

# 信达澳银慧管家货币市场基金 2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 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 3 月 26 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 3 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。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 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         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....         | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 12        |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>13</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 13        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 15        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 15        |
| 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.....             | 16        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 16        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 17        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 17        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 18        |
| 4.9 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.....       | 18        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>18</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 18        |
| 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..... | 18        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....      | 18        |
| <b>§6 审计报告</b> .....                         | <b>18</b> |
| <b>§7 年度财务报表</b> .....                       | <b>19</b> |
| 7.1 资产负债表.....                               | 19        |
| 7.2 利润表.....                                 | 21        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 22        |
| 7.4 报表附注.....                                | 23        |
| <b>§8 投资组合报告</b> .....                       | <b>44</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 44        |
| 8.2 债券回购融资情况.....                            | 44        |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限.....                        | 45        |
| 8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 46        |
| 8.5 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.....      | 46        |
| 8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....          | 46        |
| 8.7 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.....   | 47        |
| 8.8 投资组合报告附注.....                            | 47        |
| <b>§9 基金份额持有人信息</b> .....                    | <b>47</b> |

|  |           |
|--|-----------|
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....             | 47        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....          | 48        |
| 9.3 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..... | 48        |
| <b>§10 开放式基金份额变动.....</b>              | <b>48</b> |
| <b>§11 重大事件揭示.....</b>                 | <b>49</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                  | 49        |
| 11.2 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.....  | 49        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....       | 49        |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                    | 49        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....             | 49        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....     | 50        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....            | 50        |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....             | 52        |
| 11.9 其他重大事件.....                       | 52        |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>         | <b>57</b> |
| <b>§13 备查文件目录.....</b>                 | <b>57</b> |
| 13.1 备查文件目录.....                       | 57        |
| 13.2 存放地点.....                         | 57        |
| 13.3 查阅方式.....                         | 57        |

## § 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      | 6,066,707,068.04 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    |
| 下属分级基金的场内简称:    | -                  | -                  | -              |
| 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 | 659,439,389.09 份   | 5,405,307,330.40 份 | 1,960,348.55 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 | tianqing1.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》                         |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.fscinda.com                 |
| 基金年度报告备置地点          | 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                                |
|--------|--------------------|-------------------------------------|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室 |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

### 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 | 2015 年                                    |                  |              |
|---------------|---|------------------|--------------|
|               | 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  |
| 本期已实现收益       | 11,873,731.47                             | 41,237,980.87    | 254,722.23   |
| 本期利润          | 11,873,731.47                             | 41,237,980.87    | 254,722.23   |
| 本期净值收益率       | 4.2809%                                   | 4.5084%          | 3.9894%      |
|               | 2014 年 6 月 26 日（基金合同生效日）-2014 年 12 月 31 日 |                  |              |
|               | 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  |
| 本期已实现收益       | 960,856.03                                | 6,313,825.16     | 32,539.18    |
| 本期利润          | 960,856.03                                | 6,313,825.16     | 32,539.18    |
| 本期净值收益率       | 1.9079%                                   | 2.0389%          | 1.7421%      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末                                   |                  |              |
| 期末基金资产净值      | 659,439,389.09                            | 5,405,307,330.40 | 1,960,348.55 |
| 期末基金份额净值      | 1.0000                                    | 1.0000           | 1.0000       |
|               | 2014 年末                                   |                  |              |
| 期末基金资产净值      | 34,685,830.56                             | 485,374,822.96   | 1,027,853.46 |

|              |         |         |         |
|--------------|---------|---------|---------|
| 期末基金份额净值     | 1.0000  | 1.0000  | 1.0000  |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2015 年末 |         |         |
| 累计净值收益率      | 6.2704% | 6.6393% | 5.8010% |
|              | 2014 年末 |         |         |
| 累计净值收益率      | 1.9079% | 2.0389% | 1.7421% |

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     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月      | 0.7459%  | 0.0080%     | 0.4424%    | 0.0000%       | 0.3035% | 0.0080% |
| 过去六个月      | 1.6086%  | 0.0103%     | 0.8847%    | 0.0000%       | 0.7239% | 0.0103% |
| 过去一年       | 4.2809%  | 0.0148%     | 1.7550%    | 0.0000%       | 2.5259% | 0.0148% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.2704%  | 0.0122%     | 2.6638%    | 0.0000%       | 3.6066% | 0.0122% |

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     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月      | 0.7991%  | 0.0080%     | 0.4424%    | 0.0000%       | 0.3567% | 0.0080% |
| 过去六个月      | 1.7163%  | 0.0103%     | 0.8847%    | 0.0000%       | 0.8316% | 0.0103% |
| 过去一年       | 4.5084%  | 0.0148%     | 1.7550%    | 0.0000%       | 2.7534% | 0.0148% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.6393%  | 0.0122%     | 2.6638%    | 0.0000%       | 3.9755% | 0.0122% |

信达澳银慧管家货币 E

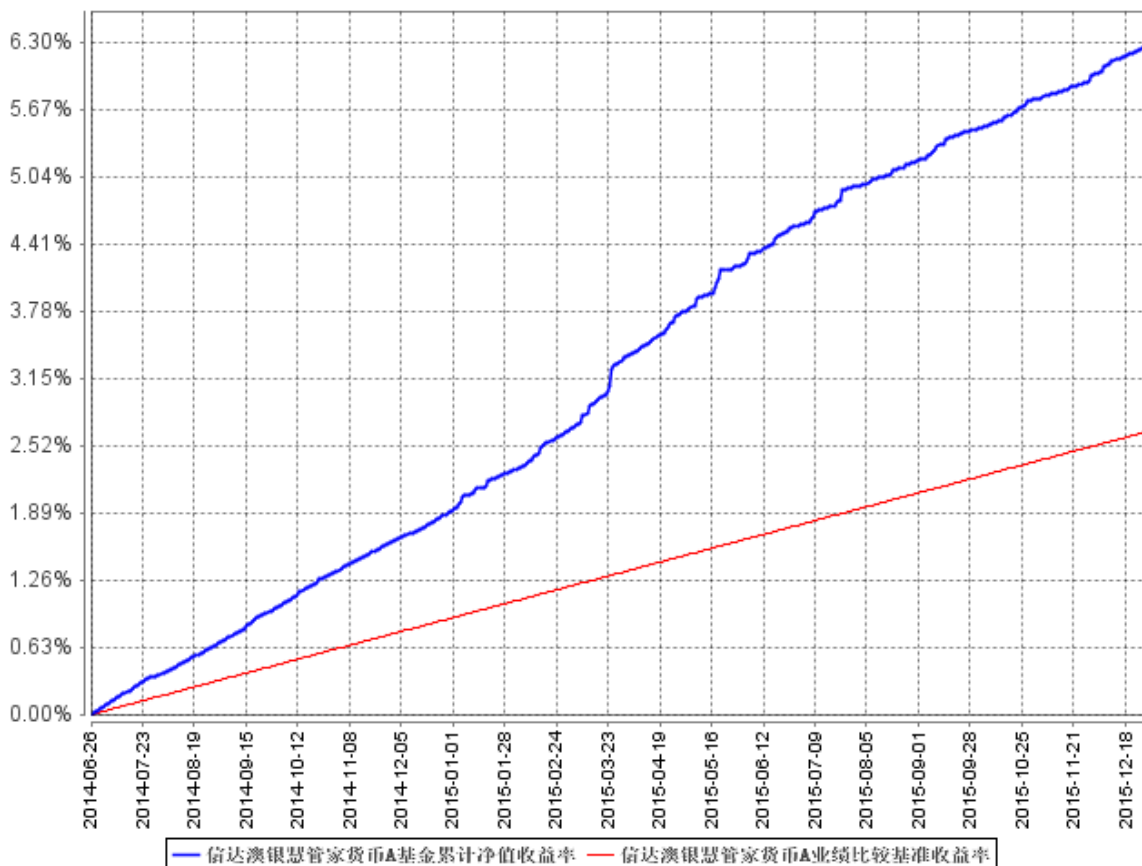
| 阶段    | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④     |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.6766%  | 0.0080%     | 0.4424%    | 0.0000%       | 0.2342% | 0.0080% |
| 过去六个月 | 1.4749%  | 0.0103%     | 0.8847%    | 0.0000%       | 0.5902% | 0.0103% |
| 过去一年  | 3.9894%  | 0.0147%     | 1.7550%    | 0.0000%       | 2.2344% | 0.0147% |
| 自基金合同 | 5.8010%  | 0.0122%     | 2.6638%    | 0.0000%       | 3.1372% | 0.0122% |

