建信天添益货币市场基金 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：江苏银行股份有限公司

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。

基金托管人江苏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 10 月 18 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	建信天添益货币		
基金主代码	003391		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016 年 10 月 18 日		
基金管理人	建信基金管理有限责任公司		
基金托管人	江苏银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	7,541,777,837.18 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称：	建信天添益货币 A	建信天添益货币 B	建信天添益货币 C
下属分级基金的交易代码：	003391	003392	003393
报告期末下属分级基金的份额总额	93,655.58 份	475,253,408.81 份	7,066,430,772.79 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，力争实现稳定的、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	江苏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	王凯宁
	联系电话	010-66228888	025-58588217
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	wangkaining@jsbchina.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	-
传真		010-66228001	-

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	http://www.ccbfund.cn

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 10 月 18 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日		
	建信天添益货币 A	建信天添益货币 B	建信天添益货币 C
本期已实现收益	199.88	519,283.05	22,379,401.53
本期利润	199.88	519,283.05	22,379,401.53
本期净值收益率	0.6115%	0.5558%	0.6302%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		
期末基金资产净值	93,655.58	475,253,408.81	7,066,430,772.79
期末基金份额净值	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入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、持有人认购或交易本基金时，不需缴纳任何费用。

3、本基金基金合同于 2016 年 10 月 18 日生效，截至报告期末未满一年。

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

建信天添益货币 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
自基金合同生效起至今	0.6115%	0.0019%	0.2774%	0.0000%	0.3341%	0.0019%

建信天添益货币 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
自基金合同生效起至今	0.5558%	0.0031%	0.2774%	0.0000%	0.2784%	0.0031%

