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:2015年8月27日

# 安信现金管理货币市场基金

## 2015 半年度 报告摘要

2015年6月30日

§1 重要提示及目录

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2015年8月25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2015年1月1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 | 1,135,929,314.22份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 安信现金管理货币A | 安信现金管理货币B |
| 下属两级基金的交易代码 | 750006 | 750007 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 173,014,482.65份 | 962,914,831.57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,决定开动态调整投资组合平均剩余期限和比例分布。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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 | 乔江晖 | 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 | 安信基金管理有限责任公司<br>地址:广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层 |

§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(2015年1月1日-2015年6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 | 6,140,299.67 | 18,514,021.63 |
| 本期利润 | 6,140,299.67 | 18,514,021.63 |
| 本期净值收益率 | 2.2811% | 2.4036% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2015年6月30日) | |
| 期末基金资产净值 | 173,014,482.65 | 962,914,831.57 |
| 期末基金份额净值 | 1.000 | 1.000 |

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、本基金收益分配方按日结转份额。

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

(1)安信现金管理货币A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

| 阶段(A级) | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差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 | 0.2658% | 0.0070% | 0.1110% | 0.0000% | 0.1548% | 0.0070% |
| 过去三个月 | 1.0174% | 0.0206% | 0.3366% | 0.0000% | 0.6808% | 0.0206% |
| 过去六个月 | 2.2811% | 0.0174% | 0.6695% | 0.0000% | 1.6116% | 0.0174% |
| 过去一年 | 4.5745% | 0.0133% | 1.3500% | 0.0000% | 3.2245% | 0.0133% |
| 自基金合同生效日起至今(2013年02月05日-2015年06月30日) | 11.0853% | 0.0100% | 3.2400% | 0.0000% | 7.8453% | 0.0100% |

(2)安信现金管理货币B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

| 阶段(B级) | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差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 | 0.2859% | 0.0070% | 0.1110% | 0.0000% | 0.1748% | 0.0070% |
| 过去三个月 | 1.0783% | 0.0206% | 0.3366% | 0.0000% | 0.7417% | 0.0206% |
| 过去六个月 | 2.4036% | 0.0174% | 0.6695% | 0.0000% | 1.7341% | 0.0174% |
| 过去一年 | 4.8264% | 0.0133% | 1.3500% | 0.0000% | 3.4764% | 0.0133% |
| 自基金合同生效日起至今(2013年02月05日-2015年06月30日) | 11.7282% | 0.0100% | 3.2400% | 0.0000% | 8.4882% | 0.0100% |

注:1、根据《安信现金管理货币市场基金基金合同》的约定,本基金收益分配方按日结转份额,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。

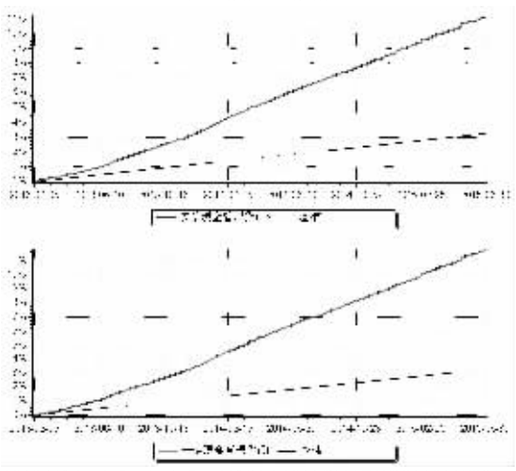
2、本基金基金合同生效日为2013年2月5日,表中所列基金及业绩比较基准的相关数值为2013年2月5日至2015年06月30日间各自的实际数值。

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

安信现金管理货币市场基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年2月5日-2015年6月30日)



注:1、本基金的建仓期为2013年2月5日至2013年8月4日,建仓期结束时,本基金各项资产配置比例均符合本基金合同的约定。

2、本基金基金合同生效日为2013年2月5日,图示日期为2013年2月5日至2015年06月30日。

§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3.5亿元人民币,股东及股权结构为:五矿资本控股有限公司持有38.72%的股权,安信证券股份有限公司持有33%的股权,佛山市顺德区新碧资易有限公司持有19.71%的股权,中广核财务有限责任公司持有8.57%的股权。

