建信瑞丰添利混合型证券投资基金

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:中国银行股份有限公司
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。

基金托管人中国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	建信瑞丰添利混合	
基金主代码	003319	
交易代码	003319	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年11月1日	
报告期末基金份额总额	37,368,591.38份	
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金通过灵活的资产配置,在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会,力求实现基金资产的持续稳定增值。	
投资策略	本基金在宏观经济分析基础上,结合政策面、市场资金面,积极把握市场发展趋势,根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况,对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整,以规避或分散市场风险,提高基金风险调整后的收益。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+中债综合全价(总值)指数收益率×60%。	
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中等收益/风险特征的基金。	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信瑞丰添利混合A	建信瑞丰添利混合C
下属分级基金的交易代码	003319	003320
报告期末下属分级基金的份额总额	31,589,893.64份	5,778,697.74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)	
	建信瑞丰添利混合A	建信瑞丰添利混合C
1. 本期已实现收益	-76,847.22	-18,349.22
2. 本期利润	-479,472.70	-90,176.28
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0147	-0.0154
4. 期末基金资产净值	32,636,765.77	5,937,879.82
5. 期末基金份额净值	1.0331	1.0275

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。

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

建信瑞丰添利混合A

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	-1.45%	0.39%	-0.34%	0.54%	-1.11%	-0.15%

建信瑞丰添利混合C

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	-1.51%	0.39%	-0.34%	0.54%	-1.17%	-0.15%

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		
朱建华	本基金的基金经理	2016年11月1日	-	10	硕士。曾任大连博达系统工程公司职员、中诚信国际信用评级公司项目组长,2007年10月起任中诚信证券评估有限公司公司评级部总经理助理,2008年8月起任国泰基金管理公司高级研究员。朱建华于2011年6月加入本公司,历任高级债券研究员、基金经理助理、基金经理。2012年8月28日至2015年8月11日任建信双周安心理财债券型证券投资基金的基金经理;2012年11月15日至2014年3月6日任建信纯债债券型证券投资基金的基金经理;2012年12月20日至2014年3月27日任建信月盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理;2013年5月14日起任建信安心回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理;2013年12月10日起任建信稳定添利债券型证券投资基金的基金经理;2016年3月14日起任建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2016年4月28日至2018年5月3日任建信安心保本六号混合型证券投资基金的基金经理,2016年6月1日任建信转债增强债券型证券投资基金的基金经理,2016年11月1日起任建信瑞丰添利混合型证券投资基金的基金经理;2018年4月20日起任建信稳定増利债券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《建信瑞丰添利混合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

三季度,国内宏观经济运行平稳,但潜在增速有进一步放缓的趋势。其中固定资产投资持续下滑,房地产投资名义增速虽保持较高水平但随着各地地产调控政策的持续发酵以及棚改货币化的逐步退出,地产的潜在需求正受到越来越多的挤压。相比而言,制造业增速出现一定回升,并保持连续五个月的加快增长。三季度,社会消费品零售总额增速维持平稳, 内需依然是拉动经济增长最重要的因素,消费市场整体呈现升级态势。进出口方面,虽然与美国的贸易摩擦加剧,但进出口形势并未受太大影响,同时国内也通过降低关税、扩大周边地区合作、产业升级、增加补贴等方式缓解贸易摩擦可能带来的不利影响。三季度,随着供给侧改革的深入,各行业经营业绩出现明显分化,钢铁、煤炭、建材、石化类企业利润大幅提升,行业集中度也进一步提高,相对而言下游制造业企业由于需求不足利润受到明显挤压,企业违约也比二季度有所增加。在金融去杠杆方面,如何化解地方隐性债务已成为目前和未来一段时期国内面临的最重要问题。从政府部门的表态看,国常会叫停了之前一刀切式的去杠杆方式转而采取了更灵活的形式,这在很大程度上避免了对实体经济的持续冲击,但去杠杆的整体基调和方向未发生改变,随着对隐性债务的认定逐步清晰以及债务的终身追责,地方上扩张式的基建模式正在逐步弱化,去杠杆将在未来很长时间内影响资产价格以及总需求的回升的速度。实体经济未来面临的挑战以及国内的应对举措将是未来一段时间市场关注的重点。

