

中信建投货币市场基金招募说明书(更新)摘要

2017年第【1】号

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

重要提示

(一) 本次基金募集的准予注册文件名称为:《关于核准中信建投货币市场基金的募集的批复》(证监许可〔2014〕665号),注册日期为:2014年7月7日。本基金合同于2014年8月5日正式生效。

(二) 基金管理人保证本《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

(三) 投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本基金《招募说明书》及《基金合同》等,全面认识本基金产品的风险收益特征,应充分考虑投资人自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,须承担基金投资中出现的各类风险,包括:市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特有风险、操作或技术风险、合规性风险和其他风险等。

(四) 基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

(五) 本基金为货币市场基金,投资者购买本货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,基金管理人并不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

(六) 基金不同于银行储蓄与债券,基金投资人有可能获得较高的收益,也有可能损失本金。投资有风险,投资人在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的

《招募说明书》及《基金合同》。

(七) 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

(八) 本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

(九) 本更新的招募说明书所载内容截止日为 2017 年 2 月 5 日,有关财务数据和净值截止日为 2016 年 12 月 31 日(财务数据未经审计)。

第一部分 基金管理人

(一) 基金管理人概况

名称: 中信建投基金管理有限公司

住所: 北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室

办公地址: 北京市东城区朝阳门内大街 2 号凯恒中心 B 座 19 层

邮政编码: 100010

法定代表人: 蒋月勤

成立日期: 2013 年 9 月 9 日

批准设立机关: 中国证监会

批准设立文号: 证监许可(2013)1108 号

经营范围: 基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

组织形式: 有限责任公司

注册资本: 30000 万元

联系人: 杨露露

电话: 010-59100288

存续期间：永久存续

股权结构：中信建投证券股份有限公司占 55%、航天科技财务有限责任公司占 25%、江苏广传广播传媒有限公司占 20%。

(二) 主要人员情况

1、董事会成员

蒋月勤先生，董事长，成都电子科技大学硕士研究生学历。曾任职中信证券交易部总经理、长盛基金管理有限公司总经理，现任中信建投证券股份有限公司党委委员、执委会委员、董事总经理，兼任中信建投基金管理有限公司董事长。

张杰女士，副董事长、总经理，首都师范大学本科学历。曾任中信建投证券股份有限公司经纪业务管理部行政负责人，现任中信建投基金管理有限公司副董事长、总经理。

陈瑛女士，董事，北京师范大学硕士研究生学历。曾任航天一院 211 厂总会计师、航天一院财务部副部长、航天一院发射技术及特种车事业部总会计师、航天投资控股有限公司财务总监，现任航天科技财务有限责任公司财务总监、中信建投基金管理有限公司董事。

周艳丽女士，董事，南京大学硕士研究生学历。曾任江苏省广播电视总台(集团)财务资产部财务主管、科长、主任助理、副主任。现任江苏省广播电视总台(集团)财务资产部副主任(主持工作)、中信建投基金管理有限公司董事。

袁野先生，职工董事，德国特里尔大学硕士研究生学历。曾任德国 HVB 银行卢森堡分行产品经理、中信建投证券股份有限公司资产管理部总监、中信建投基金管理有限公司总经理，现任中信建投基金管理有限公司常务副总经理、职工董事，兼任元达信资本管理(北京)有限公司执行董事。

杜宝成先生，独立董事，北京大学法律系硕士研究生学历。曾任北京市律师协会职员，中国侨联华联律师事务所律师，北京市融商律师事务所高级合伙人、律师，现任北京市融商律师事务所主任、中信建投基金管理有限公司独立董事。

王汀汀先生，独立董事，北京大学博士研究生学历。现任中央财经大学副教授、中信建投基金管理有限公司独立董事。

王宏利女士，独立董事，北京师范大学硕士研究生学历。曾任北京瑞达会计师事务所部门副经理，北京中洲光华会计师事务所高级经理，天健正信会计师事

务所合伙人兼事务所人力资源委员会委员兼北京所管理委员会委员, 大华会计师事务所合伙人兼事务所人力资源和薪酬考核委员会委员, 现任大华会计师事务所合伙人兼战略发展和市场管理委员会委员、中信建投基金管理有限公司独立董事。

