

# 建信嘉薪宝货币市场基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 30 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2021 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.....	6
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.....	7
3.3 其他指标.....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	17
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..	17
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.....	18
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	22
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 债券回购融资情况.....	42
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	43
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.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43

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 .....	44
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	44
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 .....	45
7.9 投资组合报告附注 .....	45
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	46
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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 .....	47
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>47</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
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 .....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	50
10.9 其他重大事件 .....	50
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>50</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 .....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	50
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>50</b>
12.1 备查文件目录 .....	50
12.2 存放地点 .....	50
12.3 查阅方式 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信嘉薪宝货币市场基金	
基金简称	建信嘉薪宝货币	
基金主代码	000686	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 6 月 17 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	101, 772, 411, 300. 70 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	建信嘉薪宝货币 A	建信嘉薪宝货币 B
下属分级基金的交 易代码	000686	002753
报告期末下属分级 基金的份额总额	101, 762, 406, 099. 92 份	10, 005, 200. 78 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采取个券选择策略、利率策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现组合增值。
业绩比较基准	七天通知存款利率（税前）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	罗丹丹
	联系电话	010-66228888	4006800000
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	luodandan@citicbank.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95558
传真		010-66228001	010-85230024
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		100033	100020
法定代表人		孙志晨	李庆萍

## 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	http://www.ccbfund.cn
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(2021年1月1日-2021年6月30日)	
	建信嘉薪宝货币 A	建信嘉薪宝货币 B
本期已实现收益	858,662,850.58	143,031.07
本期利润	858,662,850.58	143,031.07
本期净值收益率	1.2118%	1.3313%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末基金资产净值	101,762,406,099.92	10,005,200.78
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
累计净值收益率	25.9045%	18.1754%

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

建信嘉薪宝货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1881%	0.0003%	0.1110%	0.0000%	0.0771%	0.0003%
过去三个月	0.5842%	0.0006%	0.3366%	0.0000%	0.2476%	0.0006%
过去六个月	1.2118%	0.0008%	0.6695%	0.0000%	0.5423%	0.0008%
过去一年	2.3122%	0.0009%	1.3500%	0.0000%	0.9622%	0.0009%
过去三年	8.3796%	0.0032%	4.0537%	0.0000%	4.3259%	0.0032%
自基金合同生效起至今	25.9045%	0.0051%	9.5092%	0.0000%	16.3953%	0.0051%

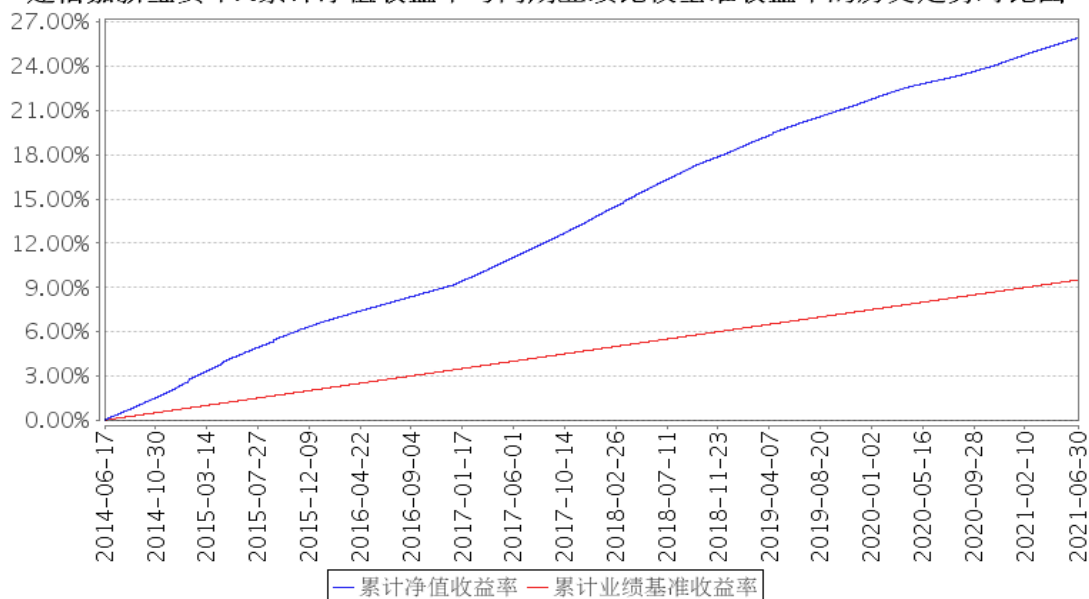
建信嘉薪宝货币 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.2078%	0.0003%	0.1110%	0.0000%	0.0968%	0.0003%
过去三个月	0.6442%	0.0006%	0.3366%	0.0000%	0.3076%	0.0006%
过去六个月	1.3313%	0.0008%	0.6695%	0.0000%	0.6618%	0.0008%
过去一年	2.5559%	0.0009%	1.3500%	0.0000%	1.2059%	0.0009%