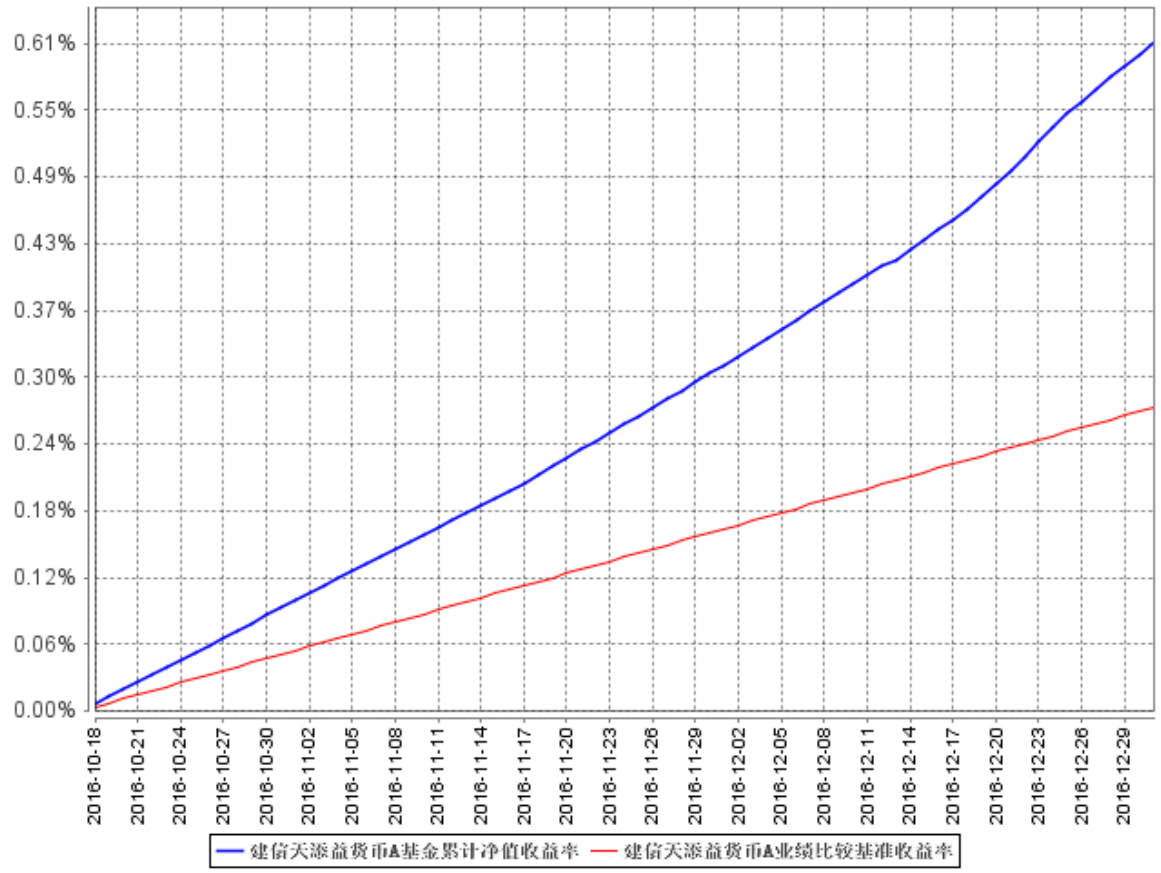
建信天添益货币 C

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较基	①－③	②－④

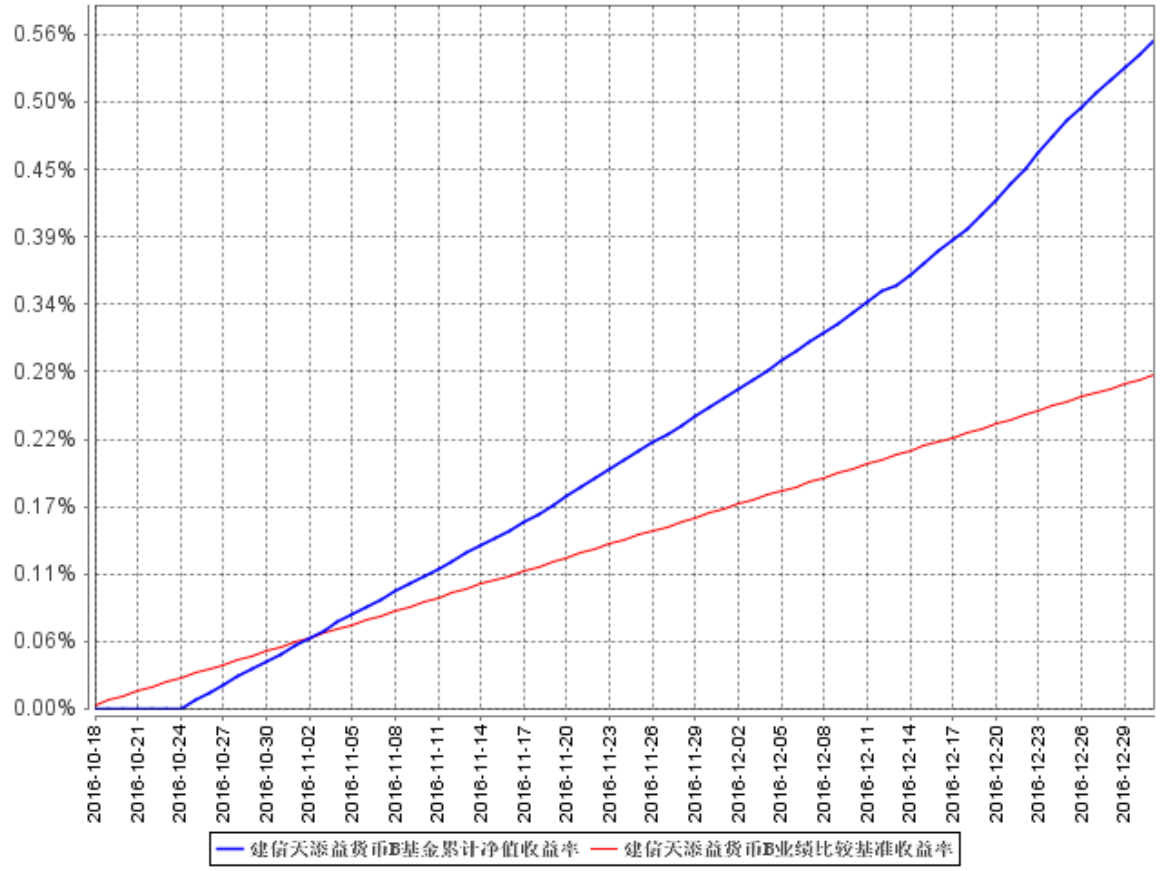
	收益率①	收益率标准差②	基准收益率③	准收益率标准差④		
自基金合同生效起至今	0.6302%	0.0019%	0.2774%	0.0000%	0.3528%	0.0019%

