

# 建信嘉薪宝货币市场基金 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 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：中信银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 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。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司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 2016 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	建信嘉薪宝货币	
基金主代码	000686	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 6 月 17 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,916,895,681.67 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	建信嘉薪宝货币 A	建信嘉薪宝货币 B
下属分级基金的交易代码:	000686	002753
报告期末下属分级基金的份额总额	481,084,388.00 份	10,435,811,293.67 份

### 2.2 基金产品说明

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。

### 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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	方韡
	联系电话	010-66228888	4006800000
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	fangwei@citicbank.com.cn
客户服务电话		400-81-95533      010-66228000	95558
传真		010-66228001	010-85230024

### 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	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

### §3 主要财务指标、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	2016 年		2015 年		2014 年 6 月 17 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日	
	建信嘉薪宝货币 A	建信嘉薪宝货币 B	建信嘉薪宝货币 A	建信嘉薪宝货币 B	建信嘉薪宝货币 A	建信嘉薪宝货币 B
本期已实现收益	13,078,943.48	71,296,143.99	16,824,457.08	-	6,147,402.13	-
本期利润	13,078,943.48	71,296,143.99	16,824,457.08	-	6,147,402.13	-
本期净值收益率	2.5300%	1.4246%	4.1445%	-	2.2887%	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
期末基金资产净值	481,084,388.00	10,435,811,293.67	485,189,973.35	-	330,504,183.81	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	-	1.0000	-

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。

4、本基金于 2016 年 5 月 9 日起新增 B 类份额，原有份额转换 A 类份额。

#### 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

建信嘉薪宝货币 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
过去三个月	0.6174%	0.0011%	0.3403%	0.0000%	0.2771%	0.0011%
过去六个月	1.2369%	0.0012%	0.6805%	0.0000%	0.5564%	0.0012%
过去一年	2.5300%	0.0019%	1.3537%	0.0000%	1.1763%	0.0019%
自基金合同生效起至今	9.2233%	0.0070%	3.4360%	0.0000%	5.7873%	0.0070%

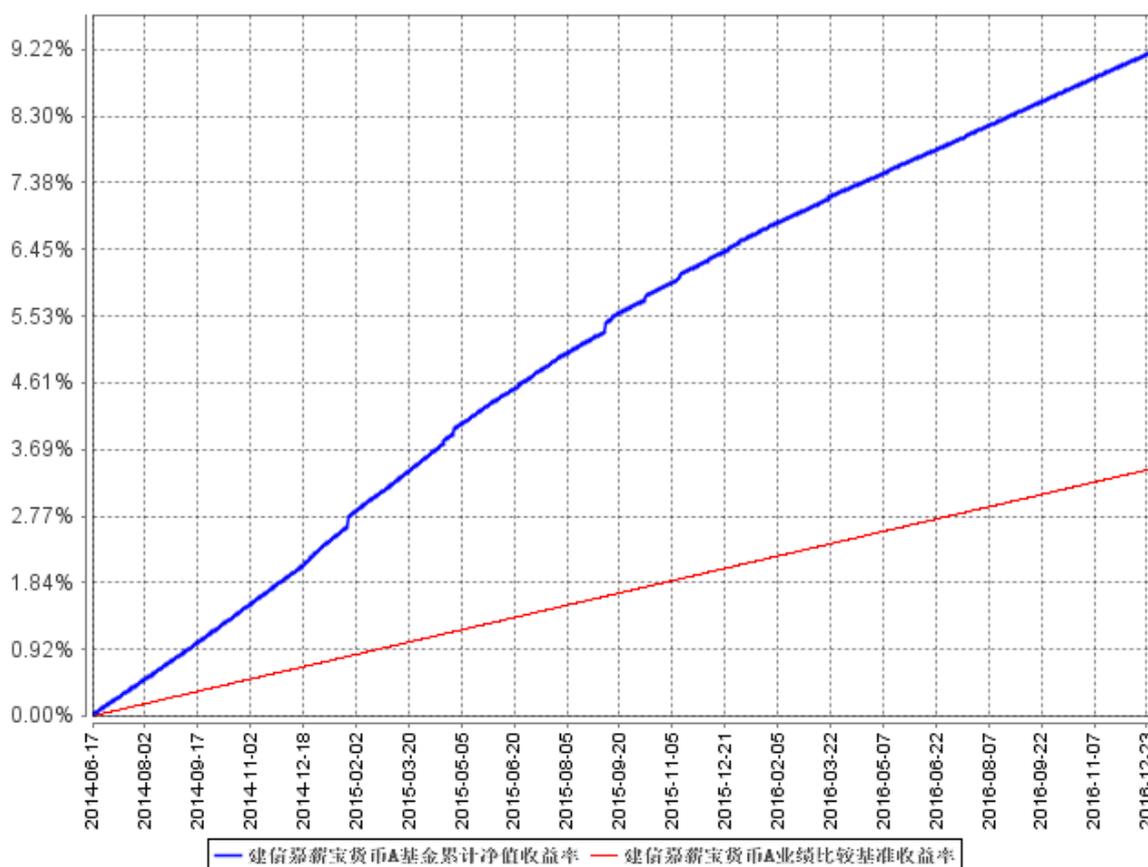
建信嘉薪宝货币 B

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-④
----	------	------	------	-------	-----	-----