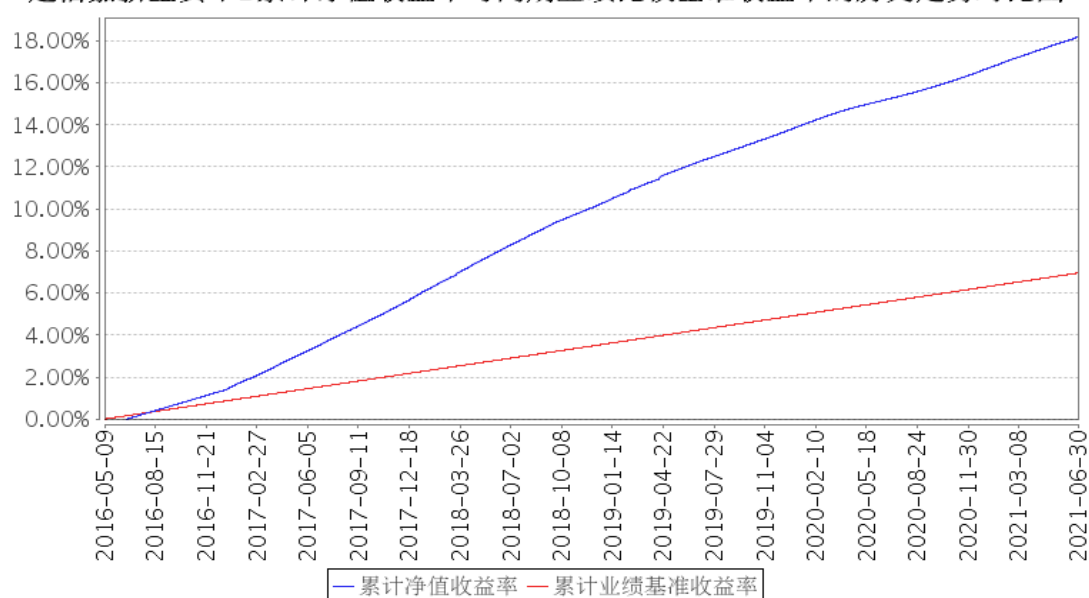
过去三年	9.1594%	0.0032%	4.0537%	0.0000%	5.1057%	0.0032%
自基金合同生效起至今	18.1754%	0.0036%	6.9497%	0.0000%	11.2257%	0.0036%

### 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

建信嘉薪宝货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信嘉薪宝货币B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、国际投资与业务发展部、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、证券公司客户部、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 2021 年 6 月 30 日，公司旗下有建信货币市场基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信利率债债券型证券投资基金基金、建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)、上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金、建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信恒久价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信创新中国混合型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信环保产业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、建信兴利灵活配置混合型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金(FOF)、建信睿丰纯债定期开放债券型发起

