

# 建信现金增利货币市场基金 2020 年中期报告

2020 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本中期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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 5         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 6         |
| 3.3 其他指标                                | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>7</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 7         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 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             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 14        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 14        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>15</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 15        |
| 6.2 利润表                                 | 16        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 17        |
| 6.4 报表附注                                | 18        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>39</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 39        |
| 7.2 债券回购融资情况                            | 40        |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限                        | 40        |
| 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         | 41        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 41        |

|   |           |
|---|-----------|
| 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 .....    | 41        |
| 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....        | 42        |
| 7.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细..... | 42        |
| 7.9 投资组合报告附注.....                           | 43        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>43</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 43        |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....                | 44        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 44        |
| 8.4 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情况 .....      | 44        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>44</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>44</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                       | 44        |
| 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 .....      | 44        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 45        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                         | 45        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 45        |
| 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 .....         | 45        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 45        |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....                  | 46        |
| 10.9 其他重大事件 .....                           | 46        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>46</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....    | 46        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                    | 46        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>47</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 47        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 47        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 47        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金名称       | 建信现金增利货币市场基金        |
| 基金简称       | 建信现金增利货币            |
| 基金主代码      | 002758              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日    | 2016 年 7 月 26 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          |
| 报告期末基金份额总额 | 94,911,331,156.74 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                 |

### 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                    | 交通银行股份有限公司                  |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 吴曙明                             | 陆志俊                         |
|             | 联系电话 | 010-66228888                    | 95559                       |
|             | 电子邮箱 | xinxipilu@ccbfund.cn            | luzj@bankcomm.com           |
| 客户服务电话      |      | 400-81-95533 010-66228000       | 95559                       |
| 传真          |      | 010-66228001                    | 021-62701216                |
| 注册地址        |      | 北京市西城区金融大街 7 号英蓝<br>国际金融中心 16 层 | 中国（上海）自由贸易试验区银<br>城中路 188 号 |
| 办公地址        |      | 北京市西城区金融大街 7 号英蓝<br>国际金融中心 16 层 | 中国（上海）长宁区仙霞路 18<br>号        |
| 邮政编码        |      | 100033                          | 200336                      |
| 法定代表人       |      | 孙志晨                             | 任德奇                         |

### 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》   |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人的住所  |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                        |
|--------|--------------|-----------------------------|
| 注册登记机构 | 建信基金管理有限责任公司 | 北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层 |

## § 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(2020年1月1日-2020年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益       | 1,276,993,315.92          |
| 本期利润          | 1,276,993,315.92          |
| 本期净值收益率       | 1.1728%                   |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020年6月30日)          |
| 期末基金资产净值      | 94,911,331,156.74         |
| 期末基金份额净值      | 1.0000                    |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2020年6月30日)          |
| 累计净值收益率       | 14.4331%                  |

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、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

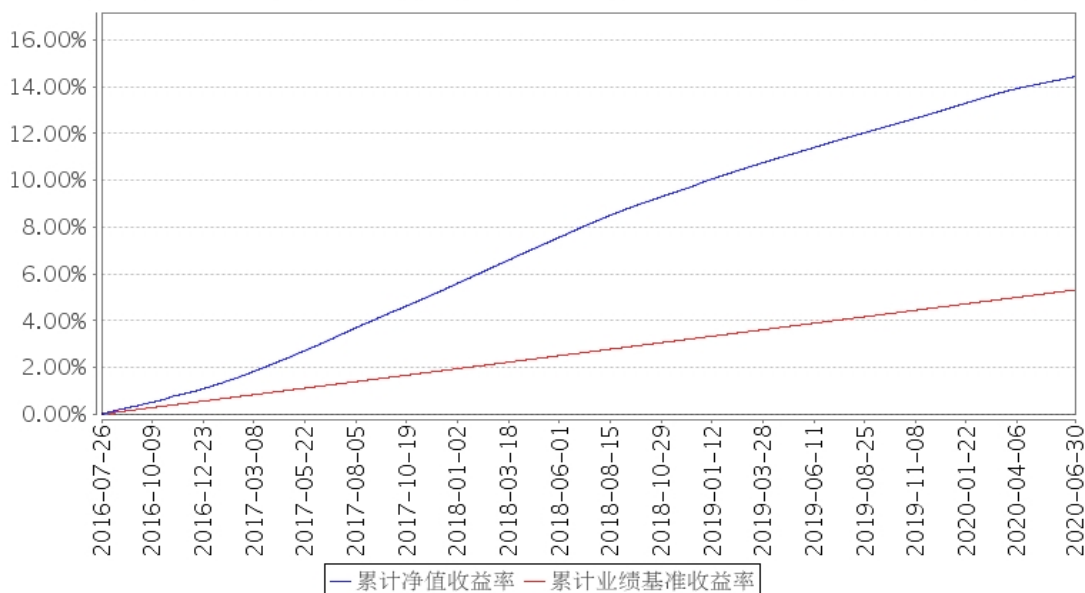
#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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    | 0.1568%  | 0.0001%     | 0.1110%    | 0.0000%       | 0.0458% | 0.0001% |
| 过去三个月    | 0.4852%  | 0.0003%     | 0.3366%    | 0.0000%       | 0.1486% | 0.0003% |
| 过去六个月    | 1.1728%  | 0.0012%     | 0.6732%    | 0.0000%       | 0.4996% | 0.0012% |
| 过去一年     | 2.5699%  | 0.0010%     | 1.3537%    | 0.0000%       | 1.2162% | 0.0010% |
| 过去三年     | 10.8700% | 0.0024%     | 4.0537%    | 0.0000%       | 6.8163% | 0.0024% |
| 自基金合同生效起 | 14.4331% | 0.0024%     | 5.3112%    | 0.0000%       | 9.1219% | 0.0024% |

|    |  |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|--|
| 至今 |  |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|--|

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

建信现金增利货币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，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

### 3.3 其他指标

无。

## § 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、海外投资部、资产配置及量化投资部、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、基础设施投资部、网络金融部、人力资源管理部、基金会计部、注册登记部、财务

