

建信货币市场基金 2016 年半年度报告摘要

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 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 2016 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 | 建信货币 |
| 基金主代码 | 530002 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006 年 4 月 25 日 |
| 基金管理人 | 建信基金管理有限责任公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 38,184,341,161.82 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在力保本金安全和基金财产较高流动性的前提下，争取获得超过投资基准的收益率。 |
| 投资策略 | 综合运用定量分析和定性分析手段，全面评估货币市场的利率走势、类属资产和券种的风险收益水平及流动性特征，在此基础上制订本基金投资策略。具体而言，包括短期资金利率走势预测、组合剩余期限调整策略、债券期限配置策略、类属资产配置策略、品种选择策略和交易策略等方面。 |
| 业绩比较基准 | 本基金投资业绩比较基准为 6 个月银行定期存款税后收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种；预期收益和风险均低于债券基金、混合基金、股票基金。 |

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 | | 建信基金管理有限责任公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 吴曙明 | 洪渊 |
| | 联系电话 | 010-66228888 | (010) 66105799 |
| | 电子邮箱 | xinxipilu@ccbfund.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-81-95533 010-66228000 | 95588 |
| 传真 | | 010-66228001 | (010) 66105798 |

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 | http://www.ccbfund.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的住所 |

§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(2016年1月1日 - 2016年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | 640,964,133.13 |
| 本期利润 | 640,964,133.13 |
| 本期净值收益率 | 1.3017% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016年6月30日) |
| 期末基金资产净值 | 38,184,341,161.82 |
| 期末基金份额净值 | 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，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、本基金的利润分配按日结转基金份额。

3、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

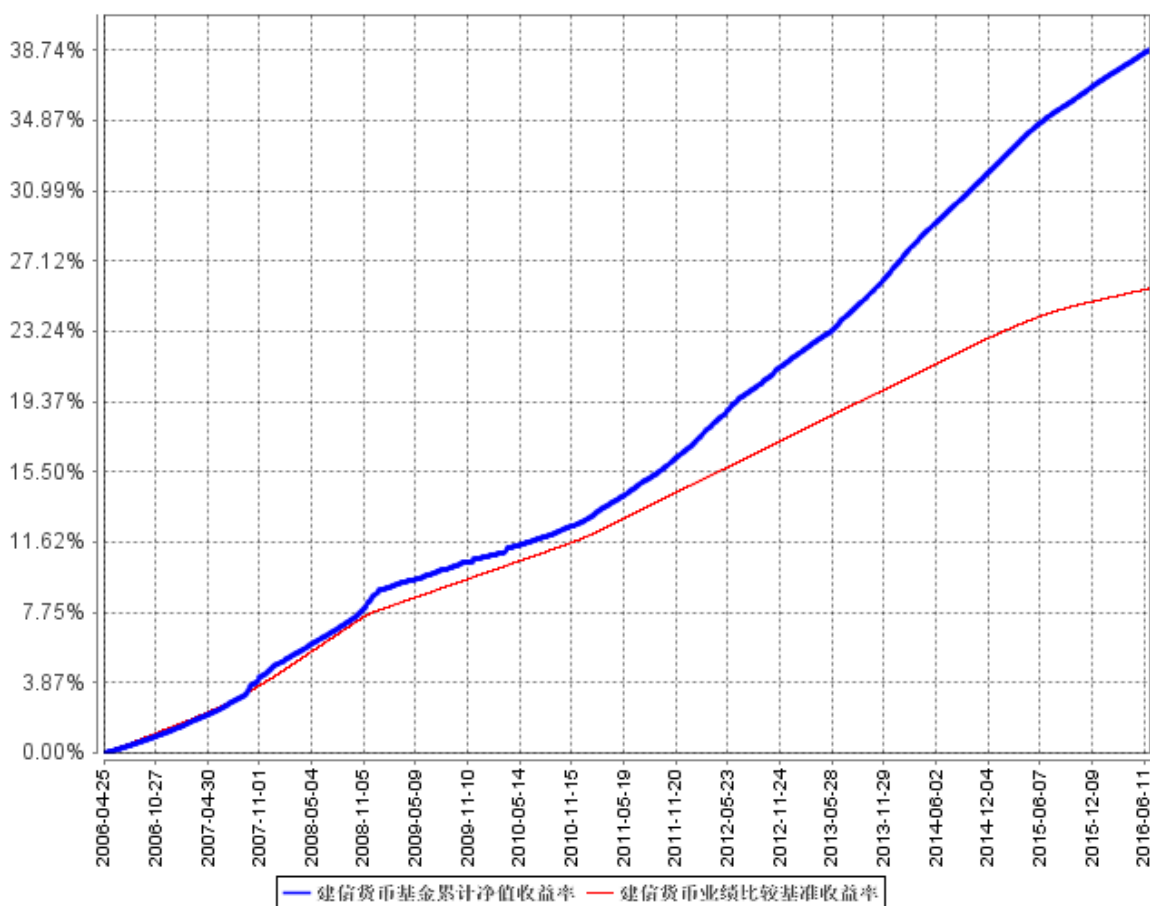
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 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 | 0.2063% | 0.0016% | 0.1068% | 0.0000% | 0.0995% | 0.0016% |
| 过去三个月 | 0.6510% | 0.0015% | 0.3241% | 0.0000% | 0.3269% | 0.0015% |
| 过去六个月 | 1.3017% | 0.0012% | 0.6482% | 0.0000% | 0.6535% | 0.0012% |
| 过去一年 | 2.7724% | 0.0014% | 1.4207% | 0.0005% | 1.3517% | 0.0009% |
| 过去三年 | 12.0335% | 0.0030% | 6.7488% | 0.0017% | 5.2847% | 0.0013% |
| 自基金合同生效起至今 | 38.7405% | 0.0063% | 25.6061% | 0.0017% | 13.1344% | 0.0046% |