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

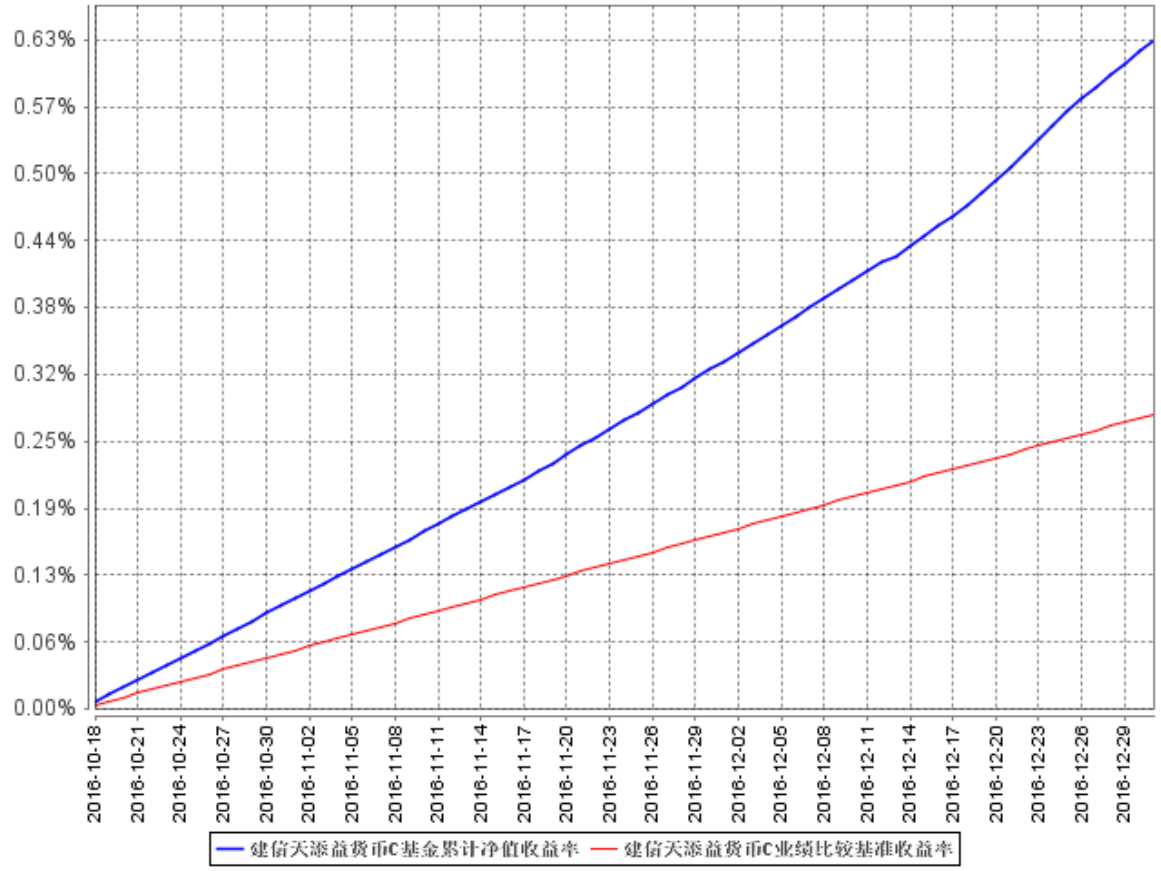
建信天添益货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信天添益货币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



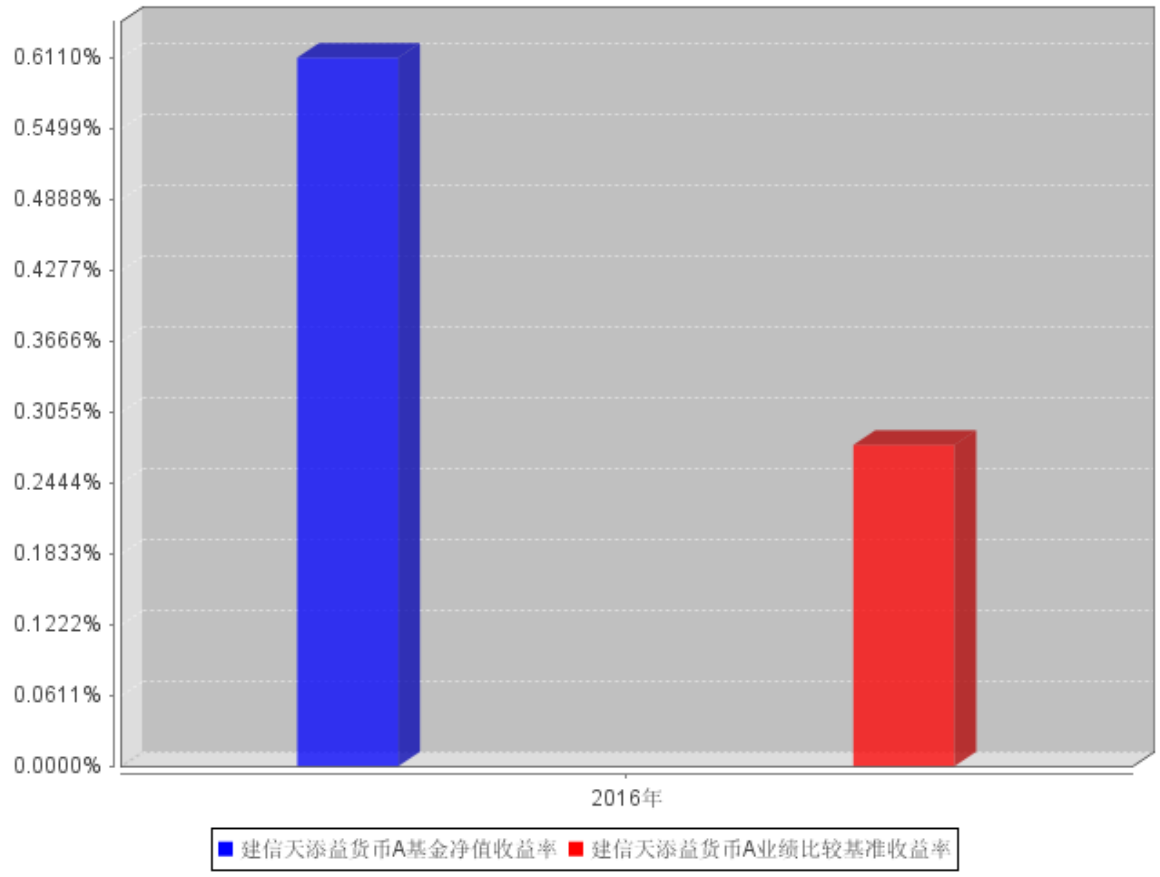
建信天添益货币C基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

