

建信现金添利货币市场基金 2016 年第 1 季度报告

2016 年 3 月 31 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 4 月 20 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 4 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信现金添利货币
基金主代码	000693
交易代码	000693
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 9 月 17 日
报告期末基金份额总额	108,648,148,045.78 份
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采取个券选择策略、利率策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现组合增值。
业绩比较基准	七天通知存款利率（税前）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年1月1日—2016年3月31日）
1. 本期已实现收益	1,025,089,054.36
2. 本期利润	1,025,089,054.36
3. 期末基金资产净值	108,648,148,045.78

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入本期公允价值变动收益，由于该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。

2、持有人认购或交易本基金时，不需缴纳任何费用。

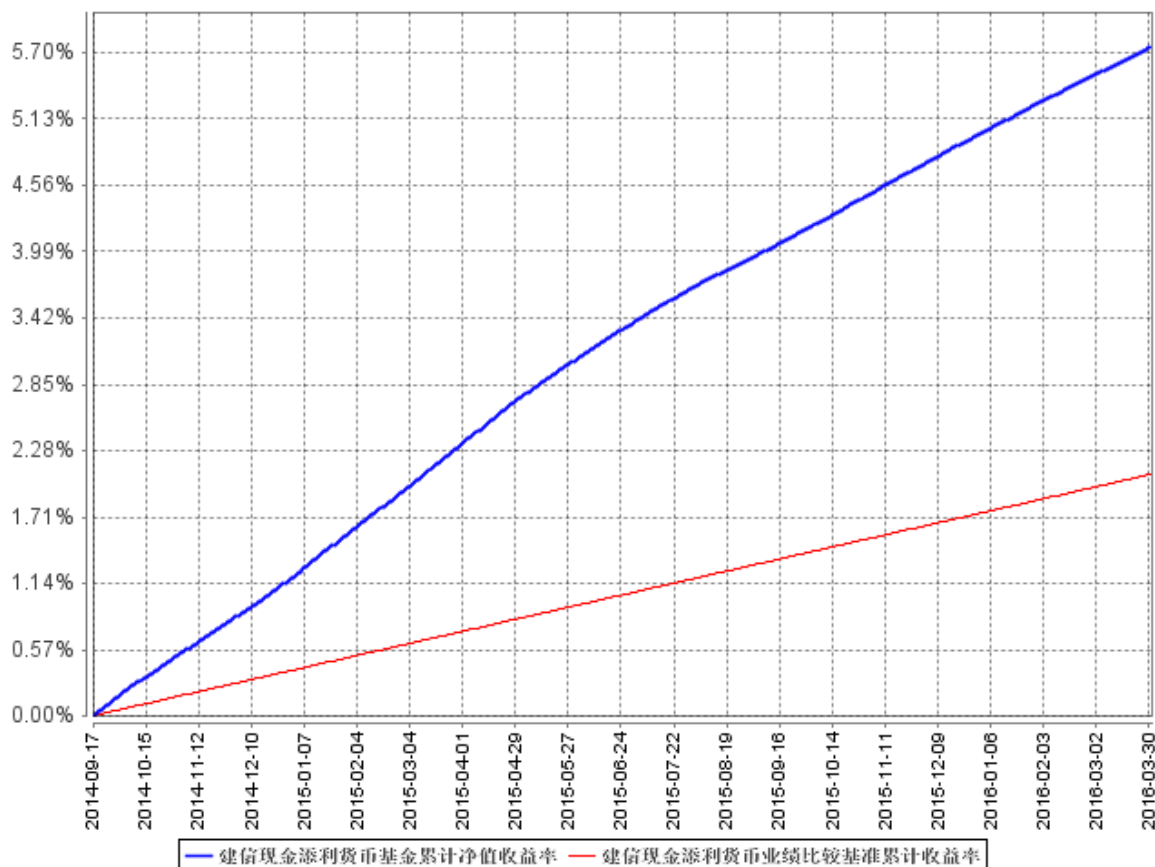
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

阶段	净值收益率①	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	0.7160%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	0.3794%	0.0008%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

建信现金添利货币基金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：本报告期本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
于倩倩	本基金的基金经理	2014年9月17日	-	7	于倩倩女士，硕士。2008年6月加入国泰人寿保险公司，任固定收益研究专员；2009年9月加入金元惠理基金管理公司（原金元比联基金管理公司），任债券研究员；2011年6月加入我公司，历任债券研究员、基金经理助理，2013年8月5日起任建信货币市场基金基金经理；2014年1月21日起任建信双

					周安心理财债券基金的基金经理；2014 年 6 月 17 日起任建信嘉薪宝货币市场基金基金经理；2014 年 9 月 17 日起任建信现金添利货币基金的基金经理。
陈建良	固定收益投资部总经理助理、本基金的基金经理	2014 年 9 月 17 日	-	8	2005 年 6 月加入中国建设银行厦门分行，任客户经理；2007 年 6 月调入中国建设银行总行金融市场部，任债券交易员；2013 年 9 月加入我公司，历任基金经理助理、基金经理、固定收益投资部总监助理。2013 年 12 月 10 日起任建信货币市场基金基金经理；2014 年 1 月 21 日起任建信月盈安心理财基金基金经理；2014 年 6 月 17 日起任建信嘉薪宝货币市场基金基金经理；2014 年 9 月 17 日起任建信现金添利货币基金的基金经理。
高珊	本基金的基金经理	2015 年 8 月 25 日	-	9	硕士。2006 年 7 月至 2007 年 6 月期间在中信建投证券公司工作，任交易员。2007 年 6 月加入建信基金管理公司，历任初级交易员、交易员，2009 年 7 月起任建信货币市场基金的基金经理助理。2012 年 8 月 28 日起任建信双周安心理财债券型证券投资基金基金经理；2012 年 12 月 20 日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理；2013 年 1 月 29 日起任建信双月安心理财债券型证券投资基金基金经理；2013 年 9 月 17 日起任建信周盈安心理财债券型证券投资基金基金经理；2013 年 12 月 20 日起任建信货币市场基金基金经理；2015 年 8 月 25 日起任建信现金添利货币市场基金基金经理。