王禹媚女士, 独立董事, 北京大学硕士研究生学历。曾任申银万国证券家电行业分析师、安信证券传媒行业分析师、中国国际金融有限公司研究部执行总经理、华泰证券股份有限公司研究所董事总经理, 现任华泰联合证券董事总经理、成长企业融资部负责人员、中信建投基金管理有限公司独立董事。

2、监事会成员

孔萍女士, 监事会主席, 中国人民大学硕士研究生学历。曾任中国工商银行财务处副科长, 华夏证券股份有限公司财务、稽核、清算部部门总经理, 现任中信建投证券股份有限公司运营管理部行政负责人、中信建投基金管理有限公司监事会主席。

许会芳女士, 监事, 中国人民银行研究生部硕士研究生学历。曾任航天科技财务有限责任公司风险管理与法律部副总经理, 现任航天科技财务有限责任公司风险管理与法律部总经理、中信建投基金管理有限公司监事。

周琰女士, 监事, 南京大学硕士研究生学历。曾任江苏省广播电视总台投资管理部业务拓展科副科长, 现任江苏省广播电视总台投资管理部业务拓展科科长、中信建投基金管理有限公司监事。

张全先生, 职工监事, 中国人民银行研究生部硕士研究生学历。曾就职于中信建投证券股份有限公司债券承销部、债券销售交易部、资本市场部, 现任中信建投基金管理有限公司总经理助理、职工监事, 兼任元达信资本管理(北京)有限公司总经理。

陈晨先生, 职工监事, 北京工业大学本科学历。曾就职于华夏证券股份有限公司信息技术部网络管理岗、中信建投证券股份有限公司信息技术部网络管理岗, 现任中信建投基金管理有限公司信息技术部总监、职工监事。

王琦先生, 职工监事, 中国人民大学博士研究生学历。曾任大通证券股份有限公司研发中心研究员, 中关村证券股份有限公司研发中心研究员, 中信建投证券股份有限公司交易部总监。现任中信建投基金管理有限公司总经理助理、职工

监事。

3、高级管理人员

蒋月勤先生，现任公司董事长，简历同上。

张杰女士，现任公司副董事长、总经理，简历同上。

袁野先生，现任公司常务副总经理、职工董事，简历同上。

周建萍女士，北京大学在职研究生学历。曾任航天科技财务有限责任公司投资部总经理、资产管理部总经理、交易部总经理，现任中信建投基金管理有限公司督察长，兼任元达信资本管理（北京）有限公司执行监事。

高翔先生，太原机械学院（现华北工学院）本科学历。曾任广东深圳蛇口新软件产业有限公司开发一部高级程序员，华夏证券深圳分公司电脑部副经理，鹏华基金管理有限公司信息技术部总监，大成基金管理有限公司信息技术部总监，中信建投基金管理有限公司总经理助理，现任中信建投基金管理有限公司副总经理。

4、本基金基金经理

黄海浩女士，山东大学物流工程工程学学士。曾任利顺金融(亚洲)有限责任公司交易部 Broker、平安利顺国际货币经纪有限责任公司交易部 Broker、国投瑞银基金管理有限公司交易部债券交易员，现任投资研究部基金经理。

5、投资决策委员会成员

袁野先生，简历同上。

王琦先生，简历同上。

王浩先生，中央财经大学硕士研究生学历。曾任中信建投证券股份有限公司资产管理部研究员，现任中信建投基金管理有限公司投资研究部基金经理。

周户先生，南开大学硕士研究生，曾任渤海证券股份有限公司研究员、广发证券股份有限公司研究员、国金证券及其下属基金公司研究员，现任中信建投基金管理有限公司投资研究部基金经理。

黄海浩女士，简历同上。

梁奇先生，清华大学计算机科学与技术硕士。曾任汤森路透集团软件工程师、英大基金管理有限公司系统工程师、风险控制师，现任职于中信建投基金管理有限公司稽核合规部风险管理岗。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人情况