通胀方面,三季度居民消费价格持续回升,通胀有抬头的趋势,但总体依然处于平稳水平。通胀出现抬升的原因主要是由于虽然总需求下滑但供给侧改革导致工业品库存一直维持低位,大宗商品价格易涨难跌,同时国际原油价格的上涨也增加了输入性通胀的担忧。在此种情况下若出现对经济的过多刺激,则通胀不排除未来超预期可能,这也是值得下阶段重点关注的。货币政策方面,为配合去杠杆央行采取了中性偏宽松的政策,资金面整体平稳,在9月份美联储加息后央行没有跟随加息反而通过降准的方式进一步释放了流动性,中美货币政策已经明显处于不同阶段。此外三季度人民币汇率的适度贬值也有效对冲了贸易摩擦对出口的影响。

债券方面,债券市场整体维持震荡格局,票息收益贡献更明显。其中收益率相比二季度出现陡峭化下行,长端利率债下行幅度较小不足10bp,但短端受资金面预期的波动下行幅度更大,目前收益率曲线陡峭化。这种曲线也反应了市场配置资金不足,地方债供给放量增加了对国开债和国债的压制同时市场对于未来通胀抬升的担忧并未解除。三季度信用债违约更为频繁,中低等级债券息差继续走阔且流动性变差,高等级信用债息差则继续处于历史低位。转债方面,三季度前期受权益市场下跌的影响跌幅较大,但9月份随着股市反弹转债市场有所转暖,虽然破发转债依然很多,但也出现部分刚上市不久转债就下调转股价的情况,转债的防御性在三季度后半段得到市场的更多认可,部分大盘转债如石油石化、银行类转债表现更为突出。权益市场三季度受国内去杠杆以及贸易摩擦加剧的影响整体呈现单边下跌格局,其中创业板指数连续新低,相对而言以大盘蓝筹为代表的上证50指数表现更为突出,外资成为A股市场最大的买方,特别是随着MSCI指数权重的调整,三季度外资继续净流入A股市场。从大类资产配置上看,权益市场虽然目前整体赚钱效应不明显,但对市场的悲观预期反应也更充分,若拉长周期看权益资产的性价比正在逐步提升。

本季度,建信瑞丰添利因整体规模较小导致无法增持信用债,债券主要以利率债为主,单只债券占比较高,债券久期先升后降,目前整体久期比最高点已经大幅降低。权益方面在三季度后半段在市场下跌过程中本基金采取了逐步增加权益仓位。但是从效果看虽然加仓时点不算太早,但因结构上权益市场更多向大盘蓝筹股转移,因此部分个股随市场出现较大波动这也导致基金净值的波动明显加大。在接下来的操作中本基金将会继续保持对权益市场的相对乐观,虽然短期市场的波动在所难免,但已经有越来越多的个股随着股价下跌其性价比逐步提升,在这个位置更应该加强个股研究保持积极的态度应对。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期建信瑞丰添利A净值增长率-1.45%,波动率0.39%,建信瑞丰添利C净值增长率-1.51%,波动率0.39%;业绩比较基准收益率-0.34%,波动率0.54%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,自2018年7月1日至2018年9月30日,本基金基金资产净值低于五千万元超过连续20个工作日。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》(2014年8月8日生效)第四十一条的要求,现将该情况在本次报告中予以披露。

§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	11,752,988.00	29.96
	其中:股票	11,752,988.00	29.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	25,645,513.63	65.36
	其中:债券	25,645,513.63	65.36
	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	-	-
	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	990,334.44	2.52
8	其他资产	845,498.11	2.15
9	合计	39,234,334.18	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	-	-
C	制造业	7,501,326.00	19.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	1,053,342.00	2.73
J	金融业	2,380,720.00	6.17
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	817,600.00	2.12
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	11,752,988.00	30.47

