安信现金管理货币市场基金 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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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06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	6,786,896,327.25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	195,867,081.66份	6,591,029,245.59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	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。 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。 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。 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。 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。
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
信息披露负责人	姓名	乔江辉	田青
	联系电话	0755-82509999	010-67595096
	电子邮箱	service@essencefund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008-088-088	010-67595096
传真		0755-82799292	010-66275853

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)	
	安信现金管理货币A	安信现金管理货币B
本期已实现收益	4,285,177.46	140,185,305.07
本期利润	4,285,177.46	140,185,305.07
本期净值收益率	1.9673%	2.0897%
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	195,867,081.66	6,591,029,245.59
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。

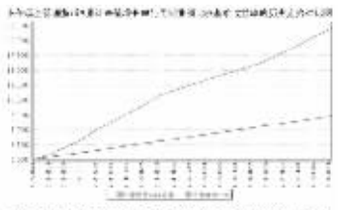
3.2 基金净值表现

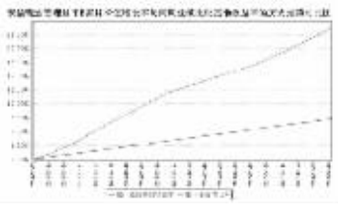
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.3278%	0.0020%	0.1110%	0.0000%	0.2168%	0.0020%
过去三个月	0.9427%	0.0013%	0.3366%	0.0000%	0.6061%	0.0013%
过去六个月	1.9673%	0.0013%	0.6695%	0.0000%	1.2978%	0.0013%
过去一年	3.9553%	0.0019%	1.3500%	0.0000%	2.6053%	0.0019%
过去三年	9.8908%	0.0037%	4.0537%	0.0000%	5.8371%	0.0037%
自基金合同生效起至今	22.0725%	0.0074%	7.2937%	0.0000%	14.7788%	0.0074%
安信现金管理货币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	0.3477%	0.0020%	0.1110%	0.0000%	0.2367%	0.0020%
过去三个月	1.0031%	0.0013%	0.3366%	0.0000%	0.6665%	0.0013%
过去六个月	2.0897%	0.0013%	0.6695%	0.0000%	1.4202%	0.0013%
过去一年	4.2047%	0.0019%	1.3500%	0.0000%	2.8547%	0.0019%
过去三年	10.6852%	0.0037%	4.0537%	0.0000%	6.6315%	0.0037%
自基金合同生效起至今	23.6666%	0.0074%	7.2937%	0.0000%	16.3729%	0.0074%

注:根据《安信现金管理货币市场基金基金合同》的约定,本基金收益分配为按日结转份额,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





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。

§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;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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨凯玮	本基金的基金经理,固定收益部总经理	2016年3月14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,台湾安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、安信稳健增利货币市场基金、安信活期宝货币市场基金、安信保证金交易型货币市场基金、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。
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、安信稳健增利货币市场基金、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

本报告期安信现金管理货币A的基金份额净值收益率为1.9673%,本报告期安信现金管理货币B的基金份额净值收益率为2.0897%,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

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144,470,482.53元,其中本基金A类共分配人民币4,285,177.46元,B类共分配人民币140,185,305.07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

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144,470,482.53元,其中本基金A类共分配人民币4,285,177.46元,B类共分配人民币140,185,305.07元,不存在应分配但尚未实施分配的情况。

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(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:安信现金管理货币市场基金

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	1,011,674,737.73	85,503,086.58
结算备付金	5,909,090.91	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	5,531,949,086.42	5,663,580,963.85
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	5,491,942,320.32	5,653,551,386.35
资产支持证券投资	40,006,766.10	10,029,577.50
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	967,923,541.89	642,563,053.90
应收证券清算款	-	-
应收利息	24,493,869.41	16,873,317.88
应收股利	-	-
应收申购款	52,277,818.00	75,950,454.04
递延所得税资产	-	-
其他资产	1,841.00	1,841.00
资产总计	7,594,229,985.36	6,484,472,717.25
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	802,456,297.86	400,898,998.65
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	1,916,128.04	1,336,467.56
应付托管费	580,644.81	404,990.14
应付销售服务费	97,936.34	86,675.49
应付交易费用	151,176.67	94,092.37
应交税费	71,462.68	-
应付利息	294,404.97	158,659.52
应付利润	1,550,105.89	2,273,704.68
递延所得税负债	-	-
其他负债	215,500.85	322,333.33
负债合计	807,333,658.11	405,575,921.74
所有者权益:		
实收基金	6,786,896,327.25	6,078,896,795.51
未分配利润	-	-
所有者权益合计	6,786,896,327.25	6,078,896,795.51
负债和所有者权益总计	7,594,229,985.36	6,484,472,717.25

