建信现金添益交易型货币市场基金 2018年年度报告摘要

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
送出日期:2019年3月26日

§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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月22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。

本报告中的财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信现金添益	
场内简称	现金添益	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	25,317,800,332.50份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2016年9月22日	
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	25,128,563,576.64份	189,236,755.86份

本基金A级建信现金添益份额面值为1元,H级现金添益份额面值为100元。

2.2 基金产品说明

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。

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	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴晖明	王健
	联系电话	010-66228888	021-38676252
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	wangj222@gtjas.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95521
传真		010-66228001	021-38677819

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018年		2017年		2016年9月2日(基金合同生效日)-2016年12月31日	
	建信现金添益	建信添益	建信现金添益	建信添益	建信现金添益	建信添益
本期已实现收益	875,404,994.40	810,141,105.30	384,671,350.61	524,536,324.58	4,197,076.64	26,343,587.05
本期利润	875,404,994.40	810,141,105.30	384,671,350.61	524,536,324.58	4,197,076.64	26,343,587.05
本期净值收益率	3.9541%	3.7047%	4.1690%	3.9194%	0.9135%	0.8327%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末基金资产净值	25,128,563,576.64	18,923,675,585.61	18,920,575,557.97	16,193,021,205.33	2,673,043,799.54	5,436,455,273.18
期末基金份额净值	1.0000	100.00	1.0000	100.00	1.0000	100.00

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 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

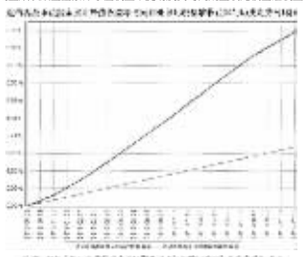
建信现金添益

阶段	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
过去三个月	0.7999%	0.0003%	0.3403%	0.0000%	0.4596%	0.0003%
过去六个月	1.7315%	0.0009%	0.6805%	0.0000%	1.0510%	0.0009%
过去一年	3.9541%	0.0015%	1.3500%	0.0000%	2.6041%	0.0015%
自基金合同生效起至今	9.2772%	0.0017%	3.1475%	0.0000%	6.1297%	0.0017%

建信添益

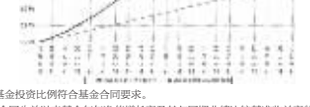
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7386%	0.0003%	0.3403%	0.0000%	0.3983%	0.0003%
过去六个月	1.6084%	0.0009%	0.6805%	0.0000%	0.9279%	0.0009%
过去一年	3.7047%	0.0015%	1.3500%	0.0000%	2.3547%	0.0015%
自基金合同生效起至今	8.6667%	0.0017%	3.1475%	0.0000%	5.5192%	0.0017%

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



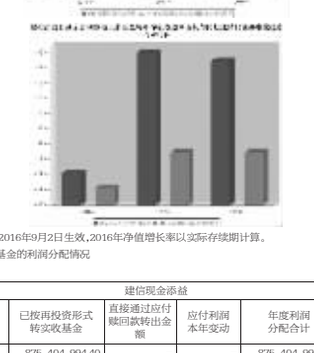
本报告期,本基金投资比例符合基金合同要求。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



本报告期,本基金投资比例符合基金合同要求。

3.2.4 自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的比较



本基金合同自2016年9月2日生效,2016年净值增长率以实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

建信现金添益					
年度	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	年度利润分配合计	备注
2018	875,404,994.40	-	-	875,404,994.40	
2017	384,671,350.61	-	-	384,671,350.61	
2016	4,197,076.64	-	-	4,197,076.64	
合计	1,264,273,421.65	-	-	1,264,273,421.65	

单位:人民币元

建信添益					
年度	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	年度利润分配合计	备注
2018	810,141,105.30	-	-	810,141,105.30	
2017	524,536,324.58	-	-	524,536,324.58	
2016	26,343,587.05	-	-	26,343,587.05	
合计	1,361,021,016.93	-	-	1,361,021,016.93	

§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、海外投资部、资产配置及量化投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、财务管理部、信息技术部、风险管理部和内控合规部,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、南京五个营销中心,并在上海设立了子公司--建信资本管理有限责任公司。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2018年12月31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、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信裕利灵活配置混合型证券投资基金、建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信睿怡纯债债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信汇利灵活配置混合型证券投资基金、建信兴利灵活配置混合型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、建信天添益货币市场基金、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中国制造2025股票型证券投资基金、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信瑞福添利混合型证券投资基金、建信高端医疗股票型证券投资基金、建信中证政策性金融债1-3年指数证券投资基金(LOF)基金、建信中证政策性金融债8-10年指数证券投资基金(LOF)基金、建信建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信福祥安泰混合型基金中基金(FOF)、建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金、建信上证50交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金、建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金、建信龙头企业股票型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金、建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金,共计104只开放式基金,管理的基金净资产规模共计为6331.39亿元。

