

# 中信建投货币市场基金 2016 年年度报告

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

送出日期：2017 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>13</b>
6.1 审计报告基本信息.....	13
6.2 审计报告的基本内容.....	14
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>15</b>
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 债券回购融资情况.....	40
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	40
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	41
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
8.6 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.....	42
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	42

8.8 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 .....	42
8.9 投资组合报告附注 .....	42
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>43</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	44
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>44</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>44</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	44
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	44
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
11.4 基金投资策略的改变 .....	45
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	45
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	45
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 .....	46
11.9 其他重大事件 .....	46
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>51</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>51</b>
13.1 备查文件目录 .....	51
13.2 存放地点 .....	51
13.3 查阅方式 .....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投货币市场基金
基金简称	中信建投货币
基金主代码	000738
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
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
报告期末基金份额总额	70,297,478.58 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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	本基金将通过分析宏观经济发展态势、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，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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信建投基金管理有限公司	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周建萍	郑鹏
	联系电话	010-59100288	010-85238667
	电子邮箱	zhou.jp@cfund108.com	zhengpeng@hxb.com.cn
客户服务电话		4009-108-108	95577
传真		010-59100298	010-85238680
注册地址		北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室	北京市东城区建国门大街 22 号

办公地址	北京市东城区朝内大街 2 号 凯恒中心 B 座 17、19 层	北京市东城区建国门大街 22 号
邮政编码	100010	100005
法定代表人	蒋月勤	吴建

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街 2 号凯恒中心 B 座 17、19 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年 8 月 5 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	3,567,671.25	60,348,772.90	9,918,961.24
本期利润	3,567,671.25	60,348,772.90	9,918,961.24
本期净值收益率	2.1204%	3.4019%	1.5150%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末基金资产净值	70,297,478.58	1,232,546,045.01	624,704,263.32
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
累计净值收益率	7.1942%	4.9684%	1.5150%

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

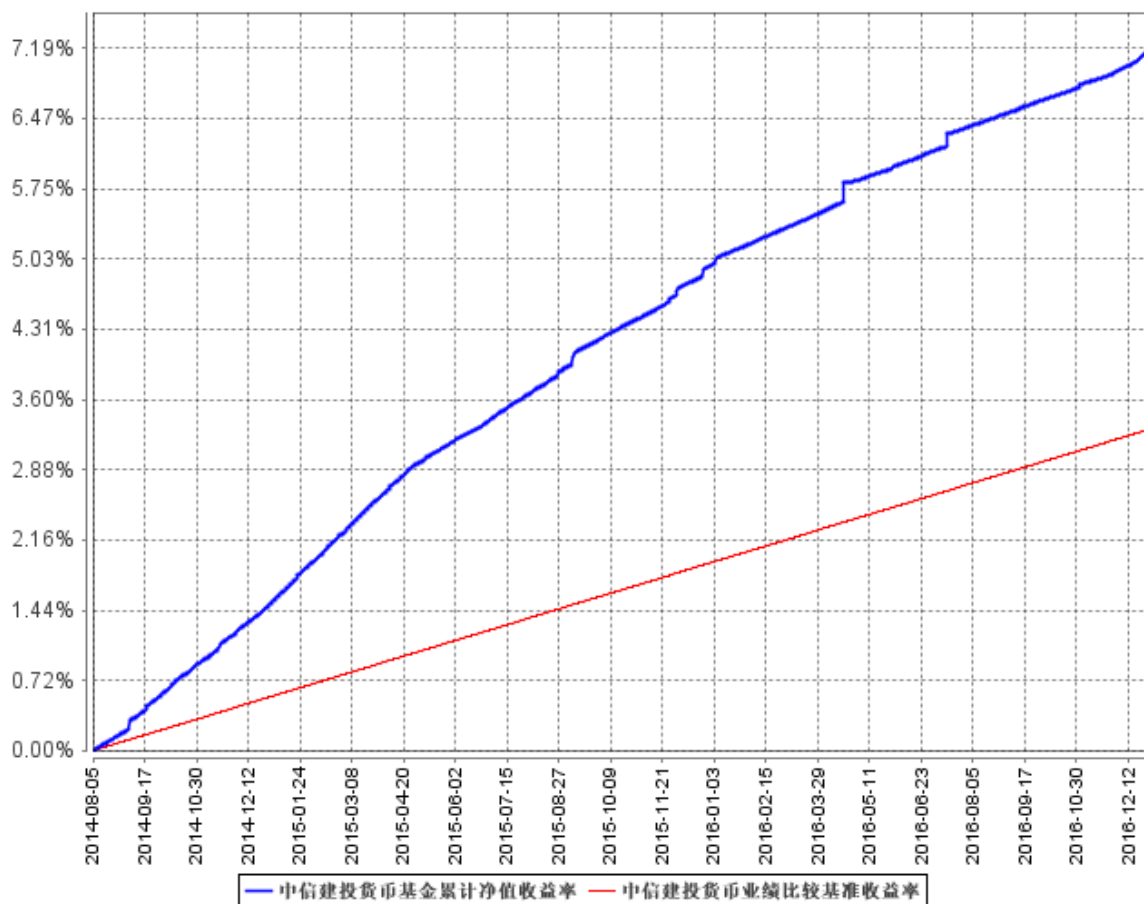
#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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%
过去六个月	1.0059%	0.0092%	0.6900%	0.0000%	0.3159%	0.0092%
过去一年	2.1204%	0.0122%	1.3725%	0.0000%	0.7479%	0.0122%
自基金合同生效起至今	7.1942%	0.0095%	3.3000%	0.0000%	3.8942%	0.0095%