管理部、金融科技部、投资风险管理部、内控合规部和审计部，以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京、石家庄六个营销中心，并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司以及在香港设立建信资产管理（香港）有限公司。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“善建财富 相伴成长”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“可信赖的财富管理专家资产管理行业的领跑者”。

截至 2020 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、建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、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、建信富时 100 指数型证券投资基金、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、建信灵活配置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 6 个月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、建信短债债券型证券投资基金、建信荣元一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信裕利灵活配置混合型证券投资基金、建



信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信睿怡纯债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、建信汇利灵活配置混合型证券投资基金、建信兴利灵活配置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、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、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、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中国制造 2025 股票型证券投资基金、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信瑞福添利混合型证券投资基金、建信高端医疗股票型证券投资基金、建信中证政策性金融债 8-10 年指数证券投资基金（LOF）、建信建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金（FOF）、建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金、建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金、建信龙头企业股票型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、建信优享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、建信中短债纯债债券型证券投资基金、建信中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、建信润利增强债券型证券投资基金、建信睿兴纯债债券型证券投资基金、建信中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、建信福泽裕泰混合型基金中基金（FOF）、建信中证红利潜力指数证券投资基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金、建信中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、建信荣瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金、建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金、建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信睿信三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、建信高股息主题股票型证券投资基金、建信科技创新混合型证券投资基金、建信科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金、建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、建信中债湖北省地

方政府债指数发起式证券投资基金、建信新能源行业股票型证券投资基金共计 126 只证券投资基金，管理的基金净资产规模共计为 4939.77 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，本基金的基金经理 | 2016年7月26日      | -    | 13年    | 陈建良先生，双学士，固定收益投资部副总经理。2005年7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月加入我公司投资管理部，历任基金经理助理、基金经理、固定收益投资部总经理助理、副总经理，2013年12月10日起任建信货币市场基金的基金经理；2014年1月21日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理，该基金于2020年1月13日转型为建信短债债券型证券投资基金，陈建良继续担任该基金的基金经理；2014年6月17日起任建信嘉薪宝货币市场基金的基金经理；2014年9月17日起任建信现金添利货币市场基金的基金经理；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的基金经理，该基金在2018年9月19日转型为建信睿怡纯债债券型证券投资基金，陈建良自2018年9月19日至2019年8月20日继续担任该基金的基金经理；2016年7月26日起任建信现金增利货币市场基金的基金经理；2016年9月2日起任建信现金添益交易型货币市场基金的基金经理；2016年9月13日至2017年12月6日任建信瑞盛添利混合型证券投资基金的基金经理；2016年10月18日起任建信天添益货币市场基金的基金经理。 |
| 先轺宇 | 本基金的基金经理             | 2017年7月7日       | -    | 8年     | 先轺宇先生，硕士。2009年7月至2016年5月在中国建设银行金融市场部工作，曾从事绩效管理，2012年起任债券交易员。2016年7月加入我公司，历任固定收益投资部基金经理助理、基金经理，2017年7月7日起任建信现金增利货币市场基金和建信现金添益交易型货币市场基金的基金经理；2018年3月26日起任建信周盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理  |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | ；2019 年 1 月 25 日起任建信天添益货币市场基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的涵含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 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》、《公开募集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》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。

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。

##### 4.3.2 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

2020 年上半年，受新冠肺炎疫情影响，宏观经济运行在经历一季度的大幅下行后企稳反弹，整体呈现出稳步复苏的态势。上半年 GDP 同比增长-1.6%，其中一季度当季 GDP 增速仅录得-6.8%，进入二季度后，随着全社会疫情防控成果逐步显现和复工复产的稳步推进，经济增长由负转正，单季增速达到 3.2%。由于疫情对居民消费活动有明显制约，上半年社会消费品零售总额同比增长仅-11.4%，增速较去年末大幅回落 19.4 个百分点，但在疫情防控逐渐向好和各项促消费政策刺激下，二季度消费出现了明显好转。尽管疫情影响下海外需求有所回落，但在防控物资出口的支撑下，净出口对 GDP 的拖累在二季度也有了明显收窄。上半年全国固定资产投资同比增长-3.1%，其中制造业投资增速仅为-11.7%，下滑较为明显，但进入二季度后在逆周期政策持续发力下，房地产投资和基建投资增速回升明显，带动投资降幅显著收窄，投资对经济的托抬作用明显增强。整体看，疫情对经济的冲击正在逐步减弱，在各种刺激政策助力下，宏观经济从二季度起呈现出稳步复苏的态势。

尽管经受了疫情的冲击，上半年物价水平仍然总体保持平稳。年初在非洲猪瘟、新冠肺炎疫情、春节以及“猪周期”等多重因素作用下，猪肉价格出现快速上涨，食品价格上行推动 CPI 在前两月涨幅均超过 5%，3 月后随着猪肉价格的回落，CPI 环比连续四个月下降。整个上半年 CPI 累计同比上涨 3.8%，呈现出前高后低的结构性上涨格局。上半年国际原油价格震荡走低，叠加新冠肺炎疫情等因素导致需求收缩，相关行业产品价格下行明显，对 PPI 涨幅形成明显拖累，使得上半年 PPI 累计同比下降 1.9%，整体保持低位运行。

货币政策方面，上半年货币政策基调呈现出明显的相机决策特征。一季度在新冠肺炎疫情对经济造成较大冲击后，人民银行在货币政策层面进行了及时的对冲操作。除通过降准等方式向市场释放长期资金以外，还先后多次调降公开市场操作利率，引导 LPR 利率下行，并自 4 月 7 日起将金融机构在央行超额存款准备金利率从 0.72% 下调至 0.35%，进一步压低了短期利率水平。在疫情防控取得阶段性胜利后，由于经济开始环比修复，以及对资金空转的隐忧，央行货币政策逐步回归到中性的常态化操作，并且更加强调政策的直达性，公开市场开始持续的资金净回笼，使得从 5 月份起资金利率中枢不断上移，部分时点短期资金价格波动明显加剧。在此环境下，上半年债券市场收益率整体呈现出“V”型走势，收益率先是在疫情影响下快速下行，随后伴随着经济修复性反弹和货币政策边际收紧，收益率水平又出现明显反弹。截至 6 月末，1 年期国债报收 2.18%，1 年期国开债报收 2.19%，较去年末分别下行 18BP 和 31BP，品种利差有所收窄。

