

北信瑞丰现金添利货币市场基金 2016 年第 4 季度报告

2016-12-31

基金管理人：北信瑞丰基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：2017-01-23

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遵规守信情况的说明

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

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

影响投资者决策的其他重要信息

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。

基金托管人华夏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 1 日起至 12 月 31 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金简称

北信瑞丰现金添利

场内简称

基金主代码

000981

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2015-01-20

报告期末基金份额总额

1,332,628,971.59

投资目标

在力求基金资产安全性、流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定收益。

投资策略

本基金通过资产配置策略、债券筛选策略、现金流管理策略、资产支持证券投资策略、其他金融工具的投资策略。在有效风险管理的前提下，通过对标的品种的基本面研究，结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险，谨慎投资。

业绩比较基准

按税后计算的中国人民银行公布的人民币活期存款基准利率

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

北信瑞丰基金管理有限公司

基金托管人

华夏银行股份有限公司

下属 2 级基金的基金简称

北信瑞丰现金添利 A

北信瑞丰现金添利 B

下属 2 级基金的场内简称

下属 2 级基金的交易代码

000981

000982

报告期末下属 2 级基金的份额总额

184,859,175.61

1,147,769,795.98

主要财务指标

单位：人民币元

项目

主基金(元)

A(元)

2016-10-01 - 2016-12-31

B(元)

2016-10-01 - 2016-12-31

本期已实现收益

119,510.21

1,813,786.40

本期利润

119,510.21

1,813,786.40

期末基金资产净值

184,859,175.61

1,147,769,795.98

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。

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

过去三个月

0.5669%

0.0064%

0.0880%

0.0000%

0.4789%

0.0064%

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

过去三个月

0.6257%

0.0064%

0.0880%

0.0000%

0.5377%

0.0064%

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，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

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

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

李富强

基金经理

2015-09-14

-

7

李富强先生，北京大学经济学院毕业，获经济学硕士学位，特许金融分析师(CFA)。曾就职于中国银行间市场交易商协会、中国人民银行金融市场司。2014年1月加入北信瑞丰基金管理有限公司，曾任北信瑞丰基金管理有限公司投资研究部高级研究员、债券专户投资经理。现任北信瑞丰宜投宝货币市场基金基金经理、北信瑞丰现金添利货币市场基金基金经理、北信瑞丰新成长混合基金基金经理、北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金基金经理、北信瑞丰稳定增强偏债混合基金基金经理、北信瑞丰丰利保本混合基金基金经理。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；

2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

报告期内本基金运作合规守信情况说明

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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有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，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《北信瑞丰基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定。

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。

报告期内基金的投资策略和运作分析

2016 年四季度，全球经济复苏缓慢且不平衡，全球总需求增长乏力，贸易、投资和生产率进一步放缓。分别来看，美国经济复苏态势较好；欧元区经济复苏虽然略有改善，但是难民问题和银行业风险依旧拖累其长期增长；英国脱欧安排也存在一些不确定性；新兴经济体有所企稳，但仍面临转型压力。我国经济运行总体平稳，结构调整呈现积极变化。消费平稳增长，投资缓中趋稳，进出口降幅收窄，工业企业效率改善。

从资金面来看，债券市场在美国加息、通胀预期升温、外汇短期贬值幅度加大、央行公开市场调整投放和信用事件后续影响下出现较大波动，收益率曲线整体大幅上行甚至出现倒挂，债券估值短期内急速上行，债市流动性承压明显；季末债券市场央行加大投放力度的情况下逐渐回暖。未来美联储的加息预期强化和央行稳健中性的货币政策将令货币市场的利率中枢带来一定上行压力，市场的整体利率水平将有所抬升。

