

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
报告送出日期：2018年10月26日

1 重要提示

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
报告送出日期：2018年10月26日

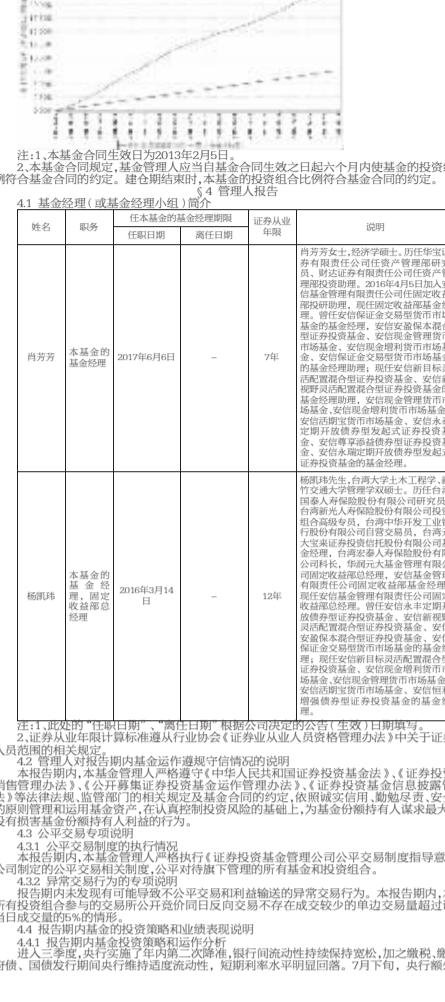
基金管理人、安信基金管理有限责任公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2018年10月26日

安信现金管理货币市场基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期：2018年10月26日

项目	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	④-⑥
过去一个月	0.78%	0.00%	0.30%	0.00%	0.48%	0.00%
过去三个月	0.78%	0.00%	0.30%	0.00%	0.48%	0.00%
过去六个月	0.78%	0.00%	0.30%	0.00%	0.48%	0.00%
过去一年	0.78%	0.00%	0.30%	0.00%	0.48%	0.00%
自基金成立起至今	0.78%	0.00%	0.30%	0.00%	0.48%	0.00%



MLI估值模型对于贷款投放和信用投放,着力度信用投放,短期利率进一步下降,上月10日上调到一个非常宽松的水平,3m存单利率下降30bp,8月中旬降准,地方债发行对短期利率的影响开始显现,虽然央行降准流动性初心的不改,短期利率回到一个适度宽松的牛市,8-9两个月地方债发行持续推出一部分市场流动性,流动性宽松,但短期利率维持在一个特定水平,没有再提高。

由于短期信用类资产收益率,本基金在三季度末增加了短期信用类资产的配置,且在重要时点配置了较高收益的资产,同时利率维持下行,获得了较好的收益。

序号	品种	净值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	银行存款	7,981,349,269.62	80.69
2	其中:国债	7,771,223,076.03	80.63
3	货币市场基金	219,126,193.00	2.17
4	买入返售金融资产	1,044,564,410.63	10.31
5	其中:同业拆借和回购	104,346,727.25	1.03
6	合计	9,246,139,873.25	92.92
7	其他资产	9,692,365,876.00	100.00

5.1 报告期末基金资产组合情况

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末持有的债券投资前五名如下:

序号	品种	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期末持有的国债	10199	10199	
2	报告期末持有的央行票据	14184	14184	

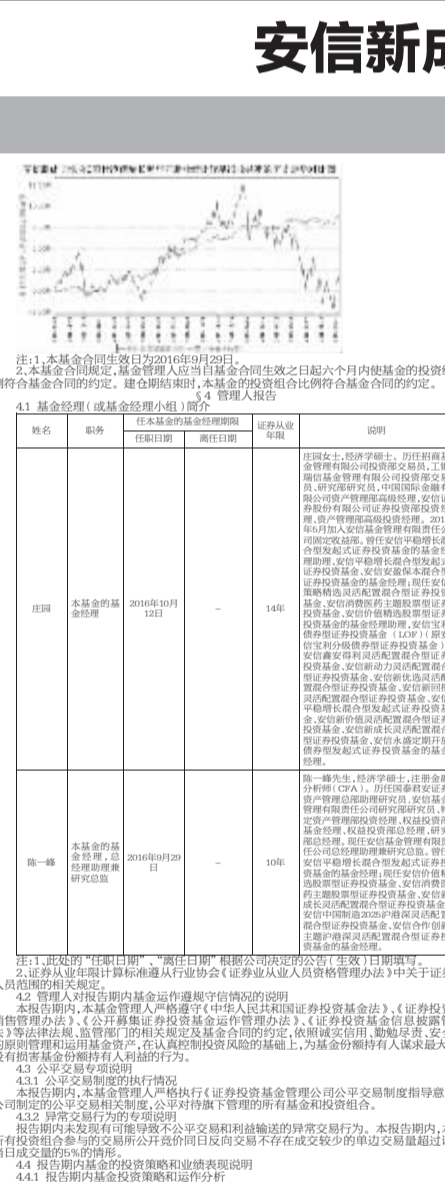
序号	债券品种	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	130227	4,200,000	41.63
2	央行票据	131170386	3,000,000	29.51
3	金融债	131170386	3,000,000	29.51
4	企业债	1309206	2,200,000	21.57
5	国债	131170386	3,000,000	29.51
6	央行票据	131170386	3,000,000	29.51
7	其他	9,771,223,076.03	92.92	
8	合计	328,023,474.63	3.18	

