信新价值灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 9 月 9 日起管理安信保证金交易型货币市场基金；从 2016 年 9 月 29 日起管理安信新成长灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 9 月 29 日起管理安信尊享纯债债券型证券投资基金；从 2016 年 10 月 10 日起管理安信永丰定期开放债券型证券投资基金；从 2016 年 10 月 12 日起管理安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金；从 2016 年

10 月 17 日起管理安信活期宝货币市场基金；从 2016 年 12 月 9 日起管理安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 12 月 19 日起管理安信新视野灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 1 月 13 日起管理安信永鑫定期开放债券型证券投资基金；从 2017 年 3 月 16 日起管理安信新起点灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 3 月 16 日起管理安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 3 月 29 日起管理安信合作创新主题沪港深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（助理）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	-	11	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。
肖芳芳	本基金的基金经理	2017年6月6日	-	6	肖芳芳女士，经济学硕士。历任华宝证券有限责任公司任资产管理部研究员、财达证券有限责任公司任资产管理部投资助理。2016年4月5日加入安信基金管理有限责任公司任固定收益部投研助理，现任固定收益部基金经理。曾任安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信保证金交易型货币市场基金的基金经理助理，现任安信安盈保本混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新视野灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，现任安信保证金交易型货币市场基金、安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信活期宝货币市场基金的基金经理。
任凭	本基金的基金经理助理	2016年10月24日	-	10	任凭女士，法学硕士。先后在招商基金管理有限公司、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。现任安信保证金交易型货币市场基金、安信活期宝货币市场基金、安信新视野灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金的基金经理助理。
徐越	本基金的基金经理助理	2016年9月9日	-	2	徐越女士，文学硕士。历任安信基金管理有限责任公司交易员，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部研究员。现任安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信保证金交易型证券投资基金、安信活期宝证券投资基金、安信安盈保本混合型证券投资基金的基金经理助理。
肖芳芳	本基金的基金经理助理	2016年9月9日	2016年10月24日	6	肖芳芳女士，经济学硕士。历任华宝证券有限责任公司任资产管理部研究员、财达证券有限责任公司任资产管理部投资助理。2016年4月5日加入安信基金管理有限责任公司任固定收益部投研助理，现任固定收益部基金经理。曾任安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信保证金交易型货币市

					<p>场基金的基金经理助理，现任安信安盈保本混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新视野灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，现任安信保证金交易型货币市场基金、安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信活期宝货币市场基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注：1、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写；基金经理助理的“任职日期”根据公司决定确定的聘任日期填写。“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遵规守信情况的说明

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

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。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

上半年宏观基本面基本稳定、略有转弱，监管面上演过山车。3 月开始，各监管机构纷纷开始收紧监管，在此背景下，资金面持续紧张；5 月下旬至 6 月初，在“不因处置风险引发新风险”的声音发出后，央行在公开市场的操作明显出现了缓和，资金面大部分时间比较宽松；6 月 12 号银行自查报告得到银监局许可延期后，债券市场情绪全面好转。

具体资产价格来看，shibor3m 由 4.35 附近上升到 4.75 附近后回落，高点出现在 6 月中；货币市场资产价格基本与 shibor3m 资金面 3 季度资金面紧张程度低于预期；银行接受 MPA 考核一年后，应对考核方面已成熟，目前考核时点体系内资金均较充裕，每逢季末央行甚至连续净回笼资金。非银机构对 MPA 考核银行资金融出减少有所预期，非银体系内准备充裕，虽然跨季价格维持高位，但供需基本平衡。

在上述背景下，产品以保持充裕流动性为首要考虑因素，顺利的应对了半年末，同时储备了一定资产，产品收益率较好，波动较低。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 100.00 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.3953%，业绩比较基准收益率为 0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年底至 2017 年上半年，金融市场最大的风险是监管政策风险，监管去杠杆愈演愈烈，导致债券市场收益率全面上行、股市也一度出现调整。经过半年左右时间的调整，我们认为去杠杆已经取得了一定的成效。但考虑到：1) 监管政策尚未落地，本轮去杠杆尚未有最终定论；2) 浮亏或收益率不达预期的委外户尚未出清；商业银行风险释放的过程会较长，急速冲击引起的快速大幅调整可能难以再次出现。机会仍然可能出现在两个时间。1) 新的监管办法出台后的情绪冲击，鉴于机构久期均不长，更可能是利空出尽的信号；2) 银行为符合监管要求调整资产带来收益率的波动，由于银行资产不确定性，以及优质资产处置速度快于相对较差资产，这种时机可以获得的有价格优势资产往往资质较差；经济的潜在增长下降是一致预期，短期扰动可能是机会。固收方面，我们认为当前债券市场最黑暗的时候已经过去，具体到货币市场，季末扰动仍然不会消

