安信现金管理货币市场基金

2015 年度 报告摘要

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
送出日期:2016年3月25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2016年3月22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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了2015年度标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2015年1月1日起至12月31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	3,814,130,437.23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	398,022,563.14份	3,416,107,874.09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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金年度报告备置地点	安信基金管理有限责任公司 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、基金净值表现及利润分配情况

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	2015年		2014年		2013年2月5日(基金合同生效日)-2013年12月31日	
	安信现金管理货币A	安信现金管理货币B	安信现金管理货币A	安信现金管理货币B	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	8,913,296.58	60,508,021.02	17,386,597.02	35,675,315.02	6,462,906.16	6,358,075.15
本期利润	8,913,296.58	60,508,021.02	17,386,597.02	35,675,315.02	6,462,906.16	6,358,075.15
本期净值收益率	3.7513%	4.0007%	4.9325%	5.1848%	3.5026%	3.7278%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末		2014年末		2013年末	
期末基金资产净值	398,022,563.14	3,416,107,874.09	413,836,589.61	654,399,423.41	343,306,098.67	434,409,612.08
期末基金份额净值	1	1	1	1	1	1

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。

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	0.7210%	0.0027%	0.3403%	0.0000%	0.3807%	0.0027%
过去六个月	1.4374%	0.0060%	0.6805%	0.0000%	0.7569%	0.0060%
过去一年	3.7513%	0.0131%	1.3500%	0.0000%	2.4013%	0.0131%
自基金合同生效起至今	12.6821%	0.0095%	3.9205%	0.0000%	8.7616%	0.0095%

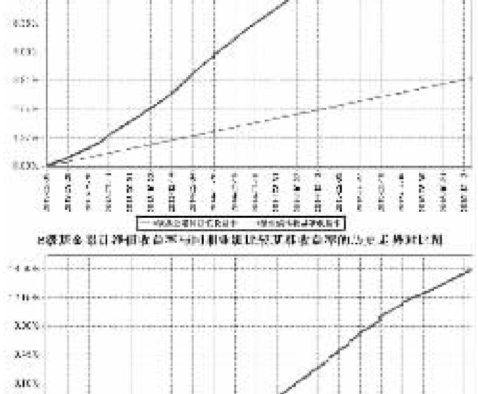
安信现金管理货币B

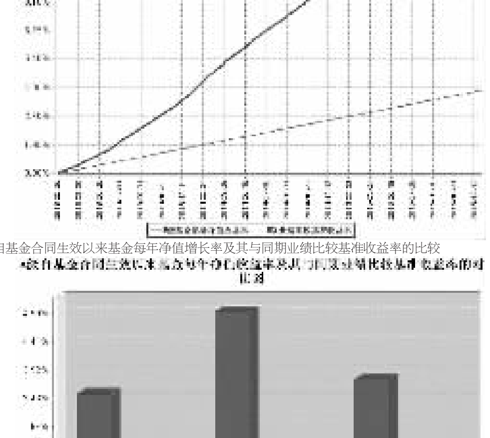
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7814%	0.0027%	0.3403%	0.0000%	0.4411%	0.0027%
过去六个月	1.5597%	0.0060%	0.6805%	0.0000%	0.8792%	0.0060%
过去一年	4.0007%	0.0131%	1.3500%	0.0000%	2.6507%	0.0131%
自基金合同生效起至今	13.4708%	0.0095%	3.9205%	0.0000%	9.5503%	0.0095%

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。

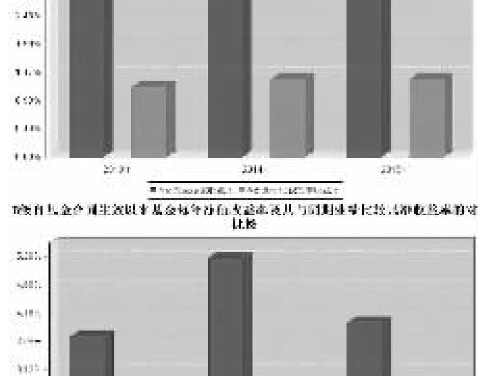
2、本基金基金合同生效日为2013年2月5日。表中所列基金及业绩比较基准的相关数值为2013年2月5日至2015年12月31日间各自的实际数值。

