

安信现金管理货币市场基金 2019 年半年度 报告

2019 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：2019 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 2019 年 8 月 26 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 2019 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	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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的真实、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.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§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.....	38
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.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.6 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.....	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.....	40
7.8 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.....	40

7.9 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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情况.....	43
§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
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.....	48
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.....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
§12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点.....	48
12.3 查阅方式.....	48

§ 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	6,963,011,738.38 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信现金管理货币 A	安信现金管理货币 B
下属分级基金的交易代码	750006	750007
报告期末下属分级基金的份额总额	112,017,125.28 份	6,850,994,613.10 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	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。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。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。4、回购策略。密切跟踪不同市场和不同期限之间的利率差异，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	田青
	联系电话	0755-82509999	010-67595096
	电子邮箱	service@essencefund.com	tianqingl.zh@ccb.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莲花街道益田路 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莲花街道益田路 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		刘入领	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	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

§ 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(2019年1月1日-2019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	1,183,769.21	82,946,739.56
本期利润	1,183,769.21	82,946,739.56
本期净值收益率	1.1980%	1.3187%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	

期末基金资产净值	112,017,125.28	6,850,994,613.10
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
累计净值收益率	25.3356%	27.2779%

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、本基金根据每日基金收益情况,每日计算当日收益并分配,每月集中支付。

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

安信现金管理货币 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	0.2051%	0.0015%	0.1110%	0.0000%	0.0941%	0.0015%
过去三个月	0.5772%	0.0012%	0.3366%	0.0000%	0.2406%	0.0012%
过去六个月	1.1980%	0.0012%	0.6695%	0.0000%	0.5285%	0.0012%
过去一年	2.6731%	0.0024%	1.3500%	0.0000%	1.3231%	0.0024%
过去三年	9.7957%	0.0026%	4.0500%	0.0000%	5.7457%	0.0026%
自基金合同生	25.3356%	0.0069%	8.6437%	0.0000%	16.6919%	0.0069%

安信现金管理货币 B

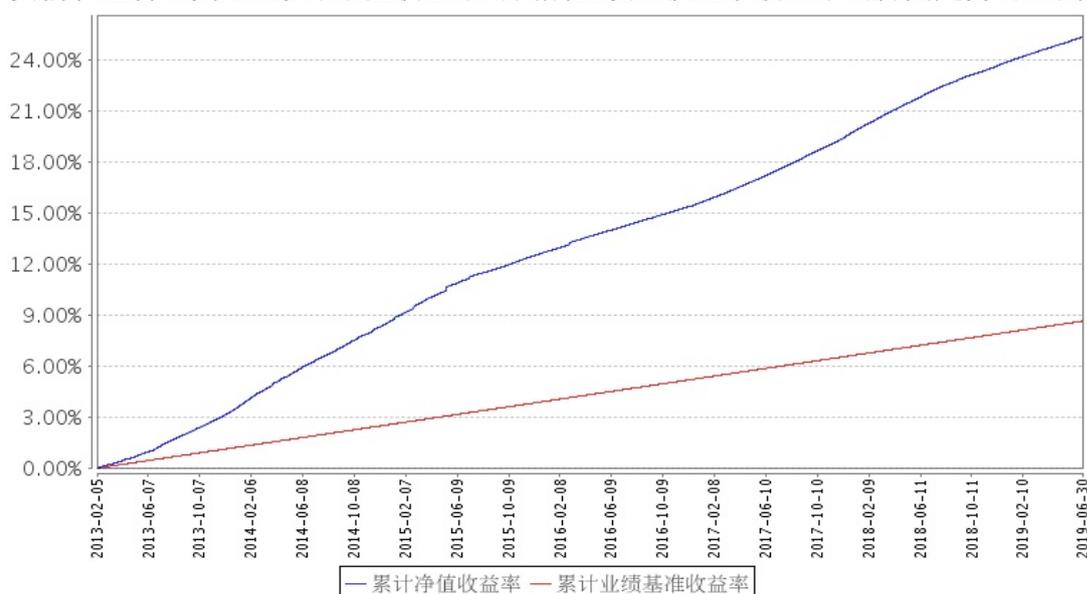
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2247%	0.0015%	0.1110%	0.0000%	0.1137%	0.0015%
过去三个月	0.6372%	0.0012%	0.3366%	0.0000%	0.3006%	0.0012%
过去六个月	1.3187%	0.0012%	0.6695%	0.0000%	0.6492%	0.0012%
过去一年	2.9202%	0.0024%	1.3500%	0.0000%	1.5702%	0.0024%
过去三年	10.5891%	0.0026%	4.0500%	0.0000%	6.5391%	0.0026%
自基金合同生	27.2779%	0.0069%	8.6437%	0.0000%	18.6342%	0.0069%

