建信环保产业股票型证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:2018年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信环保产业股票
基金主代码	001166
交易代码	001166
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月22日
报告期末基金份额总额	3,321,138,468.79份
投资目标	本基金为股票型基金,在有效控制风险前提下,精选优质的为环境保护提供助力的上市公司,力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面:首先,依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例;而后,进行各大类资产中的个股、个券精选。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四部分组成。
业绩比较基准	中证环保产业指数收益率×80%+中债综合指数收益率(全价)×20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-110,973,988.52
2.本期利润	-118,697,087.52
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0353
4.期末基金资产净值	2,045,053,746.59
5.期末基金份额净值	0.616

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(不含公允价值变动损益)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损益。

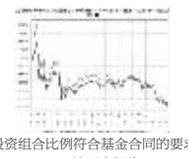
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.38%	1.10%	-9.04%	0.89%	3.66%	0.21%

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



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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姜锋	权益投资部执行投资官、本基金的基金经理	2015年4月22日	-	11	硕士,权益投资部执行投资官。2007年7月加入本公司,历任研究员、基金经理、资深基金经理、权益投资部执行投资官。2011年7月11日起任建信优势动力股票型证券投资基金的基金经理。该基金于2013年2月19日起转型为建信优势动力混合型证券投资基金(LOF),姜锋继续担任该基金的基金经理;2014年5月21日起任建信健康民生混合型证券投资基金的基金经理;2015年4月22日起任建信环保产业股票型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信环保产业股票型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年3季度国内外经济形势错综复杂。国际方面,贸易摩擦此起彼伏,美国先后开启与贸易伙伴新协议的谈判与签署,全球贸易格局步入重塑进程。中国政府也同美国开启了一系列的谈判,截止目前取得的共识相对有限。经济层面上,美国经济一枝独秀,持续强劲增长,尽管面临贸易摩擦影响但中国出口依然取得较快增长。国内方面,随着经济的缓慢下滑,政府也相继出台了各种政策措施进行对冲,提出了稳就业、稳金融、稳外贸、稳外资、稳投资、稳预期的总体应对方针。金融政策方面,配合资管新规的出台,央行连续下调了存款准备金率,为金融机构创造宽松的货币环境;财政政策方面,国务院调整企业社保缴费政策,提高个人所得税标准,研究进一步降低企业税费政策。考虑到上半年基建增速的回落,发改委开始批复和储备大型项目来对冲固定资产投资的下降。上市公司层面,中期业绩显示企业利润增速开始缓慢回落,结合宏观数据预期,预计业绩增速将呈现逐季回落态势。分行业来看,上游原材料行业业绩依然靓丽,三季度随着原油价格的持续上涨,预计相关公司经营也将受益。股票市场三季度呈现整体宽幅震荡格局,受益于油价上涨的石油行业领涨,大消费板块则大幅调整。

本基金基于合同约定,重点配置仍然是环保相关领域的龙头公司。通过对环保相关行业的对比研究,结合具体行业的业绩增速,估值水平和未来业绩预期,本基金在3季度坚持低仓位操作,减持了业绩较为一般的传统环保公司,增持了现金流较为稳定的水电公司;同时基于国内能源结构调整的趋势和天然气消费的持续高增长,基金在市场调整中对相关公司进行战略布局。由于基金整体对大消费板块配置比例较低,较好的回避了3季度相关行业大幅调整带来的损失,总体较好的控制了系统性风险但仍给净值带来的拖累。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-5.38%, 波动率1.1%, 业绩比较基准收益率-9.04%,波动率0.89%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,674,432,062.23	81.43
	其中:股票	1,674,432,062.23	81.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	17,070,607.40	0.83
	其中:债券	17,070,607.40	0.83
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	203,100,000.00	9.88
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	149,779,323.74	7.28
8	其他资产	11,879,836.90	0.58
9	合计	2,056,261,826.27	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	179,081,584.48	8.76
C	制造业	768,789,153.39	37.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	382,041,708.48	18.68
E	建筑业	50,650,317.69	2.48
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,858,602.85	2.49
J	金融业	34,906,806.00	1.71
K	房地产业	41,263,830.00	2.02
L	租赁和商务服务业	76,697,700.89	3.75
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	90,142,384.45	4.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,674,432,062.23	81.86

