

建信现金添利货币市场基金 2016 年半年 度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
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	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	7
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	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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
§5 托管人报告	14
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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
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
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 债券回购融资情况	37
7.3 基金投资组合平均剩余期限	37
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	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细	39
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	39
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	39
7.9 投资组合报告附注	40
§8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末上市基金前十名持有人	40

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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的情况	41
§9 开放式基金份额变动	41
§10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	43
10.9 其他重大事件	43
§11 备查文件目录	43
11.1 备查文件目录	43
11.2 存放地点	44
11.3 查阅方式	44

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信现金添利货币市场基金
基金简称	建信现金添利货币
基金主代码	000693
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 9 月 17 日
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	113,337,715,263.54 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
信息披露负责人	姓名	吴曙明	汤嵩彦
	联系电话	010-66228888	95559
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	tangsy@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号英蓝国际金融中心16层	上海市浦东新区银城中路188号
办公地址		北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码		100033	200120

法定代表人	许会斌	牛锡明
-------	-----	-----

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》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,879,320,054.36
本期利润	1,879,320,054.36
本期净值收益率	1.3606%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	113,337,715,263.54
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	6.4273%

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

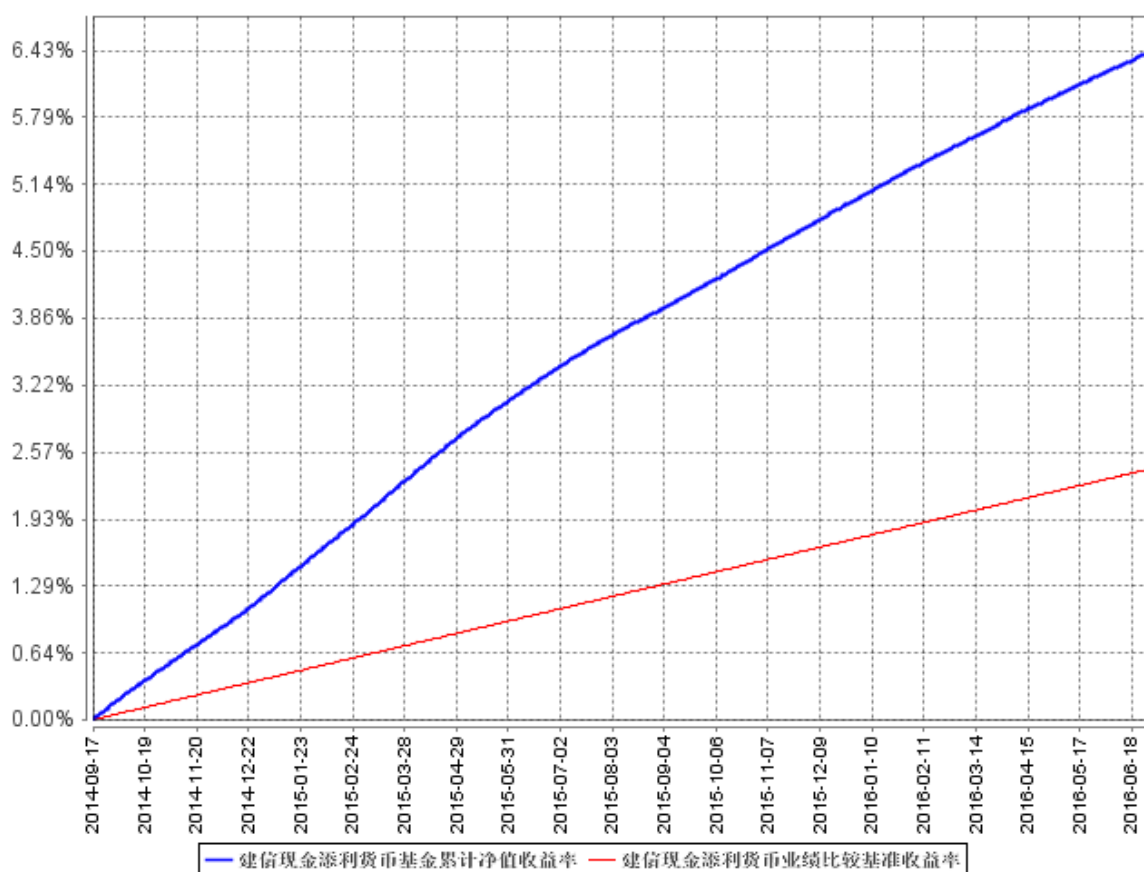
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

