

# 建信现金添益交易型货币市场基金 2019年 半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 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

送出日期：2019 年 8 月 29 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。本半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 8 月 27 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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 6 月 30 日止。

## § 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            | 建信添益                |                  |
| 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      | 27,544,426,116.10 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 | 27,378,443,828.10 份 | 165,982,288.00 份 |

注: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                        | 吴曙明                   |
|         | 联系电话                      | 010-66228888          |
|         | 电子邮箱                      | xinxipilu@ccbfund. cn |
| 客户服务电话  | 400-81-95533 010-66228000 | 021-38917599-5        |
| 传真      | 010-66228001              | 021-38677819          |

### 2.4 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人的住所  |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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<br>和指标 | 报告期(2019年1月1日-2019年6月30日) |                   |
|                   | 建信现金添益                    | 建信添益              |
| 本期已实现收益           | 403,308,845.83            | 241,666,131.19    |
| 本期利润              | 403,308,845.83            | 241,666,131.19    |
| 本期净值收益率           | 1.4923%                   | 1.3713%           |
| 3.1.2 期末数据<br>和指标 | 报告期末(2019年6月30日)          |                   |
| 期末基金资产净值          | 27,378,443,828.10         | 16,598,228,799.90 |
| 期末基金份额净值          | 1.0000                    | 100.0000          |

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。

2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可

供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3、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 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

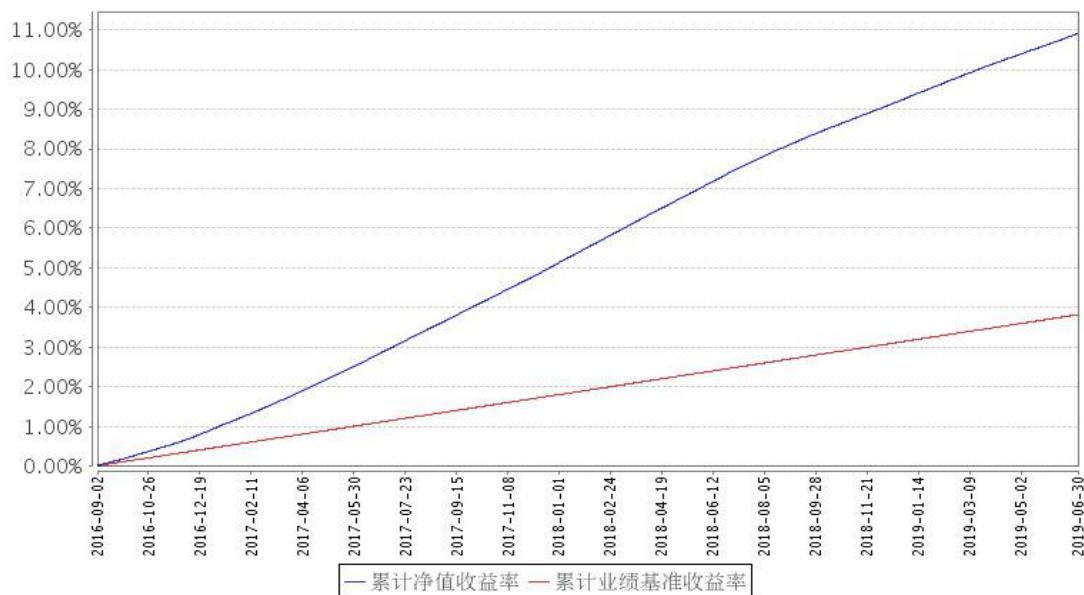
| 阶段         | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去一个月      | 0.2342%  | 0.0002%     | 0.1110%    | 0.0000%       | 0.1232% | 0.0002% |
| 过去三个月      | 0.7086%  | 0.0004%     | 0.3366%    | 0.0000%       | 0.3720% | 0.0004% |
| 过去六个月      | 1.4923%  | 0.0007%     | 0.6695%    | 0.0000%       | 0.8228% | 0.0007% |
| 过去一年       | 3.2497%  | 0.0010%     | 1.3500%    | 0.0000%       | 1.8997% | 0.0010% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.9080% | 0.0018%     | 3.8170%    | 0.0000%       | 7.0910% | 0.0018% |

