交银施罗德活期通货币市场基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30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：二〇一八年八月二十五日

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	交银活期通货币	
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	32,722,411,266.46份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	交银活期通货币A	交银活期通货币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	23,052,017,994.38份	9,670,393,272.08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@ysld.com, disclosure@ysld.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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fund001.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2018年1月1日至2018年6月30日）	
	交银活期通货币A	交银活期通货币E
本期已实现收益	352,730,328.33	248,213,887.97
本期利润	352,730,328.33	248,213,887.97
本期净值收益率	2.00%	2.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018年6月30日）	
	交银活期通货币A	交银活期通货币E
期末基金资产净值	23,052,017,994.38	9,670,393,272.08
期末基金份额净值	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. 交银活期通货币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
过去一个月	0.3149%	0.0005%	0.0288%	0.0000%	0.2861%	0.0005%
过去三个月	0.9785%	0.0006%	0.0873%	0.0000%	0.8912%	0.0006%
过去六个月	1.9970%	0.0006%	0.1736%	0.0000%	1.8234%	0.0006%
过去一年	4.0652%	0.0006%	0.3500%	0.0000%	3.7152%	0.0006%
自基金合同生效起至今	6.9907%	0.0019%	0.6751%	0.0000%	6.3156%	0.0019%

注：本基金的业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

2. 交银活期通货币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
过去一个月	0.3347%	0.0005%	0.0288%	0.0000%	0.3059%	0.0005%
过去三个月	1.0387%	0.0006%	0.0873%	0.0000%	0.9514%	0.0006%
过去六个月	2.1179%	0.0006%	0.1736%	0.0000%	1.9443%	0.0006%
过去一年	4.3140%	0.0006%	0.3500%	0.0000%	3.9640%	0.0006%
自基金合同生效起至今	7.4785%	0.0019%	0.6751%	0.0000%	6.8034%	0.0019%

注：本基金的业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

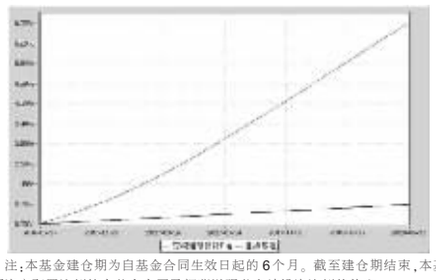
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德活期通货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

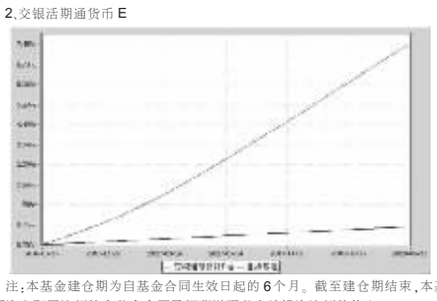
（2016年7月27日至2018年6月30日）

1.交银活期通货币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.交银活期通货币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。

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，注册资本金为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81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、交银丰盈收益债券、交银现金宝货币、交银丰润收益债券、交银活期通货币、交银天利宝货币、交银裕兴纯债债券、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、交银境商收益债券、交银天运宝货币的基金经理	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。2015年加入交银施罗德基金管理有限公司。
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、交银裕通纯债债券、交银活期通货币、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、交银境商收益债券的基金经理	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益债券型证券投资基金的基金经理。
季步平	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、交银单融回报灵活配置混合、交银活期通货币、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、交银瑞鑫定期开放灵活配置混合、交银天益宝货币、交银瑞赢定期开放灵活配置混合、交银瑞利定期开放灵活配置、交银天运宝货币的基金经理助理	2018-01-10	-	6年	季步平先生，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。

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

本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定，未发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本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研研究信息平台，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。

4.3.2 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年上半年，国内经济整体上呈稳中放缓态势，二季度中美贸易战如乌云压顶，经济悲观预期加深。国内制造业景气度保持高位扩张，制造业PMI同比增速上半年处于上升通道，尽管房地产投资增速也保持较高增长，但是受基建投资大幅下行拖累，上半年固定资产投资不断下滑。同时，中美贸易摩擦加剧，国内进口上升较快，上半年净出口对GDP的贡献率大幅转负。受资管新规影响发力，上半年企业的融资条件趋紧，企业信贷利率走高，而且广义理财规模收缩与信托委贷下降造成表外融资规模收缩，依赖表外融资的企业信用风险大幅上升。货币政策上，上半年央行执行了中性偏松的货币政策操作，通过多次降准释放了充沛的流动性以应对表外融资渠道收缩及中美贸易战带来的不确定性。一季度，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，为二月份跨春节假期及三月份跨季提供了充裕的流动性。二季度，央行分别于4月17日及6月24日两次宣布降准，释放增量资金约11万亿元。

资金面上，受央行持续降准影响，上半年市场资金面较为宽松。六月底R001较2017年年底下降43个BP以上。受资金持续宽松等因素影响，二季度同业存款及同业存单利率大幅下行。资金面宽松叠加中美贸易战加深经济悲观预期等影响，上半年利率债大幅上涨。六月底10年期国开债YTM较2017年年底回落56个BP以上，六月底3年期AAA中票YTM较2017年年底回落74个BP以上，但低评级信用债受信用事件冲击，上半年涨幅相对较小。