|       |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|

### 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

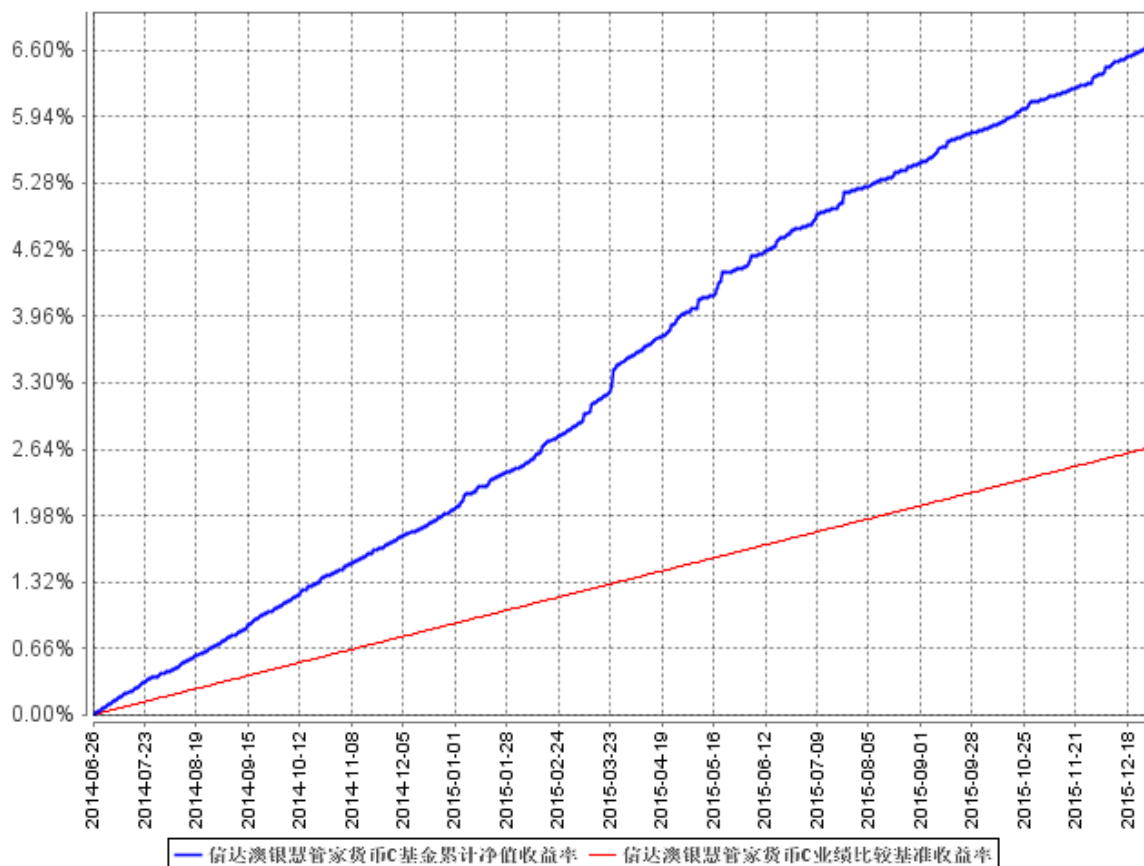
信达澳银慧管家货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



信达澳银慧管家货币 C

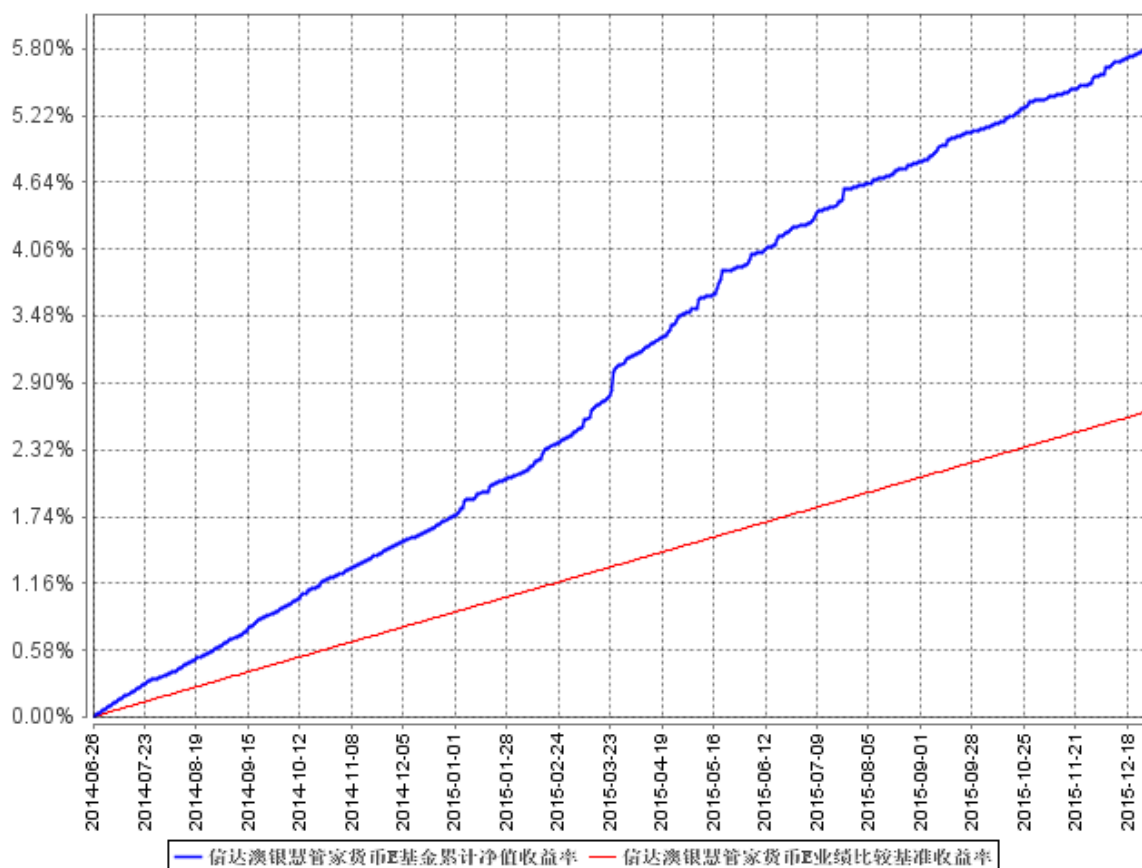


### 信达澳银慧管家货币C基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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：

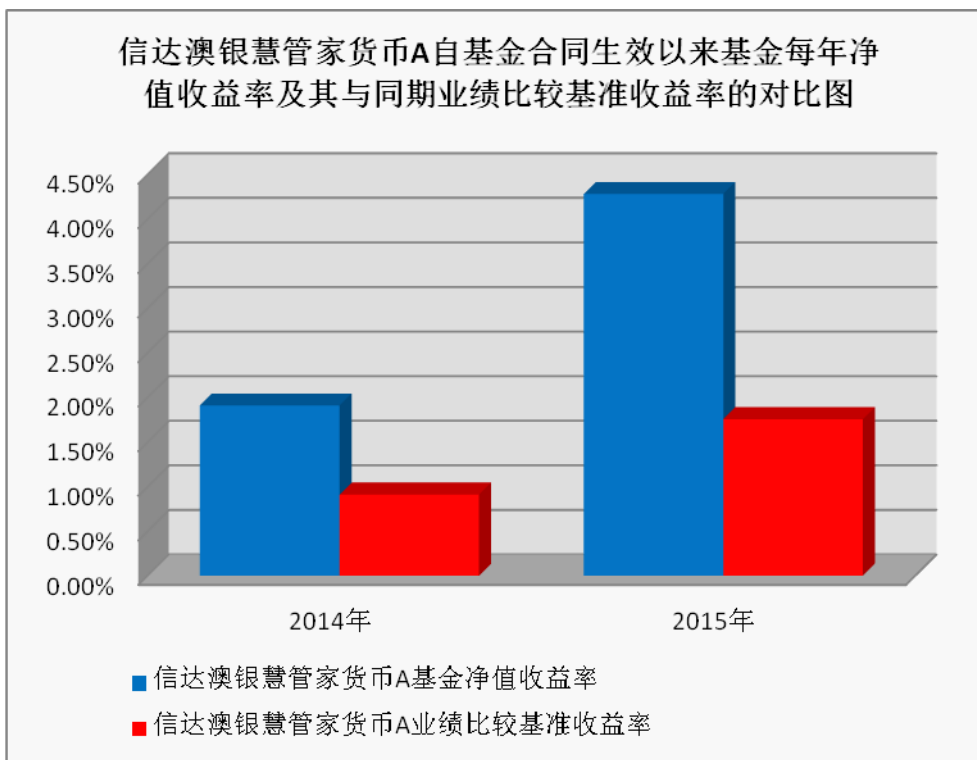
现金；通知存款；短期融资券；1年以内（含1年）的银行定期存款；期限在1年以内（含1年）的大额存单；期限在1年以内（含1年）的债券回购；期限在1年以内（含1年）的中央银行票据；剩余期限在397天以内（含397天）的债券；剩余期限在397天（含397天）以内的资产支持证券；剩余期限在397天以内（含397天）的中期票据；中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