注：本基金收益分配按日结转份额。

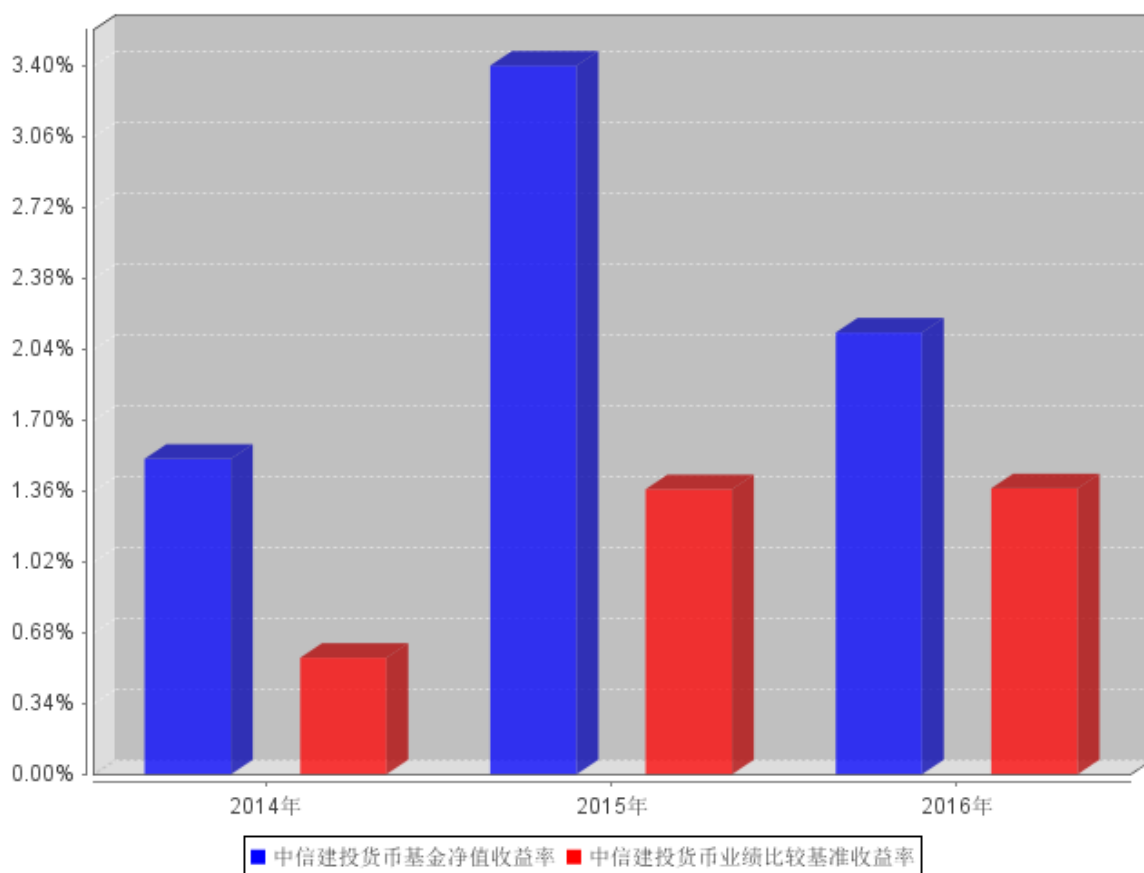
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中信建投货币自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2016	3,489,795.98	160,085.70	-82,210.43	3,567,671.25	注：-
2015	60,135,717.47	191,529.66	21,525.77	60,348,772.90	注：-
2014	9,844,980.71	12.64	73,967.89	9,918,961.24	注：-
合计	73,470,494.16	351,628.00	13,283.23	73,835,405.39	注：-