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

本基金本报告期末未投资港股通股票。

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	300232	洲明科技	90,000	877,500.00	2.27
2	300012	华测检测	140,000	817,600.00	2.12
3	002038	双鹭药业	25,000	804,000.00	2.08
4	600309	万华化学	18,000	764,460.00	1.98
5	300003	乐普医疗	20,000	607,000.00	1.57
6	002007	华兰生物	15,000	568,500.00	1.47
7	603387	基蛋生物	10,400	453,336.00	1.18
8	300059	东方财富	40,000	450,000.00	1.17
9	002142	宁波银行	25,000	444,000.00	1.15
10	000001	平安银行	40,000	442,000.00	1.15

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	8,201,600.00	21.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	12,558,000.00	32.56
	其中:政策性金融债	12,558,000.00	32.56
4	企业债券	3,042,300.00	7.89
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	1,843,613.63	4.78
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,645,513.63	66.48

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	170206	17国开06	100,000	10,043,000.00	26.04
2	010107	21国债(7)	80,000	8,201,600.00	21.26
3	124610	14云铁投	30,000	3,042,300.00	7.89
4	018005	国开1701	25,000	2,515,000.00	6.52
5	123006	东财转债	14,997	1,729,004.13	4.48

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

本基金报告期内未投资于国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

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	13,747.29
2	应收证券清算款	438,975.58
3	应收股利	-
4	应收利息	390,599.78
5	应收申购款	2,175.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	845,498.11

5.11.4 报告期末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	123006	东财转债	1,729,004.13	4.48
2	113012	骆驼转债	77,435.80	0.20
3	132012	17巨化EB	36,038.00	0.09
4	128024	宁行转债	1,135.70	0.00

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

项目	建信瑞丰添利混合A	建信瑞丰添利混合C
报告期期初基金份额总额	33,393,834.64	6,101,535.72
报告期期间基金总申购份额	631,084.46	186,231.84
减:报告期期间基金总赎回份额	2,435,025.46	509,069.82
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	31,589,893.64	5,778,697.74

上述总申购份额含转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

§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

本基金本报告期末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瑞丰添利混合型证券投资基金设立的文件;
2、《建信瑞丰添利混合型证券投资基金基金合同》;
3、《建信瑞丰添利混合型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信瑞丰添利混合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

建信瑞福添利混合型证券投资基金

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:招商银行股份有限公司
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。

基金托管人招商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	建信瑞福添利混合	
基金主代码	004182	
交易代码	004182	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年5月25日	
报告期末基金份额总额	63,366,426.37份	
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金通过灵活的资产配置,在股票、债券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会,力求实现基金资产的持续稳定增值。	
投资策略	本基金在宏观经济分析基础上,结合政策面、市场资金面,积极把握市场发展趋势,根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况,对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整,以规避或分散市场风险,提高基金风险调整后的收益。	
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×30%+中债综合全价(总值)指数收益率×70%。	
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中等收益/风险特征的基金。	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信瑞福添利混合A	建信瑞福添利混合C
下属分级基金的交易代码	004182	004468
报告期末下属分级基金的份额总额	38,445,410.42份	24,921,015.95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)	
	建信瑞福添利混合A	建信瑞福添利混合C
1. 本期已实现收益	-1,202,992.58	-812,901.57
2. 本期利润	-281,768.57	-218,476.65
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0072	-0.0086
4. 期末基金资产净值	35,674,710.01	22,837,598.71
5. 期末基金份额净值	0.9279	0.9164

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。

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

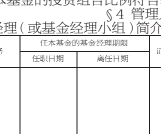
建信瑞福添利混合A

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	-0.78%	0.31%	-0.10%	0.40%	-0.68%	-0.09%

建信瑞福添利混合C

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	-0.92%	0.31%	-0.10%	0.40%	-0.82%	-0.09%

