建信货币市场基金

【2017】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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月22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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月19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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信货币	
基金主代码	530002	
交易代码	530002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年4月25日	
报告期末基金份额总额	4,639,094,637.04份	
投资目标	在力保本金安全和基金财产较高流动性的前提下,争取获得超过投资基准的收益率。	
投资策略	综合运用定量分析和定性分析手段,全面评估货币市场的利率走势、类属资产和券种的风险收益水平及流动性特征。在此基础上制订本基金投资策略。具体而言,包括短期资金利率走势预测、组合剩余期限调整策略、债券期限配置策略、类属资产配置策略、品种选择策略和交易策略等方面。	
业绩比较基准	本基金投资业绩比较基准为6个月银行定期存款税后收益率。	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种;预期收益和风险均低于债券基金、混合基金、股票基金。	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信货币A	建信货币B
下属分级基金的交易代码	530002	003185
报告期末下属分级基金的份额总额	4,237,258,436.06份	401,836,200.98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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	
	建信货币A	建信货币B
1. 本期已实现收益	42,631,967.22	7,985,484.56
2. 本期利润	42,631,967.22	7,985,484.56
3. 期末基金资产净值	4,237,258,436.06	401,836,200.98

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、本基金于2016年9月19日起新增B类份额,原有份额全部转换为A类份额。

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

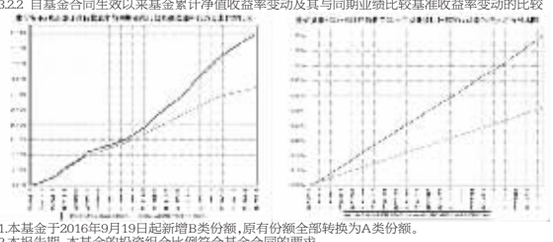
建信货币A

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	0.5765%	0.0010%	0.3205%	0.0000%	0.2560%	0.0010%

建信货币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	0.6366%	0.0010%	0.3205%	0.0000%	0.3161%	0.0010%

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



1.本基金于2016年9月19日起新增B类份额,原有份额全部转换为A类份额。
2.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		
于倩倩	本基金的基金经理	2013年8月5日	-	8	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,2013年8月5日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月21日起任建信双周安心理财债券基金的基金经理;2014年6月17日起任建信嘉薪宝货币市场基金基金经理;2014年9月17日起任建信现金添利货币基金的基金经理。
陈建良	固定收益投资部副总经理、本基金的基金经理	2013年12月10日	-	9	2006年6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;2009年7月加入我公司,历任基金经理助理、基金经理、固定收益投资部总监助理。2013年12月10日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月21日起任建信双周安心理财债券基金的基金经理;2014年6月17日起任建信嘉薪宝货币市场基金基金经理;2014年9月17日起任建信现金添利货币市场基金基金经理。
高珊	本基金的基金经理	2013年12月20日	-	10	硕士,2006年7月至2007年6月期间在中信建投证券公司工作,任交易员。2007年6月加入建信基金管理公司,历任初级交易员、交易员,2009年7月起任建信货币市场基金的基金经理助理。2012年8月20日起任建信双周安心理财债券型证券投资基金基金经理;2012年12月20日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年1月29日起任建信双月安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年9月17日起任建信周盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年12月20日起任建信货币市场基金基金经理;2015年8月26日起任建信现金添利货币市场基金基金经理;2016年6月3日起任建信鑫盛回报灵活配置基金的基金经理;2016年7月26日起任建信现金增利货币市场基金基金经理;2016年10月18日起任建信天添益货币市场基金基金经理。

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《证券法》、《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

回顾2017年1季度,债券市场整体继续下跌,跌幅较去年4季度有所放缓,其中企业债指数跌幅最大,国债和金融债指数次之,整体收益率水平上行20-40bp,曲线仍较为平坦;整体而言,基本面表现好于市场预期,叠加去杠杆政策影响延续,是债券市场利率水平仍高位盘整的主要原因。

基本面预期偏于利空。体现在几个围度上,其一,贷款和社融投放超出预期,企业贷款有所回升,这意味着短期经济增长动能并不弱;其二,新一轮地产调控的影响仍有待传导,而三四线地产销售去库存力度加大,整体房地产投资增速不降反升;其三,去年底的项目集中到年初推进,基建投资增速明显加快;其四,中上游行业受益于去年以来的供给侧改革,叠加设备更新周期,制造业投资表现企稳回升。

政策面延续央行去杠杆意图,资金面表现总体偏紧。具体而言,其一,央行两次上调公开市场逆回购和中期借贷便利操作利率,同时春节后央行明显减少了公开市场净投放操作;其二,资管大行业监管新规风向趋严,穿透式风险管理以及减少产品嵌套和错配套利是主要方向,同时3月底证监会发布公募基金流动性风险管理规定征求意见稿,将持有集中度与产品设计和投资限制关联起来,严厉程度超出预期;其三,LCR和MPA考核对银行的行为约束越发体现出来,银行发行存单的意愿明显上升,而融出长钱的意愿却明显减弱,这使得银行与非银机构之间的资金融通溢价越发增加;受以上各种因素影响,货币市场利率在1月中旬、2月下旬和3月下旬均有较大程度上行。

