

中信建投货币市场基金 2016 年第 4 季度报 告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：中信建投基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 1 月 20 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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 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 2016 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中信建投货币
交易代码	000738
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 8 月 5 日
报告期末基金份额总额	70,297,478.58 份
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将通过对宏观经济发展态势、金融监管政策、财政与货币政策、市场及其结构变化和短期的资金供需等因素的分析，形成对市场短期利率走势的判断。在以上分析的基础上，本基金将根据不同类别资产的收益率水平（不同剩余期限到期收益率、利息支付方式以及再投资便利性），结合各类资产的流动性特征（日均成交量、交易方式、市场流量）和风险特征（信用等级、波动性），决定各类资产的配置比例和期限匹配情况。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中低风险的品种，其长期平均的风险和预期收益率低于股票基金、混合基金和债券基金。
基金管理人	中信建投基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司

§ 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（2016年10月1日—2016年12月31日）
1. 本期已实现收益	315,685.41
2. 本期利润	315,685.41
3. 期末基金资产净值	70,297,478.58

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、本基金的利润分配按日结转基金份额。

3、持有人认购或交易本基金时，不需缴纳任何费用。

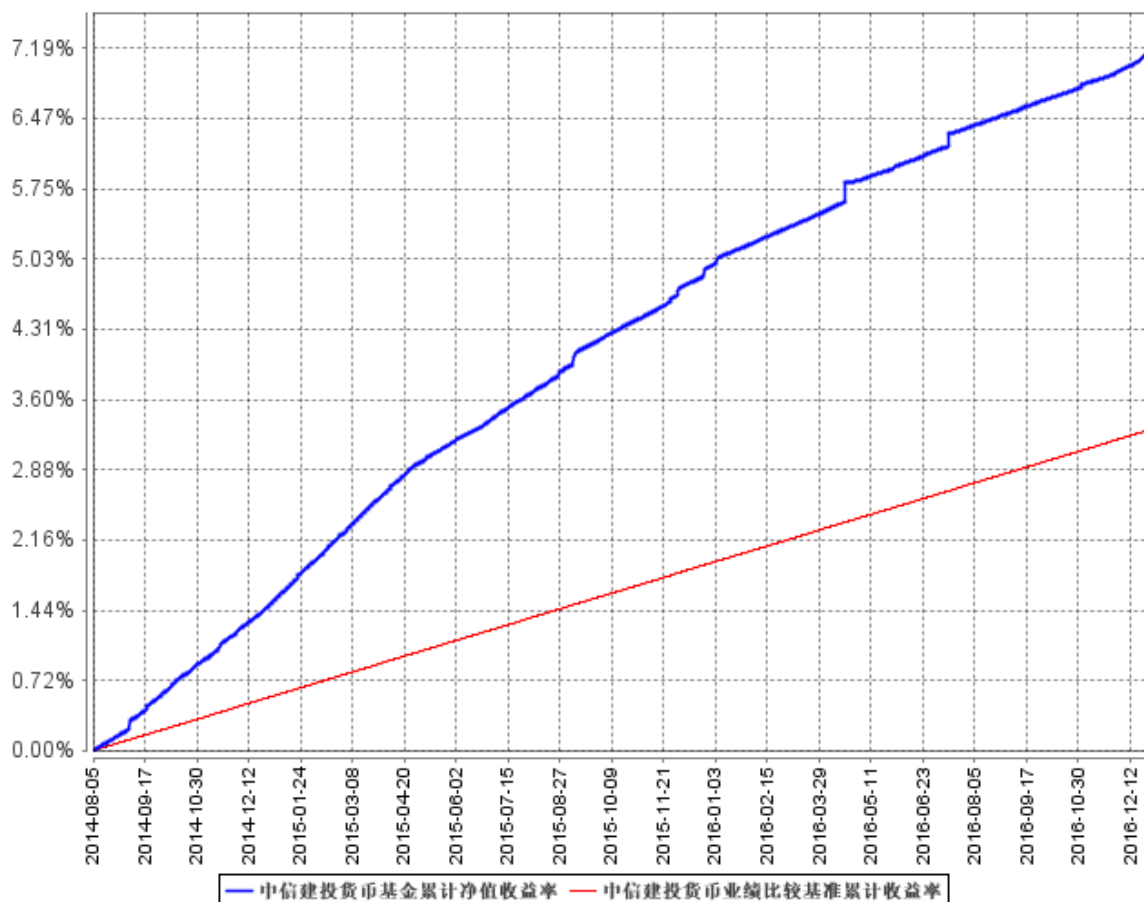
3.2 基金净值表现

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

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	0.5049%	0.0035%	0.3450%	0.0000%	0.1599%	0.0035%