报告期内，本基金在久期策略的应用上始终保持稳健，谨慎开展中长期存款和同业存单的投

资，努力把组合剩余期限控制在较低水平，并适当增加了组合杠杆水平，通过对年内到期资产的套息交易增厚组合收益。

#### 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 1.1728%，波动率 0.0012%，业绩比较基准收益率 0.6732%，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

展望下半年，随着我国疫情防控成果的进一步巩固扩大，上半年推出的一系列稳增长政策先后落地且效果逐渐显现，预计宏观经济将延续修复性回暖的趋势。在防疫常态化影响下，居民消费和企业投资需求的回升力度或难言强劲，基建投资仍然有望成为托底经济的重要力量。海外疫情的发展和中美关系走向在下半年仍然存在较大的不确定性，外需恐仍然面临一定程度的下行风险，以国内大循环为主体、国内国际双循环相互促进的新发展格局有望逐步形成。在此情形下，货币政策基调或将回归常态，在保持流动性合理充裕的前提下更加注重政策的精准性和直达性，预计债券市场收益率将延续震荡走势。

因此，本基金将继续控制对同业存单和债券类资产的配置力度，加强持仓资产信用风险筛查和结构优化，将组合剩余期限和杠杆水平控制在合理水平，进一步加大对短期逆回购和短期存款的配置比例，提高组合的策略应变空间。

#### 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[2017]13号文《中国证监会关于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。

本公司设立资产估值委员会，主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜，确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、内控合规部、投资风险管理部和基金会计部负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

资产估值委员会成员均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理工作，熟悉业内法律法规的专家型人员。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，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。

本公司根据《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》，与中债金融估值中心有限公司签署《中债信息产品服务协议》，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）；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），本公司采用中证指数有限公司独立提供的债券估值价格进行估值。

本公司与中证指数有限公司签署《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》，并依据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》和中证指数有限公司独立提供的流通受限股票流动性折扣，对公司旗下基金持有的流通受限股票进行估值。

#### 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。本报告期本基金实现收益 1,276,993,315.92 元，已全部分配，符合法律法规和基金合同的相关规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2020 年上半年度，托管人在建信现金增利货币市场基金的托管过程中，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、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

2020 年上半年度，建信基金管理有限责任公司在建信现金增利货币市场基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内向份额持有人分配利润：1,276,993,315.92 元。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2020 年上半年度，由建信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关建信现金增利货币市场基金的半年度报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：建信现金增利货币市场基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 21,891,947,747.45              | 41,630,309,402.65                |
| 结算备付金           |            | 722,319,360.84                 | 418,410,558.85                   |
| 存出保证金           |            | 1,731.03                       | -                                |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 65,840,305,079.09              | 45,795,857,256.96                |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 65,589,937,079.09              | 45,715,857,256.96                |
| 资产支持证券投资        |            | 250,368,000.00                 | 80,000,000.00                    |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | 15,071,947,930.99              | 11,176,507,269.98                |
| 应收证券清算款         |            | 3,568,707.05                   | 280,700,000.00                   |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 322,966,285.28                 | 326,196,328.43                   |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 58,945.86                      | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 103,853,115,787.59             | 99,627,980,816.87                |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2019 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          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 6,115,595,112.72               | 4,421,015,530.00                 |
| 应付证券清算款         |            | 2,786,487,955.11               | -                                |
| 应付赎回款           |            | 190,046.51                     | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 13,321,018.35                  | 11,633,371.61                    |
| 应付托管费           |            | 4,440,339.43                   | 3,877,790.50                     |
| 应付销售服务费         |            | 13,321,018.35                  | 11,633,371.61                    |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 437,335.66                     | 318,659.74                       |
| 应交税费            |            | 573,490.49                     | 433,802.97                       |
| 应付利息            |            | 1,847,073.38                   | 355,193.20                       |

|               |          |                    |                   |
|---------------|----------|--------------------|-------------------|
| 应付利润          |          | 5,076,313.00       | 7,435,748.74      |
| 递延所得税负债       |          | -                  | -                 |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 494,927.85         | 408,833.72        |
| 负债合计          |          | 8,941,784,630.85   | 4,457,112,302.09  |
| <b>所有者权益：</b> |          |                    |                   |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 94,911,331,156.74  | 95,170,868,514.78 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | -                  | -                 |
| 所有者权益合计       |          | 94,911,331,156.74  | 95,170,868,514.78 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 103,853,115,787.59 | 99,627,980,816.87 |

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 94,911,331,156.74 份。

## 6.2 利润表

会计主体：建信现金增利货币市场基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年<br>6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年<br>6 月 30 日 |
|------------------------|------------|--|---|
| 一、收入                   |            | 1,537,482,209.72                         | 1,627,697,519.96                              |
| 1. 利息收入                |            | 1,548,231,347.44                         | 1,641,741,085.66                              |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.11   | 610,267,888.44                           | 634,095,241.55                                |
| 债券利息收入                 |            | 712,545,498.90                           | 817,172,201.48                                |
| 资产支持证券利息收入             |            | 1,425,943.58                             | 3,629,551.89                                  |
| 买入返售金融资产收入             |            | 223,992,016.52                           | 186,844,090.74                                |
| 证券出借利息收入               |            | -  | -   |
| 其他利息收入                 |            | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | -10,749,137.72                           | -14,068,657.78                                |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12   | -  | -   |
| 基金投资收益                 | -          | -  | -   |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.13   | -10,749,137.72                           | -14,068,657.78                                |
| 资产支持证券投资               | 6.4.7.13.5 | -  | -   |
| 收益                     |            |  |   |
| 贵金属投资收益                | 6.4.7.14   | -  | -   |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.15   | -  | -   |
| 股利收益                   | 6.4.7.16   | -  | -   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -  | -   |