(一) 基本情况

名称：华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

法定代表人：吴建

成立时间：1992 年 10 月 14 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：10,685,572,211 元人民币

批准设立机关和设立文号：中国人民银行[银复（1992）391 号]

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]25 号

联系人：郑鹏

电话：（010）85238667

传真：（010）85238680

(二) 主要人员情况

华夏银行资产托管部内设市场一室、市场二室、风险与合规管理室和运营室 4 个职能处室。资产托管部共有员工 34 人，高管人员拥有硕士以上学位或高级职称。

(三) 基金托管业务经营情况

华夏银行于 2005 年 2 月 23 日经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会核准，获得证券投资基金托管资格，是《证券投资基金法》和《证券投资基金托管资格管理办法》实施后取得证券投资基金托管资格的第一家银行。自成立以来，华夏银行资产托管部本着“诚实信用、勤勉尽责”的行业精神，始终遵循“安全保管基金资产，提供优质托管服务”的原则，坚持以客户为中心的服务理念，依托严格的内控管理、先进的技术系统、优秀的业务团队、丰富的业

务经验,严格履行法律和托管协议所规定的各项义务,为广大基金份额持有人和资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优异业绩。截至 2016 年 6 月末,本公司托管证券投资基金、券商集合计划、银行理财、信托、保险等各类产品合计 671 只,托管规模 16,109.54 亿元,实现托管手续费收入 3.92 亿元。

第三部分 相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构

名称: 中信建投基金管理有限公司

住所: 北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室

法定代表人: 蒋月勤

办公地址: 北京市东城区朝阳门内大街 2 号凯恒中心 B 座 19 层

电话: 010-59100273

传真: 010-59100298

联系人: 贾欣欣

客户服务电话: 4009-108-108

网址: www.cfund108.com

2、销售机构

(1) 华夏银行

网址: <http://hxb.com.cn>

客户服务电话: 95577

(2) 北京银行

网址: <http://www.bankofbeijing.com.cn>

客户服务电话: 95526

(3) 申银万国证券

网址: <http://www.sw2000.com.cn>

客户服务电话: 95523

- (4) 北京植信基金销售有限公司
网址：<http://www.zhixin-inv.com>
客户服务电话：4006-802-123
- (5) 上海天天基金销售有限公司
网址：www.1234567.com.cn
客户服务电话：4001818188
- (6) 上海陆金所资产管理有限公司
网址：www.lufunds.com
客户服务电话：4008-219-031
- (7) 嘉实财富管理有限公司
网址：www.harvestwm.cn
客户服务电话：400-021-8850
- (8) 国金证券股份有限公司
网址：www.gjq.com.cn
客户服务电话：4001-600109
- (9) 信达证券股份有限公司
网址：www.cindasc.com
客户服务电话：95321
- (10) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司
网址：www.taichengcaifu.com
客户服务电话：400-6411-999
- (11) 中国国际金融股份有限公司
网址：www.cicc.com.cn
客户服务电话：400-910-1166
- (12) 渤海银行股份有限公司
网址：www.cbhb.com.cn
客户服务电话：400-888-8811
- (13) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
网址：www.fund123.cn