注：本基金收益分配按日结转份额。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中信建投基金管理有限公司于 2013 年 9 月 9 日在北京正式注册成立，主要经营基金募集、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。公司成立以来，依托强大的股东背景，经过 2014 年、2015 年的基础设施建设及资源、业务、经验的积累，公司业务呈现发展趋势。员工数量增长较快，团队建设进入加速期。公司多渠道拓展维护客户，已与多家财务公司、商业银行、信托公司、证券公司、私募基金和上市公司开展了合作，在定向增发、新股申购、结构化债券投资等多个领域开展了业务，并与移动互联网公司、传媒公司、第三方支付公司等合作，为客户提供余额、理财、类三方存管的相关服务。公司子公司元达信资本管理（北京）有限公司于 2015 年 6 月 8 日成立。公司及子公司资产管理规模快速增长，各项业务较成立之初获得了快速发展。公司秉承“忠于信，健于投”的经营理念，追求以稳健的投资及良好收益，回馈客户的信任。公司投资业绩稳步上升，以良好的投资回报实现了投资人资产的保值增值。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	-	6	黄海浩女士，山东大学工程学学士。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。
索隽石	本基金的基金经理	2014年8月5日	2016年7月4日	6	索隽石先生，北京大学软件工程专业硕士研究生学历。2010年7月至2013年9月在信达证券股份有限公司工作，2013年10月加中信建投基金管理有限公司，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基金经理，2016年7月4日离任。

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制度指导意见》、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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《中信建投基金管理有限公司公平交易管理办法》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

### 4.3.2 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制度指导意见》，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。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年，全球经济总体呈现复苏态势，中国国内企业投资意愿改善，经济下行压力减轻。货币政策方面，稳健中性的货币政策贯穿了整个 2016 年。债券市场上，货币市场利率较 2015 年而言中枢抬升、利率波动加大，并在 12 月份引发了流动性的极度紧张。