式证券投资基金、建信福泽裕泰混合型基金中基金 (FOF)、建信睿信三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金、建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、建信短债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、建信稳定得利债券型证券投资基金、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、建信多因子量化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、建信中证红利潜力指数证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、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、建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数证券投资基金 (LOF)、建信优势动力混合型证券投资基金 (LOF)、建信周盈安心理财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、建信裕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、建信现金增利货币市场基金、建信睿享纯债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、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金、建信润利增强债券型证券投资基金、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、建信上海金交易型开放式证券投资基金、建信上海金交易型开放式证券投资基金联接基金、建信智汇优选一年持有期混合型管理人中管理人 (MOM) 证券投资基金、建信智能生活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)、建信安心回报 6 个月定期开放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、建信荣瑞一年定期开放债券型证券投资基金、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、建信收益增强债券型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、建信鑫稳回报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、建信中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、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发起式联接基金、建信臻选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、建信恒安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、建信高端医疗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、建信睿兴纯债债券型证券投资基金、建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫荣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、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金、建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、建信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金、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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金、建信中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、建信利率债策略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、建信食品饮料行业股票型证券投资基金、建信中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、建信新能源行业股票型证券投资基金、建信高端装备股票型证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金(QDII)、建信新兴市场优选混合型证券投资基金(QDII)、建信富时 100 指数型证券投资基金(QDII)、建信中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、建信泓利一年持有期债券型证券投资基金、建信中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、建信裕丰利率债三个月定期开放债券型证券投资基金共计 135 只证券投资基金，管理的基金净资产规模共计为 5785.77 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	2014 年 6 月 17 日	-	14 年	陈建良先生，固定收益投资部总经理，双学士。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

	基金经理				<p>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、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。</p>
于倩倩	本基金的基金经理	2014年6月17日	-	13年	<p>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、基金经理，2013年8月5日起任建信货币市场基金的基金经理；2014年1月21日起任建信双周安心理财债券型证券投资基金的基金经理，该基金于2021年1月21日转型为建信利率债债券型证券投资基金，于倩倩自2021年1月21日至1月27日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；2018年3月26日起任建信天添益货币市场基金的基金经理；2019年12月13日起任建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。</p>
先轺宇	本基金的基金经理	2019年1月25日	-	9年	<p>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，</p>

					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；2020 年 12 月 18 日起任建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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》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

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2021 年上半年，随着疫苗接种率快速提升，国内经济延续修复但环比增速有所下降，物价总体保持平稳但输入型通胀情绪显著升温，政策延续不急转弯的思路并强调“以我为主”，流动性环境在 1 月底经历了显著波动，导致债券收益率有所上行，此后货政层面对于市场舆论的引导较为明朗，资金层面持续表现友好，债市对于利空因素的反应整体有所钝化，并在机构普遍欠配的资产荒压力下，收益率呈现趋势性回落。具体来看，长端债券收益率经历先上后下行情后整体是略有回落的，与去年底相比，10 年期国债和国开债分别下行 7bp 和 5bp，短端与长端类似，1 年期国债和国开债分别回落 4BP 和 4BP，期限利差基本保持不变。

经济复苏延续但动力开始走弱，工业品通胀进入快速上行阶段。就经济层面而言，上半年出口持续保持高增拉动制造业快速修复，消费延续修复但速度较慢，房地产投资依然保持强势但二季度开始回落，基建投资增速整体表现低迷，总体来看，上半年依然是“出口-生产”链条和房地产投资对经济的支撑作用最强，不过 2 季度开始，这两方面支撑因素都呈现减弱的迹象，一方面是出口新订单指数持续回落，海外疫情反复且发达经济体自身生产能力在修复，另一方面是国内地产调控政策持续收紧，融资、拿地、开工各环节预期都向下。与此同时，广义信用融资整体是收缩的态势，信托持续压降，地方债发行进度低于预期，城投类企业融资收紧，社融增速开始低于预期。就通胀而言，原油、有色金属等国际大宗商品价格延续上涨势头，国内限产预期引发煤炭、钢铁价格快速飙涨，叠加基数效应，PPI 快速攀升。

政策延续不急转弯的思路并强调“以我为主”。1 月下旬部分官员表态“部分领域出现泡沫，货币政策应考虑适度转向”，叠加当月 MLF 未充分续做的事实，使得政策收紧预期明显上升，一度导致资金利率飙升失控，为此央行及时发声安抚，强调公开市场操作看价不看量，在后续的操作中始终保持平稳节奏，对于市场担忧的缴税、地方债发行等可能引发资金波动的因素，都提前表态对于流动性的呵护态度，有效地抑制了资金价格的波动预期。与此同时，面对大宗商品价格快速上涨，一方面政策明确表态“以我为主”，认为若无内需趋热相叠加，仅大宗商品价格上涨不易引发明显的输入型通胀，另一方面多部门果断采取联合行动，及时地遏制了输入型通胀预