注：基金收益分配按日结转份额。

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

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日，注册资本2亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、量化衍生品及海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务

部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部，以及深圳、成都、上海、北京四家分公司和华东、西北两个营销中心，设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“国际一流、国内领先的综合性资产管理公司”。

截至 2016 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）、建信创新中国混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信安心保本二号混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型

证券投资基金、建信安心保本三号混合型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投资基金、建信目标收益一年期债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信安心保本六号混合型证券投资基金、建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金、建信安心保本七号混合型证券投资基金，共计 68 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 2,453.84 亿元。

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 | | |
| 于倩倩 | 本基金的基金经理 | 2013 年 8 月 5 日 | - | 8 | 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 | 2013 年 12 月 10 日 | - | 10 | 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；2016 年 3 月 14 日起任建信目标收益一年期债券型证券投资基金基金经理； |

| | | | | | |
|----|----------|------------------|---|----|---|
| | | | | | 2016 年 7 月 26 日起任建信现金增利货币市场基金基金经理。 |
| 高珊 | 本基金的基金经理 | 2013 年 12 月 20 日 | - | 11 | 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；2016 年 6 月 3 日起任建信鑫盛回报灵活配置基金的基金经理；2016 年 7 月 26 日起任建信现金增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，本基金管理人严格遵守《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》、基金合同和其他法律法规、部门规章，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，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

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

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 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

回顾 2016 年上半年，债券市场整体呈现下跌，其中企业债跌幅最大，国债跌幅最小；整体收益率曲线先陡峭后平坦，金融债而言，中短端品种受资金面紧平衡影响，收益率整体上行，长端品种则受基本面预期的变化影响，收益率先上后下，国债而言，1 季度上涨，2 季度补跌，整体收益率略有上行，企业债而言，受 2 季度信用事件增多影响，中债指数跌幅进一步扩大。

基本面预期重新修正。体现在几个纬度上，其一，5 月初权威人士讲话是标志性事件，重新强调供给侧改革，警惕需求端泡沫风险，预示决策层政策态度发生变化；其二，1 季度信贷数据的回暖势头没有持续，即使考虑置换债的影响，表外融资的萎缩仍是令人担忧的，同时表内信贷增长中按揭和基建支撑大部分，也同样面临放缓；其三，传统产业仍处于去库存进程中，制造业投资进一步放缓，需求端景气过度依赖于地产和基建链条，导致金融资源匹配集中，民间投资受挤出影响显著下滑；其四，外部风险因素加大，先是美联储加息预期的起伏，后是英国脱欧公投的黑天鹅事件，后者最终带来了整体避险情绪的升温。

货币政策以平衡为主，资金面有惊无险。具体而言，其一，外部风险因素加大，年初贬值风波一度造成恐慌，G20 峰会后方才平复，4 月开始人民币贬值预期再度抬头，但央行没有继续动用总量政策工具；其二，内部受缴税等因素影响，基础货币在 2 季度面临较大缺口，央行选择以短期逆回购和 MLF 续做为主，基本保证了短期资金的平稳；其三，对冲时点而言，2 月底的降准，发生在汇率平稳之后，时点略超预期，4 月份 MLF 分了 3 次续做，一度有所犹疑，叠加营改增事件和部分信用事件，4 月资金面偏紧，而后 5 月、6 月对冲动作都比较及时，营改增政策也打了“补丁”，季末实现平稳度过；其四，值得思考的是，2 季度贬值预期的波动，对资金面的影响比预期来得小，可能的猜测是居民剩余换汇额度不足、英国脱欧事件削弱了美联储加息预期。