本基金以管理流动性为第一要务,1季度在去杠杆的政策压力下,策略选择谨慎,重点配置资金在关键的波动时点,同时密切跟踪持有人结构的变化,对申赎资金动向保持敏感,在保证应对流动性的前提下,充分对比线上线下、场内场外、一级二级各种资产价格,择优锁定了一部分超调的短期资产;总体而言,本基金在1季度紧平衡的资金面环境下,顺利地实现了流动性的平稳过渡,并为投资者获得了稳定的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期建信货币A净值增长率0.5765%,波动率0.0010%,建信货币B净值增长率0.6366%,波动率0.0010%,业绩比较基准收益率0.3205%,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	2,230,402,980.02	44.83
	其中:债券	2,230,402,980.02	44.83
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,145,367,798.05	23.02
	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	1,546,328,975.88	31.08
4	其他资产	53,061,459.11	1.07
5	合计	4,975,161,213.06	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		2.87
	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	330,949,603.57	7.13
	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	52
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

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	56.94	7.13
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	14.42	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	12.03	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	4.31	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	18.40	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		106.10	7.13

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	250,038,797.37	5.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	149,988,830.08	3.23
	其中:政策性金融债	149,988,830.08	3.23
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	249,957,145.43	5.39
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,580,418,207.14	34.07
8	其他	-	-
9	合计	2,230,402,980.02	48.08
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	111610170	16兴业CD170	4,000,000	400,000,016.02	8.62
2	111610181	16兴业CD181	4,000,000	400,000,000.00	8.62
3	111694590	16广州农村商业银行CD094	2,800,000	278,107,051.34	5.99
4	019539	16附息国债11	2,500,000	250,038,797.37	5.39
5	111680671	16河北银行CD086	2,000,000	199,022,278.15	4.29
6	111696796	16广州农村商业银行CD124	1,050,000	103,744,844.61	2.24
7	011698370	16紫金矿业SCP005	1,000,000	99,987,722.82	2.16
8	111682459	16长沙银行CD044	1,000,000	99,891,324.52	2.15
9	111794734	17厦门银行CD082	1,000,000	99,652,692.50	2.15
10	120406	12农发06	500,000	50,018,492.86	1.08

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	-0.0335%
报告期内偏离度的最低值	-0.1253%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0663%

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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出现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。本报告期没有特别需要说明的证券投资决策程序。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	23,863.21
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	41,222,603.58
4	应收申购款	11,814,992.32
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	53,061,459.11

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信货币A	建信货币B
报告期期初基金份额总额	9,771,017,695.31	7,231,078,111.71
报告期期间基金总申购份额	3,436,046,549.15	397,214,084.56
报告期期间基金总赎回份额	8,969,805,808.40	7,226,455,995.29
报告期期末基金份额总额	4,237,258,436.06	401,836,200.98

上述总申购份额含红利再投资和转换转入份额,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

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

单位:份

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	1月18日至1月26日,2月6日至3月16日	2,021,254,818.84	0.00	2,021,709,567.85	0.00	0.00

本基金本报告期末不存在单一投资者份额占比达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信货币市场基金设立的文件;
2、《建信货币市场基金基金合同》;
3、《建信货币市场基金招募说明书》;
4、《建信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。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

9.3 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
2017年4月22日

建信积极配置混合型证券投资基金

【2017】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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月22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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月19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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信积极配置混合
基金主代码	530012
交易代码	530012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年1月23日
报告期末基金份额总额	108,224,156.58份
投资目标	根据宏观经济周期和市场环境的变化,本基金自上而下积极、动态地配置大类资产,同时通过合理的证券选择,力争取得高于投资业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上,动态调整大类资产配置比例,同时将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合,运用自下而上的个股、个券投资策略,在大类资产配置和证券选择两个层面上实现投资组合的双重优化。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:65%×沪深300指数+45%×中国债券总指数。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,一般情况下其风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	2,836,105.08
2.本期利润	54,729.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.0005
4.期末基金资产净值	217,937,886.02
5.期末基金份额净值	2.014

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。

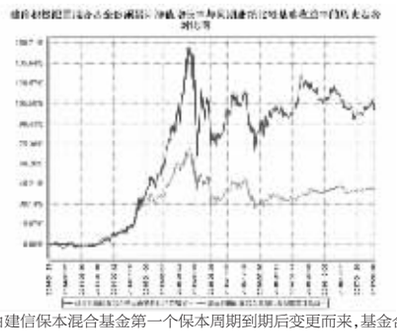
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.20%	0.56%	2.18%	0.29%	-1.98%	0.27%