期的过度发酵。

流动性环境经历 1 月底的显著波动后进入了稳定的相对宽松节奏，短端资产收益率在 1 季度冲高后开始震荡式下行。1 月下旬受政策收紧预期影响，全月隔夜平均利率显著跳升至 2.25%，而后随着央行不断发声平稳预期，叠加结余国库存款加快投放、地方政府发债进度持续低于预期，传统的资金季节效应体现均不明显，隔夜平均利率连续 3 个月维持在 2% 以内，直至 6 月份随着超储不断走低，7 天资金利率才重新回到政策中枢上方。短端资产方面，1 季度存单利率跟随资金节奏出现明显回升，AAA 存单利率高于 MLF 利率大概 20bp 以内，基本回到去年 12 月中旬水平，2 季度进入震荡式下行，AAA 存单利率重新回到低于 MLF 利率 10bp 的水平，与去年底水平基本相当。

本基金作为流动性管理产品，一直贯彻以负债稳定性来选择资产端策略的原则。一方面，本基金在上半年规模稳步上升，且稳定性相对较好，持有人集中度较低，可以充分利用剩余期限的延展空间；另一方面，年初我们判断今年短端资产可能是区间震荡格局，剩余期限策略保持相对积极，在配置结构上以哑铃型为主，立足持有期收益，跟随资金节奏，我们在 1 月下旬、春节前后、4-5 月都及时锁定了高性价比的中长期存款存单，保持剩余期限在中高水平，严控组合信用风险和偏离风险在安全范围内。总体而言，我们充分依托负债的稳定特性，跟随政策与资金节奏，及时捕捉高性价比资产的配置机会，为投资者实现了相对较好的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率 1.2118%，波动率 0.0008%，本报告期本基金 B 净值增长率 1.3313%，波动率 0.0008%；业绩比较基准收益率 0.6695%，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 2021 年下半年，经济修复动能放缓的迹象正逐渐显露，暴雨灾害与疫情反复又带来新的波折，政策料将延续跨周期视角的连续性与稳定性，坚持“以我为主”的基础上可能会相对调升稳增长的权重，流动性在外围收紧预期的不确定影响下更注重内部预留空间，方向上难言主动收紧。总体而言，短期基本面、政策面与流动性环境仍将对债券市场构成支撑，但尚缺乏足够的信号来判断货币政策是进入新一轮的降息周期，如果政策利率保持按兵不动，则仍将制约债券收益率的下行空间。

经济修复动能放缓正逐渐显露。此前支撑经济修复的 2 个主要因素，一是出口-生产链条，在外部产能恢复、上游大宗商品价格过快上涨挤压中下游行业利润空间等因素影响下，新出口订单指数已指向回落，二是房地产投资链条，自去年四季度以来就开始收紧的调控政策，在今年更是延续甚至加码的节奏，融资政策的收紧已经扩展到按揭贷款，土地招标新规也严禁激进扩张，从

政策传导周期来看，销售与开工的负反馈应在下半年有所体现。此外，今年在地方政府去杠杆的趋向向下，地方债发行项目审核流程趋严，发行进度明显低于预期，地方政府化债模式又面临 15 号文的更严考验，基建投资增速难有亮眼的表现。

政策料将延续跨周期视角的连续性与稳定性。央行在 7 月份进行了全面降准，降准时点和方式都超出了市场预期，这是基于置换 MLF 工具以达到降成本目的的操作，从历史经验来看降准一般不是一次性的，且下半年 MLF 到期量较大，继续置换以降成本的必要性看起来仍然存在，在美国 taper 操作即将来临的预期下，这充分显示了政策层“以我为主”的思路仍在延续，并为外围不确定的收紧预期预留足够的应对空间。从跨周期调节的视角而言，随着下半年经济动能放缓，政策可能相应调升稳增长的权重，货币端保持充裕的流动性供给，财政端加快地方债的发行，都在可预期的范围，但目前的信号尚不足以支持新一轮降息周期的开启，我们预计 MLF 利率短期仍将保持不变。

流动性预计仍然维持稳健偏宽松的态势，但波动可能加大。下半年的扰动因素来自以下几个方面，其一是传统的缴税因素，其二是地方债发行节奏大概率加快，其三是美国 taper 操作即将来临，市场预期 9 月议息会议会有结论；有利因素主要在于央行对于流动性的呵护态度，降准置换 MLF 的操作预计不止一次，即使市场扰动加大，央行对于流动性预期的舆论引导与及时的对冲操作，仍能保证内部充裕的流动性供给。