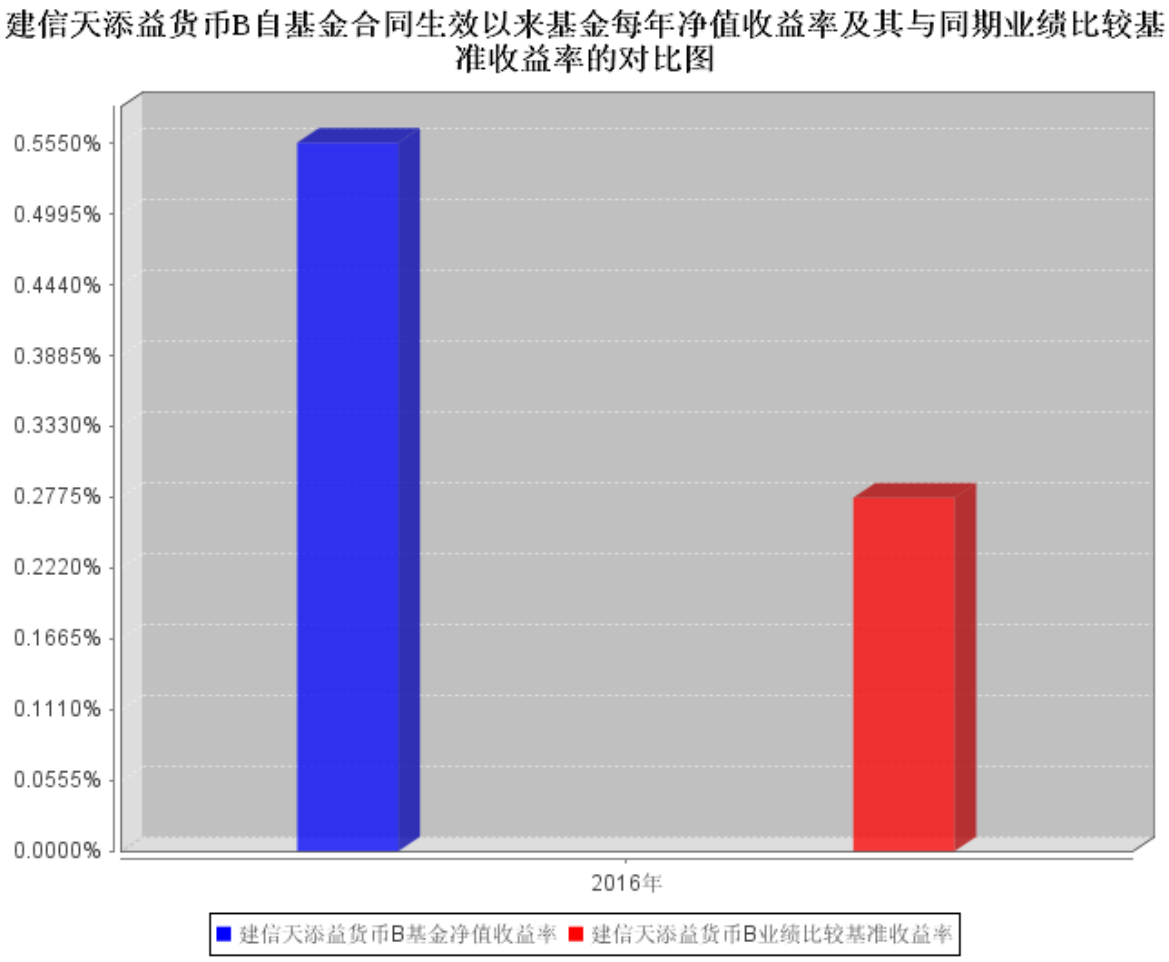


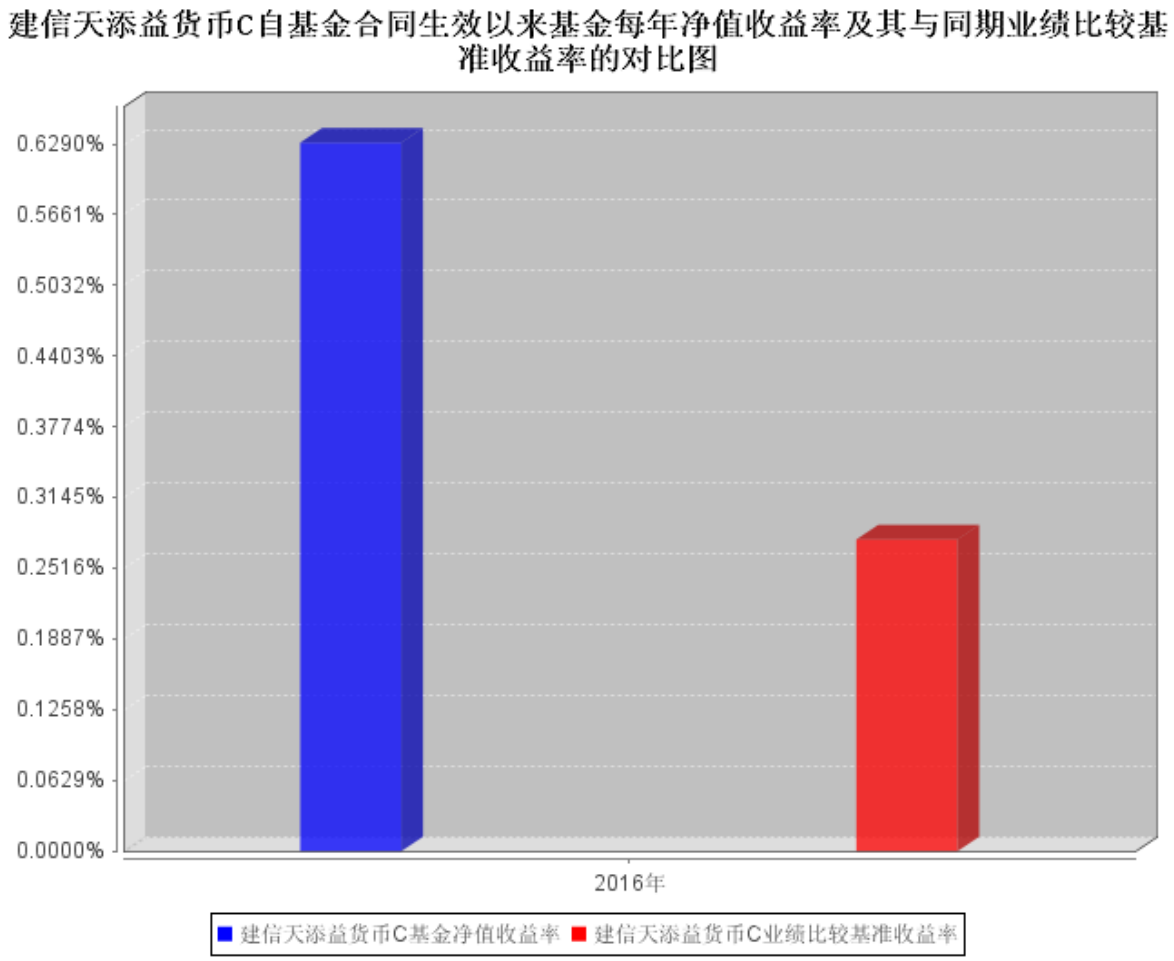
本基金基金合同于 2016 年 10 月 18 日生效，截至报告期末仍处于建仓期。

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

建信天添益货币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




建信天添益货币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
0.5550%
0.4995%
0.4440%
0.3885%
0.3330%
0.2775%
0.2220%
0.1665%
0.1110%
0.0555%
0.0000%
2016年
建信天添益货币B基金净值收益率
建信天添益货币B业绩比较基准收益率



本基金基金合同于 2016 年 10 月 18 日生效，基金成立当年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

建信天添益货币 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	199.88	-	-	199.88	
合计	199.88	-	-	199.88	

单位：人民币元

建信天添益货币 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	519,283.05	-	-	519,283.05	
合计	519,283.05	-	-	519,283.05	

单位：人民币元

建信天添益货币 C					
年度	已按再投资形式	直接通过应付	应付利润	年度利润	备注

	转实收基金	赎回款转出金额	本年变动	分配合计	
2016	22,379,401.53	-	-	22,379,401.53	
