安信活期宝货币市场基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3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	安信活期宝	
基金主代码	003402	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年10月17日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,744,061,474.36份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信活期宝A	安信活期宝B
下属分级基金的交易代码	003402	004167
报告期末下属分级基金的份额总额	1,707,329,150.42份	2,036,732,323.94份

2.2 基金产品说明

投资目标	在综合考虑基金资产收益性、安全性和流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为投资人创造稳定的收益。
投资策略	资产配置方面,本基金通过对国内市场资金供求、利率水平、通货膨胀率、GDP增长率、就业率水平以及国际市场利率水平等宏观经济指标的跟踪和分析,形成对宏观层面的判断。同时,通过对市场资金供求、基金申赎情况进行动态分析,确定本基金流动性目标,相应调整基金资产在高流动性资产和相对流动性较低资产之间的配比,在个券方面,本基金将首先考虑安全性因素,优先选择国债、央行票据等高信用等级的债券品种以规避信用风险。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率。
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较低风险品种。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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江辉	李婷婷
	联系电话	0755-82509999	0755-25879287
	电子邮箱	service@assetmanagementfund.com	LIJINHUIHUA11308@pingan.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95511-3
传真		0755-82509292	0755-82080387

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.assetmanagementfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§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10月17日(基金合同生效日)-2016年12月31日	
	安信活期宝A	安信活期宝B	安信活期宝A	安信活期宝B	安信活期宝A	安信活期宝B
本期已实现收益	59,569,652.48	62,290,315.30	15,697,599.46	42,217,013.43	340,996.30	39,102.88
本期利润	59,569,652.48	62,290,315.30	15,697,599.46	42,217,013.43	340,996.30	39,102.88
本期净值收益率	3.8929%	4.1424%	4.0120%	4.0859%	0.3482%	0.0554%
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	1,707,329,150.42	2,036,732,323.94	1,093,932,857.54	1,691,906,108.06	16,519,583.07	47,074,995.56
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

安信活期宝A

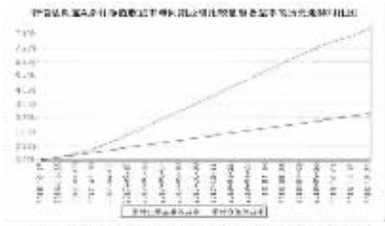
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7792%	0.0016%	0.3403%	0.0000%	0.4389%	0.0016%
过去六个月	1.7210%	0.0018%	0.6806%	0.0000%	1.0404%	0.0018%
过去一年	3.8929%	0.0022%	1.3600%	0.0000%	2.5429%	0.0022%
自基金合同生效起至今	8.4374%	0.0029%	2.9811%	0.0000%	5.4563%	0.0029%

安信活期宝B

安信活期宝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	0.8402%	0.0016%	0.3403%	0.0000%	0.4999%	0.0016%
过去六个月	1.8443%	0.0018%	0.6806%	0.0000%	1.1638%	0.0018%
过去一年	4.1424%	0.0022%	1.3600%	0.0000%	2.7924%	0.0022%
自基金合同生效起至今	8.4576%	0.0023%	2.7370%	0.0000%	5.7206%	0.0023%

注: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)。

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

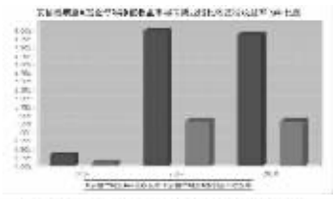


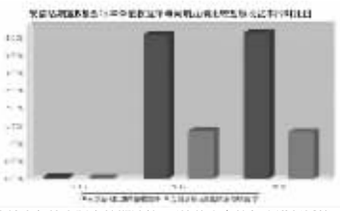
注:1、本基金合同生效日为2016年10月17日。

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、本基金自2016年12月22日起增加B类份额。

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





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

安信活期宝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	59,513,903.23	-	55,749.25	59,569,652.48	-
2017年	15,288,123.81	-	409,475.65	15,697,599.46	-
2016年	339,833.96	-	1,162.34	340,996.30	-
合计	75,141,861.00	-	466,387.24	75,608,248.24	-

安信活期宝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	62,317,756.07	-	-27,440.77	62,290,315.30	-
2017年	41,583,656.27	-	633,357.16	42,217,013.43	-
2016年	38,188.33	-	3,917.55	39,102.88	-
合计	103,936,597.67	-	609,833.94	104,546,431.61	-

§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		
丹芳芳	本基金的基金经理	2017年6月6日	-	7	丹芳芳女士,经济学硕士。历任华宝证券有限责任公司资产管理部研究员,财达证券有限责任公司任资产管理投资部,2016年4月以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。曾任安信安鑫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、安信新规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。
杨凯伟	本基金的基金经理、固收业务部总经理	2016年10月17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。台湾兆泰人寿保险股份有限公司科长、保诚元大基金管理有限责任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总经理。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、安信新规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、安信安鑫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、安信现金增利货币市场基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信优享纯债债券型证券投资基金的基金经理。
任凭	本基金的基金经理	2018年8月10日	-	11	任凭女士,法学硕士,曾任银行折麻基金管理有限公司,2011年加入安信基金管理有限责任公司,历任监管交易员,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、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信优享纯债债券型证券投资基金的基金经理助理;现任安信新规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。
徐越	本基金的基金经理助理	2016年10月24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,曾任安信安鑫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、安信尊享纯债债券型证券投资基金的基金经理助理。
任凭	本基金的基金经理助理	2016年10月24日	2018年8月10日	11	任凭女士,法学硕士,曾任银行折麻基金管理有限公司,2011年加入安信基金管理有限责任公司,历任监管交易员,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、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信优享纯债债券型证券投资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

