安信活期宝货币市场基金 2019年半年度报告摘要

2019年6月30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
送出日期:2019年8月27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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8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2019年01月01日起至06月30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	2,970,674,590.26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	799,520,103.20份	2,171,154,487.06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研。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	乔江晖	李婷婷
	联系电话	0755-82509999	0755-25878287
	电子邮箱	service@essencefund.com	LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95511-3
传真		0755-82799292	0755-82080387

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.essencefund.com
基金半年度报告备置地点	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(2019年1月1日-2019年6月30日)	
	安信活期宝A	安信活期宝B
本期已实现收益	15,099,815.28	43,686,613.81
本期利润	15,099,815.28	43,686,613.81
本期净值收益率	1.3651%	1.4864%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末基金资产净值	799,520,103.20	2,171,154,487.06
期末基金份额净值	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

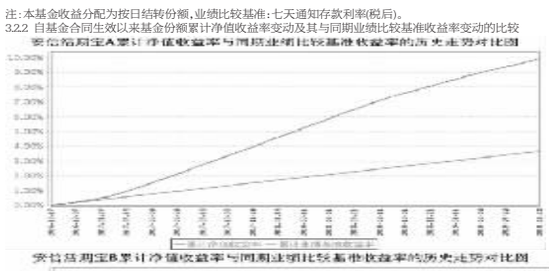
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2205%	0.0009%	0.1110%	0.0000%	0.1095%	0.0009%
过去三个月	0.6436%	0.0009%	0.3366%	0.0000%	0.3070%	0.0009%
过去六个月	1.3651%	0.0012%	0.6695%	0.0000%	0.6956%	0.0012%
过去一年	3.1096%	0.0018%	1.3500%	0.0000%	1.7596%	0.0018%
自基金合同生效起至今	9.9177%	0.0028%	3.6505%	0.0000%	6.2672%	0.0028%

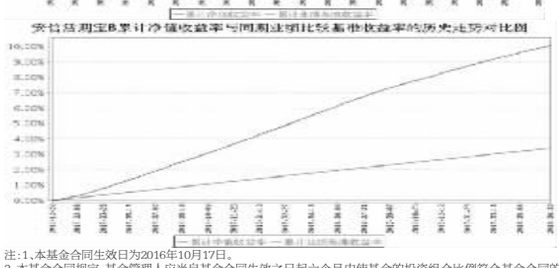
安信活期宝B

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
过去一个月	0.2403%	0.0009%	0.1110%	0.0000%	0.1293%	0.0009%
过去三个月	0.7041%	0.0009%	0.3366%	0.0000%	0.3675%	0.0009%
过去六个月	1.4864%	0.0012%	0.6695%	0.0000%	0.8169%	0.0012%
过去一年	3.3581%	0.0018%	1.3500%	0.0000%	2.0081%	0.0018%
自基金合同生效起至今	10.0697%	0.0024%	3.4064%	0.0000%	6.6633%	0.0024%

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。

§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2019年6月30日,本基金管理人共管理48只开放式基金具体如下:安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、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)、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选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、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信沪深300指数增强型发起式证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造2025沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金、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、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、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、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金(原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金)、安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证500指数增强型证券投资基金、安信优享纯债债券型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金(安信新起点灵活配置混合型证券投资基金)、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金(LOF)。

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	-	8	肖芳芳女士,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资产管理部投资助理,安信基金管理有限责任公司固定收益部投研助理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。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、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、安信现金管理货币市场基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率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	-	12	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、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;现任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、安信优享纯债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、安信鑫日享中短债债券型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10月17日	-	13	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、安信宝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、安信优享纯债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10月24日	-	4	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助理。

注:1、上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

2、证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》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。

4.3.2 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

2019年上半年,海外宏观经济方面,欧盟经济增长持续低迷,美国部分经济数据出现疲态,美联储降息预期强烈。国内宏观经济方面,建安、购地共同支撑地产投资,地产投资一枝独秀,基建投资仍旧低位徘徊,制造业投资低位企稳,消费进一步降低、低位震荡,受全球经济放缓和贸易摩擦影响,进出口增速均出现明显回落,但进口增速回落快于出口增速,逆差不降反升。

货币政策方面,整个一季度货币政策没有进一步放松,关键时间点公开市场净投放量与2018年前三个季度相比明显缩量。4月,各机构公布的一季度宏观经济数据略超预期,央行货币政策延续了1季度以来的边际收紧;5月初中美贸易战谈判形势恶化,央行对聚焦当地、服务县域的中小银行实行较低的优惠存款准备金率,分三次实施;5月24日,包商银行被托管,此后的1个月央行通过跨关键时间点的公开市场投放、超额续作MLF、增加再贴现和SLF额度等诸多方式缓解市场流动性风险。

一季度,shibor各期限利率趋势性回落,货币市场价格在低位小幅波动。本基金在允许的久期范围内配置了1-6M优质资产,充分利用组合久期的同时提高了组合流动性。受到包商银行事件冲击,二季度,shibor各期限利率先上后下,波动较大。6月中下旬央行在公开市场上投放跨季资金后,shibor各期限利率出现不同幅度回落。6月下半月,AAA股份行3m存单发行利率大幅下降50bp至2.5%,AAA股份行6m存单发行利率大幅下降55bp至2.6%。本基金在二季度择机配置了3M和9M、1Y优质资产,充分利用组合久期,保持了相对较高的静态收益,为三季度奠定了良好的基础。