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。

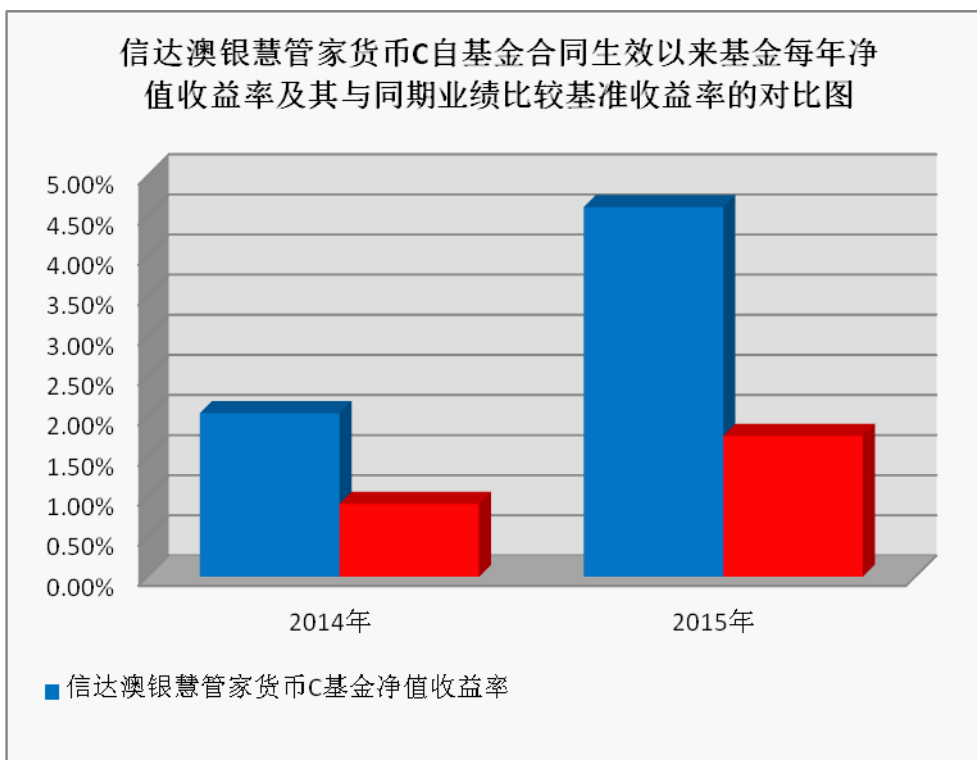
2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

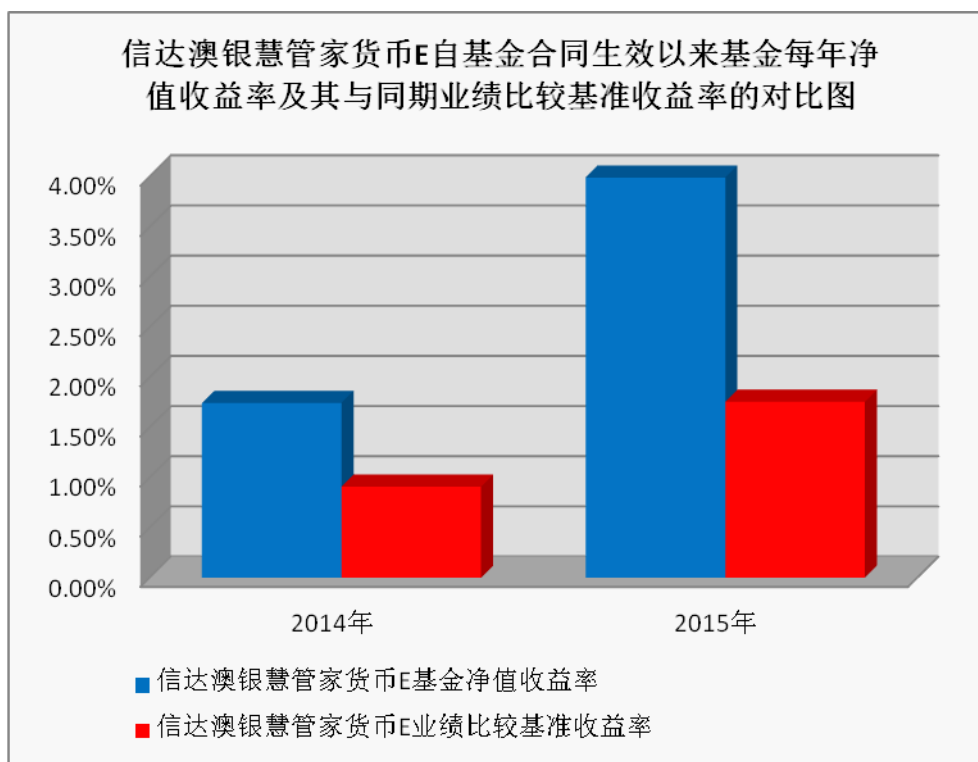
信达澳银慧管家货币A



信达澳银慧管家货币 C



信达澳银慧管家货币 E



注：本基金基金合同于 2014 年 6 月 26 日生效，因此 2014 年的净值增长率是按照基金合同生效后的实际存续期计算的。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 信达澳银慧管家货币 A |                  |                   |              |               |    |
|-------------|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 年度          | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 年度利润<br>分配合计  | 备注 |
| 2015年       | 11,835,234.63    | -                 | 38,496.84    | 11,873,731.47 | -  |
| 2014年       | 960,066.68       | -                 | 789.35       | 960,856.03    | -  |
| 合计          | 12,795,301.31    | -                 | 39,286.19    | 12,834,587.50 | -  |

单位：人民币元

| 信达澳银慧管家货币 C |                  |                   |              |               |    |
|-------------|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 年度          | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 年度利润<br>分配合计  | 备注 |
| 2015年       | 40,893,966.91    | -                 | 344,013.96   | 41,237,980.87 | -  |
| 2014年       | 6,299,519.08     | -                 | 14,306.08    | 6,313,825.16  | -  |
| 合计          | 47,193,485.99    | -                 | 358,320.04   | 47,551,806.03 | -  |

单位：人民币元

| 信达澳银慧管家货币 E |                  |                   |              |              |    |
|-------------|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 年度          | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 年度利润<br>分配合计 | 备注 |
| 2015年       | 254,630.05       | -                 | 92.18        | 254,722.23   | -  |

|       |            |   |        |            |   |
|-------|------------|---|--------|------------|---|
| 2014年 | 32,524.22  | - | 14.96  | 32,539.18  | - |
| 合计    | 287,154.27 | - | 107.14 | 287,261.41 | - |

## § 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、监察稽核部等部门，各部门分工协作，职责明确。

截至 2015 年 12 月 31 日，公司共管理十二只基金，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。

报告期内，公司第四届董事会独立董事孙志新先生以参加现场董事会薪酬考核委员会会议、现场董事会会议、进行现场考察及约谈管理层、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间 9 个工作日；独立董事刘颂兴先生以参加现场董事会薪酬考核委员会会议、现场董事会会议、进行现场考察及约谈管理层、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间 8 个工作日；独立董事刘治海先生以现场考察、参加现场董事会会议、现场风险控制委员会会议、通讯表决董事会决议和风险控制委员会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间 6 个工作日。