此外，上半年债券市场不可忽略的关键词是信用重估，4 月份连续爆发的几桩信用事件，颇有一点儿无序违约的苗头，二级市场上过剩产能行业债券的价值被重估，一级市场上再融资能力也迅速萎缩。

本基金以管理流动性为第一要务，首先，考虑到机构资金申赎波动的特性，我们布局适量资金到季末、半年末的关键时点，其次，考虑到资金面紧平衡的格局，我们积极捕捉资金波动带来的配置机会，适当锁定部分中长期资金，充分对比线上线下、场内场外、一级二级各种资产，择优投资，利用适度灵活的杠杆策略，为投资者获得了稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值收益率 1.3017%，波动率 0.0012%，业绩比较基准收益率 0.6482%，波动率 0.0000%。

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 2016 年下半年，债券市场面临的多空因素交织，短期内利率债料难突破震荡格局。

风险因素体现在以下几个纬度，其一，实体经济数据可能不会掉得那么快，房地产销售在 2 季度见顶，对开发投资的传导还需要 1—2 个季度，此外基建投资也仍有对冲的空间；其二，货币政策边际上进一步宽松的条件仍不够充分，毕竟全球量宽带来的经济、社会、政治矛盾弊端都越来越显现出来，且 5 月初权威人士的讲话以及 7 月的政治局会议都在传递泡沫风险的警示；其三，年初以来监管层一直传递出抑制金融杠杆的意图，资管、专户、保险等各领域都出台了相应的规范意见，7 月又进一步出台了理财监管新规的征求意见稿，如果执行层面较为严格的话，对市场是有一定冲击的；其四，7 月也是年报更新评级的截止时间窗口，同时产能过剩行业主体在 3 季度也进入到到期高峰，信用违约预期可能会有所升温；其五，湖北、湖南、安徽等地水灾严重程度不亚于 2008 年，对食品价格或有滞后影响，同时大宗商品价格、油价也在上涨，PPI 环比面临持续收敛，后续通胀预期可能会有所起伏。

有利因素体现在以下几个纬度，其一，房地产销售增速已经见顶，依赖地产及基建拖底需求的经济体动能会重新回落，民间投资在融资能力被挤出的金融条件下仍难以摆脱下滑趋势；其二，金融数据的表现不会好看，一方面是由于去年的高基数，另一方面在于上半年增长的结构中按揭占比不小，这部分在下半年大概率是跟随地产景气回落的；其三，货币政策受制于外部风险因素的程度是有所下降的，一方面英国脱欧事件暴露了外围环境的不稳定因素，延缓了美联储加息的步伐，也使得国内相对稳定优势看起来有所回升，另一方面上半年也释放了一定的贬值压力，加

上 9 月 G20 峰会再度召开以及外汇有限管制的现实，资本外流的压力看起来是放缓的；其四，通胀预期即使有所起伏，尚不至于到达政策紧缩的临界点；其五，非标资产陆续到期，资产欠配压力明显上升。

由于英国脱欧事件后，避险情绪有所升温，债券市场已演绎了一波行情，站在目前的估值角度，市场需要进一步的刺激因素才能打开收益率的下行空间，但目前看，监管层促进金融去杠杆、资金回流实体的意图是相对明确的，这意味着新的刺激因素兑现的概率可能低于预期。

本基金以管理流动性为第一要务，考虑到央行在流动性的指引上仍在松紧适度之间，下半年资金面大概率呈现平衡格局，本基金必须对资金面的变化保持高度警惕，一方面积极捕捉季节因素带来的资金波动机会，提前布局部分中长期资金，另一方面也要对资产规模的变化做出适时应对，根据来自不同机构的资金特性，重点布局各个关键时间点的流动性资产，保持总体剩余期限在中等水平，继续为投资者获得稳定的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策；对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督；对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总裁、督察长、投资总经理、研究总经理、风险管理总经理、运营总经理及监察稽核总经理组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成（具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定）。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件，发现估值问题；提议基金估值调整的相关方案并进行校验；根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案，报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的，由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果，基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。