以上行业分类以2018年9月30日的证监会行业分类标准为依据。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600900	长江电力	9,183,246	150,421,569.48	7.36
2	000968	蓝焰控股	10,200,069	141,984,960.48	6.94
3	002202	金风科技	8,199,301	98,473,606.03	4.82
4	000651	格力电器	2,021,450	81,262,290.00	3.97
5	601877	正泰电器	3,614,337	80,970,324.48	3.96
6	600886	国投电力	8,477,182	68,104,757.76	3.18
7	300285	国瓷材料	3,462,382	63,284,305.26	3.09
8	600674	川投能源	6,948,802	58,230,960.76	2.85
9	601222	林洋能源	12,000,056	56,160,262.08	2.75
10	300070	碧水源	5,500,000	55,000,000.00	2.69

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	17,070,607.40	0.83
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	17,070,607.40	0.83

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113014	林洋转债	186,340	17,070,607.40	0.83

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未投资于国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	603,711.49
2	应收证券清算款	10,999,867.25
3	应收股利	-
4	应收利息	124,384.08
5	应收申购款	151,873.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,879,836.90

5.11.4 报告期未持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113014	林洋转债	17,070,607.40	0.83

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	3,396,342,268.26
报告期期间基金总申购份额	18,070,872.90
减:报告期期间基金总赎回份额	93,274,376.38
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	3,321,138,468.79

总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信环保产业股票型证券投资基金设立的文件;

2、《建信环保产业股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信环保产业股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信环保产业股票型证券投资基金托管协议》;

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。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3 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
2018年10月26日

建信现金添利货币市场基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:2018年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信现金添利货币
基金主代码	000693
交易代码	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
报告期末基金份额总额	270,754,191,256.73份
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。
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
下属分级基金的基金简称	建信现金添利货币A	建信现金添利货币B
下属分级基金的交易代码	000693	003164
报告期末下属分级基金的份额总额	211,912,676,073.64份	58,841,514,583.09份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日)	
	建信现金添利货币A	建信现金添利货币B
1.本期已实现收益	3,144,871,426.11	508,065,984.88
2. 本期利润	3,144,871,426.11	508,065,984.88
3. 期末基金资产净值	211,912,676,073.64	58,841,514,583.09

1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加入本期公允价值变动收益,由于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、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 本报告期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

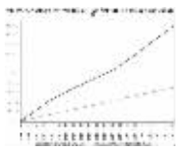
建信现金添利货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8927%	0.0005%	0.3403%	0.0000%	0.5524%	0.0005%

建信现金添利货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9283%	0.0005%	0.3403%	0.0000%	0.5880%	0.0005%

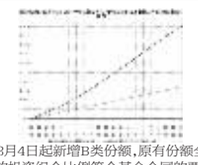
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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 基金经理(或基金经理小组)简介



姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2014年9月17日	-	11	陈建良先生,双学士,固定收益投资部副总经理。2006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;2014年6月17日起任建信嘉新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日起任建信日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日起任建信现金承兑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。
于婧钰	本基金的基金经理	2014年9月17日	-	10	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月加入金元盛世基金管理公司(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;2014年6月17日起任建信嘉新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日起任建信现金增利货币市场基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信现金添利货币市场基金基金合同》的规定。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年三季度,宏观经济运行整体保持平稳。PMI指数一直维持在景气区间内,但增速有所放缓,其中生产指数和新订单指数仍高于临界点,显示企业生产经营活动总体延续平稳态势但需求扩张步伐有所放慢。从需求端上看,尽管房地产投资仍然保持10.1%的较快名义增长,制造业投资增速较二季度进一步回升,但基建投资增速仅为4.2%,环比回落达3.1个百分点,使得三季度固定资产投资增速表现乏力。而消费保持平稳,社会消费品零售总额8月末累计增速为9.3%,服务类消费维持快速增长,消费市场转型升级态势延续。进出口方面,进出口企业面临未来关税的不确定性进一步加大,存在提前出口情况,使得三季度进出口形势暂时平稳,经贸摩擦对于进出口贸易影响在数据上尚未显现。整体而言,三季度经济生产需求虽然有所放缓但总体保持平稳,尽管基础设施建设投资仍有一定下行压力,但经济仍然保持高质量发展态势。

居民消费品价格同比持续回升,而工业品同比增速维持平稳。受天气因素和疫情影响,食品价格特别是猪肉和蔬菜价格上涨较多,使得8月份以来CPI同比涨幅较6月末进一步扩大。在需求放缓的背景下,1-8月PPI同比上涨4.0%,其中8月当月PPI当月同比增速4.1%较6月的4.7%有明显回落, 但国际原油价格上涨对工业品价格形成了一定支撑。

三季度,市场资金面整体维持在合理适度水平,9月下旬在美联储如期上调联邦基金利率之后,央行并没有跟随进行公开市场加息操作,体现出了较强的货币政策独立性。

债券市场方面,债券市场整体维持区间震荡态势,受经贸摩擦影响7月收益率小幅下行,但随后在政策向稳增长倾斜、通胀预期逐步加强以及地方债供给放量等因素影响下,8、9月债券收益率有所反弹。至9月末,10年期国债收益率较二季度末上行13BP到3.61%,而1年期收益率则下行19BP至2.97%附近,曲线整体陡峭化趋势明显。

