

安信现金管理货币市场基金 2018 年年度报告摘要

2018 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：2019 年 03 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 2019 年 03 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 2018 年 01 月 01 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	5,942,133,204.83 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	142,706,832.57 份	5,799,426,372.26 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	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4008-088-088	010-67595096
传真		0755-82799292	010-66275853

§ 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	2018 年		2017 年		2016 年	
	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	6,943,226.31	260,261,251.89	3,780,979.34	295,950,839.94	3,707,235.60	274,678,525.47
本期利润	6,943,226.31	260,261,251.89	3,780,979.34	295,950,839.94	3,707,235.60	274,678,525.47
本期净值收益率	3.4536%	3.7034%	3.6082%	3.8560%	2.5434%	2.7909%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
期末基金资产净值	142,706,832.57	5,799,426,372.26	642,082,106.97	5,436,814,688.54	104,823,261.58	15,193,960,669.00
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	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	0.6629%	0.0021%	0.3403%	0.0000%	0.3226%	0.0021%
过去六个	1.4576%	0.0030%	0.6805%	0.0000%	0.7771%	0.0030%
过去一年	3.4536%	0.0027%	1.3500%	0.0000%	2.1036%	0.0027%
过去三年	9.9126%	0.0030%	4.0537%	0.0000%	5.8589%	0.0030%
过去五年	19.6606%	0.0075%	6.7537%	0.0000%	12.9069%	0.0075%
自基金合 同生效起 至今	23.8518%	0.0071%	7.9742%	0.0000%	15.8776%	0.0071%

安信现金管理货币 B

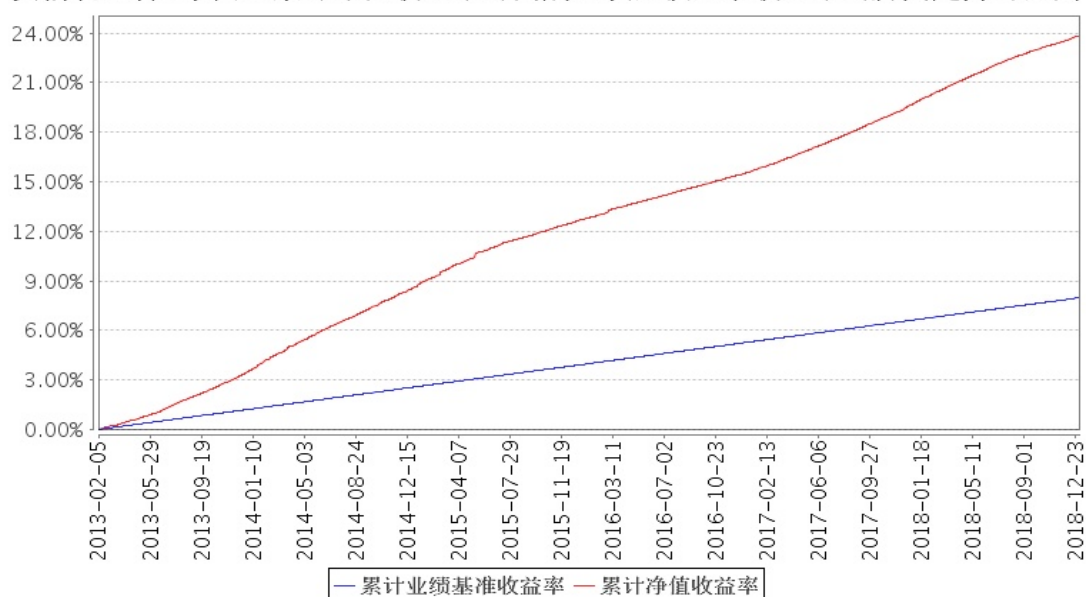
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个	0.7240%	0.0021%	0.3403%	0.0000%	0.3837%	0.0021%
过去六个	1.5806%	0.0030%	0.6805%	0.0000%	0.9001%	0.0030%
过去一年	3.7034%	0.0028%	1.3500%	0.0000%	2.3534%	0.0028%
过去三年	10.7080%	0.0030%	4.0537%	0.0000%	6.6543%	0.0030%
过去五年	21.1067%	0.0075%	6.7537%	0.0000%	14.3530%	0.0075%
自基金合 同生效起 至今	25.6213%	0.0071%	7.9742%	0.0000%	17.6471%	0.0071%