	收益率①	收益率标准差②	基准收益率③	准收益率标准差④		
过去一个月	0.2085%	0.0006%	0.1110%	0.0000%	0.0975%	0.0006%
过去三个月	0.6401%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	0.3035%	0.0005%
过去六个月	1.3606%	0.0008%	0.6732%	0.0000%	0.6874%	0.0008%
过去一年	2.9516%	0.0010%	1.3537%	0.0000%	1.5979%	0.0010%
自基金合同生效起至今	6.4273%	0.0022%	2.4152%	0.0000%	4.0121%	0.0022%

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

建信现金添利货币基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、量化衍生品及海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部，以及深圳、成都、上海、北京四家分公司和华东、西北两个营销中心，设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“国际一流、国内领先的综合性资产管理公司”。

截至 2016 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）、建信创新中国混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定

添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信安心保本二号混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信安心保本三号混合型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投资基金、建信目标收益一年期债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信安心保本六号混合型证券投资基金、建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金、建信安心保本七号混合型证券投资基金，共计 68 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 2,453.84 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
于倩倩	本基金的基金经理	2014 年 9 月 17 日	—	8	于倩倩女士，硕士。2008 年 6 月加入国泰人寿保险公司，任固定收益研究专员；2009 年 9 月加入金元惠理基金管理公司（原金元比联基金管理公司），任债券研究员；2011 年 6 月加入我公司，历任债券研究员、基金经理助理，2013 年 8 月 5 日起任建信货币市场基金基金经理；2014 年 1 月 21 日起任建信双周安心理财债券基金的基金经理；2014 年 6 月 17 日起任建信嘉薪宝货币市场基金基金经理；2014 年 9 月 17 日起任建信现金添利货币基金的基金经理。
陈建良	固定收	2014 年 9 月	—	9	2005 年 6 月加入中国建设银行

	益投资部总经理助理、本基金的基金经理	17 日			厦门分行，任客户经理；2007 年 6 月调入中国建设银行总行金融市场部，任债券交易员；2013 年 9 月加入我公司，历任基金经理助理、基金经理、固定收益投资部总监助理。2013 年 12 月 10 日起任建信货币市场基金基金经理；2014 年 1 月 21 日起任建信月盈安心理财基金基金经理；2014 年 6 月 17 日起任建信嘉薪宝货币市场基金基金经理；2014 年 9 月 17 日起任建信现金添利货币基金的基金经理；2016 年 3 月 14 日起任建信目标收益一年期债券型证券投资基金基金经理；2016 年 7 月 26 日起任建信现金增利货币市场基金基金经理。
高珊	本基金的基金经理	2015 年 8 月 25 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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年，宏观经济运行总体平稳，6.7% 的实际同比增速也基本符合市场预期。在稳增长措施发力的情况下，投资成为上半年托底经济的最重要手段。去年年底以来的地产销售火热局面延续到一季度，带动房地产投资增速从 3 月份起出现明显反弹，期间基建投资持续发力，推动 1-6 月固定资产投资同比保持 9% 的同比增速。值得注意的是，制造业投资持续萎靡，民间投资也延续下滑态势。消费数据基本保持平稳，但受制于居民收入增长乏力以及购房支出的挤压，后期难有显著改善。对外贸易方面，人民币贬值但外需走低，上半年呈现出衰退性顺差特征。

