建信货币市场基金

2017 第四季度 报告

2017年12月31日

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：2018年1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2018年1月18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10月1日起至12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	3,551,567,417.19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	综合运用宏观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，具体内容，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	2,526,147,433.99份	1,025,419,983.20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10月1日 - 2017年12月31日）	
	建信货币A	建信货币B
1.本期已实现收益	29,093,008.91	17,581,868.76
2.本期利润	29,093,008.91	17,581,868.76
3.期末基金资产净值	2,526,147,433.99	1,025,419,983.20

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

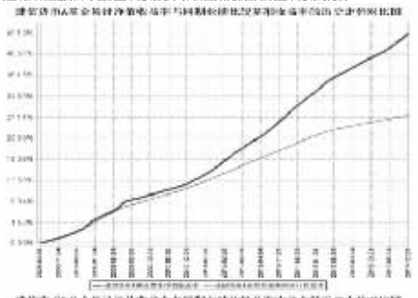
建信货币A

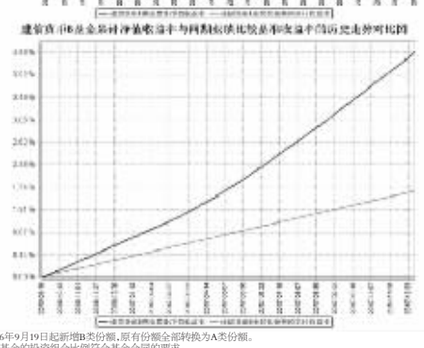
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0122%	0.0007%	0.3277%	0.0000%	0.6845%	0.0007%

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	1.0735%	0.0007%	0.3277%	0.0000%	0.7458%	0.0007%

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	-	9	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 都金元比联基金管理公司 ）任债券研究员；2011年6月加入兵公司，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日起任建信双理安心理财债券基金的基金经理；2014年6月17日起任建信嘉泰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	-	10	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、原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日起任建信嘉泰宝货币市场基金基金经理；2014年6月17日起任建信现金添利货币基金的基金经理；2014年9月17日起任建信双理安心理财债券基金的基金经理；2016年5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；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6月21日起任建信现金盈安类货币市场基金的基金经理；2016年9月13日至2018年1月15日任建信增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。
高珊	本基金的基金经理	2013年12月20日	-	11	硕士，2006年7月至2007年4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6月28日起任建信双理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日起任建信理财安心理财债券型证券投资基金基金经理；2015年8月25日起任建信现金添利货币市场基金基金经理；2016年6月13日至2017年6月19日任建信鑫瑞回报灵活配置混合基金经理；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》、《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，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2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

回顾2017年4季度，债券市场继续下跌，跌幅加大且超出预期，收益率整体呈现平坦化上行，其中金融债上行50~70bp，国债上行20~30bp，短端以同业存单、同业存款为代表的资产利率上行幅度高达100bp。总体而言，监管压力加大，大环境仍偏偏资金结构失衡矛盾加剧，是带来利率调整的主要原因。

经济基本面表现出一定的韧性。一方面，供给侧改革支撑上游工业品价格大涨，企业微观经营环境在改善，土地供给增加也延缓地产投资下滑，整体来看需求回落的程度低于预期；另一方面，表外融资层受监管影响出现萎缩，但需求回表的迹象比较明显，下半年以来信贷增速强于季节性，信贷在社会融资规模中占比也回到高位。

监管政策陆续落地，集中发力影响超预期。4季度最重要的变量就是监管，先后有3个金融监管政策出台，影响深远。其一，公募基金流动性风险管理规定从10月开始进入执行阶段，负债端管控持有人集中度、资产端限制持仓集中度，对于单一主体的存款、存单、债券进行合并计算控制，对于AA+主体总体持仓比例限制在10%以内，整体方向是降低期限错配和风险错配；其二，资管新规出台，在规范资金池、消除多层嵌套、穿透管理、限制分级、控制投资集中度和杠杆等方面都做了更严格的界定，并要求以公允价值原则进行净值管理，以举报等手段促进打破刚兑，这相当于改变了游戏规则，未来理财产品的滚动续作模式面临整顿；其三，商业银行流动性风险管理办法出台，除了原本的流动性覆盖率、流动性比例等监管指标外，新增流动性匹配率、净稳定资金比例、优质流动性资产充足率等指标，鼓励银行回归传统存贷本源，降低对同业批发融资的依赖，抑制期限错配，防范流动性风险。这些监管政策将对表内表外资金的负债结构产生深远影响，并带动资产端的调整压力，预计在未来一段时间内这种影响还将继续得以体现。

