建信现金添利货币市场基金2019年

2019年第一季度报告

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:2019年4月19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2019年4月17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2019年1月1日起至3月31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	
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	300,508,924,696.67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	223,925,697,698.80份	76,583,226,997.87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(2019年1月1日 - 2019年3月31日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31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	1,934,515,481.59	539,967,995.68
2.本期利润	1,934,515,481.59	539,967,995.68
3.期末基金资产净值	223,925,697,698.80	76,583,226,997.87

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

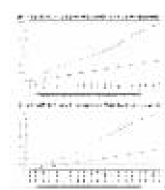
建信现金添利货币A

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	0.7488%	0.0006%	0.3329%	0.0000%	0.4159%	0.0006%

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	0.7836%	0.0006%	0.3329%	0.0000%	0.4507%	0.0006%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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



注:本报告期,本基金投资组合比例符合基金合同要求。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
于倩倩	本基金的基金经理	2014年9月17日	–	10年	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;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。
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年	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》、《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 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1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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年一季度,宏观经济运行总体平稳,一些向好趋势开始显现。随着春节后企业集中复产,制造业生产活动开始加快。制造业采购经理指数(PMI)在3月份录得50.5%,环比上升1.3个百分点,结束了连续三个月枯荣线之下的走势。从需求端看,尽管制造业投资增速有所回落,但基建投资增速反弹,房地产投资名义增长11.6%,仍然维持较高增速水平,推动固定资产投资增速实现小幅反弹,前两月累计增速达6.1%,较去年末回升0.2个百分点。消费增速继续保持平稳,结构升级趋势较为明显,剔除春节因素之后进出口总额增速为10.2%。从生产端上看,前两月全国规模以上工业增加值累计同比实际增长5.3%,增速较去年12月份小幅回落0.4个百分点,其中消费品制造业保持较快增速。总体看,一季度生产需求总体保持平稳,呈现出稳中有进的态势,但是受到外部环境等不确定性因素影响,宏观经济运行仍然面临一定下行压力。

一季度居民消费价格温和上涨,而工业品价格涨幅回落。前两月CPI累计同比上涨1.6%,较12月份回落0.3个百分点,其中受猪瘟影响导致的产能去化,猪肉价格在一季度涨幅明显,整体通胀预期有所抬升。前两月PPI同比上涨仅0.1%,较12月份回落0.8个百分点,但需要注意的是,受国际因素影响,原油价格增速从2月份开始环比由降转升。

美联储在3月份暂停了加息,人民银行公开市场操作保持定力,于1月份下调金融机构存款准备金率1个百分点后,一季度到期的中期借贷便利(MLF)不再续做,净释放长期资金约8000亿元,维持资金面的合理适度,除临近季末时点出现阶段性紧张,资金面整体保持平稳水平。

债券市场方面,受社融增速企稳回升、贸易摩擦阶段性缓和以及权益市场止跌反弹等因素影响,债券收益率长端震荡加剧,短端则在相对宽松的流动性环境中小幅下行。1年国开债收益率相比于去年末2.75%的位置下行20bp到2.55%,而1年国债收益率则由2.60%下行17bp到2.43%。

报告期内,本基金在整体利率水平处于低位的情况下,将流动性风险管理放在突出位置,控制组合剩余期限和杠杆水平,加大对短期回购的配置力度,保障了组合的备付能力。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期现金添利A净值增长率0.7488%,波动率0.0006%,现金添利B净值增长率0.7836%,波动率0.0006%,业绩比较基准收益率0.3329%,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	119,308,819,146.40	38.19
	其中:债券	118,821,815,275.56	38.03
	资产支持证券	487,003,870.84	0.16
2	买入返售金融资产	49,172,394,993.89	15.74
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	142,242,190,553.42	45.53
4	其他资产	1,707,608,386.53	0.55
5	合计	312,431,013,080.24	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	4.02
	其中:买断式回购融资	0.00

