安信现金增利货币市场基金 2018年半年度报告摘要

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
送出日期:2018年08月29日

§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。本半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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月28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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	
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	
报告期末基金份额总额	128,442,847.43份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信现金增利货币A	安信现金增利货币B
下属分级基金的交易代码	000750	003539
报告期末下属分级基金的份额总额	128,442,847.43份	0.00份

2.2 基金产品说明

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收益。
投资策略	本基金通过对国内市场资金供求、利率水平、通货膨胀率、GDP增长率、就业率水平以及国际市场利率水平等宏观经济指标的跟踪和分析,形成对宏观层面的判断。同时,结合对央行公开市场操作、债券供给等情况,对短期利率走势进行综合判断。基于对货币市场利率趋势变化的合理预测,决定并动态调整投资组合平均剩余期限和比例分布。 在个券选择策略方面,本基金首先考虑安全性因素,优先选择国债、央行票据等高信用等级的债券品种以规避信用风险。运用套利策略以实现较高收益。同时,本基金作为现金管理工具,对资产保持较高的流动性。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江晖	贺倩
	联系电话	0755-82509999	010-66060069
	电子邮箱	service@essencefund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008-088-088	95599
传真		0755-82799292	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)	
	安信现金增利货币A	安信现金增利货币B
本期已实现收益	3,730,315.20	70,269.61
本期利润	3,730,315.20	70,269.61
本期净值收益率	1.7634%	1.7677%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末基金资产净值	128,442,847.43	–
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

3、本基金收益分配为按日结转份额。

4、根据我公司2016年10月17日《关于安信现金增利货币市场基金增加B类份额并修改基金合同的公告》,自2016年10月17日起,本基金增加B类份额。

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

安信现金增利货币A

阶段	份额净值收益率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.3178%	0.0056%	0.1110%	0.0000%	0.2068%	0.0056%
过去三个月	0.8518%	0.0033%	0.3366%	0.0000%	0.5152%	0.0033%
过去六个月	1.7634%	0.0037%	0.6695%	0.0000%	1.0939%	0.0037%
过去一年	3.7351%	0.0031%	1.3500%	0.0000%	2.3851%	0.0031%
过去三年	9.7206%	0.0094%	4.0537%	0.0000%	5.6669%	0.0094%
自基金合同生效起至今	12.7807%	0.0169%	4.8637%	0.0000%	7.9170%	0.0169%

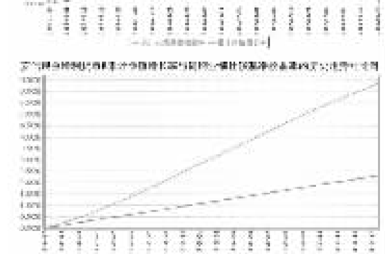
安信现金增利货币B

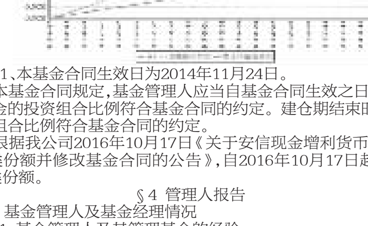
阶段	份额净值收益率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3178%	0.0056%	0.1110%	0.0000%	0.2068%	0.0056%
过去三个月	0.8518%	0.0033%	0.3366%	0.0000%	0.5152%	0.0033%
过去六个月	1.7677%	0.0037%	0.6695%	0.0000%	1.0982%	0.0037%
过去一年	3.8394%	0.0032%	1.3500%	0.0000%	2.4894%	0.0032%
自基金合同生效起至今	6.3795%	0.0028%	2.3005%	0.0000%	4.0790%	0.0028%

注:1、根据《安信现金增利货币市场基金基金合同》的约定,本基金的业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(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可支取的存款,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。本基金为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资范围、投资目标及流动性特征,选取同期七天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