建信添益

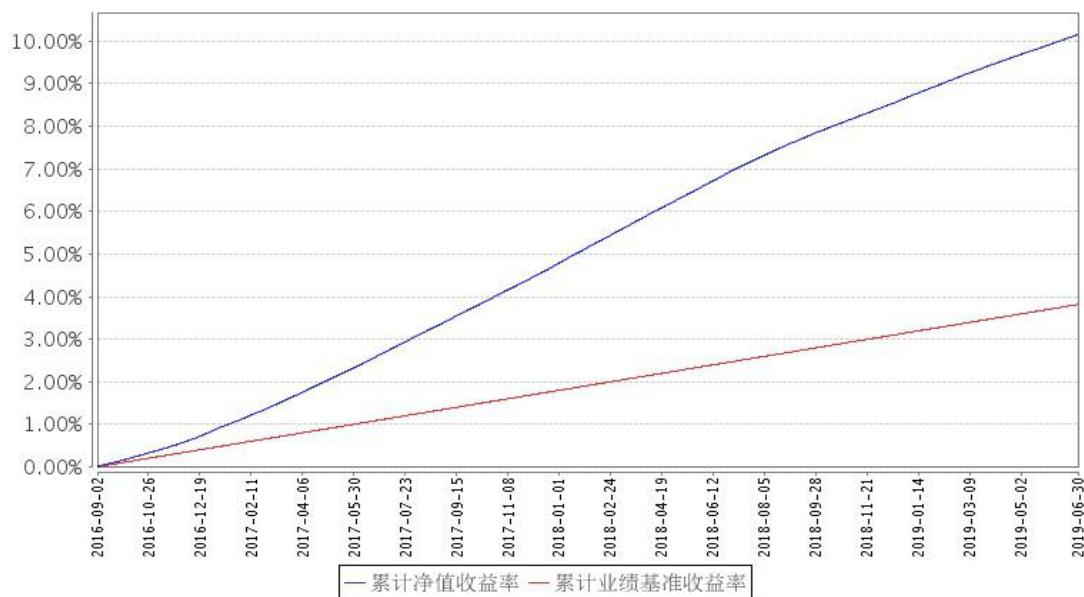
| 阶段         | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去一个月      | 0.2144%  | 0.0002%     | 0.1110%    | 0.0000%       | 0.1034% | 0.0002% |
| 过去三个月      | 0.6483%  | 0.0004%     | 0.3366%    | 0.0000%       | 0.3117% | 0.0004% |
| 过去六个月      | 1.3713%  | 0.0007%     | 0.6695%    | 0.0000%       | 0.7018% | 0.0007% |
| 过去一年       | 3.0018%  | 0.0010%     | 1.3500%    | 0.0000%       | 1.6518% | 0.0010% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.1569% | 0.0018%     | 3.8170%    | 0.0000%       | 6.3399% | 0.0018% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

建信现金添益累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信添益累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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、基金会计部、注册登记部、财务管理部、金融科技部、投资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 2019 年 6 月 30 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 6 个月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）、建信中证政策性金融债 8-10 年指数证券投资基金（LOF）、建信建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信福泽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、建信优享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、建信中短债纯债债券型证券投资基金、建信中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、建信润利增强债券型证券投资基金、建信睿兴纯债债券型证券投资基金、建信中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、建信福泽裕泰混合型基金中基金（FOF），共计 110 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 5,725.25 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 | 说明 |
|----|----|-----------------|----|----|
|----|----|-----------------|----|----|

|     |                     | 任职日期      | 离任日期 | 从业年限 |   |
|-----|---------------------|-----------|------|------|---|
| 先轲宇 | 本基金的基金经理            | 2017年7月7日 | -    | 7    | 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 | 固定收益投资部总经理，本基金的基金经理 | 2016年9月2日 | -    | 12   | 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的基金经理；2014年9月17日起任建信现金添利货币市场的基金经理；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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