自 2015 年 3 月 26 日起，公司按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值价格，对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配方式为红利再投资，每日将当日收益结转为基金份额，当日收益结转的基金份额参与下一日基金收益分配，并按月结转到投资者基金账户。本报告期内基金应分配利润为 640,964,133.13 元，已全部分配，符合法律法规和《基金合同》的相关规定。

§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

本报告期内，本基金托管人在对建信货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，建信货币市场基金的管理人——建信基金管理有限责任公司在建信货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

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

本托管人依法对建信基金管理有限责任公司编制和披露的建信货币市场基金 2016 年半年度

报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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：建信货币市场基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | | 21,444,042,199.64 | 21,090,518,706.68 |
| 结算备付金 | | 19,715,232.83 | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | | 17,159,742,794.45 | 30,027,128,664.84 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 17,159,742,794.45 | 30,027,128,664.84 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | 3,493,383,756.69 | 19,500,529,319.90 |
| 应收证券清算款 | | - | 1,000,204,465.68 |
| 应收利息 | | 217,706,594.41 | 359,015,456.73 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 12,978,074.65 | 1,109,358,946.30 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 42,347,568,652.67 | 73,086,755,560.13 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 | 上年度末 2015 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 | | 4,129,696,510.45 | 999,998,260.00 |
| 应付证券清算款 | | 491,944.49 | - |
| 应付赎回款 | | 4,098,773.62 | 60,698,605.80 |
| 应付管理人报酬 | | 13,312,649.86 | 16,753,867.99 |
| 应付托管费 | | 4,034,136.32 | 5,076,929.72 |

| | | | |
|---------------|--|-------------------|-------------------|
| 应付销售服务费 | | 10,085,340.83 | 12,692,324.23 |
| 应付交易费用 | | 211,810.03 | 350,950.87 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | 848,543.83 | 64,133.63 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 447,781.42 | 483,915.00 |
| 负债合计 | | 4,163,227,490.85 | 1,096,118,987.24 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | | 38,184,341,161.82 | 71,990,636,572.89 |
| 未分配利润 | | - | - |
| 所有者权益合计 | | 38,184,341,161.82 | 71,990,636,572.89 |
| 负债和所有者权益总计 | | 42,347,568,652.67 | 73,086,755,560.13 |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额

38,184,341,161.82 份。

6.2 利润表

会计主体：建信货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------------|-----|------------------------------------|------------------------------------|
| | | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
| 一、收入 | | 829,466,089.97 | 699,320,433.33 |
| 1.利息收入 | | 784,257,243.55 | 647,851,287.60 |
| 其中：存款利息收入 | | 355,700,310.27 | 368,825,715.34 |
| 债券利息收入 | | 365,147,023.94 | 231,260,486.49 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 63,409,909.34 | 47,765,085.77 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 45,178,161.49 | 51,469,145.73 |
| 其中：股票投资收益 | | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 45,178,161.49 | 51,469,145.73 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 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） | | 30,684.93 | - |
| 减：二、费用 | | 188,501,956.84 | 128,580,747.44 |
| 1. 管理人报酬 | | 82,054,387.22 | 48,857,485.87 |
| 2. 托管费 | | 24,864,965.80 | 14,805,298.78 |
| 3. 销售服务费 | | 62,162,414.52 | 37,013,246.93 |
| 4. 交易费用 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 19,094,140.39 | 27,590,657.33 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 19,094,140.39 | 27,590,657.33 |
| 6. 其他费用 | | 326,048.91 | 314,058.53 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 640,964,133.13 | 570,739,685.89 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 640,964,133.13 | 570,739,685.89 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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） | 71,990,636,572.89 | - | 71,990,636,572.89 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 640,964,133.13 | 640,964,133.13 |
| 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） | -33,806,295,411.07 | - | -33,806,295,411.07 |
| 其中：1.基金申购款 | 136,277,134,565.18 | - | 136,277,134,565.18 |
| 2.基金赎回款 | -170,083,429,976.25 | - | -170,083,429,976.25 |
| 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） | - | -640,964,133.13 | -640,964,133.13 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 38,184,341,161.82 | - | 38,184,341,161.82 |

| 项目 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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) | 46,227,130,117.83 | - | 46,227,130,117.83 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 570,739,685.89 | 570,739,685.89 |
| 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) | -11,679,160,462.43 | - | -11,679,160,462.43 |
| 其中：1.基金申购款 | 130,475,675,387.65 | - | 130,475,675,387.65 |
| 2.基金赎回款 | -142,154,835,850.08 | - | -142,154,835,850.08 |
| 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) | - | -570,739,685.89 | -570,739,685.89 |
| 五、期末所有者权益 (基金净值) | 34,547,969,655.40 | - | 34,547,969,655.40 |