截至2015年6月30日,本基金管理人共管理15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。

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期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 李勇 | 本基金的基金经理、公司固定收益投资监董固定收益部总经理 | 2013年2月5日 | - | 9 | 李勇先生,经济学硕士。历任中国农业银行股份有限公司总行金融市场部交易员、高级投资经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益投资总监兼固定收益部总经理。曾任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理;现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金的基金经理。 |
| 张翼飞 | 本基金的基金经理 | 2014年3月26日 | - | 4.5 | 张翼飞先生,经济学硕士。历任摩根机机(上海)有限公司财务部会计、财务主管,上海市国有资产监督管理委员会规划发展处研究员,泰显岛嘉隆高科实业有限公司财务总监,日盛嘉富证券国际有限公司上海代表处研究部研究员。现任职于安信基金管理有限责任公司固定收益部,曾任安信现金管理货币市场基金的基金经理助理;现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理,安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 魏晓菲 | 本基金的基金经理助理 | 2014年2月21日 | - | 8 | 魏晓菲女士,法学硕士。先后在安信证券股份有限公司、安信基金管理有限责任公司工作,现在安信基金管理有限责任公司固定收益部从事固定收益类投资工作。现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。 |
| 刘献荣 | 本基金的基金经理助理 | 2014年11月17日 | 2015年3月9日 | 8 | 刘献荣女士,经济学硕士。历任中国建设银行青岛市分行中山路支行信贷员、联合资信评估有限公司工商企业部分析师。现任安信基金管理有限公司固定收益部研究员。现任安信宝利分级债券型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。 |

注:1、本基金基金经理李勇的"任职日期"按基金合同生效日填写,基金经理张翼飞的"任职日期"根据公司决定的公告(生效)日期填写,基金经理助理魏晓菲、刘献荣的"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。

本基金管理人采用T值检验等统计方法,定期对旗下管理的所有基金和投资组合之间发生的同一交易日内、三个交易日内、五个交易日内的同向交易价差进行专项分析和检查。分析结果显示,本基金与本基金管理人旗下管理的所有其他基金和投资组合之间,不存在通过相同品种的同向交易进行投资组合间利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金未发生异常交易行为。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

上半年债券市场整体呈现牛市格局,主要原因是:

1、经济持续不景气,主要支柱产业,例如房地产、汽车都呈现弱势格局。基建行业上半年由于地方政府债务的收缩要求等原因,也明显下滑。高端消费由于反腐等原因也出现了一定的萧条。

2、经济不景气致货币政策持续宽松,接连降准降息。

3、PPI、CPI持续低位运行,除了上述列举的经济原因抑制了消费,供给增长、需求不畅致大宗商品的走低,也部分促成了输入性通缩。

4、企业融资需求在上半年也出现了一定的下滑,影响了资金需求。

我们在整个上半年,维持了较高的债券仓位,同时适当调增了持仓久期,除了票息收益外,也为客户创造了一定的资本利得。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年06月30日,本年本基金A类份额净值收益率为2.2409%,B类份额净值收益率为2.3606%,同期比较基准份额收益率均为0.6547%,本基金A类和B类净值收益率分别超过同期业绩比较基准1.5862%和1.7059%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们在7月初二季报里坚定的看好债市,最近一个月以来,债券市场异常火爆,部分印证了我们的判断。但目前来看,债牛的进度过快,我们认为存在一定的回调风险,主要由于:

1、近期债市的火爆,主要原因有二:

一是几万亿的打新资金在IPO暂停后失去方向,其中相当部分至少暂时转向债市;

二是股市急剧降杠杆,两融资产急剧减少,场内两融资产减少1万亿(2.4万亿降到8月初的1.4万亿),场外两融资产的减少(例如银行配资机构产的平仓结束)很可能也不低于此数。原先配置这些资产的资金由于其显著的固定收益特征,近期也转向债市。

2、上述债市的增量资金,虽然也许短期内不会离开债市,但这个增量的密度(一个月2万亿)可能难以维持。

3、认为目前债市的利率相对于其他融资渠道具有显著的吸引力,未来供给大幅度增加是大概率事件。

目前主流1年AA+利率在3.5~3.8%之间,这个利率大约只有银行贷款成本的一半。我们同时看到近期发行的房地产公司债大多在5%附近,相比房企经常使用的房地产信托等融资工具更是只有1/3左右。

4、认为通胀短期内没有大幅上行的风险,但认为最迟4季度后半段,对通胀上行的担忧将会逐渐扩散。而且一些通胀将起的迹象已经有所显现,例如猪肉价格在最近1个多月时间内上涨了30%左右。

