

# 信达澳银慧理财货币市场基金 2016 年年度 报告

2016 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：北京银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 28 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 2016 年 9 月 18 日（基金合同生效日）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.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	36
8.2 债券回购融资情况.....	36
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	37
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	37
8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	37
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.....	38

8.8 投资组合报告附注.....	38
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>38</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39
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.....	39
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>39</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>39</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	39
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.....	39
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
11.4 基金投资策略的改变.....	40
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
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.....	40
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	41
11.9 其他重大事件.....	41
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>42</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>42</b>
13.1 备查文件目录.....	42
13.2 存放地点.....	42
13.3 查阅方式.....	43

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信达澳银慧理财货币市场基金
基金简称	信达澳银慧理财货币
场内简称	-
基金主代码	003171
交易代码	003171
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 18 日
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
基金托管人	北京银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	11,276,594.55 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金根据对未来短期利率变动的预测，确定和调整基金投资组合的平均剩余期限。对各类投资品种进行定性分析和定量分析，确定和调整参与的投资品种和各类投资品种的配置比例。在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，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、股票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	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄晖	刘晔
	联系电话	0755-83172666	010-66223586
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	liuye1@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		400-8888-118	95526
传真		0755-83196151	010-66225309
注册地址		广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号 阿里巴巴大厦 N1 座第 8 层 和第 9 层	北京银行西城区金融大街甲 17 号首层
办公地址		广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号	北京银行西城区金融大街甲 17 号首层

	阿里巴巴大厦 T1 座第 8 层 和第 9 层	
邮政编码	518054	100033
法定代表人	于建伟	闫冰竹

## 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》《证券时报》
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	广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号阿里巴巴大厦 T1 座第 8 层和第 9 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	广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号阿里巴巴大厦 T1 座第 8 层和第 9 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	2016 年 9 月 18 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	647,524.13
本期利润	647,524.13
本期净值收益率	0.2997%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末
期末基金资产净值	11,276,594.55
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2016 年末
累计净值收益率	0.2997%