|                     |            |                  |                  |
|---------------------|------------|------------------|------------------|
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）  |            | -                | -                |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）  | 6.4.7.18   | -                | 25,092.08        |
| 减：二、费用              |            | 260,488,893.80   | 235,939,819.29   |
| 1. 管理人报酬            | 6.4.10.2.1 | 83,347,235.89    | 70,203,087.21    |
| 2. 托管费              | 6.4.10.2.2 | 27,782,411.92    | 23,401,029.13    |
| 3. 销售服务费            | 6.4.10.2.3 | 83,347,235.89    | 70,203,087.21    |
| 4. 交易费用             | 6.4.7.19   | -                | -                |
| 5. 利息支出             |            | 65,506,532.59    | 71,279,690.60    |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | 65,506,532.59    | 71,279,690.60    |
| 6. 税金及附加            |            | 274,399.44       | 531,991.36       |
| 7. 其他费用             | 6.4.7.20   | 231,078.07       | 320,933.78       |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 1,276,993,315.92 | 1,391,757,700.67 |
| 减：所得税费用             |            | -                | -                |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 1,276,993,315.92 | 1,391,757,700.67 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信现金增利货币市场基金

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2020年1月1日至2020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）                   | 95,170,868,514.78          | -                 | 95,170,868,514.78  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                          | 1,276,993,315.92  | 1,276,993,315.92   |
| 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） | -259,537,358.04            | -                 | -259,537,358.04    |
| 其中：1. 基金申购款                       | 92,567,260,133.42          | -                 | 92,567,260,133.42  |
| 2. 基金赎回款                          | -92,826,797,491.46         | -                 | -92,826,797,491.46 |
| 四、本期向基金                           | -                          | -1,276,993,315.92 | -1,276,993,315.92  |

|  |                                 |                   |                    |
|--|---------------------------------|-------------------|--------------------|
| 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）        |                                 |                   |                    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 94,911,331,156.74               | -                 | 94,911,331,156.74  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |                   |                    |
|  | 实收基金                            | 未分配利润             | 所有者权益合计            |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 93,745,718,542.97               | -                 | 93,745,718,542.97  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | 1,391,757,700.67  | 1,391,757,700.67   |
| 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）      | 1,719,411,012.78                | -                 | 1,719,411,012.78   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 62,134,940,071.26               | -                 | 62,134,940,071.26  |
| 2. 基金赎回款                               | -60,415,529,058.48              | -                 | -60,415,529,058.48 |
| 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） | -                               | -1,391,757,700.67 | -1,391,757,700.67  |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 95,465,129,555.75               | -                 | 95,465,129,555.75  |

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：

张军红

吴灵玲

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

建信现金增利货币市场基金(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 2015]3076 号《关于准予建信现金增利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《建信现金增利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人民币 200,002,300.00 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 872 号予以验证。经向中国证监会备案,《建信现金增利货币市场基金基金合同》于 2016 年 7 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,002,302.30 份基金份额,其中认购资金利息折合 2.30 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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信现金增利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。本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+ 的商业银行的银行存款与同业存单的,应当经基金管理人董事会审议批准,相关交易应当事先征得基金托管人的同意,并作为重大事项履行信息披露程序。本基金的业绩比较基准为:七天通知存款利率(税前)。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年半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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 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。

#### 6.4.6 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[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政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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，股票的股息、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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得

的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2020年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款         | 2,834,947,747.45  |
| 定期存款         | 19,057,000,000.00 |
| 其中：存款期限1个月以内 | -                 |
| 存款期限1-3个月    | 1,200,000,000.00  |
| 存款期限3个月以上    | 17,857,000,000.00 |
| 其他存款         | -                 |
| 合计           | 21,891,947,747.45 |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2020年6月30日 |                   |                   |                |         |
|--------|-------------------|-------------------|-------------------|----------------|---------|
|        | 摊余成本              | 影子定价              | 偏离金额              | 偏离度<br>(%)     |         |
| 债券     | 交易所市场             | 75,280,941.65     | 74,845,000.00     | -435,941.65    | -0.0005 |
|        | 银行间市场             | 65,514,656,137.44 | 65,490,448,000.00 | -24,208,137.44 | -0.0255 |
|        | 合计                | 65,589,937,079.09 | 65,565,293,000.00 | -24,644,079.09 | -0.0260 |
| 资产支持证券 | 250,368,000.00    | 250,160,000.00    | -208,000.00       | -0.0002        |         |
| 合计     | 65,840,305,079.09 | 65,815,453,000.00 | -24,852,079.09    | -0.0262        |         |

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2020年6月30日 |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 8,141,322,000.00  | -         |
| 银行间市场 | 6,930,625,930.99  | -         |
| 合计    | 15,071,947,930.99 | -         |

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2020年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 27,138,709.10     |
| 应收定期存款利息   | 162,204,519.46    |
| 应收其他存款利息   | -                 |
| 应收结算备付金利息  | 325,145.83        |
| 应收债券利息     | 117,818,787.54    |
| 应收资产支持证券利息 | 264,306.73        |
| 应收买入返售证券利息 | 15,214,815.82     |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 应收出借证券利息   | -                 |
| 其他         | 0.80              |
| 合计         | 322,966,285.28    |

## 6.4.7.6 其他资产

无。

## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                 |
| 银行间市场应付交易费用 | 437,335.66        |

|    |            |
|----|------------|
| 合计 | 437,335.66 |
|----|------------|

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 225.63            |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 预提费用        | 494,702.22        |
| 合计          | 494,927.85        |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |                    |
|---------------|----------------------------|--------------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额               |
| 上年度末          | 95,170,868,514.78          | 95,170,868,514.78  |
| 本期申购          | 92,567,260,133.42          | 92,567,260,133.42  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -92,826,797,491.46         | -92,826,797,491.46 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                          | -                  |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                          | -                  |
| 本期申购          | -                          | -                  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                          | -                  |
| 本期末           | 94,911,331,156.74          | 94,911,331,156.74  |

