
交银施罗德活期货币市场基金
2018 年年度报告摘要
2018 年 12 月 31 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年三月二十七日

§ 1 重要提示

1.1 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。

基金托管人中信建投证券股份有限公司(以下简称“中信建投”)根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 26 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。

本报告期自 2018 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	交银活期货币	
基金主代码	003042	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 7 月 27 日	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	38,698,496,665.38 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	交银活期货币 A	交银活期货币 E
下属分级基金的交易代码	003042	003043
报告期末下属分级基金的份 额总额	21,397,072,050.70 份	17,301,424,614.68 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力求本金安全性和资产充分流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在保持组合高度流动性的前提下，结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析，合理安排组合期限结构，积极选择投资工具，采取主动性的投资策略和精细化的操作手法。
业绩比较基准	活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金属于货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

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	交银施罗德基金管理有 限公司	中信建投证券股份有限公 司

信息披露 负责人	姓名	王晚婷	朱志明
	联系电话	(021) 61055050	4008-888-108
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	service@csc.com.cn
客户服务电话		400-700-5000, 021-61055000	95587
传真		(021) 61055054	010-85130975

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.fund001.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

§ 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 7 月 27 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日	
	交银活期通 货币 A	交银活期通 货币 E	交银活期通 货币 A	交银活期通 货币 E	交银活期通 货币 A	交银活期通 货币 E
本期已实现收益	709,597,201.15	465,201,589.23	183,743,134.07	96,204,671.50	4,179,461.66	2,770,254.48
本期利润	709,597,201.15	465,201,589.23	183,743,134.07	96,204,671.50	4,179,461.66	2,770,254.48
本期净值收益率	3.57%	3.82%	3.81%	4.05%	1.05%	1.15%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
	交银活期通 货币 A	交银活期通 货币 E	交银活期通 货币 A	交银活期通 货币 E	交银活期通 货币 A	交银活期通 货币 E
期末基金资产净值	21,397,072,050.70	17,301,424,614.68	10,949,621,912.61	13,008,533,546.24	1,147,534,802.24	608,458,380.83

期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000
----------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

注：1、本基金申购赎回费为零。

2、本基金收益分配按日结转份额。

3、本基金实行销售服务费分类收费方式，分设 A 类基金份额和 E 类基金份额，A 类基金份额与 E 类基金份额的管理费、托管费相同，A 类基金份额按照 0.25% 的年费率计提销售服务费，E 类基金份额按照 0.01% 的年费率计提销售服务费。

4、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，因此，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 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. 交银活期货币 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	0.6892%	0.0005%	0.0882%	0.0000%	0.6010%	0.0005%
过去六个月	1.5417%	0.0012%	0.1764%	0.0000%	1.3653%	0.0012%
过去一年	3.5695%	0.0016%	0.3500%	0.0000%	3.2195%	0.0016%
自基金合同生效起至今	8.6401%	0.0019%	0.8515%	0.0000%	7.7886%	0.0019%

注：本基金的业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

2. 交银活期货币 E:

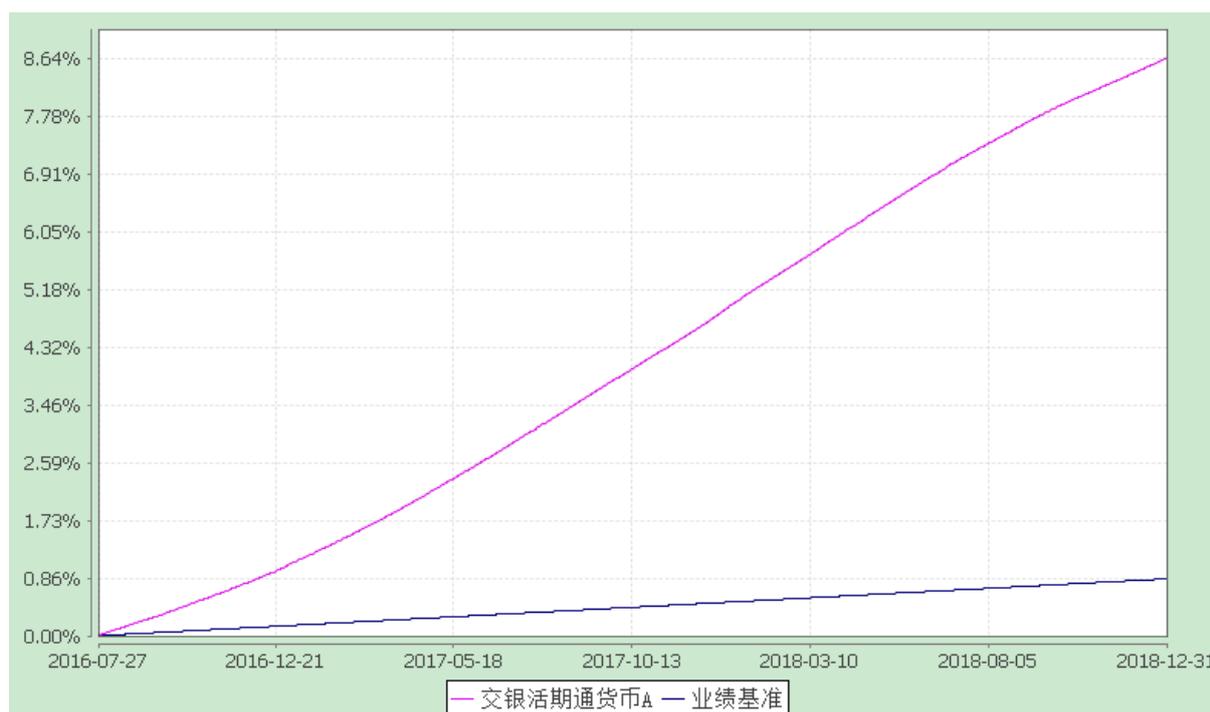
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7503%	0.0005%	0.0882%	0.0000%	0.6621%	0.0005%
过去六个月	1.6647%	0.0012%	0.1764%	0.0000%	1.4883%	0.0012%