合计	22,379,401.53	-	-	22,379,401.53	

注:本基金基金合同于 2016 年 10 月 18 日生效，截至 2016 年 12 月 31 日未满一年。

§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		
陈建良	固定收益投资部副总经理、	2016 年 10 月 18 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

	本基金的基金经理				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。
高珊	本基金的基金经理	2016 年 10 月 18 日	-	10	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；2016 年10 月 18 日起任建信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遵规守信情况的说明

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

2016 年，中国宏观经济运行总体平稳，GDP 增速全年在 6.7%。从需求上看，固定资产投资增速延续了 2014 年以来的跌势，并在 2016 年 5 月进一步落入 10%以下。但 2016 年房地产投资未见明显收缩，全年房地产投资累计增速仍然维持在 6.9%的水平；上半年，积极财政政策力度明显，基建投资增速维持在 20%左右，下半年在经济下行压力暂缓的情况下，基建投资有所放缓，但全年来看仍然是托底经济最主要的因素之一，累计增速维持在 15.7%。值得一提的是，2016 年二季度以来，工业产出表现非常平稳，工业增加值单月同比维持在 6%以上，工业企业利润加速上行，微观层面的效益改善，也带动制造业投资在 2016 年 8 月份触底反弹，全年录得 4.20%的同比增速。