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分             | 未实现部分 | 未分配利润合计           |
|----------------|-------------------|-------|-------------------|
| 上年度末           | -                 | -     | -                 |
| 本期利润           | 1,276,993,315.92  | -     | 1,276,993,315.92  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -                 | -     | -                 |
| 其中：基金申购款       | -                 | -     | -                 |
| 基金赎回款          | -                 | -     | -                 |
| 本期已分配利润        | -1,276,993,315.92 | -     | -1,276,993,315.92 |
| 本期末            | -                 | -     | -                 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----|----------------------------|
|----|----------------------------|

|           |                |
|-----------|----------------|
| 活期存款利息收入  | 75,419,546.21  |
| 定期存款利息收入  | 531,008,630.49 |
| 其他存款利息收入  | -              |
| 结算备付金利息收入 | 3,366,527.94   |
| 其他        | 473,183.80     |
| 合计        | 610,267,888.44 |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

无。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -10,749,137.72             |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -                          |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                          |
| 合计                            | -10,749,137.72             |

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 45,289,684,380.89          |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 45,079,694,596.19          |
| 减：应收利息总额                | 220,738,922.42             |
| 买卖债券差价收入                | -10,749,137.72             |

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。



6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

无。

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

无。

## 6.4.7.18 其他收入

无。

## 6.4.7.19 交易费用

无。

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 审计费用     | 64,644.58                  |
| 信息披露费    | 59,672.34                  |
| 证券出借违约金  | -                          |
| 银行划款手续费  | 76,661.15                  |
| 银行间账户维护费 | 18,000.00                  |
| 其他       | 12,100.00                  |
| 合计       | 231,078.07                 |

## 6.4.7.21 分部报告

无。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

无。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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。

### 6.4.9.2 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 |
| 交通银行股份有限公司（“交通银行”）           | 基金托管人               |
| 中国建设银行股份有限公司（中国建设银行）（“建设银行”） | 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            |
| 美国信安金融服务公司                   | 基金管理人的股东            |
| 建信资产管理（香港）有限公司               | 基金管理人的子公司           |
| 建信资本管理有限责任公司                 | 基金管理人的子公司           |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2020年1月1日至2020年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年<br>6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 83,347,235.89                  | 70,203,087.21                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 18,566,165.32                  | 25,186,595.92                       |

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 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2020年1月1日至2020年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年<br>6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 27,782,411.92                  | 23,401,029.13                       |

注：支付基金托管人交通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 × 0.05% / 当年天数。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方<br>名称 | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|--------------------|----------------------------|
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费           |
|                    | 建信现金增利货币                   |
| 建信基金               | 56,824,142.61              |
| 合计                 | 56,824,142.61              |

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |  |
|----------------|--|--|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |  |
|                | 建信现金增利货币                                   |  |
| 建信基金           | 34,172,772.12                              |  |
| 合计             | 34,172,772.12                              |  |

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。本基金约定的销售服务费年费率为 0.15%。销售服务费的计算公式为： $\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}$ 。

#### 6.4.10.3 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<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 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          |
| 中国建设银行                                     | -      | -    | -     | -    | 273,201,822,000.00 | 19,917,008.24 |
| 交通银行                                       | -      | -    | -     | -    | 29,992,254,000.00  | 1,446,931.51  |
| 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 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          |
| 中国建设银行                                     | -      | -    | -     | -    | 33,378,128,000.00  | 3,615,515.24  |
| 交通银行                                       | -      | -    | -     | -    | -                  | -             |

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

## 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

| 关联方名称            | 本期末<br>2020年6月30日 |                              | 上年度末<br>2019年12月31日 |                              |
|------------------|-------------------|------------------------------|---------------------|------------------------------|
|                  | 持有的<br>基金份额       | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>例 (%) | 持有的<br>基金份额         | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>例 (%) |
| 建信资本管理<br>有限责任公司 | -                 | -                            | 186,415,134.61      | 0.20                         |
| 交通银行             | 3,161,335,862.16  | 3.33                         | 1,130,574,531.90    | 1.19                         |

## 6.4.10.5 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<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |               | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019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        |
| 交通银行-活期 | 2,834,947,747.45           | 75,419,546.21 | 5,310,701,718.32                | 14,847,102.33 |
| 交通银行-定期 | 0.00                       | 13,905,000.47 | 3,370,000,000.00                | 51,459,666.37 |

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

## 6.4.10.6 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。

## 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动  | 本期利润分配合计         | 备注 |
|------------------|-------------------|---------------|------------------|----|
| 1,279,352,751.66 | -                 | -2,359,435.74 | 1,276,993,315.92 | -  |

## 6.4.12 期末(2020年6月30日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券

| 证券代码   | 证券名称     | 成功认购日           | 可流通日             | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量<br>(单位: 张) | 期末成本总额         | 期末估值总额         | 备注 |
|--------|----------|-----------------|------------------|--------|--------|--------|---------------|----------------|----------------|----|
| 168680 | 1 欲晓 A01 | 2020 年 6 月 22 日 | 2020 年 07 月 16 日 | 新发未上市  | 100.00 | 100.00 | 2,000,000     | 200,000,000.00 | 200,000,000.00 | -  |

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 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 6,115,595,112.72 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         |
|-----------|---------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 110208    | 11 国开 08      | 2020 年 7 月 1 日 | 101.60 | 1,200,000 | 121,914,508.10 |
| 111981914 | 19 西安银行 CD030 | 2020 年 7 月 1 日 | 99.94  | 1,300,000 | 129,915,513.94 |
| 111984358 | 19 重庆银行 CD084 | 2020 年 7 月 1 日 | 99.65  | 1,100,000 | 109,618,590.32 |
| 140409    | 14 农发 09      | 2020 年 7 月 1 日 | 102.10 | 800,000   | 81,682,775.24  |
| 150220    | 15 国开 20      | 2020 年 7 月 1 日 | 100.25 | 800,000   | 80,200,832.46  |
| 160206    | 16 国开 06      | 2020 年 7 月 1 日 | 100.66 | 8,000,000 | 805,291,891.17 |
| 160411    | 16 农发 11      | 2020 年 7 月 1 日 | 100.73 | 9,600,000 | 966,976,681.48 |
| 170209    | 17 国开 09      | 2020 年 7 月 1 日 | 100.34 | 700,000   | 70,237,269.46  |
| 180203    | 18 国开 03      | 2020 年 7 月 1 日 | 101.84 | 5,900,000 | 600,880,696.32 |
| 190002    | 19 付息国债 02    | 2020 年 7 月 1 日 | 100.69 | 3,400,000 | 342,358,826.29 |
| 190307    | 19 进出 07      | 2020 年 7 月 1 日 | 100.06 | 1,000,000 | 100,056,895.38 |