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		
李菁	固定收益投资部总经理、本基金的基金经理	2017年5月25日	-	12	李菁女士,固定收益投资部总经理,硕士。2002年7月进入中国建设银行股份有限公司基金托管部工作,从事基金托管业务,任主任科员。2005年9月进入建信基金管理有限责任公司,历任债券研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理、投资管理部副总监、固定收益投资部总监,2007年11月1日至2012年2月17日任建信货币市场基金的基金经理;2009年6月2日起任建信收益增强债券型证券投资基金的基金经理;2011年6月16日至2018年8月10日任建信信用增强债券型证券投资基金的基金经理;2016年2月4日起任建信安心保本五号混合型证券投资基金的基金经理,该基金于2018年2月6日起转型为建信弘利灵活配置混合型证券投资基金,李菁自2018年2月6日至2018年8月10日继续担任该基金的基金经理;2016年6月8日起任建信安心保本七号混合型证券投资基金的基金经理,该基金于2018年6月15日起转型为建信兴利灵活配置混合型证券投资基金,李菁继续担任该基金的基金经理;2016年11月16日起任建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理;2017年5月25日起任建信瑞福添利混合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,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《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信瑞福添利混合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

三季度在地产限购持续加码以及贸易摩擦不断升级的影响下,宏观经济呈现稳中趋降的态势。由于融资环境的改善,社融数据企稳回升,但固定资产投资增速持续下滑,说明资金向实体经济传导依然不畅,宏观经济筑底过程或将持续。通胀层面,受到南方天气因素以及非洲猪瘟的影响,食品价格大幅上涨,推动三季度CPI的持续上行至2.3%水平, 未来关注猪瘟疫情扩散情况以及原油价格冲高对通胀的影响。

政策层面,随着贸易战冲击的不断升级,维持国内政治经济形势的稳定成为政策着力点。三季度初,央行制定《关于进一步明确规范金融机构资产管理业务指导意见有关事项的通知》,同时中国银保监会起草了《商业银行理财业务监督管理办法(征求意见稿)》,这两个政策的发布明确了资管新规过渡期内金融机构资产管理的具体操作问题,较大程度地缓解了市场焦虑和紧张的情绪,因前期快速去杠杆过程中融资环境紧张而引发的信用极度萎缩的问题也得到了一定的缓解。在此影响下, 央行三季度整体实施较为宽松的货币政策, 并在9月底再次定向降准,引导资金价格稳定在较低的水平。国际方面,贸易战升级以及中东地缘摩擦加剧使得全球经济复苏受阻,仅美国经济持续强势,随着通胀的抬升美联储在9月份如期加息,人民币兑美元汇率一度突破6.9。

在此背景下,三季度债券收益率陡峭下行。短端收益率随着资金价格下行明显,其中1年期国开债收益率下行将近60bp,而长端10年期收益率仅下行5bp。权益市场方面,面对贸易战的不断升级,市场对宏观经济预期较为悲观,受此影响大盘指数呈现窄幅震荡态势,其中银行、石油石化以及钢铁等板块表现较好。

回顾三季度的基金管理工作,组合前期通过长久期利率债的波段操作,获取了一定的正收益。权益配置方面保持中性仓位,由于三季度权益市场整体表现低迷,对组合净值表现有所拖累。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期建信瑞福添利A净值增长率-0.78%,波动率0.31%,建信瑞福添利C净值增长率-0.92%,波动率0.31%;业绩比较基准收益率-0.1%,波动率0.4%。

§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	10,146,223.00	17.17
	其中:股票	10,146,223.00	17.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,758,683.60	68.96
	其中:债券	40,758,683.60	68.96
	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	5,000,000.00	8.46
	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	2,761,254.43	4.67
8	其他资产	438,030.26	0.74
9	合计	59,104,191.29	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	831,660.00	1.42
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,150,842.00	8.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	554,084.00	0.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	3,339,245.00	5.71
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	270,392.00	0.46
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	10,146,223.00	17.34