2、报告期内无B类份额时,净值收益率数据参照A类份额计算。

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





注:1、本基金合同生效日为2014年11月24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、根据我公司2016年10月17日《关于安信现金增利货币市场基金增加B类份额并修改基金合同的公告》,自2016年10月17日起,本基金增加B类份额。

§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2018年6月30日,本基金管理人共管理42只开放式基金,具体如下:从2012年6月20日起管理安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金;从2012年9月25日起管理安信目标收益债券型证券投资基金;从2012年12月18日起管理安信平稳增长混合型发起式证券投资基金;从2013年2月5日起管理安信现金管理货币市场基金;从2013年7月24日起管理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);从2013年11月8日起管理安信永利信用定期开放债券型证券投资基金;从2013年12月31日起管理安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金;从2014年4月21日起管理安信价值精选股票型证券投资基金;从2014年11月24日起管理安信现金增利货币市场基金;从2015年3月19日起管理安信消费医药主题股票型证券投资基金;从2015年4月15日起管理安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金;从2015年5月14日起管理安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金;从2015年5月20日起管理安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金;从2015年5月25日起管理安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金;从2015年6月5日起管理安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金;从2015年8月7日起管理安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金;从2015年11月24日起管理安信新动力灵活配置混合型证券投资基金;从2016年3月9日至2018年5月28日管理安信安盈保本混合型证券投资基金;从2016年5月9日起管理安信新回报灵活配置混合型证券投资基金;从2016年7月28日起管理安信新优选灵活配置混合型证券投资基金;从2016年8月9日起管理安信新目标灵活配置混合型证券投资基金;从2016年8月19日起管理安信新价值灵活配置混合型证券投资基金;从2016年9月9日起管理安信保证金交易型货币市场基金;从2016年9月29日起管理安信新成长灵活配置混合型证券投资基金;从2016年9月29日起管理安信尊享纯债债券型证券投资基金;从2016年10月10日起管理安信永丰定期开放债券型证券投资基金;从2016年10月12日起管理安信沪深300指数增强型发起式证券投资基金;从2016年10月17日起管理安信活期宝货币市场基金;从2016年12月9日起管理安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金;从2016年12月19日起管理安信新视野灵活配置混合型证券投资基金;从2017年1月13日至2018年6月11日管理安信永鑫定期开放债券型证券投资基金;从2017年3月16日起管理安信新起点灵活配置混合型证券投资基金;从2017年3月16日起管理安信中国制造2025沪港深灵活配置混合型证券投资基金;从2017年3月29日起管理安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金;从2017年7月3日起管理安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金;从2017年7月20日起管理安信工业4.0主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金;从2017年12月6日起管理安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式基金;从2017年12月28日起管理安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金从2018年3月14日起管理安信尊享添益债券型证券投资基金;从2018年3月21日起管理安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金;从2018年3月30日起管理安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金;从2018年6月1日起管理安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金;从2018年6月12日起管理安信永鑫增强债券型证券投资基金;2018年6月21日起管理安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
杨凯玮	本基金的基金经理,固定收益部总经理	2016年3月8日	–	12.0	杨凯玮先生,台湾大学土木工程学、新竹交通大学管理学双硕士。历任台湾国泰人寿保险股份有限公司研究员,台湾新光人寿保险股份有限公司投资组合高级专员,台湾中华开发工业银行股份有限公司自营交易员,台湾元大宝来证券投资信托股份有限公司基金经理,台湾宏泰人寿保险股份有限公司科长,华润元大基金管理有限公司固定收益部总经理,安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部总经理。曾任安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信新视野灵活配置混合型证券投资基金、安信安盈保本混合型证券投资基金的基金经理;现任安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信活期宝货币市场基金、安信现金管理货币市场基金、安信保证金交易型货币市场基金的基金经理。
肖芳芳	本基金的基金经理	2017年6月6日	–	7.0	肖芳芳女士,经济学硕士。历任华宝证券有限责任公司任资产管理部研究员、财达证券有限责任公司任资产管理部投资助理。2016年4月5日加入安信基金管理有限责任公司任固定收益部投研助理。现任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的基金经理助理。现任安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、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、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。
徐越	本基金的基金经理助理	2016年4月11日	–	3.0	徐越女士,文学硕士。历任安信基金管理有限责任公司交易员,现任安信基金管理有限责任公司固定收益部研究员。曾任安信安盈保本混合型证券投资基金的基金经理助理,现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、安信保证金交易型证券投资基金、安信活期宝证券投资基金的基金的基金经理助理。
任凭	本基金的基金经理助理	2017年5月15日	–	11.0	任凭女士,法学硕士。曾任招商基金管理有限公司法律合规部法务经理、安信基金管理有限责任公司监察稽核部合规岗、运营部交易员,现任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、安信新视野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、安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金的基金经理助理。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《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》、《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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