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	6,156,883,631.15	2.05
	其中:买断式回购融资	–	0.00

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。

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	82
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	102
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	71

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

无。

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	29.75	3.91
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天(含)—60天	9.98	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60天(含)—90天	40.09	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90天(含)—120天	5.97	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
5	120天(含)—397天(含)	17.61	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
	合计	103.40	3.91

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

无。

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	4,692,512,275.97	1.56
2	央行票据	–	0.00
3	金融债券	12,014,549,078.93	4.00
	其中:政策性金融债	12,014,549,078.93	4.00
4	企业债券	160,886,846.78	0.05
5	企业短期融资券	12,025,961,744.01	4.00
6	中期票据	3,136,549,613.61	1.04
7	同业存单	79,679,579,732.98	26.51
8	其他	7,111,775,983.28	2.37
9	合计	118,821,815,275.56	39.54
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	0.00

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	180407	18农发07	42,700,000	4,271,260,816.10	1.42
2	111807082	18招商银行CD082	25,000,000	2,497,512,200.83	0.83
3	111889111	18盛京银行CD493	25,000,000	2,489,564,427.61	0.83
4	111807116	18招商银行CD116	25,000,000	2,486,954,737.96	0.83
5	180410	18农发10	24,800,000	2,478,258,808.36	0.82
6	120010	12附息国债10	23,000,000	2,302,907,456.10	0.77
7	111803154	18农业银行CD154	20,000,000	1,985,358,440.19	0.66
8	111885006	18徽商银行CD130	20,000,000	1,984,982,927.60	0.66
9	111803166	18农业银行CD166	20,000,000	1,983,151,291.93	0.66
10	111808251	18中信银行CD251	20,000,000	1,979,193,155.51	0.66

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	–
报告期内偏离度的最高值	0.1414%
报告期内偏离度的最低值	0.0800%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1158%

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。

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	149554	宁远04A2	2,140,000	214,000,000.00	0.07
2	149281	花呗57A1	1,000,000	100,000,000.00	0.03
3	156006	宁远06A2	950,000	95,000,000.00	0.03
4	149732	宁远05A2	420,000	42,003,870.84	0.01
5	1889169	18福元2A1_bc	500,000	17,000,000.00	0.01
6	1889156	18唯盈2A1_bc	600,000	15,000,000.00	0.01
7	149439	1如日A03	1,000,000	4,000,000.00	0.00

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

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

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	–
2	应收证券清算款	133,338,044.93
3	应收利息	1,566,609,605.63
4	应收申购款	–
5	其他应收款	7,660,735.97
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	1,707,608,386.53

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	274,726,094,752.39	58,955,570,790.06
报告期期间基金总申购份额	173,042,780,192.62	31,240,886,676.74
报告期期间基金总赎回份额	223,843,177,246.21	13,613,230,468.93
报告期期末基金份额总额	223,925,697,698.80	76,583,226,997.87

注: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

无。

§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
2019年4月19日

建信现金添益交易型货币市场基金2019年

2019年第一季度报告

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:2019年4月19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2019年4月17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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

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	
报告期末基金份额总额	27,957,038,249.84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	27,804,612,660.51份	152,425,589.33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(2019年1月1日 - 2019年3月31日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31日)
	建信现金添益	建信添益
1.本期已实现收益	205,411,121.38	137,345,858.54
2.本期利润	205,411,121.38	137,345,858.54
3.期末基金资产净值	27,804,612,660.51	15,242,558,932.62

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

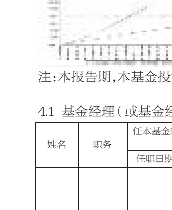
建信现金添益

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	0.7782%	0.0006%	0.3329%	0.0000%	0.4453%	0.0006%

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	②③	②-④
过去三个月	0.7183%	0.0006%	0.3329%	0.0000%	0.3854%	0.0006%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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