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
报告送出日期：2018年10月26日

1 重要提示

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
报告送出日期：2018年10月26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
报告送出日期：2018年10月26日



三季度,中美贸易摩擦升级,央行货币政策进一步宽松,定降准落地,MLI超预期放,国内经济数据体现出结构性的分化,政策预期有所强化,理财新规细则有所回,“资管新规”细则和资管新规落地,银行理财产品二季度大幅下,利率成本有所缓解,政策预期,市场回暖,以上因素综合作用下,报告期内,该基金净值表现良好,流动性指标保持较好,市场偏好继续升温。

权益方面,三季度市场中股强于小盘,上证指数下跌0.82%,沪深300下跌2.05%,中证500下跌3.22%,行业来看,今年以来休闲服务、银行、食品饮料等行业表现较好,电子、传媒、有色等行业表现较差。

本基金三季度调整了利率债仓位,拉长了持仓久期,同时根据市场情况调整了权益持仓,适当增加了部分基本面优秀的个股持仓。

序号	资产类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	1548	14.84
2	其中:股票	0.96	0.01
3	其中:基金	1547	14.83
4	债券投资	7602	72.86
5	其中:国债	5602	53.31
6	其中:地方政府债	61	0.06
7	其中:央行票据	429	4.13
8	其中:金融债	2110	20.19
9	其中:企业债	2210	21.21
10	其中:可转债	11446	11.04

5.1 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金A类基金份额净值为1.0420元,本报告期基金份额净值增长率为0.64%,截至本报告期末,本基金B类基金份额净值为1.0370元,本报告期基金份额净值增长率为0.58%,同期业绩比较基准收益率为-0.80%。

5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资明细

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	6,058,750.00	1.69
B	制造业	36,750,211.19	6.42
C	房地产业	2,384,752.80	0.41
D	医药、生物、医疗设备	3,348,870.00	0.59
E	金融业	417,200.00	0.07
F	其他行业	1,747,900.00	0.31
G	合计	7,948,513.00	1.59
H	其他资产	4,947,000.00	0.40
M	科学类研究和技术服务	-	-
N	材料、能源和公共基础设施	-	-
O	公用事业、健康和服务相关	-	-
P	消费品	-	-
Q	信息技术	-	-
R	文化、传媒和娱乐	-	-
S	综合	64,211,690.79	11.21

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
报告送出日期：2018年10月26日

1 重要提示

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
报告送出日期：2018年10月26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
报告送出日期：2018年10月26日

项目	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	④-⑥
过去一个月	-1.0%	0.3%	0.0%	0.0%	-0.2%	-0.3%
过去三个月	-1.0%	0.3%	0.0%	0.0%	-0.2%	-0.3%
过去六个月	-1.0%	0.3%	0.0%	0.0%	-0.2%	-0.3%
过去一年	-1.0%	0.3%	0.0%	0.0%	-0.2%	-0.3%
自基金成立起至今	-1.0%	0.3%	0.0%	0.0%	-0.2%	-0.3%



三季度,中美贸易摩擦升级,央行货币政策进一步宽松,定降准落地,MLI超预期放,国内经济数据体现出结构性的分化,政策预期有所强化,理财新规细则有所回,“资管新规”细则和资管新规落地,银行理财产品二季度大幅下,利率成本有所缓解,政策预期,市场回暖,以上因素综合作用下,报告期内,该基金净值表现良好,流动性指标保持较好,市场偏好继续升温。

权益方面,三季度市场中股强于小盘,上证指数下跌0.82%,沪深300下跌2.05%,中证500下跌3.22%,行业来看,今年以来休闲服务、银行、食品饮料等行业表现较好,电子、传媒、有色等行业表现较差。

本基金三季度调整了利率债仓位,拉长了持仓久期,同时根据市场情况调整了权益持仓,适当增加了部分基本面优秀的个股持仓。

序号	资产类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	22,062,743.26	17.88
2	其中:股票	22,062,743.26	17.88
3	其中:基金	-	-
4	债券投资	90,504,880.00	72.30
5	其中:国债	90,504,880.00	72.30
6	其中:央行票据	-	-
7	其中:金融债	-	-
8	其中:企业债	-	-
9	其中:可转债	-	-
10	其他资产	323,363,953.26	259.00

5.1 报告期末基金资产组合情况

截至本报告期末,本基金A类基金份额净值为1.063元,本报告期基金份额净值增长率为-0.91%,截至本报告期末,本基金B类基金份额净值为1.037元,本报告期基金份额净值增长率为-1.00%,同期业绩比较基准收益率为-0.80%。

5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资明细

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	1,428,000.00	1.13
B	制造业	16,464,000.00	12.96
C	房地产业	-	-
D	医药、生物、医疗设备	1,869,000.00	1.49
E	金融业	-	-
F	其他行业	2,268,203.26	1.79
G	合计	6,969,203.26	5.45
H	其他资产	323,363,953.26	259.00
M	科学类研究和技术服务	-	-
N	材料、能源和公共基础设施	-	-
O	公用事业、健康和服务相关	-	-
P	消费品	-	-
Q	信息技术	-	-
R	文化、传媒和娱乐	-	-
S	综合	22,062,743.26	17.88

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
报告送出日期：2018年10月26日

1 重要提示

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
报告送出日期：2018年10月26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
报告送出日期：2018年10月26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
报告送出日期：2018年10月26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
报告送出日期：2018年10月26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
报告送出日期：2018年10月26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
报告送出日期：2018年10月26日