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

2018年上半年,投资增速小幅回落、出口增速由于贸易战抢跑效应维持高位,消费增速略有下降,融资数据在年初开门红后由于非标增速的快速回落而受到拖累,人民币对美元先升后贬。在去杠杆对经济的拖累效应逐渐显现的背景下,央行在4月17日宣布了降准,落地的监管政策也较征求意见稿有所放松,央行公开市场操作也趋于温和。上半年shibor3m仍然维持了原来季节性波动,整体逐渐走低。本基金把握住重要时点,配置了较高收益的资产,并适量进行了杠杆操作,获得了较好的收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金A类份额净值收益率为1.7634%;截至本报告期末本基金B类份额净值收益率为1.7677%;同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,我们认为,经济可能将进一步温和走弱,但市场已经充分预期,由于经济下滑的压力,货币政策边际上不会收紧,甚至可能进一步放松,监管政策也有可能出现放松。我们认为资金面宽松和资金利率中枢下降是大概率事件,将在合适的时机适当拉长组合久期。

4.6 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副总经理担任,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、信用研究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、研究部及信用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;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央国债登记结算有限责任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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规及《基金合同》的约定,本基金根据每日基金收益情况,以各类基金份额的每万份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,并每日结转份额。本报告期内,本基金实施利润分配的金额为3,800,584.81元,其中本基金A类共分配人民币3,730,315.20元,B类共分配人民币70,269.61元,不存在应分配但尚未实施分配的情况。

4.8 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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—安信基金管理有限责任公司2018年1月1日至2018年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,安信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,安信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:安信现金增利货币市场基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	32,173,046.85	1,330,221.93
结算备付金	–	–
存出保证金	–	–
交易性金融资产	116,157,774.75	213,396,605.55
其中:股票投资	–	–
基金投资	–	–
债券投资	116,157,774.75	209,094,469.19
资产支持证券投资	–	4,302,136.36
贵金属投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	19,158,268.74	–
应收证券清算款	–	–
应收利息	632,895.13	2,725,048.33
应收股利	–	–
应收申购款	–	–
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	168,121,985.47	217,451,875.81
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:		
短期借款	–	–
交易性金融负债	–	–
衍生金融负债	–	–
卖出回购金融资产款	39,359,660.32	15,009,857.48
应付证券清算款	–	–
应付赎回款	–	–
应付管理人报酬	58,437.65	225,345.35
应付托管费	14,166.70	54,629.18
应付销售服务费	35,416.75	37,190.69
应付交易费用	12,814.02	40,985.83
应交税费	2,568.73	–
应付利息	7,774.96	5,041.68
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	188,298.91	270,338.75
负债合计	39,679,138.04	15,643,388.96
所有者权益:		
实收基金	128,442,847.43	201,808,486.85
未分配利润	–	–
所有者权益合计	128,442,847.43	201,808,486.85
负债和所有者权益总计	168,121,985.47	217,451,875.81

注:报告期截止日2018年6月30日,本基金A类基金份额净值1.0000元,本基金B类基金份额净值1.0000元,本基金份额总额128,442,847.43份,其中A类基金份额128,442,847.43份,B类基金无份额。