央行呵护流动性的同时，对资金波动的容忍度在提升。一方面，央行启动边期普惠降准，公开市场上提前供给跨年逆回购资金，为了应对春节备付，建立2个百分点的临时准备金动用安排，央行动用各种灵活手段，以补充年底以及春节的流动性缺口，整体态度是呵护的；另一方面，监管压力下，大环境仍偏偏资金结构失衡的矛盾在年底得以充分体现，同业存单、同业存款利率持续飙升，调整幅度高达100bp以上，而央行并未跟出窗口指导，可见其对资金波动的容忍度是在提升的。

4季度资金面趋紧，方向上符合我们的预期，幅度上略超我们的预期，本基金此前在4季度布局了充分的流动性资金，比较有利于我们捕捉利率的波动机会。具体运作方面，一方面密切跟踪负债端持有人结构的变化，及时了解申赎资金动向，以保证流动性的充分应对；另一方面，根据资金市场的调整幅度，充分对比线上线下、场内场外、一级二级各种资产价格，逐步锁定部分超调的跨年资产，适当增加剩余期限分布，合理安排估值资产的持仓占比，以控制偏离风险。总体而言，本基金在保证年底流动性充分应对的基础上，努力捕捉预期差带来的超调机会，积极增厚组合的绝对收益，为投资者实现了较好的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期建信货币A基金净值增长率1.0122%，波动率0.0007%，建信货币B基金净值增长率1.0735%，波动率0.0007%；业绩比较基准收益率0.3277%，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	1,051,998,499.93	28.78
	其中：债券	1,051,998,499.93	28.78
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	585,546,833.71	16.02
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	436,666,415.39	11.95
3	银行存款和结算备付金合计	1,936,953,040.63	53.00
4	其他资产	80,186,759.26	2.19
5	合计	3,654,685,133.53	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	5.29
	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	99,989,650.01	2.82
	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	71
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	73
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	39

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	36.95	2.82
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	7.84	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	32.00	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	5.61	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天（含）	18.24	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.65	2.82

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务投资组合

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	279,905,709.22	7.88
	其中：政策性金融债	279,905,709.22	7.88
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	772,092,790.71	21.74
8	其他	-	-
9	合计	1,051,998,499.93	29.62
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	111788113	17宁波银行CD210	1,000,000	99,530,667.27	2.80
2	111709483	17浦发银行CD483	1,000,000	99,132,406.19	2.79
3	111716276	17上海银行CD276	1,000,000	99,127,267.97	2.79
4	111771497	17广州银行CD102	1,000,000	97,629,036.24	2.75
5	150201	15国开01	800,000	79,998,640.98	2.25
6	111783477	17重庆农村商行CD166	800,000	79,454,119.74	2.24
7	170301	17进出01	600,000	59,977,662.63	1.69
8	170203	17国开03	500,000	49,990,118.67	1.41
9	150309	15进出09	500,000	49,981,614.95	1.41
10	111786411	17长沙银行CD104	500,000	49,904,135.23	1.41

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	0.0159%
报告期内偏离度的最低值	-0.0309%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0111%

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1.00000元。

5.9.2

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，上海银行股份有限公司于2017年8月11日公告；因未按规定严格审查基金资产投向，信托资金违规用于异地融资平台，中国银行业监督管理委员会上海监管局依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项处以罚金人民币50万元。沪银监罚决字〔2017〕26号。

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	-
3	应收利息	22,308,009.71
4	应收申购款	57,878,749.55
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	80,186,759.26

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	3,052,914,557.40	1,534,684,255.48
报告期期间基金总申购份额	1,188,673,009.26	2,885,379,270.15
报告期期间基金总赎回份额	1,715,440,132.67	3,394,643,542.43
报告期期末基金份额总额	2,526,147,433.99	1,025,419,983.20

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 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
2018年1月22日

建信积极配置混合型证券投资基金

2017 第四季度 报告

2017年12月31日

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：2018年1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2018年1月18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10月1日起至12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	87,519,753.75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，同时将产谨，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、个股投资策略，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：55%×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10月1日 - 2017年12月31日）
1.本期已实现收益	-2,986,707.62
2.本期利润	-6,444,307.52
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0713
4.期末基金资产净值	185,706,429.88
5.期末基金份额净值	2.122

