建信货币市场基金

2019年第二季度报告

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:2019年7月17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2019年7月15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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信货币	
基金主代码	530002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年4月26日	
报告期末基金份额总额	3,174,733,062.87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	2,465,837,884.75份	708,895,178.12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4月1日－2019年6月30日)	报告期(2019年4月1日－2019年6月30日)
	建信货币A	建信货币B
1.本期已实现收益	19,201,520.21	6,147,894.58
2.本期利润	19,201,520.21	6,147,894.58
3.期末基金资产净值	2,465,837,884.75	708,895,178.12

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上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

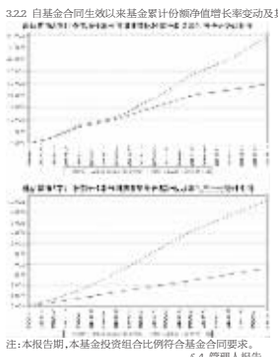
建信货币A

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	0.6461%	0.0022%	0.3241%	0.0000%	0.3220%	0.0022%

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	0.7065%	0.0022%	0.3241%	0.0000%	0.3824%	0.0022%

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		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	－	11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。
陈建良	本基金的基金经理	2013年12月10日	－	12年	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。
先柯宇	本基金的基金经理	2019年1月25日	－	7年	先柯宇先生,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，曾从事债效管理,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。

4.2 管理人对投资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《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信货币市场基金合同》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2019年2季度,贸易谈判预期出现反转,实体经济数据有所走弱,总量政策保持定力的同时更加突出结构性应对,流动性环境从边际收紧预期重新转入宽松局面,这些因素带动债券市场先跌后涨,最终中债综合财富指数实现0.65%的正收益,其中信用债表现好于利率债,政金债表现好于国债,整体利率债收益率曲线呈现平坦化。

2季度最重要的变化在于多重预期出现反转。外部形势来看,美欧经济出现放缓,降息预期逐步升温,5月中美贸易谈判透出不利走向,关税升级预期极大地打压了市场对经济基本面的信心。内部来看,社融信贷平稳投放,金融数据延续底部回稳,但实体经济表现开始呈现走弱信号,以PMI表征的制造业景气指数陷于收缩区域,钢材需求呈现回落,房地产投资也开始放缓,对类出口负面影响开始呈现;更出乎市场预期的是,包商接管事件打破了同业刚兑预期,流动性分层和信用分化持续发酵,引发了同业收缩风险,这对刚刚有所恢复的信用扩张体系来说,明显增加了信用负反馈的风险。

2季度相对有利的因素在于政策的灵活调整与积极应对。4月份政策层在1季度信用扩张有所修复的基础上一度传递出预调微调的信号,包括辟谣降准、货政例会重提货币供给总闸门、政治局会议提出货币政策要预调微调、国务院吹风会强调货币政策没收紧也没放松等等。5月份贸易谈判形势逆转后,针对中小银行的结构性降准开始兑现,月底包商事件出来后对市场的冲击是比较大的,央行及时开启大力度对冲,MLF增量供给、再贴现和常备借贷便利额度增加3000亿同时放宽质押品范围、增加跨半年末逆回购供给、协同多部门缓解非银流动性等等,及时抑制了风险的多层次多链条传染。此外,在应对内部需求回落方面,专项债纳入资金金、隐性债务平滑等政策也相继出台,虽然短期提振效果可能有限,但也有助于提升基建平滑经济下行压力的信心。

2季度资金利率中枢先升后降,短端信用资产收益出现分化,高等级被追捧,信用利差明显走阔。资金来看,部分时点出现阶段性紧张,主要是4月政策预调微调和5月底包商事件冲击,进入6月,得益于央行的大力度对冲,银行间隔夜加权利率跌破1%,但抵押品与机构信用明显被区分定价,最高利率显著攀升。短端资产方面,6月同业存单净融资为负,一级发行成功率明显下降,二级AAA及以上存单利率回落10–20bp,AA+存单利率上行30bp左右,利差走阔40–50bp,同期AAA短融利率下行13–38bp不等,分位值回到30%以内,跨年期限利差居于高位,AA+评级利差走阔13–19bp。

