

# 安信现金管理货币市场基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料已经审计。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 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§2 基金简介</b>	<b>4</b>
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
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	15
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	16
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	16
<b>§5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21
<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 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	46
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	46
8.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细.....	46
8.9 投资组合报告附注.....	46
<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 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	48
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	48
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>49</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.....	50
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	51
11.9 其他重大事件.....	51
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>53</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	53
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>54</b>
13.1 备查文件目录.....	54
13.2 存放地点.....	54
13.3 查阅方式.....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信现金管理货币市场基金	
基金简称	安信现金管理货币	
基金主代码	750006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 2 月 5 日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	54,393,728.15 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	安信现金管理货币 A	安信现金管理货币 B
下属分级基金的交 易代码	750006	750007
报告期末下属分级 基金的份额总额	40,947,887.96 份	13,445,840.19 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，通过积极主动的投资组合，力求为投资者获得超过业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>1、资产配置策略。通过对宏观经济指标的跟踪和分析，并结合央行公开市场操作等情况，合理预测货币市场利率趋势变化，决定并动态调整投资组合平均剩余期限和比例分布。</p> <p>2、个券选择策略。考虑安全性因素，优先选择国债等高信用等级债券以规避信用风险。在满足信用评级要求的前提下，根据我公司债券评分标准对信用债券进行评分筛选，重点关注低估值品种。</p> <p>3、套利策略。在保证安全性和流动性的前提下，本基金将在充分验证套利机会可行性的基础上，适当参与市场的套利，捕捉和把握无风险套利机会。</p> <p>4、回购策略。密切跟踪不同市场和不同期限之间的利率差异，在精确投资收益测算的基础上，积极采取回购杠杆操作，为基金资产增加收益。</p> <p>5、流动性管理策略。在遵循流动性优先的原则下，建立流动性预警指标，动态调整基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例，确保基金资产的变现能力。</p>
业绩比较基准	七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		安信基金管理有限责任公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	孙晓奇	李申

负责人	联系电话	0755-82509999	021-60637102
	电子邮箱	service@essencefund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008-088-088	021-60637111
传真		0755-82799292	021-60635778
注册地址		广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518026	100033
法定代表人		刘入领	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号，东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

## § 3 主要财务指标、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	2021 年		2020 年		2019 年	
	安信现金管理货币 A	安信现金管理货币 B	安信现金管理货币 A	安信现金管理货币 B	安信现金管理货币 A	安信现金管理货币 B
本期已实现收益	809,310.32	6,590,741.02	901,197.47	119,066,294.57	1,983,048.95	167,273,829.26
本期利润	809,310.32	6,590,741.02	901,197.47	119,066,294.57	1,983,048.95	167,273,829.26
本期	1.8484%	2.0930%	1.7746%	2.0195%	2.3695%	2.6161%

净值 收益 率						
3.1. 2 期 末数 据和 指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末 基金 资产 净值	40,947,887 .96	13,445,840 .19	37,467,773 .00	892,674,371 .57	63,516,926 .81	8,676,672,802 .05
期末 基金 份额 净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1. 3 累 计期 末指 标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
累计 净值 收益 率	31.4216%	34.2635%	29.0365%	31.5110%	26.7866%	28.9077%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，所以公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金为货币市场基金，无认（申）购或交易基金的各项费用。

3、本基金根据每日基金收益情况，每日计算当日收益并分配，每月集中支付。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信现金管理货币 A

阶段	份额净值收 益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④

过去三个月	0.4574%	0.0026%	0.3403%	0.0000%	0.1171%	0.0026%
过去六个月	0.8686%	0.0022%	0.6805%	0.0000%	0.1881%	0.0022%
过去一年	1.8484%	0.0021%	1.3500%	0.0000%	0.4984%	0.0021%
过去三年	6.1119%	0.0017%	4.0537%	0.0000%	2.0582%	0.0017%
过去五年	13.7375%	0.0029%	6.7537%	0.0000%	6.9838%	0.0029%
自基金合同生效起至今	31.4216%	0.0063%	12.0279%	0.0000%	19.3937%	0.0063%

安信现金管理货币 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.5180%	0.0026%	0.3403%	0.0000%	0.1777%	0.0026%
过去六个月	0.9904%	0.0022%	0.6805%	0.0000%	0.3099%	0.0022%
过去一年	2.0930%	0.0021%	1.3500%	0.0000%	0.7430%	0.0021%
过去三年	6.8796%	0.0017%	4.0537%	0.0000%	2.8259%	0.0017%
过去五年	15.1116%	0.0029%	6.7537%	0.0000%	8.3579%	0.0029%
自基金合同生效起至今	34.2635%	0.0063%	12.0279%	0.0000%	22.2356%	0.0063%