报告期内，公司及基金运作未发生重大利益冲突事件，独立董事在履职过程中未发现公司存

在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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、稳定价值债券基金、稳定增利债券基金（LOF）和信用债债券基金的基金经理，公募投资总部副总监 | 2014 年 6 月 26 日 | -    | 11 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 年 7 月 4 日  | -    | 8 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 | 本基金的基金经理助理、信用债债券基金的基金经理助理                              | 2015 年 9 月 10 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 日起至今）。  |

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、2016 年 2 月 23 日郑少波离任本基金的基金经理助理。

## 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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《信达澳银基金管理有限公司公平交易实施办法》在投资决策、交易执行、风险监控等环节建立了严谨的内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系，严谨的公平交易机制，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、业务流程和技术手段保证公平交易原则的贯彻，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

本基金管理人通过风险监控信息系统对不同投资组合同向交易进行公平交易分析，分别于每季度和每年度对本基金管理人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）的收益率差异等进行分析，形成公平交易制度执行情况分析报告。通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。若发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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，报告期内本基金管理人管理的投资组合未发生交易所公开竞价的同时反向交易。

## 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

2015 年全年本基金获得了较好的回报率，同时流动性和安全性方面也着力稳健操作。2015 年央行货币宽松正在进行式，降准降息正在路上，基于此背景，本基金对于债券持仓比例持续维持高位，获得了较好的配置收益。另一方面，积极关注资金面的波动，用短期交易机会增强组合收益，取得了较好的效果。但下半年的“资产荒”，使得大量资金流入固定收益市场，投资标的收益率下行较快，本基金规模膨胀，影响了收益的稳定，摊薄效应明显，使得下半年收益表现弱于上半年。

### 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 4.2809%，同期业绩比较基准收益率为 1.7550%；

截至报告期末，C 类基金份额：本报告期份额净值收益率为 4.5084%，同期业绩比较基准收益率为 1.7550%；

截至报告期末，E 类基金份额：本报告期份额净值收益率为 3.9894%，同期业绩比较基准收益率为 1.7550%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济小幅下行，地产投资和基建投资是主要的拖累因素，库存偏高的状态限制企业新开工和投资，表现出来的是拿地继续低迷，明年投资将继续下降预计达到 1%左右。基建投资会在财政收入减少和增加地方政府赤字之间平衡，反腐也会压制地方政府投资积极性，乐观估计基建投资增速将保持稳定在 18%。通胀整体下台阶的格局不变。主要的逻辑：一是经济下台阶带动物价下台阶；二是猪肉价格将会下降，主要是玉米供过于求，猪粮比价处于历史高位，将会刺激养殖户加快存栏，猪肉价格在春节过后存在季节性下降，随着供给的不断增加，二季度猪肉价格下跌幅度有望超越季节性规律，CPI 的低点大约在二季度。

经济和通胀下台阶决定了债市仍为暖市，利率难以系统上行。目前货币市场利率处于央行主导的利率走廊之中，制约着长端和短端利率债的波幅，利率债总体投资策略是以交易性机会为主。而信用债方面两极分化，高等级信用债总体可以理解为类利率债，策略与利率一致；而中低评级信用债，随着经济继续下行，信用风险已逐渐开始暴露，信用溢价走高，处于历史较高水平，但信用风险在货币宽松环境下，大面积扩散较难，更多是结构性、点状分布。总体而言，中低评级



信用债采用扎实分析调研、精挑细选、沙里淘金策略，相对高等级信用债的稳健配置收益，会带来超额收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察稽核工作中一切从规范运作、保障基金份额持有人利益出发，由独立于各业务部门的监察稽核人员对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时敦促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报公司管理层和监管机构。报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作重点完成了以下几个方面：

(1) 进一步完善公司管理及业务制度。

(2) 实时监控基金投资运作，监督投资决策行为，保证了公司所管理的基金合法合规运作，未出现重大违规事件。

(3) 监督后台运营业务安全、准确运行，推进完善信息技术系统，履行反洗钱义务。

(4) 监督市场营销、基金销售的合规性，落实执行销售适用性原则。

(5) 加强对员工包括投资管理人员的监察监督，严格执行防范投资人员道德风险的有关措施，规避不正当交易行为的发生。

(6) 对业务部门进行相关法律培训，提高员工遵规守法意识。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，有效保障了基金份额持有人利益。我们将继续以风险控制为核心，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 4.7.1 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，由分管基金运营的副总经理担任；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。

##### 4.7.2 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。

#### 4.7.3 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。

#### 4.7.4 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。

#### 4.8 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 53,366,434.57 元，实际分配收益 53,366,434.57 元。

#### 4.9 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 11,873,731.47 元，C 类 41,237,980.87 元，E 类 254,722.23 元。

#### 5.3 托管人对本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 审计报告

安永华明（2016）审字第 60467227\_H10 号

信达澳银慧管家货币市场基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的信达澳银慧管家货币市场基金的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表，2015 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

#### 一、基金管理人对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是信达澳银慧管家货币市场基金的基金管理人信达澳银基金管理有限公司的责任。这种责任包括：(1) 按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

#### 二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

#### 三、审计意见

我们认为，信达澳银慧管家货币市场基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了信达澳银慧管家货币市场基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师 汤 骏

中国 北京

中国注册会计师 印艳萍

2016 年 3 月 23 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|-----|-----|-------------------------|--------------------------|
|-----|-----|-------------------------|--------------------------|

|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                            |                             |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 1,169,488,814.71           | 179,347,397.38              |
| 结算备付金           |            | -                          | 319,000.00                  |
| 存出保证金           |            | -                          | -                           |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 3,362,537,400.42           | 210,508,028.77              |
| 其中：股票投资         |            | -                          | -                           |
| 基金投资            |            | -                          | -                           |
| 债券投资            |            | 3,362,537,400.42           | 210,508,028.77              |
| 资产支持证券投资        |            | -                          | -                           |
| 贵金属投资           |            | -                          | -                           |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | 1,699,915,869.87           | 125,439,148.16              |
| 应收证券清算款         |            | -                          | -                           |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 37,095,919.57              | 5,796,829.35                |
| 应收股利            |            | -                          | -                           |
| 应收申购款           |            | -                          | -                           |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                          | -                           |
| 资产总计            |            | 6,269,038,004.57           | 521,410,403.66              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2015年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2014年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                            |                             |
| 短期借款            |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债         |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款       | 7.4.12.3   | 199,999,500.00             | -                           |
| 应付证券清算款         |            | -                          | -                           |
| 应付赎回款           |            | -                          | 5,000.00                    |
| 应付管理人报酬         |            | 1,331,428.46               | 129,957.55                  |
| 应付托管费           |            | 295,874.47                 | 28,879.49                   |
| 应付销售服务费         |            | 140,491.06                 | 8,405.41                    |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 50,173.46                  | 15,543.84                   |
| 应交税费            |            | -                          | -                           |
| 应付利息            |            | 41,755.71                  | -                           |
| 应付利润            |            | 397,713.37                 | 15,110.39                   |
| 递延所得税负债         |            | -                          | -                           |
| 其他负债            | 7.4.7.8    | 74,000.00                  | 119,000.00                  |
| 负债合计            |            | 202,330,936.53             | 321,896.68                  |
| <b>所有者权益：</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金            | 7.4.7.9    | 6,066,707,068.04           | 521,088,506.98              |
| 未分配利润           | 7.4.7.10   | -                          | -                           |
| 所有者权益合计         |            | 6,066,707,068.04           | 521,088,506.98              |
| 负债和所有者权益总计      |            | 6,269,038,004.57           | 521,410,403.66              |

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 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 6,066,707,068.04 份，其中信达澳银慧管家货币 A 基金份额 659,439,389.09 份，信达澳银慧管家货币 C 基金份额 5,405,307,330.40 份，信达澳银慧管家货币 E 基金份额 1,960,348.55 份。