注: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

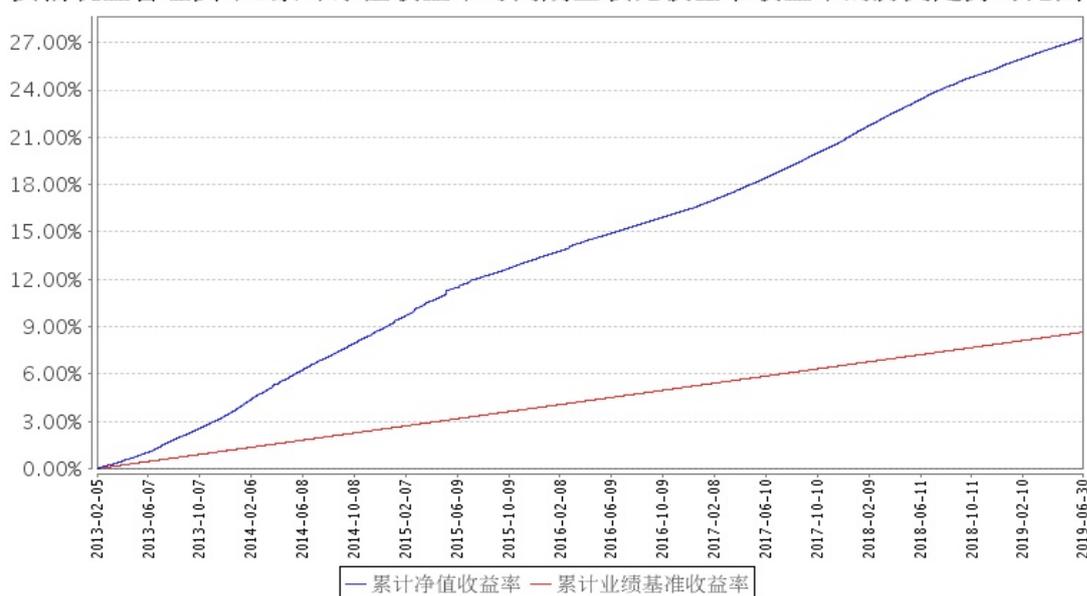
比较基准：七天通知存款利率(税后)。通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。

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A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



安信现金管理货币B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 2013 年 2 月 5 日。

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 5.0625 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 39.84%的股权，安信证券股份有限公司持有 33.95%的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 20.28%的股权，中广核财务有限责任公司持有 5.93%的股权。

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 48 只开放式基金具体如下：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、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）、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选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、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金（原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金）、安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信优享纯债债券型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争

力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金（LOF）。

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		
肖芳芳	本基金的 基金经理	2017年6月6 日	-	8	肖芳芳女士,经济学硕士。历任华宝证券有限责任公司资产管理部研究员,财达证券有限责任公司资产管理部投资助理,安信基金管理有限责任公司固定收益部投研助理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。曾任安信安盈保本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、安信保证金交易型货币市场基金、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,安信保证金交易型货币市场基金的基金经理;现任安信新目标灵活配置混合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、安信活期宝货币市场基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信鑫

					日享中短债债券型证券投资基金的基金经理。
杨凯玮	本基金的基金经理，固定收益部总经理	2016年3月14日	-	13	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。曾任安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信新视野灵活配置混合型证券投资基金、安信安盈保本混合型证券投资基金、安信保证金交易型货币市场基金的基金经理;现任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、安信现金管理货币市场基金、安信活期宝货币市场基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信优享纯债

					债券型证券投资基金的基金经理。
徐越	本基金的基金经理助理	2016年4月11日	-	4	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。曾任安信安盈保本混合型证券投资基金、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、安信活期宝证券投资基金的基金、安信恒利增强债券型证券投资基金的基金经理助理。
任凭	本基金的基金经理助理	2017年5月15日	-	12	任凭女士，法学硕士。曾任职于招商基金管理有限公司，2011年加入安信基金管理有限责任公司，历任运营部交易员、固定收益部投研助理，现任固定收益部基金经理。曾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、安信现金增利货币市场基金、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、安信优享纯债债券型证券投资基金的基金经理助理，安信活期宝