### 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 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

2019 年上半年，宏观经济增速小幅回落，但运行总体保持平稳。前两季度 GDP 同比增长 6.3%，较去年全年回落 0.3 个百分点。固定资产投资受到制造业和基建分项疲弱影响，贡献率相比于去年年末也有所下滑，上半年中美贸易摩擦获得阶段性缓和，使得净出口对于 GDP 增长的贡献由负转正。虽然社会消费品零售总额在上半年同比增长 8.4%，增速相较于去年同期回落 1 个百分点，

但最终消费支出对 GDP 增长的贡献率为 60.1%，表明消费仍然是推动经济稳定增长的重要动力。

整体看，尽管上半年国内外形势仍然错综复杂，但经济总体仍保持较为平稳的增长态势。

上半年物价水平总体保持平稳。CPI 上涨 2.2%，较去年同期扩大 0.2 个百分点，其中食品价格尤其是猪肉和鲜果价格上涨对 CPI 温和回升带动明显。由于上半年原油价格先涨后跌波动较大，对国内相关行业工业品价格形成传导，使得 PPI 在上半年同比增长仅录得 0.3%，涨幅比去年同期出现明显回落。

上半年货币政策基调保持稳健。央行灵活采用多项政策工具“削峰填谷”，除部分时点呈现阶段性紧张外，资金面始终处于合理适度水平。其中受 5 月下旬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，信用分层情况下，非银机构融资成本显著抬升。随着 6 月份人民银行及时鼓励头部券商定向支持，并增加常备借贷便利 3000 亿元等操作陆续推出，市场对流动性的紧张预期有所缓解，资金面逐渐回归平稳。

债券市场方面，上半年收益率水平整体波动较大，利率呈现冲高回落走势。一季度债券市场收益率整体维持底部区域窄幅震荡。进入 4 月后受到一季度经济金融数据好转影响收益率出现显著上行，而 5 月份贸易摩擦加剧，叠加国内经济数据出现反复，收益率冲高回落。截至半年末，1 年期国债和国开债分别报收于 2.64% 和 2.73%，较年初上行了 14bp 和 7bp。

报告期内，本基金加强了对组合资产信用风险的梳理防范，重点加大对利率债以及高等级同业存单的配置力度，适当拉长组合久期，并始终将杠杆水平控制在合理水平，取得了良好的投资收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值收益率 1.4923%，波动率 0.0007%，本报告期本基金 B 净值收益率 1.3713%，波动率 0.0007%；业绩比较基准收益率 0.6695%，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

展望下半年，尽管对外贸易在上半年展现出了较强的韧性，但随着贸易摩擦的持续，负面影响恐将进一步显现，而“房住不炒”的大基调下，地产融资政策的进一步收紧或将对下半年的房地产投资增速形成制约，宏观经济仍然面临着一定的下行压力。预计下半年在内外部环境没有出现明显恶化的背景下，整体政策基调将继续保持定力，货币政策大概率呈现逆周期调节下的中性偏松，流动性仍将维持合理充裕，有利于债券市场利率水平的进一步下行。

因此，本基金将在做好信用风险防范的前提下，将适当加大杠杆策略和久期策略的弹性和灵活性，加强对利率走势的研判，在立足静态收益的基础上，通过一定的波段交易操作增厚组合收