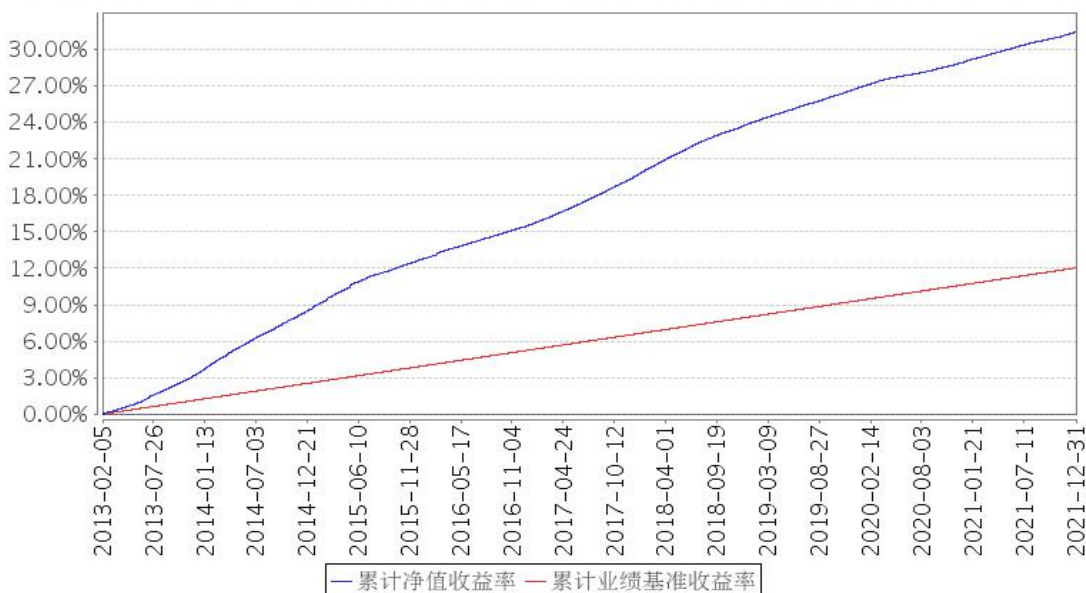
注：根据《安信现金管理货币市场基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准：七天通知存



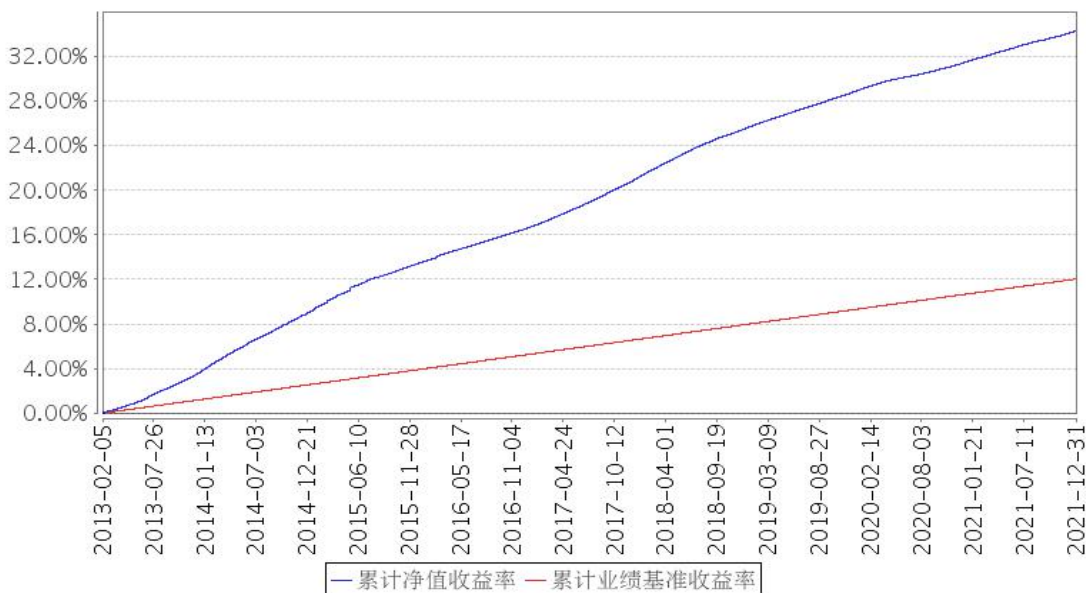
款利率(税后)。通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

安信现金管理货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安信现金管理货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