通胀方面，居民消费物价水平在上半年冲高回落。1-4 月在蔬菜和猪肉价格快速上涨的推动下，CPI 从年初的 1.8% 跳涨至 2.3% 的上半年高点。5 月后随着蔬菜价格回落和猪肉价格涨势趋缓，CPI 逐步回落至 2% 以内。工业品价格方面，年初以来处于库存低位的大宗商品价格持续回升，部

分行业出厂价格明显改善，带动 PPI 从 1 月份起同比跌幅逐渐收窄，环比更于 3 月翻正。

货币政策方面，央行在政策基调上保持总体稳健，与过去相比，较少使用降准、降息等总量宽松政策，而是更加重视公开市场操作，主要采用“逆回购+MLF”滚动续作的方式进行基础货币投放和政策引导。资金面方面，除 3 月末因首次广义信贷考核和“营改增”引发机构预期混乱，导致货币市场出现较大波动以外，其余时间资金面基本保持平稳。从汇率上看，人民币对美元中间价波动较大，中间价从年初的 6.50 左右抬升至 6 月末的 6.63 附近，总体延续贬值趋势。但近期的外汇储备和商业银行结售汇数据均有改善，市场对人民币贬值最为恐慌的时刻或已过去。

债券市场方面，上半年债券市场基本呈现先涨后跌再涨的“N”字走势。利率品上看，年初长期利率债延续去年四季度以来的牛市趋势。10 年国债收益率在 1 月份势如破竹，一路下探至上半年最低的 2.70%。10 年国开债收益率也一度往下击穿 3.0% 一线至 2.98% 附近，此后受金融数据超预期走强、一季度末资金面波动、营改增以及信用风险事件集中爆发等一系列因素的冲击，开始进入调整并陷入震荡。直至 6 月下旬英国脱欧事件引发全球避险情绪升温，收益率再度往下，但没能突破前期低点。总体而言，到二季度末 10 年国债收益率较年初下行 3BP，10 年国开债收益率与年初持平。利率债 10Y-1Y 期限利差有所收窄，曲线整体小幅平坦化下移。

信用品方面，年初起机构对信用品配置热情高涨，AA 以上评级品种各期限信用利差均被压缩至低位，3 月份信用债净融资额超过 7000 亿，创下历史新高。但 4 月份起违约事件频发，信用债市场风险大幅增加，机构对低评级和过剩产能行业债券偏好大幅下降，信用债一二级市场均受到剧烈冲击，信用利差走势开始出现明显分化，资质较好品种在信用利差走扩后随即收敛并保持低位。转债方面，上半年新发可转债 10 只，公募交换债 2 只，二季度末转债市场存量（含交换债）468 亿元，目前转债平均溢价率保持在 47% 的水平，整体溢价率水平仍维持高位。转债股性驱动特征较为明显，在股市下跌影响下，上半年中证转债指数整体下行 11.9%。

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 1.3606%，波动率 0.0008%，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 7 月份以及三季度，预计决策层将继续在稳增长和促改革之间寻找平衡，央行或延续上半年思路，在货币政策总体上维持稳健基调。通胀在去年较高的基数效应下，CPI 或在今年三季度降至年内低点，同时上半年人民币汇率贬值预期管理取得明显成效，一定程度上为央行货币政策

策操作打开空间。从目前来看，短期利率位于央行的合意水平，下半年除非出现通胀走高或者经济超预期下行等情况，主动大幅收紧或者放松货币条件的可能性和空间有限。央行很可能延续上半年以来公开市场高频率滚动续作的方式，将资金面维持在中性偏宽的水平。

基本面方面，二季度以来房地产销售增速明显回落，而制造业投资大概率延续趋势性下行，若仅靠基建发力，固定资产投资端对经济的拉动作用恐边际减弱，在消费和外贸缺乏改善条件的情况下，经济缺乏持续回暖基础。但一季度火热的房地产销售，或将带动三季度的开工数据向好，工业企业库存数据见底前，工业产出很难出现明显收缩，数据上并不支持中长期债券收益率在三季度的突破性下行。若央行继续锚定短期利率水平不变，短期债券收益率继续下行空间也会受到限制。