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



1、本基金由建信保本混合基金第一个保本周期到期后变更而来,基金合同于2014年1月23日生效。

2、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		
姚锦	权益投资部总经理、本基金的基金经理	2014年1月23日	-	12	博士。曾任天津通广三星电子有限公司工程师、天弘基金管理公司研究员、研究部副主管、研究部主管、投资部副总经理兼研究总监等职,2009年3月17日至2011年3月3日担任天弘永利债券型证券投资基金基金经理;2009年12月17日至2011年5月5日任天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理,历任我公司研究部首席策略分析师、权益投资部总经理。2012年2月17日起任建信优选成长混合型证券投资基金基金经理,2012年8月14日至2014年3月6日任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理;2014年1月20日起任建信保本混合的基金经理。该基金于1月23日起转型为建信积极配置混合型证券投资基金,姚锦继续担任该基金的基金经理。

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《建信积极配置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

2017年以来美国政策预期仍旧是全球最关注的事件之一。美国和欧洲部分经济先行数据转好,美联储加息确认宽松货币政策结束。大宗商品价格和美国国债价格波动加大,美国股票指数在创历史新高后呈现震荡走势。以三四线地产为代表,国内增长稳定,对未来经济影响最大的关注点在地方政府基建项目的落实。以CPI为代表的通胀平稳,综合考虑PPI和房价等的广义通胀处于较高水平。

2017年一季度,受较好增长预期的影响,股票市场整体上表现较好。结构上来看,以水泥和钢铁为代表的基建品超额收益明显,以一带一路为代表的主题板块表现突出,兼具消费属性和投资属性的白酒行业表现较好。本基金在一季度对经济的判断未能及时契合到市场预期,配置的重点偏向于消费和成长,因此结构上与市场出现一定的偏离。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率0.2%,波动率0.56%,业绩比较基准收益率2.18%,波动率0.29%。

§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	142,176,339.18	64.47
	其中:股票	142,176,339.18	64.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	73,259,658.51	33.22
8	其他资产	5,094,413.79	2.31
9	合计	220,530,411.48	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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,930,879.52	2.72
B	采矿业	-	-
C	制造业	37,103,355.05	17.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	135,563.04	0.06
F	批发和零售业	28,883,773.00	13.25
G	交通运输、仓储和邮政业	23,391,956.60	10.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,176,637.69	6.96
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	16,598,337.00	7.62
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.01
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	14,938,907.12	6.85
S	综合	-	-
	合计	142,176,339.18	65.24

以上行业分类以2017年3月31日的中国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沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期未投资沪港通股票。

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	300081	恒信移动	999,100	14,087,310.00	6.46
2	300356	光一科技	448,100	13,532,620.00	6.21
3	601111	中国国航	1,314,100	10,893,889.00	5.00
4	600029	南方航空	1,349,600	10,877,776.00	4.99
5	002624	完美世界	363,589	10,722,239.61	4.92
6	600153	建发股份	801,300	8,790,261.00	4.03
7	002127	南极电商	727,800	8,589,040.00	3.94
8	300364	中文在线	221,100	8,242,608.00	3.78
9	601888	中国国旅	141,300	8,010,297.00	3.68
10	600715	文投控股	302,726	6,696,299.12	3.07

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金报告期内未投资于国债期货。

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均无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	122,235.96
2	应收证券清算款	4,938,654.54
3	应收股利	-
4	应收利息	15,082.43
5	应收申购款	18,440.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,094,413.79

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300364	中文在线	8,242,608.00	3.78	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	127,581,568.96
报告期期间基金总申购份额	1,877,552.16
减:报告期期间基金总赎回份额	21,234,964.54
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	108,224,156.58

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

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积极配置混合型证券投资基金设立的文件;
2、《建信积极配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《建信积极配置混合型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信积极配置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
2017年4月22日

建信嘉薪宝货币市场基金

【2017】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:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月22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2017年4月19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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信嘉薪宝货币	
基金主代码	000686	
交易代码	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	
报告期末基金份额总额	11,067,092,643.02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	中信银行股份有限公司	
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	930,354,747.19份	10,136,737,895.83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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	
	建信嘉薪宝货币A	建信嘉薪宝货币B
1. 本期已实现收益	7,027,211.75	104,296,841.68
2. 本期利润	7,027,211.75	104,296,841.68
3. 期末基金资产净值	930,354,747.19	10,136,737,895.83

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

建信嘉薪宝货币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	0.9623%	0.0011%	0.3329%	0.0000%	0.6294%	0.0011%

建信嘉薪宝货币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	1.0216%	0.0011%	0.3329%	0.0000%	0.6887%	0.0011%

1.本基金于2016年5月9日起新增B类份额。

2.本报告期本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累