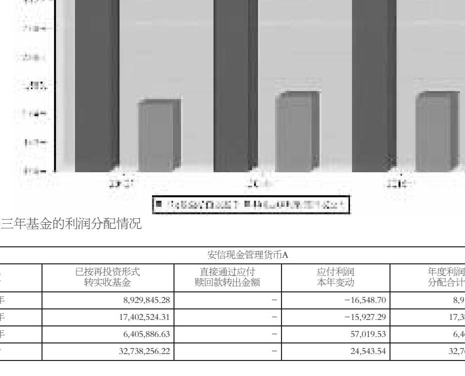
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

安信现金管理货币A					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2015年	8,929,845.28	-	-16,548.70	8,913,296.58	
2014年	17,402,524.31	-	-15,927.29	17,386,597.02	
2013年	6,405,886.63	-	57,019.53	6,462,906.16	
合计	32,738,256.22	-	24,543.54	32,762,799.76	

单位:人民币元

安信现金管理货币B					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2015年	60,345,296.83	-	162,724.19	60,508,021.02	
2014年	35,681,440.61	-	-6,125.59	35,675,315.02	
2013年	6,282,997.65	-	75,077.50	6,358,075.15	
合计	102,309,735.09	-	231,676.10	102,541,411.19	

§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,佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有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12月31日,本基金管理人共管理17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。

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		
李勇	本基金的基金经理、公司固定投资总监兼固定收益部总经理	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。
刘献荣	本基金的基金经理助理	2014年11月7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,安信基金管理有限责任公司固定收益部研究员。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部投资经理。
魏晓菲	本基金的基金经理助理	2014年2月21日	2015年7月24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。
魏晓菲	本基金的基金经理助理	2015年10月26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。
周仁	本基金的基金经理助理	2015年10月26日	-	0.5	周仁先生,金融硕士。曾任安信基金管理有限责任公司固定收益部研究助理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理助理。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。

注:1、基金经理的李勇的"任职日期"按基金合同生效日填写,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 公平交易制度和控制方法

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 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。

4.3.3 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

回顾2015年,宏观经济受大宗商品市场不景气、上游企业产能过剩、房地产库存问题凸显等因素影响,经济增速延续下行态势;货币政策方面,央行为应对经济下行压力,通过多次降准降息向市场注入流动性,大量资金在银行间体系沉淀,全年资金面整体维持宽松格局。在宏观经济基本面偏弱、多次降准降息及资金配置需求等因素支撑下全年债市整体呈现牛市行情,全年中债总净价(总值)指数上涨接近4%。

本基金在报告期内,始终把流动性风险管理放在第一位,同时严格控制组合的信用风险、价格风险和操作风险,确保报告期内风险事件零发生。在投资策略方面,一是较为准确的抓住全年为数不多的几次资金紧张时点,积极布局较长期限的同业存款及大额存单以提高组合收益;二是在保障流动性的前提下适当放大产品杠杆,通过配置优质短融品种提高组合收益;三是随着信用风险事件的不断出现,在个券的选择上提高了信用评级标准,严格防控信用风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,现金管理A的收益率为3.7513%,现金管理B的收益率为4.0007%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

首先梳理下目前宏观经济的情况。随着经济持续在底部徘徊,现在大家普遍的共识是我国经济经济将在一段时间内处在L型底的环境下,目前是内需不振且外需不稳,亟待过剩产能逐步出清。为了配合政府的供给侧改革,央行在本年度进行了5次降息和5次降准,维持了相对宽松的货币政策。但是市场也存在对资金面有扰动的因素,主要有两个:其一是美元加息带来的资本外流和人民币贬值预期。其二是改革正处在攻坚阶段,政府调低了经济增长的目标以使得过剩产能有逐步出清的空间,而该政策使得央行不能过度放水。所以新的年度里,稳健的货币政策和积极的财政政策将会是主旋律,不能对央行会大量放水有过高期望。在国家调低经济增长预期的同时,我们也要调低债券市场的目标收益。