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

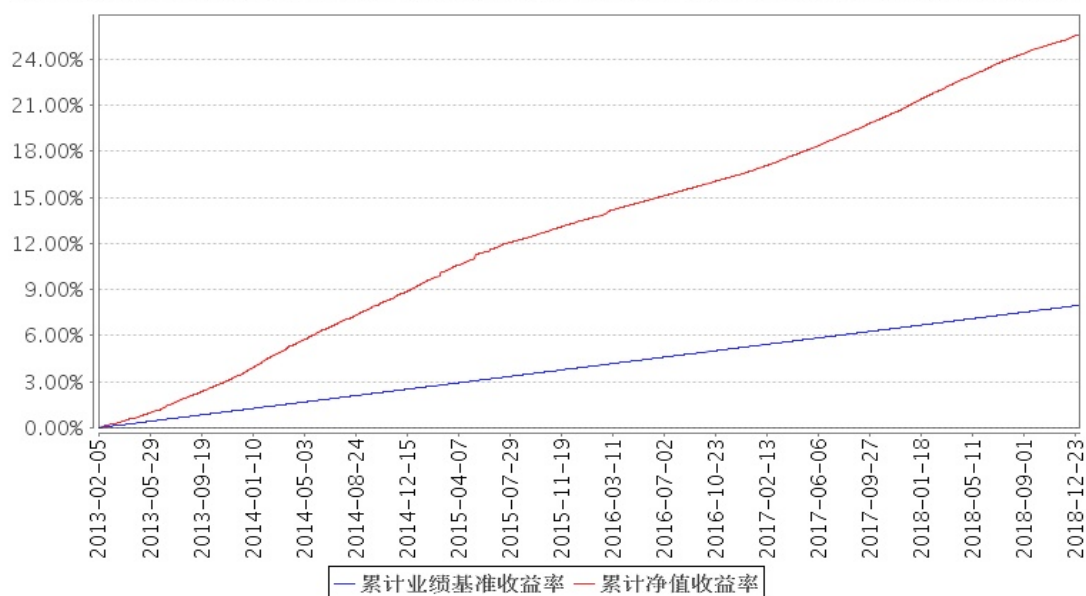
比较基准：七天通知存款利率(税后)。通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。

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

安信现金管理货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安信现金管理货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