					货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信聚利增强债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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。

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

2019 年上半年，海外宏观经济方面，欧盟经济增长持续低迷，美国部分经济数据出现疲态，美联储降息预期强烈。国内宏观经济方面，建安、购地共同支撑地产投资、地产投资一枝独秀，基建投资仍旧低位徘徊，制造业投资低位企稳，消费进一步降低、低位震荡，受全球经济放缓和贸易摩擦影响，进出口增速均出现明显回落，但进口增速回落快于出口增速，逆差不降反升。

货币政策方面，整个一季度货币政策没有进一步放松，关键时间点公开市场净投放量与 2018 年前三个季度相比明显缩量。4 月，各机构公布的一季度宏观经济数据略超预期，央行货币政策延续了 1 季度以来的边际收紧；5 月初中美贸易战谈判形势恶化，央行对对聚焦当地、服务县域

的中小银行实行较低的优惠存款准备金率，分三次实施；5月24日，包商银行被托管，此后的1个月央行通过跨关键时间点的公开市场投放、超额续作MLF、增加再贴现和SLF额度等诸多方式缓解市场流动性风险。

一季度，shibor各期限利率趋势性回落，货币市场价格在低位小幅波动。本基金在一季度择机配置了1-6M优质资产，充分利用组合久期，保持了相对较高的静态收益。受到包商银行事件冲击，二季度，shibor各期限利率先上后下，波动较大。6月中下旬央行在公开市场上投放跨季资金后，shibor各期限利率出现不同幅度回落。6月下半月，AAA股份行3m存单发行利率大幅下降50bp至2.5%，AAA股份行6m存单发行利率大幅下降55bp至2.6%。本基金在二季度择机配置了1-3M优质资产，充分利用组合久期，保持了相对较高的静态收益，为三季度奠定了良好的基础。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期安信现金管理货币A的基金份额净值收益率为1.1980%，本报告期安信现金管理货币B的基金份额净值收益率为1.3187%，同期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

进入三季度，固定资产投资方面，鉴于上半年财政赤字已经在较高水平，专项债发行额度有限，基建增速可能会稳在目前的水平，难以大幅向上；地产投资增速可能会受累于拿地放缓而进一步下滑，但是由于16年销售的期房交房期在今年，建筑工程预计仍将支撑地产投资在一定水平；制造业投资受益于贸易战缓解，增速有望持续小幅回暖；净出口仍然有望支撑经济增长；消费增速方面预期将在目前的水平低位徘徊。

总的来说，经济数据出炉可能会渐显疲态，但是我们判断目前经济增长的目标是低底线稳增长（外贸、外资、投资），高底线稳就业、稳金融、稳预期。

货币政策方面，由于货币、债券市场已经紧密跟随央行货币政策、非常的市场化，利率并轨落地后，很难说会直接受到进一步的影响。从央行目前的态度来看，保持定力、“以我为主”仍然是主线。未来如果美联储先行降息，同时在国内经济超预期下滑时，央行或将指引利率走廊整体下移。

资金利率方面，比较确定的是，即使不进行全面降准降息，持续的定向降准也必然会带来增量流动性，进而带来重新定价。鉴于今年以来资金利率波动较大，三季度这一局面可能不会改变，我们认为货币组合一方面需要准备关键时间点的短期流动性、另一方面可拉长久期提高收益。

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，保证基金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，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。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。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债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司，由其按约定提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

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 84,130,508.77 元，其中本基金 A 类共分配人民币 1,183,769.21 元，B 类共分配人民币 82,946,739.56 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，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 84,130,508.77 元，其中本基金 A 类共分配人民币 1,183,769.21 元，B 类共分配人民币 82,946,739.56 元，不存在应分配但尚未实施分配的情况。