失，我们的策略仍然是优先配置季末资产，兼顾收益性和流动性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、证监会的相关规定以及基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。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。估值委员会负责人由公司分管投资的副总经理担任，估值委员会成员由运营部、权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部、信用研究部和监察稽核部分别委派一名或多名代表组成。估值委员会各成员职责分工如下：权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部及信用研究部负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经历。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。

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。截至报告期末本基金管理人已签约的定价服务机构为中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司，由其按约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，根据法律法规及《基金合同》的约定，本基金根据每日基金收益情况，以基金份额的每百份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，并每日结转份额，计入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 10,966,095.44 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

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，招商证券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。

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：安信保证金交易型货币市场基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	21,393,401.90	458,188,308.96
结算备付金		135,732.27	30,687,071.55
存出保证金		5,918.75	20,405.37
交易性金融资产	6.4.7.2	151,786,901.98	942,665,805.51
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		141,786,901.98	882,665,805.51
资产支持证券投资		10,000,000.00	60,000,000.00
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	59,800,329.70	196,800,535.20
应收证券清算款		-	9,997,626.06
应收利息	6.4.7.5	764,788.89	7,044,379.24
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	5,825,476.96
资产总计		233,887,073.49	1,651,229,608.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		-	153,799,791.80
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		63,022.83	656,279.16
应付托管费		21,007.62	218,759.73
应付销售服务费		52,519.06	546,899.32
应付交易费用	6.4.7.7	16,937.24	40,936.09
应交税费		-	-
应付利息		-	11,855.92
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	283,550.04	3,958,474.26
负债合计		437,036.79	159,232,996.28
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	233,450,036.70	1,491,996,612.57
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		233,450,036.70	1,491,996,612.57
负债和所有者权益总计		233,887,073.49	1,651,229,608.85

注：注：报告截止日 2017 年 06 月 30 日，本基金份额净值 100.00 元。本基金份额总额 2,334,500.43 份。

6.2 利润表

会计主体：安信保证金交易型货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		14,117,557.03
1.利息收入		13,721,177.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,195,326.89
债券利息收入		7,604,439.21
资产支持证券利息收入		560,138.36
买入返售金融资产收入		3,361,272.89
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		346,329.25
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.12	608,355.70
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.	-262,026.45
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
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）	6.4.7.16	50,050.43
减：二、费用		3,151,461.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,260,911.69
2. 托管费	6.4.10.2.2	420,303.91
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,050,759.70
4. 交易费用	6.4.7.17	20.31
5. 利息支出		150,210.60
其中：卖出回购金融资产支出		150,210.60
6. 其他费用	6.4.7.18	269,255.38

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,966,095.44
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,966,095.44

注：本基金合同生效日为 2016 年 9 月 9 日，无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信保证金交易型货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	1,491,996,612.57	-	1,491,996,612.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,966,095.44	10,966,095.44
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）	-1,258,546,575.87	-	-1,258,546,575.87
其中：1.基金申购款	602,976,195.44	-	602,976,195.44
2.基金赎回款	-1,861,522,771.31	-	-1,861,522,771.31
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）	-	-10,966,095.44	-10,966,095.44
五、期末所有者权益（基金净值）	233,450,036.70	-	233,450,036.70

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：

<u>刘入领</u>	<u>范瑛</u>	<u>尚尔航</u>
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

安信保证金交易型货币市场基金（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”）2016年6月2日下发的证监许可[2016]1207号文《关于核准安信保证金交易型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《安信保证金交易型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2016年9月1日至2016年9月5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(2016)验字60962175_H54号验资报告。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,798,596,000.00元。经向中国证监会备案，《安信保证金交易型货币市场基金基金合同》于2016年9月9日正式生效。截至2016年9月9日止，安信保证金交易型货币市场基金已收到的首次发售募集的有效认购金额（本基金不收取认购费用）为人民币1,798,596,000.00元，折合1,798,596,000.00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87,750.00元，折合87,750.00份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币1,798,683,750.00元，折合1,798,683,750.00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，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《安信保证金交易型货币市场基金基金合同》和《安信保证金交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定，安信保证金交易型货币市场基金在基金合同生效当日，安信基金管理有限责任公司（以下简称“本基金管理人”）将为本基金办理份额折算，并由注册登记机构进行基金份额的变更登记。基金份额持有人持有的基金份额对应为折算前基金份额持有人持有的基金份额/100。本基金的份额折算日为2016年9月9日，折算前基金份额总额为1,798,683,750.00份，折算后的基金份额总额为17,986,838.00份，折算后基金份额净值为人民币100.00元。