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		
先柯宇	本基金的基金经理	2017年7月7日	-	6	先柯宇先生,硕士。2009年7月至2016年5月在中国建设银行企融市场部工作,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日起任建信现金添益交易型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。
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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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 公平交易制度和控制方法

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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》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 公平交易制度的执行情况

根据《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》,本基金管理人对过去四个季度不同时间窗口下(日内、3日内、5日内)管理的不同投资组合(包括封闭式基金、开放式基金、资产管理计划等)同向交易的交易价差从T检验(置信度为95%)、平均溢价率、贡献率、正溢价率占优频率等几个方面进行了专项分析。经分析,本报告期内未出现公司管理的不同投资组合间有同向交易价差异常的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有3次,原因是投资组合投资策略需要,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年,中国宏观经济增长总体平稳,增速略有下滑。全年GDP同比增长6.6%,增速较2017年回落了0.2个百分点。受汽车类商品消费增速放缓影响,社会消费品零售总额全年实际增速为6.9%,较上年有所回落,但总体上仍保持较快增长,消费升级持续推进。全年固定资产投资增速下滑至5.9%,其中制造业投资增速较上年提高4.7个百分点至9.5%,成为拉动投资增长的重要引擎。受中美贸易摩擦和国际形势变化的影响,全年对外贸易顺差明显收窄,净出口对于经济贡献由正转负。总体看,在2018年国内外复杂多变的形势下,全年经济运行仍然保持着平稳发展态势。

全年物价总体稳定。消费者价格指数(CPI)月度同比走势虽有波动,各月同比涨幅呈不对称的“M”型走势,但总体温和上涨。工业品价格指数(PPI)受翘尾因素影响,年初同比涨幅较高,尤其5月份后受国际原油价格大幅度上涨等因素推动涨幅有所扩大,下半年随着翘尾因素逐月减少加之国际原油价格出现下跌,PPI同比走势快速回落,全年同比走势呈前高后低走势。

全年货币政策维持稳健基调,央行灵活采取了一系列逆周期调节措施,保持流动性合理充裕,资金面整体维持宽松态势。央行分别在1、4、7和10月份四次下调存款准备金率,并在二季度以后不再跟随美联储加息进行公开市场利率上调操作,体现了较强的货币政策独立性。此外,央行在年中动态调整了MPA政策参数,扩大金融机构广义信贷增长空间,4月份出台《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》并在7月下发补充意见,宏观审慎监管体系得到进一步完善。

债券市场方面,2018年债券市场收益率总体下移并呈现陡峭化态势。在经历一季度的先抑后扬后,二季度在定向降准政策刺激下,到期收益率开始快速下行,尤其6月份后,随着贸易摩擦进一步升级引发避险情绪,叠加央行暂停加息和再次定向降准,市场做多情绪进一步发酵。全年在相对宽松的流动性环境中,10年期国债和国开债益率未来收于3.23%和3.64%,较去年未分别下行65BP和118BP,1年期国债和国开债分别收于2.60%和2.75%,全年下分别下行119BP和193BP,曲线整体陡峭化下移。

在报告期内,本基金将信用风险和流动性风险防范作为重点内容,在提高准入标准的基础上,在短期利率的相对高点加大对高等级信用债、同业存单及利率债的配置力度,提高优质流动性资产的配置比例,着力优化组合流动性,提升组合骨付能力,确保了组合的安全运作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期现金添益A基金净值收益率3.9541%,波动率0.0015%,现金添益H基金净值收益率3.7047%,波动率0.0015%;业绩比较基准收益率1.3500%,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2019年,政策调控下房地产投资增速或将有所回落,工业品价格下行则会制约制造业投资,外需收缩对净出口的影响恐较2018年进一步显现,在消费缺乏明显增长空间的情况下,预计全年GDP同比增速将小幅回落至6%至6.5%左右,基本面仍然存在一定压力。预计财政政策和货币政策会配合发力以托底经济,但在基数和猪肉价格波动的影响下,下半年或存在一定的通胀压力,料将加大债券市场的波动。

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、风险管理部和资产核算部门负责人组成,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A类基金份额根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,且每日进行支付,支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式。本基金H类基金份额根据每日基金收益情况,以每百份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,计入投资人收益账户,投资人收益账户里的累计未付收益和其持有的基金份额一起参加当日的收益分配。本报告期内基金应分配利润为1,685,546,099.7元,其中A类份额应分配利润为875,404,994.4元,H类份额应分配收益为810,141,105.3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