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（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	176,007,176.37	15,830,584.08
结算备付金		9,754,500.00	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	5,388,030,040.03	5,914,576,934.25
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,338,030,040.03	5,814,576,934.25
资产支持证券投资		50,000,000.00	100,000,000.00
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	1,426,608,572.96	355,940,903.91
应收证券清算款		20,149,500.00	-
应收利息	6.4.7.5	7,349,227.53	12,607,116.23
应收股利		-	-
应收申购款		51,222,972.77	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	1,841.00	1,841.00
资产总计		7,079,123,830.66	6,298,957,379.47
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2019 年 6 月 30 日	2018 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		112,934,620.56	351,884,112.17
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,179,134.56	1,785,394.67
应付托管费		357,313.47	541,028.69
应付销售服务费		51,394.55	85,474.87
应付交易费用	6.4.7.7	87,262.28	93,334.91
应交税费		17,798.31	115,950.67
应付利息		13,315.99	192,106.16
应付利润		1,345,857.22	1,804,439.17
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	125,395.34	322,333.33
负债合计		116,112,092.28	356,824,174.64
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	6,963,011,738.38	5,942,133,204.83
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		6,963,011,738.38	5,942,133,204.83
负债和所有者权益总计		7,079,123,830.66	6,298,957,379.47

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 6,963,011,738.38 份，其中安信现金管理货币 A 基金份额总额为 112,017,125.28 份，基金份额净值 1.0000；安信现金管理货币 B 基金份额总额为 6,850,994,613.10 份，基金份额净值 1.0000。

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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		103,950,165.50	169,147,890.46
1. 利息收入		102,424,223.63	168,560,435.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,997,185.10	16,520,144.29
债券利息收入		78,477,192.01	128,649,099.86
资产支持证券利息收入		1,555,383.06	119,233.10
买入返售金融资产收入		14,394,463.46	23,271,958.41
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,525,941.87	587,454.80

其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,505,485.20	583,688.91
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	20,456.67	3,765.89
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	6.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、费用		19,819,656.73	24,677,407.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,527,734.18	11,523,672.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,190,222.44	3,492,022.05
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	437,022.19	612,290.27
4. 交易费用	6.4.7.19	150.50	-
5. 利息支出		5,484,703.83	8,772,677.01
其中：卖出回购金融资产支出		5,484,703.83	8,772,677.01
6. 税金及附加		11,954.88	19,949.28
7. 其他费用	6.4.7.20	167,868.71	256,796.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		84,130,508.77	144,470,482.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		84,130,508.77	144,470,482.53

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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	5,942,133,204.83	-	5,942,133,204.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	84,130,508.77	84,130,508.77
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）	1,020,878,533.55	-	1,020,878,533.55
其中：1. 基金申购款	17,066,727,603.83	-	17,066,727,603.83
2. 基金赎回款	-16,045,849,070.28	-	-16,045,849,070.28

			28
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）	-	-84,130,508.77	-84,130,508.77
五、期末所有者权益（基金净值）	6,963,011,738.38	-	6,963,011,738.38
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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）	6,078,896,795.51	-	6,078,896,795.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	144,470,482.53	144,470,482.53
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）	707,999,531.74	-	707,999,531.74
其中：1. 基金申购款	19,669,286,502.15	-	19,669,286,502.15
2. 基金赎回款	-18,961,286,970.41	-	-18,961,286,970.41
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-144,470,482.53	-144,470,482.53
五、期末所有者权益（基金净值）	6,786,896,327.25	-	6,786,896,327.25

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

范瑛

苗杨

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[2013]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人民币 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。

根据《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》的有关规定,本基金的投资范围为现金、通知存款、短期融资券、1 年以内(含 1 年)的银行定期存款、大额存单、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的中期票据、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)的中央银行票据以及中国证监会认可的其他具有良好流动性的金融工具。

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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 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、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 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 企业所得税

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 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46 号文《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》、财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定及其他相关法规：

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，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，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；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；存款利息收入不征收增值税。

6.4.6.3 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 2019年6月30日	
	活期存款	6,007,176.37
定期存款	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	170,000,000.00	
合计	176,007,176.37	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019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	5,338,030,040.03	5,340,391,000.00	2,360,959.97	0.0339
	合计	5,338,030,040.03	5,340,391,000.00	2,360,959.97	0.0339
资产支持证券	50,000,000.00	50,000,000.00	-	-	
合计	5,388,030,040.03	5,390,391,000.00	2,360,959.97	0.0339	

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资产/负债。

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 2019年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	284,800,000.00	-
银行间市场	1,141,808,572.96	-
合计	1,426,608,572.96	-