客户服务电话：4000-766-123

（14）中信建投证券

网址：<http://www.csc108.com>

客户服务电话：4008-888-108

（15）上海长量基金销售投资顾问有限公司

网址：www.erichfund.com

客户服务电话：400-820-2899

（16）深圳富济财富管理有限公司

网址：www.jinqianwo.cn

客户服务电话：0755-83999907

（17）浙江同花顺基金销售有限公司

网址：www.5ifund.com

客户服务电话：4008-773-772

（18）大泰金石基金销售有限公司

网址：www.dtfortune.com

客户服务电话：400-928-2266

（19）北京电盈基金销售有限公司

网址：www.5ijjh.com

客户服务电话：400-100-3391

（20）上海凯石财富基金销售有限公司

网址：www.lingxianfund.com

客户服务电话：4000-178-000

（21）珠海盈米财富管理有限公司

网址：www.yingmi.cn

客户服务电话：020-89629066

（22）北京钱景财富投资管理有限公司

网址：www.qianjing.com

客户服务电话：400-893-6885

（23）上海浦东发展银行股份有限公司

网址: <http://www.spdb.com.cn/chpage/c1>

客户服务电话: 95528

(24) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

网址: www.buyfunds.cn

客户服务电话: 400-027-9899

(25) 北京汇成基金销售有限公司

网址: www.fundzone.cn

客户服务电话: 400-619-9059

(26) 北京恒天明泽基金销售有限公司

网址: www.chtfund.com

客户服务电话: 4008980618

(27) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

网址: <http://kenterui.jd.com>

客户服务电话: 400-098-8511

(28) 上海利得基金销售有限公司

网址: www.leadfund.com.cn

客户服务电话: 400-921-7755

(29) 中信证券股份有限公司

网址: www.cs.ecitic.com

客户服务电话: 95548

(30) 中信证券(山东)有限责任公司

网址: www.zxwt.com.cn

客户服务电话: 95548

(31) 北京格上富信投资顾问有限公司

网址: www.igesafe.com

客户服务电话: 400-066-8586

(32) 北京微动利投资管理有限公司

网址: www.buyforyou.com.cn

客户服务电话: 400-819-6665

3、基金管理人可根据《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》和本基金基金合同等的规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时履行公告义务。(二) 登记机构

名称: 中信建投基金管理有限公司

住所: 北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室

法定代表人: 蒋月勤

办公地址: 北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座19层

电话: 010-59100228

传真: 010-59100298

联系人: 陈莉君

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称: 上海市通力律师事务所

住所: 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层

办公地址: 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层

负责人: 俞卫锋

电话: 021-31358666

传真: 021-31358600

经办律师: 黎明、孙睿

联系人: 孙睿

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称: 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所: 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址: 上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人: 杨绍信

电话: 021-23238888

传真: 021-23238800

联系人: 张勇

经办注册会计师: 许康玮、张勇

第四部分 基金的名称

中信建投货币市场基金

第五部分 基金类型

货币市场基金

第六部分 基金的投资目标

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。

第七部分 基金的投资范围

本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括:现金,期限在一年以内(含一年)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、资产支持证券、非金融企业债务融资工具,以及法律法规或中国证监会、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。

法律法规或监管机构允许货币市场基金投资其他货币市场基金的,在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的前提下,本基金可参与其他货币市场基金的投资,不需召开基金份额持有人大会。基金投资其他货币市场基金的比例不超过基金资产的 80%,具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

第八部分 基金的投资策略

一、投资策略

1、资产配置策略

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。

2、债券筛选策略

本基金将优先考虑安全性因素,优先选择央票、短期国债等高信用等级的债券品种进行投资以规避风险。在基金投资中对个券进行选择时,首先本基金将针对各券种的信用等级、剩余期限和流动性进行初步筛选;第二步,本基金将评估其投资价值,进行再次筛选,这一步主要针对各券种的收益率与剩余期限的结构合理性进行筛选;最后,在前两步筛选的基础上,再评估各券种的到期收益率波动性与可投资量(流通量、日均成交量与冲击成本估算),从而综合决定具体各个券种的投资比例。

3、现金流管理策略

作为现金管理工具,本基金具有较高的流动性要求。本基金将会紧密关注申购/赎回现金流变化情况、季节性资金流动等影响货币市场基金流动性管理的因素,建立组合流动性监控管理指标,实现对基金资产流动性的实时管理。具体操作中,本基金将综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例,通过现金留存、银行定期存款提前支取、持有高流动性券种、正向回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性,也可采用持续滚动投资方法,将回购或债券的到期日进行均衡等量配置等手段,从而争取在保持充分流动性的基础上取得较高收益。

4、其他金融工具的投资策略

如法律法规或监管机构以后允许本类基金投资于其他衍生金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资

主要以对提高组合整体收益为主要目的。本基金将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。

未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,在履行相应程序后,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