益，努力为持有人创造良好的投资回报。

#### 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、投资风险管理部和基金会计部负责人组成。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、风险管理等工作，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《证券投资基金管理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，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 644,974,977.02 元，其中 A 类份额应分配利润为 403,308,845.83 元，H 类份额应分配收益为 241,666,131.19 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《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《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 托管人对本半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、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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号 | 本期末<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|------------|-----|-------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |     |                   |                     |
| 银行存款       |     | 15,173,111,856.14 | 16,178,687,743.78   |
| 结算备付金      |     | 215,756,605.98    | 157,807,454.99      |
| 存出保证金      |     | —                 | 32,379.10           |
| 交易性金融资产    |     | 23,677,271,966.79 | 24,300,479,352.84   |
| 其中：股票投资    |     | —                 | —                   |
| 基金投资       |     | —                 | —                   |
| 债券投资       |     | 23,677,271,966.79 | 24,077,711,352.84   |
| 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        |            | 6,748,319,172.46          | 5,849,189,826.40            |
| 应收证券清算款         |            | -                         | 300,801,164.41              |
| 应收利息            |            | 127,688,145.51            | 213,250,010.81              |
| 应收股利            |            | -                         | -                           |
| 应收申购款           |            | 58,056,230.72             | 92,493,237.53               |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            |            | -                         | -                           |
| 资产总计            |            | 46,000,203,977.60         | 47,092,741,169.86           |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2018年12月31日</b> |
| <b>负债:</b>      |            |                           |                             |
| 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       |            | 1,452,878,953.56          | 3,018,497,152.60            |
| 应付证券清算款         |            | 554,139,952.11            | -                           |
| 应付赎回款           |            | -                         | -                           |
| 应付管理人报酬         |            | 9,002,781.30              | 10,270,580.22               |
| 应付托管费           |            | 2,880,889.99              | 3,286,585.68                |
| 应付销售服务费         |            | 3,749,376.30              | 5,223,149.35                |
| 应付交易费用          |            | 167,233.25                | 116,486.83                  |
| 应交税费            |            | 240,645.95                | 339,704.30                  |
| 应付利息            |            | 188,606.77                | 2,258,958.67                |
| 应付利润            |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                         | -                           |
| 其他负债            |            | 282,910.37                | 509,389.96                  |
| 负债合计            |            | 2,023,531,349.60          | 3,040,502,007.61            |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金            |            | 43,976,672,628.00         | 44,052,239,162.25           |
| 未分配利润           |            | -                         | -                           |
| 所有者权益合计         |            | 43,976,672,628.00         | 44,052,239,162.25           |
| 负债和所有者权益总计      |            | 46,000,203,977.60         | 47,092,741,169.86           |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 27,544,426,116.10 份，其中建信现金添益基金 A 类份额总额为 27,378,443,828.10 份，基金份额净值 1.0000；建信添益基金 H 类份额总额为 165,982,288.00 份，基金份额净值 100.0000。

## 6.2 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|----|-----|----------------------------|---------------------------------|
|----|-----|----------------------------|---------------------------------|

|                        |               | 月 30 日            | 年 6 月 30 日        |
|------------------------|---------------|-------------------|-------------------|
| 一、收入                   |               | 759, 176, 265. 59 | 947, 481, 911. 27 |
| 1. 利息收入                |               | 760, 317, 967. 75 | 948, 425, 009. 54 |
| 其中：存款利息收入              |               | 253, 521, 054. 88 | 478, 851, 833. 87 |
| 债券利息收入                 |               | 412, 186, 473. 52 | 360, 665, 586. 04 |
| 资产支持证券利息收入             |               | 2, 335, 981. 53   | 11, 134, 235. 57  |
| 买入返售金融资产收入             |               | 92, 274, 457. 82  | 97, 773, 354. 06  |
| 其他利息收入                 |               | -                 | -                 |
| 2. 投资收益（损失以“-”号填列）     |               | -1, 141, 702. 16  | -943, 098. 27     |
| 其中：股票投资收益              |               | -                 | -                 |
| 基金投资收益                 |               | -                 | -                 |
| 债券投资收益                 |               | -1, 141, 702. 16  | -943, 098. 27     |
| 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）     |               | -                 | -                 |
| 减：二、费用                 |               | 114, 201, 288. 57 | 110, 681, 362. 96 |
| 1. 管理人报酬               | 6. 4. 8. 2. 1 | 55, 709, 626. 28  | 49, 375, 969. 70  |
| 2. 托管费                 | 6. 4. 8. 2. 2 | 17, 827, 080. 40  | 15, 800, 310. 37  |
| 3. 销售服务费               | 6. 4. 8. 2. 3 | 23, 248, 240. 91  | 25, 927, 559. 31  |
| 4. 交易费用                |               | -                 | -                 |
| 5. 利息支出                |               | 16, 928, 214. 83  | 19, 210, 203. 48  |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |               | 16, 928, 214. 83  | 19, 210, 203. 48  |
| 6. 税金及附加               |               | 224, 888. 01      | 85, 810. 97       |
| 7. 其他费用                |               | 263, 238. 14      | 281, 509. 13      |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    |               | 644, 974, 977. 02 | 836, 800, 548. 31 |
| 减：所得税费用                |               | -                 | -                 |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）      |               | 644, 974, 977. 02 | 836, 800, 548. 31 |