安信保证金于2016年9月27日经上海证券交易所自律监管决定书[2016]238号文核准同意在上海证券交易所上市交易，上市交易份额为17,986,838.00份。本基金上市交易后，所有的

基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

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，本基金的投资范围包括现金，期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款，债券回购，中央银行票据，同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券，非金融企业债务融资工具，资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他具有良好流动性的货币市场工具（但须符合中国证监会的规定）。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〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 2017 年 06 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 06 月 30 日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、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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 营业税、增值税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。

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。

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以及金融同业往来利息收入免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

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，由债券发行企业及金融机构在向基金派发债券的利息及储蓄利息时代扣代缴 20%的个人所得税；

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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	21,393,401.90
定期存款	-

其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	21,393,401.90

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 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	29,965,218.50	29,883,000.00	-82,218.50	-0.0352%
	银行间市场	111,821,683.48	111,960,800.00	139,116.52	0.0596%
	合计	141,786,901.98	141,843,800.00	56,898.02	0.0244%

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 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	59,800,329.70	-
合计	59,800,329.70	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期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 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	5,070.18
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	85.95
应收债券利息	555,644.86
应收买入返售证券利息	21,157.80
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	182,830.10
合计	764,788.89

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 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	16,937.24
合计	16,937.24

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	283,550.04
合计	283,550.04

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,919,966.17	1,491,996,612.57
本期申购	6,029,761.94	602,976,195.44
本期赎回(以“-”号填列)	-18,615,227.68	-1,861,522,771.31
本期末	2,334,500.43	233,450,036.70

6.4.7.10 未分配利润

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	10,966,095.44	-	10,966,095.44
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	-10,966,095.44	-	-10,966,095.44
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	196,613.81
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,941,083.44
结算备付金利息收入	57,520.29
其他	109.35
合计	2,195,326.89

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。

6.4.7.12 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
	2017年1月1日至2017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	608,355.70
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	608,355.70

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
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,362,227,931.03

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付） 成本总额	1,357,147,635.44
减：应收利息总额	4,471,939.89
买卖债券差价收入	608,355.70

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	50,676,044.29
减：卖出资产支持证券成本总额	50,000,000.00
减：应收利息总额	938,070.74
资产支持证券投资收益	-262,026.45

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	50,050.43
合计	50,050.43

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	20.31
银行间市场交易费用	-
合计	20.31

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
银行划款费用	24,441.34
其他	764.00
上市费	26,341.92
银行间帐户维护费	19,353.84
合计	269,255.38

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，本基金无需要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要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、基金销售机构
招商证券股份有限公司（以下简称“招商证券”）	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
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	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
安信乾正股权投资管理（深圳）有限公司	基金管理人子公司的子公司

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、本基金管理人子公司安信乾盛财富管理（深圳）有限公司于 2015 年 11 月 3 日设立了全资子公司安信乾正股权投资管理（深圳）有限公司。

3、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 股票交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

当期发生的基金应支付的管理费	1,260,911.69
其中：支付销售机构的客户维护费	49,419.01

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.30% 的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

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
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	420,303.91

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

金额单位：人民币元

获得销售服务费 各关联方名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
安信基金	983,285.82
合计	983,285.82

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

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

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

本基金本报告期基金管理人未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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016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
招商证券股份有限公司	181,072.00	7.7600%	1,296,557.00	8.6900%

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 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司	21,393,401.90	196,613.81

注：本基金的银行存款由基金托管人招商证券保管，按约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期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

本基金本期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

已按再投资形式转实收	直接通过应付	应付利润	本期利润分配	备注

基金	赎回款转出金额	本年变动	合计	
10,966,095.44	-	-	10,966,095.44	-

6.4.12 期末（2017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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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，本基金无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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无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。

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。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、存款、短期融资券、剩余期限在 397 天以内的债券、剩余期限在 397 天以内的中期票据、剩余期限在 1 年以内的债券回购、剩余期限在 1 年以内的央行票据等。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。

截至本期末，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 34.95%。（上年度末为 45.39%）