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。

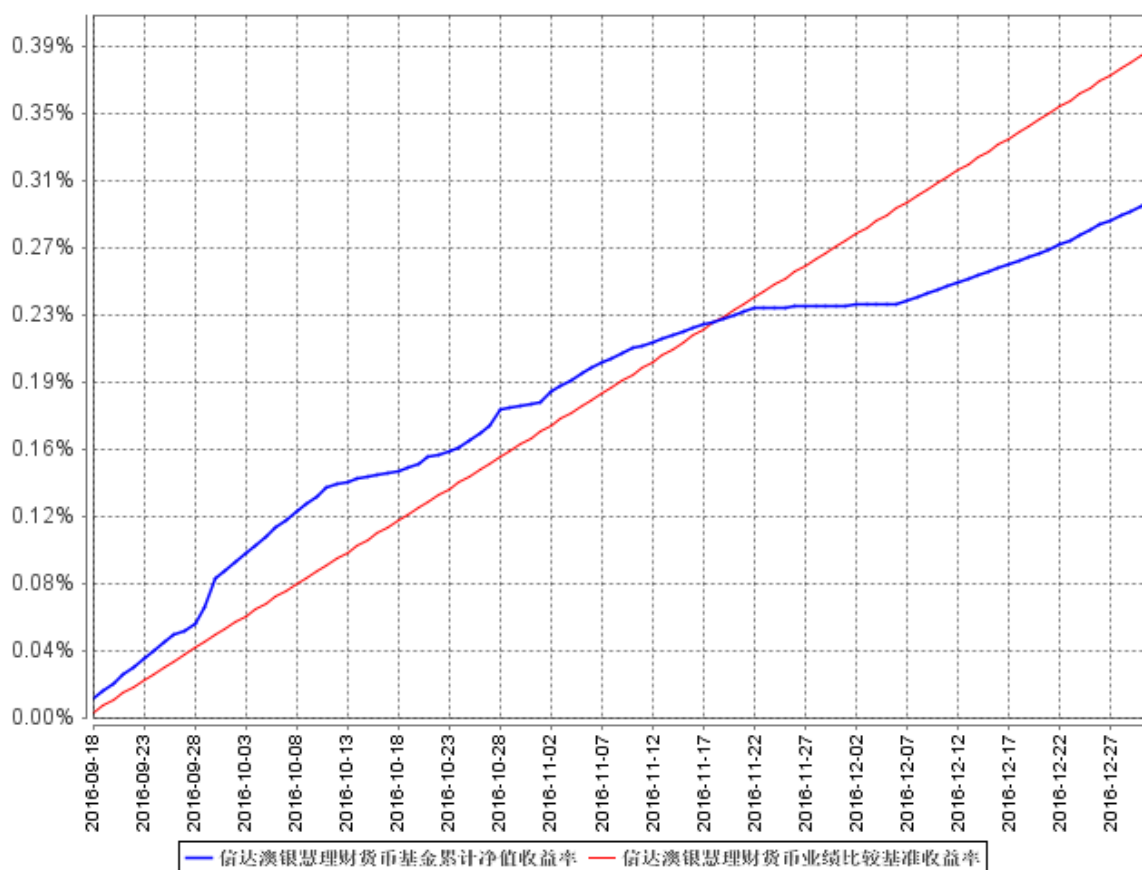
## 3.2 基金净值表现

### 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

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	0.2186%	0.0016%	0.3403%	0.0000%	-0.1217%	0.0016%
自基金合同生效起至今	0.2997%	0.0024%	0.3884%	0.0000%	-0.0887%	0.0024%

### 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

信达澳银慧理财货币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； 期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单； 剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券； 中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

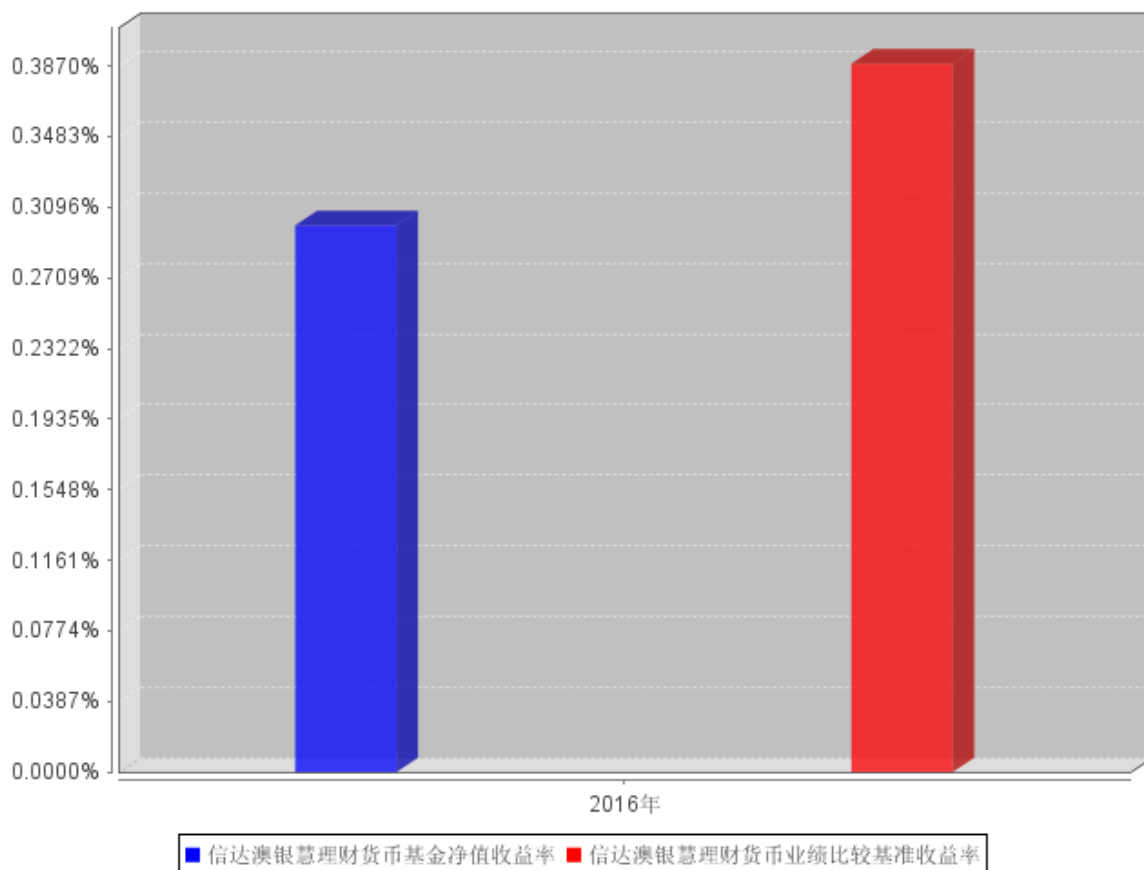
对于法律法规及监管机构今后允许货币基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