本基金以流动性管理为第一要务。一方面，考虑到本基金负债端稳定性相对较好，在策略方向内我们可以灵活把握剩余期限的延展空间；另一方面，央行呵护态度下资金波动幅度仍是有限度的，我们将根据资金节奏的变化，立足持有期收益，及时锁定性价比较高的中长期存款存单，保持组合剩余期限在中等偏上水平，控制组合偏离风险在安全范围内，以灵活杠杆策略，实现组合流动性与收益性的大体平衡。

#### 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，每日将当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。本年度嘉薪宝 A 应分配收益为 858,662,850.58 元，嘉薪宝 B 应分配收益为 143,031.07 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对建信嘉薪宝货币市场基金 2021 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司在建信嘉薪宝货币市场基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有

关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2021 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：建信嘉薪宝货币市场基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	41,592,683,951.83	7,932,065,385.26
结算备付金		701,766,511.09	14,802,857.14
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	23,679,875,195.98	8,133,751,801.55
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		23,679,875,195.98	8,133,751,801.55
资产支持证券投资		-	-
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	40,290,430,908.04	8,814,187,961.21
应收证券清算款		-	637,808.23
应收利息	6.4.7.5	330,823,240.38	75,155,199.21
应收股利		-	-
应收申购款		1,701,826.12	3,891,469.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		106,597,281,633.44	24,974,492,482.28
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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		1,228,728,905.63	535,298,877.05
应付证券清算款		3,559,847,575.42	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		11,895,566.13	2,928,830.62
应付托管费		3,965,188.75	976,276.84
应付销售服务费		19,823,527.85	4,875,326.17
应付交易费用	6.4.7.7	227,307.80	131,120.93
应交税费		-	23,633.08
应付利息		134,246.42	121,867.64
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	248,014.74	249,000.00
负债合计		4,824,870,332.74	544,604,932.33
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	101,772,411,300.70	24,429,887,549.95
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		101,772,411,300.70	24,429,887,549.95
负债和所有者权益总计		106,597,281,633.44	24,974,492,482.28

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 101,772,411,300.70 份，其中建信嘉薪宝货币 A 基金份额总额 101,762,406,099.92 份，基金份额净值 1.0000 元；建信嘉薪宝货币 B 基金份额总额 10,005,200.78 份，基金份额净值 1.0000 元。

## 6.2 利润表

会计主体：建信嘉薪宝货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		1,026,779,118.04	263,087,515.36
1. 利息收入		1,014,663,650.36	263,032,870.43
其中：存款利息收入	6.4.7.11	495,514,140.80	111,362,216.17
债券利息收入		205,376,980.24	95,259,545.11
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		313,772,529.32	56,411,109.15
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		12,115,467.68	54,644.93
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	12,115,467.68	54,644.93
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“-”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	-	-
减：二、费用		167,973,236.39	57,118,489.41
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	53,478,782.74	14,153,657.03
2. 托管费	6.4.10.2.2	17,826,260.90	4,717,885.71
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	89,118,432.82	23,530,133.47
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		7,382,219.75	14,542,824.24
其中：卖出回购金融资产支 出		7,382,219.75	14,542,824.24
6. 税金及附加		2,612.36	17,540.23
7. 其他费用	6.4.7.20	164,927.82	156,448.73
三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）		858,805,881.65	205,969,025.95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		858,805,881.65	205,969,025.95

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信嘉薪宝货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	24,429,887,549.95	-	24,429,887,549.95
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数（本期 利润）	-	858,805,881.65	858,805,881.65
三、本期基金份	77,342,523,750.75	-	77,342,523,750.75

额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	517,191,212,695.36	-	517,191,212,695.36
2. 基金赎回款	-439,848,688,944.61	-	-439,848,688,944.61
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）	-	-858,805,881.65	-858,805,881.65
五、期末所有者权益（基金净值）	101,772,411,300.70	-	101,772,411,300.70
项目	上年度可比期间 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）	14,571,642,694.45	-	14,571,642,694.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	205,969,025.95	205,969,025.95
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）	3,678,471,650.23	-	3,678,471,650.23
其中：1. 基金申购款	204,266,683,452.01	-	204,266,683,452.01
2. 基金赎回款	-200,588,211,801.78	-	-200,588,211,801.78
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）	-	-205,969,025.95	-205,969,025.95
五、期末所有者权益（基金净值）	18,250,114,344.68	-	18,250,114,344.68