过去一年	3.8178%	0.0016%	0.3500%	0.0000%	3.4678%	0.0016%
自基金合同生效起至今	9.2676%	0.0019%	0.8515%	0.0000%	8.4161%	0.0019%

注：本基金的业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

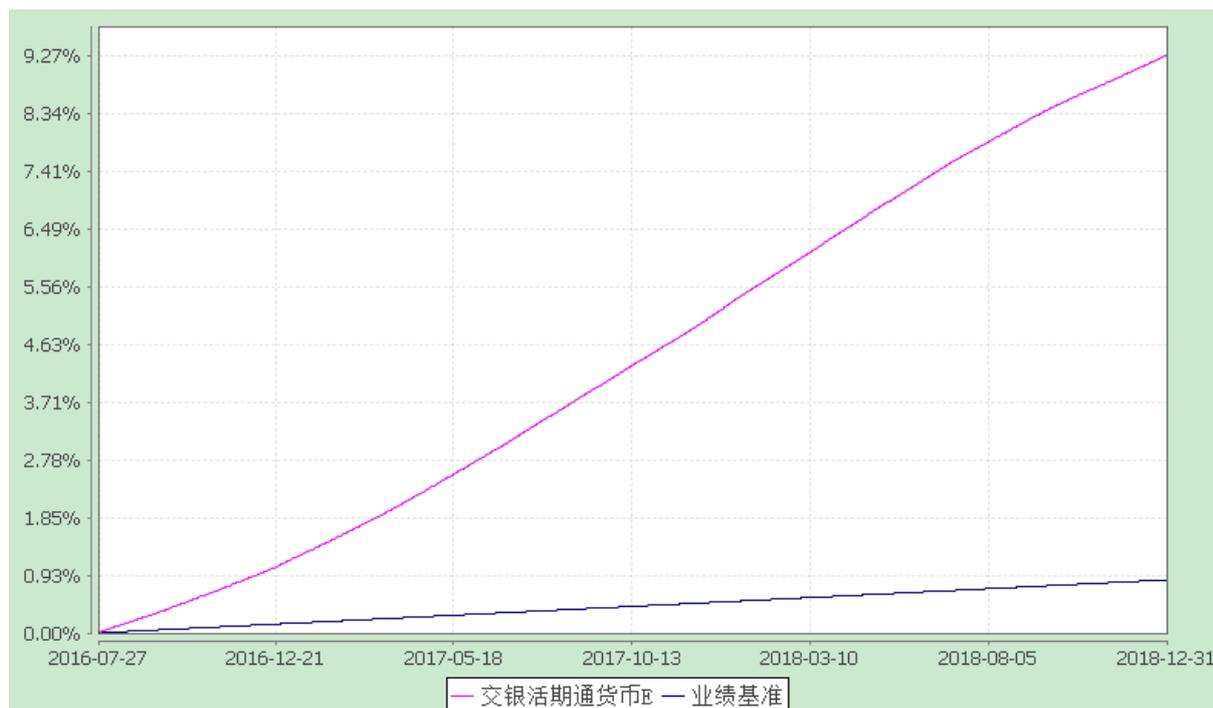
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