物价方面，工业品价格在本身库存水平处于低位的情况下，受供给侧改革，国内市场需求暂稳以及海外大宗商品市场的影响和带动，在 2016 年涨幅较大。PPI 同比自 2012 年 3 月以来连续下跌 53 个月后，于 2016 年 8 月翻正，并与 CPI 缺口完全收敛。CPI 物价除一季度和四季度因蔬菜价格涨幅较大受到扰动外，总体表现平稳，全年 CPI 同比稳定在 2%的水平，但工业领域产品价格上涨对消费端的传导已然显现。

货币政策方面，2016 年全年政策基调一直保持总体稳健。上半年在稳增长的目标下，央行一直维持市场短期利率的量价稳定，并在 3 月初降低存款准备金利率 0.5 个百分点，以引导货币信贷规模平稳增长。此后，一直采用“逆回购+MLF”滚动续作的方式进行货币投放和政策引导。进入下半年，在经济下行压力缓解情况下，政策目标向抑制资产泡沫和金融机构去杠杆切换，先后在 8 月和 9 月重启 14 天和 28 天逆回购，拉长政策工具久期，抬升资金供给成本，引发了市场预期的短暂混乱，此外受到海外市场动荡、机构间信任危机等因素影响，银行间市场在四季度出现流动性阶段性紧张。

债券市场方面，全年债券收益率呈“W” 型走势，年初在强劲的配置力量的带动下，收益率出现一波快速下行，10 年国开债短暂下探至 3%下方的年内低点。3 月份起 MPA 对银行资产端的约束开始显现，资金面迎来年内首次大幅波动。4 月份一系列的信用风险事件集中爆发，叠加“营改增”等不确定性因素的影响，收益率开始震荡上行，10 年国债收益率回到 3%上方，机构

风险偏好降低，信用利差明显扩大。此后，不利因素被市场逐步消化，巨量委外资金入市并开始发力，在阶段性缺资产情况下，信用债迎来一波强劲买盘，AA 评级以上各期限信用利差迅速压缩至历史低位，市场牛市氛围极为浓厚，10 年国债收益率在 8 月份探得年内低点。进入 9 月份后，一方面全球开始对长期以来的宽松政策副作用进行反思，另一方面在基本面企稳的情况下，央行在金融市场去杠杆的一系列措施先后出台，逐步扭转市场预期。短期回购利率明显攀升，债券收益率开始震荡上行。11 月之后在特朗普当选引发全球无风险利率上行，以及美联储加息落地等多个因素共同作用下，国内债券市场开始了一波迅猛的深幅调整，10 年国债收益率回到 3.40%附近，10 年国开债收益率接近 4%，上行幅度分别达到 70BP 和 90BP，调整强度堪比 2013 年钱荒时代。

国内方面，中央经济工作会议已经将防风险、特别是防范金融风险放到了更加重要的位置，其中房地产泡沫风险和债市高杠杆风险首当其冲，因此 2017 年的货币政策可能继续呈现中性偏紧的态势。另外，将理财纳入 MPA 的考核将从 2017 年一季度开始实施，势必对理财规模的增量产生限制，这方面来看是对债券偏空。

建信天添益货币市场基金于 2016 年 10 月成立，在投资上坚持了一贯的稳健投资风格，维持低久期和低杠杆操作策略，重点配置中高等级银行存单以及存款，妥善应对了大额申赎的冲击，合理安排资金和投资资产。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期天添益 A 基金净值收益率 0.6115%，波动率 0.0019%，天添益 B 基金净值收益率 0.5558%，波动率 0.0031%，天添益 C 基金净值收益率 0.6302%，波动率 0.0019%,业绩比较基准收益率 0.2744%，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，发达国家的政治局面存在极大的不确定性。随着美国就业数据的改善，美联储预计年内至少加息 2 次。特朗普上台之后，各种政策不确定性加大，对债市和全球流动性都可能产生影响。英国将在今年启动脱欧进程，法国总统选举和德国普选导致全球政治不确定性上升，地缘政治紧张局势升温，全球市场波动加剧。

国内方面，中央经济工作会议已经将防风险、特别是金融风险放到了更加重要的位置，其中房地产泡沫风险和债市高杠杆风险首当其冲，因此 2017 年的货币政策可能继续呈现中性偏紧的态势。另外，将理财纳入 MPA 的考核将从 2017 年一季度开始实施，势必对理财规模的增量产生