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：

_____ 孙志晨 _____ 赵乐峰 _____ 丁颖
 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

建信货币市场基金(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”)证监基金字[2006]第 56 号《关于同意建信货币市场基金募集的批复》核准,由建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《建信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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 7,659,641,315.67 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 48 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信货币市场基金基金合同》于 2006 年 4 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 7,660,614,611.89 份基金份额,其中认购资金利息折合 973,296.22 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金

托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》和《建信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;通知存款;一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;剩余期限在 397 天(含 397 天)以内的债券;期限在一年以内(含一年)的债券回购;期限在一年以内(含一年)的中央银行票据以及中国证监会、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为六个月银行定期存款税后收益率。

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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信货币市场基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间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

本基金本报告期内未发生会计差错。

6.4.6 税项

财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号

《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，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。

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

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 |
|------------------------|---------------------|
| 建信基金管理有限责任公司(“建信基金”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 美国信安金融服务公司 | 基金管理人的股东 |
| 中国华电集团资本控股有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 建信资本管理有限责任公司 | 基金管理人子公司 |

下述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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

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未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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 2016年1月1日至2016年 6月30日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 82,054,387.22 | 48,857,485.87 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,728,140.63 | 4,476,611.57 |

注：1、支付基金管理人建信基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值

0.33%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 X 0.33% / 当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 24,864,965.80 | 14,805,298.78 |

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% / 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

| 获得销售服务费 各关联方名称 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | |
|-------------------|--|--|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | |
| 中国建设银行 | 5,362,041.20 | |
| 中国工商银行 | 143,641.90 | |
| 建信基金 | 49,918,927.41 | |
| 合计 | 55,424,610.51 | |
| 获得销售服务费 各关联方名称 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | |
| 中国建设银行 | 12,676,221.66 | |
| 中国工商银行 | 181,571.36 | |
| 建信基金 | 19,168,774.95 | |
| 合计 | 32,026,567.97 | |

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 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给建信基金管理有限责任公司，再由建信基金管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 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 |
| 中国工商银行 | - | - | - | - | 29,773,840,000.00 | 1,957,014.65 |
| 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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 |

| | | | | | | |
|--------|---|---|---|---|-------------------|--------------|
| 中国工商银行 | - | - | - | - | 13,073,340,000.00 | 1,144,721.86 |
|--------|---|---|---|---|-------------------|--------------|

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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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的情况

除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未持有本基金。

6.4.8.5 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 2016年1月1日至2016年6月 30日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日 | |
|-------|--------------------------------|--------------|---------------------------------|--------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| | 中国工商银行 | 4,042,199.64 | 151,880.17 | 2,685,540.44 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.8.6 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发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间内本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。

6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年6月30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2,429,696,510.45元，是以如下债券作为抵押：

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 |
|------|------|-------|--------|-------|--------|
|------|------|-------|--------|-------|--------|

| | | | | | |
|-----------|-------------------|-------------------|--------|------------|------------------|
| 150416 | 15 农发 16 | 2016 年 7 月 4 日 | 100.00 | 10,000,000 | 999,986,366.22 |
| 150215 | 15 国开 15 | 2016 年 7 月 1 日 | 100.00 | 1,000,000 | 100,001,040.18 |
| 110412 | 11 农发 12 | 2016 年 7 月 1 日 | 100.04 | 500,000 | 50,021,880.84 |
| 130429 | 13 农发 29 | 2016 年 7 月 1 日 | 100.79 | 500,000 | 50,396,454.33 |
| 150416 | 15 农发 16 | 2016 年 7 月 6 日 | 100.00 | 500,000 | 49,999,318.31 |
| 150419 | 15 农发 19 | 2016 年 7 月 6 日 | 99.99 | 4,000,000 | 399,944,530.72 |
| 120233 | 12 国开 33 | 2016 年 7 月 6 日 | 99.93 | 500,000 | 49,963,566.58 |
| 150222 | 15 国开 22 | 2016 年 7 月 6 日 | 100.02 | 800,000 | 80,014,633.83 |
| 130237 | 13 国开 37 | 2016 年 7 月 6 日 | 100.32 | 1,500,000 | 150,476,264.97 |
| 111592990 | 15 盛京银 行 CD075 | 2016 年 7 月 4 日 | 98.50 | 5,260,000 | 518,120,261.17 |
| 合计 | | | | 24,560,000 | 2,448,924,317.15 |