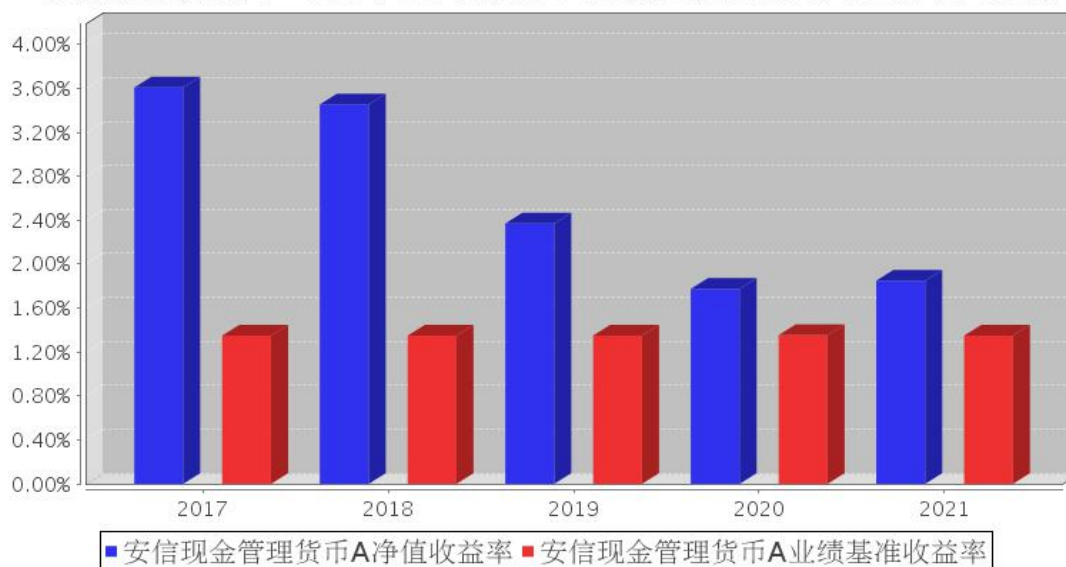


注：1、本基金基金合同生效日为 2013 年 2 月 5 日。

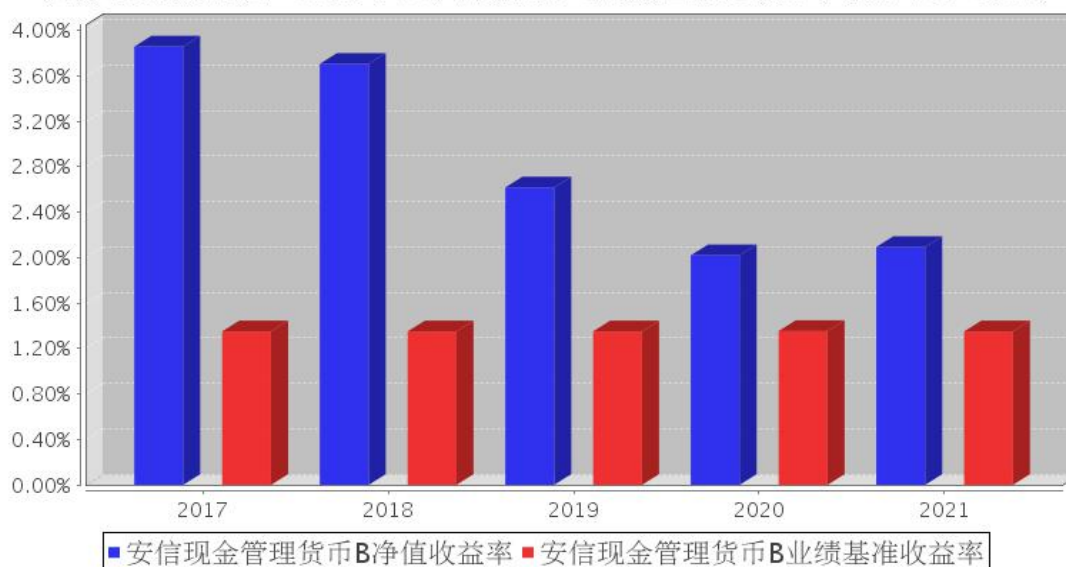
2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 3.2.3 过去五年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

安信现金管理货币A基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



安信现金管理货币B基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

安信现金管理货币 A

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
2021 年	809,340.85	-	-30.53	809,310.32	-
2020 年	902,823.20	-	-1,625.73	901,197.47	-
2019 年	2,018,632.42	-	-35,583.47	1,983,048.95	-
合计	3,730,796.47	-	-37,239.73	3,693,556.74	-

安信现金管理货币 B

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
2021 年	6,654,026.80	-	-63,285.78	6,590,741.02	-
2020 年	119,617,093.58	-	-550,799.01	119,066,294.57	-
2019 年	168,423,636.57	-	-1,149,807.31	167,273,829.26	-
合计	294,694,756.95	-	-1,763,892.10	292,930,864.85	-

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于 2011 年 12 月，总部位于深圳，注册资本 5.0625 亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有 39.84% 的股权，安信证券股份有限公司持有 33.95% 的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 20.28% 的股权，中广核财务有限责任公司持有 5.93% 的股权。

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 77 只开放式基金具体如下：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数型证券投资基金（原安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金）、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券

投资基金(原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金)、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金(原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金)、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金(LOF)、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金(LOF)、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信价值驱动三年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信价值成长混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金(LOF)、安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金、安信尊享添利利率债债券型证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信成长精选混合型证券投资基金、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金、安信创新先锋混合型发起式证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信医药健康主题股票型发起式证券投资基金、安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信均衡成长 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信消费升级一年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值启航混合型证券投资基金、安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金、安信优质企业三年持有期混合型证券投资基金、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
肖芳芳	本基金的基金经理	2017年6月6日	-	10年	肖芳芳女士，经济学硕士。历任华宝证券有限责任公司资产管理部研究员，财达证券有限责任公司资产管理部投资助理，安信基金管理有限责任公司固定收益部投研助理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。曾任安信安盈保本混合型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信保证金交易型货币市场基金、安信新视

					野灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信保证金交易型货币市场基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金的基金经理；现任安信新目标灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信现金管理货币市场基金、安信活期宝货币市场基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
祝璐琛	本基金的基金经理	2021 年 12 月 31 日	-	5 年	祝璐琛先生，经济学硕士，曾任华西证券股份有限公司固定收益部交易员，安信基金管理有限责任公司固定收益部分析师，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。曾任安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信活期宝货币市场基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理，现任安信尊享添利利率债债券型证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理助理，安信现金管理货币市场基金、安信活期宝货币市场基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。
祝璐琛	本基金的基金经理助理	2020 年 12 月 16 日	2021 年 12 月 31 日	5 年	祝璐琛先生，经济学硕士，曾任华西证券股份有限公司固定收益部交易员，安信基金管理有限责任公司固定收益部分析师，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。曾任安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信活期宝货币市场基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理，现任安信尊享添利利率债债券型证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理助理，安信现金管理货币市场基金、安信活期宝货币市场基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金的

					基金经理。
任凭	本基金的基金经理	2020年4月3日	2021年10月19日	14年	任凭女士，法学硕士。曾任职于招商基金管理有限公司，2011年加入安信基金管理有限公司，历任运营部交易员、固定收益部投研助理，现任固定收益部基金经理。曾任安信保证金交易型货币市场基金、安信活期宝货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信新视野灵活配置混合型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信优享纯债债券型证券投资基金的基金经理助理；安信恒利增强债券型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信现金管理货币市场基金的基金经理。现任安信新目标灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信活期宝货币市场基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信宏盈18个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。

注：1、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写；基金经理助理的“任职日期”根据公司决定确定的聘任日期填写。“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 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《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人采用 T 值检验等统计方法，定期对旗下管理的所有基金和投资组合之间发生的

同一交易日内、三个交易日内、五个交易日内的同向交易价差进行专项分析和检查。分析结果显示，本基金与本基金管理人旗下管理的所有其他基金和投资组合之间，不存在通过相同品种的同向交易进行投资组合间利益输送的行为。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 1 次，为不同基金经理管理的基金因投资策略和流动性需要而发生的反向交易，有关基金经理履行了内部审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 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