回顾 2016 操作，本基金始终以流动性为主要管理目标，经受住重重考验的同时，也给投资者带来了合适的收益。

### 4.4.2 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 2.1204%，同期业绩比较基准收益率为 1.3725%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，我们认为中国经济运行面临三个不确定性。一是在美联储继续加息背景下，资本外流和汇率贬值是否继续互相推动；二是民间投资虽然趋稳，但增长动力如何；三是房地产市场降温幅度、供给侧改革深化对经济的影响如何扩展。因此可以预计货币政策将更加关注供给侧结构性改革和防控金融风险，保持稳健中性，为经济进一步企稳营造适宜的金融环境。具体到债券市场，一些迹象表明市场的悲观预期有所修正，首先人民币贬值预期开始减弱，外汇占款流出量逐步减少，降低了流动性冲击的预期；其次同业负债率基本开始企稳，同业负债利率已经处于历史高位，上升的空间不大；再次，经济的不确定性将带来交易的结构性的机会增多。总体而言，我们认为 2017 年债券市场将更加注重流动性管理与结构性交易。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人结合法律法规和业务发展的需要，进一步修订、完善了公司内部制度；组织多项合规培训，加强员工的风险意识和合规意识；针对投资研究等重点业务，加大检查力度，

促进公司业务合法合规、稳健经营；积极参与新产品、新业务的设计，提出合规建议，对基金的宣传推介、基金投资交易等方面积极开展各项合规管理工作，有效防范风险，规避违规行为的发生。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金遵循下列报表附注所述的估值政策和估值原则对基金持有的资产和负债进行估值。

为确保估值政策和估值原则的合理合法性，公司成立估值委员会和风险内控小组。公司总经理任估值委员会负责人，委员包括督察长、投资研究部、特定资产管理部、交易部、产品与金融工程部、稽控合规部、运营管理部的主要负责人及基金经理（若负责人认为必要，可适当增减委员会委员），主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。

在严格遵循公平、合理原则下，公司制订了健全、有效的估值政策流程：

1. 运营管理部基金会计每天按照相关政策对基金资产和负债进行估值并计算基金净值，公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用于非货币基金）或影子定价（适用于货币基金和理财类基金）；公司与中证指数有限公司签署了《债券估值数据服务协议》，并依据其提供的估值价格对公司旗下基金持有的交易所有固定收益品种进行估值。

2. 由投资研究部估值小组确认基金持有的投资品种是否采用估值方法确定公允价值，若确定用估值方法计算公允价值，则在参考基金业协会的意见或第三方意见后确定估值方法；

3. 由估值委员会计算该投资品种的公允价值，并将计算结果提交公司管理层；

4. 公司管理层审批后，该估值方法方可实施。

为了确保旗下基金持有投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性，风险内控小组应定期对估值政策、程序及估值方法进行考核，并建立风险防控标准。在考虑投资策略的情况下，公司旗下的不同基金持有的同一证券的估值政策、程序及相关的方法应保持一致。除非产生需要更新估值政策或程序的情形，已确定的估值政策和程序应当持续适用。

估值委员会应互相协助定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后应及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订建议由

估值委员会提议，并提交公司管理层，待管理层审批后方可实施。公司旗下基金在采用新投资策略或投资新品种时，应由估值委员会对现有估值政策和程序的适用性做出评价。

在采用估值政策和程序时，估值委员会应当审查并充分考虑参与估值流程各部门及人员的经验、专业胜任能力和独立性，通过参考行业协会估值意见、参考托管行及其他独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配方式为红利再投资，每日将当日收益结转为基金份额，当日收益参与下一日基金收益分配，并按日结转到投资者基金账户。本年度基金应分配利润为 3,567,671.25 元，已全部分配，符合法律法规和基金合同的相关规定。

#### 4.9 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

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 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2016 年年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 22721 号
--------	-------------------------

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	中信建投货币市场基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的中信建投货币市场基金(以下简称“中信建投货币基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是中信建投货币基金的基金管理人中信建投基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为,上述 中信建投货币基金 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了 中信建投货币基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	许 康 玮	张 勇
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国 · 上海市	
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中信建投货币市场基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	7,694,837.36	643,647,000.50
结算备付金		261,041.10	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	21,322,327.57	210,253,288.62
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		20,868,427.57	210,253,288.62
资产支持证券投资		453,900.00	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	41,160,149.10	722,801,059.73
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	272,430.30	4,953,681.94
应收股利		-	-
应收申购款		320.00	1,344,382.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		70,711,105.43	1,582,999,412.79
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	350,000,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		17,971.89	109,437.02
应付托管费		5,446.04	33,162.75
应付销售服务费		13,615.08	82,906.82
应付交易费用	7.4.7.7	4,310.61	23,367.53
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		13,283.23	95,493.66
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	359,000.00	109,000.00
负债合计		413,626.85	350,453,367.78
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	70,297,478.58	1,232,546,045.01
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		70,297,478.58	1,232,546,045.01
负债和所有者权益总计		70,711,105.43	1,582,999,412.79