1、交银活期货币 A



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

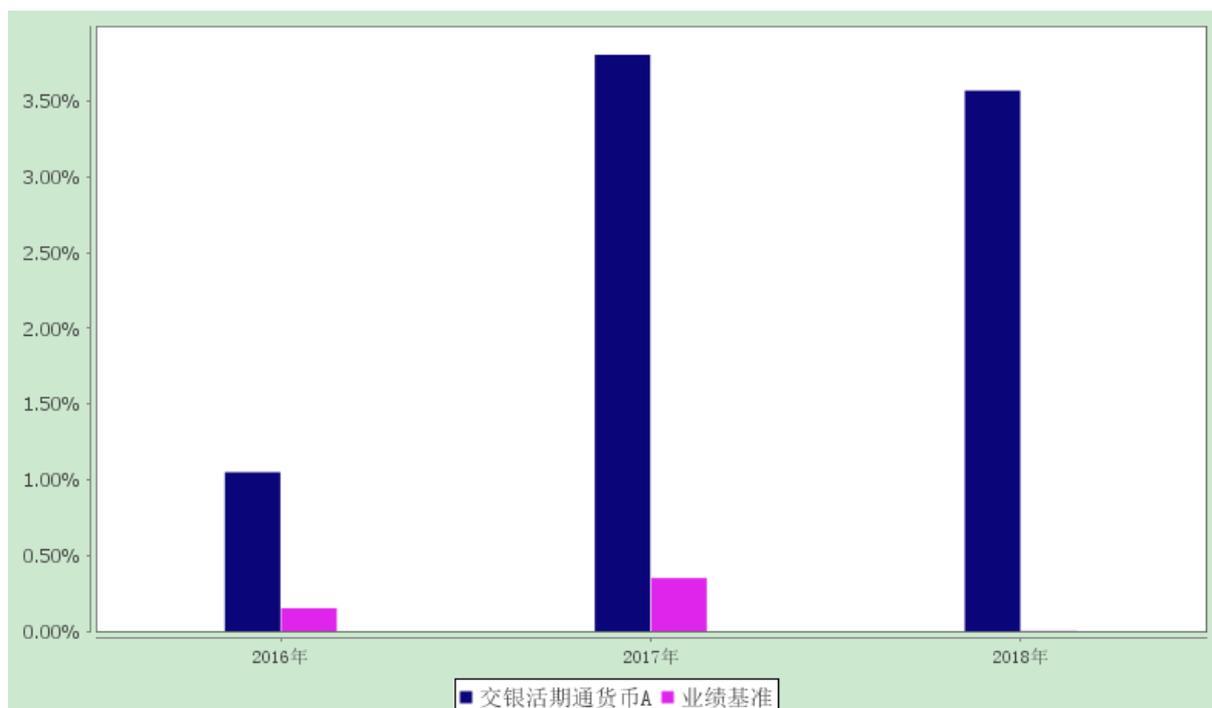
2、交银活期货币 E



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

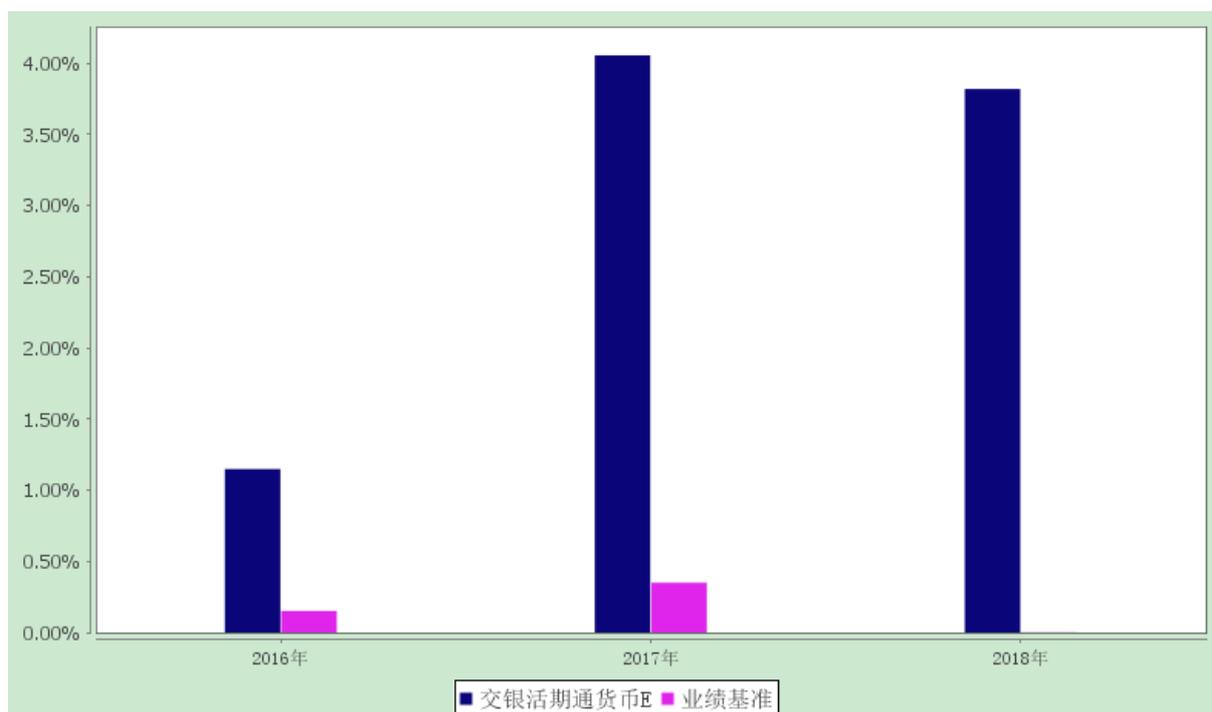
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、交银活期货币 A



