

信息披露 Disclosure

安信现金增利货币市场基金

[2015] 第二季度报告

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月21日

重要提示

基金管理人的董事局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。

基金管理人和基金托管人根据基金合同的约定，于2015年7月17日复核了本报告中的财务数据，本基金净值和份额净值已按期复核。本基金合同约定，定期报告中不包含基金净值，但不保证基金一定盈利。

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定期报告。

本报告期自2015年4月1日起至2015年6月30日止。

2 基金产品概况

基金简称	安信现金增利货币
基金主代码	000750
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年11月24日
报告期末基金份额总额	267,743,670.00

投资目标 在综合考虑基金资产收益性、安全性和流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资人创造稳定的回报。

本基金通过投资于货币市场工具，在保证基金资产净值的20%的说明

注:由于四舍五入的原因,分项数和合计数存在尾差。

5.2 报告期回购股份数量和融资情况

基金份额持有人数和平均净资产额

其中:实盘式回购金额

占基金资产净值比例 (%) 10.74

其中:定期式回购金额

占基金资产净值比例 (%) 0.26

5.3 报告期内回购股份数量和融资余额

占基金资产净值比例 (%) 700,000,000

占基金资产净值比例 (%) 0.26

5.4 报告期内赎回回购股份数额占基金资产净值的比例为报告期内每日赎回余额占基金资产净值比例的简单平均值。

5.5 报告期内回购股份数额超过基金资产净值的20%的说明

注:在报告期初未持有货币市场基金尚未回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.6 基金资产组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目 天数

报告期初投资组合平均剩余期限 168

报告期内投资组合平均剩余期限最高 193

报告期内投资组合平均剩余期限最低 24

报告期初投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

序号 发生日期 平均剩余期限 原因 调整期

1 2015年06月22日 10,000 日定期 1个工作日

注:根据本基金合同的约定,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天。

5.6.2 报告期末组合平均剩余期限超过180天情况说明

序号 发生日期 平均剩余期限 原因 调整期

1 2015年06月22日 10,000 日定期 1个工作日

注:根据本基金合同的约定,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天。

5.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年04月01日-2015年06月30日)

1.本期已实现收益 1,218,330.07

2.本期利润 1,218,330.07

3.期末未分配利润 207,743,670.07

注:本基金实现收益后本期已实现收益、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)等相关费用后的利润,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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① 净值增长② 标准差③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.103% 0.0402% 0.300% 0.0000% 0.0869% 0.0402%

注:1.本基金收益分配为按日盈转份额;

2.本基金业绩比较基准为七天通知存款利率(税后);

3.2.2 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.本基金合同生效日为2014年11月24日。示意图日期为2014年11月24日至2015年6月30日。

2.本基金的建仓期为2014年11月24日至2015年6月23日,建仓期结束时,本基金各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

张翼飞 本基金的基金经理 2014年11月24日 4.5

注:1.此处的任职日期为本基金合同生效日;

2.证券从业年限计算遵从行业协会《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;

3.本基金的基金经理遵照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售机构内部控制指引》、《证券投资基金销售适用性指导意见》、《证券投资基金评价方法》等法律法规的规定以及基金合同的约定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理并运用基金资产,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 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金的公平交易执行《证券投资基金销售机构公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度,公平对待所有客户。

4.4 报告期内基金的估值政策和程序

2015年第3季度,中短债券二级市场价格行情,长端债券呈现波动态势,期限利差较显著,主要是因为期限利差降低,但是市场价格对宽松货币政策实行一段时间后,通胀率的走势有些扰动。我们在第2季度对信用债配置仓位较高,但是由于信用上采取了较为保守的策略,在获取票息收益的同时,也取得了一定的资本利得收益,从而获得较高的收益,整个季度表现良好,整体保持了比较平稳的涨幅。