2、本基金基金合同生效日 2016 年 9 月 18 日至报告期末未满足 1 年。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将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增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

信达澳银慧理财货币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对比图



注：本基金基金合同于 2016 年 9 月 18 日生效，因此 2016 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

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2016	646,934.82	-	589.31	647,524.13	注：-
合计	646,934.82	-	589.31	647,524.13	注：-



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人信达澳银基金管理有限公司（以下简称“公司”）成立于 2006 年 6 月 5 日，由中国信达资产管理股份有限公司（原中国信达资产管理公司）和澳洲联邦银行全资附属公司康联首域集团有限公司共同发起，是经中国证监会批准设立的国内首家由国有资产管理公司控股的基金管理公司，也是澳洲在中国合资设立第一家基金管理公司。2015 年 5 月 22 日，信达证券股份有限公司受让中国信达资产管理股份有限公司持有的股权，与康联首域共同持有公司股份。公司注册资本 1 亿元人民币，总部设在深圳，在北京设有分公司。公司中方股东信达证券股份有限公司出资比例为 54%，外方股东康联首域集团有限公司出资比例为 46%。

公司建立了健全的法人治理结构，根据《中华人民共和国公司法》的规定设立了股东会、董事会和执行监事。董事会层面设立风险控制委员会和薪酬考核委员会两个专门委员会，并建立了独立董事制度。公司实行董事会领导下的总经理负责制，由总经理负责公司的日常运作，并由各委员会包括经营管理委员会、投资审议委员会、风险管理委员会、产品审议委员会、IT 治理委员会协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构，设立了公募投资总部、专户理财部、市场销售总部、产品创新部、运营管理总部、行政人事部、财务会计部、监察稽核部、董事会办公室等部门，各部门分工协作，职责明确。

截至 2016 年 12 月 31 日，公司共管理十六只基金，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、信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)、信达澳银消费优选混合型证券投资基金、信达澳银信用债债券型证券投资基金、信达澳银慧管家货币市场基金、信达澳银转型创新股票型证券投资基金、信达澳银新能源产业股票型证券投资基金、信达澳银纯债债券型证券投资基金、信达澳银慧理财货币市场基金、信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金。

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 10 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 9 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 9 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、鑫安债券基金（LOF）、信用债债券基金、慧管家货币基金、纯债债券基金、新目标混合基金的基金经理，公募投资总部副总监	2016 年 9 月 30 日	-	12 年	中央财经大学金融学硕士。历任金元证券股份有限公司研究员、固定收益总部副总经理；2011 年 8 月加入信达澳银基金公司，历任投资研究部下固定收益部总经理、固定收益副总监、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）、信达澳银鑫安债券基金（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基金基金经理（2014 年 6 月 26 日起至今）、信达澳银纯债债券基金基金经理（2016 年 8 月 4 日起至今）、信达澳银慧理财货币基