本基金作为流动性管理产品,一直贯彻以负债稳定性来选择资产端策略的原则。一方面,由于整体货基收益持续下沉,部分机构套利行为一度导致前十大集中度有所提高,我们始终控制剩余期限和短期流动性资产比例在合理范围内,以充分应对关键时点的申赎变化;另一方面,我们跟随政策预期变化及时调整组合结构,在资金阶段性紧张时点适当布局了部分跨季资产,包商事件后进一步强化了组合的安全性,并适当锁定了高等级品种的配置机会。总体而言,在保证流动性的前提下,我们积极把握资金波动的机会,保持组合剩余期限在中等水平,利用适度杠杆策略为投资者实现了较好的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金A净值收益率0.6461%，波动率0.0022%，本基金B净值收益率0.7065%，波动率0.0022%;业绩比较基准收益率0.3241%,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	1,912,553,425.80	55.09
	其中:债券	1,912,553,425.80	55.09
	资产支持证券	－	0.00
2	买入返售金融资产	1,257,793,393.19	36.23
	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	277,239,265.07	7.99
4	其他资产	23,918,479.59	0.69
5	合计	3,471,504,563.65	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	11.63	
	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	294,989,452.50	9.29
	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	75
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	95
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	54

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	35.47	9.29
	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	17.34	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	17.59	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	4.72	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)	33.47	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		108.59	9.29

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	－	－
2	央行票据	－	－
3	金融债券	221,110,600.23	6.96
	其中:政策性金融债	181,085,826.94	5.70
4	企业债券	150,102,804.01	4.73
5	企业短期融资券	800,053,660.72	25.20
6	中期票据	－	－
7	同业存单	741,286,360.84	23.35
8	其他	－	－
9	合计	1,912,553,425.80	60.24
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	111811324	18平安银行CD324	3,000,000	296,462,396.70	9.34
2	041800307	18中石油CP001	2,500,000	250,277,752.32	7.88
3	011901350	19中电投SCP020	1,000,000	99,926,838.34	3.15
4	111917003	19光大银行CD003	1,000,000	98,962,903.67	3.12
5	111918043	19华夏银行CD043	1,000,000	98,953,667.10	3.12
6	111908017	19中信银行CD017	1,000,000	98,953,667.10	3.12
7	071900033	19渤海证券CP005	700,000	70,000,000.00	2.20
8	136826	16国网01	600,000	60,032,238.55	1.89
9	150208	15国开08	500,000	50,502,469.76	1.59
10	150410	15农发10	500,000	50,445,576.21	1.59

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	0.1416%
报告期内偏离度的最低值	0.0422%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0827%

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

无。

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	13,157.53
2	应收证券清算款	－
3	应收利息	19,374,955.46
4	应收申购款	4,530,366.60
5	其他应收款	－
6	待摊费用	－
7	其他	－
8	合计	23,918,479.59

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	建信货币A	建信货币B
报告期期初基金份额总额	3,216,448,062.10	794,112,503.02
报告期期间基金总申购份额	1,377,275,918.61	552,287,307.66
报告期期间基金总赎回份额	2,127,886,096.96	637,504,632.56
报告期期末基金份额总额	2,465,837,884.75	708,895,178.12

注: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

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。

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7月17日

建信积极配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

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:2019年7月17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2019年7月15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4月1日起至6月30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
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	71,181,766.94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(2019年4月1日－2019年6月30日)
1.本期已实现收益	3,792,910.97
2.本期利润	－2,122,214.65
3. 加权平均基金份额本期利润	－0.0296
4.期末基金资产净值	156,830,802.93
5.期末基金份额净值	2.203

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。

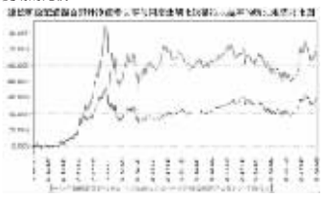
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	－1.34%	1.22%	－0.31%	0.82%	－1.03%	0.40%