注：图示日期为 2016 年 7 月 27 日至 2018 年 12 月 31 日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。

2、交银活期货币 E



注：图示日期为 2016 年 7 月 27 日至 2018 年 12 月 31 日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

交银活期货币 A:

单位：人民币元

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	709,299,842.43	-	297,358.72	709,597,201.15	-
2017 年	182,482,781.91	-	1,260,352.16	183,743,134.07	-
2016 年	4,069,863.95	-	109,597.71	4,179,461.66	-
合计	895,852,488.29	-	1,667,308.59	897,519,796.88	-

交银活期货币 E:

单位：人民币元

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	465,452,742.09	-	-251,152.86	465,201,589.23	-
2017 年	94,553,699.87	-	1,650,971.63	96,204,671.50	-
2016 年	2,708,152.89	-	62,101.59	2,770,254.48	-
合计	562,714,594.85	-	1,461,920.36	564,176,515.21	-

§ 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

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128 号文批准，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司共同发起设立。公司成立于 2005 年 8 月 4 日，注册地在中国上海，注册资本为 2 亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有 65% 的股份，施罗德投资管理有限公司持有 30% 的股份，中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司持有 5% 的股份。公司并下设交银施罗德资产管理（香港）有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、保本混合型、普通混合型和股票型在内的 77 只基金，其中股票型涵盖普通指数型、交易型开放式（ETF）、QDII 等不同类型基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
连端清	交银货币、交银理财 60 天债券、交银丰盈	2016-07-27	-	5 年	连端清先生，复旦大学经济学博士。历任交通银行总行金融市场部、湘财证券研究所研究员、中航信托资产管理部投资经理。

	收益债券、交银现金宝货币、交银丰润收益债券、交银活期货币、交银天利宝货币、交银裕盈纯债债券、交银裕利纯债债券、交银裕隆纯债债券、交银天鑫宝货币、交银天益宝货币、交银境尚收益债券、交银天运宝货币的基金经理				2015 年加入交银施罗德基金管理有限公司。2017 年 3 月 31 日至 2018 年 8 月 23 日担任交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金的基金经理。
黄莹洁	交银货币、交银理财 21 天债券、交银现金宝货币、交银丰享收益债券、交银裕通纯债	2016-07-27	-	10 年	黄莹洁女士，香港大学工商管理硕士、北京大学经济学、管理学双学士。历任中海基金管理有限公司交易员。2012 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任中央交易室交易员。2015 年 7 月 25 日至 2018 年 3 月 18 日担任交银施罗德丰泽收

	债券、交银活期货币、交银天利宝货币、交银裕隆纯债债券、交银天鑫宝货币、交银天益宝货币、交银境尚收益债券的基金经理				益债券型证券投资基金的基金经理。
季参平	交银货币、交银理财 21 天债券、交银理财 60 天债券、交银现金宝货币、交银活期货币、交银天利宝货币、交银裕隆纯债债券、交银天鑫宝货币、交银瑞鑫定期开放灵活配置混合、交	2018-01-10	-	6 年	季参平先生，美国密歇根大学金融工程硕士、对外经济贸易大学经济学学士。 2012 年 3 月至 2017 年 7 月任瑞士银行外汇和利率交易员、联席董事。2017 年加入交银施罗德基金管理有限公司。 2017 年 9 月 19 日至 2018 年 7 月 18 日担任交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。 2017 年 9 月 19 日至 2018 年 11 月 16 日担任交银施罗德瑞景定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。 2018 年 6 月 28 日至 2018 年 12 月 7 日担任交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证

	银天益宝货币、交银天运宝货币的基金经理助理				券投资基金的基金经理助理。
--	-----------------------	--	--	--	---------------

注：1、本表所列基金经理（助理）任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告(如适用)之日为准；

2、本表所列基金经理（助理）证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定；

3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

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

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下所管理的所有资产组合投资运作的公平。旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。制度中包含的主要控制方法如下：

（1）公司建立资源共享的投资研究信息平台，所有研究成果对所有投资组合公平开放，确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

（2）公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度，建立了合理且可操作的公平交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

（3）公司建立了清晰的授权制度，明确各层级投资决策主体的职责和权限划分，组合投资经理充分发挥专业判断能力,不受他人干预,在授权范围内独立行使投资决策权，维护公平的投资管理环境，维护所管理投资组合的合法利益,保证各投资组合交易决策的客观性和独立性，防范不公平及异常交易的发生。