2021 年，全球经济仍然受到疫情影响，由于经济需求有所复苏、但局部疫情反复恶化，供应链约束下，全球出现了通货膨胀，值得一提的是，由于清洁能源在过往数十年的大步发展，以及 2021 年极端天气的影响，能源价格也给全球通胀做出较大贡献。相比之下，全球经济复苏的进程乏善可陈。美国维持宽松货币政策至 4 季度，已开始 TAPER；中国下半年两度降准。国内经济多项指标呈现前高后低的趋势，投资、消费、净出口三项主力中，仅有净出口受益于国内相对完善的产业链，其余两项相对弱势。

全年来看，SHIBOR 先上后下再上，年初波动较大，剩余时间波动较小，各期限均下降 25bp 附近。整体来说，经济需求渐弱叠加央行降准两次，SHIBOR 中枢走低。

本基金操作方面，考虑到客户流动性需求，组合全年以利率债短期波段搭配 1-3M 存单和存款操作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期安信现金管理货币 A 的基金份额净值收益率为 1.8484%，本报告期安信现金管理货币 B 的基金份额净值收益率为 2.0930%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%。

### 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 2022 年，国内经济情况和海外经济情况仍然会受到疫情的变化和自身的发展而变得复杂，国内新的增长动力崛起和旧的增长模式的渐退并行。后疫情时代，新的增长模式会催生与之

相适应的金融模式，随着资管新规的步步推进，打破刚兑带来的利率中枢水平走低是大概率发生的事情。2022 年国内二十大和美国中期选举都将受到全球特别关注。美联储加息、缩表也将成为影响全球金融市场的关键因素之一。

具体到货币市场上，预计 2022 年 SHIBOR 中枢可能会维持目前水平或者有所下降，并且仍将遵循惯有的季节性。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展的实际需要，通过合规培训、梳理业务风险点、细化制度流程、对员工行为以及重点业务稽核检查等方式，保障了基金管理及公司业务的有效开展及合规运作。本基金管理人承诺将持续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金资产安全、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

本基金管理人按照相关法律法规、证监会的相关规定以及基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证基金估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会负责人由公司分管投资的公司领导担任，估值委员会成员由运营部、权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部、固定收益研究部、风险管理部和监察稽核部分别委派一名或多名代表组成，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会各成员职责分工如下：权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部及固定收益研究部负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；风险管理部协助评估相关估值模型及参数，向估值委员会提出建议；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截至报告期末本基金管理人已签约的定价服务机构为中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司，由其按约定提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。



#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，根据法律法规及《基金合同》的约定，本基金每日计算投资人账户当日所产生的收益，每月将投资人账户累计的收益结转为其基金份额，计入该投资人账户的本基金份额中。本报告期内，本基金实施利润分配的金额为 7,400,051.34 元，其中本基金 A 类共分配人民币 809,310.32 元，B 类共分配人民币 6,590,741.02 元，不存在应分配但尚未实施分配的情况。

#### 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。本报告期内，本基金实施利润分配的金额为 7,400,051.34 元，其中本基金 A 类共分配人民币 809,310.32 元，B 类共分配人民币 6,590,741.02 元，不存在应分配但尚未实施分配的情况。

#### 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

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	安信现金管理货币市场基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了安信现金管理货币市场基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的安信现金管理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，公允反映了安信现金管理货币市场基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基	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。审计报告的“注

<p>础</p>	<p>册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于安信现金管理货币市场基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。</p>
<p>强调事项</p>	<p>无</p>
<p>其他事项</p>	<p>无</p>
<p>其他信息</p>	<p>安信现金管理货币市场基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估安信现金管理货币市场基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督安信现金管理货币市场基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，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。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对安信现金管理货币市场基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况</p>

	可能导致安信现金管理货币市场基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报 (包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所 (特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	邓雯
会计师事务所的地址	中国北京市东城区东长安街 1 号, 东方广场安永大楼 16 层	
审计报告日期	2022 年 03 月 24 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 安信现金管理货币市场基金

报告截止日: 2021 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	10,861,644.98	17,753,217.62
结算备付金		650,935.70	478,574.84
存出保证金		11,726.60	40,848.73
交易性金融资产	7.4.7.2	24,904,136.44	698,536,710.39
其中: 股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		24,904,136.44	698,536,710.39
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	18,074,332.11	341,015,316.53
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	24,683.14	2,949,239.98
应收股利		-	-
应收申购款		38,932.43	361,001.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		54,566,391.40	1,061,134,909.18
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 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		-	129,999,685.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	149.78
应付管理人报酬		22,752.37	458,897.91
应付托管费		6,894.69	139,059.93
应付销售服务费		10,275.49	22,734.83
应付交易费用	7.4.7.7	16,601.00	78,534.75
应交税费		199.03	6,530.84
应付利息		-	7,914.37
应付利润		3,307.34	66,623.65
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	112,633.33	212,633.55
负债合计		172,663.25	130,992,764.61
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	54,393,728.15	930,142,144.57
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		54,393,728.15	930,142,144.57
负债和所有者权益总计		54,566,391.40	1,061,134,909.18

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 54,393,728.15 份，其中安信现金管理货币 A 基金份额总额为 40,947,887.96 份，基金份额净值 1.0000 元；安信现金管理货币 B 基金份额总额为 13,445,840.19 份，基金份额净值 1.0000 元。