本报告期内,国泰君安证券股份有限公司(以下称“本托管人”)在建信现金添益交易型货币市场基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《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有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人根据《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,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况(如有)、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了后附的建信现金添益交易型货币市场基金(以下简称“建信现金添益交易型货币市场基金”)的财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注,并出具了普华永道中天审字(2019)第22642号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:建信现金添益交易型货币市场基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款		16,178,687,743.78	18,803,722,107.30
结算备付金		157,807,454.99	247,518,234.72
存出保证金		32,379.10	190.52
交易性金融资产		24,300,479,352.84	12,300,683,236.69
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		24,077,711,352.84	12,300,683,236.69
资产支持证券投资		222,768,000.00	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		5,849,189,826.40	6,104,120,351.19
应收证券清算款		300,801,164.41	515,541,000.00
应收利息		213,250,010.81	210,503,045.53
应收股利		-	-
应收申购款		92,493,237.53	275,863,136.32
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		47,092,741,169.86	38,457,951,302.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		3,018,497,152.60	3,327,078,788.11
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,270,580.22	7,764,808.71
应付托管费		3,286,585.68	2,484,738.79
应付销售服务费		5,223,149.35	4,210,331.75
应付交易费用		116,486.83	133,305.89
应交税费		339,704.30	-
应付利息		2,258,958.67	2,106,104.73
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		509,389.96	576,460.99
负债合计		3,040,502,007.61	3,344,354,538.97
所有者权益:			
实收基金		44,052,239,162.25	35,113,596,763.30
未分配利润		-	-
所有者权益合计		44,052,239,162.25	35,113,596,763.30
负债和所有者权益总计		47,092,741,169.86	38,457,951,302.27

报告截止日2018年12月31日,基金份额总额25,317,800,332.50份,其中建信现金添益交易型货币市场基金A类基金份额净值1.0000元,基金份额总额25,128,563,576.64份;建信现金添益交易型货币市场基金H类基金份额净值100.00元,基金份额总额189,236,755.86份。

7.2 利润表

会计主体:建信现金添益交易型货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入		1,945,361,356.63	1,067,402,755.80
1.利息收入		1,948,988,108.88	1,065,075,022.14
其中:存款利息收入		873,903,553.21	571,919,231.34
债券利息收入		832,631,398.87	356,694,812.07
资产支持证券利息收入		18,982,169.24	-
买入返售金融资产收入		223,470,987.56	136,460,978.73
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-3,626,752.25	2,197,733.66
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-3,626,752.25	2,197,733.66
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”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)		-	130,000.00
减:二、费用		259,815,256.93	158,195,080.61
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	113,934,729.56	55,924,379.22
2. 托管费	7.4.8.2.2	36,459,113.58	17,895,801.22
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	58,963,753.70	34,178,923.13
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		49,549,877.04	49,628,127.11
其中:卖出回购金融资产支出		49,549,877.04	49,628,127.11
6. 税金及附加		295,865.96	-
7. 其他费用		611,917.09	567,849.93
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,685,546,099.70	909,207,675.19
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,685,546,099.70	909,207,675.19

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信现金添益交易型货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31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)	35,113,596,763.30	-	35,113,596,763.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,685,546,099.70	1,685,546,099.70
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)	8,938,642,398.95	-	8,938,642,398.95
其中:1.基金申购款	98,827,261,752.70	-	98,827,261,752.70
2.基金赎回款	-89,888,619,353.75	-	-89,888,619,353.75
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-1,685,546,099.70	-1,685,546,099.70
五、期末所有者权益(基金净值)	44,052,239,162.25	-	44,052,239,162.25
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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)	8,109,499,072.72	-	8,109,499,072.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	909,207,675.19	909,207,675.19
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)	27,004,097,690.58	-	27,004,097,690.58
其中:1.基金申购款	103,179,588,144.24	-	103,179,588,144.24
2.基金赎回款	-76,175,490,453.66	-	-76,175,490,453.66
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)	-	-909,207,675.19	-909,207,675.19
五、期末所有者权益(基金净值)	35,113,596,763.30	-	35,113,596,763.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

张军红 吴晖明 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信现金添益交易型货币市场基金(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[2016]1446号《关于准予建信现金添益交易型货币市场基金注册的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信现金添益交易型货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币4,050,804,687.99元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1124号予以验证。经向中国证监会备案,《建信现金添益交易型货币市场基金基金合同》于2016年9月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,050,804,765.32份基金份额,其中认购资金利息折合40,077.33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,基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

根据《建信现金添益交易型货币市场基金基金合同》和《建信现金添益交易型货币市场基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金份额包括建信现金添益货币基金之A类份额(以下简称“建信现金添益A份额”),建信现金添益货币基金之H类份额(以下简称“建信添益H份额”)。建信现金添益份额只接受场外与场内申购和赎回,建信现金添益A份额不上市交易;建信添益H份额只上市交易。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或每百份基金已实现收益和七日年化收益率。投资人可自由选择认购、申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

建信添益H份额的基金份额折算日为基金合同生效当日,折算前建信添益H份额总额为3,780,763,000.00份,折算前基金份额净值为1.0000元。根据基金合同中约定的基金份额折算方法,本基金折算后的建信添益H份额总额为37,807,630.00份,折算后基金份额净值为100.00元。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证自律监管决定书[2016]232号审核同意,本基金H类份额37,807,630.00份于2016年9月21日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信现金添益交易型货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金;期限在1年以内(含1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、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;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。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:同期中国人民银行公布的七天通知存款利率(税前)。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于2019年3月21日批准报出。

7.4.2 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以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信现金添益交易型货币市场基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编