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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	20,150,062.46	40,999,734.09
A-1 以下	-	-
未评级	61,615,943.82	229,525,073.89
合计	81,766,006.28	270,524,807.98

- 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。

6.4.13.2.2 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	上年度末
--------	-----	------

	2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	60,576,540.56	615,442,252.81
合计	60,576,540.56	615,442,252.81

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。

6.4.13.3 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，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 2017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	21,393,401.90	-	-	-	-	21,393,401.90
结算备付金	135,732.27	-	-	-	-	135,732.27
存出保证金	5,918.75	-	-	-	-	5,918.75
交易性金融资产	121,821,683.48	29,965,218.50	-	-	-	151,786,901.98
买入返售金融资产	59,800,329.70	-	-	-	-	59,800,329.70
应收利息	-	-	-	-	764,788.89	764,788.89
资产总计	203,157,066.10	29,965,218.50	-	-	764,788.89	233,887,073.49
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	63,022.83	63,022.83
应付托管费	-	-	-	-	21,007.62	21,007.62
应付销售服务费	-	-	-	-	52,519.06	52,519.06
应付交易费用	-	-	-	-	16,937.24	16,937.24
其他负债	-	-	-	-	283,550.04	283,550.04
负债总计	-	-	-	-	437,036.79	437,036.79
利率敏感度缺口	203,157,066.10	29,965,218.50	-	-	327,752.10	233,450,036.70

上年度末 2016 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	458,188,308.96	-	-	-	-	458,188,308.96
结算备付金	30,687,071.55	-	-	-	-	30,687,071.55
存出保证金	20,405.37	-	-	-	-	20,405.37
交易性金融资产	882,665,805.51	60,000,000.00	-	-	-	942,665,805.51
买入返售金融资产	196,800,535.20	-	-	-	-	196,800,535.20
应收证券清算款	-	-	-	-	9,997,626.06	9,997,626.06
应收利息	-	-	-	-	7,044,379.24	7,044,379.24
其他资产	-	-	-	-	5,825,476.96	5,825,476.96
资产总计	1,568,362,126.59	60,000,000.00	-	-	-22,867,482.26	1,651,229,608.85
负债						
卖出回购金融资产款	153,799,791.80	-	-	-	-	153,799,791.80
应付管理人报酬	-	-	-	-	656,279.16	656,279.16
应付托管费	-	-	-	-	218,759.73	218,759.73
应付销售服务费	-	-	-	-	546,899.32	546,899.32
应付交易费用	-	-	-	-	40,936.09	40,936.09
应付利息	-	-	-	-	11,855.92	11,855.92
其他负债	-	-	-	-	3,958,474.26	3,958,474.26
负债总计	153,799,791.80	-	-	-	-5,433,204.48	159,232,996.28
利率敏感度缺口	1,414,562,334.79	60,000,000.00	-	-	-17,434,277.78	1,491,996,612.57

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（2017年6月30日） 上年度末（2016年12月31日）

1、市场利率下降 25 个基点	160,294.39	974,157.79
2、市场利率上升 25 个基点	-159,804.50	-970,739.62

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。

§ 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	151,786,901.98	64.90
	其中:债券	141,786,901.98	60.62
	资产支持证券	10,000,000.00	4.28
2	买入返售金融资产	59,800,329.70	25.57
	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	21,529,134.17	9.20
4	其他各项资产	770,707.64	0.33
5	合计	233,887,073.49	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	1.42	
	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	-	-
	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

本基金本报告期末未出现债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的情况。

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	62
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	75
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	25

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

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	61.40	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	12.94	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	12.94	-
4	90 天(含)—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天 (含)	25.52	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

合计	99.86	-
----	-------	---

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

本基金本报告期末未出现投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

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	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	29,965,218.50	12.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,206,318.30	12.94
	其中：政策性金融债	30,206,318.30	12.94
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	19,999,421.36	8.57
6	中期票据	-	-
7	同业存单	61,615,943.82	26.39
8	其他	-	-
9	合计	141,786,901.98	60.74
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	30,206,318.30	12.94

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	111721055	17 渤海银行 CD055	421,000	42,010,325.44	18.00
2	130242	13 国开 42	300,000	30,206,318.30	12.94
3	019557	17 国债 03	300,000	29,965,218.50	12.84
4	071721004	17 渤海证券	200,000	19,999,421.36	8.57

		CP004			
5	111798690	17 包商银行 CD076	200,000	19,605,618.38	8.40

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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0635%
报告期内偏离度的最低值	-0.1935%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0535%