5、国际利率环境可能也面临上行的压力。

6、股市下跌等引起的资本外流,可能对国内的利率水平产生压力。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《安信基金管理有限责任公司估值管理制度》开展。

公司基金的日常估值业务由运营部负责,运营部在日常估值管理中,必须严格遵循各项法律法规及基金合同的规定,及时准确对基金资产估值事项进行基金估值。运营部对基金所使用的估值系统进行总体规划和组织实施,建立并不断完善基金资产估值系统。另外,公司成立基金估值委员会,主任委员由公司总经理担任,成员由副总经理、运营部、研究部、监察稽核部人员组成,投资部门相关人员列席。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。

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,保证公司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。估值委员会采取临时会议的方式召开会议,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时,运营部应及时提请估值委员会召开会议修订估值方法,以保证其持续适用。估值委员会会议决议须经全体委员半数以上投票表决同意方能通过,并形成书面文件妥善保管。对于重大事项,应在充分征求监管机构、托管银行、会计师事务所、律师事务所意见的基础上,再行表决。估值政策和程序的修订经估值委员会审批通过后方可实施。

估值委员会中各成员的职责分工如下:运营部凭借专业技能和对市场产品长期丰富的估值经验以及对相关法律法规的熟练掌握,对没有市价的投资品种的估值方法在其专业领域提供专业意见。研究部凭借丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究,对没有市价的投资品种综合宏观经济、行业发展及个股状况等因素,从价值投资的角度进行理论分析,并根据分析的结果建议应采用的估值方法及合理的估值区间。研究部根据估值委员会提出的多种估值方法预案,利用金融工程研究体系各种经济基础数据和数量化工具,针对不同的估值方法及估值模型进行演算,为估值委员会寻找公允的、操作性较强的估值方法提供数理依据。监察稽核部对估值委员会临时会议的全程讨论、做出的决议、提交的基金估值信息披露文件进行合规性审查。投资部门相关人员和基金经理有权列席估值委员会会议,但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

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。截止报告期末本基金管理人未与任何外部估值定价服务机构签约。

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24654321.3元,其中本基金A类共分配人民币6140299.67元,B类共分配人民币18514021.63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

本报告期内,本基金未出现连续20个工作日基金份额持有人不满200人或基金资产净值低于5000万元人民币的情形。

§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24654321.3元,其中本基金A类共分配人民币6140299.67元,B类共分配人民币18514021.63元。

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、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:2015年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期末 2015年6月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产: | | |
| 银行存款 | 480,495,523.14 | 609,794,986.79 |
| 结算备付金 | - | - |
| 存出保证金 | - | - |
| 交易性金融资产 | 605,414,061.47 | 545,166,029.15 |
| 其中:股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 605,414,061.47 | 545,166,029.15 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 69,300,303.95 | - |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 10,785,766.83 | 15,224,293.79 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 504,603.02 | 49,057,963.21 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 1,166,500,258.41 | 1,219,243,272.94 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2015年6月30日 | 上年度末 2014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 | 29,699,865.15 | 150,029,454.96 |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | 377,408.38 | 324,418.07 |
| 应付托管费 | 114,366.23 | 98,308.54 |
| 应付销售服务费 | 52,748.46 | 95,507.27 |
| 应付交易费用 | 31,861.32 | 39,178.04 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | 1,135.70 | 38,015.56 |
| 应付利润 | 83,017.50 | 110,044.15 |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 210,541.45 | 272,333.33 |
| 负债合计 | 30,570,944.19 | 151,007,259.92 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 1,135,929,314.22 | 1,068,236,013.02 |
| 未分配利润 | - | - |
| 所有者权益合计 | 1,135,929,314.22 | 1,068,236,013.02 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,166,500,258.41 | 1,219,243,272.94 |