### 6.3 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30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)                        | 44,052,239,162.25               | -               | 44,052,239,162.25  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                               | 644,974,977.02  | 644,974,977.02     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)  | -75,566,534.25                  | -               | -75,566,534.25     |
| 其中：1.基金申购款                             | 39,798,497,858.53               | -               | 39,798,497,858.53  |
| 2.基金赎回款                                | -39,874,064,392.78              | -               | -39,874,064,392.78 |
| 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) | -                               | -644,974,977.02 | -644,974,977.02    |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 43,976,672,628.00               | -               | 43,976,672,628.00  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30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)               | -                               | 836,800,548.31  | 836,800,548.31     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)  | 6,093,574,030.31                | -               | 6,093,574,030.31   |
| 其中：1.基金申购款                             | 52,666,195,796.85               | -               | 52,666,195,796.85  |

|  |                    |                 |                    |
|--|--------------------|-----------------|--------------------|
| 2. 基金赎回款                               | -46,572,621,766.54 | -               | -46,572,621,766.54 |
| 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） | -                  | -836,800,548.31 | -836,800,548.31    |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 41,207,170,793.61  | -               | 41,207,170,793.61  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张军红

吴曙明

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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]第 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)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 4,050,844,765.32 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]第 232 号文审核同意，建信添益 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。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)。

#### **6.4.2 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 6.4.4 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制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2019 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 差错更正的说明**

本基金本报告期内未发生会计差错。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税

[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

##### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                  | 与本基金的关系      |
|------------------------|--------------|
| 国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安证券”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）   | 基金销售机构、基金管理人 |

|                        |                 |
|------------------------|-----------------|
| 建信资本管理有限责任公司           | 基金管理人的子公司       |
| 美国信安金融服务公司             | 基金管理人的股东        |
| 中国华电集团资本控股有限公司         | 基金管理人的股东        |
| 中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”） | 基金销售机构、基金管理人的股东 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.8.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.8.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.8.2 关联方报酬

###### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2019年1月1日至2019年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年<br>6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 55,709,626.28                  | 49,375,969.70                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 9,626,782.13                   | 10,211,286.20                       |

注：1、支付基金管理人建信基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活

动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2019年1月1日至2019年6月30日 | 2018年1月1日至2018年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 17,827,080.40        | 15,800,310.37        |

注：支付基金托管人国泰君安证券的托管费按前一日基金资产净值 0.08%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X0.08%/当年天数。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                   |              |               |
|----------------|----------------------|--------------|---------------|
|                | 2019年1月1日至2019年6月30日 |              |               |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费     |              |               |
| 建信现金添益         | 建信添益                 | 合计           |               |
| 国泰君安           | 1,007.24             | 1,437,939.59 | 1,438,946.83  |
| 建设银行           | 559,642.29           | -            | 559,642.29    |
| 建信基金管理有限责任公司   | 648,936.65           | 7,641,985.04 | 8,290,921.69  |
| 合计             | 1,209,586.18         | 9,079,924.63 | 10,289,510.81 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间              |              |               |
|                | 2018年1月1日至2018年6月30日 |              |               |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费     |              |               |
| 建信现金添益         | 建信添益                 | 合计           |               |
| 国泰君安           | 702.82               | 1,476,228.01 | 1,476,930.83  |
| 建设银行           | 634,640.61           | -            | 634,640.61    |
| 建信基金管理有限责任公司   | 240,596.51           | 6,584,063.01 | 6,824,659.52  |
| 合计             | 875,939.94           | 8,060,291.02 | 8,936,230.96  |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月

底，按月支付给建信基金，再由建信基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额和 H 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.01% 和 0.25%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费=前一日基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |        |      |                    |          |       |          |
|---------------------------------------|--------|------|--------------------|----------|-------|----------|
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                    | 债券交易金额 |      | 基金逆回购              |          | 基金正回购 |          |
|                                       | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额               | 利息收入     | 交易金额  | 利息<br>支出 |
| 国泰君安证券                                | -      | -    | 100,000.00<br>0.00 | 6,599.32 | -     | -        |

| 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |        |      |       |      |       |          |
|--|--------|------|-------|------|-------|----------|
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                         | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |          |
|  | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息<br>支出 |
| 国泰君安证券                                     | -      | -    | -     | -    | -     | -        |