					金基金经理（2016年9月30日起至今）、信达澳银新目标混合基金基金经理（2016年10月25日起至今）。
唐弋迅	本基金的基金经理、新目标混合基金、新财富混合基金的基金经理	2016年11月25日	-	4年	中国人民大学世界经济专业硕士。2012年7月至2014年7月在第一创业证券，任研究所债券研究员；2014年7月至2015年9月在第一创业证券，任固定收益部销售经理、产品经理；2015年9月至2016年7月在第一创业证券，任固定收益部债券交易员、投资经理助理。2016年8月加入信达澳银基金，任信达澳银慧理财货币基金基金经理（2016年11月25日起至今）、信达澳银新目标混合基金基金经理（2016年11月25日起至今）、信达澳银新财富混合基金基金经理（2016年11月25日起至今）。
綦鹏	原本基金的基金经理、原慧管家货币基金的基金经理、原纯债债券基金的基金经理	2016年9月18日	2016年10月19日	9年	上海财经大学管理学硕士。2007年起先后在广发银行、华安基金公司任债券交易员；2010年起先后在万家基金公司、浦银安盛基金管理公司担任基金经理助理、专户高级投资经理等职；2014年5月加

					入信达澳银基金公司，担任信达澳银慧管家货币市场基金基金经理（2014年7月4日起至2016年8月12日）、信达澳银纯债债券基金基金经理（2016年5月5日起至2016年8月12日）、信达澳银慧理财货币基金基金经理（2016年9月18日起至2016年10月19日）。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

#### 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，没有发生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间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

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度，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。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司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）公司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，未发现公司所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，报告期内本公司所管理的投资组合未发生交易所公开竞价的同日反向交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年一季度，央行仅进行了一次降准操作，实质上执行了偏中性的政策。公开市场的货币投放偏谨慎，且回购利率维持在 2.25%，使得短端收益率无法进一步向下突破。二季度，债券市场受到营改增事件的阶段性冲击，同时大宗商品的大幅反弹也带来了通胀的担忧，因此在二季度初中长期利率债收益率有较大的反弹。但二季度的中后期，由于海外市场的动荡致使风险偏好下降，中国的利率债收益率也开始逐渐回落。三季度，央行重启 14 天和 28 天的逆回购，有意识的锁短放长，以压迫市场降低杠杆。但市场依然较为乐观，金融杠杆维持高位。四季度，央行在公开市场操作持续净回笼，导致货币市场极度紧张，银行同业存单利率大幅上行，并带来连锁反应，致使货币利率及债券各期限利率在短时间内大幅上扬。

伴随着“灾后重建”，中高评级债券的收益率逐步回落。不过，市场的悲观情绪仍未完全消散，长期限和低等级的债券利差仍然有扩大的趋势。目前市场对 2017 年的担心主要基于三点：1、按照当下的监管方向，2017 年银行委外增速大概率放缓甚至减少，部分机构仍然有卖券压力；2、美国进入加息周期的逐步确立，限制了收益率下行的空间；3、关于明年基本面和通胀看法，市场预期存在较大差异。

本基金成立于 2016 年三季度，运作过程中维持较低的杠杆率和加权久期。四季度货币基金遭遇赎回狂潮，本基金依靠于配置于流动性较高的存单资产，有效地应对了赎回压力，产品偏离度保持在较低的水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本报告期份额净值收益率为 0.2997%，同期业绩比较基准收益率为 0.3884%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，2017 年债券市场叠加了政治周期、海外因素、监管变化，而市场基本面变化存在较大分歧，也因此，债券市场或无法形成一致性的趋势。策略选择正确与否更能决定投资整体表现。目前收益率整体上移，对于货币来说相对有利，但是本基金管理人认为流动性风险并未完全解除，基于收益率的上升，在月末、季末等考核时点，仍需保证流动性需要以应对可能到来的赎回要求，谨防重演 2016 年末的遭遇。在资产的配置上，多元化资产的配置方向，把握风险收益比。