期间,本基金进一步加强在短期利率下行趋势中对阶段性配置机会的把握,适当加大对具有相对价值优势的部分高等级信用品种的配置力度,并提高短期逆回购的持仓比例,力求在保持组合信用风险和流动性安全的基础上,取得更好的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率0.8927%,波动率为0.0005%,现金添利B净值收益率为0.9283%,波动率为0.0005%、业绩比较基准收益率为0.3403%,波动率为0.0000%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	153,142,602,174.41	38.70
	其中:债券	151,398,023,153.26	39.25
	资产支持证券	1,744,579,021.15	0.45
2	买入返售金融资产	94,771,692,649.64	24.57
	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	135,673,669,746.73	35.17
4	其他资产	2,177,362,284.36	0.56
5	合计	385,765,326,854.14	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	3.68
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	5,197,830,270.76	1.40
	其中:买断式回购融资	-	-

报告期内债券回购融资余额占基金净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期本投资组合平均剩余期限	92
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	97
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	77

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告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	29.27	3.86
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	14.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	26.75	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	2.44	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	30.16	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	103.45	3.86

5.4 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。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,547,035,897.20	5.54
	其中:政策性金融债	20,547,035,897.20	5.54
4	企业债券	7,742,375,149.72	2.09
5	企业短期融资券	17,165,018,104.03	4.63
6	中期票据	3,652,982,690.97	0.99
7	同业存单	102,090,241,460.57	27.54
8	其他	-	-
9	合计	151,398,023,153.26	40.84
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111806216	18交通银行CD216	50,000,000	4,920,086,122.46	1.33
2	111812113	18北京银行CD113	50,000,000	4,919,618,723.02	1.33
3	170413	17农发13	36,900,000	3,688,620,246.13	0.99
4	111807069	18招商银行CD069	33,000,000	3,227,072,012.64	0.87
5	111809160	18浦发银行CD160	30,000,000	2,985,819,068.40	0.81
6	111807054	18招商银行CD054	30,000,000	2,974,009,879.87	0.80
7	111807114	18招商银行CD114	30,000,000	2,961,652,475.63	0.80
8	180407	18农发07	29,500,000	2,948,529,906.75	0.80
9	111807060	18招商银行CD060	29,400,000	2,917,776,426.68	0.79
10	180201	18国开01	28,900,000	2,889,481,031.43	0.78

5.7 "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	0.2260%
报告期内偏离度的最低值	0.1061%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1460%

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%。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	149419	宁远03A3	3,760,000.00	376,000,000.00	0.19
2	149418	宁远03A2	2,940,000.00	294,000,000.00	0.08
3	149553	宁远04A1	2,450,000.00	245,000,000.00	0.07
4	149554	宁远04A2	2,140,000.00	214,000,000.00	0.06
5	156005	宁远06A1	1,000,000.00	100,000,000.00	0.03
5	149439	18如日A03	1,000,000.00	100,000,000.00	0.03
5	149231	18雁邦花苑B7	1,000,000.00	100,000,000.00	0.03
6	156006	宁远06A2	950,000.00	95,000,000.00	0.03
7	149731	宁远05A1	580,000.00	59,012,234.67	0.02
8	1889156	18鞍盈2A1_bc	600,000.00	45,000,000.00	0.01
9	1889169	18丽元2A1_bc	500,000.00	42,500,000.00	0.01
10	149732	宁远05A2	420,000.00	42,004,386.48	0.01

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

基金投资的前十名债券的发行主体本期未披露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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	21,214.96
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,669,680,333.44
4	应收申购款	500,000,000.00
5	其他应收款	7,660,735.97
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,177,362,284.36

5.9.4 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信现金添利货币A	建信现金添利货币B
报告期期初基金份额总额	323,721,480,951.94	46,300,095,819.75
报告期期间基金总申购份额	291,481,258,827.54	25,661,432,442.29
报告期期间基金总赎回份额	303,290,073,105.84	13,120,013,678.95
报告期期末基金份额总额	311,912,676,073.64	58,841,514,583.09

申购份额含红利再投和因份额升降级导致的强制调增份额,赎回份额含因份额升降级导致的强制调减份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3 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
2018年10月26日

建信现金增利货币市场基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:2018年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信现金增利货币
基金主代码	002758
交易代码	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
报告期末基金份额总额	77,677,025,016.38份
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,