## 7.2 利润表

会计主体：信达澳银慧管家货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期<br>2015年1月1日至2015<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2014年6月26日(基金合同<br>生效日)至2014年12月31<br>日 |
|-----------------------|----------|---------------------------------|--|
| <b>一、收入</b>           |          | 62,957,490.71                   | 8,703,109.50                                       |
| 1.利息收入                |          | 45,658,631.19                   | 8,279,998.83                                       |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.11 | 12,417,627.61                   | 4,755,574.62                                       |
| 债券利息收入                |          | 27,915,765.80                   | 2,724,050.02                                       |
| 资产支持证券利息收入            |          | -                               | -  |
| 买入返售金融资产收入            |          | 5,325,237.78                    | 800,374.19   |
| 其他利息收入                |          | -                               | -  |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 17,283,859.52                   | 423,110.67   |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.12 | -                               | -  |
| 基金投资收益                |          | -                               | -  |
| 债券投资收益                | 7.4.7.13 | 17,283,859.52                   | 423,110.67   |
| 资产支持证券投资收益            |          | -                               | -  |
| 贵金属投资收益               |          | -                               | -  |
| 衍生工具收益                | 7.4.7.14 | -                               | -  |
| 股利收益                  | 7.4.7.15 | -                               | -  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | -                               | -  |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -                               | -  |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.17 | 15,000.00                       | -  |
| <b>减：二、费用</b>         |          | 9,591,056.14                    | 1,395,889.13                                       |

|                     |          |               |              |
|---------------------|----------|---------------|--------------|
| 1. 管理人报酬            | 7.4.10.2 | 6,088,393.69  | 738,946.11   |
| 2. 托管费              | 7.4.10.2 | 1,516,660.72  | 186,994.02   |
| 3. 销售服务费            |          | 1,004,260.32  | 85,121.46    |
| 4. 交易费用             | 7.4.7.18 | -             | -            |
| 5. 利息支出             |          | 730,189.54    | 187,840.04   |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |          | 730,189.54    | 187,840.04   |
| 6. 其他费用             | 7.4.7.19 | 251,551.87    | 196,987.50   |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | 53,366,434.57 | 7,307,220.37 |
| 减：所得税费用             |          | -             | -            |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | 53,366,434.57 | 7,307,220.37 |

注：本财务报表上年度可比期间的实际报告期间为 2014 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日。

### 7.3 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）               | -                                      | 53,366,434.57  | 53,366,434.57     |
| 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）      | 5,545,618,561.06                       | -              | 5,545,618,561.06  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 13,610,994,098.31                      | -              | 13,610,994,098.31 |
| 2. 基金赎回款                               | -8,065,375,537.25                      | -              | -8,065,375,537.25 |
| 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） | -                                      | -53,366,434.57 | -53,366,434.57    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 6,066,707,068.04                       | -              | 6,066,707,068.04  |

| 项目 | 上年度可比期间<br>2014 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 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)                        | 561,144,771.73  | -             | 561,144,771.73  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -               | 7,307,220.37  | 7,307,220.37    |
| 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)      | -40,056,264.75  | -             | -40,056,264.75  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 895,573,948.51  | -             | 895,573,948.51  |
| 2. 基金赎回款                               | -935,630,213.26 | -             | -935,630,213.26 |
| 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) | -               | -7,307,220.37 | -7,307,220.37   |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 521,088,506.98  | -             | 521,088,506.98  |

注：本财务报表上年度可比期间的实际报告期间为 2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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)×1.3。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。唯上年度可比期间的实际编制期间系 2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止。



#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资；

##### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

##### 后续计量

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格（附注 7.4.4.5），以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

##### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

### 金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### **7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金估值采用摊余成本法，其接近于公允价值。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，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；本基金金融工具的估值方法具体如下：

##### 1) 银行存款

基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际利率逐日计提利息。

##### 2) 债券投资

基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

##### 3) 回购协议

(1) 基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在回购期内逐日计提利息。

(2) 基金持有的买断式回购以成本列示，所产生的利息在回购期内逐日计提。回购期满，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值。

#### 4) 其他

- (1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。
- (2) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“影子定价”确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度的绝对值达到或超过0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合。其中，对于偏离度的绝对值达到或超过0.50%的情形，基金管理人应编制并披露临时报告。
- (3) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。每份基金份额面值为人民币 1.00 元。申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的慧管家货币 A、慧管家货币 C 基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

- (1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；
- (2) 债券利息收入按摊余成本和实际利率，在债券实际持有期内逐日计提；资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；
- (3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在实际持有期间内逐日计提；
- (4) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；
- (5) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量

的时候确认。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

(1) 根据基金合同，基金管理费封闭期间按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提，从首个开放申购赎回日（含）开始，实施浮动管理费率，计算规则参见附注 7.4.10.2.1；

(2) 根据基金合同，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率逐日计提；

(3) 根据基金合同，本基金 A 级基金份额、C 级基金份额及 E 级基金份额的销售服务费分别按前一日该级基金资产净值的 0.25%、0.01% 和 0.55% 的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 交易费用发生时按照确定的金额计入费用；

(6) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1) 本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(3) “每日分配、按日支付”。基金管理人可根据基金账户和规模调整分配方式及支付方式。本基金根据每日基金收益情况，以每万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。并每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理（因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止）；

(4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益，增加基金份额；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益，基金份额不变；基金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零，若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益，减少基金份额；本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用。

(5) 当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；

(6) 当日赎回的基金份额投资人当日赎回的基金份额，如基金管理人当日已为投资者支付赎回款项，则投资者自当日起（含当日）不享有基金份额的分配权益；除上述情形外，投资人当日赎回的基金份额自下一个工作日起不享有基金份额的分配权益。

(7) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.11 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向

管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 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[2008]1 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税收优惠项目列示如下：

- (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。
- (2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入、债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
- (3) 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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 988,814.71              | 547,397.38               |
| 定期存款           | 1,168,500,000.00        | 178,800,000.00           |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | 725,000,000.00          | 178,800,000.00           |
| 存款期限 1-3 个月    | 443,500,000.00          | -                        |
| 其他存款           | -                       | -                        |
| 合计：            | 1,169,488,814.71        | 179,347,397.38           |

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。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 |       | 本期末<br>2015年12月31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 | 3,362,537,400.42    | 3,367,407,000.00 | 4,869,599.58 | 0.0803% |
|    | 合计    | 3,362,537,400.42    | 3,367,407,000.00 | 4,869,599.58 | 0.0803% |
| 项目 |       | 上年度末<br>2014年12月31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 | 210,508,028.77      | 210,652,000.00   | 143,971.23   | 0.0276% |
|    | 合计    | 210,508,028.77      | 210,652,000.00   | 143,971.23   | 0.0276% |

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。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2015年12月31日 |           | 上年度末<br>2014年12月31日 |           |
|------------|--------------------|-----------|---------------------|-----------|
|            | 账面余额               | 其中；买断式逆回购 | 账面余额                | 其中；买断式逆回购 |
| 买入返售证券_银行间 | 1,699,915,869.87   | -         | 125,439,148.16      | -         |
| 合计         | 1,699,915,869.87   | -         | 125,439,148.16      | -         |

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 311.98                  | 154.26                   |
| 应收定期存款利息   | 1,793,784.47            | 277,565.56               |
| 应收其他存款利息   | -                       | -                        |
| 应收结算备付金利息  | -                       | 157.96                   |
| 应收债券利息     | 34,864,997.62           | 5,387,653.71             |
| 应收买入返售证券利息 | 436,825.50              | 131,297.86               |
| 应收申购款利息    | -                       | -                        |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                       | -                        |
| 其他         | -                       | -                        |
| 合计         | 37,095,919.57           | 5,796,829.35             |

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                       | -                        |
| 银行间市场应付交易费用 | 50,173.46               | 15,543.84                |
| 合计          | 50,173.46               | 15,543.84                |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | -                       | -                        |
| 预提费用        | 74,000.00               | 119,000.00               |
| 合计          | 74,000.00               | 119,000.00               |

#### 7.4.7.9 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<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |                   |
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额              |
| 上年度末          | 34,685,830.56                          | 34,685,830.56     |
| 本期申购          | 3,494,929,080.01                       | 3,494,929,080.01  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -2,870,175,521.48                      | -2,870,175,521.48 |
| 本期末           | 659,439,389.09                         | 659,439,389.09    |

金额单位：人民币元

| 信达澳银慧管家货币 C   |  |                   |
|---------------|--|-------------------|
| 项目            | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |                   |
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额              |
| 上年度末          | 485,374,822.96                         | 485,374,822.96    |
| 本期申购          | 10,056,669,831.72                      | 10,056,669,831.72 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -5,136,737,324.28                      | -5,136,737,324.28 |
| 本期末           | 5,405,307,330.40                       | 5,405,307,330.40  |