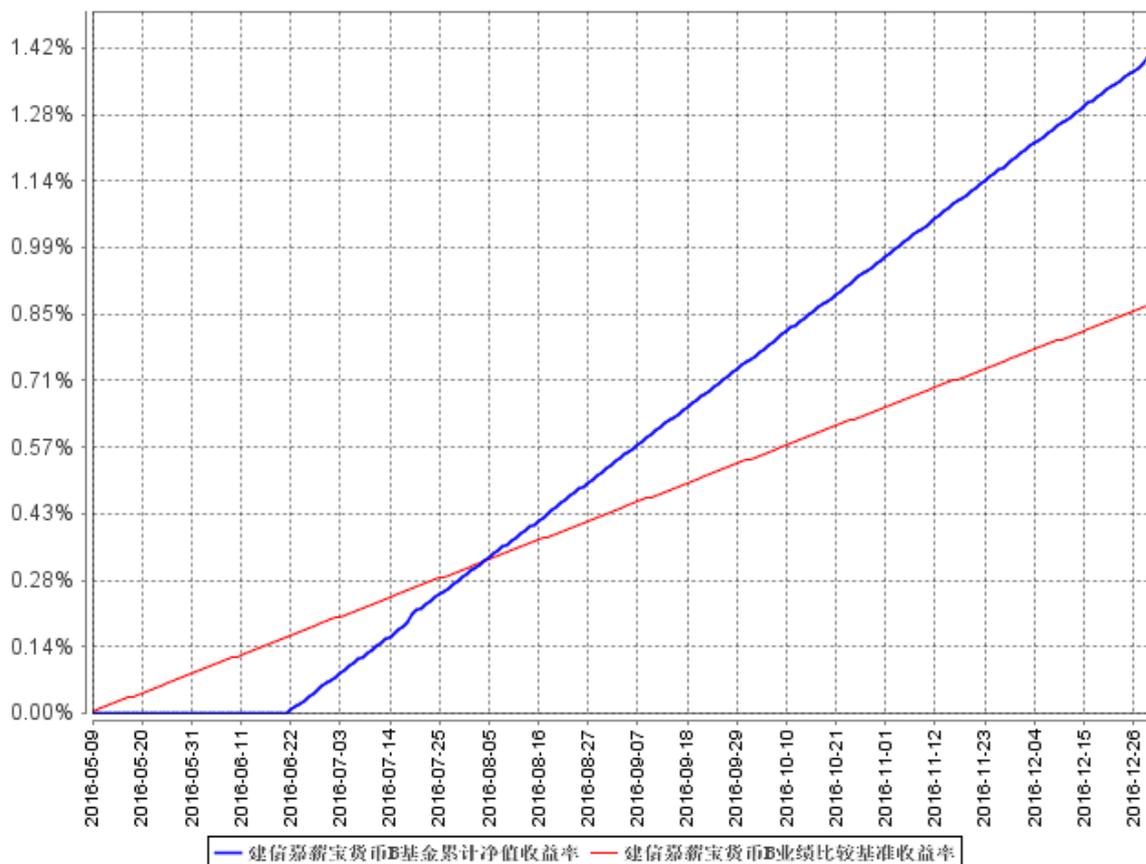
	收益率①	收益率标准差②	基准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	0.6781%	0.0011%	0.3403%	0.0000%	0.3378%	0.0011%
过去六个月	1.3592%	0.0012%	0.6805%	0.0000%	0.6787%	0.0012%
过去一年	1.4246%	0.0031%	0.8766%	0.0000%	0.5480%	0.0031%
自基金合同生效起至今	1.4246%	0.0031%	0.8766%	0.0000%	0.5480%	0.0031%