6.2 利润表

会计主体:安信现金增利货币市场基金

本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年6月30日
一、收入	4,843,073.36	49,279,957.23
1.利息收入	4,781,805.50	49,157,422.20
其中:存款利息收入	610,736.92	4,539,343.84
债券利息收入	3,391,218.40	37,886,490.31
资产支持证券利息收入	22,199.37	874,170.93
买入返售金融资产收入	757,650.81	5,857,417.12
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)	61,267.86	122,535.03
其中:股票投资收益	–	–
基金投资收益	–	–
债券投资收益	61,328.80	94,080.18
资产支持证券投资收益	-60.94	28,454.85
贵金属投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	–	–
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	–	–
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)	–	–
减:二、费用	1,042,488.55	8,507,641.73
1. 管理人报酬	360,447.69	3,606,735.38
2. 托管费	87,492.67	874,360.02
3. 销售服务费	214,407.60	289,401.13
4. 交易费用	200.00	–
5. 利息支出	158,208.51	3,503,298.39
其中:卖出回购金融资产支出	158,208.51	3,503,298.39
6. 税金及附加	1,118.31	–
7. 其他费用	220,613.77	233,846.81
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	3,800,584.81	40,772,315.50
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	3,800,584.81	40,772,315.50

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:安信现金增利货币市场基金

本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30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)	201,808,486.85	–	201,808,486.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	3,800,584.81	3,800,584.81
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)	-73,365,639.42	–	-73,365,639.42
其中:1.基金申购款	3,024,474,903.74	–	3,024,474,903.74
2.基金赎回款	-3,097,840,543.16	–	-3,097,840,543.16
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)	–	-3,800,584.81	-3,800,584.81
五、期末所有者权益(基金净值)	128,442,847.43	–	128,442,847.43

项目	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年6月30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)	3,042,656,458.67	–	3,042,656,458.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	40,772,315.50	40,772,315.50
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)	-1,205,194,300.20	–	-1,205,194,300.20
其中:1.基金申购款	4,173,258,245.18	–	4,173,258,245.18
2.基金赎回款	-5,378,452,545.38	–	-5,378,452,545.38
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)	–	-40,772,315.50	-40,772,315.50
五、期末所有者权益(基金净值)	1,837,462,158.47	–	1,837,462,158.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

安信现金增利货币市场基金(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")2014年7月15日下发的证监许可[2014]704号文《关于核准安信现金增利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《安信现金增利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2014年11月10日至2014年11月20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(2014)验字60962175_H50号验资报告。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币208,436,595.42元。经向中国证监会备案,《安信现金增利货币市场基金基金合同》于2014年11月24日正式生效。截至2014年11月24日止,安信现金增利货币市场基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币208,436,595.42元,折合208,436,595.42份基金份额;有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币14,154.42元,折合14,154.42份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币208,450,749.84元,折合208,450,749.84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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同的有关规定,经基金管理人安信基金管理有限责任公司与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致,本基金自2016年10月17日起增加B类份额。本基金根据赎回费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。从本类别基金资产中计提销售服务费年费率为0.20%的,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费年费率为0.01%的,称为B类基金份额。两类份额向投资者不收取赎回费。两类基金份额单独设置基金代码,并分别计算基金份额净值。原有的基金份额全部自动转为安信现金增利货币市场基金A类份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金合同的有关规定,本基金的投资范围包括现金,通知存款,短期融资券,一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单,剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,资产支持证券、以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具(但须符合中国证监会的规定)。本基金投资组合的平均剩余到期期限不得超过120天。

本基金的业绩比较基准:七天通知存款利率(税后)。

6.4.2 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》、《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〈年度报告和半年度报告〉》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。

6.4.3 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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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。

6.4.6 税项

6.4.6.1 企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

6.4.6.2 增值税

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]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。

6.4.6.3 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20%的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司(以下简称"安信基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(以下简称"中国农业银行")	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司(以下简称"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
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	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
安信乾盛财富管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注:1)本基金管理人于2013年12月2日设立了全资子公司安信乾盛财富管理(深圳)有限公司。