金额单位：人民币元

| 信达澳银慧管家货币 E   |  |                |
|---------------|--|----------------|
| 项目            | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |                |
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额           |
| 上年度末          | 1,027,853.46                           | 1,027,853.46   |
| 本期申购          | 59,395,186.58                          | 59,395,186.58  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -58,462,691.49                         | -58,462,691.49 |
| 本期末           | 1,960,348.55                           | 1,960,348.55   |

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

#### 7.4.7.10 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           | 11,873,731.47  | -     | 11,873,731.47  |
| 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        | -11,873,731.47 | -     | -11,873,731.47 |
| 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           | 41,237,980.87 | -     | 41,237,980.87 |
| 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 | -41,237,980.87 | - | -41,237,980.87 |
| 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           | 254,722.23  | -     | 254,722.23  |
| 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        | -254,722.23 | -     | -254,722.23 |
| 本期末            | -           | -     | -           |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                    | 上年度可比期间                         |
|-----------|-----------------------|---------------------------------|
|           | 2015年1月1日至2015年12月31日 | 2014年6月26日(基金合同生效日)至2014年12月31日 |
| 活期存款利息收入  | 13,742.15             | 29,675.79                       |
| 定期存款利息收入  | 12,403,463.35         | 4,721,960.49                    |
| 其他存款利息收入  | -                     | -                               |
| 结算备付金利息收入 | 422.11                | 3,938.34                        |
| 其他        | -                     | -                               |
| 合计        | 12,417,627.61         | 4,755,574.62                    |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本期及上年度可比期间无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                      | 本期                    | 上年度可比期间                         |
|-------------------------|-----------------------|---------------------------------|
|                         | 2015年1月1日至2015年12月31日 | 2014年6月26日(基金合同生效日)至2014年12月31日 |
| 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额   | 5,491,932,622.68      | 394,284,261.14                  |
| 减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额 | 5,373,932,989.06      | 390,277,262.81                  |
| 减：应收利息总额                | 100,715,774.10        | 3,583,887.66                    |
| 买卖债券差价收入                | 17,283,859.52         | 423,110.67                      |

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

本基金本期及上年度可比期间无股利收益。

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本期及上年度可比期间无公允价值变动收益。

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2015年1月1日至2015年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2014年6月26日(基金合同生效<br>日)至2014年12月31日 |
|----|---------------------------------|--|
| 其他 | 15,000.00                       | -  |

注：本期其他为基金管理人弥补基金投资者收益。

#### 7.4.7.18 交易费用

本基金本期及上年度可比期间无交易费用。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015年1月1日至2015<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2014年6月26日(基金合同生<br>效日)至2014年12月31日 |
|-----------|---------------------------------|--|
| 审计费用      | 65,000.00                       | 60,000.00                                      |
| 信息披露费     | 100,000.00                      | 100,000.00                                     |
| 银行费用      | 50,342.37                       | 21,087.50                                      |
| 债券托管账户维护费 | 36,200.00                       | 15,000.00                                      |
| 证券账户开户费   | -                               | 900.00   |
| 其他        | 9.50                            | -  |
| 合计        | 251,551.87                      | 196,987.50                                     |

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 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。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

### 7.4.9.1 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

经本基金管理人股东会决议通过，并由中国证券监督管理委员会（证监许可[2015]339 号）批准，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本公司 54%的股权。上述股东变更的工商变更手续已于 2015 年 5 月 22 日办理完毕。基于基金管理人的控股股东变更，原基金管理人控股股东中国信达资产管理股份有限公司的子公司——幸福人寿保险股份有限公司自 2015 年 5 月 22 日起，不再作为与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方。

### 7.4.9.2 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，原基金管理人的控股股东 |
| 幸福人寿保险股份有限公司（“幸福人寿”）                            | 原基金管理人的控股股东的子公司                  |

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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 6 月 26 日 (基金合同生效日) 至<br>2014 年 12 月 31 日 |
|-----------------|--|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 6,088,393.69                           | 738,946.11   |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 921,501.31                             | 69,050.73  |

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                                  | 上年度可比期间  |
|----------------|-------------------------------------|--|
|                | 2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 12 月 31 日 | 2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)<br>至 2014 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,516,660.72                        | 186,994.02                                     |

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期   |             |             |            |
|----------------|--|-------------|-------------|------------|
|                | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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         |
| 信达证券           | 21,294.61                                  | 195.10      | 7.20        | 21,496.91  |
| 中国建设银行         | 550,320.00                                 | 18,864.35   | -           | 569,184.35 |
| 信达澳银基金公司       | 6,635.61                                   | 67,210.95   | 12,746.57   | 86,593.13  |
| 合计             | 578,250.22                                 | 86,270.40   | 12,753.77   | 677,274.39 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                                    |             |             |            |
|                | 2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 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         |
| 信达证券           | 2,141.49                                   | 112.57      | -           | 2,254.06   |
| 中国建设银行         | 7,200.14                                   | 2,408.67    | -           | 9,608.81   |
| 信达澳银基金公司       | 5,000.26                                   | 11,109.37   | 2,633.02    | 18,742.65  |

|    |           |           |          |           |
|----|-----------|-----------|----------|-----------|
| 合计 | 14,341.89 | 13,630.61 | 2,633.02 | 30,605.52 |
|----|-----------|-----------|----------|-----------|

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。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |                   |              | 上年度可比期间<br>2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日 |              |              |
|-------------------|--|-------------------|--------------|---|--------------|--------------|
|                   | 信达澳银<br>慧管家A                           | 信达澳银<br>慧管家C      | 信达澳银<br>慧管家E | 信达澳银<br>慧管家A  | 信达澳银<br>慧管家C | 信达澳银<br>慧管家E |
|                   | 期初持有的基金份额                              | -                 | -            | -   | -            | -            |
| 期间申购/买入总份额        | -                                      | 20,175,577<br>.16 | -            | -   | -            | -            |
| 期间因拆分变动份额         | -                                      | -                 | -            | -   | -            | -            |
| 减：期间赎回/卖出总份额      | -                                      | 20,175,577<br>.16 | -            | -   | -            | -            |
| 期末持有的基金份额         | -                                      | -                 | -            | -   | -            | -            |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | -                                      | -                 | -            | -   | -            | -            |

注：期间申购/买入总份额含红利转投份额。

#### 7.4.10.4.2 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

| 信达澳银慧管家货币 C |                         |                          |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 关联方名称       | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|             |                         |                          |

|      | 持有的基金份额        | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 |
|------|----------------|--------------------------|---------|--------------------------|
| 信达证券 | 100,013,690.38 | 1.65%                    | -       | -                        |

注：原基金管理人控股股东中国信达资产管理股份有限公司的子公司——幸福人寿于上年度末持有本基金份额 10,164,026.05 份，占基金总份额的比例 1.95%。基于基金管理人的控股股东变更，幸福人寿自 2015 年 5 月 22 日起，不再作为与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方。

#### 7.4.10.5 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<br>名称 | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |           | 上年度可比期间<br>2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 年<br>12 月 31 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    | 988,814.71                             | 13,742.15 | 547,397.38   | 29,675.79 |

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。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 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。

### 7.4.11 利润分配情况

#### 7.4.11.1 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<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合计      | 备注 |
|---------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 11,835,234.63 | -                 | 38,496.84    | 11,873,731.47 | -  |

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<br>赎回款转出金<br>额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合计      | 备注 |
|---------------|-----------------------|--------------|---------------|----|
| 40,893,966.91 | -                     | 344,013.96   | 41,237,980.87 | -  |

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<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合<br>计 | 备注 |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 254,630.05   | -                 | 92.18        | 254,722.23   | -  |

## 7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.12.1 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。

### 7.4.12.2 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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 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 199,999,500.00 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         |
|-----------|------------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 071525007 | 15 国都证券<br>CP007 | 2016 年 1 月 7 日 | 100.01 | 1,500,000 | 150,013,933.83 |
| 071540007 | 15 东吴证券<br>CP007 | 2016 年 1 月 7 日 | 99.98  | 500,000   | 49,990,408.62  |
| 合计        |                  |                |        | 2,000,000 | 200,004,342.45 |

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 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。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 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。本基金主要投资于信用债，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。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。

#### 7.4.13.2 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。

##### 7.4.13.2.1 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<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | 1,814,616,462.45        | 160,537,994.41           |
| A-1 以下 | -                       | -                        |



|     |                  |                |
|-----|------------------|----------------|
| 未评级 | 1,377,727,413.94 | 40,009,194.54  |
| 合计  | 3,192,343,876.39 | 200,547,188.95 |