限制，这方面来看是对债券偏空。

此外,17 年出口行业可能将面对来自欧盟和美国贸易保护主义者更多的挑战。人民币贬值压力仍较大,汇率环境不稳定、投资者信心下降亦将是未来中国经济面对的风险之一。中国经济在未来较长时间内将处于转型升级的过程中,供给侧结构性改革任重道远,需求不振和产能过剩等矛盾依然突出,房地产政策全面收紧也使得 2017 年经济下行压力增大,经济稳定运行的基础还不牢固。因此，2017 年仍然要重视信用风险。

综上所述，建信天添益货币市场基金在 2017 年将继续保持稳健的投资风格，以存款和存单为主，中高等级信用债投资为辅，在保证组合流动性的同时力争保证组合能够跟随市场的发展变化为投资人获得合理的收益。

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，每日将前一日收益结转为基金份额，当日收益参与下一日基金收益分配，并按月结转到投资者基金账户。本年度建信天添益货币 A 应分配利润为 199.88 元，建信天添益货币 B 应分配收益为 519,283.05 元，建信天添益货币 C 应分配收益为 22,379,401.53 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

在托管建信天添溢货币市场基金的过程中，本基金托管人—江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《建信天添溢货币市场基金基金合同》、《建信天添溢货币市场基金托管协议》的约定，对建信天添溢货币市场基金的基金管理人—建信基金管理有限责任公司 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，没有从事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天添溢货币市场基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、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《中华人民共和国证券投资基金法》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天添溢货币市场基金的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）审计了后附的建信现金天添益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 21881 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审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：建信天添益货币市场基金

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
资 产：		
银行存款		3,638,619,829.14
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产		1,217,182,269.48
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		1,217,182,269.48
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		3,139,458,713.14
应收证券清算款		-
应收利息		7,462,624.88
应收股利		-
应收申购款		20,554,900.00
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		8,023,278,336.64

负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 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		-
应付证券清算款		480,000,000.00
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,031,071.14
应付托管费		240,583.28
应付销售服务费		37,392.66
应付交易费用		20,808.53
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		170,643.85
负债合计		481,500,499.46
所有者权益：		
实收基金		7,541,777,837.18
未分配利润		-
所有者权益合计		7,541,777,837.18
负债和所有者权益总计		8,023,278,336.64

注：

1.报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 7,541,777,837.18 份，其中建信天添益基金 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 93,655.58 份；建信天添益基金 B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 475,253,408.81 份；建信天添益基金 C 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 7,066,430,772.79 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2016 年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：建信天添益货币市场基金

本报告期：2016 年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

一、收入		26,081,870.41
1.利息收入		26,250,680.15
其中：存款利息收入		13,405,766.10
债券利息收入		3,906,057.19
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		8,938,856.86
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-168,809.74
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益		-168,809.74
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）		-
减：二、费用		3,182,985.95
1．管理人报酬		2,092,696.15
2．托管费		488,295.78
3．销售服务费		74,211.37
4．交易费用		-
5．利息支出		357,138.80
其中：卖出回购金融资产支出		357,138.80
6．其他费用		170,643.85
三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列）		22,898,884.46
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,898,884.46

注:本基金基金合同于 2016 年 10 月 18 日生效，截至 2016 年 12 月 31 日未满一年。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信天添益货币市场基金

本报告期：2016 年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 10 月 18 日(基金合同生效日)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）	3,000,019,086.00	-	3,000,019,086.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,898,884.46	22,898,884.46
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）	4,541,758,751.18	-	4,541,758,751.18
其中：1.基金申购款	5,668,636,410.13	-	5,668,636,410.13
2.基金赎回款	-1,126,877,658.95	-	-1,126,877,658.95
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）	-	-22,898,884.46	-22,898,884.46
五、期末所有者权益（基金净值）	7,541,777,837.18	-	7,541,777,837.18

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：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信天添益货币市场基金(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 2016]2067 号《关于准予建信天添益货币市场基金注册的批复》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《建信天添益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 3,000,019,086.00 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(2016)第 1319 号予以验证。经向中国证监会备案，《建信天添益货币市场基金基金合同》于 2016 年 10 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,000,019,086.00 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，基金托管人为江苏银行股份有限公司。

本基金根据投资者认(申)购的金额等级或其他条件，对投资者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。首次认购最低金额为 0.01 元，追加认购的最低金额为 0.01 元，年销售服务费率为 0.1%的，称为 A 类基金份额；首次认购最低金额为 0.01 元，追加认购的最低金额为 0.01 元，年销售服务费率为 0.25%的，称为 B 类基金份额；首次认购最低金额为 500 万元，追加认购的最低金额为 0.01 元，年销售服务费率为 0.01%的称为 C 类基金份额。本基金各类基金份额之间暂不开通基金份额自动升降级。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信天添益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》、《建信天添益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 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的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 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为

2016 年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风

险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1） 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2） 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每日以红利再投资方式集中支付累计收益。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(2)对于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)，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结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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[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)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、基金销售机构
江苏银行股份有限公司(“江苏银行”)	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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,092,696.15
其中：支付销售机构的客户维护费	4,990.92