### 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

建信嘉薪宝货币A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



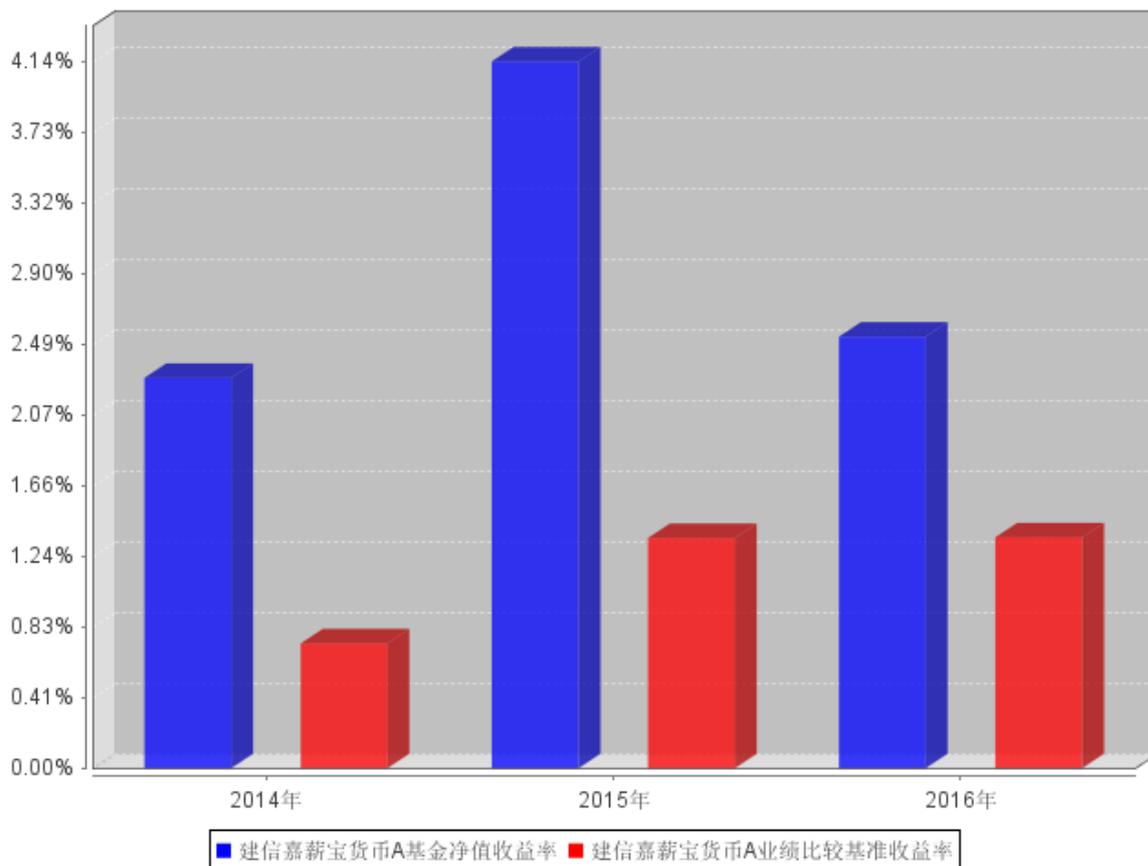
建信嘉薪宝货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



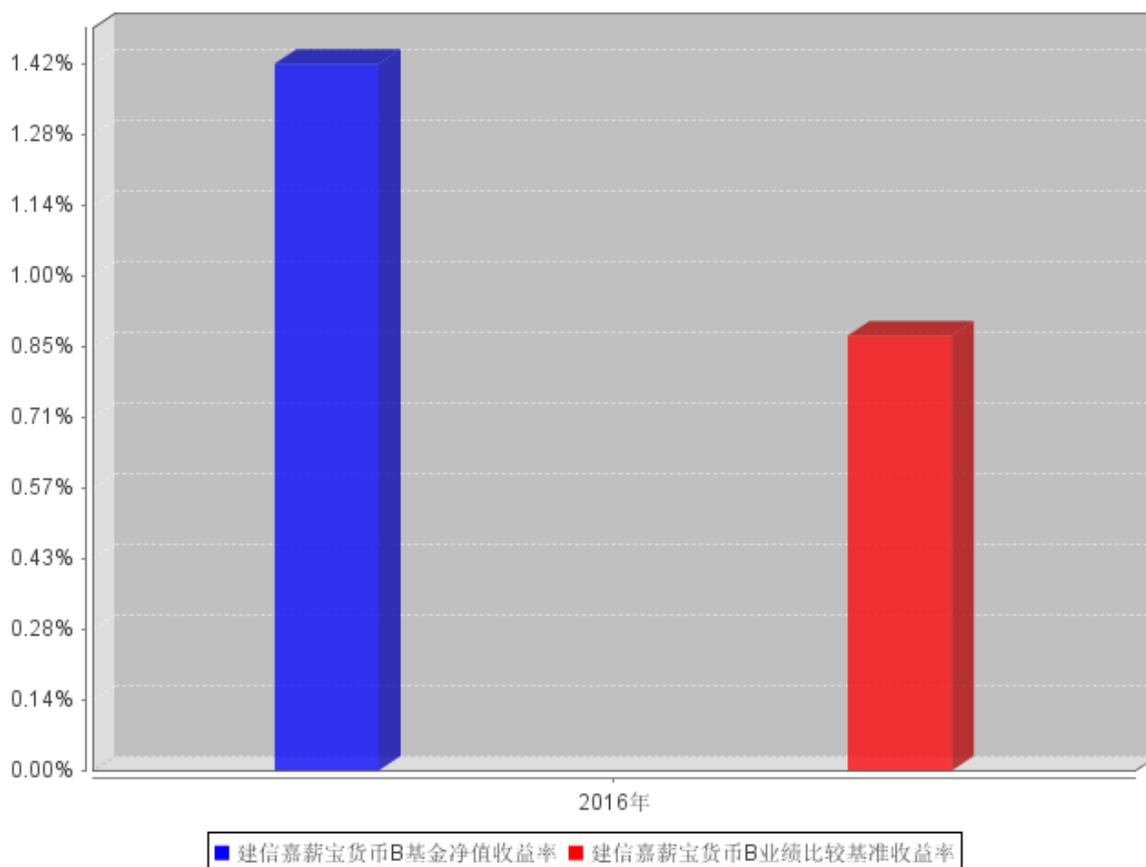
本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信嘉薪宝货币A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对比图