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 2019年6月30日
应收活期存款利息	4,697.19
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	1,432,049.79
应收结算备付金利息	4,389.50
应收债券利息	5,371,139.68
应收资产支持证券利息	21,698.63
应收买入返售证券利息	515,252.74
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	7,349,227.53

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
其他应收款	1,841.00
待摊费用	-
合计	1,841.00

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019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	87,262.28
合计	87,262.28

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付审计费	54,547.97
应付信息披露费	61,699.85
应付银行间账户维护费	9,147.52
合计	125,395.34

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

安信现金管理货币 A

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	142,706,832.57	142,706,832.57
本期申购	102,749,294.39	102,749,294.39
本期赎回（以“-”号填列）	-133,439,001.68	-133,439,001.68
本期末	112,017,125.28	112,017,125.28

安信现金管理货币 B

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,799,426,372.26	5,799,426,372.26
本期申购	16,963,978,309.44	16,963,978,309.44
本期赎回（以“-”号填列）	-15,912,410,068.60	-15,912,410,068.60
本期末	6,850,994,613.10	6,850,994,613.10

注：申购含红利再投资、分级调整及基金转入份额；赎回含分级调整、转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

安信现金管理货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	1,183,769.21	-	1,183,769.21
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	-1,183,769.21	-	-1,183,769.21
本期末	-	-	-
安信现金管理货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

本期利润	82,946,739.56	-	82,946,739.56
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	-82,946,739.56	-	-82,946,739.56
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2019年1月1日至2019年6月30日	
活期存款利息收入		52,326.41
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		7,899,688.68
结算备付金利息收入		45,170.01
其他		-
合计		7,997,185.10

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 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2019年1月1日至2019年6月30日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额		9,754,807,523.86
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额		9,719,272,759.90
减：应收利息总额		34,029,278.76
买卖债券差价收入		1,505,485.20

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2019年1月1日至2019年6月30日	
卖出资产支持证券成交总额		136,616,159.38
减：卖出资产支持证券成本总额		135,108,283.53

减：应收利息总额	1,487,419.18
资产支持证券投资收益	20,456.67

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 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	150.50
合计	150.50

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	54,547.97
信息披露费	58,366.52
银行间账户维护费	19,107.52
银行汇划费用	35,846.70
合计	167,868.71

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

截至财务报表批准报出日，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
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司（以下简称“中广核财务”）	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司（以下简称“安信乾盛”）	基金管理人的子公司

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

6.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,527,734.18	11,523,672.96
其中：支付销售机构的客户维护费	257,925.66	429,263.68

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的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 为每日应计提的基金管理费

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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,190,222.44	3,492,022.05

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的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 为每日应计提的基金托管费

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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
安信基金	44,145.33	299,703.64	343,848.97
中国建设银行	21,740.72	-	21,740.72
安信证券	30,688.15	8,207.87	38,896.02
合计	96,574.20	307,911.51	404,485.71
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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
安信基金	45,725.99	313,330.69	359,056.68
中国建设银行	43,613.41	515.00	44,128.41
安信证券	145,520.58	11,486.59	157,007.17
合计	234,859.98	325,332.28	560,192.26

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

本基金本报告期及上年度可比期间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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
	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）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	143,496,692.49
报告期间申购/买入总份额	-	138,628,080.90
报告期间因拆分变动份额	-	
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	151,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	131,124,773.39
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-%	1.8800%
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
	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）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	156,060,945.20
报告期间申购/买入总份额	-	246,294,516.62
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	282,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	120,355,461.82
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-%	1.7700%

注：期间申购/买入总份额含红利再投份额；期间赎回/卖出总份额含转换出份额。本基金管理人运用自有资金投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

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

安信现金管理货币 B

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018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 (%)
安信证券	300,019,173.35	4.31	-	-
中广核财务	68,617,539.26	0.99	50,397,231.06	0.85
安信乾盛	-	-	10,837,428.85	0.18

注:本基金其他关联方投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	6,007,176.37	52,326.41	11,674,737.73	51,157.23

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,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

安信现金管理货币 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
1,203,847.79	-	-20,078.58	1,183,769.21	-
安信现金管理货币 B				
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
83,385,242.93	-	-438,503.37	82,946,739.56	-