注:本报告期,本基金投资组合比例符合基金合同要求。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
先轲宇	本基金的基金经理	2017年7月7日	–	6年	先轲宇先生,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,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。
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年	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》、《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 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1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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年一季度,宏观经济运行总体平稳,一些向好趋势开始显现。随着春节后企业集中复产,制造业生产活动开始加快。制造业采购经理指数(PMI)在3月份录得50.5%,环比上升1.3个百分点,结束了连续三个月枯荣线之下的走势。从需求端看,尽管制造业投资增速有所回落,但基建投资增速反弹,房地产投资名义增长11.6%,仍然维持较高增速水平,推动固定资产投资增速实现小幅反弹,前两月累计增速达6.1%,较去年末回升0.2个百分点。消费增速继续保持平稳,结构升级趋势较为明显,剔除春节因素之后进出口总额增速为10.2%。从生产端上看,前两月全国规模以上工业增加值累计同比实际增长5.3%,增速较去年12月份小幅回落0.4个百分点,其中消费品制造业保持较快增速。总体看,一季度生产需求总体保持平稳,呈现出稳中有进的态势,但是受到外部环境等不确定性因素影响,宏观经济运行仍然面临一定下行压力。

一季度居民消费价格温和上涨,而工业品价格涨幅回落。前两月CPI累计同比上涨1.6%,较12月份回落0.3个百分点,其中受猪瘟影响导致的产能去化,猪肉价格在一季度涨幅明显,整体通胀预期有所抬升。前两月PPI同比上涨仅0.1%,较12月份回落0.8个百分点,但需要注意的是,受国际因素影响,原油价格增速从2月份开始环比由降转升。

美联储在3月份暂停了加息,人民银行公开市场操作保持定力,于1月份下调金融机构存款准备金率1个百分点后,一季度到期的中期借贷便利(MLF)不再续做,净释放长期资金约8000亿元,维持资金面的合理适度,除临近季末时点出现阶段性紧张,资金面整体保持平稳水平。

债券市场方面,受社融增速企稳回升、贸易摩擦阶段性缓和以及权益市场止跌反弹等因素影响,债券收益率长端震荡加剧,短端则在相对宽松的流动性环境中小幅下行。1年国开债收益率相比于去年末2.75%的位置下行20bp到2.55%,而1年国债收益率则由2.60%下行17bp到2.43%。

报告期内,本基金着力控制组合杠杆水平和剩余期限,适当加大对高评级同业存单及银行存款的配置力度,提高组合流动性资产占比,力求在满足投资者流动性管理需求的同时,提供良好的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期现金添益A净值增长率0.7782%,波动率0.0006%,现金添益B净值增长率0.7183%,波动率0.0006%,业绩比较基准收益率0.3329%,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	24,404,626,848.43	55.01
	其中:债券	24,354,626,848.43	54.90
	资产支持证券	50,000,000.00	0.11
2	买入返售金融资产	6,148,997,341.74	13.86
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	13,180,190,578.08	29.71
4	其他资产	631,206,298.84	1.42
5	合计	44,365,021,067.09	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	3.38
	其中:买断式回购融资	0.00

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,299,999,300.00	3.02
	其中:买断式回购融资	–	0.00

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

无。

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	81
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	105
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	70

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

无。

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	31.67	3.02
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天(含)—60天	12.88	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60天(含)—90天	30.52	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90天(含)—120天	6.20	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
5	120天(含)—397天(含)	21.03	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
	合计	102.29	3.02