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

本基金本报告期末未投资港股通股票。

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	002142	宁波银行	72,800	1,292,928.00	2.21
2	601166	兴业银行	68,800	1,097,360.00	1.88
3	600409	三友化工	120,800	984,520.00	1.68
4	601818	光大银行	242,700	948,957.00	1.62
5	002714	牧原股份	33,400	831,660.00	1.42
6	002157	正邦科技	198,500	809,880.00	1.38
7	002311	海大集团	28,700	623,938.00	1.07
8	600585	海螺水泥	16,800	618,072.00	1.06
9	600031	三一重工	64,600	573,648.00	0.98
10	600690	青岛海尔	32,700	540,204.00	0.92

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	7,176,400.00	12.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,018,000.00	5.16
	其中:政策性金融债	3,018,000.00	5.16
4	企业债券	5,013,000.00	8.57
5	企业短期融资券	15,088,000.00	25.79
6	中期票据	5,040,500.00	8.61
7	可转债(可交换债)	5,422,783.60	9.27
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,758,683.60	69.66

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	010107	21国债(7)	70,000	7,176,400.00	12.26
2	011800528	18铜陵有色SCP001	50,000	5,043,500.00	8.62
3	041800234	18晋煤CP002	50,000	5,042,500.00	8.62
4	101800771	18中粮地产MTN002	50,000	5,040,500.00	8.61
5	143082	18陕燃01	50,000	5,013,000.00	8.57

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

本报告期本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

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	22,843.20
2	应收证券清算款	5,993.15
3	应收股利	-
4	应收利息	394,321.98
5	应收申购款	14,871.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	438,030.26

5.11.4 报告期末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	113011	光大转债	1,355,583.60	2.32

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

项目	建信瑞福添利混合A	建信瑞福添利混合C
报告期期初基金份额总额	39,945,977.36	26,051,584.82
报告期期间基金总申购份额	240,538.54	510,028.62
减:报告期期间基金总赎回份额	1,741,105.48	1,640,597.49
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	38,445,410.42	24,921,015.95

上述总申购份额含转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

§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

本基金本报告期末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瑞福添利混合型证券投资基金设立的文件;
2、《建信瑞福添利混合型证券投资基金基金合同》;
3、《建信瑞福添利混合型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信瑞福添利混合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

建信现金添益交易型货币市场基金

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:国泰君安证券股份有限公司
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。

基金托管人国泰君安证券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	建信现金添益	
基金主代码	003022	
交易代码	003022	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年9月2日	
报告期末基金份额总额	24,808,698,890.36份	
投资目标	在控制投资组合风险和保持流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金将采取资产配置策略、个券选择策略、利率策略、资产支持证券投资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	同期中国人民银行公布的七天通知存款利率(税前)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,基金的预期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	国泰君安证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信现金添益	建信添益
下属分级基金的场内简称	-	建信添益
下属分级基金的交易代码	003022	511660
报告期末下属分级基金的份额总额	24,559,550,488.91份	249,148,401.45份

本基金A级建信现金添益份额净值为1元,H级现金添益份额净值为100元。

§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)	
	建信现金添益	建信添益
1. 本期已实现收益	252,940,159.43	212,605,712.12
2. 本期利润	252,940,159.43	212,605,712.12
3. 期末基金资产净值	24,559,550,488.91	24,914,840,144.84

1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加入本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

3.2 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

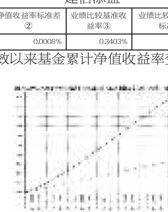
建信现金添益

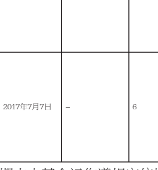
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9243%	0.0008%	0.3403%	0.0000%	0.5840%	0.0008%

建信添益

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	0.8634%	0.0008%	0.3403%	0.0000%	0.5231%	0.0008%