二、基金管理人运用基金财产的决策依据、决策程序

1、投资决策依据

- (1) 有关法律、法规和基金合同的有关规定。
- (2) 经济运行态势和证券市场走势。
- (3) 投资对象的风险收益配比。

2、投资决策程序

(1) 投资决策支持: 研究人员、基金经理及相关人员根据独立研究及各咨询机构的研究方案,向投资决策委员会提出宏观经济分析方案和投资策略方案等决策支持。

(2) 投资原则的制定: 投资决策委员会在遵守国家有关法律、法规和基金合同的有关规定的前提下,根据研究人员和基金经理的有关方案,决定基金投资的主要原则,对基金投资组合的资产配置比例等提出指导性意见。

(3) 研究支持: 研究分析人员根据投资决策委员会的决议,为基金经理提供各类分析方案和投资建议;也可根据基金经理的要求进行有关的研究。

(4) 制定投资决策: 基金经理按照投资决策委员会决定的投资原则,根据研究分析人员提供的投资建议以及自己的分析判断,做出具体的投资决策。

(5) 风险控制与评估: 风险管理委员会定期召开会议,听取投资研究部、基金经理、风险控制人员对基金投资组合进行的风险评估,并提出风险控制意见。

(6) 组合的调整: 基金经理有权根据环境的变化和实际的需要,在其权限范围内对组合进行调整,超出其权限的调整,需报投资决策委员会审批。

第九部分 基金的业绩比较基准

七天通知存款税后利率

根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征,本基金选取同期七天通知存款税后利率作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时,经与基金托管人协商一致,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

第十部分 基金的风险收益特征

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。

第十一部分 基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 12 月 31 日(摘自本基金 2016 年第 4 季度报告),本报告中所列财务数据未经审计。

一、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

二、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

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%

三、基金投资组合平均剩余期限

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。

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	-

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。

四、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	-	-

五、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

六、“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发生负偏离度的绝对值达到或超过 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发生负偏离度的绝对值达到或超过 0.5%的情况。