6.4.12 期末(2019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 112,934,620.56 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
130404	13 农发 04	2019 年 7 月 1 日	101.00	78,000	7,878,313.70
190402	19 农发 02	2019 年 7 月 1 日	99.66	1,100,000	109,621,175.67
合计				1,178,000	117,499,489.37

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

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、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 2019 年 6 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 66.77%（2018 年 12 月 31 日：74.80%）。

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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	60,001,262.17	110,002,956.17
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	469,573,328.83	170,144,173.29
合计	529,574,591.00	280,147,129.46

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. 债券投资以净价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	50,000,000.00	100,000,000.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	50,000,000.00	100,000,000.00

注：1. 资产支持证券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 资产支持证券投资以净价列示。
3. 短期信用评级 A-1 所填列的资产支持证券均为 AAA 级的短期资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	3,671,261,820.04	3,917,782,090.27
A-1 以下	607,594,673.26	396,724,873.56
未评级	0.00	0.00
合计	4,278,856,493.30	4,314,506,963.83

注：1. 同业存单评级取自第三方评级机构的主体评级。

2. 短期信用评级 A-1 所填列的同业存单均为 AAA 级的同业存单。
3. 短期信用评级 A-1 以下所填列的同业存单均为 AAA 级以下的同业存单。

6.4.13.2.4 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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	529,598,955.73	1,219,922,840.96
合计	529,598,955.73	1,219,922,840.96

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. 债券投资以净价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 资产支持证券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 资产支持证券投资以净价列示。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全

开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值、份额持有人集中度以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、具有良好流动性的债券和货币市场工具，均在证券交易所或银行间同业市场交易，因此，除在 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），均能够及时变现。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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
-----	--------	----------	-------	-----	----

2019年6月30日					
资产					
银行存款	176,007,176.37	-	-	-	176,007,176.37
结算备付金	9,754,500.00	-	-	-	9,754,500.00
交易性金融资产	4,277,701,787.30	751,459,666.07	358,868,586.66	-	5,388,030,040.03
买入返售金融资产	1,426,608,572.96	-	-	-	1,426,608,572.96
应收利息	-	-	-	7,349,227.53	7,349,227.53
应收申购款	-	-	-	51,222,972.77	51,222,972.77
应收证券清算款	-	-	-	20,149,500.00	20,149,500.00
其他资产	-	-	-	1,841.00	1,841.00
资产总计	5,890,072,036.63	751,459,666.07	358,868,586.66	78,723,541.30	7,079,123,830.66
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,179,134.56	1,179,134.56
应付托管费	-	-	-	357,313.47	357,313.47
卖出回购金融资产款	112,934,620.56	-	-	-	112,934,620.56
应付销售服务费	-	-	-	51,394.55	51,394.55
应付交易费用	-	-	-	87,262.28	87,262.28
应付利息	-	-	-	13,315.99	13,315.99
应付利润	-	-	-	1,345,857.22	1,345,857.22
应交税费	-	-	-	17,798.31	17,798.31
其他负债	-	-	-	125,395.34	125,395.34
负债总计	112,934,620.56	-	-	3,177,471.72	116,112,092.28
利率敏感度缺口	5,777,137,416.07	751,459,666.07	358,868,586.66	75,546,069.58	6,963,011,738.38
上年度末 2018年12月31日	6个月以内	6个月 -1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款	15,830,584.08	-	-	-	15,830,584.08
交易性金融资产	5,075,084,755.50	410,861,316.11	428,630,862.64	-	5,914,576,934.25
买入返售金融资产	355,940,903.91	-	-	-	355,940,903.91
应收利息	-	-	-	12,607,116.23	12,607,116.23
其他资产	-	-	-	1,841.00	1,841.00
资产总计	5,446,856,243.49	410,861,316.11	428,630,862.64	12,608,957.23	6,298,957,379.47
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,785,394.67	1,785,394.67
应付托管费	-	-	-	541,028.69	541,028.69
卖出回购金融资产款	351,884,112.17	-	-	-	351,884,112.17
应付销售服务费	-	-	-	85,474.87	85,474.87
应付交易费用	-	-	-	93,334.91	93,334.91
应付利息	-	-	-	192,106.16	192,106.16
应付利润	-	-	-	1,804,439.17	1,804,439.17
应交税费	-	-	-	115,950.67	115,950.67
其他负债	-	-	-	322,333.33	322,333.33
负债总计	351,884,112.17	-	-	4,940,062.47	356,824,174.64
利率敏感度缺口	5,094,972,131.32	410,861,316.11	428,630,862.64	7,668,894.76	5,942,133,204.83

