安信平稳增长混合型发起式证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

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

基金简称	安信平稳增长混合发起	
交易代码	750005	
基金运作方式	契约型开放式发起式	
基金合同生效日	2012年12月18日	
报告期末基金份额总额	1,922,969,893.15份	
投资目标	通过稳健的资产配置策略,将基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间灵活配置,并通过积极主动的股票投资和债券投资,把握中国经济增长和资本市场发展机遇,严格控制下行风险,力争实现基金份额净值的长期平稳增长。	
投资策略	1、资产配置策略:研究与跟踪宏观经济运行状况和资本市场变动特征,分析类别资产预期收益和预期风险,根据最优风险投酬比原则确定资产配置比例并进行动态调整。 2、上市公司研究方法:以深入细致的公司研究推动股票的精选与投资。在对上市公司的研究中,采用安信基金三因素分析法,即重点分析上市公司的盈利模式、竞争优势和所处行业的发展环境。 3、股票投资策略:坚持价值投资理念,以PE/PB等估值指标入手对价值型公司进行评估,在共实深入的公司研究基础上,重点发掘出价值低估的股票。 4、债券投资策略:采取利率策略、信用策略、相对价值策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会。	
业绩比较基准	50%×中证800指数收益率+50%×中债总指数(全价)收益率	
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信平稳增长A	安信平稳增长C
下属分级基金的交易代码	750005	002035
报告期末下属分级基金的份额总额	211,447,689.24份	1,711,522,203.91份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 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)	
	安信平稳增长A	安信平稳增长C
1. 本期已实现收益	1,030,393.90	3,111,898.29
2. 本期利润	1,380,606.68	7,374,595.61
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0062	0.0042
4. 期末基金资产净值	305,462,441.97	2,472,185,041.46
5. 期末基金份额净值	1.445	1.444

注:1、所述基金业绩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;
3、本基金自2015年11月18日起增加C类份额,C类份额的报告期间为2015年11月18日至2015年12月31日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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

安信平稳增长A

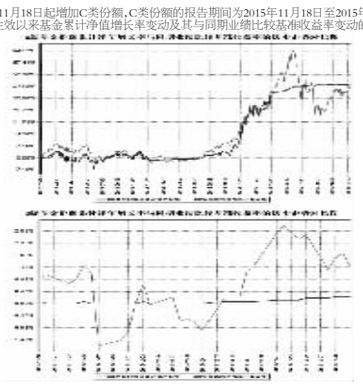
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.48%	0.05%	10.52%	0.85%	-10.04%	-0.80%

安信平稳增长C

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	0.21%	0.04%	0.46%	0.81%	-0.25%	-0.77%

注:1、业绩比较基准收益率=中证800指数收益率×50%+中债总指数(全价)收益率×50%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡;
2、本基金自2015年11月18日起增加C类份额,C类份额的报告期间为2015年11月18日至2015年12月31日。

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、本基金的建仓期为2012年12月18日至2013年6月17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。
2、本基金基金合同生效日为2012年12月18日,自2015年11月18日起增加C类份额。A类份额图示日期为2012年12月18日至2015年12月31日,C类份额图示日期为2015年11月18日至2015年12月31日。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
姜诚	本基金的基金经理、基金投资部总经理	2014年8月8日	-	9	姜诚先生,经济学硕士,历任国泰君安证券股份有限公司资产委托管理总部助理研究员、研究员、投资经理,安信基金管理有限责任公司研究部总经理。现任安信基金管理有限责任公司基金投资部总经理。现任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金的基金经理。
庄园	本基金的基金经理	2014年5月29日	2015年7月8日	11	庄园女士,经济学硕士,历任招商基金管理有限公司投资部交易员,工银瑞信基金管理有限公司投资部交易员,研究部研究员,中国国际金融有限公司资产管理部高级经理,安信证券股份有限公司证券投资部投资经理、资产管理部高级投资经理。2012年5月加入安信基金管理有限责任公司固定收益部,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助理、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理;现任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金的基金经理助理,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)、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注:1、此处任职日期是指注册成为本基金的基金经理注册生效日,离任日期指完成基金经理变更注册的日期。
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 公平交易专项说明