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份  
份额单位：份

| 关联方名称  | 建信添益                   |                              |                          |                             |
|--------|------------------------|------------------------------|--------------------------|-----------------------------|
|        | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |                              | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |                             |
|        | 持有的<br>基金份额            | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 (%) | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例<br>(%) |
| 国泰君安证券 | 1,000,313.00           | 0.60                         | 11,600.00                | 0.01                        |

注：分级基金占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各级别的份额。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

无。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,452,878,953.56 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码   | 债券名称     | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量(张)     | 期末估值总额         |
|--------|----------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 150208 | 15 国开 08 | 2019 年 7 月 1 日 | 101.01 | 2,300,000 | 232,323,405.75 |
| 160215 | 16 国开 15 | 2019 年 7 月 1 日 | 100.01 | 2,000,000 | 200,025,419.03 |
| 170205 | 17 国开 05 | 2019 年 7 月 1 日 | 100.81 | 8,900,000 | 897,193,632.14 |
| 180216 | 18 国开 16 | 2019 年 7 月 1 日 | 99.97  | 1,000,000 | 99,966,647.08  |

|        |          |                |       |            |                  |
|--------|----------|----------------|-------|------------|------------------|
| 190302 | 19 进出 02 | 2019 年 7 月 1 日 | 99.76 | 1,000,000  | 99,763,184.58    |
| 合计     |          |                |       | 15,200,000 | 1,529,272,288.58 |

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 06 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 23,677,271,966.79 元，无属于第一层次或第三层次的余额。(2018 年 06 月 30 日：第二层次 20,074,413,538.80 元，无第一层次或第三层次)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

###### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

###### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额                | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|-------------------|--------------|
| 1  | 固定收益投资            | 23,677,271,966.79 | 51.47        |
|    | 其中：债券             | 23,677,271,966.79 | 51.47        |
|    | 资产支持证券            | -                 | -            |
| 2  | 买入返售金融资产          | 6,748,319,172.46  | 14.67        |
|    | 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      | 15,388,868,462.12 | 33.45        |
| 4  | 其他各项资产            | 185,744,376.23    | 0.40         |
| 5  | 合计                | 46,000,203,977.60 | 100.00       |

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 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 | 3.69             |               |
|    | 其中：买断式回购融资   | -                |               |
| 序号 | 项目           | 金额               | 占基金资产净值的比例（%） |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | 1,452,878,953.56 | 3.30          |
|    | 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

注：本基金合同约定：“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 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    | 86  |
| 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 | 63  |

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

### 7.3.2 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                  | 28.38               | 4.56                |
|    | 其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | —                   | —                   |
| 2  | 30 天(含) — 60 天          | 20.14               | —                   |
|    | 其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | —                   | —                   |
| 3  | 60 天(含) — 90 天          | 25.28               | —                   |
|    | 其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | —                   | —                   |
| 4  | 90 天(含) — 120 天         | 4.98                | —                   |
|    | 其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | —                   | —                   |
| 5  | 120 天(含) — 397 天(含)     | 25.40               | —                   |
|    | 其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | —                   | —                   |
| 合计 |                         | 104.18              | 4.56                |

### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注: 本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位: 人民币元

| 序号 | 债券品种                 | 摊余成本              | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------------------|-------------------|---------------|
| 1  | 国家债券                 | 1,197,064,672.76  | 2.72          |
| 2  | 央行票据                 | —                 | —             |
| 3  | 金融债券                 | 1,559,248,218.53  | 3.55          |
|    | 其中: 政策性金融债           | 1,559,248,218.53  | 3.55          |
| 4  | 企业债券                 | 140,027,575.62    | 0.32          |
| 5  | 企业短期融资券              | 2,867,132,812.79  | 6.52          |
| 6  | 中期票据                 | 360,621,781.69    | 0.82          |
| 7  | 同业存单                 | 17,553,176,905.40 | 39.91         |
| 8  | 其他                   | —                 | —             |
| 9  | 合计                   | 23,677,271,966.79 | 53.84         |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | —                 | —             |