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		
	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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
分析	1、市场利率下降 25 个基点	4,671,344.91	5,822,334.44
	2、市场利率上升 25 个基点	-4,656,132.79	-5,802,221.66

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 其他价格风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

§ 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	5,388,030,040.03	76.11
	其中：债券	5,338,030,040.03	75.41
	资产支持证券	50,000,000.00	0.71
2	买入返售金融资产	1,426,608,572.96	20.15
	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	185,761,676.37	2.62
4	其他各项资产	78,723,541.30	1.11
5	合计	7,079,123,830.66	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	7.84	
	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	112,934,620.56	1.62
	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

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	2019年3月28日	30.37	大额赎回	3个交易日
2	2019年3月29日	24.86	大额赎回	2个交易日
3	2019年4月1日	23.66	大额赎回	2个交易日
4	2019年5月28日	20.46	大额赎回	2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	63
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	81
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	41

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期末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	34.35	1.62
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.43	-
2	30 天（含）—60 天	34.07	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	4.01	-
3	60 天（含）—90 天	17.44	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	0.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	14.26	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.83	1.62

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	689,135,244.73	9.90
	其中：政策性金融债	689,135,244.73	9.90
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	370,038,302.00	5.31
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,278,856,493.30	61.45
8	其他	-	-
9	合计	5,338,030,040.03	76.66
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	308,913,363.16	4.44

7.6 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	160309	16 进出 09	2,800,000	278,985,806.67	4.01
2	111997743	19 成都银行 CD110	1,500,000	149,533,298.81	2.15
3	111804102	18 中国银行 CD102	1,500,000	149,186,415.06	2.14
4	111810601	18 兴业银行 CD601	1,500,000	148,908,769.11	2.14
5	111820219	18 广发银行 CD219	1,200,000	119,433,524.37	1.72
6	111916081	19 上海银行 CD081	1,100,000	109,990,922.01	1.58
7	111916139	19 上海银行 CD139	1,100,000	109,917,761.60	1.58
8	111980832	19 恒生银行 CD010	1,100,000	109,793,416.77	1.58
9	111809344	18 浦发银行 CD344	1,100,000	109,769,698.94	1.58
10	190402	19 农发 02	1,100,000	109,621,175.67	1.57

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	0.1166%
报告期内偏离度的最低值	-0.0030%
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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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名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	156794	信泽 01A2	500,000	50,000,000.00	0.72

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体除 19 上海银行 CD139（证券代码：111916139CY）、19 上海银行 CD081（证券代码：111916081CY）、18 兴业银行 CD601（证券代码：111810601CY）、18 浦发银行 CD344（证券代码：111809344CY）、18 广发银行 CD219（证券代码：111820219CY），本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

上海银行股份有限公司于 2018 年 10 月 8 日收到中国银行业监督管理委员会上海监管局行政处罚（沪银监罚决字〔2018〕49 号），因违规向其关系人发放信用贷款，被责令改正，罚没合计 1091460.03 元。

上海银行股份有限公司于 2018 年 10 月 18 日收到上海银监局行政处罚决定书（沪银监罚决字〔2018〕54 号），因对某同业资金违规投向资本金不足的房地产项目合规性审查未尽职责，被罚款 50 万元。

兴业银行股份有限公司存在资产托管部副总经理任职时“不符合法定条件，未通过相关高级管理人员证券投资法律知识考试，不具备任职资格”的情形。上海证监局责令兴业银行股份有限公司于 2018 年 10 月 25 日前整改，健全基金托管业务内部控制制度，加强从业人员管理，并于 2018 年 10 月 25 日前提提交整改报告。

兴业银行股份有限公司于 2018 年 8 月 21 日因违规经营被深圳市消委会监管（约见）谈话，责令改正。

兴业银行股份有限公司于 2018 年 9 月 12 日因违规经营被上海证监局责令整改。

兴业银行股份有限公司于 2019 年 3 月 31 日因未依法履行职责被鼓东市场监管局罚款（鼓市场监管字〔2018〕108 号）。

上海浦东发展银行股份有限公司于 2018 年 7 月 26 日收到中国人民银行行政处罚（银反洗罚决字【2018】3 号），未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易，被处以 170 万元罚款。