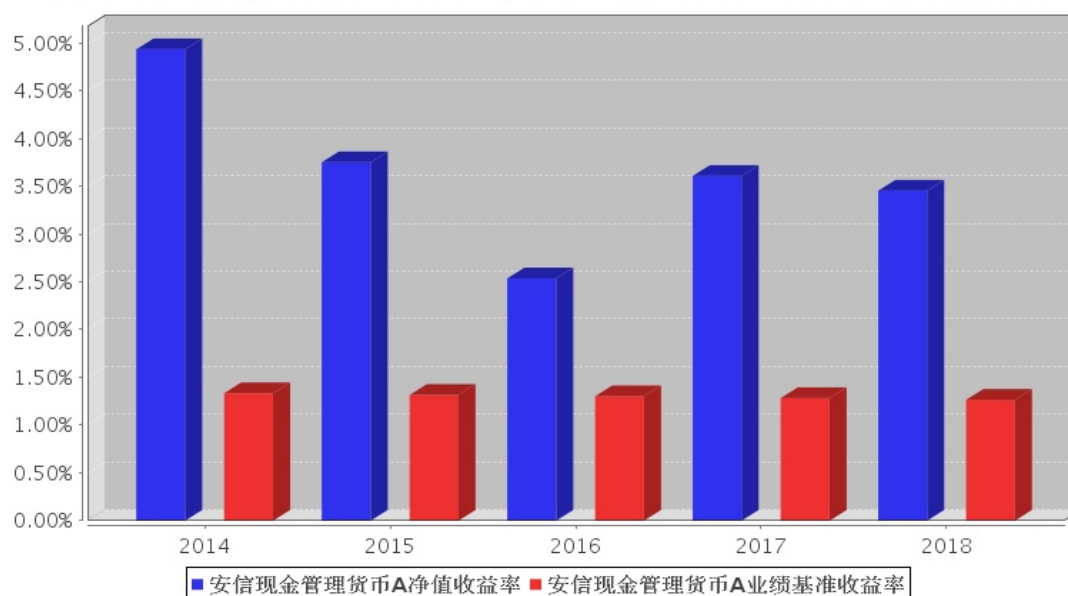


注：1、本基金基金合同生效日为 2013 年 2 月 5 日。

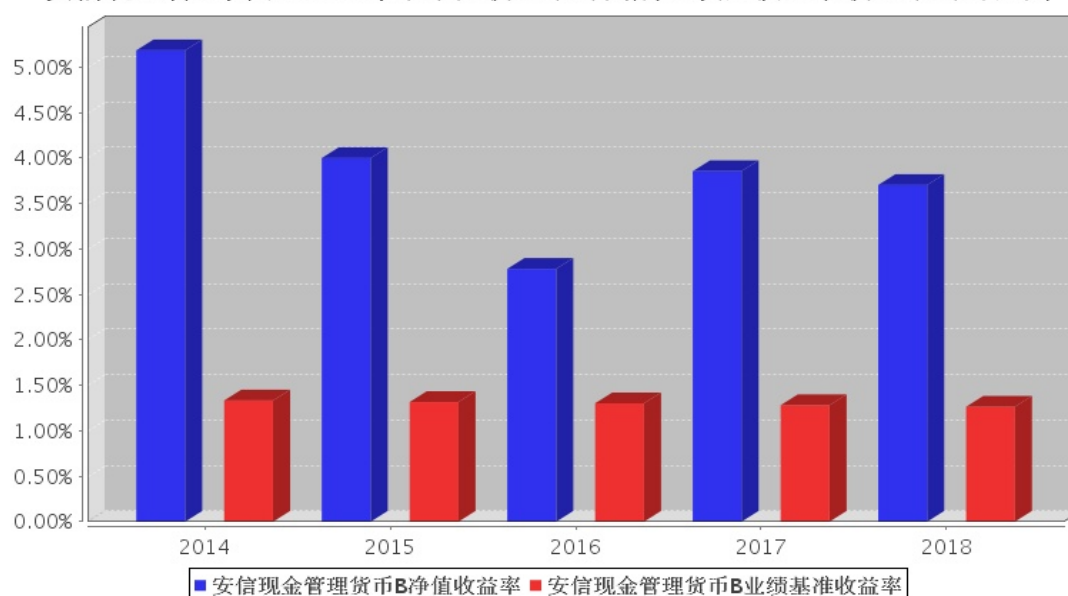
2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.2.3 过去五年基金每年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基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



安信现金管理货币B基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位: 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
2018 年	7,132,394.03	-	-189,167.72	6,943,226.31	-
2017 年	3,570,012.57	-	210,966.77	3,780,979.34	-
2016 年	3,713,918.71	-	-6,683.11	3,707,235.60	-
合计	14,416,325.31	-	15,115.94	14,431,441.25	-

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
2018 年	260,541,349.68	-	-280,097.79	260,261,251.89	-
2017 年	296,693,263.38	-	-742,423.44	295,950,839.94	-
2016 年	272,122,900.65	-	2,555,624.82	274,678,525.47	-
合计	829,357,513.71	-	1,533,103.59	830,890,617.30	-