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。

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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金以追求绝对收益为主要目标,因此在市场风险较高时低仓位运作,四季度的市场反弹我们没有参与。报告期内本基金的大部分资产配置于固定收益类标的,包括银行间债券、交易所债券及银行间逆回购等。除此以外的小部分仓位配置于股票,并根据市场点位的高低进行反向操作,对收益率起到了一定的增厚作用。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金A类份额净值为1.445元,本基金C类份额净值为1.444元。本报告期本基金A类份额净值增长率为0.48%,本基金C类份额净值增长率为0.21%,同期业绩比较基准增长分别为10.52%和0.46%。基金业绩分别高于同期业绩比较基准-10.04%和-0.25%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	40,347,850.06	1.45
	其中:股票	40,347,850.06	1.45
2	固定收益投资	1,008,405,862.40	36.24
	其中:债券	1,008,405,862.40	36.24
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,718,758,678.87	61.77
7	其他资产	15,114,502.16	0.54
8	合计	2,782,626,893.49	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	619,368.78	0.02
C	制造业	24,178,658.73	0.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	735,549.32	0.03
F	批发和零售业	222,304.44	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,517,852.18	0.09
J	金融业	10,982,000.00	0.40
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	982,724.40	0.04
S	综合	-	-
	合计	40,347,850.06	1.45

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期未未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000725	京东方A	6,437,200	19,118,484.00	0.69
2	601939	建设银行	1,900,000	10,982,000.00	0.40
3	002250	联化科技	85,565	1,614,611.55	0.06
4	603508	思维列控	14,605	1,136,853.20	0.04
5	603999	读者传媒	16,713	982,724.40	0.04
6	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.03
7	601088	中国神华	41,374	619,368.78	0.02
8	603996	中新科技	16,729	494,174.66	0.02
9	000338	潍柴动力	47,800	461,748.00	0.02
10	600585	海螺水泥	21,900	374,490.00	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	200,500,000.00	7.22
	其中:政策性金融债	200,500,000.00	7.22
4	企业债券	8,330,862.40	0.30
5	企业短期融资券	501,905,000.00	18.07
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	297,670,000.00	10.72
9	其他	-	-
10	合计	1,008,405,862.40	36.30

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111507137	15招行CD137	2,000,000	198,460,000.00	7.14
2	011537008	15中建材SCP008	1,000,000	100,380,000.00	3.61
3	111593057	15监京银行CD079	1,000,000	99,210,000.00	3.57
4	150411	15农发11	800,000	80,232,000.00	2.89
5	150202	15国开02	800,000	80,096,000.00	2.88

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期未未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期未未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期未未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期未未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期未未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	91,708.88
2	应收证券清算款	2,722,388.01
3	应收股利	-
4	应收利息	12,208,948.57
5	应收申购款	91,456.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,114,502.16

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	安信平稳增长A	安信平稳增长C
报告期期初基金份额总额	256,886,306.54	-
报告期期间基金总申购份额	75,083,304.71	1,801,799,287.24
减:报告期期间基金总赎回份额	120,521,922.01	90,277,083.33
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	211,447,689.24	1,711,522,203.91

注:总申购份额含红利再投和转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	9,999,000.00	0.52	9,999,000.00	0.52	3年
其他	-	-	-	-	-
合计	9,999,000.00	0.52	9,999,000.00	0.52	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人2015年11月18日发布公告,自公告当日起增加C类份额并修改基金合同。本次增加C类份额及相应修改基金合同不会对原基金份额持有人造成不利影响。

本基金管理人2015年12月31日发布公告,自2015年12月30日起,王连志先生任公司董事长,牛冠兴先生不再担任公司董事长。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会核准安信平稳增长混合型发起式证券投资基金募集的文件;
2、《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金基金合同》;
3、《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金托管协议》;
4、《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金招募说明书》;
5、中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

安信基金管理有限责任公司

地址:中国广东省深圳市福田区莲花街道益田路6009号新世界商务中心36层

10.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅,或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话:4008-088-088

网址:http://www.essencefund.com

安信基金管理有限责任公司
2016年1月20日

安信现金增利货币市场基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31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指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

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

基金简称	安信现金增利货币
交易代码	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	194,887,513.07份
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研。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此例分布。 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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 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	1,214,225.93
2. 本期利润	1,214,225.93
3. 期末基金资产净值	194,887,513.07

注: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。

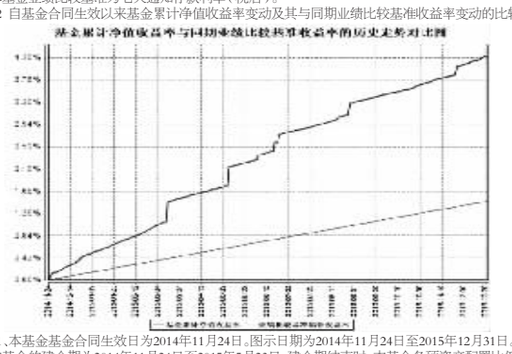
3.2 基金净值表现

3.2.1 本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

阶段	净值收益率①	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
过去三个月	0.7040%	0.0148%	0.3403%	0.0000%	0.3637%	0.0148%