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，本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信现金添利货币市场基金基金合同》的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现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超过该证券当日成交量的 5% 的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年第一季度，主要经济体经济走势进一步分化。美国经济复苏势头减缓，欧元区复苏基础尚待巩固，日本经济低迷，主要新兴经济体实体经济也面临较多困难。整体来看，今年我国经济增长面临的外部环境更趋复杂，也更加困难。

国内方面，今年 M2 目标由去年的 12% 调增到 13%，并首次将社会融资规模纳入货币政策调控指标，显示出货币政策层面对实体经济的支持力度进一步加大。今年以来，劳动力成本、土地价格刚性上涨，天气因素也推动了食品价格上涨，国内的通胀预期渐起。再加上今年的翘尾影响大于去年，因此 CPI 大概率将保持温和上涨态势。数据显示，基建和房地产的固定投资力度也在加大，经济稳定预期也在加强。

流动性方面，央行通过各种公开市场资金的定价，为市场设立了资金的价格走廊，引导资金价格中枢的稳步下移。统观 1 季度资金面，整体比较平稳，只出现了时点性的紧张。春节前因

为票据问题发酵，结合节假日提现需求较大，导致银行间阶段性资金紧张。3 月季末，资金面也是结构性骤紧，主要央行实行 MPA 考核，银行将资金出给非银机构的意愿不强，导致非银机构的流动性紧张，进而推高了时点性资金价格。

综上所述，本基金在第一季度维持了一贯稳健的投资风格，维持了中性的久期和杠杆比例，并且有效的根据申赎合理安排资金和配置债券。在资金宽松时候提前预备了头寸应对规模收缩，在收益高位又配置了大量优质资产，收官业绩表现良好。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期净值收益率为 0.7160%，波动率为 0.0008%；业绩比较基准收益率为 0.3366%，波动率为 0.0000%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	42,343,853,895.89	35.78
	其中：债券	42,343,853,895.89	35.78
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	10,354,928,723.92	8.75
	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	64,881,200,051.44	54.82
4	其他资产	769,753,990.29	0.65
5	合计	118,349,736,661.54	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	5.18	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	9,386,291,298.20	8.64
	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

本基金本报告期内基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	86
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	65

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天, 平均剩余存续期未超过 240 天。

5.3.2 报告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	33.17	8.83
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	15.64	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.72	-
3	60 天(含)-90 天	16.18	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-180 天	36.00	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)-397 天(含)	6.59	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	107.58	8.83

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本 (元)	占基金资产净值比例 (%)
----	------	----------	---------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,880,179,602.26	8.17
	其中：政策性金融债	8,710,187,224.65	8.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,648,915,203.07	9.80
6	中期票据	-	-
7	同业存单	22,814,759,090.56	21.00
8	其他	-	-
9	合计	42,343,853,895.89	38.97
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	787,427,985.46	0.72

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	150413	15 农发 13	29,100,000	2,909,671,650.14	2.68
2	150416	15 农发 16	17,000,000	1,700,539,288.79	1.57
3	111507114	15 招行 CD114	15,000,000	1,484,224,009.36	1.37
4	111609080	16 浦发 CD080	15,000,000	1,483,219,760.97	1.37
5	160201	16 国开 01	12,000,000	1,198,356,326.21	1.10
6	111690060	16 重庆银行 CD002	11,000,000	1,073,750,983.09	0.99
7	111691030	16 绍兴银行 CD021	10,000,000	995,209,308.69	0.92
8	111593074	15 西安银行 CD036	10,000,000	993,014,906.11	0.91
9	111609015	16 浦发 CD015	10,000,000	991,681,357.17	0.91
10	111691108	16 长沙银行 CD022	10,000,000	987,515,789.85	0.91

5.6 “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	0.1021%

报告期内偏离度的最低值	0.0485%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0686%

5.7 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金计价采用摊余成本法，即估值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法每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在 1.0000 元。

5.8.2

本报告期内，本基金不存在持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20% 的情况。

5.8.3

基金投资的前十名债券的发行主体本期未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。本报告期没有特别需要说明的证券投资决策程序。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	769,753,990.29
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	769,753,990.29

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	165,966,372,764.40
报告期期间基金总申购份额	156,220,578,054.02

报告期期间基金总赎回份额	213,538,802,772.64
报告期期末基金份额总额	108,648,148,045.78

注：上述总申购份额含红利再投份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信现金添利货币市场基金设立的文件；
- 2、《建信现金添利货币市场基金基金合同》；
- 3、《建信现金添利货币市场基金招募说明书》；
- 4、《建信现金添利货币市场基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司
2016 年 4 月 20 日