§ 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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 45 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 日至 2018 年 9 月 26 日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证券投资基金；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；从 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；从 2018 年 9 月 3 日起管理安信量化优选股票型发起式证券投资基金；从 2018 年 9 月 26 日起管理安信恒利增强债券型证券投资基金；从 2018 年 11 月 29 日起管理安信中证 500 指数增强型证券投资基金；从 2018 年 12 月 7 日起管理安信优享纯债债券型证券投资基金。

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		
肖芳芳	本基金的基金经理	2017 年 6 月 6 日	-	7	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，安信保证金交易型货币市场基金的基金经理；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。
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	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、安信保证金交易型货币市场基金的基金经理；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、安信现金管理货币市场基金、安信活期宝货币市场基金、安信恒利增强债券型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	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、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、安信活期宝证券投资基金的基金、安信恒利增强债券型证券投资基金的基金经理助理。
任凭	本基金的基金	2017 年 5 月 15 日	-	11	任凭女士，法学硕士。曾任职于招商基金管理有限公司，2011 年加入安信基金

	经 理 助 理				管理有限责任公司，历任运营部交易员、固定收益部投研助理，现任固定收益部基金经理。曾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、安信现金增利货币市场基金的基金经理助理；现任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的基金经理助理，安信活期宝货币市场基金、安信现金增利货币市场基金的基金经理。
--	------------	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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

2018 年，宏观方面，GDP 同比增长、投资累积增速、社会融资总量存量增速不断下滑，消费增速也回落到 10%以内，贸易顺差额也较去年明显收窄，经济下行压力较大；微观方面，企业盈利普遍出现下滑，由于监管去杠杆、去刚兑的政策，部分民营企业出现了资金链断裂的风险。在上述背景下，去杠杆政策趋缓，央行进行了 3 次降低存款准备金率的操作，财政部督促各地方政府加大地方政府专项债发行的力度，银保监会、证监会等机构配合出台了一系列托底中小企业融资的政策。几乎所有的政策指向宽货币+宽信用，但是由于信用传导的旧途径已经被阻塞、信用传导不畅通导致宽信用难以实施，引发了无风险利率的大幅下行和中高评级信用债收益率的大幅下行。

2018 年 shibor 各期限利率不断下台阶，本基金在前三季度维持了季末月配置较高收益资产的策略，在四季度置换为始终维持长久期策略，总的来说，保持了相对较高的静态收益，为新一年奠定了良好的基础。

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 3.4536%，本报告期安信现金管理货币 B 的基金份额净值收益率为 3.7034%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对 2019 年的判断是，经济基本面情况，尤其在投资、净出口等方面的增速大概率会进一步走低，宏观基本面情况要弱于 2018 年，因此货币政策边际上仍然要维持一个适度的宽松。

此前对于货币政策最大的制约因素是外围环境。美国加息、缩表等计划制约了利率水平的进一步降低。但目前可得信息，美国经济正处于本轮周期见顶阶段，加息、缩表政策都尚有未知变数，外围的压力正在逐渐减小。总的来说，我们认为宽松的货币政策将延续，我们将把握季节波动，充分利用久期，获取高的静态组合收益，同时警惕货币政策转向的风险。

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 267,204,478.20 元，其中本基金 A 类共分配人民币 6,943,226.31 元，B 类共分配人民币 260,261,251.89 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关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 267,204,478.20 元，其中本基金 A 类共分配人民币 6,943,226.31 元，B 类共分配人民币

260,261,251.89 元，不存在应分配但尚未实施分配的情况。

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（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 审计报告

