

财通资管鑫管家货币市场基金 2016 年第 4 季度报告

2016-12-31

基金管理人：财通证券资产管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2017-01-21

目录全部展开 目录全部收拢

重要提示

基金产品概况

基金基本情况

主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标

基金净值表现

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

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

管理人报告

基金经理（或基金经理小组）简介

管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

异常交易行为的专项说明

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内基金的业绩表现

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

报告期债券回购融资情况

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%

投资组合平均剩余期限基本情况

期末投资组合平均剩余期限分布比例

期末按债券品种分类的债券投资组合

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

“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

投资组合报告附注

基金计价方法说明

本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券说明

受到调查以及处罚情况

期末其他各项资产构成

投资组合报告附注的其他文字描述部分

开放式基金份额变动

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

备查文件目录

备查文件目录

存放地点

查阅方式

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 1 月 19 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 25 日起至 12 月 31 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金简称

财通资管鑫管家货币

场内简称

基金主代码

003479

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2016-10-25

报告期末基金份额总额

4,433,883,823.84

投资目标

在力求保持基金资产安全性与较高流动性的基础上，追求稳定的当前收益。

投资策略

本基金主要为投资人提供现金管理工具，通过积极的投资组合管理，同时充分把握市场短期失衡带来的套利机会，在安全性、流动性和收益性之间寻求最佳平衡点。

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（税后）

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高流动性、低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

基金管理人

财通证券资产管理有限公司

基金托管人
中国银行股份有限公司
下属 2 级基金的基金简称
财通资管鑫管家货币 A
财通资管鑫管家货币 B
下属 2 级基金的场内简称
下属 2 级基金的交易代码
003479
003480
报告期末下属 2 级基金的份额总额
212,520,003.8
4,221,363,820.04
主要财务指标
单位：人民币元
项目
主基金(元)
A(元)
2016-10-25 - 2016-12-31
B(元)
2016-10-25 - 2016-12-31
本期已实现收益
2,879,436.4
20,522,053.39
本期利润
2,879,436.4
20,522,053.39
期末基金资产净值
212,520,003.8
4,221,363,820.04

注：1、本期间本基金无持有人认购或交易的各项费用。

2、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。

3、本基金按日结转份额。

4、本基金合同于 2016 年 10 月 25 日生效，合同当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

基金净值表现

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

-%

-%

-%

-%

-%

-%

-%

-%

-%

-%

-%

-%

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 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

自基金合同生效日起至今

0.5401%

0.0016%

0.2515%

0.0000%

0.2886%

0.0016%

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 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

自基金合同生效日起至今

0.5857%

0.0016%

0.2515%

0.0000%

0.3342%

0.0016%

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

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
A

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
B

注：1、本基金合同于 2016 年 10 月 25 日生效，截止报告期末本基金合同生效未满一年。
2、按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。
3、自基金合同生效至报告期末，财通资管鑫管家货币基金 A 类基金份额净值增长率为 0.5401%，同期业绩比较基准收益率为 0.2515%；财通资管鑫管家货币市场基金 B 类基金份额净值增长率为 0.5857%，同期业绩比较基准收益率为 0.2515%。

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

张波

本基金基金经理、财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金基金经理

2016-10-25

-

7

中南财经政法大学财政学学士。2007 年 8 月至 2013 年 8 月期间，于平安资产管理有限公司担任集中交易部债券交易员，2014 年 7 月至 2016 年 5 月期间，担任平安养老保险股份有限公司资产管理事业部债券交易员。

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，首任基金经理任职日期为基金合同生效日期。

2、证券从业的涵义遵守行业协会《证券从业人员资格管理办法》相关规定。

报告期内本基金运作合规守信情况说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《财通资管鑫管家货币市场基金基金合同》、《财通资管鑫管家货币市场基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

公平交易专项说明

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《财通证券资产管理有限公司公平交易管理办法》等规定。

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。

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。

报告期内基金的投资策略和运作分析

近期全球经济有所企稳,美国经济在居民加杠杆以及特朗普政策刺激预期下逐步回升;日元和欧元区汇率贬值使得其出口有所改善;国内经济 L 型企稳和通胀预期的背景下,政策从稳增长转向去杠杆防风险。在国内外因素影响下,4 季度发生了钱荒和债市调整,10 年期国债估值收益率从 10 月下旬的 2.64%大幅走到 12 月下旬的 3.36%。

央行召开四季度货币政策委员会例会,强调了美国经济复苏加快,新兴经济面临更多挑战。中国货币政策将保持中性,维护流动性基本稳定。四季度资金紧张的天数和利率的波动都大于 2016 年前三季度。同业存单四季度以来收益率上行达到 70-100bp。大型股份制银行期限稍长品种收益率达到 4.4%-4.5%,一个月品种达到 4.8%-5%。90 天期限 AAA 超短融 10 月上旬一级发行利率在 3%以下,12 月中旬一级发行利率已上行 100bp。12 月中旬长久期利率债大幅下跌叠加代持事件的发酵,商业银行限制了与非银机构的融资,资金面急剧紧张。信用债收益率整体上行了 150bp 以上,机构去杠杆现象显著。12 月下旬央行公开市场投放了较大的资金,并且指导商业银行向非银行机构融出资金,回购利率有较大幅度下行,跨年资金供需情况有所平衡。

本基金四季度保持了较好的流动性。在市场资金极度紧张,较大比重的货币基金因资产端债券和同业存单收益率上行可能导致负偏离度超标的情况下,本基金仍然将偏离度维持在较小波动范围内。