### 建信嘉薪宝货币B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对比图



本基金基金合同于 2014 年 6 月 17 日生效，基金成立当年净值收益率以实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

建信嘉薪宝货币 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
2016	13,078,943.48	-	-	13,078,943.48	
2015	16,824,457.08	-	-	16,824,457.08	
2014	6,147,402.13	-	-	6,147,402.13	
合计	36,050,802.69	-	-	36,050,802.69	

单位：人民币元

建信嘉薪宝货币 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
2016	71,296,143.99	-	-	71,296,143.99	
合计	71,296,143.99	-	-	71,296,143.99	

注：本基金于 2016 年 5 月 9 日起新增 B 类份额，原有份额转换 A 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

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、财务管理部、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、广州五家分公司和华东、西北两个营销中心，并在上海设立了子公司——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 12 月 31 日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信货币市场基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、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、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信积极配置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、建信信用增强债券型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、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、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信纯债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、建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券

投资基金、建信创新中国混合型证券投资基金、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、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、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、建信现金增利货币市场基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信瑞盛添利混合型证券投资基金、建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒丰纯债债券型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金共 82 只开放式基金，管理的公募基金资产规模共计为 3770.62 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	2014 年 6 月 17 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	固定收益投资部副总经理、本基金的基金经理	2014 年 6 月 17 日	-	9	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；2016 年 9 月 2 日起任建信现金添益交易型货币市场基金基金经理；2016 年 9 月 13 日起任建信瑞盛添利混合型证券投资基金基金经理；2016 年 10 月 18 日起任建信基金天添益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 公平交易制度和控制方法

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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

本基金管理人对过去四个季度不同时间窗口下（日内、3日内、5日内）管理的不同投资组合（包括封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合等）同向交易的交易价差从 T 检验（置信度为 95%）、平均溢价率、贡献率、正溢价率占优频率等几个方面进行了专项分析。具体分析结果如下：

当时间窗为 1 日时，配了 19338 对投资组合，有 4101 对投资组合未通过 T 检验，其中 1329 对投资组合的正溢价率占优频率小于 55%，其它 2772 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合中，其中 1807 对平均溢价率低于 2%，其它 965 对平均溢价率超过 2%的投资组合中，其中 920 对贡献率均未超过 5%，另外 45 对溢价金额占组合净资产比例很小，因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为；

当时间窗为 3 日时，配了 20730 对投资组合，有 4694 对投资组合未通过 T 检验，但其中 822 对投资组合的溢价率占优频率均小于 55%，其它 3872 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合中，其中 3601 对平均溢价率低于 5%，其它 271 对平均溢价率超过 5%的投资组合中，有 235 对

贡献率未超过 5%，另外 36 对溢价金额占组合净资产比例很小，因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为；

当时间窗为 5 日时，配了 21350 对投资组合，有 5960 对投资组合未通过 T 检验，但其中 1162 对投资组合的溢价率占优频率均小于 55%，其它 4798 对正溢价率占优频率大于 55% 的投资组合，其中 4709 对平均溢价率低于 10%，其它 89 对平均溢价率超过 10% 的投资组合中，有 80 对贡献率均未超过 5%，另外 9 对溢价金额占组合净资产比例很小，同样未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人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% 的情况有 2 次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