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。

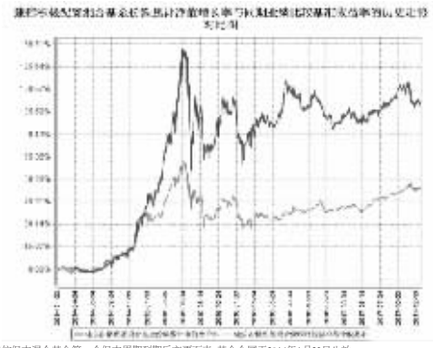
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-3.37%	0.74%	2.40%	0.44%	-5.77%	0.30%

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		
姚维	权益投资部总经理、本基金的基金经理	2014年1月23日	-	13	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，权益投资部副总监兼研究部首席策略分析师，权益投资部总监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基金经理，2012年4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基金经理，姚维博士担任该基金的基金经理；2017年6月9日起任建信核心精选混合型证券投资基金基金经理。

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，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》、《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，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2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

2017年四季度，虽然国内对于宏观经济的预期并不明朗，但海外需求不断超预期，以铜为代表的工业金属表现较好。国内受限产影响，钢铁、水泥等行业盈利创新高。

四季度股票市场呈现出明显的结构性行情，以贵州茅台为代表的稳定增长类股票，其股票价格创新高，主要带动因素是盈利超预期和产品价格上涨预期。而出于对资管新规的不明确解读，以金融为代表的行业带动市场先涨后跌。四季度在部分消费类股票创新高之后，本基金认为其短期估值中枢基本合理，选择实现收益，本基金较为看好供给侧改革周期龙头和制造业龙头企业盈利增长的稳定性，以及在资管新规出台之后，表外资产透明化带来银行表外环账预期修复的空间。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-3.37%，波动率0.74%，业绩比较基准收益率2.4%，波动率0.44%。

§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	112,624,284.51	49.67
	其中：股票	112,624,284.51	49.67
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	40,000,000.00	17.64
	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	74,021,967.59	32.64
8	其他资产	105,031.48	0.05
9	合计	226,751,283.58	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	-	-
B	采矿业	6,579,295.00	3.54
C	制造业	49,843,861.37	26.84
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	8,133,559.20	4.38
G	交通运输、仓储和邮政业	1,945,436.00	1.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,856,039.94	4.23
J	金融业	22,841,974.00	12.30
K	房地产业	3,834,650.00	2.06
L	租赁和商务服务业	11,589,469.00	6.24
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	112,624,284.51	60.65

以上行业分类以2017年12月31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

本基金本报告期末投资沪港通股票。

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	601888	中国国旅	267,100	11,589,469.00	6.24
2	600887	伊利股份	304,920	9,815,374.80	5.29
3	300081	恒信东方	799,760	8,133,559.20	4.38
4	002624	完美世界	234,789	7,856,039.94	4.23
5	600872	中炬高新	292,103	7,232,470.28	3.89
6	601088	中国神华	267,100	6,188,707.00	3.33
7	600000	浦发银行	400,100	5,037,259.00	2.71
8	600438	通威股份	365,900	4,431,049.00	2.39
9	600201	生物股份	133,800	4,246,812.00	2.29
10	600019	宝钢股份	484,700	4,187,808.00	2.26

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	62,622.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,809.06
5	应收申购款	24,600.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	105,031.48

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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

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

项目	
报告期期初基金份额总额	94,484,669.85
报告期期间基金总申购份额	1,224,592.03
减:报告期期间基金总赎回份额	8,189,508.13
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	87,519,753.75

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

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

本基金本报告期末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
2018年1月22日

华泰紫金天天金交易型货币市场基金

2017 第四季度 报告

2017年12月31日

基金管理人：华泰证券(上海)资产管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2018年01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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年1月18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。

本报告期自2017年10月1日起至12月31日止。

§2基金产品概况

基金简称	华泰紫金天天金交易型货币ETF
场内简称	华泰天金
基金主代码	511670
基金运作方式	契约型开放（ETF）
基金合同生效日	2017年08月11日
报告期末基金份额总额	4,870,443,204.34份
投资目标	在保持基金良好流动性和基金财产的低风险的原则下，追求高于同期基准的稳定收益。
投资策略	本基金将在广配置和精选个券相结合，自动态调整现金类资产与固定收益类资产的投资比例的基础上，精选优质个券和稳健投资组合，在严格控制风险的基础上，实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种，本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	华泰证券(上海)资产管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	华泰紫金天天金货币ETF	华泰紫金天天金货币ETF联
下属分级基金的场内简称	华泰天金	华泰天金
下属分级基金的交易代码	511670	000749
报告期末下属分级基金的份额总额	1,655,883,691.88份	3,214,559,512.46份

注：本基金场内基