2) 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	360,447.69	3,606,735.38
其中:支付销售机构的客户维护费	202,854.21	186,134.55

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.33%的年费率逐日计提。计算方法如下:

H=E×0.33%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	87,492.67	874,360.02

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.08%的年费率逐日计提。计算方法如下:

H=E×0.08%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.3 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 2018年1月1日 至 2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信现金增利货币A	安信现金增利货币B	合计
安信基金	11,306.14	226.81	11,532.95
安信证券	202,854.21	–	202,854.21
合计	214,160.35	226.81	214,387.16
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信现金增利货币A	安信现金增利货币B	合计
安信基金	3,420.90	99,798.51	103,219.41
安信证券	186,134.55	–	186,134.55
合计	189,555.45	99,798.51	289,353.96

注:基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别,适用不同的销售服务费率。其中,安信现金增利A类基金份额销售服务费年费率为0.20%,B类基金份额销售服务费年费率为0.01%。

本基金A类基金份额销售服务费计提的计算方法分别如下:

H=E×0.20%/当年天数

H为A类基金份额每日应计提的销售服务费

E为A类基金份额前一日的基金资产净值

本基金B类基金份额销售服务费计提的计算方法分别如下:

H=E×0.01%/当年天数

H为B类基金份额每日应计提的销售服务费

E为B类基金份额前一日的基金资产净值

6.4.8.3 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均未发生通过与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)的交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.8.5 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 2018年1月1日 至 2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	2,173,046.85	19,743.28	4,867,109.16	37,885.32

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按约定利率计息。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 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其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 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暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末,本基金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为39,359,660.32元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
111810263	18兴业银行CD263	2018-07-02	99.20	120,000	11,903,796.21
111811079	18平安银行CD079	2018-07-02	99.04	100,000	9,904,380.82
111898916	18徽商银行CD087	2018-07-02	99.11	200,000	19,821,324.55
合计				420,000	41,629,501.58

6.4.9.3.2 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 投资组合报告

7.1 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	116,157,774.75	69.09
	其中:债券	116,157,774.75	69.09
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	19,158,268.74	11.40
	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	32,173,046.85	19.14
4	其他各项资产	632,895.13	0.38
5	合计	168,121,985.47	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		4.61
	其中:买断式回购融资		–
2	报告期末债券回购融资余额	39,359,660.32	30.64
	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个交易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	2018-03-30	24.08	巨额赎回	2个工作日
2	2018-03-31	24.07	巨额赎回	1个工作日
3	2018-04-02	22.52	巨额赎回	1个工作日
4	2018-05-31	23.66	巨额赎回	1个工作日
5	2018-06-29	30.65	巨额赎回	1个工作日
6	2018-06-30	30.64	巨额赎回	1个工作日

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	67
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	77
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	13

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金报告期内投资组合平均剩余期限未出现超过120天的情况。

7.3.2 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	25.95	30.64
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	–	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	96.73	–
	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)	7.72	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	130.40	30.64

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未出现超过240天的情况。

7.5 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	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	21,919,167.80	17.07
	其中:政策性金融债	21,919,167.80	17.07
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	4,999,437.29	3.89
6	中期票据	–	–
7	同业存单	89,239,169.66	69.48
8	其他	–	–
9	合计	116,157,774.75	90.44
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

7.6 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: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	111809171	18浦发银行CD171	200,000	19,839,674.52	15.45
2	111810263	18兴业银行CD263	200,000	19,839,660.35	15.45
3	111820124	18广发银行CD124	200,000	19,834,129.42	15.44
4	111898916	18徽商银行CD087	200,000	19,821,324.55	15.43
5	170207	17国开07	100,000	9,999,617.30	7.79
6	160208	16国开08	100,000	9,918,687.49	7.72
7	111811079	18平安银行CD079	100,000	9,904,380.82	7.71
8	071800018	18中信CP005BC	50,000	4,999,437.29	3.89
9	170410	17农发10	20,000	2,000,863.01	1.56