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

建信嘉薪宝货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]338号《关于核准建信嘉薪宝货币市场基金募集的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信嘉薪宝货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 205,515,896.86 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 314 号予以验证。经向中国证监会备案,《建信嘉薪宝货币市场基金基金合同》于 2014 年 6 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 205,515,896.86 份基金份额,本基金募集期间有效认购参与款项未产生需要折算为基金份额的利息。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信嘉薪宝货币市场基金基金合同》的有关规定,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 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 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[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。

(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。

(4) 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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	5,002,683,951.83
定期存款	36,590,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	3,000,000,000.00
存款期限 1-3 个月	500,000,000.00
存款期限 3 个月以上	33,090,000,000.00
其他存款	-
合计	41,592,683,951.83

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	-	-	-	-
	银行间市场	23,679,875,195.98	23,681,982,000.00	2,106,804.02	0.0021
	合计	23,679,875,195.98	23,681,982,000.00	2,106,804.02	0.0021
资产支持证券	-	-	-	-	
合计	23,679,875,195.98	23,681,982,000.00	2,106,804.02	0.0021	

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 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	20,093,100,000.00	-
银行间市场	20,197,330,908.04	-
合计	40,290,430,908.04	-

##### 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 2021年6月30日
应收活期存款利息	4,076,511.21
应收定期存款利息	291,860,778.81
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	315,794.90
应收债券利息	3,071,161.65
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	31,498,993.81
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	-
合计	330,823,240.38

#### 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 2021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	227,307.80
合计	227,307.80

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	248,014.74
合计	248,014.74

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 建信嘉薪宝货币 A

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,419,415,938.22	24,419,415,938.22
本期申购	517,181,069,664.29	517,181,069,664.29
本期赎回（以“-”号填列）	-439,838,079,502.59	-439,838,079,502.59
-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	101,762,406,099.92	101,762,406,099.92

## 建信嘉薪宝货币 B

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,471,611.73	10,471,611.73
本期申购	10,143,031.07	10,143,031.07
本期赎回（以“-”号填列）	-10,609,442.02	-10,609,442.02
-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	10,005,200.78	10,005,200.78
-----	---------------	---------------

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

建信嘉薪宝货币 A

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	858,662,850.58	-	858,662,850.58
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	-858,662,850.58	-	-858,662,850.58
本期末	-	-	-

建信嘉薪宝货币 B

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	143,031.07	-	143,031.07
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	-143,031.07	-	-143,031.07
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	60,759,333.40
定期存款利息收入	432,203,412.55
其他存款利息收入	-

结算备付金利息收入	2,551,394.85
其他	-
合计	495,514,140.80

#### 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 2021年1月1日至2021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	12,115,467.68
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	12,115,467.68

##### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	21,374,084,268.78
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	21,330,681,486.75
减：应收利息总额	31,287,314.35
买卖债券差价收入	12,115,467.68

##### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	27,463.08
银行间账户维护费	17,500.00
其他	950.00
合计	164,927.82

## 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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

金”)	
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	基金托管人
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金管理人的股东
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

无。

##### 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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	53,478,782.74	14,153,657.03
其中：支付销售机构的客户维护费	26,776,104.67	9,917,640.07

注：支付基金管理人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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

### 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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	17,826,260.90	4,717,885.71

注：支付基金托管人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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

### 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名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信嘉薪宝货币 A	建信嘉薪宝货币 B	合计
建信基金	9,853.33	536.30	10,389.63
合计	9,853.33	536.30	10,389.63
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		



方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信嘉薪宝货币 A	建信嘉薪宝货币 B	合计
建信基金	2,602.15	2,438.07	5,040.22
合计	2,602.15	2,438.07	5,040.22

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。A 类基金份额和 B 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25% 和 0.01%。销售服务费的计算公式为：
$$\text{销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

#### 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

无。

#### 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自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

无。

#### 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行-活期	5,002,683,951.83	60,759,333.40	4,802,970,944.22	40,051,274.37
中信银行-定期	4,420,000,000.00	47,383,719.94	200,000,000.00	5,323,555.47

