建信现代服务业股票型证券投资基金

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:兴业银行股份有限公司
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。

基金托管人兴业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	建信现代服务业股票
基金主代码	001781
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月23日
报告期末基金份额总额	27,991,939.94份
投资目标	本基金主要投资于同现代服务业相关的行业的上市公司股票,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值,力争创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势等因素对各个行业及上市公司的影响以及核心股票资产的估值水平,综合分析证券市场的走势,主动判断市场时机,通过稳健的资产配置,合理确定基金资产在股票、债券等各类资产类别上的投资比例,以最大限度地降低投资组合的风险,提高收益。
业绩比较基准	85%×中证服务业指数收益率+15%×中债总财富(总值)指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§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	234,283.24
2.本期利润	-811,650.08
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0284
4.期末基金资产净值	29,645,276.17
5.期末基金份额净值	1.059

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	-2.58%	1.55%	-4.97%	1.27%	2.39%	0.28%

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陶灿	本基金的基金经理	2016年2月23日	-	11年	陶灿先生,硕士,权益投资部总经理助理兼研究部首席策略官。2007年7月加入本公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理、权益投资部总经理助理兼研究部首席策略官。2011年7月11日至2016年4月22日任建信优化配置混合型证券投资基金的基金经理;2014年5月14日起任建信改革红利股票型证券投资基金的基金经理;2016年2月23日起任建信现代服务业股票型证券投资基金的基金经理;2017年2月9日起任建信回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2017年3月22日起任建信恒久价值混合型证券投资基金的基金经理;2017年10月27日起任建信安心保本二号混合型证券投资基金的基金经理。该基金于2017年11月4日起转型为建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金,陶灿继续担任该基金的基金经理。

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《建信现代服务业股票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

第二季度以来,市场波动是显著加大,行业表现亦显著分化,总体上消费行业却得显著优势,部分服务业亦却得较大优势。在经济增速转型升级阶段,龙头企业的市场竞争力持续加强,份额继续集中,在股票市场上,各行业龙头亦受基本面驱动,整体表现优于同行。

本基金在第二季度,聚焦投资于服务业相关行业,特别是消费与服务叠加的相关行业,在战胜同期行业基准的情况下,为投资服务业的持有人创造超额回报。

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-2.58%,波动率1.55%,业绩比较基准收益率-4.97%,波动率1.27%。

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2019年4月1日至2019年6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	26,562,998.19	88.22
	其中:股票	26,562,998.19	88.22
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	-	0.00
	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	2,906,585.48	9.65
8	其他资产	638,850.77	2.12
9	合计	30,108,434.44	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	2,037,392.98	6.87
B	采矿业	1,021,334.57	3.45
C	制造业	13,824,527.44	46.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,169,550.00	3.95
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	1,351,784.00	4.56
J	金融业	3,105,501.10	10.48
K	房地产业	1,140,744.00	3.85
L	租赁和商务服务业	701,221.50	2.37
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	1,340,878.60	4.52
R	文化、体育和娱乐业	870,064.00	2.93
S	综合	-	-
	合计	26,562,998.19	89.60

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	000858	五粮液	17,100	2,016,945.00	6.80
2	600519	贵州茅台	1,700	1,672,800.00	5.64
3	300498	温氏股份	40,093	1,437,734.98	4.85
4	002123	梦网集团	95,600	1,351,784.00	4.56
5	002463	沪电股份	93,200	1,269,384.00	4.28
6	603027	千禾味业	49,140	1,172,971.80	3.96
7	601668	中国建筑	203,400	1,169,550.00	3.95
8	000661	长春高新	3,400	1,149,200.00	3.88
9	600048	保利地产	89,400	1,140,744.00	3.85
10	601688	华泰证券	49,300	1,100,376.00	3.71

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	42,768.00
2	应收证券清算款	590,835.16
3	应收股利	-
4	应收利息	1,438.56
5	应收申购款	3,809.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	638,850.77