本基金 2018 年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 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：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	15,830,584.08	85,503,086.58
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	5,914,576,934.25	5,663,580,963.85
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	5,814,576,934.25	5,653,551,386.35
资产支持证券投资	100,000,000.00	10,029,577.50
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	355,940,903.91	642,563,053.90
应收证券清算款	-	-
应收利息	12,607,116.23	16,873,317.88
应收股利	-	-
应收申购款	-	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	6,298,957,379.47	6,484,472,717.25
负债和所有者权益	本期末 2018 年 12 月 31 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	351,884,112.17	400,898,998.65
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	1,785,394.67	1,336,467.56
应付托管费	541,028.69	404,990.14
应付销售服务费	85,474.87	86,675.49
应付交易费用	93,334.91	94,092.37
应交税费	115,950.67	-
应付利息	192,106.16	158,659.52
应付利润	1,804,439.17	2,273,704.68
递延所得税负债	-	-
其他负债	322,333.33	322,333.33
负债合计	356,824,174.64	405,575,921.74
所有者权益:		
实收基金	5,942,133,204.83	6,078,896,795.51
未分配利润	-	-
所有者权益合计	5,942,133,204.83	6,078,896,795.51
负债和所有者权益总计	6,298,957,379.47	6,484,472,717.25

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 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。本基金份额总额 5,942,133,204.83 份，其中 A 类基金份额 142,706,832.57 份，B 类基金份额 5,799,426,372.26 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	320,938,162.17	350,704,076.84
1. 利息收入	316,915,604.31	344,900,435.90
其中：存款利息收入	31,242,524.83	55,171,949.29
债券利息收入	250,165,372.58	231,720,780.35
资产支持证券利息收	3,091,767.38	9,237,583.11

入		
买入返售金融资产收入	32,415,939.52	48,770,123.15
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	4,022,557.86	5,803,065.60
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,023,149.69	5,175,631.59
资产支持证券投资收益	-591.83	627,434.01
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）	-	575.34
减：二、费用	53,733,683.97	50,972,257.56
1. 管理人报酬	24,588,352.83	27,192,045.59
2. 托管费	7,451,016.03	8,240,013.69
3. 销售服务费	1,230,469.91	1,067,631.45
4. 交易费用	99.50	1,597.10
5. 利息支出	19,872,856.53	13,950,679.42
其中：卖出回购金融资产支出	19,872,856.53	13,950,679.42
6. 税金及附加	74,739.62	-
7. 其他费用	516,149.55	520,290.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	267,204,478.20	299,731,819.28
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	267,204,478.20	299,731,819.28

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	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）	-	267,204,478.20	267,204,478.20
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）	-136,763,590.68	-	-136,763,590.68
其中：1. 基金申购款	32,778,288,054.95	-	32,778,288,054.95
2. 基金赎回款	-32,915,051,645.63	-	-32,915,051,645.63
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）	-	-267,204,478.20	-267,204,478.20
五、期末所有者权益（基金净值）	5,942,133,204.83		5,942,133,204.83
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	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）	-	299,731,819.28	299,731,819.28
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）	-9,219,887,135.07	-	-9,219,887,135.07
其中：1. 基金申购款	46,658,612,684.19	-	46,658,612,684.19
2. 基金赎回款	-55,878,499,819.26	-	-55,878,499,819.26
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）	-	-299,731,819.28	-299,731,819.28
五、期末所有者权益（基金净值）	6,078,896,795.51	-	6,078,896,795.51

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

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

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币 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《安信现金管理货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为现金、通知存款、短期融资券、1 年以内（含 1 年）的银行定期存款、大额存单、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的中期票据、期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购、期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据以及中国证监会认可的其他具有良好流动性的金融工具。

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《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。

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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 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 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 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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。

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
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（以下简称“中广核财务”）	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司（以下简称“安信乾盛”）	基金管理人的子公司

注：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 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 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。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	24,588,352.83	27,192,045.59
其中：支付销售机构的客户维护费	1,351,970.50	199,515.75