## 7.2 利润表

会计主体：安信现金管理货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		9,465,298.70	152,677,259.85
1. 利息收入		8,805,757.33	149,775,324.92
其中：存款利息收入	7.4.7.11	790,621.56	21,435,777.90
债券利息收入		5,650,825.61	86,069,649.18
资产支持证券利息收入		-	2,292,510.77
买入返售金融资产收入		2,364,310.16	39,977,387.07
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		659,541.37	2,901,934.93
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	659,541.37	2,362,785.64
资产支持证券投资 收益	7.4.7.14	-	539,149.29
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	-	-
3. 公允价值变动收益(损失 以“-”号填列)	7.4.7.18	-	-
4. 汇兑收益(损失以“-” 号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-” 号填列)	7.4.7.19	-	-
减: 二、费用		2,065,247.36	32,709,767.81
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,177,335.71	20,024,249.35
2. 托管费	7.4.10.2.2	356,768.37	6,067,954.26
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	140,876.01	728,066.79
4. 交易费用	7.4.7.20	-7,110.00	275.00
5. 利息支出		226,748.04	5,543,663.44
其中: 卖出回购金融资产支 出		226,748.04	5,543,663.44
6. 税金及附加		441.02	27,498.39
7. 其他费用	7.4.7.21	170,188.21	318,060.58
三、利润总额(亏损总额以 “-”号填列)		7,400,051.34	119,967,492.04
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-” 号填列)		7,400,051.34	119,967,492.04

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 安信现金管理货币市场基金

本报告期: 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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)	930,142,144.57	-	930,142,144.57
二、本期经营活动产生的基 金净值变动数(本期利润)	-	7,400,051.34	7,400,051.34
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)	-875,748,416.42	-	-875,748,416.42

其中：1. 基金申购款	2,168,555,542.13	-	2,168,555,542.13
2. 基金赎回款	-3,044,303,958.55	-	-3,044,303,958.55
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）	-	-7,400,051.34	-7,400,051.34
五、期末所有者权益（基金净值）	54,393,728.15	-	54,393,728.15
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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）	8,740,189,728.86	-	8,740,189,728.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	119,967,492.04	119,967,492.04
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）	-7,810,047,584.29	-	-7,810,047,584.29
其中：1. 基金申购款	19,941,097,694.75	-	19,941,097,694.75
2. 基金赎回款	-27,751,145,279.04	-	-27,751,145,279.04
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）	-	-119,967,492.04	-119,967,492.04
五、期末所有者权益（基金净值）	930,142,144.57	-	930,142,144.57

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：

刘入领

范瑛

苗杨

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

安信现金管理货币市场基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]1649号文“关于核准安信现金管理货币市场基金募集的批复”的核准，由基金管理人安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信现金管理货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金募集期间为2013年1月21日至2013年2月1日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊

普通合伙)验证并出具安永华明(2013)验字 60962175\_H01 号验资报告。经向中国证监会备案,《安信现金管理货币市场基金基金合同》于 2013 年 2 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,540,254,942.88 份,其中认购资金利息折合 289,164.51 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司,注册登记机构为安信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《安信现金管理货币市场基金基金合同》及《安信现金管理货币市场基金招募说明书》,本基金分设两类基金份额:A 类基金份额和 B 类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码,收取不同的销售服务费并分别公布每万份基金净收益和七日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信现金管理货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金;期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、同业存单;剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券;剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券;剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的中期票据、短期融资券;期限在 1 年以内(含 1 年)的债券回购;期限在 1 年以内(含 1 年)的中央银行票据以及中国证监会、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。

本基金的业绩比较基准:七天通知存款利率(税后)。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 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。

### 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及贷款和应收款项。

本基金以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算保证金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

#### (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。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

### 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

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。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；应收款项和其他金融负债等相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证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。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。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，按银行实际协议利率逐日计提利息；

##### (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

A. 基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

B. 基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，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

A. 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；

B. 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 0.5%的情形，基金管理人应与基金托管人协商一致后，参考成交价、市场利率等信息对投资

组合进行价值重估，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值，编制临时报告书，予以公告；

C. 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

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当时可执行的；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。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资和资产支持证券投资处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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

同一类别的每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配；本基金收益每月集中支付一次，每月

累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每月累计收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额；当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一工作日起，不享有基金的分配权益。

#### 7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要的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

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》，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，暂不征收企业所得税。

##### 7.4.6.2 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定及其他相关法规：

资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的

增值税应纳税额中抵减；对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.6.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。基金取得的债券的利息收入及储蓄利息收入，由债券发行企业及金融机构在向基金派发债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

### 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	861,644.98	17,753,217.62
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	10,000,000.00	-
合计	10,861,644.98	17,753,217.62

注：其他存款所列金额为基金投资于有存款期限但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	24,904,136.44	24,911,500.00	7,363.56	0.0135
	合计	24,904,136.44	24,911,500.00	7,363.56	0.0135
资产支持证券	-	-	-	-	
合计	24,904,136.44	24,911,500.00	7,363.56	0.0135	

项目		上年度末 2020 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	49,911,534.25	49,935,000.00	23,465.75	0.0025
	银行间市场	648,625,176.14	648,782,000.00	156,823.86	0.0169
	合计	698,536,710.39	698,717,000.00	180,289.61	0.0194
资产支持证券		-	-	-	-
合计		698,536,710.39	698,717,000.00	180,289.61	0.0194

注：1) 偏离金额=影子定价-摊余成本

2) 偏离度=偏离金额/摊余成本法确认的基金资产净值

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告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

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	10,000,000.00	-
银行间市场	8,074,332.11	-
合计	18,074,332.11	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	290,000,000.00	-
银行间市场	51,015,316.53	-
合计	341,015,316.53	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,088.83	2,116.26
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	21,508.43	-

应收结算备付金利息	322.19	236.94
应收债券利息	-	2,819,231.59
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	1,757.86	127,634.95
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	5.83	20.24
合计	24,683.14	2,949,239.98