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	30,652,774.53
报告期期间基金总申购份额	1,016,818.33
减:报告期期间基金总赎回份额	3,677,652.92
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	27,991,939.94

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情况
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
无。
7.2 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代服务业股票型证券投资基金设立的文件;
2、《建信现代服务业股票型证券投资基金基金合同》;
3、《建信现代服务业股票型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信现代服务业股票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

建信现金添利货币市场基金

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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	260,270,130,838.15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	197,526,726,250.45份 / 62,743,404,587.70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	1,452,699,634.13	514,308,763.44
2.本期利润	1,452,699,634.13	514,308,763.44
3.期末基金资产净值	197,526,726,250.45	62,743,404,587.70

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。

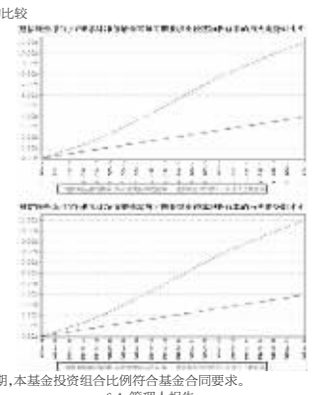
3.2 基金净值表现

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	0.6763%	0.0002%	0.3366%	0.0000%	0.3397%	0.0002%

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	0.7115%	0.0002%	0.3366%	0.0000%	0.3749%	0.0002%

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	-	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日起任建信双鸽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	固定收益部副总经理,本基金的基金经理	2014年9月17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日起任建信嘉薪宝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

宏观经济方面,二季度经济运行稳中略降。PMI指数在6月份录得49.4%,持平5月水平,已经连续两个月低于枯荣线水平,显示企业生产经营活动步伐有所放缓。从需求端上看,前5个月固定资产投资累计增速较一季度末小幅回落0.5个百分点至5.6%。其中制造业投资增速继续下滑,5月末维持在2.7%的低位,基建投资增速相对平稳,房地产投资名义增长虽较一季度末回落了0.8个百分点,但仍维持在较高水平。前5月社会消费品零售总额同比增长8.1%,增速较一季度末下行0.2个百分点,其中网上零售占比继续提高,消费增速在二季度整体保持平稳,而在贸易摩擦加强的背景下,前5月进出总额同比仍然保持了4.1%的正增长。总体看,今年二季度经济生产需求虽较一季度有所回落,但保持总体平稳,国内外各种不确定性因素的影响仍然不容忽视。

通胀方面,二季度居民消费价格涨势温和,前5月CPI累计同比上涨2.2%,涨幅比一季度末上行0.4个百分点,其中食品项目中鲜果和猪肉价格涨幅明显,非食品价格基本保持稳定。由于国际大宗商品价格回落导致输入性因素压力减少,前5月PPI同比上涨0.4%,其中5月当月PPI同比走势从4月的0.9%回落到0.6%,涨幅有所回落。

二季度资金面除部分时点因事件冲击出现阶段性紧张外,整体维持合理适度水平。5月下旬受包商银行被接管影响,全市场质押式回购利率出现明显上行,非银机构融资成本显著抬升。随着监管机构陆续采取多种有效措施对市场预期进行合理引导后,流动性紧张和分层局面有所缓解。从人民币汇率上看,二季度人民币汇率先贬后升,6月末人民币兑美元中间价收于6.8747,较一季度末贬值2.1%。

债券市场方面,二季度债券市场收益率先上后下,整体收益率维持区间震荡。4月受到一季度经济金融数据好转影响,收益率显著上行,5月之后贸易战风波重燃,国内经济数据出现反复,收益率又再度回落。二季度末1年国开债收益率报收2.73%,较一季度末2.55%的位置上行18BP。

报告期内,本基金加强对持仓信用债及同业存单信用风险的梳理重检,进一步提高大中型国有银行及股份制银行存单和存款的持仓比例,加大短期回购配置力度,控制组合久期,保持组合流动性和备付能力,在剧烈的市场波动中保障了组合资产安全。