## 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，债券市场整体出现大幅下跌，跌幅超过 2%，时间主要分布在 2 季度和 4 季度，其中企业债指数跌幅最大，金融债指数次之，国债指数跌幅最小，整体收益率水平大幅上行，曲线进一步平坦化；年度行情以债灾收尾，明显超出市场预期，主要是同业、资管业务链条杠杆嵌套，引来监管层一致启动风险纠偏，短期利率均衡水平被重构，连锁反应到各个资产环节。

基本面预期偏于利空。体现在几个维度上，其一，房地产市场是价格大幅上涨的大年行情，库存去化进程很快，带动相关消费、投资数据走稳，推升相关服务消费价格回升；其二，基建仍是全年的亮点，主要得益于 PPP 模式的推进、债务置换力度的加大以及专项债发行；其三，供给侧改革持续推进，过剩产能去化明显，中上游价格大幅上涨，带来库存回补预期；其四，通胀预期重新升温，体现在 PPI 转正并持续回升。外围来看，年度发生两件黑天鹅事件，其一是年中的英国脱欧，一度带来避险预期的回升，但事后实质影响并未继续发酵，另一件则是 4 季度的美国大选，特朗普财政刺激计划明显带动了需求端预期回暖。

与实体相较，金融体系内的风险再度累积，政策应对更加灵活多变。体现在几个维度上，其一，汇率方面，在强美元的环境下，人民币经历了贬值压力释放的一年，G20 会议强化了国际间政策协同，且在有限管制的形势下，内部利率受到的掣肘程度尚能弥补，多样化的货币供给方式保证了上半年相对较低的均衡利率水平；其二，同业理财业务得到了爆发式增长，低利率环境下的杠杆嵌套与期限错配极大地累积了风险，并引发监管层进行风险纠偏；其三，总量层面的政策

转向始于 8 月，央行在公开市场上收短放长，并窗口指导资金拆借市场，去杠杆意图得以彰显，叠加前期金融体系风险的快速积累，最终引发了 4 季度的大调整，短期负债利率均衡水平被重构，连锁反应波及到各个金融资产环节。

资金面波动更是冰火两重天。表现出几方面新的特征，其一，资金松的时候极度宽松，短期资金过度累积，价格异常低迷，杠杆错配换取收益的策略变成无奈选择；其二，资金紧的时候，流动性快速丧失，负债端的稳定性变得至关重要；其三，MPA 考核将非银机构置于尴尬境地，每逢季度末，银行往往限制对非银机构融出，后来爆发了国海事件后，非银的流动性获取能力进一步下降。

本基金以管理流动性为第一要务。首先，积极跟踪持有人申赎动态，及时调整组合持仓结构，以保证流动性的充分应对；其次，密切关注资金面预期变化，合理选择流动性配置策略，上半年在低利率环境下，利用适度杠杆策略积极捕捉季节性波动机会，下半年政策转向后，果断降低杠杆，缩短组合剩余期限；最后，经过充分沟通、积极应对，本基金在 2016 年高波动的市场环境下，顺利地实现了流动性的平稳过渡，并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

本报告期嘉薪宝 A 基金净值收益率 2.5300%，波动率 0.0019%，业绩比较基准收益率 1.3537%，波动率 0.0000%，嘉薪宝 B 基金净值收益率 1.4246%，波动率 0.0031%，业绩比较基准收益率 0.8766%，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 2017 年，票息收益已较去年大为改观，但去杠杆压力预计仍将在上半年继续渗透，波段操作需要密切关注政策走向。

基本面预期关注修正的可能。开年经济数据表现不错，去年累积的项目集中在年初投放，贷款投放很快，中上游行业基于供给侧改革预期，价格持续看涨，补库存活动仍在发生，一季度总体基本面预期表现不悲观。二季度后，房地产销量同比下滑的趋势可能显现出来，制造业补库存活动也可能告一段落，贷款增长可能后续乏力，经济基本面预期有被修正的可能。

政策走向是更大的变数。一方面是总量货币政策，春节后央行已经上调了公开市场的操作利率，至少在一定程度上表明去杠杆的进程还没结束，只要短端利率因为去杠杆的动作仍维持在高位，后续公开市场操作就仍然存在利率继续上调的可能；另一方面是金融行业监管政策的调整，2 月已经出台新的资产管理办法，细则如果确定落实，则对市场的短期冲击是不小的。总体来说，

上半年面临的政策压力仍不小，不过当前的实体经济环境本身并不支持短端资金利率水平长期维持在 4%以上，更多是金融系统内阶段性控制风险的产物，下半年可以关注去杠杆压力是否缓解。