根据以上分析，三季度建信现金添利货币基金仍将保持稳健的投资风格，适当降低组合平均剩余期限，增强组合的流动性，加大组合久期和规模弹性，在严控信用风险的基础上，力争保证组合能够跟随市场的运行节奏，为投资人获得合理收益。

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。本报告期内本基金实现收益 1,879,320,054.36 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

2016 上半年度，托管人在建信现金添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

2016 上半年度，建信基金管理有限责任公司在建信现金添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：1,879,320,054.36 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2016 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添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：建信现金添利货币市场基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	60,900,647,157.43	89,591,316,232.49
结算备付金		195,203,754.38	16,048,095.24
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	47,439,046,974.84	61,493,045,017.96
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		47,289,083,138.47	61,493,045,017.96
资产支持证券投资		149,963,836.37	-
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	8,518,325,761.19	19,086,511,672.02
应收证券清算款		1,500,264,583.35	-
应收利息	6.4.7.5	453,390,568.45	859,677,061.41
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		119,006,878,799.64	171,046,598,079.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		5,605,095,160.15	4,988,596,480.00
应付证券清算款		-	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		31,910,787.09	32,355,932.88
应付托管费		5,318,464.50	27,513,641.61
应付销售服务费		15,955,393.56	16,177,966.44
应付交易费用	6.4.7.7	493,840.45	641,869.95
应交税费		-	-
应付利息		1,759,153.22	1,848,114.47
应付利润		8,188,982.55	12,783,268.27
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	441,754.58	308,041.10
负债合计		5,669,163,536.10	5,080,225,314.72
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	113,337,715,263.54	165,966,372,764.40
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		113,337,715,263.54	165,966,372,764.40
负债和所有者权益总计		119,006,878,799.64	171,046,598,079.12

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

113,337,715,263.54 份。

6.2 利润表

会计主体：建信现金添利货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		2,290,955,371.33	1,157,314,794.93
1.利息收入		2,209,250,268.98	1,120,746,703.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,226,366,062.13	872,251,802.71
债券利息收入		831,349,921.85	212,055,205.16
资产支持证券利息收入		555,036.10	-
买入返售金融资产收入		150,979,248.90	36,439,695.67
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		81,705,102.35	36,568,091.39
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	81,705,102.35	36,568,091.39
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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“-”	6.4.7.17	-	-

”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)	6.4.7.18	-	-
减：二、费用		411,635,316.97	163,780,565.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	207,990,925.99	70,085,432.79
2. 托管费	6.4.10.2.2	34,665,154.37	11,680,905.50
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	103,995,463.07	35,042,716.45
4. 交易费用	6.4.7.19	0.00	0.00
5. 利息支出		64,658,387.23	46,680,616.30
其中：卖出回购金融资产支出		64,658,387.23	46,680,616.30
6. 其他费用	6.4.7.20	325,386.31	290,894.80
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,879,320,054.36	993,534,229.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,879,320,054.36	993,534,229.09

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：建信现金添利货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	165,966,372,764.40	-	165,966,372,764.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,879,320,054.36	1,879,320,054.36
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)	-52,628,657,500.86	-	-52,628,657,500.86
其中：1.基金申购款	306,682,378,355.16	-	306,682,378,355.16
2.基金赎回款	-359,311,035,856.02	-	-359,311,035,856.02
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)	-	-1,879,320,054.36	-1,879,320,054.36