（4）公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库，制定明确的备选库建立、

维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上，根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对手备选库，组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

(5) 公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各投资组合公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的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没有超过该证券当日总成交量 5% 的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差未出现异常。

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，主要受到中美贸易战冲击、表外融资规模收缩以及基建投资大幅下滑的影响，国内经济增速放缓，且下半年下行压力逐渐加大。2018 年广义理财与银行同业业务的监管政策效应发酵，委贷与信托等表外融资大幅收缩，严重依赖表外融资的民

企债务风险不断涌现。尽管在央行宽松货币政策护航下，商业银行加大表内信贷投放，但依然难以赶上表外融资收缩规模，2018 年信贷利率持续高企。地方政府融资平台监管趋严，叠加表外融资收缩，从而导致 2018 年基建投资出现大幅下滑。同时中美贸易摩擦爆发，贸易战的外部冲击，不仅影响到我国的进出口，而且扰乱了经济参与者的预期。尽管受到“抢出口效应”影响，国内出口曾出现短暂冲高，但十一月起贸易战负面效应显现，出口已大幅下滑，十二月更是出现负增长。

为应对表外融资收缩与中美贸易战带来的负面冲击，2018 年央行货币政策转向了中性偏松，通过多次降准释放了充沛的流动性。2018 年一季度通过定向降准落地以及“临时准备金动用安排”释放了大量流动性。2018 年二季度央行两次宣布降准，释放增量资金约 1.1 万亿。2018 年下半年央行主要通过公开市场逆回购与 MLF 操作维持货币市场资金面宽松，同时努力疏通货币传导机制，引导宽松的货币市场流动性进入实体经济，但民企融资难与贵的问题短期内依然比较突出。

资金面上，受央行持续降准影响，2018 年货币市场资金面非常宽松。十二月底 R001 较 2017 年底下降 106BP 以上。受资金持续宽松及银行同业投资规模收缩等影响，同业存款及存单利率大幅下行，且全年大部分时间内同业存款利率更低。十二月底股份制银行存单利率较 2017 年底下降 230BP 以上。受货币政策转向、资金面宽松叠加中美贸易战导致经济悲观预期加深等因素影响，2018 年债市在年初回调至高位后，迎来了大涨行情。十二月底十年期国开债 YTM 较 2017 年底回落 117BP 以上，三年期 AAA 中票 YTM 较 2017 年底回落 147BP 以上。

基金操作方面，报告期内本基金保持适度的流动性以期满足基金份额持有人潜在赎回需求。同时严格控制信用风险，择机提升组合杠杆与久期。在资产配置上，择机加大存单、短融与存款等投资品种的配置力度。根据市场情况灵活调整存款、存单及债券配置比例，为持有人创造了稳健的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要会计数据和财务指标”及“3.2.1 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”部分披露。

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 2019 年，尽管中美重启贸易磋商预示着 2019 年一季度的中美贸易谈判有望朝着向好的方向进展，但是 2018 年贸易战带来的负面冲击短期仍难消除，而且美欧实体经济也在走弱，因此出口对国内经济增长的拖累估计短期内难以逆转。政策层面上，中央经济政策托底工作进一步增强。十二月中央经济工作会议提出要加大积极财政政策力度，解决好民企融资问题，加快经济体制改革等措施。十二月央行四季度货币政策例会指出“加大逆周期调节的力度”，并且已在 2019 年初宣布全面降准一个百分点。预计短期内经济惯性下行压力依然较大，年内经济下探寻底将与稳增长政策加码赛跑。

预计央行可能维持宽松货币政策，发挥逆周期调节作用。我们将密切关注中美贸易谈判的进展、政府经济政策动态以及美欧经济走势。组合管理方面，本基金将密切跟踪研判宏观经济走势与央行货币政策操作，保持较好的流动性，把握市场机会，同时严格控制风险，努力为投资者创造稳健的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。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，截止报告期末未有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

遵照法律法规及基金合同的约定，本基金每日分配收益，按日结转份额。本基金本报告期内利润分配情况参见年度报告正文 7.4.7.10。

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

本基金本报告期内无需预警说明。

§ 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

在本报告期内，本基金托管人在托管交银施罗德活期货币基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关

规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、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。

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

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

§ 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对交银施罗德活期货币基金 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告【普华永道中天审字(2019)第 21559 号】。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德活期货币基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	7.4.7.1	8,310,514,829.56	9,052,796,494.89