注：未评级债券为政策性金融债、短期融资券及大额可转让同业存单。

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。

#### 7.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | -                       | -                        |
| AAA 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 170,193,524.03          | 9,960,839.82             |
| 合计     | 170,193,524.03          | 9,960,839.82             |

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。

#### 7.4.13.3 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中有 199,999,500.00 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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2015年12<br>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            |

| 上年度末<br>2014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                | 179,347,397.38 | -    | -    | -            | 179,347,397.38 |
| 结算备付金               | 319,000.00     | -    | -    | -            | 319,000.00     |
| 交易性金融资产             | 210,508,028.77 | -    | -    | -            | 210,508,028.77 |
| 买入返售金融资产            | 125,439,148.16 | -    | -    | -            | 125,439,148.16 |
| 应收利息                | -              | -    | -    | 5,796,829.35 | 5,796,829.35   |
| 资产总计                | 515,613,574.31 | -    | -    | 5,796,829.35 | 521,410,403.66 |
| 负债                  |                |      |      |              |                |
| 应付赎回款               | -              | -    | -    | 5,000.00     | 5,000.00       |
| 应付管理人报酬             | -              | -    | -    | 129,957.55   | 129,957.55     |
| 应付托管费               | -              | -    | -    | 28,879.49    | 28,879.49      |
| 应付销售服务费             | -              | -    | -    | 8,405.41     | 8,405.41       |
| 应付交易费用              | -              | -    | -    | 15,543.84    | 15,543.84      |
| 应付利润                | -              | -    | -    | 15,110.39    | 15,110.39      |
| 其他负债                | -              | -    | -    | 119,000.00   | 119,000.00     |
| 负债总计                | -              | -    | -    | 321,896.68   | 321,896.68     |
| 利率敏感度缺口             | 515,613,574.31 | -    | -    | 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。

#### 7.4.13.4.1.2 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（2015年12月31日）             | 上年度末（2014年12月31日） |
|    | 1. 市场利率下降 25 个基点   | 上升约 281                      | 上升约 20            |
|    | 2. 市场利率上升 25 个基点   | 下降约 280                      | 下降约 20            |

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 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。

##### 7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 3 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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            | 3,362,537,400.42 | 53.64         |
|    | 其中：债券             | 3,362,537,400.42 | 53.64         |
|    | 资产支持证券            | -                | -             |
| 2  | 买入返售金融资产          | 1,699,915,869.87 | 27.12         |
|    | 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      | 1,169,488,814.71 | 18.65         |
| 4  | 其他各项资产            | 37,095,919.57    | 0.59          |
| 5  | 合计                | 6,269,038,004.57 | 100.00        |

### 8.2 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 | 2.31           |

|    | 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 | 199,999,500.00 | 3.30           |
|    | 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  | 2015 年 3 月 25 日 | 23.36             | 2015 年 3 月 25 日发生巨额赎回，导致 3 月 25 日净值下降 | 3 月 26 日调整完毕 |

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 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    | 75  |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 117 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 57  |

### 8.3.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 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 180 天。

### 8.3.3 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                 | 50.80               | 3.30                |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天(含)—60 天           | 4.05                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天(含)—90 天           | 25.27               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天(含)—180 天          | 9.57                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 180 天(含)—397 天(含)      | 13.03               | -                   |

|    |                        |        |      |
|----|------------------------|--------|------|
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -      | -    |
| 合计 |                        | 102.72 | 3.30 |

#### 8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种                 | 摊余成本             | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------------------|------------------|---------------|
| 1  | 国家债券                 | -                | -             |
| 2  | 央行票据                 | -                | -             |
| 3  | 金融债券                 | 320,551,746.16   | 5.28          |
|    | 其中：政策性金融债            | 320,551,746.16   | 5.28          |
| 4  | 企业债券                 | -                | -             |
| 5  | 企业短期融资券              | 2,544,790,838.68 | 41.95         |
| 6  | 中期票据                 | -                | -             |
| 7  | 同业存单                 | 497,194,815.58   | 8.20          |
| 8  | 其他                   | -                | -             |
| 9  | 合计                   | 3,362,537,400.42 | 55.43         |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -                | -             |

#### 8.5 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 (元)       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|----------------|-----------|----------------|---------------|
| 1  | 071525007 | 15 国都证券 CP007  | 1,500,000 | 150,013,933.83 | 2.47          |
| 2  | 071546005 | 15 国元证券 CP005  | 1,200,000 | 119,991,484.89 | 1.98          |
| 3  | 150206    | 15 国开 06       | 1,000,000 | 100,356,651.90 | 1.65          |
| 4  | 110221    | 11 国开 21       | 1,000,000 | 100,092,196.40 | 1.65          |
| 5  | 111593439 | 15 南京银行 CD139  | 1,000,000 | 99,248,422.17  | 1.64          |
| 6  | 111511327 | 15 平安 CD327    | 1,000,000 | 99,231,406.66  | 1.64          |
| 7  | 011598151 | 15 龙源电力 SCP017 | 900,000   | 89,998,413.54  | 1.48          |
| 8  | 011598129 | 15 苏国信 SCP007  | 900,000   | 89,986,128.51  | 1.48          |
| 9  | 071539001 | 15 上海证券 CP001  | 900,000   | 89,982,748.59  | 1.48          |
| 10 | 071507008 | 15 中信建投 CP008  | 900,000   | 89,981,549.59  | 1.48          |

#### 8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目                            | 偏离情况    |
|-------------------------------|---------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 | 25      |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.3485% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0139% |

|                        |         |
|------------------------|---------|
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1734% |
|------------------------|---------|

## 8.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 投资组合报告附注

**8.8.1** 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。

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

**8.8.3** 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。

### 8.8.4 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | -             |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收利息    | 37,095,919.57 |
| 4  | 应收申购款   | -             |
| 5  | 其他应收款   | -             |
| 6  | 待摊费用    | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 37,095,919.57 |

### 8.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 | 4,740    | 139,122.23 | 13,495,274.95 | 2.05%  | 645,944,114.14 | 97.95% |

|             |       |               |                  |        |                  |        |
|-------------|-------|---------------|------------------|--------|------------------|--------|
| 信达澳银慧管家货币 C | 94    | 57,503,269.47 | 4,999,408,714.28 | 92.49% | 405,898,616.12   | 7.51%  |
| 信达澳银慧管家货币 E | 1,432 | 1,368.96      | 0.00             | 0.00%  | 1,960,348.55     | 100%   |
| 合计          | 6,266 | 968,194.55    | 5,012,903,989.23 | 82.63% | 1,053,803,078.81 | 17.37% |

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）。

## 9.2 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 | 52,776.08 | 0.01%    |
|                  | 信达澳银慧管家货币 C | 0.00      | 0.00%    |
|                  | 信达澳银慧管家货币 E | 2,194.36  | 0.11%    |
|                  | 合计          | 54,970.44 | 0.00%    |

## 9.3 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                 |
| 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                 |

## § 10 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              | 34,685,830.56    | 485,374,822.96    | 1,027,853.46  |
| 本报告期基金总申购份额               | 3,494,929,080.01 | 10,056,669,831.72 | 59,395,186.58 |



|               |                  |                  |               |
|---------------|------------------|------------------|---------------|
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 2,870,175,521.48 | 5,136,737,324.28 | 58,462,691.49 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                | -                | -             |
| 本报告期期末基金份额总额  | 659,439,389.09   | 5,405,307,330.40 | 1,960,348.55  |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

本基金管理人双方股东于 2015 年 1 月 16 日作出决议，一致同意选举于建伟先生担任信达澳银基金管理有限公司第四届董事会董事。

本基金管理人双方股东于 2015 年 5 月 8 日作出决议，一致同意选举刘治海先生担任信达澳银基金管理有限公司第四届董事会独立董事。

本基金管理人 2015 年 8 月 22 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，王战强先生辞去信达澳银基金管理有限公司副总经理职务。

本基金管理人 2015 年 12 月 31 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，聘任程文卫先生为信达澳银基金管理有限公司副总经理。

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人 2015 年 5 月 27 日发布公告，经信达澳银基金管理有限公司第四届董事会第六次会议审议通过，改聘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，报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为 6.5 万元。