|         |             |                |        |            |                  |
|---------|-------------|----------------|--------|------------|------------------|
|         |             | 日              |        |            |                  |
| 200201  | 20 国开 01    | 2020 年 7 月 1 日 | 100.53 | 3,500,000  | 351,867,435.07   |
| 2002120 | 20 国开战疫 120 | 2020 年 7 月 1 日 | 99.70  | 2,100,000  | 209,363,028.73   |
| 200304  | 20 进出 04    | 2020 年 7 月 1 日 | 100.07 | 1,000,000  | 100,065,348.90   |
| 200308  | 20 进出 08    | 2020 年 7 月 1 日 | 99.90  | 2,000,000  | 199,808,661.92   |
| 2003662 | 20 进出 662   | 2020 年 7 月 1 日 | 99.62  | 7,400,000  | 737,199,377.98   |
| 200403  | 20 农发 03    | 2020 年 7 月 1 日 | 98.98  | 6,800,000  | 673,056,687.02   |
| 207701  | 20 贴现国开 01  | 2020 年 7 月 1 日 | 99.69  | 2,000,000  | 199,372,939.58   |
| 209917  | 20 贴现国债 17  | 2020 年 7 月 1 日 | 99.97  | 4,000,000  | 399,866,047.42   |
| 合计      |             |                |        | 62,600,000 | 6,279,734,006.78 |

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程  
度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督  
和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和控制  
上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、内  
控合规部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的督  
察长和内控合规部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。



### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在定期存款和银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用产品投资流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年年末未持有除国债、央行票据、政策性金融债以外的债券。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020年6月30日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | 5,880,239,471.57  | 1,108,293,901.21    |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 7,771,086,426.75  | 2,964,668,992.40    |
| 合计     | 13,651,325,898.32 | 4,072,962,893.61    |

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、资产支持证券及同业存单等

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020年6月30日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 50,368,000.00     | 80,000,000.00       |
| 合计     | 50,368,000.00     | 80,000,000.00       |

## 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020年6月30日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 45,692,286,200.71 | 36,587,432,837.28   |
| 合计     | 45,692,286,200.71 | 36,587,432,837.28   |

## 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2020年6月30日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 206,125,077.54    | 202,239,385.27      |
| AAA 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | -                 | -                   |
| 合计     | 206,125,077.54    | 202,239,385.27      |

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、资产支持证券及同业存单等

## 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2020年6月30日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 200,000,000.00    | -                   |
| AAA 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | -                 | -                   |
| 合计     | 200,000,000.00    | -                   |

## 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

## 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

。

公司建立了健全有效的流动性风险内部控制体系，对流动性风险管理的组织架构、职责分工以及指标监控体系进行了明确规定，同时建立了以流动性风险为核心的压力测试体系，由独立的风险管理部门负责压力测试的实施，多维度对投资组合流动性风险进行管控。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对于基金持有资产的集中度、偏离度、剩余期限、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申请，保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资和买入返售金融资产等，本基金的基金管理人每日通过影子价格对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的平均剩余期限等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020年6月30日 | 6个月以内             | 6个月-1年            | 1-5年 | 5年以上 | 不计息              | 合计                 |
|-------------------|-------------------|-------------------|------|------|------------------|--------------------|
| 资产                |                   |                   |      |      |                  |                    |
| 银行存款              | 21,891,947,747.45 | -                 | -    | -    | -                | 21,891,947,747.45  |
| 结算备付金             | 722,319,360.84    | -                 | -    | -    | -                | 722,319,360.84     |
| 存出保证金             | 1,731.03          | -                 | -    | -    | -                | 1,731.03           |
| 交易性金融资产           | 52,709,409,178.44 | 13,130,895,900.65 | -    | -    | -                | 65,840,305,079.09  |
| 衍生金融资产            | -                 | -                 | -    | -    | -                | -                  |
| 买入返售金融资产          | 15,071,947,930.99 | -                 | -    | -    | -                | 15,071,947,930.99  |
| 应收证券清算款           | -                 | -                 | -    | -    | 3,568,707.05     | 3,568,707.05       |
| 应收利息              | -                 | -                 | -    | -    | 322,966,285.28   | 322,966,285.28     |
| 应收股利              | -                 | -                 | -    | -    | -                | -                  |
| 应收申购款             | -                 | -                 | -    | -    | 58,945.86        | 58,945.86          |
| 其他资产              | -                 | -                 | -    | -    | -                | -                  |
| 资产总计              | 90,395,625,948.75 | 13,130,895,900.65 | -    | -    | 326,593,938.19   | 103,853,115,787.59 |
| 负债                |                   |                   |      |      |                  |                    |
| 卖出回购金融资产款         | 6,115,595,112.72  | -                 | -    | -    | -                | 6,115,595,112.72   |
| 短期借款              | -                 | -                 | -    | -    | -                | -                  |
| 交易性金融负债           | -                 | -                 | -    | -    | -                | -                  |
| 衍生金融负债            | -                 | -                 | -    | -    | -                | -                  |
| 应付证券清算款           | -                 | -                 | -    | -    | 2,786,487,955.11 | 2,786,487,955.11   |
| 应付赎回款             | -                 | -                 | -    | -    | 190,046.51       | 190,046.51         |
| 应付管理人报酬           | -                 | -                 | -    | -    | 13,321,018.35    | 13,321,018.35      |