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。

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	142333	花呗 11 优先级(总价)	100,000.00	10,000,000.00	4.28

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

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 100.00 元。

7.9.2

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。

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	5,918.75
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	764,788.89
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	770,707.64

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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

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
209	11,169.86	2,279,363.33	97.64%	55,137.10	2.36%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	安信乾盛财富—浦发银行—安信乾盛朱雀新时空专项资产管理计划	363,620.00	15.58%
2	华润深国投信托有限公司—明远万吨资产深海鲸6号集合资金信托计划	249,169.00	10.67%
3	安信乾盛财富—民生银行—安信乾盛和信融智PIPE投资二号特定多客户资产管理计划	222,599.00	9.54%
4	安信乾盛财富—民生银行—安信乾盛和信融智PIPE投资六号特定多客户资产管理计划	222,481.00	9.53%
5	安信乾盛财富—民生银行—安信乾盛和信融智PIPE投资五号特定多客户资产管理计划	222,252.00	9.52%
6	安信乾盛财富—民生银行—安	222,219.00	9.52%

	信乾盛和信融智 PIPE 投资三号 特定多客户资产管理计划		
7	招商证券股份有限公司	181,072.00	7.76%
8	安信基金—浦发银行—安信基金保腾丰利 2 号定增优化资产管理计划	152,386.00	6.53%
9	华宝信托有限责任公司—交银盛通精选集合资金信托计划 A 类 4 期	145,734.00	6.24%
10	申万宏源证券—中国银行—宏源证券股债双丰 8 号集合资产管理计划	101,282.00	4.34%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	30.00	0.0013%

8.4 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 9 月 9 日）基金份额总额	17,989,921.54
本报告期期初基金份额总额	14,919,966.17
本报告期基金总申购份额	6,029,761.94
减：本报告期基金总赎回份额	18,615,227.68
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	2,334,500.43

§ 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

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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 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	佣金	占当期佣金	

			成交总额的比 例		总量的比例	
国信证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金管理人制定了《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》，对券商交易单元的选择标准和程序进行了规定。本基金管理人将券商路演数量和质量、提供的信息充分性和及时性、系统支持等作为交易单元的选择标准，由权益投资部、研究部、运营部交易室对券商考评后提出租用及变更方案，最终由公司基金投资决策委员讨论及决定。

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
国信证券	79,954,100.00	100.00%	72,200,000.00	100.00%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-

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	法定披露方式	法定披露日期
1	安信基金管理有限责任公司关于旗下鼎龙股份估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2017 年 1 月 14 日
2	安信基金管理有限责任公司关于旗下先导智能估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2017 年 1 月 17 日
3	安信保证金交易型货币市场基金 2016 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2017 年 1 月 21 日
4	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	2017 年 2 月 18 日
5	安信基金管理有限责任公司关于旗下东方网力估值调整的公告	证券时报	2017 年 3 月 7 日
6	安信基金管理有限责任公司关于电子直销交易平台易购渠道部分银行卡暂停开户及增卡业务的公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2017 年 3 月 8 日
7	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	2017 年 3 月 24 日
8	安信基金管理有限责任公司关于临时暂停 T+0 快速赎回业务中当天申购并当天快速赎回业务的公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2017 年 4 月 13 日

9	安信基金管理有限责任公司关于恢复 T+0 快速赎回业务中当天申购并当天快速赎回业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 4 月 18 日
10	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	2017 年 4 月 18 日
11	安信保证金交易型货币市场基金更新招募说明书摘要（2017 年第 1 号）	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 4 月 21 日
12	安信保证金交易型货币市场基金 2017 年第 1 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 4 月 22 日
13	关于安信保证金交易型货币市场基金新增长江证券及光大证券为销售服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 4 月 28 日
14	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分公募基金参加上海陆金所资产管理有限公司基金认购、申购、定投进行费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 5 月 3 日
15	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持国电南瑞（600406）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 6 月 2 日
16	2017 年度 安信保证金交易型货币市场基金基金经理变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 6 月 7 日
17	安信基金管理有限责任公司关于电子直销交易平台增加中国民生银行股份有限公司厦门分	上海证券报、中国证券报、证券时报	2017 年 6 月 8 日

	行第三方支付业务的公告		
18	安信基金管理有限责任公司关于增加基金直销账户的公告	上海证券报、中国证券报、 证券时报	2017 年 6 月 8 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 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

2017年8月24日