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



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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姚锦	权益投资总部经理，本基金的基金经理	2014年1月23日	－	15年	姚锦女士,权益投资部总经理,博士。曾任天津通广三星电子有限公司工程师,2004年5月至2011年5月任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。历任建信基金管理公司研究部首席策略分析师、权益投资部副总经理兼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的基金经理;2012年8月14日至2014年3月6日任建信社会责任股票型证券投资基金的基金经理;2014年1月20日起任建信保本混合型证券投资基金的基金经理，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;2017年6月9日至2018年9月12日任建信稳心精选混合型证券投资基金的基金经理;2018年1月24日起任建信龙头企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》、《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

2019年以来,国内经济和国际形势在一季度呈现双缓和,二季度呈现双波动。国际方面,延续2018年年底一直进行的中美贸易谈判,在二季度出现反复。国内经济方面,与一季度较好的经济数据和较宽松的货币信贷相比,二季度均出现回落。

二季度股票市场受国际国内双波动的影响,呈现出波动的走势,结构性表现非常明显。以白酒、医药、保险、免税等为代表的内需性行业,受国际形势影响较小,长期受益于中国经济转型和强大的内需拉动,在二季度不断创出历史新高,成为具有代表性的核心资产。而投资拉动的基建产业链、地产产业链,以及受国际形势影响较大的科技类板块,则呈现与市场走势相同的波动性。

本基金在二季度积极布局内需型稳健消费类龙头,受益于其较好的股价表现。本基金同时积极布局受益于内需拉动,具有估值优势的其他消费和服务类板块,并坚持全市场精选个股和估值匹配的原则。本基金在仓位方面根据市场波动进行了动态调整。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率–1.34%，波动率1.22%，业绩比较基准收益率–0.31%,波动率0.82%。

§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	103,954,800.17	51.56
	其中:股票	103,954,800.17	51.56
2	基金投资	－	0.00
3	固定收益投资	－	0.00
	其中:债券	－	0.00
	资产支持证券	－	0.00
4	贵金属投资	－	0.00
5	金融衍生品投资	－	0.00
6	买入返售金融资产	40,000,000.00	19.84
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	－	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	57,600,903.26	28.57
8	其他资产	74,461.16	0.04
9	合计	201,630,164.59	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	8,295,269.00	5.29
B	采矿业	5,734,840.77	3.66
C	制造业	26,941,284.52	17.18
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	22,785,743.76	14.53
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,390,852.12	9.18
J	金融业	－	－
K	房地产业	7,871,940.00	5.02
L	租赁和商务服务业	15,810,018.30	10.08
M	科学研究和技术服务业	－	－
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	2,124,851.70	1.35
R	文化、体育和娱乐业	－	－
S	综合	－	－
	合计	103,954,800.17	66.28

注:以上行业分类以2019年6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

无。

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	601888	中国国旅	178,342	15,810,018.30	10.08
2	601111	中国国航	1,122,952	10,746,650.64	6.85
3	300010	立思辰	1,094,223	10,180,853.97	6.49
4	002714	牧原股份	141,100	8,296,269.00	5.29
5	000858	五粮液	70,100	8,268,295.00	5.27
6	000961	中南建设	909,000	7,871,940.00	5.02
7	600029	南方航空	862,296	6,656,925.12	4.24
8	300760	迈瑞医疗	35,800	5,842,560.00	3.73
9	000968	蓝焰控股	493,957	5,734,840.77	3.66
10	600115	东方航空	858,400	5,382,168.00	3.43

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

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五名权证投资明细

无。

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

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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	51,123.75
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	11,547.71
5	应收申购款	11,789.70
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	74,461.16

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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	73,094,639.64
报告期期间基金总申购份额	867,278.25
减:报告期期间基金总赎回份额	2,780,150.95
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	71,181,766.94

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

2019年7月17日

建信嘉薪宝货币市场基金

2019年第二季度报告

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:2019年7月17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2019年7月15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4月1日起至6月30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	000696	
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	5,954,457,905.39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	000696	002753
报告期末下属分级基金的份额总额	5,949,449,801.79份	5,008,103.60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4月1日－2019年6月30日)	报告期(2019年4月1日－2019年6月30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	21,195,585.40	44,033.98
2.本期利润	21,195,585.40	44,033.98
3. 期末基金资产净值	5,949,449,801.79	5,008,103.60

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	0.7870%	0.0082%	0.3366%	0.0000%	0.4504%	0.0082%

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