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末与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 2021年12月31日	上年度末 2020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	16,601.00	78,534.75
合计	16,601.00	78,534.75

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	0.22
应付证券出借违约金	-	-
应付银行间账户维护费	9,300.00	9,300.00
应付信息披露费	83,333.33	123,333.33
应付审计费	20,000.00	80,000.00
合计	112,633.33	212,633.55

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 安信现金管理货币 A

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	37,467,773.00	37,467,773.00
本期申购	179,517,641.18	179,517,641.18
本期赎回（以“-”号填列）	-176,037,526.22	-176,037,526.22
本期末	40,947,887.96	40,947,887.96

安信现金管理货币 B

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	892,674,371.57	892,674,371.57
本期申购	1,989,037,900.95	1,989,037,900.95
本期赎回 (以“-”号填列)	-2,868,266,432.33	-2,868,266,432.33
本期末	13,445,840.19	13,445,840.19

注：申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

安信现金管理货币 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	809,310.32	-	809,310.32
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	-809,310.32	-	-809,310.32
本期末	-	-	-

安信现金管理货币 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	6,590,741.02	-	6,590,741.02
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	-6,590,741.02	-	-6,590,741.02
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入	21,609.92
定期存款利息收入	-	2,658,194.40
其他存款利息收入	744,741.78	18,564,153.60
结算备付金利息收入	23,525.09	115,926.11
其他	744.77	245.18

合计	790,621.56	21,435,777.90
----	------------	---------------

注：其他存款利息收入所列金额为基金投资于有存款期限但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告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 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,914,603,004.64	20,552,518,603.87
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,897,946,127.32	20,510,600,161.83
减：应收利息总额	15,997,335.95	39,555,656.40
买卖债券差价收入	659,541.37	2,362,785.64

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	-	210,834,004.88
减：卖出资产支持证券成本总额	-	207,002,403.86
减：应收利息总额	-	3,292,451.73
资产支持证券投资收益	-	539,149.29

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。



#### 7.4.7.17 股利收益

本基金本报告期末及上年度可比期间无股利收益。

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间无公允价值变动收益。

#### 7.4.7.19 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间无其他收入。

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	-7,110.00	275.00
合计	-7,110.00	275.00

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	20,000.00	80,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	37,488.21	80,860.58
银行间账户维护费	32,700.00	37,200.00
合计	170,188.21	318,060.58

#### 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

截至本财务报表批准报出日，本基金无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
安信基金管理有限责任公司（“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司（“安信证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司

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

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 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 2021年1月1日至2021年12	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年
----	-------------------------	----------------------------

	月 31 日	12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,177,335.71	20,024,249.35
其中：支付销售机构的客户维护费	78,762.87	817,845.94

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	356,768.37	6,067,954.26

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 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		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信现金管理货币 A	安信现金管理货币 B	合计
安信基金	50,810.03	26,893.73	77,703.76
安信证券	13,326.55	1,379.84	14,706.39
中国建设银行	19,666.51	-	19,666.51
合计	83,803.09	28,273.57	112,076.66
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信现金管理货币 A	安信现金管理货币 B	合计
安信基金	45,177.45	519,787.79	564,965.24
安信证券	24,208.29	10,205.15	34,413.44
中国建设银行	24,001.91	-	24,001.91
合计	93,387.65	529,992.94	623,380.59

注：本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额持有人的费率。B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其达到 B 类条件的开放日后的下一个工作日起享受 B 类基金份额持有人的费率。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
	安信现金管理货币 A	安信现金管理货币 B
基金合同生效日(2013 年 2 月 5 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	120,622,970.32
报告期间申购/买入总份额	173,949.18	281,537,333.31
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	8.90	402,160,303.63

报告期末持有的基金份额	173,940.28	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.32%	-
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
	安信现金管理货币 A	安信现金管理货币 B
基金合同生效日(2013年2月5日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	134,882,914.75
报告期内申购/买入总份额	-	448,820,057.57
报告期内因拆分变动份额	-	-
减:报告期内赎回/卖出总份额	-	463,080,002.00
报告期末持有的基金份额	-	120,622,970.32
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	12.97%

注:本基金管理人运用固有资金投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

#### 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

##### 安信现金管理货币 A

关联方名称	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
安信乾盛财富管理(深圳)有限公司	43,019.25	0.08	-	-

注:本基金其他关联方投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

#### 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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年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	861,644.98	21,609.92	17,753,217.62	97,258.61

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按约定利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

安信现金管理货币 A				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
809,340.85	-	-30.53	809,310.32	-
安信现金管理货币 B				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
6,654,026.80	-	-63,285.78	6,590,741.02	-

#### 7.4.12 期末(2021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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

##### 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

截止至本报告期末，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，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，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无

抵押债券。

#### 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

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部、风险管理部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具包括现金、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、同业存单、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的中期票据、短期融资券、期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购、期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据以及中国证监会和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，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

##### 7.4.13.2 信用风险

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了严格的债券备选池制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在

银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券按摊余成本计价占基金资产净值的比例为 36.68%（2020 年 12 月 31 日：31.02%）。

#### 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	10,011,804.24
A-1 以下	-	-
未评级	4,950,614.83	180,085,321.98
合计	4,950,614.83	190,097,126.22

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

3. 债券投资以净价列示。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	19,953,521.61	278,546,496.51
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	19,953,521.61	278,546,496.51