以“-”号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	113,337,715,263.54	-	113,337,715,263.54
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	32,889,359,062.68	-	32,889,359,062.68
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	993,534,229.09	993,534,229.09
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)	27,351,525,270.23	-	27,351,525,270.23
其中：1.基金申购款	201,778,623,795.96	-	201,778,623,795.96
2.基金赎回款	-174,427,098,525.73	-	-174,427,098,525.73
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)	-	-993,534,229.09	-993,534,229.09
五、期末所有者权益 (基金净值)	60,240,884,332.91	-	60,240,884,332.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 孙志晨	_____ 赵乐峰	_____ 丁颖
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信现金添利货币市场基金(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”)证监基金字(2014)535号《关于核准建信现金添利货币市场基金募集的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信现金添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7,759,805,423.19元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第538号予以验证。经向中国证监会备案，《建信现金添利货币市

场基金基金合同》于 2014 年 9 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 7,760,531,892.11 份基金份额，其中认购资金利息折合 726,468.92 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《建信现金添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；通知存款；一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单；剩余期限在 397 天(含 397 天)以内的债券；期限在一年以内(含一年)的债券回购；期限在一年以内(含一年)的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为七天通知存款利率(税前)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信现金添利货币市场基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内未发生会计差错。

6.4.6 税项

财税[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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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。

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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	1,000,647,157.43
定期存款	59,900,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	24,900,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	1,000,000,000.00
存款期限 3 个月以上	34,000,000,000.00
其他存款	—
合计：	60,900,647,157.43

注：定期存款的存款期限指票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	2,336,724,331.35	2,336,566,000.00	-158,331.35	-0.0001%
	银行间市	44,952,358,807.12	44,970,270,000.00	17,911,192.88	0.0158%

场					
合计	47,289,083,138.47	47,306,836,000.00	17,752,861.53	0.0157%	

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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

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 2016 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	8,518,325,761.19	1,936,539,967.48
合计	8,518,325,761.19	1,936,539,967.48

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日						
	债券代码	债券名称	约定 返售日	估值单价	数量（张）	估值 总额	其中：已 或再质押总 额
买断式回 购-银行 间	101564018	15 蒙君正 MTN001	2016 年 7 月 8 日	100.52	400,000	40,208,000.00	—
买断式回 购-银行 间	101663007	16 阿波罗 MTN001	2016 年 7 月 8 日	99.77	1,000,000	99,770,000.00	—
买断式回 购-银行 间	101651017	16 平安不 动 MTN001	2016 年 7 月 8 日	99.44	800,000	79,552,000.00	—
买断式回 购-银行 间	1082088	10 中化 MTN1	2016 年 7 月 8 日	101.36	200,000	20,272,000.00	—

买断式回购-银行间	011699436	16 新中泰集 SCP002	2016 年 7 月 12 日	99.88	500,000	49,940,000.00	-
买断式回购-银行间	1580117	15 津融集团债	2016 年 7 月 12 日	105.48	1,900,000	200,412,000.00	-
买断式回购-银行间	101660051	16 山西建工 MTN001	2016 年 7 月 12 日	100.08	1,000,000	100,080,000.00	-
买断式回购-银行间	011699997	16 红狮 SCP002	2016 年 7 月 12 日	99.80	600,000	59,880,000.00	-
买断式回购-银行间	011699998	16 苏国信 SCP006	2016 年 7 月 6 日	100.00	1,000,000	100,000,000.00	-
买断式回购-银行间	011699992	16 电信股 SCP006	2016 年 7 月 6 日	99.97	3,500,000	349,895,000.00	-
买断式回购-银行间	011698001	16 南航股 SCP004	2016 年 7 月 6 日	99.98	2,000,000	199,960,000.00	-
买断式回购-银行间	041662033	16 陆家嘴 CP001	2016 年 7 月 6 日	99.91	800,000	79,928,000.00	-
买断式回购-银行间	1580166	15 海基债	2016 年 7 月 6 日	103.58	1,500,000	155,370,000.00	-
买断式回购-银行间	101654019	16 玉皇化工 MTN001	2016 年 7 月 6 日	99.45	1,000,000	99,450,000.00	-
买断式回购-银行间	011699250	16 阳煤 SCP003	2016 年 7 月 6 日	99.45	500,000	49,725,000.00	-
买断式回购-银行间	011699037	16 同煤	2016 年	100.18	600,000	60,108,000.00	-