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	2016年9月2日	-	11	陈建良先生,双学士,固定收益投资部副总经理。2005年7月加入中国建设银行厦门分行,任客户经理;2007年6月调入中国建设银行总行金融市场部,任债券交易员;2013年9月加入我公司投资管理部,历任基金经理助理、基金经理、固定收益投资部总经理助理、副总经理,2013年12月10日起任建信货币市场基金的基金经理;2014年1月21日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理;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,陈建良继续担任该基金的基金经理;2016年7月26日起任建信现金增利货币市场基金的基金经理;2016年9月2日起任建信现金添益交易型货币市场基金的基金经理;2016年9月13日至2017年12月6日任建信瑞盛添利混合型证券投资基金的基金经理;2016年10月18日起任建信天添益货币市场基金的基金经理。
先轲宇	本基金的基金经理	2017年7月7日	-	6	硕士。2009年7月至2016年5月在中国建设银行总行金融市场部工作,曾从事绩效管理,2012年起任债券交易员。2016年7月加入我公司,历任固定收益投资部基金经理助理、基金经理,2017年7月7日起任建信现金增利货币市场基金和建信现金添益交易型货币市场基金的基金经理;2018年3月26日起任建信周盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理。

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《建信现金添益交易型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,本基金适当加大波段交易力度以增厚组合收益,并提高杠杆弹性和久期弹性,在确保季末时点流动性备付安全的前提下,努力维持组合收益的相对稳定,为投资者创造更好的持有回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期现金添益A基金净值增长率0.9243%,波动率0.0008%,现金添益B基金净值增长率0.8634%,波动率0.0008%;业绩比较基准收益率0.3403%,波动率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	24,278,841,396.51	46.79
	其中:债券	24,038,244,396.51	46.33
	资产支持证券	240,597,000.00	0.46
2	买入返售金融资产	10,773,796,817.87	20.76
	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	16,445,407,713.59	31.69
4	其他资产	389,888,257.25	0.75
5	合计	51,887,934,185.22	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		5.84
	其中:买断式回购融资		0.00
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	2,392,848,874.72	4.84
	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%。

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
报告期末投资组合平均剩余期限	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	103
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	85

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期末超过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	32.03	4.84
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	11.59	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	28.72	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	4.55	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	27.27	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	104.16	4.84

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	957,719,807.73	1.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,148,212,433.45	4.34
	其中:政策性金融债	2,148,212,433.45	4.34
4	企业债券	441,166,308.63	0.89
5	企业短期融资券	2,369,143,361.32	4.79
6	中期票据	481,730,194.87	0.97
7	同业存单	16,176,139,806.87	32.70
8	其他	1,464,132,483.64	2.96
9	合计	24,038,244,396.51	48.59
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	111892505	18宁波银行CD043	12,000,000	1,190,607,962.29	2.41
2	111804030	18中国银行CD030	10,000,000	997,979,317.93	2.02
3	111806182	18交通银行CD182	10,000,000	997,973,301.05	2.02
4	111811250	18平安银行CD250	10,000,000	995,261,447.71	2.01
5	111812113	18北京银行CD113	10,000,000	984,351,745.69	1.99
6	111814109	18江苏银行CD109	10,000,000	978,640,441.82	1.98
7	111786794	17杭州银行CD210	5,500,000	548,694,238.84	1.11
8	130891	16贵州06	5,000,000	497,590,912.53	1.01
9	140125	16湖南05	5,000,000	496,259,384.54	1.00
10	111897463	18重庆农村商行CD039	5,000,000	491,127,328.36	0.99

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	1
报告期内偏离度的最高值	0.2513%
报告期内偏离度的最低值	0.1195%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1536%

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	1889046	18交元1A	13,300,000.00	240,597,000.00	0.49

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。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	31,757.44
2	应收证券清算款	33,337,432.56
3	应收利息	239,117,897.57
4	应收申购款	117,386,045.42
5	其他应收款	-
6	待摊费用	15,124.26
7	其他	-
8	合计	389,888,257.25

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	建信现金添益	建信添益
报告期期初基金份额总额	23,071,607,224.54	181,355,635.69
报告期期间基金总申购份额	17,154,427,470.29	118,310,961.12
报告期期间基金总赎回份额	15,666,484,205.92	50,518,195.36
报告期期末基金份额总额	24,559,550,488.91	249,148,401.45

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期末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益交易型货币市场基金设立的文件;
2、《建信现金添益交易型货币市场基金基金合同》;
3、《建信现金添益交易型货币市场基金招募说明书》;
4、《建信现金添益交易型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