注：1. 同业存单评级取自第三方评级机构的主体评级。

2. 短期信用评级 A-1 所填列的同业存单均为 AAA 级的同业存单。

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

#### 7.4.13.2.3 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-



未评级	-	229,893,087.66
合计	-	229,893,087.66

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

3. 债券投资以净价列示。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值、份额持有人集中度以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、具有良好流动性的债券和货币市场工具，均在证券交易所或银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。银行存款、结算备付金及债券投资等品种的公允价值均面临在市场利率上升时出现下降的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，采用久期、凸度、VaR（在险价值）等量化风险指标评估基金的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	10,861,644.98	-	-	-	10,861,644.98
结算备付金	650,935.70	-	-	-	650,935.70
存出保证金	11,726.60	-	-	-	11,726.60
交易性金融资产	24,904,136.44	-	-	-	24,904,136.44
买入返售金融资产	18,074,332.11	-	-	-	18,074,332.11
应收利息	-	-	-	24,683.14	24,683.14
应收申购款	-	-	-	38,932.43	38,932.43
资产总计	54,502,775.83	-	-	63,615.57	54,566,391.40
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	22,752.37	22,752.37
应付托管费	-	-	-	6,894.69	6,894.69
应付销售服务费	-	-	-	10,275.49	10,275.49
应付交易费用	-	-	-	16,601.00	16,601.00
应付利润	-	-	-	3,307.34	3,307.34
应交税费	-	-	-	199.03	199.03
其他负债	-	-	-	112,633.33	112,633.33
负债总计	-	-	-	172,663.25	172,663.25
利率敏感度缺口	54,502,775.83	-	-	-109,047.68	54,393,728.15
上年度末 2020 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月 -1 年	1-5 年	不计息	合计
<b>资产</b>					

银行存款	17,753,217.62	-	-	-	17,753,217.62
结算备付金	478,574.84	-	-	-	478,574.84
存出保证金	40,848.73	-	-	-	40,848.73
交易性金融资产	418,615,432.83	279,921,277.56	-	-	698,536,710.39
买入返售金融资产	341,015,316.53	-	-	-	341,015,316.53
应收利息	-	-	-	2,949,239.98	2,949,239.98
应收申购款	-	-	-	361,001.09	361,001.09
资产总计	777,903,390.55	279,921,277.56	-	3,310,241.07	1,061,134,909.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	149.78	149.78
应付管理人报酬	-	-	-	458,897.91	458,897.91
应付托管费	-	-	-	139,059.93	139,059.93
卖出回购金融资产款	129,999,685.00	-	-	-	129,999,685.00
应付销售服务费	-	-	-	22,734.83	22,734.83
应付交易费用	-	-	-	78,534.75	78,534.75
应付利息	-	-	-	7,914.37	7,914.37
应付利润	-	-	-	66,623.65	66,623.65
应交税费	-	-	-	6,530.84	6,530.84
其他负债	-	-	-	212,633.55	212,633.55
负债总计	129,999,685.00	-	-	993,079.61	130,992,764.61
利率敏感度缺口	647,903,705.55	279,921,277.56	-	2,317,161.46	930,142,144.57

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 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		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	9,843.07	654,056.78
	2. 市场利率上升 25 个基点	-9,829.65	-652,694.20

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，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。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无其他价格风险。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

### 7.4.14 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

##### (1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中划分为第二层次的余额为人民币 24,904,136.44 元，无划分为第一层次及第三层次余额（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中划分为第二层次的余额为人民币 698,536,710.39 元，无划分为第一层次及第三层次余额）。

##### 公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

### 第三层次公允价值金额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

(2) 根据《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》(财会〔2017〕7 号)、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》(财会〔2017〕8 号)、《企业会计准则第 24 号—套期会计》(财会〔2017〕9 号)、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(财会〔2017〕14 号)(以上统称新金融工具相关会计准则),以及《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会〔2020〕22 号),自 2022 年 1 月 1 日起,本基金开始执行新金融工具相关会计准则。

#### 7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 3 月 24 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	24,904,136.44	45.64
	其中:债券	24,904,136.44	45.64
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	18,074,332.11	33.12
	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	11,512,580.68	21.10
4	其他各项资产	75,342.17	0.14
5	合计	54,566,391.40	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	-	-
	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	2021年8月2日	25.75	巨额赎回	1个交易日
2	2021年12月7日	26.83	巨额赎回	1个交易日

### 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	30
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	95
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	9

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期末未出现投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

#### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	72.76	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	18.33	-
	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）	9.10	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.20	-

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期末未出现投资组合平均剩余期限超过 240 天的情况。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	4,950,614.83	9.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	19,953,521.61	36.68
8	其他	-	-
9	合计	24,904,136.44	45.78
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

### 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	112110045	21 兴业银行 CD045	100,000	9,980,855.41	18.35
2	112173382	21 杭州银行 CD214	100,000	9,972,666.20	18.33
3	219959	21 贴现国债 59	50,000	4,950,614.83	9.10

### 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1209%
报告期内偏离度的最低值	-0.0720%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0374%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未出现负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

### 8.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.9 投资组合报告附注

#### 8.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在 1.0000 元。

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

报告期内本基金投资的前十名证券除 21 杭州银行 CD214（证券代码：112173382 CY）、21 兴

业银行 CD045（证券代码：112110045 CY）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2021 年 1 月 19 日，杭州银行股份有限公司因涉嫌违反法律法规被中国人民银行杭州中心支行警告，罚款 25 万元【杭银处罚字（2021）6 号】。

2021 年 5 月 24 日，杭州银行股份有限公司因违规经营被浙江银保监局罚款 250 万元【浙银保监罚决字（2021）25 号】。

2021 年 1 月 13 日，兴业银行股份有限公司因违规经营被中国银行保险监督管理委员会消保局协会通报批评【银保监消保发（2021）2 号】。

2021 年 1 月 15 日，兴业银行股份有限公司因未依法履行职责被中国银行间市场交易商协会通报批评、通知整改。

2021 年 7 月 7 日，兴业银行股份有限公司因违规经营被中国银行保险监督管理委员会消保局协会通报批评【银保监消保发（2021）12 号】。

2021 年 7 月 21 日，兴业银行股份有限公司因违规经营被国家外汇管理局福建省分局警告、通知整改、没收违法所得、罚款 300.11 万元【闽汇罚（2021）5 号】。