七、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

八、投资组合报告附注

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。

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。

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

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。

第十二部分 基金的业绩

基金业绩截止日为 2016 年 12 月 31 日。

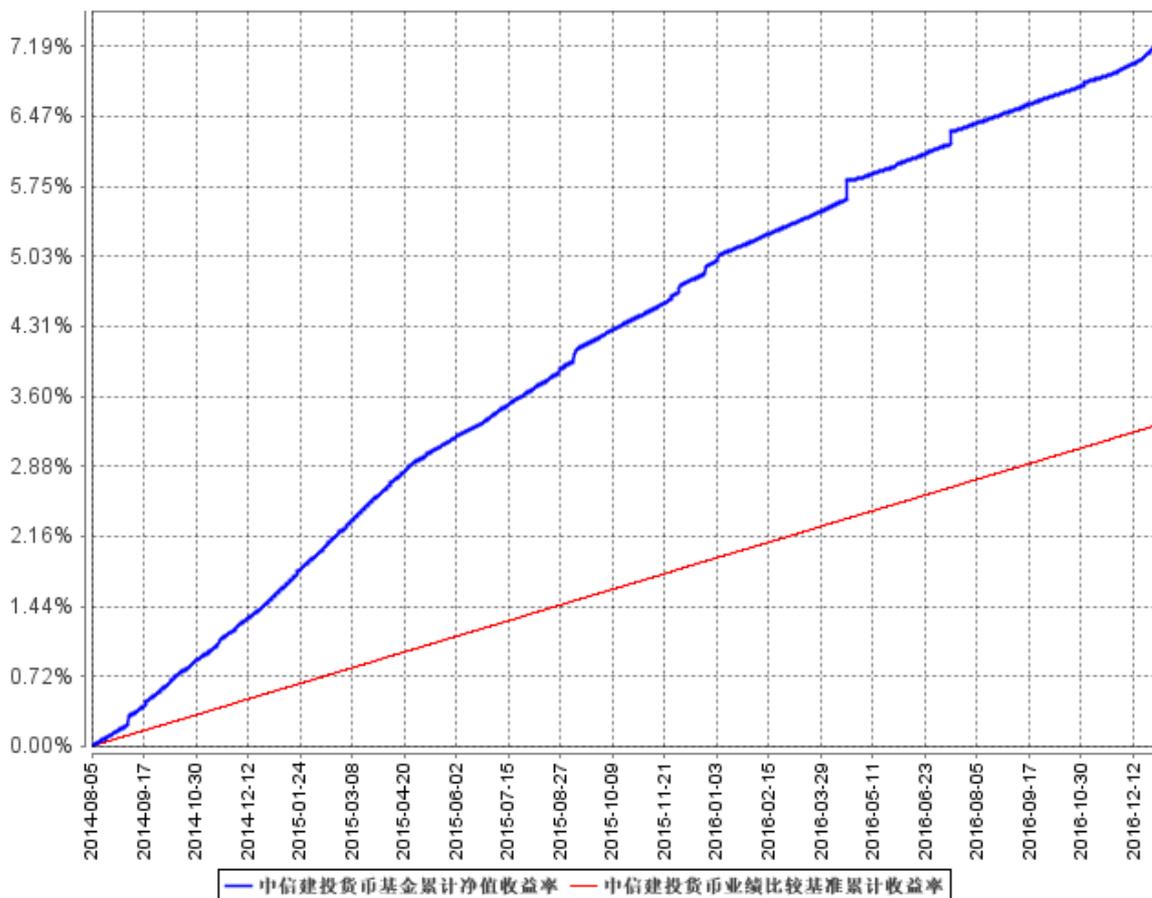
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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	0.5049%	0.0035%	0.3450%	0.0000%	0.1599%	0.0035%
2016 年 7 月 1 日 -2016 年 9 月 30 日	0.4984%	0.0126%	0.3450%	0.0000%	0.1534%	0.0126%
2016 年 1 月 1 日 -2016 年 6 月 30 日	1.1034%	0.0146%	0.6825%	0.0000%	0.4209%	0.0146%
2015 年 1 月 1 日 -2015 年 12 月 31 日	3.4019%	0.0064%	1.3500%	0.0000%	2.0519%	0.0064%
2014 年 8 月 5 日(基金合同生效日) -2014 年 12 月 31 日	1.5150%	0.0070%	0.5511%	0.0000%	0.9639%	0.0070%

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

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



第十三部分 基金费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3. 基金销售服务费

本基金年销售服务费率为 0.25%。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至

最近可支付日支付。

上述“一、基金费用的种类中第4—9项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露编报规则第5号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》等有关法律、法规及《基金合同》，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对《中信建投货币市场基金招募说明书》进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、更新了“第一部分 绪言”的相关内容；
- 2、更新了“第二部分 释义”的相关内容；
- 3、更新了“第三部分 基金管理人”的“主要人员情况”相关内容；
- 4、更新了“第四部分 基金托管人”的相关内容；
- 5、更新了“第五部分 相关服务机构”的相关内容；

- 6、更新了“第六部分 基金的募集”的相关内容；
- 7、更新了“第七部分 基金合同的生效”的相关内容；
- 8、更新了“第八部分 基金份额的申购与赎回”的相关内容；
- 9、更新了“第九部分 基金的投资”的相关内容；
- 10、更新了“第十部分 基金投资组合报告”，并经托管人复核；
- 11、更新了“第十一部分 基金的业绩”，并经托管人复核；
- 12、更新了“第十三部分 基金资产估值”的相关内容；
- 13、更新了“第十七部分 基金的信息披露”的相关内容；
- 14、更新了“第二十部分 基金合同内容摘要”的相关内容；
- 15、更新了“第二十一部分 基金托管协议的内容摘要”的相关内容；
- 16、更新了“第二十三部分 其他应披露事项”，列示了本次更新期间与本基金相关的公告事项。

中信建投基金管理有限公司

2017年3月