注：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 X0.30%/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，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年

	12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	488,295.78

注：支付基金托管人江苏银行的托管费按前一日基金资产净值 0.07%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 X0.07%/当年天数。

7.4.8.2.3 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 2016 年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	建信天添益货币 A	建信天添益货币 B	建信天添益货币 C	合计
江苏银行	5.81	-	546.47	552.28
建信基金	-	0.56	5,858.20	5,858.76
合计	5.81	0.56	6,404.67	6,411.04

注:于 2016 年 12 月 10 日前，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、B 类基金份额和 C 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.10%、0.25%和 0.01%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费＝前一日对应类别基金资产净值 X 约定年费率 / 当年天数。

根据基金管理人于 2016 年 12 月 8 日发布的《建信基金管理有限责任公司关于建信天添益货币市场基金 B 类份额销售服务费优惠活动的公告》，自 2016 年 12 月 10 日至 2016 年 12 月 31 日止期间，本基金 B 类基金份额支付基金销售机构的销售服务费调整为按 B 类基金份额前一日基金资产净值 0.01%的年费率计提，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。其计算公式为：

日销售服务费＝B 类基金份额前一日基金资产净值 X0.01% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内本基金管理人未投资本基金。

7.4.8.4.2 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

建信天添益货币 C

份额单位：份

关联方名称	本期 2016 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
江苏银行	4,018,302,609.33	56.86%

7.4.8.5 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 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
江苏银行：活期存款	488,619,829.14	433,603.50
江苏银行：定期存款	1,500,000,000.00	1,008,333.30

注：本基金的活期存款和部分定期存款由基金托管人江苏银行保管，按约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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，本基金银行间市场无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 1,217,182,269.48 元，无属于第一层次或第三层次的余额。

(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。

(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	1,217,182,269.48	15.17
	其中：债券	1,217,182,269.48	15.17
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,139,458,713.14	39.13
	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	3,638,619,829.14	45.35
4	其他各项资产	28,017,524.88	0.35
5	合计	8,023,278,336.64	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	1.76	
	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

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%。

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	40
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	74
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	11

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	83.38	6.36
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	6.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	2.64	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	6.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天（含）	7.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		106.01	6.36

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	9,980,125.09	0.13
	其中：政策性金融债	9,980,125.09	0.13
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,207,202,144.39	16.01
8	其他	-	-

9	合计	1,217,182,269.48	16.14
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

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	111617169	16 光大 CD169	2,000,000	198,186,222.93	2.63
2	111692594	16 广州农村商业银行 CD053	1,500,000	148,518,048.20	1.97
3	111697703	16 华融湘江银行 CD054	1,500,000	145,838,046.89	1.93
4	111610181	16 兴业 CD181	1,000,000	99,815,114.86	1.32
5	111680464	16 西安银行 CD051	1,000,000	99,521,422.39	1.32
6	111613117	16 浙商 CD117	1,000,000	99,474,198.26	1.32
7	111697572	16 成都农商银行 CD024	1,000,000	97,270,862.66	1.29
8	111618266	16 华夏 CD266	1,000,000	97,110,193.98	1.29
9	111697028	16 河北银行 CD039	500,000	49,651,439.65	0.66
10	111694704	16 重庆银行 CD027	500,000	49,582,227.77	0.66

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	0.0014%
报告期内偏离度的最低值	-0.1494%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0272%

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

本基金投资的前十名证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。

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	-
3	应收利息	7,462,624.88
4	应收申购款	20,554,900.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	28,017,524.88

§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	持有人户	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

别			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
建信天添益货币A	340	275.46	0.00	0.00%	93,655.58	100.00%
建信天添益货币B	8,913	53,321.37	0.00	0.00%	475,253,408.81	100.00%
建信天添益货币C	33	214,134,265.84	7,066,430,772.79	100.00%	0.00	0.00%
合计	9,286	812,166.47	7,066,430,772.79	93.70%	475,347,064.39	6.30%

注：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	建信天添益货币A	222.60	0.24%
	建信天添益货币B	10,714.20	0.00%
	建信天添益货币C	0.00	0.00%
	合计	10,936.80	0.00%

注：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

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、该只基金的基金经理未持有该只基金。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	建信天添益货币 A	建信天添益货币 B	建信天添益货币 C
基金合同生效日（2016 年 10 月 18 日）基金份额总额	19,086.00	-	3,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	-	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	119,779.11	633,667,229.49	5,034,849,401.53
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	45,209.53	158,413,820.68	968,418,628.74
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	93,655.58	475,253,408.81	7,066,430,772.79

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。

§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 10 日表决通过了《关于建信天添益货币市场基金调整管理费率、销售服务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。

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。

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 100,000.00 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	
中信证券	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、本基金本报告期内无新增或剔除交易单元。

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

本报告期内，本基金租用的证券公司交易单元未进行其他证券投资。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

建信基金管理有限责任公司
2017 年 3 月 29 日