#### 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，由分管基金运营的高级管理人员担任；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 647,524.13 元, 实际分配收益 647,524.13 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

2016 年 11 月 11 日至 2016 年 12 月 31 日，本基金存在共连续三十六个交易日基金资产净值低于五千万的情形。本基金于 2017 年 1 月 24 日起基金资产净值超过五千万。

## § 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

在本报告期内，本基金托管人在托管 XX 证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、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进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配情况、投资组合报告的内容（“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内），保证复核内容真实、准确和完整，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（2017）审字第 60467227\_H15 号

信达澳银慧理财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理财货币市场基金的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，自 2016 年 9 月 18 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表、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理财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，信达澳银慧理财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理财货币市场基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2016 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间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 郭淑仪

2017 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：信达澳银慧理财货币市场基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	818,404.21
结算备付金		331,818.18
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	-
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		-
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	10,200,000.00

应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	34,927.24
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		11,385,149.63
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,824.79
应付托管费		456.19
应付销售服务费		1,824.79
应付交易费用	7.4.7.7	860.00
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		589.31
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	103,000.00
负债合计		108,555.08
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	11,276,594.55
未分配利润	7.4.7.10	-
所有者权益合计		11,276,594.55
负债和所有者权益总计		11,385,149.63

注：1、本财务报表的实际报告期间为 2016 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日，无可比期间数据。

2、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 11,276,594.55 份。

## 7.2 利润表

会计主体：信达澳银慧理财货币市场基金

本报告期：2016 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2016
-----	-----	--------------------------------------

		年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		930,573.33
1.利息收入		917,353.33
其中：存款利息收入	7.4.7.11	536,678.65
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		380,674.68
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-
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	-
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	13,220.00
<b>减：二、费用</b>		283,049.20
1. 管理人报酬	7.4.10.2	76,041.88
2. 托管费	7.4.10.2	19,740.03
3. 销售服务费		78,960.42
4. 交易费用	7.4.7.18	-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.19	108,306.87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		647,524.13
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		647,524.13

注：本财务报表的实际报告期间为 2016 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日，无可比期间数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银慧理财货币市场基金

本报告期：2016 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016年9月18日(基金合同生效日)至2016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)	410,686,485.23	-	410,686,485.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	647,524.13	647,524.13
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)	-399,409,890.68	-	-399,409,890.68
其中: 1. 基金申购款	11,548,197.79	-	11,548,197.79
2. 基金赎回款	-410,958,088.47	-	-410,958,088.47
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)	-	-647,524.13	-647,524.13
五、期末所有者权益(基金净值)	11,276,594.55	-	11,276,594.55

注:本财务报表的实际报告期间为2016年9月18日(基金合同生效日)至2016年12月31日,无可比期间数据。

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                                徐伟文                                董瑾娟        
 基金管理人负责人                    主管会计工作负责人                    会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

信达澳银慧理财货币市场基金(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[2016]第1714号《关于核准信达澳银慧理财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《信达澳银慧理财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2016年8月29日起至2016年9月9日止期间公开发售,共募集有效净认购资金410,605,321.68元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2016)验字第60467227\_H02号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信达澳银慧理财货币市场基金基金合同》于2016年9月18日正式生效。本基金首次发售募集的有效认购资金为人民币410,605,321.68元,折合410,605,321.68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人民币81,163.55元,

折合 81,163.55 份基金份额。以上基金合同生效日的基金份额总额为 410,686,485.23 份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳银基金管理有限公司，基金托管人为北京银行股份有限公司（以下简称“北京银行”）。