资金面来看，上半年压力大于下半年。大的趋势主要是看央行态度，上半年去杠杆的压力还没结束；小的趋势看季节性，季度末、缴税大月都是波动的时点；外部因素的影响看汇率压力，年初以来人民币表现坚挺，后续关注美国经济复苏变化以及美联储加息进程。

本基金以管理流动性为第一要务。上半年在去杠杆的政策压力下，策略选择谨慎，重点配置资金在关键的波动时点，同时密切跟踪持有人结构的变化，对申赎资金动向保持敏感，在保证流动性充分应对的前提下，根据政策信号的变化，适时调整组合策略，择机配置部分资金到下半年，以期持有人获得稳定的收益。

#### 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（适用货币基金和理财类基金）。

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 84,375,087.47 元，其中 A 类份额应分配利润为 13,078,943.48，B 类份额应分配收益为 71,296,143.99，已全部分配，符合法律法规和《基金合同》的相关规定。

本基金于 2016 年 5 月 9 日起新增 B 类份额，原有份额转换 A 类份额。

## §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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对建信嘉薪宝货币市场基金 2016 年度基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司在建信嘉薪宝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、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《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，在各重要方面的运作严格按照基金合

同的规定进行。

### 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

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的建信嘉薪宝货币市场基金 2016 年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## §6 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计了后附的建信嘉薪宝货币市场基金的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注，并出具了普华永道中天审字（2017）第 21915 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：建信嘉薪宝货币市场基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		10,194,790,712.55	261,266,479.45
结算备付金		14,092,727.27	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		219,761,539.77	248,875,762.46
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		219,761,539.77	248,875,762.46
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		468,376,942.57	-
应收证券清算款		10,008,905.56	-

应收利息		7,640,201.63	3,001,347.30
应收股利		-	-
应收申购款		6,049,497.97	7,537,517.49
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	3,419.41
资产总计		10,920,720,527.32	520,684,526.11
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		-	34,999,747.50
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,646,066.60	125,600.10
应付托管费		441,011.09	20,933.35
应付销售服务费		192,478.91	104,666.75
应付交易费用		29,042.47	17,814.83
应交税费		-	-
应付利息		-	2,543.65
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		516,246.58	223,246.58
负债合计		3,824,845.65	35,494,552.76
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		10,916,895,681.67	485,189,973.35
未分配利润		-	-
所有者权益合计		10,916,895,681.67	485,189,973.35
负债和所有者权益总计		10,920,720,527.32	520,684,526.11

报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 10,916,895,681.67 份。其中建信嘉薪宝货币基金 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 481,084,388.00 份；建信嘉薪宝货币基金 B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 10,435,811,293.67 份。

## 7.2 利润表

会计主体：建信嘉薪宝货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
-----	-----	---------------------------------	--------------------------------------

一、收入		99,706,852.99	21,220,122.23
1.利息收入		100,455,300.40	18,718,907.90
其中：存款利息收入		86,614,510.20	8,385,732.97
债券利息收入		8,530,020.89	9,031,691.38
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,310,769.31	1,301,483.55
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-748,447.41	2,501,214.33
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-748,447.41	2,501,214.33
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）		-	-
<b>减：二、费用</b>		15,331,765.52	4,395,665.15
1. 管理人报酬		9,444,165.11	1,297,318.11
2. 托管费		1,574,027.55	216,219.67
3. 销售服务费		1,572,961.41	1,081,098.44
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		2,088,730.52	1,264,711.66
其中：卖出回购金融资产支出		2,088,730.52	1,264,711.66
6. 其他费用		651,880.93	536,317.27
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		84,375,087.47	16,824,457.08
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		84,375,087.47	16,824,457.08

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信嘉薪宝货币市场基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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)	485,189,973.35	-	485,189,973.35
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本期 利润)	-	84,375,087.47	84,375,087.47
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)	10,431,705,708.32	-	10,431,705,708.32
其中: 1. 基金申购款	56,338,499,757.79	-	56,338,499,757.79
2. 基金赎回款	-45,906,794,049.47	-	-45,906,794,049.47
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)	-	-84,375,087.47	-84,375,087.47
五、期末所有者权益 (基金净值)	10,916,895,681.67	-	10,916,895,681.67
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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)	330,504,183.81	-	330,504,183.81
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本期 利润)	-	16,824,457.08	16,824,457.08
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)	154,685,789.54	-	154,685,789.54
其中: 1. 基金申购款	13,552,495,687.59	-	13,552,495,687.59
2. 基金赎回款	-13,397,809,898.05	-	-13,397,809,898.05
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)	-	-16,824,457.08	-16,824,457.08
五、期末所有者权益 (基金净值)	485,189,973.35	-	485,189,973.35

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：

<u>孙志晨</u>	<u>赵乐峰</u>	<u>丁颖</u>
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