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

无。

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	679,968,122.79	1.58
2	央行票据	–	–
3	金融债券	2,029,858,939.19	4.72
	其中:政策性金融债	2,029,858,939.19	4.72
4	企业债券	1,438,913,814.36	3.34
5	企业短期融资券	2,529,253,142.10	5.88
6	中期票据	449,924,718.11	1.05
7	同业存单	17,226,708,111.88	40.02
8	其他	–	–
9	合计	24,354,626,848.43	56.58
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	111808283	18中信银行CD283	15,000,000	1,480,735,668.88	3.44
2	111915096	19民生银行CD096	10,000,000	993,840,937.73	2.31
3	111807188	18招商银行CD188	10,000,000	989,775,563.28	2.30
4	180407	18农发07	9,000,000	900,555,843.39	2.09
5	111994025	19天津银行CD026	6,000,000	596,149,410.25	1.38
6	111994042	19盛京银行CD134	6,000,000	596,136,192.16	1.38
7	111806238	18交通银行CD238	6,000,000	593,281,495.80	1.38
8	130891	16贵州05	5,000,000	499,910,000.78	1.16
9	111812090	18北京银行CD090	5,000,000	499,493,474.68	1.16
10	111895164	18富滇银行CD133	5,000,000	499,344,898.90	1.16

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	0.1717%
报告期内偏离度的最低值	0.0892%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1348%

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。

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	156289	宁远07A2	500,000	50,000,000.00	0.12

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

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	–
2	应收证券清算款	300,000,000.00
3	应收利息	224,609,042.69
4	应收申购款	106,597,256.15
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	631,206,298.84

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	25,128,563,576.64	189,236,755.86
报告期期间基金总申购份额	15,415,134,157.59	56,548,998.59
报告期期间基金总赎回份额	12,739,085,073.72	93,360,165.12
报告期期末基金份额总额	27,804,612,660.51	152,425,589.33

注: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交易明细

无。

§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
2019年4月19日

建信现金增利货币市场基金2019年

2019年第一季度报告

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:2019年4月19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2019年4月17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2019年1月1日起至3月31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
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	97,759,805,021.10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,力争实现稳定的、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

§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(2019年1月1日 - 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	727,596,965.54
2.本期利润	727,596,965.54
3.期末基金资产净值	97,759,805,021.10

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。

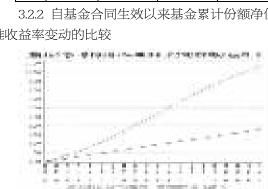
2、持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

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

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	0.7648%	0.0005%	0.3329%	0.0000%	0.4319%	0.0005%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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



注:本报告期,本基金投资组合比例符合基金合同要求。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
先轲宇	本基金的基金经理	2017年7月7日	–	6年	先轲宇先生,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,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。
陈建良	固定收益投资部副总经理,本基金的基金经理	2016年7月26日	–	11年	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《建信现金增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》、《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 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1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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年一季度,宏观经济运行总体平稳,一些向好趋势开始显现。随着春节后企业集中复产,制造业生产活动开始加快。制造业采购经理指数(PMI)在3月份录得50.5%,环比上升1.3个百分点,结束了连续三个月枯荣线之下的走势。从需求端看,尽管制造业投资增速有所回落,但基建投资增速反弹,房地产投资名义增长11.6%,仍然维持较高增速水平,推动固定资产投资增速实现小幅反弹,前两月累计增速达6.1%,较去年末回升0.2个百分点。消费增速继续保持平稳,结构升级趋势较为明显,剔除春节因素之后进出口总额增速为10.2%。从生产端上看,前两月全国规模以上工业增加值累计同比实际增长5.3%,增速较去年12月份小幅回落0.4个百分点,其中消费品制造业保持较快增速。总体看,一季度生产需求总体保持平稳,呈现出稳中有进的态势,但是受到外部环境等不确定性因素影响,宏观经济运行仍然面临一定下行压力。

一季度居民消费价格温和上涨,而工业品价格涨幅回落。前两月CPI累计同比上涨1.6%,较12月份回落0.3个百分点,其中受猪瘟影响导致的产能去化,猪肉价格在一季度涨幅明显,整体通胀预期有所抬升。前两月PPI同比上涨仅0.1%,较12月份回落0.8个百分点,但需要注意的是,受国际因素影响,原油价格增速从2月份开始环比由降转升。