**11.6 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。

**11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****11.7.1 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      | -    | -            | -         | -          | 新增     |
| 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      | -    | -            | -         | -          | 新增     |
| 华创证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -      |
| 华泰证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -      |
| 联讯证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | 新增     |
| 民生证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -      |
| 平安证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -      |
| 中泰证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -      |
| 申万宏源 | 3      | -    | -            | -         | -          | -      |
| 世纪证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -      |
| 西南证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | 新增     |
| 信达证券 | 3      | -    | -            | -         | -          | 新增 1 个 |
| 兴业证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -      |
| 银河证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -      |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 银泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信万通 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |

注：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。

### 11.7.2 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 | - | - | -             | -       | - | - |
| 中泰证券 | - | - | -             | -       | - | - |
| 申万宏源 | - | - | -             | -       | - | - |
| 世纪证券 | - | - | -             | -       | - | - |
| 西南证券 | - | - | -             | -       | - | - |
| 信达证券 | - | - | -             | -       | - | - |
| 兴业证券 | - | - | -             | -       | - | - |
| 银河证券 | - | - | -             | -       | - | - |
| 银泰证券 | - | - | -             | -       | - | - |
| 招商证券 | - | - | 55,600,000.00 | 100.00% | - | - |
| 浙商证券 | - | - | -             | -       | - | - |
| 中金公司 | - | - | -             | -       | - | - |
| 中投证券 | - | - | -             | -       | - | - |
| 中信建投 | - | - | -             | -       | - | - |
| 中信万通 | - | - | -             | -       | - | - |
| 中信证券 | - | - | -             | -       | - | - |
| 中银国际 | - | - | -             | -       | - | - |

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：无。

### 11.9 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  | 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 | 2015年1月5日  |
| 2  | 信达澳银慧管家货币市场基金2014年第4季度报告                         | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015年1月20日 |
| 3  | 信达澳银基金管理有限公司关于增加长城证券为代销机构、开通转换业务、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 | 2015年2月4日  |
| 4  | 信达澳银慧管家货币市场基金招募说明书（更新）及摘要2014年第1期                | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015年2月6日  |

|    |  |                  |            |
|----|--|------------------|------------|
| 5  | 信达澳银基金管理有限公司关于我司旗下基金暂停参加长城证券定期定额投资业务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 | 2015年2月7日  |
| 6  | 关于信达澳银慧管家货币基金2015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 | 2015年2月13日 |
| 7  | 信达澳银基金管理有限公司关于增加联泰资产为代销机构、开通转换业务、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 | 2015年3月27日 |
| 8  | 关于旗下基金所持交易所固定收益品种实施新估值标准的公告                      | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015年3月27日 |
| 9  | 信达澳银慧管家货币市场基金2014年年度报告及摘要                        | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015年3月28日 |
| 10 | 关于信达澳银慧管家货币基金2015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 | 2015年3月30日 |
| 11 | 信达澳银基金管理有限公司关于上海联泰资产代销我公司基金代销业务的更正公告             | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015年4月2日  |
| 12 | 信达澳银基金管理有限公司关于增加恒泰证券为代销机构、开通转换业务的公告              | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015年4月8日  |
| 13 | 信达澳银慧管家货币市场基金2015年第1季度报告                         | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015年4月22日 |
| 14 | 信达澳银基金管理有限公司关于增加展恒基金为代销机构、开通转换业务、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 | 2015年4月22日 |
| 15 | 关于信达澳银慧管家货币基金2015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 | 2015年4月27日 |
| 16 | 信达澳银基金管理有限公司关于公司股东变更的公告                          | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015年5月25日 |
| 17 | 信达澳银基金管理有限公司旗下基金改聘会计师事务所公告                       | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015年5月27日 |
| 18 | 关于信达澳银慧管家货币基金2015年“端午节”假期前暂停申购、转换转入和定期定额         | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015年6月16日 |

|    | 投资业务的公告   |                  |            |
|----|---|------------------|------------|
| 19 | 信达澳银基金管理有限公司关于增加增财基金等四家机构为代销机构、开通转换业务和参加部分机构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 | 2015年6月17日 |
| 20 | 信达澳银基金管理有限公司旗下基金半年度净值公告                                   | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015年7月1日  |
| 21 | 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 | 2015年7月1日  |
| 22 | 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 | 2015年7月4日  |
| 23 | 信达澳银基金管理有限公司关于公司、高管及基金经理投资旗下基金相关事宜的公告                     | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015年7月6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 | 2015年7月8日  |
| 25 | 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 | 2015年7月9日  |
| 26 | 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 | 2015年7月10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 | 2015年7月11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 | 2015年7月11日 |
| 29 | 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 | 2015年7月15日 |
| 30 | 信达澳银基金管理有限公司关于增加太平洋证券为代销机构、开通转换业务的公告                      | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015年7月15日 |
| 31 | 信达澳银基金管理有限公司关于北京分公司负责人和办公地址变更的公告                          | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015年7月17日 |
| 32 | 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 | 2015年7月18日 |
| 33 | 信达澳银慧管家货币市场基金 2015 年第 2 季度报告                              | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015年7月20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 | 2015年7月22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 | 2015 年 7 月 25 日  |
| 36 | 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 | 2015 年 7 月 29 日  |
| 37 | 关于信达澳银慧管家货币市场基金暂停大额申购、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 | 2015 年 8 月 6 日   |
| 38 | 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 1 期                 | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015 年 8 月 7 日   |
| 39 | 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 | 2015 年 8 月 11 日  |
| 40 | 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 | 2015 年 8 月 18 日  |
| 41 | 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 | 2015 年 8 月 22 日  |
| 42 | 信达澳银基金管理有限公司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 | 2015 年 8 月 22 日  |
| 43 | 信达澳银慧管家货币市场基金 2015 年半年度报告及摘要                          | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015 年 8 月 26 日  |
| 44 | 关于信达澳银慧管家货币市场基金调整大额申购、转换转入、定期定额投资业务限额的公告              | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015 年 8 月 26 日  |
| 45 | 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 | 2015 年 8 月 26 日  |
| 46 | 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 | 2015 年 8 月 27 日  |
| 47 | 关于信达澳银慧管家货币基金 2015 年 9 月 1 日、2 日暂停申购、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 | 2015 年 8 月 28 日  |
| 48 | 关于信达澳银慧管家货币市场基金恢复大额申购、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 | 2015 年 9 月 12 日  |
| 49 | 关于信达澳银慧管家货币基金 2015 年“国庆节”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 | 2015 年 9 月 24 日  |
| 50 | 信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调                                   | 证监会指定信息披         | 2015 年 10 月 16 日 |

|    |  |                  |                  |
|----|--|------------------|------------------|
|    | 整长期停牌股票估值方法的提示性公告  | 露报纸、公司网站         |                  |
| 51 | 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 | 2015 年 10 月 17 日 |
| 52 | 信达澳银慧管家货币市场基金 2015 年第 3 季度报告   | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015 年 10 月 24 日 |
| 53 | 关于信达澳银开通京东网上交易平台基金销售业务的公告  | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015 年 10 月 29 日 |
| 54 | 信达澳银基金管理有限公司关于增加国金证券、嘉实财富为代销机构、开通转换业务和参加嘉实财富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 | 2015 年 10 月 30 日 |
| 55 | 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 | 2015 年 11 月 5 日  |
| 56 | 信达澳银基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在北京京东叁佰陆拾度电子商务有限公司网上交易平台申购起点的公告                  | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015 年 11 月 11 日 |
| 57 | 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 | 2015 年 11 月 25 日 |
| 58 | 信达澳银基金管理有限公司关于增加北京乐融多源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 | 2015 年 12 月 16 日 |
| 59 | 信达澳银基金管理有限公司关于增加诺亚正行为稳定增利 (LOF) 基金和慧管家货币基金代销机构、转型创新股票基金参加诺亚正行费率优惠活动的公告 | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2015 年 12 月 18 日 |
| 60 | 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 | 2015 年 12 月 18 日 |
| 61 | 关于增加陆金所资管为代销机构、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 | 2015 年 12 月 25 日 |
| 62 | 关于信达澳银慧管家货币基金 2016 年“元旦节”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 | 2015 年 12 月 25 日 |
| 63 | 信达澳银基金管理有限公司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 | 2015 年 12 月 31 日 |



## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 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。

### 13.3 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](http://www.fscinda.com)