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

中信建投货币基金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



§ 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		
黄海浩	本基金的基金经理	2016年5月25日	-	5	中国籍,1985年10月生,山东大学工学学士。2007年9月至2010年10月在平安利顺货币经纪公司担任交易员,从事美元拆借货币经纪、债券货币经纪交易工作;2010年11月至2014年1月在国投瑞银基金管理有限公司担任交易员,从事债券交

					易工作；2014 年 10 月至今任职于中信建投基金管理有限公司投资研究部，先后从事交易、证券投资研究分析工作，担任中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金、中信建投货币市场基金、中信建投凤凰货币市场基金、中信建投添鑫宝货币市场基金、中信建投稳裕定期开放债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内，未出现涉及本基金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 5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年四季度，固定资产投资同比增速出现改善。固定资产投资累计同比增速由 8 月的 8.1% 提高至 11 月的 8.3%。经济增速的稳定和固定资产投资的回升都表明，货币政策不需要加大刺激

力度，中性和流动性的基本稳定是四季度以来的货币政策主线。债券市场上，四季度货币市场利率中枢继续抬升和利率波动继续加大，并在 12 月份引发了流动性的极度紧张。在坚持审慎操作、确保组合投资安全性的前提下，我们加强流动性风险管理，努力为投资者创造合理稳定的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期份额净值收益率为 0.5049%，同期业绩比较基准收益率为 0.3450%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期末发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 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	21,322,327.57	30.15
	其中：债券	20,868,427.57	29.51
	资产支持证券	453,900.00	0.64
2	买入返售金融资产	41,160,149.10	58.21
	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	7,955,878.46	11.25
4	其他资产	272,750.30	0.39
5	合计	70,711,105.43	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	0.19	
	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	-	-
	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资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金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

报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额均未超过基金资产净值的 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	85
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

本报告期内本基金未发生投资组合平均剩余期限超过 120 天的情形。

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	41.76	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	7.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	20.36	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	69.25	-

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

本报告期内本基金未发生投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情形。

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	3,016,193.69	4.29
	其中：政策性金融债	3,016,193.69	4.29
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	9,001,592.28	12.81
6	中期票据	-	-
7	同业存单	8,850,641.60	12.59
8	其他	-	-
9	合计	20,868,427.57	29.69
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	111695525	16 包商银行 CD042	90,000	8,850,641.60	12.59
2	011699768	16 福耀玻璃 SCP003	50,000	5,003,589.93	7.12
3	011697010	16 沪华信 SCP006	40,000	3,998,002.35	5.69
4	140401	14 农发 01	20,000	2,002,954.01	2.85
5	140347	14 进出 47	10,000	1,013,239.68	1.44

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	0.0397%
报告期内偏离度的最低值	-0.1941%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0483%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未出现负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

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	债券代码	债券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1689159	16 紫鑫 1A	10,000	453,900.00	0.65

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。本基金通过每日计算收益并分配的方式，使基金份额净值始终保持在 1.0000 元。

5.9.2

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体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。

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	272,430.30
4	应收申购款	320.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	272,750.30

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	61,015,920.37
报告期期间基金总申购份额	43,816,035.58
报告期期间基金总赎回份额	34,534,477.37
报告期期末基金份额总额	70,297,478.58

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投资份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	红利再投	2016年10月10日	7,680.77	0.00	0.00%
2	红利再投	2016年10月11日	768.03	0.00	0.00%
3	红利再投	2016年10月12日	757.11	0.00	0.00%
4	红利再投	2016年10月13日	760.38	0.00	0.00%
5	红利再投	2016年10月14日	761.42	0.00	0.00%
6	红利再投	2016年10月17日	2,288.59	0.00	0.00%
7	红利再投	2016年10月18日	763.84	0.00	0.00%
8	红利再投	2016年10月19日	766.85	0.00	0.00%
9	红利再投	2016年10月20日	770.31	0.00	0.00%
10	红利再投	2016年10月21日	722.17	0.00	0.00%
11	红利再投	2016年10月24日	2,190.50	0.00	0.00%
12	红利再投	2016年10月25日	769.45	0.00	0.00%
13	红利再投	2016年10月26日	844.92	0.00	0.00%
14	红利再投	2016年10月27日	1,604.54	0.00	0.00%
15	红利再投	2016年10月28日	726.29	0.00	0.00%
16	红利再投	2016年10月31日	2,472.31	0.00	0.00%
17	红利再投	2016年11月1日	820.96	0.00	0.00%
18	红利再投	2016年11月2日	827.88	0.00	0.00%
19	红利再投	2016年11月3日	5,827.32	0.00	0.00%