### 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位: 人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 债券数量（张）    | 摊余成本             | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|------------|------------------|--------------|
| 1  | 111808283 | 18 中信银行 CD283 | 15,000,000 | 1,493,889,604.16 | 3.40         |
| 2  | 019611    | 19 国债 01      | 11,000,000 | 1,097,309,283.38 | 2.50         |
| 3  | 111807188 | 18 招商银行 CD188 | 10,000,000 | 998,630,662.96   | 2.27         |
| 4  | 111916155 | 19 上海银行 CD155 | 10,000,000 | 993,675,844.78   | 2.26         |
| 5  | 111914090 | 19 江苏银行 CD090 | 10,000,000 | 979,938,913.71   | 2.23         |
| 6  | 170205    | 17 国开 05      | 8,900,000  | 897,193,632.14   | 2.04         |
| 7  | 111806238 | 18 交通银行 CD238 | 6,000,000  | 598,545,644.32   | 1.36         |
| 8  | 111995971 | 19 宁波银行 CD062 | 5,000,000  | 499,057,629.25   | 1.13         |
| 9  | 111808265 | 18 中信银行 CD265 | 5,000,000  | 498,830,114.11   | 1.13         |
| 10 | 111997741 | 19 宁波银行 CD090 | 5,000,000  | 498,112,939.00   | 1.13         |

### 7.7 “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                   | 0.1717% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0304% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0990% |

#### 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。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

无。

### 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1 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。

### 7.9.2

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。

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额             |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | -              |
| 2  | 应收证券清算款 | -              |
| 3  | 应收利息    | 127,688,145.51 |
| 4  | 应收申购款   | 58,056,230.72  |
| 5  | 其他应收款   | -              |
| 6  | 待摊费用    | -              |
| 7  | 其他      | -              |
| 8  | 合计      | 185,744,376.23 |

### 7.9.4 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额<br>级别       | 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有<br>的基金份<br>额 | 持有人结构             |                |                   |                |
|----------------|------------------|-------------------|-------------------|----------------|-------------------|----------------|
|                |                  |                   | 机构投资者             |                | 个人投资者             |                |
|                |                  |                   | 持有份额              | 占总份额<br>比例 (%) | 持有份额              | 占总份额比<br>例 (%) |
| 建信<br>现金<br>添益 | 542,154          | 50,499.39         | 15,920,565,086.04 | 58.15          | 11,457,878,742.06 | 41.85          |
| 建信<br>添益       | 11,611           | 14,295.26         | 112,668,777.09    | 67.88          | 53,313,510.91     | 32.12          |

|    |         |           |                   |       |                   |       |
|----|---------|-----------|-------------------|-------|-------------------|-------|
| 合计 | 553,765 | 49,740.28 | 16,033,233,863.13 | 58.21 | 11,511,192,252.97 | 41.79 |
|----|---------|-----------|-------------------|-------|-------------------|-------|

注:分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

建信现金添益

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额(份) | 占上市总份额比例(%) |
|----|-------|---------|-------------|
| -  | -     | -       | -           |

建信添益

| 序号 | 持有人名称                                  | 持有份额(份)      | 占上市总份额比例(%) |
|----|--|--------------|-------------|
| 1  | 瑞士信贷(香港)有限公司                           | 4,568,260.00 | 2.75        |
| 2  | 兴业国际信托有限公司—兴业信托·兴享进取高毅利伟1号证券投资集合资金信托计划 | 2,376,802.00 | 1.43        |
| 3  | DEUTSCHE BANK AKTIENGESELLSCHAFT       | 2,251,438.00 | 1.36        |
| 4  | 泰康人寿保险有限责任公司—投连—创新动力                   | 2,218,095.00 | 1.34        |
| 5  | 基本养老保险基金一二零四组合                         | 2,088,511.00 | 1.26        |
| 6  | 汇安基金—浙商银行—汇安基金—湖畔1号资产管理计划              | 2,014,105.00 | 1.21        |
| 7  | 西南证券股份有限公司                             | 1,515,032.00 | 0.91        |
| 8  | 招商证券股份有限公司                             | 1,508,030.00 | 0.91        |
| 9  | 申万菱信基金—民生银行—申万菱信基金申菱指数增强资产管理计划         | 1,500,395.00 | 0.90        |
| 10 | 太平资产—工商银行—太平之星21号投资产品                  | 1,376,052.00 | 0.83        |