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,451,016.03	8,240,013.69

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

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	本期
-------------	----

方名称	2018 年 1 月 1 日至 2018 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
中国建设银行	76,732.30	950.16	77,682.46
安信基金	102,096.76	636,793.45	738,890.21
安信证券	250,541.49	27,017.02	277,558.51
合计	429,370.55	664,760.63	1,094,131.18
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 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
中国建设银行	74,876.08	—	74,876.08
安信基金	64,852.43	800,615.73	865,468.16
安信证券	47,334.76	1,027.31	48,362.07
合计	187,063.27	801,643.04	988,706.31

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：

$H = E \times \text{销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$

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

本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

份额单位：份

项目	本期
	2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日

	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）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	—	156,060,945.20
报告期间申购/买入总份额	—	275,435,747.29
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	288,000,000.00
报告期末持有的基金份额	—	143,496,692.49
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	2.41%
项目	上年度可比期间 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日
	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）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	—	—
报告期间申购/买入总份额	—	251,060,945.20
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	95,000,000.00
报告期末持有的基金份额	—	156,060,945.20
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	2.57%

注：期间申购/买入总份额含红利再投份额；期间赎回/卖出总份额含转换出份额。本基金管理人运用固有资金投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

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

安信现金管理货币 B

关联方名称	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 （%）
安信证券	—	0.00	501,026,911.44	8.24
中广核财务	50,397,231.06	0.85	—	—
安信乾盛	10,837,428.85	0.18	—	—

注:本基金其他关联方投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	15,830,584.08	100,171.55	5,503,086.58	154,631.17

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按约定利率计息。

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均无需说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2018 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股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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余额为人民币 351,884,112.17 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
111809289	18 浦发银行	2019-01-02	99.25	1,025,000	101,732,234.03

	CD289				
130213	13 国开 13	2019-01-04	100.28	520,000	52,146,956.31
160309	16 进出 09	2019-01-02	99.49	2,025,000	201,473,846.06
合计				3,570,000	355,353,036.40

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1 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。

7.4.10.2 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。

7.4.10.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 3 月 27 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	5,914,576,934.25	93.90
	其中：债券	5,814,576,934.25	92.31
	资产支持证券	100,000,000.00	1.59
2	买入返售金融资产	355,940,903.91	5.65
	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	15,830,584.08	0.25
4	其他各项资产	12,608,957.23	0.20
5	合计	6,298,957,379.47	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	9.38	
	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	351,884,112.17	5.92
	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	2018-01-04	20.75	大额赎回	5 个交易日
2	2018-01-05	20.86	大额赎回	4 个工作日
3	2018-01-08	25.75	大额赎回	3 个工作日

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	77
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	86
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	27

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期末未出现投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

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	7.94	5.92
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.34	—
2	30 天（含）—60 天	30.84	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	4.69	—
3	60 天（含）—90 天	55.12	—
	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）	11.89	—

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		105.79	5.92

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期末未出现投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

8.5 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	1,370,008,864.62	23.06
	其中：政策性金融债	1,370,008,864.62	23.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	130,061,105.80	2.19
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,314,506,963.83	72.61
8	其他	-	-
9	合计	5,814,576,934.25	97.85
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	358,433,036.84	6.03

8.6 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：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	111809289	18 浦发银行 CD289	4,400,000	436,704,224.15	7.35
2	120227	12 国开 27	4,200,000	421,061,311.26	7.08
3	160309	16 进出 09	2,800,000	278,581,120.48	4.69
4	111809276	18 浦发银行 CD276	2,500,000	248,277,846.71	4.18
5	160305	16 进出 05	2,000,000	200,503,330.93	3.37
6	111821367	18 渤海银行 CD367	2,000,000	198,875,935.02	3.35
7	111819365	18 恒丰银行 CD365	2,000,000	198,869,967.66	3.35
8	111820219	18 广发银行 CD219	2,000,000	195,675,253.64	3.29
9	180404	18 农发 04	1,500,000	150,086,023.66	2.52
10	111819360	18 恒丰银行 CD360	1,500,000	149,152,249.46	2.51

8.7 “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	0.1886%
报告期内偏离度的最低值	-0.0693%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0664%