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/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

建信嘉薪宝货币 A				
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
858,662,850.58	-	-	858,662,850.58	-
建信嘉薪宝货币 B				
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
143,031.07	-	-	143,031.07	-

## 6.4.12 期末(2021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

无。

## 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 2021 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 1,228,728,905.63 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
112014172	20 江苏银 行 CD172	2021 年 7 月 1 日	99.88	5,845,000	583,795,879.60
112197824	21 南京银 行 CD093	2021 年 7 月 1 日	99.26	7,430,000	737,524,353.96
合计				13,275,000	1,321,320,233.56

#### 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内。

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	190,000,055.98
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	190,000,055.98

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

无。

## 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	23,218,031,524.63	6,726,383,526.91
合计	23,218,031,524.63	6,726,383,526.91

## 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	351,556,062.49	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	351,556,062.49	-

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

无。

#### 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 2021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	29,682,683,951.83	11,910,000,000.00	-	-	-	41,592,683,951.83
结算备付金	701,766,511.09	-	-	-	-	701,766,511.09
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	13,315,480,538.40	10,364,394,657.58	-	-	-	23,679,875,195.98
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	40,290,430,908.04	-	-	-	-	40,290,430,908.04
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	330,823,240.38	330,823,240.38
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	1,701,826.12	1,701,826.12
其他资产	-	-	-	-	-	-

资产总计	83,990,361,909.36	22,274,394,657.58	-	-	332,525,066.50	106,597,281,633.44
负债						
卖出回购金融资产款	1,228,728,905.63	-	-	-	-	1,228,728,905.63
短期借款	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	3,559,847,575.42	3,559,847,575.42
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	11,895,566.13	11,895,566.13
应付托管费	-	-	-	-	3,965,188.75	3,965,188.75
应付销售服务费	-	-	-	-	19,823,527.85	19,823,527.85
应付交易费用	-	-	-	-	227,307.80	227,307.80
应交税费	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	134,246.42	134,246.42
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	248,014.74	248,014.74
负债总计	1,228,728,905.63	-	-	-	3,596,141,427.11	4,824,870,332.74
利率敏感度缺口	82,761,633,003.73	22,274,394,657.58	-	-	-3,263,616,360.61	101,772,411,300.70
上年度末 2020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	7,032,065,385.26	900,000,000.00	-	-	-	7,932,065,385.26
结算备付金	14,802,857.14	-	-	-	-	14,802,857.14
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	6,810,694,618.63	1,323,057,182.92	-	-	-	8,133,751,801.55
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	8,814,187,961.21	-	-	-	-	8,814,187,961.21
应收证券清算款	-	-	-	-	637,808.23	637,808.23
应收利息	-	-	-	-	75,155,199.21	75,155,199.21
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	3,891,469.68	3,891,469.68

其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	22,671,750.82	2,223,057.18	-	-	79,684,477.12	24,974,492,482.28
负债						
卖出回购金融资产款	535,298,877.05	-	-	-	-	535,298,877.05
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	-	-	-	-	2,928,830.62	2,928,830.62
应付托管费	-	-	-	-	976,276.84	976,276.84
应付销售服务费	-	-	-	-	4,875,326.17	4,875,326.17
应付交易费用	-	-	-	-	131,120.93	131,120.93
应交税费	-	-	-	-	23,633.08	23,633.08
应付利息	-	-	-	-	121,867.64	121,867.64
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	249,000.00	249,000.00
负债总计	535,298,877.05	-	-	-	9,306,055.28	544,604,932.33
利率敏感度缺口	22,136,451.94	2,223,057.18	-	-	70,378,421.84	24,429,887,549.95

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 0.00 元，属于第二层次的余额为人民币 23,679,875,195.98 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元（于 2020 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 0.00 元，属于第二层次的余额为人民币 8,133,751,801.55 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元）。

###### 6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

###### 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	23,679,875,195.98	22.21
	其中：债券	23,679,875,195.98	22.21
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	40,290,430,908.04	37.80
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备 付金合计	42,294,450,462.92	39.68
4	其他各项资产	332,525,066.50	0.31
5	合计	106,597,281,633.44	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	1.21	
	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	1,228,728,905.63	1.21
	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	99
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	107
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	72