建信嘉薪宝货币市场基金(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[2014]第 338 号《关于核准建信嘉薪宝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《建信嘉薪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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 205,515,896.86 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(2014)第 314 号予以验证。经向中国证监会备案,《建信嘉薪宝货币市场基金基金合同》于 2014 年 6 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 205,515,896.86 份基金份额,本基金募集期间有效认购参与款项未产生需要折算为基金份额的利息。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《建信基金管理有限责任公司关于建信嘉薪宝货币市场基金增加基金份额类别的公告》并报证监会备案,本基金于 2016 年 5 月 9 日起根据基金份额持有人的申购金额,对其持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,因此形成不同的基金份额类别。按照 0.25%年费率计提销售服务费的基金份额类别,称为 A 类基金份额;按照 0.01%年费率计提销售服务费的基金份额类别,称为 B 类基金份额。各类基金份额类别分别设置代码并分别计算和公告每万份基金已实现收益和七日年化收益率。投资人可自行选择申购的基金份额类别,本基金不同基金份额类别之间暂不得互相转换。2016 年 5 月 9 日后,原持有的基金份额全部转换为建信嘉薪宝货币市场基金 A 类份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信嘉薪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;期限在一年以内(含一年)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、资产支持证券、非金融企业债务融资工具;法律法规或中国证监会、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七天通知存款利率(税前)。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 2017 年 3 月 27 日批准报出。

## 7.4.2 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》、《建信嘉薪宝货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 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

本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

## 7.4.5 会计差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[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》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。对证券投资基金管理人运用基金买卖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。

(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。

### 7.4.7 关联方关系

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、注册登记机构和基金销售机构
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	基金托管人
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
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	基金管理人的子公司

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

#### 7.4.8.1 关联方报酬

##### 7.4.8.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,444,165.11	1,297,318.11
其中：支付销售机构的客户维护费	828,324.26	449,946.49

1、支付基金管理人建信基金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 X 0.30%/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，不属于从基金资产里列支的费用项目。

##### 7.4.8.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付	1,574,027.55	216,219.67

的托管费		
------	--	--

支付基金托管人中信银行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 X 0.05% / 当年天数。

### 7.4.8.1.3 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信嘉薪宝货币 A	建信嘉薪宝货币 B	合计
建信基金	134,137.82	262,366.58	396,504.40
中信银行	-	-	-
中国建设银行	-	-	-
合计	134,137.82	262,366.58	396,504.40
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信嘉薪宝货币 A	建信嘉薪宝货币 B	合计
建信基金	366,427.04	-	366,427.04
中信银行	-	-	-
中国建设银行	-	-	-
合计	366,427.04	-	366,427.04

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，按月支付给建信基金，再由建信基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额和 B 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 X 约定年费率 / 当年天数。

### 7.4.8.2 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日					
	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
中信银行	-	20,108,202.22	-	-	-	-
银行间市场交易	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	

的各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

### 7.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.3.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	建信嘉薪宝货币 A	建信嘉薪宝货币 B
基金合同生效日（2014年6月17日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	建信嘉薪宝货币 A	建信嘉薪宝货币 B
基金合同生效日（2014年6月17日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	81,304,688.69	-
期间申购/买入总份额	1,958,853.50	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	83,263,542.19	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

分级基金占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

#### 7.4.8.3.2 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

建信嘉薪宝货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
中国建设银行	10,002,539,132.38	95.85%	-	-

分级基金占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

#### 7.4.8.4 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行-活期 存款	514,790,712.55	3,308,531.87	1,266,479.45	209,297.30
中信银行-定期 存款	-	11,450,305.56	-	1,470,869.05

本基金的活期存款和部分定期存款由基金托管人中信银行保管，按约定利率计息。

#### 7.4.8.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.8.6 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。

### 7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.9.1 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。

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限证券。

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

至本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

至本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

#### 7.4.10 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 12 月 31 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属于第二层次的余额为 219,761,539.77 元，无属于第一层次或第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第二层次 248,875,762.46 元，无第一层次或第三层次)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

###### (iii) 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 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

###### (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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	219,761,539.77	2.01
	其中: 债券	219,761,539.77	2.01
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	468,376,942.57	4.29
	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	10,208,883,439.82	93.48
4	其他各项资产	23,698,605.16	0.22
5	合计	10,920,720,527.32	100.00

### 8.2 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	9.03	
	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	-	-
	其中: 买断式回购融资	-	-

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

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 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	25
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	114

报告期内投资组合平均剩余期限最低值	7
-------------------	---

### 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。

#### 8.3.2 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	92.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	3.76	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.09	-
3	60 天(含)—90 天	1.28	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	0.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	2.01	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.91	-