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。

8.8 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	156288	宁远 07A1	1,000,000	100,000,000.00	1.68

8.9 投资组合报告附注

8.9.1

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。

8.9.2

本基金投资的前十名证券的发行主体除 18 浦发银行 CD289（证券代码：111809289 CY，对应上市公司为浦发银行，股票代码：600000）、18 浦发银行 CD276（证券代码：111809276 CY，对应上市公司为浦发银行，股票代码：600000）、18 渤海银行 CD367（证券代码：111821367 CY）、18 恒丰银行 CD360（证券代码：111819360 CY）、18 恒丰银行 CD365（证券代码：111819365 CY），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。

上海浦东发展银行股份有限公司于 2018 年 8 月 1 日收到中国人民银行处罚决定书（银反洗罚决字（2018）3 号）。因浦发银行未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资

料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、存在与身份不明的客户进行交易的行为等，根据《中华人民共和国反洗钱法》对浦发银行合计处以 170 万元罚款，并根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（一）项、第（二）项、第（三）项和第（四）项规定，对相关责任人共处以 18 万元罚款。

上海浦东发展银行股份有限公司于 2018 年 2 月 12 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书（银监罚决字〔2018〕4 号），因内控管理严重违反审慎经营规则，被予以罚款 5845 万元，没收违法所得 10.927 万元，罚没合计 5855.927 万元。

渤海银行股份有限公司于 2018 年 11 月 9 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〕9 号），因内控管理严重违反审慎经营规则，理财及自营投资资金违规用于缴交土地款等行为，被罚款 2350 万元。

恒丰银行股份有限公司于 2018 年 4 月 28 日受中国银行间市场交易商协会约见谈话，因尽职调查工作不充分，访谈纪要信息不完备等行为，被中国银行间市场交易商协会给予诫勉谈话处分，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

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。

8.9.3 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	12,607,116.23
4	应收申购款	-
5	其他应收款	1,841.00
6	待摊费用	-
7	合计	12,608,957.23

8.9.4 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。

§ 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		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	4,317	33,056.95	54,888,944.70	38.46	87,817,887.87	61.54
安信现金 管理货币 B	70	82,848,948.18	5,732,119,971.03	98.84	67,306,401.23	1.16
合计	4,387	1,354,486.71	5,787,008,915.73	97.39	155,124,289.10	2.61

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	华夏人寿保险股份有限公司-资本补充债	308,456,467.33	5.19
2	中国大地财产保险股份有限公司	302,663,478.83	5.09
3	中国人寿再保险有限责任公司	302,643,511.56	5.09
4	安信基金工商银行安信证券2号资产管理计划	300,047,880.83	5.05
5	深圳市富德前海基础设施投资控股有限公司	299,882,374.01	5.05
6	中欧名选1号资产管理计划	298,425,003.83	5.02
7	中融国际信托有限公司-鑫瑞1号	211,162,346.78	3.55
8	华夏人寿保险股份有限公司-传统	207,096,774.17	3.49
9	安信乾宏投资有限公司	206,304,230.72	3.47
10	中融国际信托有限公司-唐昇1号	200,610,160.58	3.38

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)。

9.3 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	安信现金管理货币A	164,197.78	0.1151
	安信现金管理货币B	-	-
	合计	164,197.78	0.0028

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)。

9.4 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

项目	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	642,082,106.97	5,436,814,688.54
本报告期基金总申购份额	698,703,643.51	32,079,584,411.44
减：本报告期基金总赎回份额	1,198,078,917.91	31,716,972,727.72
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	142,706,832.57	5,799,426,372.26

§ 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

本报告期内本基金基金管理人、托管人无重大人事变动。

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。本年度应支付的审计费为人民币 110,000.00 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、托管人的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	
安信证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
西藏东财	2	-	-	-	-	新租
中信证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

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。

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
安信证券	70,270,500.00	100.00%	3,271,400,000.00	100.00%	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

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。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

无。

12.2 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

2019 年 03 月 29 日