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1.3651%;截至本报告期末本基金B类份额净值收益率为1.4864%;同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入三季度,固定资产投资方面,鉴于上半年财政赤字已经在较高水平,专项债发行额度有限,基建增速可能会稳在目前的水平,难以大幅向上;地产投资增速可能会受累于拿地放缓而进一步下滑,但是由于16年销售的期房交房期在今年,建筑工程预计仍将支撑地产投资在一定水平;制造业投资受益于贸易战缓解,增速有望持续小幅回暖;净出口仍然有望支撑经济增长;消费增速方面预期将在目前的水平低位徘徊。

总的来说,经济数据出炉可能会渐显疲态,但是我们判断目前经济增长的目标是低底线稳增长(外贸、外资、投资),高底线稳就业、稳金融、稳预期。

货币政策方面,由于货币、债券市场已经紧密跟随央行货币政策、非常的市场化,利率并轨落地后,很难说会直接受到进一步的影响。从央行目前的态度来看,保持定力、"以我为主"仍然是主线。未来如果美联储先行降息,同时在国内经济超预期下滑时,央行或将指引利率走廊整体下移。

资金利率方面,比较确定的是,即使不进行全面降准降息,持续的定向降准也必然会带来增量流动性,进而带来重新定价。鉴于今年以来资金利率波动较大,三季度这一局面可能不会改变,我们认为货币组合一方面需要准备关键时间点的短期流动性、另一方面可拉长久期提高收益。

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债金融估值中心有限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58,786,429.09元,其中本基金A类共分配人民币15,099,815.28元,B类共分配人民币43,686,613.81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58,786,429.09元,其中本基金A类共分配人民币15,099,815.28元,B类共分配人民币43,686,613.81元。

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

本报告期,本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§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:安信活期宝货币市场基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:		
银行存款	206,529,267.24	32,732,378.59
结算备付金	4,819,500.00	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	2,857,743,037.45	4,188,391,687.62
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	2,737,735,105.99	4,113,180,914.79
资产支持证券投资	120,007,931.46	75,210,772.83
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	89,959,194.94	50,020,435.03
应收证券清算款	-	-
应收利息	7,661,129.18	7,445,399.94
应收股利	-	-
应收申购款	5,721,944.39	98,883,765.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,172,434,073.20	4,377,473,666.18
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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	200,065,699.97	630,485,094.27
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	435,265.89	488,380.60
应付托管费	174,106.35	195,352.21
应付销售服务费	191,308.86	363,450.17
应付交易费用	47,739.85	77,030.15
应交税费	18,693.93	44,138.06
应付利息	23,321.32	402,025.18
应付利润	699,620.55	1,076,221.18
递延所得税负债	-	-
其他负债	103,726.22	280,500.00
负债合计	201,759,482.94	633,412,191.82
所有者权益:		
实收基金	2,970,674,590.26	3,744,061,474.36
未分配利润	-	-
所有者权益合计	2,970,674,590.26	3,744,061,474.36
负债和所有者权益总计	3,172,434,073.20	4,377,473,666.18

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额总额2,970,674,590.26份,其中安信活期宝A基金份额总额为799,520,103.20份,基金份额净值1.0000元;安信活期宝B基金份额总额为2,171,154,487.06份,基金份额净值1.0000元。

6.2 利润表

会计主体:安信活期宝货币市场基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	68,297,176.50	64,629,716.60
1.利息收入	67,553,403.81	63,430,154.17
其中:存款利息收入	4,355,595.04	9,949,526.43
债券利息收入	57,260,593.29	46,473,052.67
资产支持证券利息收入	1,574,032.06	414,672.93
买入返售金融资产收入	4,363,183.42	6,592,902.14
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	743,772.69	1,199,562.43
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	743,923.19	1,199,562.43
资产支持证券投资收益	-150.50	-
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	9,510,747.41	9,498,468.08
1. 管理人报酬	3,045,235.33	2,165,180.78
2. 托管费	1,218,094.15	760,099.15
3. 销售服务费	1,519,318.47	1,813,042.91
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	3,603,853.25	4,536,114.07
其中:卖出回购金融资产支出	3,603,853.25	4,536,114.07
6. 税金及附加	12,419.99	9,546.80
7. 其他费用	111,826.22	214,484.37
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	58,786,429.09	55,131,248.52
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	58,786,429.09	55,131,248.52

6.3 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:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	3,744,061,474.36	-	3,744,061,474.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	58,786,429.09	58,786,429.09
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)	-773,386,884.10	-	-773,386,884.10
其中:1.基金申购款	9,330,906,194.65	-	9,330,906,194.65
2.基金赎回款	-10,104,293,078.75	-	-10,104,293,078.75
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)	-	-58,786,429.09	-58,786,429.09
五、期末所有者权益(基金净值)	2,970,674,590.26	-	2,970,674,590.26
	上年度可比期间 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)	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)	-	55,131,248.52	55,131,248.52
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)	778,163,716.75	-	778,163,716.75
其中:1.基金申购款	7,492,730,338.79	-	7,492,730,338.79
2.基金赎回款	-6,714,566,622.04	-	-6,714,566,622.04
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)	-	-55,131,248.52	-55,131,248.52
五、期末所有者权益(基金净值)	3,564,002,682.35	-	3,564,002,682.35

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:

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

6.4 报表附注

6.4.1 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)。

6.4.2 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。

6.4.3 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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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 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。

6.4.6 税项

6.4.6.1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。

6.4.6.2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。

6.4.6.3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。

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
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。

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

6.4.8.1.1 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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)
安信证券	3,504,300,000.00	100.00	-	-

6.4.8.1.4 权证交易

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权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,045,235.33	2,165,180.78
其中:支付销售机构的客户维护费	773,847.16	678,790.79

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率逐日计提。计算方法如下:

H=E×管理费率/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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,218,094.15	760,099.15

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.06%的年费率逐日计提。计算方法如下:

H=E×托管费率/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

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 2019年1月1日至2019年6月30日 |