美联储在3月份暂停了加息,人民银行公开市场操作保持定力,于1月份下调金融机构存款准备金率1个百分点后,一季度到期的中期借贷便利(MLF)不再续做,净释放长期资金约8000亿元,维持资金面的合理适度,除临近季末时点出现阶段性紧张,资金面整体保持平稳水平。

债券市场方面,受社融增速企稳回升、贸易摩擦阶段性缓和以及权益市场止跌反弹等因素影响,债券收益率长端震荡加剧,短端则在相对宽松的流动性环境中小幅下行。1年国开债收益率相比于去年末2.75%的位置下行20bp到2.55%,而1年国债收益率则由2.60%下行17bp到2.43%。

期间,本基金继续加强对流动性风险和信用风险的管控力度,进一步提高信用债的准入标准,降低信用债持仓比重,同时加大对高等级同业存单和短期回购的配置力度,努力在安全性、流动性和收益性之间做出平衡。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率0.7648%,波动率0.0005%,业绩比较基准收益率0.3329%,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	47,121,448,236.32	45.13
	其中:债券	47,007,444,365.48	45.02
	资产支持证券	114,003,870.84	0.11
2	买入返售金融资产	18,574,925,840.78	17.79
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	38,121,151,178.08	36.51
4	其他资产	603,243,092.08	0.58
5	合计	104,420,768,347.26	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	6.78
	其中:买断式回购融资	–

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	3,748,697,615.35	3.83
	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。

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	93
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	105
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	82

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

无。

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	27.83	6.77
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天(含)—60天	13.32	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60天(含)—90天	36.50	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90天(含)—120天	3.76	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
5	120天(含)—397天(含)	24.91	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
	合计	106.32	6.77

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

无。

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	500,027,197.43	0.51
2	央行票据	–	0.00
3	金融债券	5,203,451,200.47	5.32
	其中:政策性金融债	5,203,451,200.47	5.32
4	企业债券	–	0.00
5	企业短期融资券	7,670,061,251.19	7.85
6	中期票据	100,250,203.96	0.10
7	同业存单	32,934,060,308.28	33.69
8	其他	599,594,204.15	0.61
9	合计	47,007,444,365.48	48.08
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	0.00

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	111909059	19浦发银行CD059	10,000,000	994,602,000.56	1.02
2	111915094	19民生银行CD094	10,000,000	994,526,180.86	1.02
3	111810505	18兴业银行CD505	10,000,000	988,853,655.86	1.01
4	111872583	18晋商银行CD234	10,000,000	971,843,406.23	0.99
5	180407	18农发07	8,900,000	890,032,617.83	0.91
6	120248	12国开48	7,000,000	708,037,824.24	0.72
7	111887264	18北京农商银行CD088	7,000,000	698,623,702.98	0.71
8	111994025	19天津银行CD026	7,000,000	695,507,645.27	0.71
9	111872114	18徽商银行CD200	7,000,000	694,696,556.42	0.71
10	111885455	18江西银行CD098	7,000,000	694,565,244.73	0.71

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	–
报告期内偏离度的最高值	0.1558%
报告期内偏离度的最低值	0.0857%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1256%

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。

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	149732	宁远05A2	420,000	42,003,870.84	0.04
2	156289	宁远07A2	400,000	40,000,000.00	0.04
3	1889169	18福元2A1_bc	500,000	17,000,000.00	0.02
4	1889156	18唯盈2A1_bc	600,000	15,000,000.00	0.02

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

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

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	–
2	应收证券清算款	123,132,760.55
3	应收利息	480,110,331.53
4	应收申购款	–
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	603,243,092.08

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

报告期期初基金份额总额	93,745,718,542.97
报告期期间基金总申购份额	34,401,694,813.78
报告期期间基金总赎回份额	30,387,608,335.65
报告期期末基金份额总额	97,759,805,021.10

注:上述总申购份额含红利再投份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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增利货币市场基金设立的文件;
2、《建信现金增利货币市场基金基金合同》;
3、《建信现金增利货币市场基金招募说明书》;
4、《建信现金增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
2019年4月19日