展望 2017 年一季度,资金面波动会继续加大。本基金在操作上会有更多时间节点带来的机会。短期债券资产对于目前经济、通胀预期和市场情绪等方面起到一定防御作用,我们会精选个券以期达到增厚组合收益,抵御流动性波动的目的。

报告期内基金的业绩表现

自基金合同生效至报告期末,财通资管鑫管家货币基金 A 类基金份额净值增长率为 0.5401%,同期业绩比较基准收益率为 0.2515%;财通资管鑫管家货币市场基金 B 类基金份额净值增长率为 0.5857%,同期业绩比较基准收益率为 0.2515%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

投资组合报告

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

737,743,362.1

16.09

其中:债券

737,743,362.1

16.09

资产支持证券

-

-

2

买入返售金融资产

3,231,742,031.15

70.49

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

608,116,558.38

13.26

4

其他各项资产

7,209,890.32

0.16

5

合计

4,584,811,841.95

100

注：1.在报告期内，根据流动性管理的需要，本基金提前支取了部分可提前支取且没有利息损失的存款。

2.由于四舍五入的原因，期末市值占期末总资产比例的分项之和与合计可能有尾差。

报告期债券回购融资情况

序号

项目

金额（元）

占基金资产净值的比例（%）

1

报告期内债券回购融资余额

-

3.42

其中：买断式回购融资

-

-

2

报告期末债券回购融资余额

148,499,577.25

3.35

其中：买断式回购融资

-

-

注：上表中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个交易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

注：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

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

31

报告期内投资组合平均剩余期限最高值

57

报告期内投资组合平均剩余期限最低值

0

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

序号

发生日期

平均剩余期限（天数）

原因

调整期

-

-

-

-

-

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

80.96

3.35

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

2

30 天(含)—60 天

2.26

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-
3
60天(含)—90天
6.28
-
其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债
-
-
4
90天(含)—180天
6.76
-
其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债
-
-
5
180天(含)—397天(含)
6.99
-
其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债
-
-
合计
103.24
3.35
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
1,000.9
-
2
央行票据
-
-
3
金融债券
-
-
其中：政策性金融债
-

-
4
企业债券
-
-
5
企业短期融资券
389,604,792.13
8.79
6
中期票据
-
-
7
同业存单
348,137,569.07
7.85
8
其他
-
-
9
合计
737,743,362.10
16.64
10
剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券
-
-

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

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

011698776

16 珠海华发 SCP007

1,000,000

99,924,393.75

2.25

2

111682039

16 嘉兴银行 CD067

1,000,000

99,854,013.28

2.25

3

111607173

16 招行 CD173

1,000,000

99,374,764.65

2.24

4

111697893

16 南京银行 CD112

1,000,000

99,179,946.35

2.24

5

041654069

16 大秦铁路 CP002

700,000

69,956,708.7

1.58

6

011698819

16 潞安 SCP009

500,000

49,979,228.09

1.13

7

011698600

16 鲁钢铁 SCP006

500,000

49,890,139.27

1.13

8

111610110

16 兴业 CD110

500,000

49,728,844.79

1.12

9

011698622

16 潞安 SCP008

400,000

39,852,328.02

0.9

10

041662027

16 厦港务 CP001

300,000

30,036,570.07

0.68

“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

0.0037%

报告期内偏离度的最低值

-0.1667%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值

0.0388%

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（%）

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

投资组合报告附注

基金计价方法说明

本基金估值采用“摊余成本法”计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券说明
本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券，未发生该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况。

序号

发生日期

该类浮动债占基金资产净值的比例

原因

调整期

受到调查以及处罚情况

本基金持有的前十名证券的发行主体本期未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。

其他资产构成

单位：人民币元

序号	
名称	
金额（元）	
1	
存出保证金	
0.29	
2	
应收证券清算款	
-	
3	
应收利息	
7,209,890.03	
4	
应收申购款	
-	
5	
其他应收款	
-	
6	
待摊费用	
-	
8	
其他	
-	
9	
合计	
7,209,890.32	
开放式基金份额变动	
单位：份	
项目	
财通资管鑫管家货币	
财通资管鑫管家货币 A	
财通资管鑫管家货币 B	
基金合同生效日的基金份额总额	
1,873,176,855.71	
10,587,382,656.95	
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	
57,011,456.57	
4,962,951,139.73	
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	
1,717,668,308.48	
11,328,969,976.64	
报告期期末基金份额总额	
4,433,883,823.84	

212,520,003.8

4,221,363,820.04

注：A类和B类总申购份额含因份额升降级等原因导致的调制调增份额，总赎回份额含因份额升降级等原因导致的强制调减份额。

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

认购

2016-10-21

200,000,000

200,000,000

2

申购

2016-12-21

100,000,000

100,000,000

合计

300,000,000

300,000,000

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目

持有份额总数

持有份额占基金总份额比例

发起份额总数

发起份额占基金总份额比例

发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金

-%

-%

基金管理人高级管理人员

-%

-%

基金经理等人员

-%

-%

基金管理人股东

-%

-%

其他

-%

-%

合计

-%

-%

备查文件目录

- 1、财通资管鑫管家货币市场基金相关批准文件
- 2、财通证券资产管理有限公司营业执照、公司章程
- 3、财通资管鑫管家货币市场基金基金合同
- 4、财通资管鑫管家货币市场基金招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

存放地点

浙江省杭州市上城区四宜路四宜大院 B 幢办公楼

上海市浦东新区福山路 500 号城建国际大厦 28 楼

查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人财通证券资产管理有限公司。

咨询电话：95336

公司网址：www.ctzg.com