4.5 报告期内基金的绩效指标

截至2015年6月30日,本报告期内本基金净值增长率为1.103%,期间比较基准收益率为0.336%,净值增长率为0.103%,期间收益率超出了0.095%。

4.6 报告期内基金净值增长率偏离度情况

本报告期内,本基金净值增长率偏离度始终在规定的范围内。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年第3季度,中短债券二级市场价格行情,长端债券呈现波动态势,期限利差较显著,主要是因为期限利差降低,但是市场价格对宽松货币政策实行一段时间后,通胀率的走势有些扰动。我们在第2季度对信用债配置仓位较高,但是由于信用上采取了较为保守的策略,在获取票息收益的同时,也取得了一定的资本利得收益,从而获得较高的收益,整个季度表现良好,整体保持了比较平稳的涨幅。

4.8 其他资产构成

本报告期内,本基金无其他资产。

4.9 报告期内基金的估值政策和程序

2015年第3季度,中短债券二级市场价格行情,长端债券呈现波动态势,期限利差较显著,主要是因为期限利差降低,但是市场价格对宽松货币政策实行一段时间后,通胀率的走势有些扰动。我们在第2季度对信用债配置仓位较高,但是由于信用上采取了较为保守的策略,在获取票息收益的同时,也取得了一定的资本利得收益,从而获得较高的收益,整个季度表现良好,整体保持了比较平稳的涨幅。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年04月01日-2015年06月30日)

1.本期已实现收益 123,716,019.39

2.本期利润 126,330,993.06

3.期末未分配利润 0.0377

4.期末基金份额净值 7,486,919,119.02

5.6 期末基金资产净值 1.103%

注:所列基金收益指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低

于所列数字;

2.本期已实现收益指本基金利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的金额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.基金净值表现

3.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① 净值增长② 标准差③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去六个月 0.30% 0.15% 1.20% 0.00% 2.60% 0.14%

注:业绩比较基准收益率=一年期人民币定期存款基准利率+3.00%。

3.2.2 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.本基金合同生效日为2014年11月24日。示意图日期为2014年11月24日至2015年6月30日。

2.本基金的建仓期为2014年11月24日至2015年6月23日,建仓期结束时,本基金各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

4. 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

张翼飞 本基金的基金经理 2014年11月24日 4.5

注:1.此处的任职日期为本基金合同生效日;

2.证券从业年限计算遵从行业协会《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;

3.本基金的基金经理遵照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售机构内部控制指引》、《证券投资基金销售适用性指导意见》、《证券投资基金评价方法》等法律法规的规定以及基金合同的约定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理并运用基金资产,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 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金的公平交易执行《证券投资基金销售机构公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度,公平对待所有客户。

4.4 报告期内基金的估值政策和程序

2015年第3季度,中短债券二级市场价格行情,长端债券呈现波动态势,期限利差较显著,主要是因为期限利差降低,但是市场价格对宽松货币政策实行一段时间后,通胀率的走势有些扰动。我们在第2季度对信用债配置仓位较高,但是由于信用上采取了较为保守的策略,在获取票息收益的同时,也取得了一定的资本利得收益,从而获得较高的收益,整个季度表现良好,整体保持了比较平稳的涨幅。

4.5 报告期内基金的业绩表现

传统投资品种,结合宏观环境、市场价格及行业走势的简单展望。

4.6 报告期内基金的估值政策和操作原则

在策略上,我们侧重于个股的精选炒作,侧重于等待市场的风险溢价,成长空间大的好公司成为我们下一阶段的主要投资策略,具体行业方面,我们将继续重点关注与转型升级以及创业板创新相关的投资方向,诸如:工业4.0、人工智能、精准医疗、互联网金融等领域。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年04月01日-2015年06月30日)

1.本期已实现收益 123,716,019.39

2.本期利润 126,330,993.06

3.期末未分配利润 0.0377

4.期末基金份额净值 7,486,919,119.02

5.6 期末基金资产净值 1.103%

注:所列基金收益指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低

于所列数字;

2.本期已实现收益指本基金利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的金额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.基金净值表现

3.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① 净值增长② 标准差③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-