再看债券市场,由于经济持续恶化及股票、大宗等资产价格的大幅下跌,债市在本年度延续了债牛行情。债市在高收益资产缺少的如今正成为各路资金的避风港,与此同时债券的收益率也在逐渐下降,其中具代表性的有十年期国债突破3%的整数关口。期限利差、信用利差都在大幅缩小。在这一轮大的行情中也伴随着少量的回调,但仍不改收益率下行的趋势。但是,在债牛逐渐行进的过程中我们也要注意可能的风险,我们认为风险包括但不限于以下几点:1.美元加息导致资本外流,人民币汇率承压。这点压缩了货币政策的实施空间。2.债券供给增加。随着地方政府债及公司债的大量发行,预测明年的债券供给甚至会超过今年。3.经济可能底部企稳。随着改革的推进,不排除经济在明年企稳。4.债市的去杠杆风险。由于管理层逐步对债券市场高杠杆问题的担忧,债市的杠杆可能会面临调整的风险。

我们依此判断明年债券市场可能会处在震荡的区间中,而且随着经济持续恶化,信用风险也可能在明年引来集中爆发,因此可以掌握好节奏进行波段操作,同时严格把控风险,尤其在择券时注意信用风险。

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69,421,317.60元,其中本基金A类共分配人民币8,913,296.58元,B类共分配人民币60,508,021.02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69,421,317.60元,其中本基金A类共分配人民币8,913,296.58元,B类共分配人民币60,508,021.02元。

5.3 托管人对本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 审计报告

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计了安信现金管理货币市场基金财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表、2015年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注,并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解详细内容,可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 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12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产:		
银行存款	1,550,896,412.38	609,794,986.79
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	2,326,539,088.52	545,166,029.15
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	2,326,539,088.52	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	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	22,653,914.17	15,224,293.79
应收股利	-	-
应收申购款	65,718,293.00	49,057,963.21
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,965,807,708.07	1,219,243,272.94
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31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	149,999,725.00	150,029,454.96
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	884,323.77	324,418.07
应付托管费	267,976.91	98,308.54
应付销售服务费	78,063.43	95,507.27
应付交易费用	69,272.34	39,178.04
应交税费	-	-
应付利息	9,356.42	38,015.56
应付利润	256,219.64	110,044.15
递延所得税负债	-	-
其他负债	112,333.33	272,333.33
负债合计	151,677,270.84	151,007,259.92
所有者权益:		
实收基金	3,814,130,437.23	1,068,236,013.02
未分配利润	-	-
所有者权益合计	3,814,130,437.23	1,068,236,013.02
负债和所有者权益总计	3,965,807,708.07	1,219,243,272.94

注:报告截止日2015年12月31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3,814,130,437.23份,其中A类基金份额398,022,563.14份;B类基金份额3,416,107,874.09份。

7.2 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日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	83,658,580.66	62,855,085.09
1.利息收入	74,995,527.57	54,040,323.01
其中:存款利息收入	45,054,642.81	34,615,334.55
债券利息收入	29,543,339.06	16,424,783.93
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	397,545.70	3,000,204.53
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	8,663,053.09	8,814,762.08
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	8,663,053.09	8,814,762.08
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	14,237,263.06	9,793,173.05
1. 管理人报酬	6,798,702.16	3,648,411.85
2. 托管费	2,060,212.76	1,105,579.53
3. 销售服务费	770,303.84	1,007,763.82
4. 交易费用	-	146.73
5. 利息支出	4,098,435.66	3,568,198.36
其中:卖出回购金融资产支出	4,098,435.66	3,568,198.36
6. 其他费用	509,608.64	463,072.76
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	69,421,317.60	53,061,912.04
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	69,421,317.60	53,061,912.04