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,700,000,000.00 元，于 2016 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 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 2016 年 6 月 30 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无属于第一层级的余额，属于第二层级的余额为 17,159,742,794.45 元，无属于第三层级的余额（2015 年 6 月 30 日：无第一层级余额，第二层级 16,473,680,746.34 元，无第三层级）。于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（2015 年 6 月 30 日：同）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 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 | 17,159,742,794.45 | 40.52 |
| | 其中：债券 | 17,159,742,794.45 | 40.52 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 3,493,383,756.69 | 8.25 |
| | 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 | 21,463,757,432.47 | 50.68 |
| 4 | 其他各项资产 | 230,684,669.06 | 0.54 |
| 5 | 合计 | 42,347,568,652.67 | 100.00 |

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例 (%) | |
|----|--------------|------------------|----------------|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 4.15 | |
| | 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 | 4,129,696,510.45 | 10.82 |
| | 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

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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 | 83 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 99 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 55 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 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。

7.3.2 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 | 33.98 | 10.82 |
| | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天(含)—60 天 | 13.06 | - |
| | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天(含)—90 天 | 24.61 | - |
| | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天(含)—120 天 | 9.81 | - |
| | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |

| | | | |
|----|----------------------|--------|-------|
| 5 | 120天(含)—397天(含) | 28.84 | - |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 110.30 | 10.82 |

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

7.5 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 | 1,794,417,098.56 | 4.70 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 1,930,804,055.98 | 5.06 |
| | 其中：政策性金融债 | 1,930,804,055.98 | 5.06 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 2,959,627,534.45 | 7.75 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 10,474,894,105.46 | 27.43 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 17,159,742,794.45 | 44.94 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

7.6 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 | 111508158 | 15 中信 CD158 | 11,000,000 | 1,097,458,214.53 | 2.87 |
| 2 | 150416 | 15 农发 16 | 10,500,000 | 1,049,985,684.53 | 2.75 |
| 3 | 020121 | 16 贴现 23 | 10,000,000 | 996,910,705.92 | 2.61 |
| 4 | 111618153 | 16 华夏 CD153 | 10,000,000 | 993,114,739.68 | 2.60 |
| 5 | 111692121 | 16 杭州银行 CD057 | 10,000,000 | 992,603,834.90 | 2.60 |
| 6 | 111592990 | 15 盛京银行 CD075 | 10,000,000 | 985,019,507.93 | 2.58 |
| 7 | 111516196 | 15 上海银行 CD196 | 5,000,000 | 499,158,320.16 | 1.31 |

| | | | | | |
|----|-----------|----------------|-----------|----------------|------|
| 8 | 020119 | 16 贴现 21 | 5,000,000 | 498,648,131.88 | 1.31 |
| 9 | 111611235 | 16 平安 CD235 | 5,000,000 | 496,639,753.96 | 1.30 |
| 10 | 111615130 | 16 民生 CD130 | 5,000,000 | 496,321,521.07 | 1.30 |

7.7 “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 | - |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.1735% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0357% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1122% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

报告期内正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

7.8 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

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。

7.9.2

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，中信银行股份有限公司(601998)于 2016 年 1 月 29 日发布公告：中信银行兰州分行发生票据业务风险事件。经核查，涉及风险金额为人民币 9.69 亿元，公安机关已立案侦查。

7.9.3 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 | 217,706,594.41 |
| 4 | 应收申购款 | 12,978,074.65 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 230,684,669.06 |

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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 |
| 692,028 | 55,177.45 | 34,251,897,160.78 | 89.70% | 3,932,444,001.04 | 10.30% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 9,892,833.17 | 0.03% |

8.3 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 | 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 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------|--------------------|
| 基金合同生效日（2006 年 4 月 25 日）基金份额总额 | 7,661,034,284.89 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 71,990,636,572.89 |
| 本报告期基金总申购份额 | 136,277,134,565.18 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 170,083,429,976.25 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 38,184,341,161.82 |

注：上述总申购份额含红利再投资和转换转入份额，总赎回份额含转换转出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 | |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为。

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

（3）具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个股等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务。

（4）佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本报告期内未发生交易单元的变更。

10.7.2 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 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券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 |
| 中金公司 | - | - | 12,378,800,000.00 | 100.00% | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内偏离度绝对值不存在超过 0.5%的情况。

建信基金管理有限责任公司
2016 年 8 月 27 日