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

无。

#### 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	52.20	4.71
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	4.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	1.57	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	8.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	37.96	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	104.41	4.71

#### 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

无。

#### 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	央行票据	-	-
3	金融债券	461,843,671.35	0.45
	其中：政策性金融债	110,287,608.86	0.11
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	23,218,031,524.63	22.81
8	其他	-	-
9	合计	23,679,875,195.98	23.27
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

### 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排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	占基金资产净值比例（%）
1	112014221	20 江苏银行 CD221	13,000,000	1,284,665,618.59	1.26
2	112183576	21 郑州银行 CD173	12,000,000	1,174,206,260.41	1.15
3	112197824	21 南京银行 CD093	10,000,000	992,630,355.26	0.98
4	112117106	21 光大银行 CD106	10,000,000	974,713,688.91	0.96
5	112183664	21 徽商银行 CD091	8,000,000	783,025,524.55	0.77
6	112115127	21 民生银行 CD127	7,500,000	748,696,122.05	0.74
7	112121167	21 渤海银行 CD167	6,800,000	678,654,946.33	0.67
8	112191322	21 汉口银行 CD002	6,200,000	614,546,981.59	0.60
9	112199955	21 重庆银行 CD054	6,200,000	604,202,487.42	0.59
10	112014172	20 江苏银行 CD172	6,000,000	599,277,207.46	0.59

### 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	0.0537%
报告期内偏离度的最低值	-0.0392%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0109%

**报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明**

无。

**报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明**

无。

**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**

无。

**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，南京银行股份有限公司（601009）于 2021 年 3 月 11 日发布公告，公司于该日披露其 2020 年收到的各类处罚，其中因违规办理票据及信用证业务、员工行为管理不审慎等被中国银保监会派出机构根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项等的规定罚款 195 万元；因为未按规定对客户身份开展持续识别、未按规定对高风险客户采取强化识别措施等被中国人民银行派出机构罚款 676 万元；因存在办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查的行为等被国家外汇管理局地方分支机构依据《中华人民共和国外汇管理条例》第 47 条第 1 项规定罚款 55 万元。合计接受处罚约 926 万元。

**7.9.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-

3	应收利息	330,823,240.38
4	应收申购款	1,701,826.12
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	332,525,066.50

#### 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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比 例 (%)
建信嘉薪宝货币 A	9,075,731	11,212.59	43,641.93	-	101,762,362,457.99	100.00
建信嘉薪宝货币 B	1	10,005,200.78	10,005,200.78	100.00	-	-
合计	9,075,732	11,213.69	10,048,842.71	0.01	101,762,362,457.99	99.99

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

## 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	个人	60,064,885.72	0.06
2	个人	42,480,619.03	0.04
3	个人	22,813,678.51	0.02
4	个人	21,738,513.79	0.02
5	个人	21,719,410.46	0.02
6	个人	17,993,807.83	0.02
7	个人	13,016,465.00	0.01
8	个人	12,049,107.18	0.01
9	个人	11,131,975.32	0.01
10	个人	10,774,505.93	0.01

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	建信嘉薪宝货币 A	306,826.70	0.00
	建信嘉薪宝货币 B	0.00	0.00
	合计	306,826.70	0.00

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

## 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	建信嘉薪宝货币 A	0~10
	建信嘉薪宝货币 B	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	建信嘉薪宝货币 A	0~10
	建信嘉薪宝货币 B	-
	合计	0~10

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信嘉薪宝货币 A	建信嘉薪宝货币 B
基金合同生效日	205,515,896.86	-

(2014 年 6 月 17 日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	24,419,415,938.22	10,471,611.73
本报告期基金总申购份额	517,181,069,664.29	10,143,031.07
减：本报告期基金总赎回份额	439,838,079,502.59	10,609,442.02
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	101,762,406,099.92	10,005,200.78

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	
中金公司	2	-	-	-	-	-

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
中金公司	-	-	511,004,531,000.00	100.00%	-	-

## 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

## 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嘉薪宝货币市场基金设立的文件；
- 2、《建信嘉薪宝货币市场基金基金合同》；
- 3、《建信嘉薪宝货币市场基金招募说明书》；
- 4、《建信嘉薪宝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

2021 年 8 月 30 日