式回 购-银 行间		SCP001	7 月 6 日				
买断 式回 购-银 行间	041655004	16 阳煤 CP001	2016 年 7 月 14 日	99.68	1,500,000	149,520,000.00	-
买断 式回 购-银 行间	101573014	15 中信国 安 MTN002	2016 年 7 月 1 日	101.58	500,000	50,790,000.00	-
合计					19,300,000	1,944,860,000.00	-

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,797,254.26
应收定期存款利息	261,641,038.84
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	87,841.70
应收债券利息	185,861,661.82
应收买入返售证券利息	3,485,792.10
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	516,979.73
合计	453,390,568.45

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 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	493,840.45
合计	493,840.45

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	441,754.58
合计	441,754.58

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	165,966,372,764.40	165,966,372,764.40
本期申购	306,682,378,355.16	306,682,378,355.16
本期赎回(以“-”号填列)	-359,311,035,856.02	-359,311,035,856.02
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	113,337,715,263.54	113,337,715,263.54

注：申购含红利再投份额。

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	1,879,320,054.36	-	1,879,320,054.36
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	-1,879,320,054.36	-	-1,879,320,054.36
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

活期存款利息收入	26,323,223.99
定期存款利息收入	1,198,387,585.40
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	425,918.73
其他	1,229,334.01
合计	1,226,366,062.13

注：于 2016 年上半年，本基金未发生提前支取定期存款而产生利息损失的情况。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

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 2016年1月1日至2016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	81,705,102.35
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	81,705,102.35

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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	89,959,074,295.25
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	89,344,819,737.34
减：应收利息总额	532,549,455.56
买卖债券差价收入	81,705,102.35

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资-赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资-申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期末投资贵金属。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末投资贵金属。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末投资贵金属。

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

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期末投资衍生工具。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	84,535.36
信息披露费	149,178.12
银行汇划费用	68,678.08
其他费用	4,994.75
银行间账户维护费	18,000.00
合计	325,386.31

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**

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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、注册登记机构和基金销售机构
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”）	基金管理人的股东
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	207,990,925.99	70,085,432.79
其中：支付销售机构的客户维护费	32,618,880.37	43,609,695.38

注：1、支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	34,665,154.37	11,680,905.50

注：支付基金托管行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 X 0.05% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费 各关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国建设银行	40,773,600.47
建信基金管理有限责任公司	57,701,440.37
合计	98,475,040.84
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国建设银行	31,149,782.31
交通银行	-
建信基金管理有限责任公司	3,889,318.92
合计	35,039,101.23

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.15% 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 = 前一日基金资产净值 X 0.15% / 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期存款	1,000,647,157.43	26,323,223.99	1,685,835,862.56	14,852,688.11
交通银行-定期存款	-	33,940,555.56	1,700,000,000.00	21,516,528.38

注：1. 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；

2. 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2016 年 06 月 30 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示(2015 年 06 月 30 日：同)。

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

本报告期及上年度可比期间本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金**

金额单位：人民币元

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	本期利润分配 合计	备注
1,883,914,340.08	-	-4,594,285.72	1,879,320,054.36	-

注：本基金在本报告期内累计分配收益 1,879,320,054.36 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 1,871,131,071.81 元，计入应付收益科目 8,188,982.55 元。