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,银保监局、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、信用传导不通畅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

截至本报告期末本基金A类份额净值收益率为3.8929%;截至本报告期末本基金B类份额净值收益率为4.1424%;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121,859,967.78元,其中本基金A类共分配人民币59,569,652.48元,B类共分配人民币62,290,315.30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,平安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121,859,967.78元,其中本基金A类共分配人民币59,569,652.48元,B类共分配人民币62,290,315.30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

本报告期,本托管人复核了财务指标、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真实、准确、完整。

§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:安信活期宝货币市场基金

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	32,732,378.59	8,413,642.85
结算备付金	-	-
存出保证金	-	374.05
交易性金融资产	4,188,391,687.62	2,713,696,131.06
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	4,113,180,914.79	2,713,696,131.06
资产支持证券投资	75,210,772.83	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	50,020,435.03	149,220,196.33
应收证券清算款	-	-
应收利息	7,445,389.94	5,936,315.37
应收股利	-	-
应收申购款	98,883,705.00	11,563,392.28
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,377,473,666.18	2,888,830,050.94
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	630,485,094.27	100,799,648.80
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	488,380.60	622,757.42
应付托管费	195,352.23	143,713.25
应付销售服务费	363,450.17	40,618.12
应付交易费用	77,030.15	49,770.35
应交税费	44,138.06	-
应付利息	402,025.18	76,164.70
应付利润	1,076,221.18	1,047,912.70
递延所得税负债	-	-
其他负债	280,500.00	210,500.00
负债合计	633,412,191.82	102,991,088.34
所有者权益:		
实收基金	3,744,061,474.36	2,785,838,965.60
未分配利润	-	-
所有者权益合计	3,744,061,474.36	2,785,838,965.60
负债和所有者权益总计	4,377,473,666.18	2,888,830,050.94

注:报告截止日2018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3,744,061,474.36份,其中A类基金份额1,707,329,150.42份;B类基金份额2,036,732,323.94份。

7.2 利润表

会计主体:安信活期宝货币市场基金

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	144,691,793.62	67,390,493.84
1.利息收入	140,238,227.54	66,040,310.69
其中:存款利息收入	17,200,547.65	699,950.75
债券利息收入	110,089,963.61	58,484,310.15
资产支持证券利息收入	3,093,562.03	-
买入返售金融资产收入	9,854,164.25	6,856,049.79
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	4,453,566.08	1,321,146.64
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,460,960.46	1,278,794.48
资产支持证券投资收益	-7,394.38	42,356.16
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)	-	29,042.51
减:二、费用	22,831,825.84	9,475,888.95
1、管理人报酬	5,015,963.60	3,502,122.40
2、托管费	1,900,412.26	808,182.21
3、销售服务费	4,082,177.88	192,349.62
4、交易费用	-	-
5、利息支出	11,344,630.62	4,741,336.72
其中:卖出回购金融资产支出	11,344,630.62	4,741,336.72
6、税金及附加	31,316.48	-
7、其他费用	457,325.00	231,900.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	121,859,967.78	57,914,612.89
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	121,859,967.78	57,914,612.89

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:安信活期宝货币市场基金

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)	2,785,838,965.60	-	2,785,838,965.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	121,859,967.78	121,859,967.78
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)	958,222,508.76	-	958,222,508.76
其中:1.基金申购款	14,253,427,131.69	-	14,253,427,131.69
2.基金赎回款	-13,295,204,622.93	-	-13,295,204,622.93
四、本期末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)	-	-121,859,967.78	-121,859,967.78
五、期末所有者权益(基金净值)	3,744,061,474.36	-	3,744,061,474.36

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)	63,594,578.63	-	63,594,578.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	57,914,612.89	57,914,612.89
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)	2,722,244,386.97	-	2,722,244,386.97
其中:1.基金申购款	7,284,110,836.76	-	7,284,110,836.76
2.基金赎回款	-4,561,866,448.79	-	-4,561,866,448.79
四、本期末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)	-	-57,914,612.89	-57,914,612.89
五、期末所有者权益(基金净值)	2,785,838,965.60	-	2,785,838,965.60

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_____ _____范筑_____ _____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

安信活期宝货币市场基金(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")2016年8月15日下发的证监许可[2016]1841号文《关于准予安信活期宝货币市场基金注册的批复》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《安信活期宝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2016年10月10日至2016年10月13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(2016)验字60962175_H67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300,321,259.04元。经向中国证监会备案,《安信活期宝货币市场基金基金合同》于2016年10月17日正式生效。截至2016年10月17日止,安信活期宝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300,321,259.04元,折合300,321,259.04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49,556.65元,折合49,556.65份基金份额。以上收到的实收基金共计人民300,370,815.69元,折合300,370,815.69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,基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信活期宝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;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。

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"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
平安银行股份有限公司(以下简称"平安银行")	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(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