2021 年 8 月 20 日，兴业银行股份有限公司因违规经营被中国人民银行罚款 5 万元【银罚字（2021）26 号】。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,726.60
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	24,683.14
4	应收申购款	38,932.43
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	75,342.17

### 8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 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 (%)
安信现金管理货币 A	3,924	10,435.24	12,400,294.80	30.28	28,547,593.16	69.72
安信现金管理货币 B	2	6,722,920.10	6,981,274.09	51.92	6,464,566.10	48.08
合计	3,926	13,854.74	19,381,568.89	35.63	35,012,159.26	64.37

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
1	其他机构	6,981,274.09	12.83
2	个人	6,464,566.10	11.88
3	其他机构	3,363,360.30	6.18
4	其他机构	2,923,017.06	5.37
5	其他机构	2,076,764.76	3.82
6	个人	2,061,647.69	3.79
7	其他机构	2,001,348.03	3.68
8	个人	1,099,105.84	2.02
9	个人	1,001,856.12	1.84
10	个人	1,001,856.12	1.84

注：占总份额比例的计算中，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	安信现金管理货币 A	7,146.34	0.02
	安信现金管理货币 B	-	-
	合计	7,146.34	0.01

注：管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式	安信现金管理货币 A	0~10
	安信现金管理货币 B	0

基金		
	合计	0~10
本基金基金经理持有 本开放式基金	安信现金管理货币 A	0
	安信现金管理货币 B	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信现金管理货币 A	安信现金管理货币 B
基金合同生效日（2013 年 2 月 5 日）基金份额总额	1,175,384,651.29	364,870,291.59
本报告期期初基金份额总额	37,467,773.00	892,674,371.57
本报告期基金总申购份额	179,517,641.18	1,989,037,900.95
减：本报告期基金总赎回份额	176,037,526.22	2,868,266,432.33
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	40,947,887.96	13,445,840.19

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

### 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

#### 一、基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于 2021 年 3 月 19 日发布了《2021 年度安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告》，经安信基金管理有限责任公司第四届董事会第五次会议审议通过：自 2021 年 3 月 18 日起，孙晓奇先生担任公司督察长，卸任公司副总经理；乔江晖女士担任公司副总经理，卸任公司督察长。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本年度应支付的审计费为人民币 20,000.00 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

本报告期内本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 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	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	新租
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金管理人制定了《安信基金管理有限责任公司券商交易单元选择标准及佣金分配办法》，对券商交易单元的选择标准和程序进行了规定。本基金管理人将券商路演数量和质量、提供的信息充分性和及时性、系统支持等作为交易单元的选择标准，由权益投资部、研究部、

运营部交易室对券商考评后提出租用及变更方案，最终由公司基金投资决策委员讨论及决定。

### 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	1,385,247,391.04	100.00%	2,187,870,000.00	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

### 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	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-01-22
2	安信基金管理有限责任公司关于调整适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-01-27
3	关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 57 只基金新增中邮证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-02-04
4	关于安信现金管理货币市场基金春节前两个工作日暂停代销渠道申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	证券日报	2021-02-08

5	2021 年度 安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-03-19
6	关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 52 只基金新增泛华普益基金销售有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-03-23
7	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金年度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-03-29
8	关于安信目标收益债券型证券投资基金等 35 只基金新增中国中金财富证券有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-04-06
9	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-04-21
10	关于安信现金管理货币市场基金五一节前两个工作日暂停代销渠道申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	证券日报	2021-04-29
11	安信基金管理有限责任公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-05-20
12	安信基金管理有限责任公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司名义从事诈骗活动的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-06-26
13	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增华融证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-07-15
14	安信基金管理有限责任公司旗下 66 只基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-07-20
15	安信基金管理有限责任公司旗下 69 只基中期报告提示性公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-08-27
16	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增上海利得基金销售有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-09-03
17	安信基金管理有限责任公司关于新增基金直销账户信息的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-09-22
18	安信基金管理有限责任公司关于恢复泰信财富基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-09-22
19	2021 年度 安信现金管理货币市场基金基金经理变更的公告	证券日报	2021-10-20
20	安信基金管理有限责任公司旗下 73 只基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-10-26
21	关于调整安信现金管理货币市场基金代销渠道大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资限额的公告	证券日报	2021-12-23

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210312-20210312;20210419-20210422;20210426-20210719;20210722-20211001;20211014-20211206	120,622,970.32	281,537,333.31	402,000,008.90	160,294.73	0.30
	2	20210101-20210111;20210129-20210302	262,961,436.76	1,470,422.88	264,431,859.64	-	-
	3	20210720-20210720;20210722-20210730	-	66,942,650.13	66,900,000.00	42,650.13	0.08
	4	20210101-20210106	203,701,811.96	845,406.62	204,547,218.58	-	-
	5	20210623-20210629	-	105,000,000.00	105,000,000.00	-	-
	6	20210428-20210526;20210604-20210607;20210609-20210609	-	50,263,312.40	50,263,312.40	-	-
	7	20210604-20210607	2,401,492.58	49,035,957.82	51,437,450.40	-	-
	8	20211221-20211222	-	67,637,599.50	67,637,599.50	-	-
产品特有风险							

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

（1）基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

（2）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

（3）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

（4）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

（5）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

## 12.2 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、中国证监会核准安信现金管理货币市场基金募集的文件；
- 2、《安信现金管理货币市场基金基金合同》；
- 3、《安信现金管理货币市场基金托管协议》；
- 4、《安信现金管理货币市场基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

本基金管理人及基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2022 年 3 月 31 日