6.4.12 期末（2016 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**

本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 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 2016 年 06 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 5,605,095,160.15 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
150408	15 农发 08	2016 年 7 月 1 日	101.00	2,000,000	201,998,971.63
160304	16 进出 04	2016 年 7 月 1 日	99.82	14,500,000	1,447,334,844.61
150224	15 国开 24	2016 年 7 月 1 日	99.87	4,000,000	399,484,693.44
150315	15 进出 15	2016 年 7 月 1 日	99.53	3,900,000	388,184,392.74
160209	16 国开 09	2016 年 7 月 1 日	99.78	5,000,000	498,899,776.54
140201	14 国开 01	2016 年 7 月 1 日	101.56	1,000,000	101,564,043.07
160201	16 国开 01	2016 年 7 月 1 日	99.90	6,900,000	689,328,143.92
150408	15 农发 08	2016 年 7 月 5 日	101.00	2,800,000	282,798,560.29
160414	16 农发 14	2016 年 7 月 5 日	99.93	2,600,000	259,809,498.36
150416	15 农发 16	2016 年 7 月 5 日	100.00	7,000,000	700,033,316.81
160401	16 农发 01	2016 年 7 月 5 日	99.93	5,000,000	499,665,811.59
160201	16 国开 01	2016 年 7 月 7 日	99.90	5,100,000	509,503,410.72
合计				59,800,000	5,978,605,463.72

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易，故未存在作为抵押的债券。

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内。

本基金风险管理的主要目标是通过事前监测、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、
监察稽核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
督察长和监察稽核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同责任，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。

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 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	2,519,780,191.76	7,161,130,276.05
A-1 以下	-	-
未评级	5,547,734,638.05	9,988,693,062.84
合计	8,067,514,829.81	17,149,823,338.89

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、央行票据及
同业存单等。

6.4.13.2.2 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	上年度末
--------	-----	------

	2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
AAA	149,963,836.37	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	149,963,836.37	-

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、央行票据及同业存单等。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金所持大部分证券在证券交易所上市和银行间同业市场交易，除 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

除 6.4.13.4.1.1 中列示的卖出回购金融资产款外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

6.4.13.4 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 2016 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	60,900,647,157.43	-	-	-	-	60,900,647,157.43
结算备付金	195,203,754.38	-	-	-	-	195,203,754.38
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	36,948,343,654.07	10,490,703,320.77	-	-	-	47,439,046,974.84
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	8,518,325,761.19	-	-	-	-	8,518,325,761.19
应收证券清算款	-	-	-	-	1,500,264,583.35	1,500,264,583.35
应收利息	-	-	-	-	453,390,568.45	453,390,568.45
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	106,562,520,327.07	10,490,703,320.77	-	-	1,953,655,151.80	119,006,878,799.64
负债						
卖出回购金融资产款	5,605,095,160.15	-	-	-	-	5,605,095,160.15
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	-	-	-	-	31,910,787.09	31,910,787.09
应付托管费	-	-	-	-	5,318,464.50	5,318,464.50
应付销售服务费	-	-	-	-	15,955,393.56	15,955,393.56
应付交易费用	-	-	-	-	493,840.45	493,840.45
应交税费	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	1,759,153.22	1,759,153.22
应付利润	-	-	-	-	8,188,982.55	8,188,982.55

其他负债	-	-	-	-	441,754.58	441,754.58
负债总计	5,605,095,160.15	-	-	-	64,068,375.95	5,669,163,536.10
利率敏感度缺口	100,957,425,166.92	10,490,703,320.77	-	-	1,889,586,775.85	113,337,715,263.54
上年度末 2015 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	86,591,316,232.49	3,000,000,000.00	-	-	-	89,591,316,232.49
结算备付金	16,048,095.24	-	-	-	-	16,048,095.24
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	48,382,480,306.34	13,110,564,711.62	-	-	-	61,493,045,017.96
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	19,086,511,672.02	-	-	-	-	19,086,511,672.02
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	859,677,061.41	859,677,061.41
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	154,076,356,306.09	16,110,564,711.62	-	-	859,677,061.41	171,046,598,079.12
负债						
卖出回购金融资产 款	4,988,596,480.00	-	-	-	-	4,988,596,480.00
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	-	-	-	-	32,355,932.88	32,355,932.88
应付托管费	-	-	-	-	27,513,641.61	27,513,641.61
应付销售服务费	-	-	-	-	16,177,966.44	16,177,966.44
应付交易费用	-	-	-	-	641,869.95	641,869.95
应交税费	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	1,848,114.47	1,848,114.47
应付利润	-	-	-	-	12,783,268.27	12,783,268.27
其他负债	-	-	-	-	308,041.10	308,041.10
负债总计	4,988,596,480.00	-	-	-	91,628,834.72	5,080,225,314.72
利率敏感度缺口	149,087,759,826.09	16,110,564,711.62	-	-	768,048,226.69	165,966,372,764.40