7.7 "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	–
报告期内偏离度的最高值	0.1341%
报告期内偏离度的最低值	0.0068%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0558%

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。

7.8 期末按公允价值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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

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。

7.9.2

本基金投资的前十名证券的发行主体除18浦发银行CD171(证券代码:111809171 CY,对应上市公司为浦发银行,股票代码:600000)、18中信CP005BC(证券代码:071800018 CY,对应上市公司为中信证券,股票代码:600030)、18兴业银行CD263(证券代码:111810263 CY,对应上市公司为兴业银行,股票代码:601166),本期没有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。

上海浦东发展银行股份有限公司成都分行于2018年1月19日收到中国银行业监督管理委员会四川监管局(以下简称"银监会四川监管局")行政处罚决定书(川银监罚字【2018】2号)。因内控管理严重失效,授信管理违规,违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为于2018年1月18日被银监会四川监管局给予行政处罚。

中信证券股份有限公司于2018年5月25日收到中国证监会《行政处罚事先告知书》(处罚字[2017]57号),因违规对司度(上海)贸易有限公司提供融资融券服务,被证监会给予警告,没收违法所得人民币61,655,849.78元,并处人民币308,279,248.90元罚款。

兴业银行股份有限公司于2018年4月19日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书(银保监银罚决字(2018)1号),因重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告,内控管理严重违反审慎经营规则,非真实转让信贷资产,个人理财资金违规投资等十二项违规行为,被罚款5870万元。

基金管理人对上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.9.3 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	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	632,895.13
4	应收申购款	–
5	其他应收款	–
6	其他	–
7	合计	632,895.13

7.9.4 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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 持有份额	占总份额比例(%)	个人投资者 持有份额	占总份额比例(%)
安信现金增利货币A	1,437	89,382.64	48,479.37	0.04	128,394,368.06	99.96
安信现金增利货币B	–	–	–	–	–	–
合计	1,437	89,382.64	48,479.37	0.04	128,394,368.06	99.96

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)。

8.2 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	个人	14,885,358.38	11.59
2	个人	12,117,457.41	9.43
3	个人	5,996,867.93	4.67
4	个人	2,917,691.90	2.27
5	个人	2,680,394.06	2.09
6	个人	2,633,943.20	2.05
7	个人	1,889,596.75	1.47
8	个人	1,781,506.33	1.39
9	个人	1,734,040.78	1.35
10	个人	1,425,278.76	1.11

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)。

8.3 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	安信现金增利货币A	13,868.24	0.0108
	安信现金增利货币B	–	–
	合计	13,868.24	0.0108

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)。

8.4 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	安信现金增利货币A	0~10
	安信现金增利货币B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	安信现金增利货币A	0
	安信现金增利货币B	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	安信现金增利货币A	安信现金增利货币B
基金合同生效日(2014年11月24日)基金份额总额	208,515,201.19	–
本报告期期初基金份额总额	101,048,815.71	100,759,671.14
本报告期基金总申购份额	3,007,404,472.13	17,070,431.61
减:本报告期基金总赎回份额	2,980,010,440.41	117,830,102.75
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	128,442,847.43	–

§10 重大事件揭示

10.1 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。

–

10.2 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

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

–

10.3 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。

–

10.4 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。

–

10.5 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。

–

10.6 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和托管人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。

–

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
安信证券	2	–	–	–	–	–
海通证券	2	–	–	–	–	–
招商证券	2	–	–	–	–	–
东吴证券	2	–	–	–	–	–
兴业证券	2	–	–	–	–	–
国信证券	2	–	–	–	–	–
中信证券	2	–	–	–	–	–
光大证券	2	–	–	–	–	新增
中投证券	2	–	–	–	–	新增

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。

10.7.2 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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
东吴证券	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–
中投证券	–	–	–	–	–	–

10.8 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 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比(%)
机构	1	20180101-20180105	100,731,035.62	94,477.82	100,825,513.44	–	–

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份额的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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

安信基金管理有限责任公司

2018年08月29日