本基金在 2016 年四季度坚持货币基金作为流动性管理工具的定位，继续保持投资组合较好的流动性和合适的剩余期限。基金投资类属配置以同业存款、逆回购、金融债和信用相对较好的短期融资券为主，追求相对稳定的投资收益。本基金管理人始终将基金资产安全和基金收益稳定的重要性置于高收益的追求之上，在综合考虑基本面、货币政策和资金面变化的具体情况下，结合考虑流动性需求，抓住重要时点进行配置相对低风险和高收益的产品，并根据债券市场的波动合理地进行交易操作。本基金管理人始终将基金资产安全和基金收益稳定的重要性置于高收益的追求之上，坚持规范运作、审慎投资，勤勉尽责地为基金持有人谋求长期、稳定的回报。

报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金 A 净值收益率为 0.5669%，波动率 0.0064%；本基金 B 净值收益率为 0.6257%，波动率 0.0064%；业绩比较基准收益率 0.0880%。

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

无。

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

119,837,909.76

7.08

其中：债券

119,837,909.76

7.08

资产支持证券

-

-

2

买入返售金融资产

1,200,937,556.42

70.93

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

367,804,237.28

21.72

4

其他各项资产

4,485,929.88

0.26

5

合计

1,693,065,633.34

100.00

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

-

0.95

其中：买断式回购融资

-

-

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

序号

发生日期

融资余额占基金资产净值的比例（%）

原因

调整期

1

2016-12-15

25.07

被动超期，短时间内调整

2016-12-16

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

15

报告期内投资组合平均剩余期限最高值

89

报告期内投资组合平均剩余期限最低值

15

注：注：本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

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

119.22

27.01

其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债

-

-

2

30天(含)—60天

2.99

-

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)—180 天
-
-
其中： 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-
5
180 天(含)—397 天（含）
-
-
其中： 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-
合计
126.71

27.01
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
9,986,204.00

0.75
其中： 政策性金融债

9,986,204.00

0.75

4

企业债券

-

-

5

企业短期融资券

59,973,625.17

4.50

6

中期票据

-

-

7

同业存单

49,878,080.59

3.74

8

其他

-

-

9

合计

119,837,909.76

8.99

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

111696273

16 杭州银行 CD116

200,000

19,931,072.57

1.50

2

011698660
16 鲁钢铁 SCP007
100,000
9,997,968.27
0.75
3
011698280
16 南航股 SCP006
100,000
9,997,588.89
0.75
4
011698259
16 鲁国资 SCP001
100,000
9,997,223.42
0.75
5
011698274
16 苏汇鸿 SCP001
100,000
9,997,187.42
0.75
6
011698842
16 铜陵有色 SCP001
100,000
9,995,673.51
0.75
7
111619096
16 恒丰银行 CD096
100,000
9,995,431.75
0.75
8
111698242
16 宁波银行 CD202
100,000
9,991,415.65
0.75
9
041652028
16 南方水泥 CP002

100,000

9,987,983.66

0.75

10

160311

16 进出 11

100,000

9,986,204.00

0.75

“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

0.0529%

报告期内偏离度的最低值

-0.2347%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值

0.0621%

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：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。

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

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

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有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	-
2	
应收证券清算款	-
3	
应收利息	1,250,577.88
4	
应收申购款	3,235,352.00
5	
其他应收款	-
6	
待摊费用	-
8	
其他	-
9	
合计	4,485,929.88

投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

开放式基金份额变动

单位：份

项目

北信瑞丰现金添利

北信瑞丰现金添利 A

北信瑞丰现金添利 B

报告期期初基金份额总额

4,452,593.27

198,923,419.19

报告期期间总申购份额

239,221,772.25

1,316,352,867.52

报告期期间基金总赎回份额

58,815,189.91

367,506,490.73

报告期期末基金份额总额

1,332,628,971.59

184,859,175.61

1,147,769,795.98

注：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。

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

合计

注：注：本报告期内，本公司未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

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

-%

-%

影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

- 1、《北信瑞丰现金添利货币市场基金基金合同》。
- 2、《北信瑞丰现金添利货币市场基金招募说明书》。

3、《北信瑞丰现金添利货币市场基金托管协议》。

4、中国证监会要求的其他文件。

存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站 www.bxrfund.com。

查阅方式

投资者可以在开放时间内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，也可登陆基金管理人网站 www.bxrfund.com 查阅。