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

(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 06 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 47,439,046,974.84 元，无属于第一层次或第三层次的余额(2015 年 06 月 30 日：第二层次 18,720,799,397.65 元，无第一层次或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产 (2015 年 06 月 30 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	47,439,046,974.84	39.86
	其中：债券	47,289,083,138.47	39.74
	资产支持证券	149,963,836.37	0.13
2	买入返售金融资产	8,518,325,761.19	7.16
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	1,936,539,967.48	1.63
3	银行存款和结算备付金合计	61,095,850,911.81	51.34
4	其他各项资产	1,953,655,151.80	1.64
5	合计	119,006,878,799.64	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	4.61	
	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	5,605,095,160.15	4.95
	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

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	96
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	96
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	65

报告期内投资组合平均剩余期限超过 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	19.43	4.95
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
2	30 天(含)—60 天	15.98	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.69	—
3	60 天(含)—90 天	28.84	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
4	90 天(含)—120 天	17.15	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
5	120 天(含)—397 天(含)	22.59	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
合计		103.98	4.95

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	2,336,724,331.35	2.06
2	央行票据	—	—
3	金融债券	6,177,405,271.78	5.45
	其中：政策性金融债	6,177,405,271.78	5.45
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	8,067,514,829.81	7.12
6	中期票据	—	—
7	同业存单	30,707,438,705.53	27.09
8	其他	—	—
9	合计	47,289,083,138.47	41.72
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	787,669,086.18	0.69

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值 比例 (%)
1	111610170	16 兴业 CD170	20,000,000	2,000,000,000.00	1.76
2	111609080	16 浦发 CD080	15,000,000	1,493,876,242.06	1.32
3	160304	16 进出 04	14,500,000	1,447,334,844.61	1.28
4	020117	16 贴债 19	14,500,000	1,447,234,083.71	1.28
5	111507114	15 招行 CD114	14,500,000	1,446,496,325.26	1.28
6	160201	16 国开 01	12,000,000	1,198,831,554.64	1.06
7	111611093	16 平安 CD093	12,000,000	1,192,888,040.89	1.05
8	111690060	16 重庆银行 CD002	11,000,000	1,081,976,534.51	0.95
9	011699568	16 中国中信 SCP001	10,000,000	999,345,287.81	0.88
10	111691108	16 长沙银行 CD022	10,000,000	994,873,859.46	0.88

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
----	------

报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1021%
报告期内偏离度的最低值	0.0067%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0454%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

报告期内正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1689097	16 招金 1A1(总价)	900,000	90,090,000.00	0.08
2	1689098	16 招金 1A2(总价)	600,000	60,018,000.00	0.05

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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,500,264,583.35
3	应收利息	453,390,568.45
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-

6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,953,655,151.80

§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
499,649	226,834.67	70,671,645,634.17	62.35%	42,666,069,629.37	37.65%

8.2 期末上市基金前十名持有人

无

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	12,541,491.59	0.01%

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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 9 月 17 日）基金份额总额	7,760,531,892.11
本报告期期初基金份额总额	165,966,372,764.40
本报告期基金总申购份额	306,682,378,355.16
减：本报告期基金总赎回份额	359,311,035,856.02
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	113,337,715,263.54

注：上述总申购份额含红利再投份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
高华证券	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、本基金与同一托管行托管的基金共用原有交易单元。

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	-	-	-	-	-	-
中信证券	159,156,600.00	100.00%	121,316,900,000.00	100.00%	-	-

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

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增中信期货为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2016 年 2 月 5 日

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

11.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司
2016 年 8 月 27 日