注:报告截止日2015年6月30日,本基金A类基金份额净值1.0000元,B类基金份额净值1.0000元。本基金份额总额1,135,929,314.22份,其中A类基金份额173,014,482.65份;B类基金份额962,914,831.57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:2015年1月1日-2015年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期2015年1月1日-2015年6月30日 | 上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 29,045,719.03 | 28,471,499.72 |
| 1.利息收入 | 23,393,446.92 | 24,214,482.79 |
| 其中:存款利息收入 | 13,949,916.93 | 15,836,527.28 |
| 债券利息收入 | 9,085,752.52 | 5,977,854.63 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 357,777.47 | 2,400,100.88 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | 5,652,272.11 | 4,257,016.93 |
| 其中:股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 5,652,272.11 | 4,257,016.93 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 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 | 4,391,397.73 | 3,766,883.12 |
| 1.管理人报酬 | 1,813,271.95 | 1,574,057.04 |
| 2.托管费 | 549,476.40 | 476,987.04 |
| 3.销售服务费 | 385,058.38 | 477,001.05 |
| 4.交易费用 | - | 146.73 |
| 5.利息支出 | 1,395,505.33 | 1,009,191.80 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 1,395,505.33 | 1,009,191.80 |
| 6.其他费用 | 248,085.67 | 229,499.46 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 24,654,321.30 | 24,704,616.60 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | 24,654,321.30 | 24,704,616.60 |

注:本基金合同于2013年2月5日生效,本报告期的财务报表及报表附注上年度可比期间为2014年1月1日至2014年6月30日。

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:2015年1月1日-2015年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期 2015年1月1日-2015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) | 1,068,236,013.02 | - | 1,068,236,013.02 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 24,654,321.30 | 24,654,321.30 |
| 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) | 67,693,301.20 | - | 67,693,301.20 |
| 其中:1.基金申购款 | 4,836,633,504.72 | - | 4,836,633,504.72 |
| 2.基金赎回款 | -4,768,940,203.52 | - | -4,768,940,203.52 |
| 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) | - | -24,654,321.30 | -24,654,321.30 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,135,929,314.22 | - | 1,135,929,314.22 |
| 项 目 | 上年度可比期间 2014年01月01日-2014年06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) | 777,715,710.75 | - | 777,715,710.75 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 24,704,616.60 | 24,704,616.60 |
| 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) | 456,102,788.23 | - | 456,102,788.23 |
| 其中:1.基金申购款 | 4,857,991,131.19 | - | 4,857,991,131.19 |
| 2.基金赎回款 | -4,401,888,342.96 | - | -4,401,888,342.96 |
| 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) | - | -24,704,616.60 | -24,704,616.60 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,233,818,498.98 | - | 1,233,818,498.98 |

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 | 廖维坤 | 尚尔航 |
|---|---|---|
| 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【2012】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(以下简称"建设银行")。

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《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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。

本财务报表采用了若干修订后/新会计准则:2014年1至3月,财政部制定了《企业会计准则第39号--公允价值计量》和《企业会计准则第30号--财务报表列报》等7项会计准则;上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月,财政部修订了《企业会计准则第37号--金融工具列报》,在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

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2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015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和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。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系自2015年1月1日起至2015年6月30日止。

6.4.5 会计差错更正的说明

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 营业税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入,免征营业税。

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 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,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

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 |
| 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 债券交易

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债券交易。

6.4.8.1.2 债券回购交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期2015年1月1日-2015年6月30日 | | 上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券回购总量的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购总量的比例 |
| 安信证券 | 250,400,000.00 | 100.00% | 286,781,000.00 | 100.00% |

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2015年1月1日-2015年6月30日 | 上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,813,271.95 | 1,574,057.04 |
| 其中:应支付销售机构的客户维护费 | 506,620.40 | 618,680.42 |

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2015年1月1日-2015年6月30日 | 上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 549,476.40 | 476,987.04 |

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 2015年1月1日-2015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 |
| 中国建设银行 | 178,368.80 | 11,932.42 | 418,682.50 |
| 安信基金直销 | 7,080.97 | 19,059.70 | 14,417.40 |
| 安信证券 | 38,068.15 | 260.56 | 93,667.96 |
| 合计 | 223,517.92 | 31,252.68 | 526,767.86 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间2014年01月01日-2014年06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 |
| 中国建设银行 | 240,313.70 | 10,638.97 | 250,952.67 |
| 安信基金直销 | 7,336.43 | 9,560.27 | 16,896.70 |
| 安信证券 | 55,599.81 | 573.53 | 56,173.34 |
| 合计 | 303,249.94 | 20,772.77 | 324,022.71 |

注:本基金A类基金份额的销售服务费年费率为0.25%,对于由B类降级为A类的基金份额持有人,年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额持有人的费率。B类基金份额的销售服务费年费率为0.01%,对于由A类升级为B类的基金份额持有人,年销售服务费率应自其达