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0.6763%,波动率0.0002%,本基金B净值收益率0.7115%,波动率0.0002%;业绩比较基准收益率0.3366%,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	108,245,165,798.93	37.75
	其中:债券	108,240,915,798.93	37.75
	资产支持证券	4,250,000.00	0.00
2	买入返售金融资产	59,797,419,318.39	20.85
	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	117,670,239,401.60	41.04
4	其他资产	1,020,122,581.73	0.36
5	合计	286,732,947,100.65	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	3.19
	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	11,269,964,896.23 / 4.33
	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	81
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	83
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	64

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	39.26	10.12
	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	16.15	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	27.45	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	2.19	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)	24.72	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		109.77	10.12

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	7,529,624,313.92	2.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,440,923,073.26	3.24
	其中:政策性金融债	8,440,923,073.26	3.24
4	企业债券	210,352,980.35	0.08
5	企业短期融资券	5,753,259,978.86	2.21
6	中期票据	2,292,087,887.01	0.88
7	同业存单	80,826,806,620.13	31.05
8	其他	3,187,860,945.40	1.22
9	合计	108,240,915,798.93	41.59
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	111914090	19江苏银行CD090	45,000,000	4,406,080,970.09	1.69
2	019611	19国债01	36,600,000	3,648,947,080.80	1.40
3	111909153	19浦发银行CD153	30,000,000	2,986,160,986.29	1.15
4	111916164	19上海银行CD164	30,000,000	2,981,859,985.98	1.15
5	170205	17国开05	25,900,000	2,608,534,210.80	1.00
6	111808265	18中信银行CD265	25,000,000	2,494,107,206.39	0.96
7	111807188	18招商银行CD188	20,000,000	1,997,103,077.83	0.77
8	111808251	18中信银行CD251	20,000,000	1,997,042,401.43	0.77
9	111916149	19上海银行CD149	20,000,000	1,987,355,566.29	0.76
10	111916155	19上海银行CD155	20,000,000	1,987,351,689.55	0.76

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	0.0952%
报告期内偏离度的最低值	0.0334%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0574%

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	1889169	18福元2A1_bc	500,000	4,250,000.00	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	5,822.62
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,012,456.023.14
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	1,020,122,581.73

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	223,925,697,698.80	76,583,226,997.87
报告期期间基金总申购份额	127,462,606,686.51	8,215,652,933.16
报告期期间基金总赎回份额	153,861,578,134.86	22,055,475,343.33
报告期期末基金份额总额	197,526,726,250.45	62,743,404,587.70

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7月17日

建信现金添益交易型货币市场基金

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:国泰君安证券股份有限公司
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。

基金托管人国泰君安证券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	27,544,426,116.10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	27,378,443,828.10份 / 165,982,288.00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)
	建信现金添益	建信添益
1.本期已实现收益	197,897,724.45	104,320,272.65
2.本期利润	197,897,724.45	104,320,272.65
3.期末基金资产净值	27,378,443,828.10	16,598,228,799.90

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。

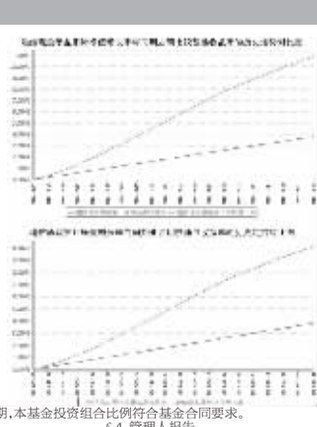
3.2 基金净值表现

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	0.7086%	0.0004%	0.3366%	0.0000%	0.3720%	0.0004%

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	0.6483%	0.0004%	0.3366%	0.0000%	0.3117%	0.0004%

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
先柯宇	本基金的基金经理	2017年7月7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