|                     |                   |                   |      |      |     |                   |                   |
|---------------------|-------------------|-------------------|------|------|-----|-------------------|-------------------|
| 应付托管费               | -                 | -                 | -    | -    | -   | 4,440,339.43      | 4,440,339.43      |
| 应付销售服务费             | -                 | -                 | -    | -    | -   | 13,321,018.35     | 13,321,018.35     |
| 应付交易费用              | -                 | -                 | -    | -    | -   | 437,335.66        | 437,335.66        |
| 应交税费                | -                 | -                 | -    | -    | -   | 573,490.49        | 573,490.49        |
| 应付利息                | -                 | -                 | -    | -    | -   | 1,847,073.38      | 1,847,073.38      |
| 应付利润                | -                 | -                 | -    | -    | -   | 5,076,313.00      | 5,076,313.00      |
| 其他负债                | -                 | -                 | -    | -    | -   | 494,927.85        | 494,927.85        |
| 负债总计                | 6,115,595,112.72  | -                 | -    | -    | -   | 2,826,189,518.13  | 8,941,784,630.85  |
| 利率敏感度缺口             | 84,280,030,836.03 | 13,130,895,900.65 | -    | -    | -   | -2,499,595,579.94 | 94,911,331,156.74 |
| 上年度末<br>2019年12月31日 | 6个月以内             | 6个月-1年            | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计                |                   |
| 资产                  |                   |                   |      |      |     |                   |                   |
| 银行存款                | 38,130,309,402.65 | 3,500,000,000.00  | -    | -    | -   | -                 | 41,630,309,402.65 |
| 结算备付金               | 418,410,558.85    | -                 | -    | -    | -   | -                 | 418,410,558.85    |
| 存出保证金               | -                 | -                 | -    | -    | -   | -                 | -                 |
| 交易性金融资产             | 33,558,876,919.51 | 12,236,980,337.45 | -    | -    | -   | -                 | 45,795,857,256.96 |
| 衍生金融资产              | -                 | -                 | -    | -    | -   | -                 | -                 |
| 买入返售金融资产            | 11,176,507,269.98 | -                 | -    | -    | -   | -                 | 11,176,507,269.98 |
| 应收证券清算款             | -                 | -                 | -    | -    | -   | 280,700,000.00    | 280,700,000.00    |
| 应收利息                | -                 | -                 | -    | -    | -   | 326,196,328.43    | 326,196,328.43    |
| 应收股利                | -                 | -                 | -    | -    | -   | -                 | -                 |
| 应收申购款               | -                 | -                 | -    | -    | -   | -                 | -                 |
| 其他资产                | -                 | -                 | -    | -    | -   | -                 | -                 |
| 资产总计                | 83,284,104,150.99 | 15,736,980,337.45 | -    | -    | -   | 606,896,328.43    | 99,627,980,816.87 |
| 负债                  |                   |                   |      |      |     |                   |                   |
| 卖出回购金融资产款           | 4,421,015,530.00  | -                 | -    | -    | -   | -                 | 4,421,015,530.00  |
| 短期借款                | -                 | -                 | -    | -    | -   | -                 | -                 |
| 交易性金融负债             | -                 | -                 | -    | -    | -   | -                 | -                 |
| 衍生金融负债              | -                 | -                 | -    | -    | -   | -                 | -                 |
| 应付证券清算款             | -                 | -                 | -    | -    | -   | -                 | -                 |
| 应付赎回款               | -                 | -                 | -    | -    | -   | -                 | -                 |
| 应付管理人报酬             | -                 | -                 | -    | -    | -   | 11,633,371.6      | 11,633,371.61     |

|         |                        |                        |   |   |                |                   |
|---------|------------------------|------------------------|---|---|----------------|-------------------|
|         |                        |                        |   |   | 1              |                   |
| 应付托管费   | -                      | -                      | - | - | 3,877,790.50   | 3,877,790.50      |
| 应付销售服务费 | -                      | -                      | - | - | 11,633,371.61  | 11,633,371.61     |
| 应付交易费用  | -                      | -                      | - | - | 318,659.74     | 318,659.74        |
| 应交税费    | -                      | -                      | - | - | 433,802.97     | 433,802.97        |
| 应付利息    | -                      | -                      | - | - | 355,193.20     | 355,193.20        |
| 应付利润    | -                      | -                      | - | - | 7,435,748.74   | 7,435,748.74      |
| 其他负债    | -                      | -                      | - | - | 408,833.72     | 408,833.72        |
| 负债总计    | 4,421,015.53<br>0.00   | -                      | - | - | 36,096,772.09  | 4,457,112,302.09  |
| 利率敏感度缺口 | 78,863,088.62<br>20.99 | 15,736,980.37<br>37.45 | - | - | 570,799,556.34 | 95,170,868,514.78 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，在影子价格监控机制有效的前提下，若市场利率上升或下降 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不会发生重大变动（上年末：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 6.4.14.1 公允价值

##### 6.4.14.1.1 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，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性金融资产中属于第二层次的余额为人民币 65,840,305,079.09 元，无划分为第一层次及第三层次的余额（于 2019 年 06 月 30 日，属于第二层次的余额为人民币 44,740,368,515.47 元，无划分为第一层次及第三层次的余额）。

###### 6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的交易性金融资产的公允价值所属层次未发生重大变动。

###### 6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### 6.4.14.2 承诺事项

无。

#### 6.4.14.3 其他事项

无。

## § 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                | 65,840,305,079.09  | 63.40  |
|   | 其中：债券                 | 65,589,937,079.09  | 63.16  |
|   | 资产支持证<br>券            | 250,368,000.00     | 0.24   |
| 2 | 买入返售金融资产              | 15,071,947,930.99  | 14.51  |
|   | 其中：买断式回购的<br>买入返售金融资产 | -                  | -      |
| 3 | 银行存款和结算备<br>付金合计      | 22,614,267,108.29  | 21.78  |
| 4 | 其他各项资产                | 326,595,669.22     | 0.31   |
| 5 | 合计                    | 103,853,115,787.59 | 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 | 7.33             |                |
|    | 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 | 6,115,595,112.72 | 6.44           |
|    | 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

无。

## 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    | 97  |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 105 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 58  |

### 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                     | 31.00               | 9.38                |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -                   | -                   |



|   |                            |        |      |
|---|----------------------------|--------|------|
| 2 | 30 天（含）—60 天               | 15.12  | -    |
|   | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -      | -    |
| 3 | 60 天（含）—90 天               | 18.50  | -    |
|   | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -      | -    |
| 4 | 90 天（含）—120 天              | 5.76   | -    |
|   | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -      | -    |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含）          | 38.70  | -    |
|   | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -      | -    |
|   | 合计                         | 109.08 | 9.38 |