基金操作方面，报告期内本基金保持适度的流动性满足客户赎回需求，控制信用风险，择机调整组合杠杆与久期。在资产配置上，择机加大存款、高评级同业存单与短融等投资品种的配置力度，根据市场趋势灵活调整存款、同业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主要财务指标"及"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"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2018年下半年，考虑中美贸易战风险、贷款利率高企及表外融资收缩等问题，我们预计经济在边际上仍存在下行压力，但稳中放缓的可能性较大。因此，短期内货币政策仍可能以中性偏宽松为主，但防控金融风险的任务未完成，仍需要高度关注相关政策出台的节奏与力度。我们将继续关注美国引发的贸易战对经济走势的影响，跟踪表外融资收缩带来的问题。组合管理方面，本基金将密切跟踪研判宏观经济走势、央行货币政策操作与金融监管政策动态，保持较好的流动性，把握市场机会，尽力控制信用风险，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6.4.7.10。

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通货币市场基金过程中，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遵规守信、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损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德活期通货币市场基金

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	9,596,972,541.29	9,052,796,494.89
结算备付金		73,459,090.94	18,059,090.91
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	17,181,942,844.64	9,326,203,692.86
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		17,101,942,844.64	9,326,203,692.86
资产支持证券投资		80,000,000.00	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	7,298,607,701.44	5,402,540,624.07
应收证券清算款		699,151.45	126,954.71
应收利息	6.4.7.5	126,961,046.22	82,302,620.42
应收股利		-	-
应收申购款		334,500.00	87,018,005.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		34,278,976,875.98	23,969,047,482.96

负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,536,676,226.52	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,301,706.24	4,566,480.32
应付托管费		1,383,617.69	761,080.05
应付销售服务费		4,848,742.73	2,214,267.84
应付交易费用	6.4.7.7	108,725.09	67,872.81
应交税费		941,662.17	-
应付利息		310,244.98	-
应付利润		3,791,985.60	3,083,023.09
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	202,698.50	199,300.00
负债合计		1,556,565,609.52	10,892,024.11
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	32,722,411,266.46	23,958,155,458.85
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		32,722,411,266.46	23,958,155,458.85
负债和所有者权益总计		34,278,976,875.98	23,969,047,482.96

注：1.报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额32,722,411,266.46份，其中A类基金份额总额23,052,017,994.38份，E类基金份额总额9,670,393,272.08份。

2.本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半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半年度报告正文。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德活期通货币市场基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		679,015,923.76	65,031,330.63
1.利息收入		677,987,288.60	64,868,888.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	298,511,011.59	42,165,596.14
债券利息收入		272,141,370.35	16,992,320.32
资产支持证券利息收入		445,122.74	-
买入返售金融资产收入		106,889,783.92	5,710,972.17
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）		1,028,635.16	162,442.00
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	1,028,635.16	162,442.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
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）	6.4.7.14	-	-
减：二、费用		78,071,707.46	9,686,429.40
1.管理人报酬		44,198,262.13	4,528,594.99
2.托管费		7,366,376.98	754,765.75
3.销售服务费		22,735,546.53	2,918,122.26
4.交易费用		-	-
5.利息支出		3,103,685.69	1,334,460.10
其中：卖出回购金融资产支出		3,103,685.69	1,334,460.10
6.税金及附加		401,431.73	-
7.其他费用	6.4.7.15	266,404.40	150,486.30
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		600,944,216.30	55,344,901.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		600,944,216.30	55,344,901.23

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德活期通货币市场基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	600,944,216.30	600,944,216.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"-"号填列）	8,764,255,807.61	-	8,764,255,807.61
其中：1.基金申购款	81,093,606,357.70	-	81,093,606,357.70
2.基金赎回款	-72,329,350,550.09	-	-72,329,350,550.09
四、本期向基金分配利润产生的基金净值变动（净值减少以"-"号填列）	-	-600,944,216.30	-600,944,216.30
五、期末所有者权益（基金净值）	32,722,411,266.46	-	32,722,411,266.46

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,755,993,183.07	-	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）	-	55,344,901.23	55,344,901.23
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）	3,149,471,038.11	-	3,149,471,038.11
其中：1.基金申购款	15,499,141,711.86	-	15,499,141,711.86
2.基金赎回款	-12,349,670,673.75	-	-12,349,670,673.75
四、本期向基金分配利润产生的基金净值变动（净值减少以"-"号填列）	-	-55,344,901.23	-55,344,901.23
五、期末所有者权益（基金净值）	4,905,464,221.18	-	4,905,464,221.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：阮红，主管会计工作负责人：夏华龙，会计机构负责人：单江

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德活期通货币市场基金（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通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《交银施罗德活期通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，《交银施罗德活期通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《交银施罗德活期通货币市场基金基金合同》和《交银施罗德活期通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《交银施罗德活期通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）。

6.4.2 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》、《交银施罗德活期通货币市场基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年上半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6月30日的财务状况以及2018年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	44,198,262.13	4,528,594.99
其中：支付销售机构的客户维护费	188,136.47	17,760.19

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,366,376.98	754,765.75

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。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银活期通货币A	交银活期通货币E	合计
交银施罗德基金公司	21,894,788.92	582,717.95	22,477,506.87
交通银行	251,826.58	3,411.01	255,237.59
合计	22,146,615.50	586,128.96	22,732,744.46

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6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银活期通货币A	交银活期通货币E	合计
交银施罗德基金公司	2,845,225.49	35,650.55	2,880,876.04
交通银行	36,999.97	-	36,999.97
合计	2,882,225.46	35,650.55	2,917,876.01

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。

6.4.8.3 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6月30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	400,090,479.45	-	419,430,000.00	237,354.46	-	-

上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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	-	-	-	-	-	-

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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
基金合同生效日（2016年7月27日）持有的基金份额	-	-	-	-
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	-	-	-	2,566,361.64
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	100,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	-	-	133,901,336.85
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	10.13%

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金