

重要提示

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

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2019年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2019年04月01日起至2019年06月30日止。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Rows include 基金简称, 场内简称, 基金主代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人.

主要财务指标

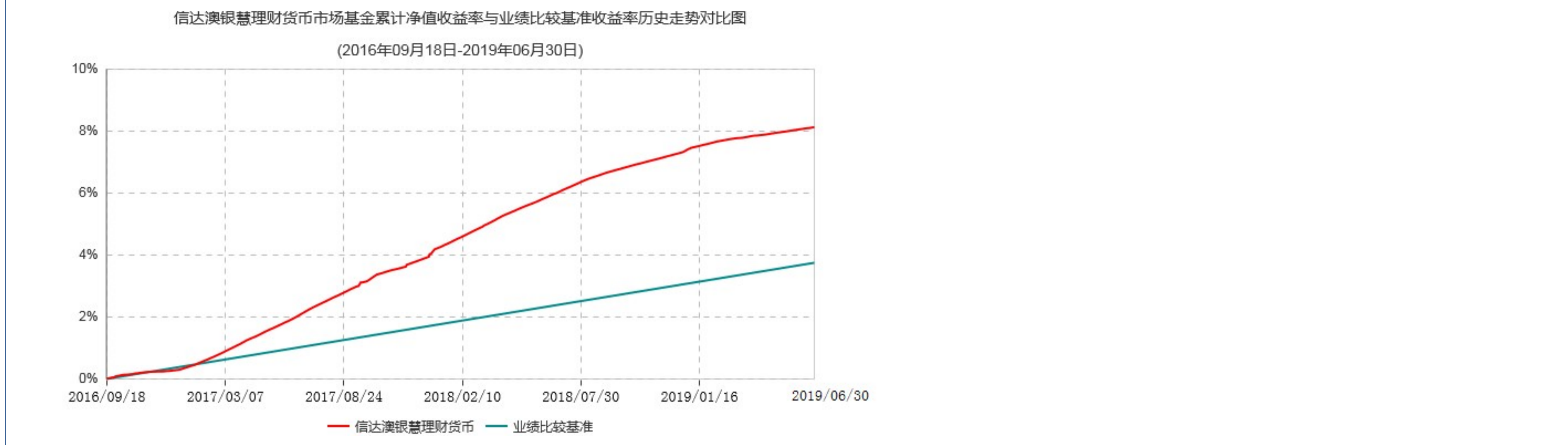
Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Rows include 本期已实现收益, 本期利润, 期末基金资产净值.

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

基金净值表现

Table with 6 columns: 阶段, 净值收益率①, 净值收益率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Row: 过去三个月.

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



注：1、本基金基金合同于2016年9月18日生效，2016年9月26日开始办理申购、赎回业务。2、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、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。

基金经理（或基金经理小组）简介

Table with 5 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理期限 (Tenure), 证券从业年限 (Securities Industry Experience), 说明 (Remarks). Rows: 曹伟迅, 孔雪峰.

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。

报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

公平交易专项说明

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。

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对倒反向交易。

报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年二季度政策转向，增长速度有所回落，短期的经济向好反映出增长韧性，触发政策转向。2019年4月政治局会议，删除了“六个稳”的提法，强调“结构性去杠杆”和“经济结构中的结构性问题”。

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本报告期基金份额净值收益率为50.271%，同期业绩比较基准收益率为0.3366%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

2018年12月24日至2019年6月28日，本基金存在连续六十个交易日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已按照法规规定向监管机构报送说明报告，截至报告期末基金资产净值未达到五千万。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号 (No.), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage). Rows: 1. 固定收益投资, 2. 买入返售金融资产, 3. 银行存款和结算备付金合计, 4. 其他各项资产, 5. 合计.

报告期末债券回购融资情况

Table with 4 columns: 序号 (No.), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount), 占基金资产净值的比例 (%) (Percentage). Rows: 1. 报告期内债券回购融资余额, 2. 报告期内债券回购融资余额.

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%。

投资组合平均剩余期限基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item), 天数 (Days). Rows: 报告期末投资组合平均剩余期限, 报告期内投资组合平均剩余期限最高值, 报告期内投资组合平均剩余期限最低值.

注：本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

Table with 4 columns: 序号 (No.), 项目 (Item), 各期限资产占基金资产净值的比例 (%) (Percentage), 各期限负债占基金资产净值的比例 (%) (Percentage). Rows: 1. 30天以内, 2. 30天(含)-60天, 3. 60天(含)-90天, 4. 90天(含)-120天, 5. 120天(含)-397天(含), 合计.

注：本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号 (No.), 债券品种 (Bond Type), 摊余成本 (元) (Amortized Cost), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage). Rows: 1. 国家债券, 2. 央行票据, 3. 金融债券, 4. 企业债券, 5. 企业短期融资券, 6. 中期票据, 7. 同业存单, 8. 其他, 9. 合计, 10. 剩余存续期超过287天的浮动利率债券.

期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号 (No.), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 债券数量 (张) (Quantity), 摊余成本 (元) (Amortized Cost), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage). Rows: 1. 188901, 2. 188603.

注：本报告期末本基金仅持有上述债券。

“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

Table with 2 columns: 项目 (Item), 偏离情况 (Deviation). Rows: 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, 报告期内偏离度的最低值, 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值.

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注：报告期内未发生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：报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

投资组合报告附注

本基金采用“摊余成本法”计价，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率和约定利率并考虑其天时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。

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天的浮动利率债券说明

Table with 4 columns: 序号 (No.), 发生日期 (Date), 该类浮动债占基金资产净值的比例 (Ratio), 原因 (Reason), 调整期 (Adjustment Period).

受到调查以及处罚情况

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。

其他资产构成

Table with 3 columns: 序号 (No.), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount). Rows: 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, 3. 应收利息, 4. 应收申购款, 5. 其他应收款, 6. 待摊费用, 7. 其他, 8. 合计.

投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Rows: 报告期初基金份额总额, 报告期间基金份额总额, 报告期间基金份额总额, 报告期末基金份额总额.

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 5 columns: 序号 (No.), 交易方式 (Transaction Type), 交易日期 (Date), 交易金额 (份) (Amount), 交易金额 (元) (Amount), 适用费率 (Applicable Rate).

注：基金管理人报告期内未运用固有资金投资本基金。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with 6 columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Shares), 持有份额占基金总份额比例 (%) (Percentage), 发起份额总数 (Initiated Shares), 发起份额占基金总份额比例 (%) (Percentage), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Period).

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table with 7 columns: 投资者类别 (Investor Type), 序号 (No.), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval), 期初份额 (Start Shares), 申购份额 (Purchase Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (Current Shares), 份额占比 (Percentage).

1、赎回申请导致的风险；2、流动性风险；3、基金资产净值波动导致的风险；4、基金资产净值波动导致的风险；5、基金资产净值波动导致的风险；6、基金资产净值波动导致的风险；7、基金资产净值波动导致的风险；8、基金资产净值波动导致的风险；9、基金资产净值波动导致的风险；10、基金资产净值波动导致的风险。

影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；2、《信达澳银慧理货币市场基金基金合同》；3、《信达澳银慧理货币市场基金托管协议》；4、《基金招募说明书》；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、本报告期公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他相关公告。

存放地点

备查文件存放于基金管理人/或基金托管人住所。

查阅方式

投资者可到基金管理人/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印件或复印件。