结算备付金		26,272,727.28	18,059,090.91
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	28,123,187,402.38	9,326,203,692.86
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		27,973,187,402.38	9,326,203,692.86
资产支持证券投资		150,000,000.00	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	2,573,995,180.99	5,402,540,624.07
应收证券清算款		-	126,954.71
应收利息	7.4.7.5	80,907,357.13	82,302,620.42
应收股利		-	-
应收申购款		5,046,696.76	87,018,005.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		39,119,924,194.10	23,969,047,482.96
负债和所有者权益	附注号	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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		400,036,079.95	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,202,130.59	4,566,480.32
应付托管费		1,700,355.10	761,080.05
应付销售服务费		4,756,519.93	2,214,267.84
应付交易费用	7.4.7.7	241,347.00	67,872.81
应交税费		711,871.66	-
应付利息		350,695.54	-
应付利润		3,129,228.95	3,083,023.09
递延所得税负债		-	-

其他负债	7.4.7.8	299,300.00	199,300.00
负债合计		421,427,528.72	10,892,024.11
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	38,698,496,665.38	23,958,155,458.85
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		38,698,496,665.38	23,958,155,458.85
负债和所有者权益总计		39,119,924,194.10	23,969,047,482.96

注：1、报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 38,698,496,665.38 份，其中 A 类基金份额 21,397,072,050.70 份，E 类基金份额 17,301,424,614.68 份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

7.2 利润表

会计主体：交银施罗德活期货币市场基金

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	附注号	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		1,366,513,261.82	322,922,910.52
1.利息收入		1,362,810,896.09	322,473,096.82
其中：存款利息收入	7.4.7.11	471,765,097.87	147,942,000.38
债券利息收入		686,233,860.18	135,912,361.67
资产支持证券利息收入		1,874,597.72	-
买入返售金融资产收入		202,937,340.32	38,618,734.77
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,702,365.73	449,813.70
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	3,702,365.73	449,813.70
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
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）	7.4.7.14	-	-
减：二、费用		191,714,471.44	42,975,104.95
1. 管理人报酬		99,572,293.87	20,808,836.21
2. 托管费		16,595,382.34	3,468,139.26
3. 销售服务费		52,754,243.21	11,954,531.15
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		21,458,107.23	6,451,257.49
其中：卖出回购金融资产支出		21,458,107.23	6,451,257.49
6. 税金及附加		898,067.81	-
7. 其他费用	7.4.7.15	436,376.98	292,340.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,174,798,790.38	279,947,805.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,174,798,790.38	279,947,805.57

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德活期货币市场基金

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）	23,958,155,458.85	-	23,958,155,458.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,174,798,790.38	1,174,798,790.38
三、本期基金份额	14,740,341,206.53	-	14,740,341,206.53

交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	160,901,564,718.98	-	160,901,564,718.98
2.基金赎回款	-146,161,223,512.45	-	-146,161,223,512.45
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）	-	-1,174,798,790.38	-1,174,798,790.38
五、期末所有者权益（基金净值）	38,698,496,665.38	-	38,698,496,665.38
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）	1,755,993,183.07	-	1,755,993,183.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	279,947,805.57	279,947,805.57
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）	22,202,162,275.78	-	22,202,162,275.78
其中：1.基金申购款	66,889,718,980.20	-	66,889,718,980.20
2.基金赎回款	-44,687,556,704.42	-	-44,687,556,704.42
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）	-	-279,947,805.57	-279,947,805.57
五、期末所有者权益（基金净值）	23,958,155,458.85	-	23,958,155,458.85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：谢卫，主管会计工作负责人：夏华龙，会计机构负责人：单江

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

交银施罗德活期货币市场基金(以下简称“本基金”)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[2016]1570号《关于准予交银施罗德活期货币市场基金注册的批复》核准，由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德活期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证券投资基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 210,070,922.49 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 996 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德活期货币市场基金基金合同》于 2016 年 7 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 210,080,375.35 份基金份额，其中认购资金利息折合 9,452.86 份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

根据《交银施罗德活期货币市场基金基金合同》和《交银施罗德活期货币市场基金招募说明书》的相关规定，本基金根据销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为 A 类基金份额和 E 类基金份额。销售服务费率为 0.25%的基金份额，称为 A 类基金份额；销售服务费率为 0.01%基金份额，称为 E 类基金份额。两类基金份额单独设置基金代码，并分别公布各类基金份额的每万份基金已实现收益和七日年化收益率。投资者可自行选择认购的基金份额类别，除非基金管理人在未来另行公告开通相关业务，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德活期货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。本基金的业绩比较基准为：活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于 2019 年 3 月

25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德活期货币基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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《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《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]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
交银施罗德基金管理有限公司(“交银施罗德基金公司”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中信建投证券股份有限公司(“中信建投证券”)	基金托管人
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构
施罗德投资管理有限公司	基金管理人的股东
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	基金管理人的股东
交银施罗德资产管理有限公司(“交银施罗德资产公司”)	基金管理人的子公司
上海直源投资管理有限公司	受基金管理人控制的公司
交烨投资管理(上海)有限公司	受基金管理人控制的公司

注：下述关联方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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

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	99,572,293.87	20,808,836.21
其中：支付销售机构的客户维护费	453,538.02	169,586.96