无。

注:持有人为场内持有人。

## 8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额(份)        | 占总份额比例(%) |
|----|-------|----------------|-----------|
| 1  | 其他机构  | 741,031,763.16 | 2.69      |
| 2  | 其他机构  | 641,024,002.88 | 2.33      |
| 3  | 银行类机构 | 570,492,897.21 | 2.07      |
| 4  | 银行类机构 | 557,917,032.23 | 2.03      |
| 5  | 银行类机构 | 539,828,500.20 | 1.96      |
| 6  | 银行类机构 | 528,075,413.72 | 1.92      |

|    |       |                |      |
|----|-------|----------------|------|
| 7  | 银行类机构 | 526,879,728.74 | 1.91 |
| 8  | 信托类机构 | 516,768,992.34 | 1.88 |
| 9  | 银行类机构 | 511,996,303.25 | 1.86 |
| 10 | 银行类机构 | 508,553,778.79 | 1.85 |

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别   | 持有份额总数(份)    | 占基金总份额比例(%) |
|------------------|--------|--------------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 建信现金添益 | 9,942,944.79 | 0.04        |
|                  | 建信添益   | 0.00         | 0.00        |
|                  | 合计     | 9,942,944.79 | 0.04        |

#### 8.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别   | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|--------------------------------|--------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 建信现金添益 | 0~10              |
|                                | 建信添益   | -                 |
|                                | 合计     | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 建信现金添益 | 0~10              |
|                                | 建信添益   | -                 |
|                                | 合计     | 0~10              |

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                               | 建信现金添益            | 建信添益           |
|----------------------------------|-------------------|----------------|
| 基金合同生效日<br>(2016年9月2日)<br>基金份额总额 | 270,081,765.32    | 37,807,630.00  |
| 本报告期期初基金份额总额                     | 25,128,563,576.64 | 189,236,755.86 |
| 本报告期基金总申购份额                      | 28,765,309,727.34 | 110,331,881.31 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                    | 26,515,429,475.88 | 133,586,349.17 |
| 本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)         | -                 | -              |
| 本报告期期末基金份额                       | 27,378,443,828.10 | 165,982,288.00 |

|     |  |  |
|-----|--|--|
| 额总额 |  |  |
|-----|--|--|

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期, 本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

经本基金管理人建信基金管理有限责任公司第五届董事会第五次临时会议审议通过, 自 2019 年 3 月 13 日起, 曲寅军不再担任建信基金管理有限责任公司首席投资官(副总裁)。上述事项本公司已按相关规定报中国证券监督管理委员会北京监管局和中国证券投资基金业协会备案并于 2019 年 3 月 16 日公告。

报告期内, 本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今, 本报告期内会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责, 以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内, 本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

| 券商名称 | 交易单<br>元数量 | 股票交易 |                  | 应支付该券商的佣金 |                        | 备注 |
|------|------------|------|------------------|-----------|------------------------|----|
|      |            | 成交金额 | 占当期股票成<br>交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣<br>金<br>总量的比<br>例 |    |
| 国泰君安 | 2          | -    | -                | -         | -                      | -  |

注:1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

- (1) 财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为。
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- (3) 具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务。
- (4) 佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本基金本报告期末新增和剔除交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |                      | 债券回购交易             |                            | 权证交易 |                          |
|------|------|----------------------|--------------------|----------------------------|------|--------------------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额               | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额 | 占当期权<br>证<br>成交总额<br>的比例 |
| 国泰君安 | -    | -                    | 151,738,533,000.00 | 100.00%                    | -    | -                        |

>

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

建信基金管理有限责任公司

2019 年 8 月 29 日