注:报告期截止日2018年6月30日,本基金A类基金份额净值人民币1.0000元,B类基金份额净值人民币1.0000元。基金份额总额6,786,896,327.25份,其中A类基金份额195,867,081.66份;B类基金份额6,591,029,245.59份。

6.2 利润表

会计主体:安信现金管理货币市场基金

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	169,147,890.46	218,132,544.78
1.利息收入	168,560,435.66	215,454,400.54
其中:存款利息收入	16,520,144.29	48,208,598.51
债券利息收入	128,649,099.86	124,433,664.82
资产支持证券利息收入	119,233.10	7,371,745.46
买入返售金融资产收入	23,271,958.41	35,440,391.75
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	587,454.80	2,678,144.24
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	583,688.91	2,678,144.24
资产支持证券投资收益	3,765.89	-
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	24,677,407.93	32,271,071.39
1. 管理人报酬	11,523,672.96	17,892,200.14
2. 托管费	3,492,022.05	5,421,878.78
3. 销售服务费	612,290.27	650,094.58
4. 交易费用	-	1,000.00
5. 利息支出	8,772,677.01	8,044,561.41
其中:卖出回购金融资产支出	8,772,677.01	8,044,561.41
6. 税金及附加	19,949.28	-
7. 其他费用	256,796.36	261,336.48
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	144,470,482.53	185,861,473.39
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	144,470,482.53	185,861,473.39

6.3 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: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)	6,078,896,795.51	-	6,078,896,795.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	144,470,482.53	144,470,482.53
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)	707,999,531.74	-	707,999,531.74
其中:1.基金申购款	19,669,286,502.15	-	19,669,286,502.15
2.基金赎回款	-18,961,286,970.41	-	-18,961,286,970.41
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)	-	-144,470,482.53	-144,470,482.53
五、期末所有者权益(基金净值)	6,786,896,327.25	-	6,786,896,327.25
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)	15,298,783,930.58	-	15,298,783,930.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	185,861,473.39	185,861,473.39
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)	-11,015,506,430.25	-	-11,015,506,430.25
其中:1.基金申购款	26,495,886,218.23	-	26,495,886,218.23
2.基金赎回款	-37,511,392,648.48	-	-37,511,392,648.48
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)	-	-185,861,473.39	-185,861,473.39
五、期末所有者权益(基金净值)	4,283,277,500.33	-	4,283,277,500.33

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。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,539,965,778.37元。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。截至2013年2月5日止,安信现金管理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1,539,965,778.37元,折合1,539,965,778.37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289,164.51元,折合289,164.51份基金份额。其中A类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1,175,163,078.37元,折合1,175,163,078.37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221,572.92元,折合221,572.92份基金份额。B类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364,802,700.00元,折合364,802,700.00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67,591.59元,折合67,591.59份基金份额。以上收到的实收基金共计人民1,540,254,942.88元,折合1,540,254,942.88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《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,本基金的投资范围为国内依法发行、具有一定剩余期限限制的债券、央行票据、回购以及法律法规允许投资的其他金融工具。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股票、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
中国建设银行股份有限公司(以下简称"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(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
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: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均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	11,523,672.96	17,892,200.14
其中:支付销售机构的客户维护费	429,263.68	98,526.66

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	3,492,022.06	5,421,878.78

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率逐日计提。计算方法如下:

H=E×0.10%/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		
	安信现金管理货币A	安信现金管理货币B	合计
安信基金	45,725.99	313,330.69	359,056.68
中国建设银行	43,613.41	515.00	44,128.41
安信证券	145,520.58	11,486.59	157,007.17
合计	234,859.98	325,332.28	560,192.26
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	