#### 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                             | 742,224,873.71    | 0.78         |
| 2  | 央行票据                             | -                 | -            |
| 3  | 金融债券                             | 5,347,973,399.39  | 5.63         |
|    | 其中：政策性<br>金融债                    | 5,297,975,028.81  | 5.58         |
| 4  | 企业债券                             | 25,282,571.07     | 0.03         |
| 5  | 企业短期融<br>资券                      | 13,651,325,898.32 | 14.38        |
| 6  | 中期票据                             | 130,844,135.89    | 0.14         |
| 7  | 同业存单                             | 45,692,286,200.71 | 48.14        |
| -  | 其他                               | -                 | -            |
| -  | 合计                               | 65,589,937,079.09 | 69.11        |
| -  | 剩余存续期<br>超过 397 天的<br>浮动利率债<br>券 | -                 | -            |

#### 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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<br>净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|------------|------------------|------------------|
| 1  | 112093555 | 20 汇丰银行<br>CD014 | 18,000,000 | 1,792,795,607.39 | 1.89             |

|    |           |                  |            |                  |      |
|----|-----------|------------------|------------|------------------|------|
| 2  | 112098912 | 20 宁波银行<br>CD079 | 16,500,000 | 1,640,107,496.70 | 1.73 |
| 3  | 112003013 | 20 农业银行<br>CD013 | 16,300,000 | 1,612,599,071.27 | 1.70 |
| 4  | 112009043 | 20 浦发银行<br>CD043 | 11,500,000 | 1,140,888,218.73 | 1.20 |
| 5  | 112004011 | 20 中国银行<br>CD011 | 11,000,000 | 1,085,195,951.35 | 1.14 |
| 6  | 111911111 | 19 平安银行<br>CD111 | 10,000,000 | 998,757,707.90   | 1.05 |
| 7  | 111908160 | 19 中信银行<br>CD160 | 10,000,000 | 998,142,893.17   | 1.05 |
| 8  | 111903099 | 19 农业银行<br>CD099 | 10,000,000 | 996,951,235.62   | 1.05 |
| 9  | 112080804 | 20 贵阳银行<br>CD072 | 10,000,000 | 989,621,048.69   | 1.04 |
| 10 | 160411    | 16 农发 11         | 9,600,000  | 966,976,681.48   | 1.02 |

#### 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 | 0        |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.1660%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0454% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0926%  |

#### 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 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称     | 数量（份）     | 摊余成本           | 占基金资产净值<br>比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|------------------|
| 1  | 168680 | 1 欲晓 A01 | 2,000,000 | 200,000,000.00 | 0.21             |
| 2  | 138650 | 万科 13 优  | 400,000   | 40,000,000.00  | 0.04             |
| 3  | 139839 | 万科 08A1  | 800,000   | 10,368,000.00  | 0.01             |

## 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，上海浦东发展银行股份有限公司（600000）于 2019 年 10 月 14 日发布公告，中国银行保险监督管理委员会（以下简称“中国银保监会”）对公司成都分行授信业务及整改情况严重失察、重大审计发现未向监管部门报告、轮岗制度执行不力的违规行为依法查处，执行罚款 130 万元人民币（银保监罚决字【2019】7 号）。

### 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   | 1,731.03       |
| 2  | 应收证券清算款 | 3,568,707.05   |
| 3  | 应收利息    | 322,966,285.28 |
| 4  | 应收申购款   | 58,945.86      |
| 5  | 其他应收款   | -              |
| 6  | 待摊费用    | -              |
| 7  | 其他      | -              |
| 8  | 合计      | 326,595,669.22 |

### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 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（%） |
| 4,381,048 | 21,664.07 | 69,081,348,038.96 | 72.79     | 25,829,983,117.78 | 27.21     |

**8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况**

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额（份）          | 占总份额比例（%） |
|----|-------|------------------|-----------|
| 1  | 银行类机构 | 3,161,335,862.16 | 3.33      |
| 2  | 银行类机构 | 2,006,953,710.14 | 2.11      |
| 3  | 银行类机构 | 1,585,237,200.04 | 1.67      |
| 4  | 银行类机构 | 1,558,460,769.72 | 1.64      |
| 5  | 基金类机构 | 1,548,483,235.69 | 1.63      |
| 6  | 银行类机构 | 1,542,903,232.68 | 1.63      |
| 7  | 证券类机构 | 1,515,794,145.42 | 1.60      |
| 8  | 其他机构  | 1,514,349,810.87 | 1.60      |
| 9  | 银行类机构 | 1,510,673,534.93 | 1.59      |
| 10 | 其他机构  | 1,509,297,183.21 | 1.59      |

**8.3 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 | 2,402,856.22 | 0.00        |

**8.4 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<br>究部门负责人持有本开放式基金 | -                 |
| 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（2016年7月26日）<br>基金份额总额 | 200,002,302.30    |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 95,170,868,514.78 |
| 本报告期基金总申购份额                   | 92,567,260,133.42 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | 92,826,797,491.46 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少<br>以“-”填列）  | -                 |
| 本报告期期末基金份额总额                  | 94,911,331,156.74 |

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

**§ 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**

报告期内本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），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、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。

**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 |    |
| 高华证券  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 太平洋证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 天风证券  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券  | 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和剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

#### 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 |
| 高华证券  | -             | -            | 38,627,042,000.00  | 7.24%          | -    | -            |
| 太平洋证券 | -             | -            | -                  | -              | -    | -            |
| 天风证券  | -             | -            | -                  | -              | -    | -            |
| 中信证券  | 25,337,250.00 | 100.00%      | 495,031,300,000.00 | 92.76%         | -    | -            |

#### 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。

#### 10.9 其他重大事件

无。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信现金增利货币市场基金设立的文件；
- 2、《建信现金增利货币市场基金基金合同》；
- 3、《建信现金增利货币市场基金招募说明书》；
- 4、《建信现金增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。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 12.3 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

2020 年 8 月 28 日