7.3 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日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31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)	-	69,421,317.60	69,421,317.60
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)	2,745,894,424.21	-	2,745,894,424.21
其中:1.基金申购款	12,258,844,302.31	-	12,258,844,302.31
2.基金赎回款	-9,512,949,878.10	-	-9,512,949,878.10
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)	-	-69,421,317.60	-69,421,317.60
五、期末所有者权益(基金净值)	3,814,130,437.23	-	3,814,130,437.23
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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)	-	53,061,912.04	53,061,912.04
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)	290,520,302.27	-	290,520,302.27
其中:1.基金申购款	8,294,615,661.85	-	8,294,615,661.85
2.基金赎回款	-8,004,095,359.58	-	-8,004,095,359.58
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)	-	-53,061,912.04	-53,061,912.04
五、期末所有者权益(基金净值)	1,068,236,013.02	-	1,068,236,013.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 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)。

7.4.2 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>》、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。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.7 关联方关系

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
安信乾正股权投资管理(深圳)有限公司	基金管理人子公司的子公司

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) 本基金管理人的子公司安信乾盛财富管理(深圳)有限公司于2015年11月3日设立了全资子公司安信乾正股权投资管理(深圳)有限公司。

3) 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 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日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
安信证券	250,400,000.00	100.00%	286,781,000.00	100.00%

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,798,702.16	3,648,411.85
其中:支付销售机构的客户维护费	998,533.10	1,174,320.65

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,060,212.76	1,105,579.53

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

7.4.8.2.3 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日至2015年12月31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
建设银行	288,871.35	17,881.00	306,752.35
安信基金直销	23,681.96	120,962.87	144,644.83
安信证券	66,124.46	2,309.62	68,434.08
合计	378,677.77	141,153.49	519,831.26
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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
建设银行	498,002.33	17,107.99	515,110.32
安信基金直销	25,506.73	35,087.59	60,594.32
安信证券	108,090.69	4,138.08	112,228.77
合计	631,599.75	56,333.66	687,933.41

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到B类条件的开放日后的下一个工作日起享受B类基金份额持有人的费率。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下:

H=E×销售服务费年费率÷当年天数

H为每日该类基金份额应计提的销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	49,987,500.00	-	-	-	-	-

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.4.10.4.1.1安信现金管理货币A

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额(注)	10,073.00	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额(注)	8,873.00	-
期末持有的基金份额	1,200.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	-

注:期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额;期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

7.4.10.4.1.2安信现金管理货币B

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安信现金管理货币B。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	3,896,412.38	78,831.71	20,794,986.79	126,719.94

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。上述当期利息收入中包含了本基金资金托管账户利息收入和对手方为中国建设银行的协议存款利息收入。

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止,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余额为149,999,725.00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
041551065	15扬子大桥CP001	2016年1月4日	99.94	300,000	29,980,554.70
041560006	15昌源水务CP001	2016年1月4日	100.92	400,000	40,366,736.86
041560096	15津临港CP001	2016年1月4日	99.94	300,000	29,983,085.82
041568006	15津旅游CP001	2016年1月4日	100.09	300,000	30,026,728.96
041569039	15空港科技CP001	2016年1月4日	99.97	200,000	19,993,054.45
合计				1,500,000	150,350,160.79

7.4.9.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券余额为0元,无质押债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.3财务报表的批准

本财务报表已于2016年3月22日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 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	2,326,539,088.52	58.66
	其中:债券	2,326,539,088.52	58.66
	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	1,550,896,412.38	39.11
4	其他各项资产	88,372,207.17	2.23
5	合计	3,965,807,708.07	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

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	9.15	
	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	149,999,725.00	3.93
	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	2015年3月2日	22.01	大额赎回	2个交易日
2	2015年3月3日	21.19	大额赎回	1个交易日

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	133
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限(天数)	原因	调整期
1	2015年1月4日	125	大额赎回	4个交易日
2	2015年1月5日	126	大额赎回	3个交易日
3	2015年1月6日	133	大额赎回	2个交易日
4	2015年1月7日	125	大额赎回	1个交易日
5	2015年2月5日	122	大额赎回	2个交易日
6	2015年2月6日	123	大额赎回	1个交易日
7	2015年12月11日	126	大额赎回	1个交易日
8	2015年12月28日	124	大额赎回	2个交易日
9	2015年12月29日	124	大额赎回	1个交易日