20	红利再投	2016 年 11 月 4 日	778.08	0.00	0.00%
21	红利再投	2016 年 11 月 7 日	2,277.55	0.00	0.00%
22	红利再投	2016 年 11 月 8 日	790.23	0.00	0.00%
23	红利再投	2016 年 11 月 9 日	671.25	0.00	0.00%
24	红利再投	2016 年 11 月 10 日	672.36	0.00	0.00%
25	红利再投	2016 年 11 月 11 日	673.53	0.00	0.00%
26	红利再投	2016 年 11 月 14 日	1,421.46	0.00	0.00%
27	红利再投	2016 年 11 月 15 日	763.08	0.00	0.00%
28	红利再投	2016 年 11 月 16 日	815.48	0.00	0.00%
29	红利再投	2016 年 11 月 17 日	782.34	0.00	0.00%
30	红利再投	2016 年 11 月 18 日	821.96	0.00	0.00%
31	红利再投	2016 年 11 月 21 日	2,506.48	0.00	0.00%
32	红利再投	2016 年 11 月 22 日	785.52	0.00	0.00%
33	红利再投	2016 年 11 月 23 日	820.38	0.00	0.00%
34	红利再投	2016 年 11 月 24 日	810.28	0.00	0.00%
35	红利再投	2016 年 11 月 25 日	874.79	0.00	0.00%
36	红利再投	2016 年 11 月 28 日	2,573.30	0.00	0.00%
37	红利再投	2016 年 11 月 29 日	978.56	0.00	0.00%
38	红利再投	2016 年 11 月 30 日	1,087.06	0.00	0.00%
39	红利再投	2016 年 12 月 1 日	1,618.52	0.00	0.00%
40	红利再投	2016 年 12 月 2 日	1,335.11	0.00	0.00%
41	红利再投	2016 年 12 月 5 日	3,930.05	0.00	0.00%

42	红利再投	2016 年 12 月 6 日	1,284.16	0.00	0.00%
43	红利再投	2016 年 12 月 7 日	1,195.06	0.00	0.00%
44	红利再投	2016 年 12 月 8 日	776.90	0.00	0.00%
45	红利再投	2016 年 12 月 9 日	1,029.06	0.00	0.00%
46	红利再投	2016 年 12 月 12 日	3,089.78	0.00	0.00%
47	红利再投	2016 年 12 月 13 日	1,018.52	0.00	0.00%
48	红利再投	2016 年 12 月 14 日	1,002.46	0.00	0.00%
49	红利再投	2016 年 12 月 15 日	1,069.16	0.00	0.00%
50	红利再投	2016 年 12 月 16 日	1,388.05	0.00	0.00%
51	红利再投	2016 年 12 月 19 日	4,738.45	0.00	0.00%
52	红利再投	2016 年 12 月 20 日	1,658.35	0.00	0.00%
53	红利再投	2016 年 12 月 21 日	986.04	0.00	0.00%
54	红利再投	2016 年 12 月 22 日	3,821.79	0.00	0.00%
55	红利再投	2016 年 12 月 23 日	1,733.25	0.00	0.00%
56	红利再投	2016 年 12 月 26 日	5,200.17	0.00	0.00%
57	红利再投	2016 年 12 月 27 日	2,156.99	0.00	0.00%
58	红利再投	2016 年 12 月 28 日	2,052.56	0.00	0.00%
59	红利再投	2016 年 12 月 29 日	2,054.30	0.00	0.00%
60	红利再投	2016 年 12 月 30 日	2,054.46	0.00	0.00%
合计			98,220.52	0.00	

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2016 年 12 月 22 日发布《中信建投基金管理有限公司关于修订旗下货币市场基金〈基金合同〉和〈托管协议〉的公告》、《中信建投货币市场基金基金合同》、《中信建投货币市场基金托管协议》。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《中信建投货币市场基金基金合同》；
- 3、《中信建投货币市场基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司
2017 年 1 月 20 日