

安信现金增利货币市场基金

[2015]第四季度报告

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:2016年1月20日

§ 1 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年1月18日复核了本报告中的财务数据、净值表现和投资组合报告等內容，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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称 安信现金增利货币

交易代码 000750

基金运作方式 约定型开放式

基金经理孙晓东 2014年11月24日

报告期末基金份额总额 194,887,513.07份

投资目标 在综合考虑货币资金吸收效率、安全性及流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资人创造良好的收益。

本基金通过对国内市场的货币基金、利率汇率、通胀预期、GDP增长、就业率变化以及国际市场利率水平等宏观经济指标的跟踪分析，形成对宏观经济的判断，同时，结合对央行公开市场操作、货币市场的动态变化对短期利率走势进行综合判断，基于对货币市场的判断对投资组合进行动态调整，决定是否调整投资组合平均剩余期限比例配置。

基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)

1.本期已实现收益 1,214,226.03

2.本期利润 1,214,226.03

3.期末未分配利润 194,887,513.07

注:1.本期各项收益指基金本期已实现收入、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本期报告期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

单位:人民币元

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率②

① -0.40% 0.50% ② -0.40% 0.50%

③ 0.0000% 0.0000% ④ 0.0014%

注:1.本基金收益分配为按日结转份额的方式。

2.本期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收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

基金名称 安信现金增利货币市场基金

基金简称 安信现金增利货币

基金运作方式 约定型开放式

基金经理 孙晓东 2014年11月24日

报告期末基金份额总额 230,646,769.63份

注:1.本基金基金合同生效日为2014年11月24日。图示日期为2014年11月24日至2015年12月31日。

2.本基金的建仓期为2014年11月24日至2015年12月31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间 证券从业年限 说明

任期日期 离任日期

张翼飞 基金经理 2014年11月24日 - 4.05

注:1.此处的任职日期为本基金合同生效日。

2.证券从业人员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的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金管理暂行办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规、监管机构的相关规定及基金合同的约定，依法规范运作，勤勉尽责，安全高效的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 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易制度，公平对待所有客户，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金报告期内，基金管理人严格按照《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管理暂行办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规、监管机构的相关规定及基金合同的约定，依法规范运作，勤勉尽责，安全高效的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。

4.5 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易制度，公平对待所有客户，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.6 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金报告期内，基金管理人严格按照《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管理暂行办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规、监管机构的相关规定及基金合同的约定，依法规范运作，勤勉尽责，安全高效的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。

4.7 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易制度，公平对待所有客户，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.8 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金报告期内，基金管理人严格按照《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管理暂行办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规、监管机构的相关规定及基金合同的约定，依法规范运作，勤勉尽责，安全高效的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。

4.9 投资组合报告

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位:人民币元

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例(%)

1 固定收益投资 123,804,669.02 58.01

其中:债券 - 123,804,669.02 58.01

2 买入返售金融资产 - 0.00

其中:买断式回购 - 0.00

3 衍生工具 - 0.00

4 其他资产 2,042,010.06 0.09

5 合计 125,846,681.08 100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

注:1.本基金基金合同生效日为2015年10月1日起至12月31日止。

2.证券从业人员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的相关规定。

3.2.1 本期报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率②

① 10.89% 0.96% ② 10.08% 0.81% -0.02%

注:1.本基金收益指基金本期已实现收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣减相关费用后的余额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.2 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

单位:人民币元

基金名称 安信现金增利货币市场基金

基金简称 安信现金增利货币

基金运作方式 约定型开放式

基金经理 孙晓东 2014年11月24日

报告期末基金份额总额 194,887,513.07份

注:1.本基金基金合同生效日为2014年11月24日。图示日期为2014年11月24日至2015年12月31日。

2.本基金的建仓期为2014年11月24日至2015年12月31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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额 148,900,001.36

报告期期初基金总份额 1,617,224,578.93

减:报告期赎回基金份额 1,517,397,067.22

报告期期末基金份额总额 194,887,513.07份

注:1.本基金份额净值变动情况见附录四“基金净值变动情况”。

2.本基金的建仓期为2014年11月24日至2015年12月31日，本报告期内基金净值变动情况见附录四“基金净值变动情况”。

3.2.3 本期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

单位:人民币元

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率②

① 1.214,226.03 0.0000% ② 1.214,226.03 0.0000%

注:1.本基金收益指基金本期已实现收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣减相关费用后的余额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.4 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

单位:人民币元

基金名称 安信现金增利货币市场基金

基金简称 安信现金增利货币

基金运作方式 约定型开放式

基金经理 孙晓东 2014年11月24日

报告期末基金份额总额 194,887,513.07份

注:1.本基金基金合同生效日为2014年11月24日。图示日期为2014年11月24日至2015年12月31日。

2.本基金的建仓期为2014年11月24日至2015年12月31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。

§ 7 备查文件

§ 8 影响投资者决策的重要因素

§ 9 备查文件目录

§ 10 其他需要披露的重大信息

§ 11 其他

§ 12 其他

§ 13 其他

§ 14 其他

§ 15 其他

§ 16 其他

§ 17 其他

§ 18 其他

§ 19 其他

§ 20 其他

§ 21 其他

§ 22 其他

§ 23 其他

§ 24 其他

§ 25 其他

§ 26 其他

§ 27 其他

§ 28 其他

§ 29 其他

§ 30 其他

§ 31 其他

§ 32 其他

§ 33 其他

§ 34 其他

§ 35 其他

§ 36 其他

§ 37 其他

§ 38 其他

§ 39 其他

§ 40 其他

§ 41 其他

§ 42 其他

§ 43 其他

§ 44 其他

§ 45 其他

§ 46 其他

§ 47 其他

§ 48 其他

§ 49 其他

§ 50 其他

§ 51 其他

§ 52 其他

§ 53 其他

§ 54 其他