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

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	16,595,382.34	3,468,139.26

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

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 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		
	交银活期货币基金 A	交银活期货币基金 E	合计
交通银行	415,776.54	6,315.45	422,091.99
交银施罗德基金公司	51,075,991.66	1,244,962.59	52,320,954.25
合计	51,491,768.20	1,251,278.04	52,743,046.24
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		
	交银活期货币基金 A	交银活期货币基金E	合计
	交银施罗德基金公司	11,457,354.52	222,674.14
交通银行	272,753.08	20.82	272,773.90
合计	11,730,107.60	222,694.96	11,952,802.56

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额和 E 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25%和 0.01%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

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

本期 2018年1月1日至2018年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
中信建投证券	1,322,256,158.81	90,663,297.54	1,115,930,000.00	593,019.18	-	-
上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	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

中信建投证 券	-	10,177,70 3.42	-	-	-	-
------------	---	-------------------	---	---	---	---

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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	交银活期通 货 币 A	交银活期通 货 币 E	交银活期通 货 币 A	交银活期通 货 币 E
报告期初持有的基金份额	-	-	-	231,334,975.21
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	2,829,441.76
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	234,164,416.97
报告期末持有的基金份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	-

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务。

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

3、基金管理人投资本基金适用的申购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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

交银活期货币 A

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

交银活期货币 E

份额单位：份

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
交通银行	9,380,902,681.73	24.24%	3,003,004,196.85	12.53%
交银施罗德资产管理有限公司	230,288,896.70	0.60%	248,000,000.00	1.04%
上海直源投资管理有限公司	6,716,243.61	0.02%	-	-

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

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
交通银行	2,514,829.56	533,907.06	4,796,494.89	530,774.64

注：本基金的银行存款账户开立交通银行，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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 2018 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款余额 400,036,079.95 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
189956	18 贴现国债 56	2019-01-02	99.50	593,000	59,003,500.00
189950	18 贴现国债 50	2019-01-02	99.73	1,064,000	106,112,720.00
189949	18 贴现国债 49	2019-01-02	99.83	2,500,000	249,575,000.00
合计				4,157,000	414,691,220.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**(1) 公允价值****(a) 金融工具公允价值计量的方法**

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具**(i) 各层次金融工具公允价值**

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 27,973,187,402.38 元，属于第三层次的余额为 150,000,000.00 元，无属于第一层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第二层次 9,326,203,692.86 元，无第一或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具为

150,000,000.00 元(2017 年 12 月 31 日: 无)。本基金本期购买第三层次的金融工具的金
 额为 180,000,000.00 元(2017 年度: 无), 出售第三层次的金融工具的金额为
 30,000,000.00 元(2017 年度: 无), 无计入损益的第三层次的金融工具公允价值变动
 (2017 年度: 无)。本基金于本期末仍持有的第三层次的金融工具无计入本年度损益的
 未实现利得或损失(2017 年 12 月 31 日: 无)。

于 2018 年 12 月 31 日本基金持有的第三层次的交易性金融资产(均为交易所资产支持
 证券投资)公允价值为 150,000,000.00 元, 采用现金流量折现法估值技术, 不可观察输
 入值为折现率, 与公允价值之间呈负相关关系(2017 年 12 月 31 日: 无)。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年
 12 月 31 日: 同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值
 与公允价值相差很小。

(2)

除公允价值和增值税外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	28,123,187,402.38	71.89
	其中: 债券	27,973,187,402.38	71.51
	资产支持证券	150,000,000.00	0.38
2	买入返售金融资产	2,573,995,180.99	6.58
	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	8,336,787,556.84	21.31
4	其他各项资产	85,954,053.89	0.22
5	合计	39,119,924,194.10	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	2.18	
	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	400,036,079.95	1.03
	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银行间市场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

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

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	80
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	93
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	46

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过 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	16.59	1.03
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	20.13	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	45.76	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	0.26	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	18.13	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
6	合计	100.87	1.03

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

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

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	1,694,946,646.36	4.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	445,668,038.93	1.15
	其中：政策性金融债	445,668,038.93	1.15
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,872,869,498.87	7.42
6	中期票据	-	-
7	同业存单	22,959,703,218.22	59.33
8	其他	-	-
9	合计	27,973,187,402.38	72.28
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利	-	-

	率债券		
--	-----	--	--

8.6 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	111884102	18 徽商银行 CD119	5,000,000	497,250,632.40	1.28
2	111819365	18 恒丰银行 CD365	5,000,000	497,020,003.08	1.28
3	111884273	18 锦州银行 CD194	5,000,000	497,005,878.95	1.28
4	111870084	18 晋商银行 CD215	5,000,000	488,241,246.91	1.26
5	111870700	18 东亚银行 CD050	4,000,000	397,726,068.68	1.03
6	111821370	18 渤海银行 CD370	3,400,000	338,057,961.14	0.87
7	071800041	18 国泰君安 CP005	3,000,000	300,000,023.37	0.78
8	111819430	18 恒丰银行 CD430	3,000,000	299,256,045.98	0.77
9	111821355	18 渤海银行 CD355	3,000,000	298,514,558.31	0.77
10	111821356	18 渤海银行 CD356	3,000,000	298,496,602.83	0.77