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；期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；中国证监会、中国人民银行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市场基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率（税后）。

#### **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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2016 年 9 月 18 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间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。唯本期财务报表的实际编制期间系自 2016 年 9 月 18 日（基金合同生效日）至 2016 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

基金持有的付息债券、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”。当基金资产净值与影子价格产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

(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。

#### 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；另外，根据中国证监会令第 120 号《货币市场基金监督管理办法》的规定，自 2016 年 2 月 1 日起，如果出现因提前支取而导致的利息损失的情形，基金管理人应当使用风险准备金予以弥补，风险准备金不足的，应当使用固有资金予以弥补；

(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，管理费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率逐日计提，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 0.05% 的年费率逐日计提；
- (3) 根据基金合同，基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.20% 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) 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；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；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；
- (5) 当日申购的基金份额自下一个交易日起，享有基金的收益分配权益；
- (6) 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

### 7.4.6.1 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》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。

### 7.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，

自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

### 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 2016 年 12 月 31 日
活期存款	818,404.21
定期存款	-
其他存款	-
合计：	818,404.21

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

本基金本期末无交易性金融资产。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	10,200,000.00	-
买入返售证券_银行间	-	-
合计	10,200,000.00	-

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	80.68
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	164.23
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	34,682.33
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	34,927.24

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本期末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 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	860.00
合计	860.00

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 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	103,000.00
合计	103,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	410,686,485.23	410,686,485.23
本期申购	11,548,197.79	11,548,197.79
本期赎回(以“-”号填列)	-410,958,088.47	-410,958,088.47
本期末	11,276,594.55	11,276,594.55

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

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	647,524.13	-	647,524.13
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	-647,524.13	-	-647,524.13
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年9月18日(基金合同生效日)至2016年12月31日
活期存款利息收入	128,875.69
定期存款利息收入	398,843.69
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,959.27
其他	-
合计	536,678.65

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本期无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金本期无债券投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

本基金本期无股利收益。

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本期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 2016 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-
基金转换费收入	-
其他	13,220.00
合计	13,220.00

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

本基金本期无交易费用。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00
信息披露费	50,000.00
银行费用	4,906.87
债券托管账户维护费	3,000.00
其他	400.00
合计	108,306.87

### 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，除 7.4.6.1 增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

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
北京银行股份有限公司(“北京银行”)	基金托管人、基金代销机构
信达证券股份有限公司(“信达证券”)	基金管理人的控股股东
康联首域集团有限公司 (Colonial First State Group Limited)	基金管理人的股东
信达新兴财富(北京)资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股 20%以上的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期间的关联方交易

### 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
	2016年9月18日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	76,041.88
其中：支付销售机构的客户维护费	3,413.07

注：根据基金合同，本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年9月18日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	19,740.03

注：支付基金托管人北京银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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 × 0.05% / 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
	2016年9月18日(基金合同生效日)至2016年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
北京银行	307.13
信达澳银基金公司	55,652.67
合计	55,959.80

注：本基金的年销售服务费率为 0.20%。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**

本期基金管理人无运用固有资金投资本基金。

**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**

本期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金。

**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

关联方名称	本期 2016年9月18日(基金合同生效日)至 2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
北京银行	818,404.21	128,875.69

注：本基金的银行存款由基金托管人北京银行保管，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**

本基金本期获得基金管理人弥补基金投资者收益人民币 13,220.00 元。

**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

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
646,934.82	-	589.31	647,524.13	-

**7.4.12 期末(2016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

本基金本期末无持有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 2016 年 12 月 31 日止, 本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额, 无抵押债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止, 本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。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。本基金的投资范围包括: 现金、期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单; 剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券; 中国证监会、中国人民银行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以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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北京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。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券。