注:本报告期内本基金未出现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。

8.3.2 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	15.84	3.93
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	6.21	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	38.64	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	22.80	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	18.16	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	101.66	3.93

8.4 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	187,485,550.27	4.92
	其中:政策性金融债	187,485,550.27	4.92
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,142,211,744.45	29.95
6	中期票据	-	-
7	同业存单	996,841,793.80	26.14
8	其他	-	-
9	合计	2,326,539,088.52	61.00
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

8.5 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

金额单位:人民币元

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	041562031	15云投CP001	1,000,000	100,496,861.99	2.63
2	111507133	15招行CD133	1,000,000	99,392,642.45	2.61
3	111592954	15广州银行CD032	1,000,000	99,391,513.46	2.61
4	111519104	15恒丰银行CD104	1,000,000	99,329,215.50	2.60
5	111593340	15苏州银行CD024	1,000,000	99,258,609.11	2.60
6	111593215	15郑州银行CD063	1,000,000	98,430,270.79	2.58
7	111592231	15广州农村商业银行CD020	1,000,000	97,147,944.33	2.55
8	011582002	15太钢SCP002	900,000	89,971,475.30	2.36
9	140311	14进出11	600,000	60,211,181.34	1.58
10	071525007	15国都证券CP007	600,000	59,989,251.46	1.57

8.6 "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	19
报告期内偏离度的最高值	0.4089%
报告期内偏离度的最低值	0.0474%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1331%

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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。

8.8.2 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。

8.8.3 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。

8.8.4 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	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

§9 基金份额持有人信息

9.1 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		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
安信现金管理货币A	3,488	114,111.97	14,925,846.12	3.75%	383,096,717.02	96.25%
安信现金管理货币B	57	59,931,717.09	3,152,384,346.21	92.28%	263,723,527.88	7.72%
合计	3,545	1,075,918.32	3,167,310,192.33	83.04%	646,820,244.90	16.96%

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)。

9.2 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	安信现金管理货币A	208,984.26	0.0525%
	安信现金管理货币B	-	-
	合计	208,984.26	0.0055%

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)。

9.3 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的情况

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	安信现金管理货币A	0~10
	安信现金管理货币B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	安信现金管理货币A	0
	安信现金管理货币B	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

	安信现金管理货币A	安信现金管理货币B
基金合同生效日(2013年2月5日)基金份额总额	1,175,384,651.29	364,870,291.59
本报告期期初基金份额总额	413,836,589.61	654,399,423.41
本报告期基金总申购份额	1,793,847,879.44	10,464,996,422.87
减:本报告期基金总赎回份额	1,809,661,905.91	7,703,287,972.19
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	398,022,563.14	3,416,107,874.09

注:总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本基金管理人于2015年1月9日发布公告,聘任乔江晖女士为安信基金管理有限责任公司督察长,孙晓奇先生不再担任安信基金管理有限责任公司督察长;聘任孙晓奇先生为安信基金管理有限责任公司副总经理,汪建先生不再担任安信基金管理有限责任公司副总经理。

本基金管理人于2015年12月31日发布公告,聘任王连志先生为安信基金管理有限责任公司董事长,牛冠兴先生不再担任安信基金管理有限责任公司董事长。

本基金托管人2015年1月4日发布任免通知,聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

本基金托管人2015年9月18日发布任免通知,解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。目前安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)已为本基金提供审计服务3年,本报告期应支付的报酬为人民币100,000元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-

注:公司制定《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》,对选择证券公司的标准和程序,以及佣金分配规则进行了规定。

根据上述制度,由公司基金投资部、固定收益部、研究部、特定资产管理部、分管投资的副总经理及交易室于每季度末对券商进行综合评分,评价标准包括研究及投资建议的质量、报告的及时性、服务质量、交易成本等,由公司基金投资决策委员会根据评分结果对下一季度的证券公司名单及佣金分配比例做出决议。首只基金成立后最初半年的券商选择及佣金分配由基金投资决策委员会决定。

11.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	250,400,000.00	100.00%	-	-

11.8 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。

安信基金管理有限责任公司

2016年3月25日