广发银行股份有限公司于 2019 年 1 月 22 日收到行政处罚决定书（广州银罚字〔2019〕9 号），因违反支付结算管理规定，被处罚款 30,000 元。

广发银行股份有限公司于 2018 年 12 月 24 日收到中国人民银行佛山市中心支行行政处罚决定书（（佛银）罚字〔2018〕1 号），因违反《金融统计管理规定》以及人民银行《境内大中小微企业贷款专项统计制度》等相关制度，被警告，并处人民币 3 万元罚款。

基金管理人对上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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	20,149,500.00
3	应收利息	7,349,227.53
4	应收申购款	51,222,972.77
5	其他应收款	1,841.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	78,723,541.30

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

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	4,121	27,182.03	35,819,694.32	31.98	76,197,430.96	68.02
安信现金管理货币B	83	82,542,103.77	6,795,682,855.53	99.19	55,311,757.57	0.81
合计	4,204	1,656,282.53	6,831,502,549.85	98.11	131,509,188.53	1.89

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 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
----	-------	---------	-----------

1	保险类机构	306,688,513.65	4.40
2	保险类机构	306,668,280.89	4.40
3	保险类机构	304,125,327.55	4.37
4	保险类机构	303,262,605.15	4.36
5	银行类机构	300,038,064.13	4.31
6	券商类机构	300,019,173.35	4.31
7	保险类机构	250,031,720.10	3.59
8	其他机构	208,145,441.99	2.99
9	其他机构	200,044,822.46	2.87
10	银行类机构	200,025,376.08	2.87

注：占总份额比例的计算中，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	安信现金管理货币 A	8,091.59	0.0072
	合计	8,091.59	0.0001

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）。

8.4 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

项目	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	142,706,832.57	5,799,426,372.26
本报告期基金总申购份额	102,749,294.39	16,963,978,309.44
减：本报告期基金总赎回份额	133,439,001.68	15,912,410,068.60
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	112,017,125.28	6,850,994,613.10

§ 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

一、基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于 2019 年 6 月 1 日发布了《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》，经安信基金管理有限责任公司第三届董事会第十次会议审议通过，廖维坤先生自 2019 年 5 月 31 日起担任公司副总经理兼首席信息官。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。

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、托管人的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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
西藏东财	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	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
安信证券	20,084,800.00	100.00%	7,559,915,000.00	100.00%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

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	关于调整安信现金管理货币市场基金大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资限额的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2019-01-11
2	安信现金管理货币市场基金 2018 年第 4 季度报告	证券日报	2019-01-19
3	关于调整安信现金管理货币市场基金大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资限额的公告	证券日报	2019-01-25
4	安信基金管理有限责任公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司和北京钱景基金销售有限公司销售旗下基金业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2019-01-30
5	安信基金管理有限责任公司关于新增基金直销账户信息的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-02-28
6	安信现金管理货币市场基金更新招募	证券日报	2019-03-22

	说明书摘要（2019 年第 1 号）		
7	安信现金管理货币市场基金 2018 年年度报告摘要	证券日报	2019-03-29
8	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-04-03
9	安信现金管理货币市场基金 2019 年第 1 季度报告	证券日报	2019-04-22
10	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-05-13
11	关于安信平稳增长混合型发起式证券投资基金 C 类份额等基金新增开源证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、上海证券报	2019-05-15
12	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-05-20
13	关于调整安信现金管理货币市场基金代销渠道大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资限额的公告	证券日报	2019-05-21
14	关于安信现金管理货币市场基金在平安银行股份有限公司销售渠道调整大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资限额的公告	证券日报	2019-05-22
15	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-05-22
16	关于安信现金管理货币市场基金在联泰基金、好买基金、万得基金、华瑞保险等四家销售渠道调整大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资限额的公告	证券日报	2019-05-28
17	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、证券日报	2019-06-01
18	关于调整安信现金管理货币市场基金代销渠道大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资限额的公告	证券日报	2019-06-19
19	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-06-21
20	关于安信基金管理有限责任公司暂停快速取现业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-06-29

		报	
--	--	---	--

§ 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。

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

2019年8月27日