#### 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。

本基金所持有的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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 2016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	818,404.21	-	-	-	818,404.21
结算备付金	331,818.18	-	-	-	331,818.18
买入返售金融资产	10,200,000.00	-	-	-	10,200,000.00
应收利息	-	-	-	34,927.24	34,927.24
资产总计	11,350,222.39	-	-	34,927.24	11,385,149.63
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,824.79	1,824.79
应付托管费	-	-	-	456.19	456.19
应付销售服务费	-	-	-	1,824.79	1,824.79
应付交易费用	-	-	-	860.00	860.00
应付利润	-	-	-	589.31	589.31
其他负债	-	-	-	103,000.00	103,000.00
负债总计	-	-	-	108,555.08	108,555.08
利率敏感度缺口	11,350,222.39	-	-	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

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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，本基金的资产净值连续超过 20 个工作日低于人民币 5,000 万元。

##### 7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 28 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	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	10,200,000.00	89.59
	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	1,150,222.39	10.10
4	其他各项资产	34,927.24	0.31
5	合计	11,385,149.63	100.00

### 8.2 债券回购融资情况

注：本基金本报告期内未发生债券回购融资。

#### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

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

### 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	36
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

#### 8.3.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本基金本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 120 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	11.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	88.68	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.65	-

#### 8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0000%
报告期内偏离度的最低值	0.0000%

报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0000%
------------------------	---------

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期末未发生内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

注：本基金本报告期末未发生内正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

## 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。

### 8.8.3 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	-
3	应收利息	34,927.24
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	34,927.24

### 8.8.4 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

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

334	33,762.26	10,508,031.20	93.18%	768,563.35	6.82%
-----	-----------	---------------	--------	------------	-------

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,003.77	0.01%

## 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年9月18日）基金份额总额	410,686,485.23
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	11,548,197.79
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	410,958,088.47
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份 额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	11,276,594.55

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

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

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

银基金管理有限公司第四届董事会董事。

本基金管理人 2016 年 12 月 30 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十六次书面决议通过, 程文卫先生离任信达澳银基金管理有限公司副总经理。

本报告期内, 本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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

报告期内, 本基金管理人继续聘任安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金的外部审计机构。报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为 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	
中金公司	2	-	-	-	-	新增

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
中金公司	-	-	1,568,800,000.00	100.00%	-	-

## 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	信达澳银慧理财货币市场基金招募说明书	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016年8月25日
2	信达澳银慧理财货币市场基金基金份额发售公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016年8月25日
3	信达澳银慧理财货币市场基金托管协议	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016年8月25日
4	信达澳银慧理财货币市场基金基金合同及摘要	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016年8月25日
5	关于增加申万宏源证券、申万宏源西部证券、首创证券及联讯证券为信达澳银慧理财货币基金代销机构的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016年8月31日
6	关于增加恒泰证券为信达澳银慧理财货币市场基金代销机构的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016年9月5日
7	关于信达澳银慧理财货币市场基金合同生效的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016年9月19日
8	关于信达澳银慧理财货币市场基金开放申购、赎回、转换、定投业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016年9月23日
9	信达澳银基金管理有限公司关于直销网上交易系统机房搬迁直销电子交易平台业务暂停服务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016年9月23日
10	信达澳银基金管理有限公司关于机房搬迁所有对外业务暂停服务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016年9月30日
11	信达澳银慧理财货币市场基金基金经理变更公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016年9月30日

12	信达澳银基金管理有限公司关于公司总部迁址的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 10 月 12 日
13	信达澳银慧理财货币市场基金基金经理变更公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 10 月 19 日
14	信达澳银基金管理有限公司关于增加直销咨询电话的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 10 月 24 日
15	关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 10 月 25 日
16	关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 12 月 14 日
17	信达澳银慧理财货币市场基金基金经理变更公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 11 月 25 日
18	关于高级管理人员变更的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 12 月 30 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、《信达澳银慧理财货币市场基金基金合同》；
- 3、《信达澳银慧理财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)