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	0
报告期内偏离度的最高值	0.2142%
报告期内偏离度的最低值	-0.0442%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0673%

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存在负偏离度的绝对值达到0.25%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存在正偏离度的绝对值达到0.5%情况。

8.8 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

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	0.26
2	149553	宁远 04A1	500,000	50,000,000.00	0.13

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率和摊余成本逐日摊销计算损益。

8.9.2 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

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	80,907,357.13
4	应收申购款	5,046,696.76
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	85,954,053.89

8.9.4 其他需说明的重要事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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)	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
交银活期货币 A	1,997,768	10,710.49	206,164.96	0.00%	21,396,865,885.74	100.00%
交银活期货币 E	90	192,238,051.27	17,291,473,794.57	99.94%	9,950,820.11	0.06%
合计	1,997,858	19,369.99	17,291,679,959.53	44.68%	21,406,816,705.85	55.32%

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	银行类机构	9,380,902,681.73	24.24%
2	银行类机构	821,877,899.99	2.12%
3	基金类机构	600,641,098.20	1.55%
4	银行类机构	540,937,143.94	1.40%
5	银行类机构	502,659,829.80	1.30%
6	券商类机构	502,628,534.02	1.30%
7	银行类机构	502,602,898.60	1.30%
8	银行类机构	500,710,706.37	1.29%
9	银行类机构	402,084,885.59	1.04%
10	银行类机构	314,837,856.79	0.81%

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	交银活期货币 A	4,073,632.93	0.02%
	交银活期货币 E	-	-
	合计	4,073,632.93	0.01%

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	交银活期货币 A	10~50
	交银活期货币 E	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	交银活期货币 A	0
	交银活期货币 E	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	交银活期货币 A	交银活期货币 E
基金合同生效日（2016 年 7 月 27 日）基金份额总额	70,925.35	210,009,450.00
本报告期期初基金份额总额	10,949,621,912.61	13,008,533,546.24
本报告期基金总申购份额	120,567,104,513.72	40,334,460,205.26
减：本报告期基金总赎回份额	110,119,654,375.63	36,041,569,136.82
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	21,397,072,050.70	17,301,424,614.68

注：1、如果本报告期间发生转换入、份额类别调整、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务。

2、如果本报告期间发生转换出、份额类别调整业务，则总赎回份额中包含该业务。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开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

1、基金管理人的重大人事变动：

(1) 本基金管理人于 2018 年 6 月 30 日发布公告，经公司第四届董事会第三十二次会议审议通过，同意苏奋先生辞去公司督察长职务，并于 2018 年 9 月 28 日发布公告，经公司第四届董事会第三十三次会议审议通过，同意余川女士担任公司督察长职务；

(2) 本基金管理人于 2018 年 10 月 20 日发布公告，经公司第五届董事会第一次会议审议通过，选举阮红女士担任公司董事长（法定代表人），并于 2019 年 2 月 28 日发布公告，经公司第五届董事会第五次会议审议通过，选举谢卫先生担任公司总经理，阮红女士不再担任公司总经理。期后变动敬请关注基金管理人发布的相关公告。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、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

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本期审计费用为 170,000.00 元。自本基金基金合同生效以来，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

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

1、管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

2、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

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	
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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		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
海通证券股份有限公司	-	-	122,205,400,000.00	100.00%	-	-

注：1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；

2、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；

3、租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准进行综合评价，然后根据评价选择基金交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比	期初份	申购份	赎回份额	持有份额	份额占比

		例达到或者超过 20%的时间区间	额	额			
机构	1	2018/1/1- 2018/12/31	3,003, 004,19 6.85	13,377 ,898,4 84.88	7,000,00 0,000.00	9,380,902,6 81.73	24.24%
产品特有风险							
本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对本基金带来流动性冲击，从而影响基金的投资运作和收益水平。基金管理人将加强流动性管理，防范相关风险，保护持有人利益。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人依据国家税收法律、法规、规章及税收规范性文件的规定，对管理的基金产品运营过程中产生的应税收入，计提及缴纳增值税及附加税费，该部分税费由基金资产承担。详情请见有关公告。

2、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的有关规定及相关监管要求，经与基金托管人协商一致并报监管机构备案，基金管理人对本基金基金合同等法律文件作相应修改。欲知详情请查阅本基金管理人于 2018 年 3 月 22 日发布的有关公告及法律文件。

交银施罗德基金管理有限公司
二〇一九年三月二十七日