#### 8.4 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。

#### 8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,970,809.86	0.46
	其中：政策性金融债	49,970,809.86	0.46
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	99,998,210.07	0.92
6	中期票据	-	-
7	同业存单	69,792,519.84	0.64

8	其他	-	-
9	合计	219,761,539.77	2.01
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	9,963,977.76	0.09

### 8.6 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	041651016	16 大唐租赁 CP002	300,000	30,048,992.59	0.28
2	160209	16 国开 09	300,000	30,001,724.33	0.27
3	111613104	16 浙商 CD104	300,000	29,992,566.85	0.27
4	011698783	16 象屿股份 SCP001	300,000	29,985,706.70	0.27
5	011698814	16 利港 SCP004	300,000	29,966,707.66	0.27
6	111698780	16 成都银行 CD043	300,000	29,943,612.91	0.27
7	160304	16 进出 04	100,000	10,005,107.77	0.09
8	011698841	16 川投能源 SCP001	100,000	9,996,803.12	0.09
9	150315	15 进出 15	100,000	9,963,977.76	0.09
10	111697828	16 天津银行 CD038	100,000	9,856,340.08	0.09

### 8.7 “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	0.1439%
报告期内偏离度的最低值	-0.0254%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0423%

#### 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%。

## 8.8 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。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1

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。

### 8.9.2

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，天津银行股份有限公司于 2016 年 4 月 8 日发布公告：天津银行上海分行票据买入返售业务发生一起风险事件，涉及风险金额为 7.86 亿元，公安机关已立案侦查。

### 8.9.3 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	10,008,905.56
3	应收利息	7,640,201.63
4	应收申购款	6,049,497.97
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	23,698,605.16

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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	

建信嘉薪宝货币 A	486,595	988.68	6,254,097.04	1.30%	474,830,290.96	98.70%
建信嘉薪宝货币 B	6	1,739,301,882.28	10,435,811,293.67	100.00%	0.00	0.00%
合计	486,601	23,435.00	10,442,065,390.71	95.65%	474,830,290.96	4.35%

分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	建信嘉薪宝货币 A	226,730.87	0.05%
	建信嘉薪宝货币 B	0.00	0.00%
	合计	226,730.87	0.00%

分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 9.3 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	份额级别	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	建信嘉薪宝货币 A	0~10
	建信嘉薪宝货币 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	建信嘉薪宝货币 A	-
	建信嘉薪宝货币 B	-
	合计	-

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

	建信嘉薪宝货币 A	建信嘉薪宝货币 B
基金合同生效日（2014 年 6 月 17 日）基金份额总额	205,563,137.87	-
本报告期期初基金份额总额	485,189,973.35	-
本报告期基金总申购份额	35,777,203,613.80	20,561,296,143.99
减:本报告期基金总赎回份额	35,781,309,199.15	10,125,484,850.32
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	481,084,388.00	10,435,811,293.67

1. 上述总申购份额含红利再投资份额。
2. 本基金于 2016 年 5 月 9 日起新增 B 类份额，原有份额转换 A 类份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金基金份额持有人大会于 2017 年 1 月 13 日表决通过了《关于建信嘉薪宝货币市场基金降低基金费率有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

### 11.2 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

我公司于 2016 年 11 月 22 日第四届董事会第五次会议决定调整高管职务名称，曲寅军任首席投资官（副总裁）、张威威任首席市场官（副总裁）。2016 年 12 月 23 日公司第四届董事会第十二次临时会议决定吴曙明任首席风险官（副总裁）、吴灵玲任首席财务官（副总裁），已按有关规定报中国基金业协会和北京证监局备案，并于 12 月 27 日对外公告。

本报告期内，经中信银行股份有限公司董事会会议审议通过以下事项：任命李庆萍女士为本行董事长，任命孙德顺先生为本行行长，以上任职资格于 2016 年 7 月 20 日获中国银监会批复核准。

2016 年 8 月 6 日，中信银行股份有限公司发布变更法定代表人的公告：“中信银行股份有限公司（“本行”）收到北京市工商行政管理局重新核发的《营业执照》，本行已完成法定代表人变更的工商登记手续，自 2016 年 8 月 1 日起，本行法定代表人由常振明先生变更为李庆萍女士。”

### 11.3 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。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为人民币 153,000.00 元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

## 11.6 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、基金业协会、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。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	2	-	-	-	-	-

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、个券等进行深入、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、本基金本报告期未新增交易单元，未剔除交易单元，与托管在同一托管行的公司其他基金共

用交易单元。

### 11.7.2 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	-	-	11,773,800,000.00	100.00%	-	-

### 11.8 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  
2017 年 3 月 29 日