注:1、本基金收益分配为按日结转份额;
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5月23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。

§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 任职日期	离任日期	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	张翼飞先生,经济学硕士,历任摩根轧机(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,秦皇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、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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 公平交易专项说明

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。

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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

1.第4季度初,资金仍保持相对宽松,债券市场收益率继续缓慢下降,在此过程中,我们配置了一定量的利率品种和超短期同业存款,以观望为主。

2.11月初,短债收益率逐渐上升,我们在此过程中分批开始了中长期限的配置。逐渐增加久期。

3.12月,收益率一路下行,由于我们提前进行了配置,获得了较为满意的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本报告期内本基金A类份额净值收益率为0.7040%,同期比较基准份额收益率为0.3403%,基金净值收益率超过同期业绩比较基准0.3637%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	133,804,659.82	58.01
	其中:债券	133,804,659.82	58.01
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	94,799,299.75	41.10
4	其他资产	2,042,810.06	0.89
5	合计	230,646,769.63	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	5.70
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额 / 占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	31,979,784.01 / 16.41
	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	2015年12月15日	56.25	巨额赎回	1
2	2015年12月23日	23.02	巨额赎回	3
3	2015年12月24日	38.15	巨额赎回	2
4	2015年12月25日	40.76	巨额赎回	1
5	2015年12月28日	34.75	巨额赎回	1

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	117
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	157
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	85

注:根据本基金基金合同的约定,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。

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况,但根据本基金基金合同的约定,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。

5.3.2 报告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	23.17	18.26
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	20.61	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	20.57	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	31.72	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	21.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	117.31	18.26

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	3,714,372.32	1.91
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,034,356.07	10.28
	其中:政策性金融债	20,034,356.07	10.28
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	80,285,572.25	41.20
6	中期票据	-	-
7	同业存单	29,770,359.18	15.28
8	其他	-	-
9	合计	133,804,659.82	68.66
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	071525007	15国都证券CP007	200,000	19,996,417.15	10.26
2	041551063	15均子大桥CP001	200,000	19,987,083.10	10.26
3	111592185	15广州农村商业银行CD019	200,000	19,790,807.53	10.15
4	041562035	15邮电器材CP001	100,000	10,096,876.27	5.18
5	041558036	15沈公用CP002	100,000	10,087,459.66	5.18
6	041569020	15海纳川CP001	100,000	10,068,757.31	5.17
7	011599417	15厦路桥SCP003	100,000	10,048,978.76	5.16
8	140206	14国开06	100,000	10,037,300.24	5.15
9	150311	15进出11	100,000	9,997,085.83	5.13
10	111593383	15长安银行CD025	100,000	9,979,551.65	5.12

5.6 "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	0.1323%
报告期内偏离度的最低值	0.0031%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0704%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期未未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

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。

5.8.2

本报告期内本基金不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	22,653,914.17
4	应收申购款	65,718,293.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	88,372,207.17

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	安信现金管理货币A	安信现金管理货币B
报告期期初基金份额总额	176,098,866.95	3,616,956,287.91
报告期期间基金总申购份额	486,949,540.04	1,912,726,042.29
减:报告期期间基金总赎回份额	265,025,843.85	2,113,574,456.11
报告期期末基金份额总额	398,022,563.14	3,416,107,874.09

注:总申购份额含红利再投和转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人2015年12月31日发布公告,自2015年12月30日起,王连志先生任公司董事长,牛冠兴先生不再担任公司董事长。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准安信现金增利货币市场基金募集的文件;
2、《安信现金增利货币市场基金基金合同》;
3、《安信现金增利货币市场基金托管协议》;
4、《安信现金增利货币市场基金招募说明书》;
5、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

安信基金管理有限责任公司

地址:中国广东省深圳市福田区莲花街道益田路6009号新世界商务中心36层

9.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅,或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话:4008-088-088

网址:http://www.essencefund.com

安信基金管理有限责任公司
2016年1月20日

安信现金管理货币市场基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31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。

基金托管人中国建设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指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

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

基金简称	安信现金管理货币
交易代码	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
报告期末基金份额总额	3,814,130,437.23份
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,持续合类行业开市场操作等情况,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,根据各公司债券评分和收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,在精确控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权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