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 70,297,478.58 份。

## 7.2 利润表

会计主体：中信建投货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		5,132,604.33	74,857,525.58
1.利息收入		4,554,351.26	69,370,426.69
其中：存款利息收入	7.4.7.11	842,492.38	29,402,190.35
债券利息收入		2,061,098.81	19,926,554.91
资产支持证券利息收入		90,683.91	-
买入返售金融资产收入		1,560,076.16	20,041,681.43
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		578,253.07	5,487,098.89
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	578,511.09	5,487,098.89
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-258.02	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		1,564,933.08	14,508,752.68
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	555,522.06	6,514,307.97



2. 托管费	7.4.10.2.2	168,581.23	1,974,032.62
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	421,453.28	4,935,081.68
4. 交易费用	7.4.7.19	88.50	475.00
5. 利息支出		33,088.01	649,655.41
其中：卖出回购金融资产支出		33,088.01	649,655.41
6. 其他费用	7.4.7.20	386,200.00	435,200.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>3,567,671.25</b>	<b>60,348,772.90</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>3,567,671.25</b>	<b>60,348,772.90</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中信建投货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,232,546,045.01	-	1,232,546,045.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,567,671.25	3,567,671.25
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,162,248,566.43	-	-1,162,248,566.43
其中：1. 基金申购款	380,677,492.38	-	380,677,492.38
2. 基金赎回款	-1,542,926,058.81	-	-1,542,926,058.81
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-3,567,671.25	-3,567,671.25
五、期末所有者权益（基金净值）	70,297,478.58	-	70,297,478.58
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	624,704,263.32	-	624,704,263.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	60,348,772.90	60,348,772.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	607,841,781.69	-	607,841,781.69
其中：1. 基金申购款	18,312,422,943.20	-	18,312,422,943.20
2. 基金赎回款	-17,704,581,161.51	-	-17,704,581,161.51
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-60,348,772.90	-60,348,772.90
五、期末所有者权益（基金净值）	1,232,546,045.01	-	1,232,546,045.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 蒋月勤	_____ 高翔	_____ 陈莉君
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中信建投货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]第 665 号《关于准予中信建投货币市场基金注册的批复》核准,由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证出具安永华明(2014)验字第 60952150\_A12 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信建投货币市场基金基金合同》于 2014 年 8 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 910,926,136.50 份基金份额,其中认购资金利息折合 32,165.18 份基金份额。本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司,基金托管人为华夏银行股份有限公司(以下简称“华夏银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投货币市场基金基金合同》的有关规定,

本基金的投资范围为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。本基金的业绩比较基准为：七天通知存款税后利率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中信建投货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度 的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策和会计估计与上年度报告相一致。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表

中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产和其他各类应付款项。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

-

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并按基金份额面值 1.00 元分配后将当日收益结转到投资人基金账户。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	7,694,837.36	363,647,000.50
定期存款	-	280,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	280,000,000.00
其他存款	-	-

合计:	7,694,837.36	643,647,000.50
-----	--------------	----------------

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目		本期末 2016年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	20,868,427.57	20,820,700.00	-47,727.57	-0.0679%
	合计	20,868,427.57	20,820,700.00	-47,727.57	-0.0679%
项目		上年度末 2015年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	210,253,288.62	210,795,000.00	541,711.38	0.0440%
	合计	210,253,288.62	210,795,000.00	541,711.38	0.0440%

注: 1、偏离金额=影子定价法计算的基金资产市值-摊余成本法确定的基金资产成本;

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位: 人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	
	账面余额	其中: 买断式逆回购
买入返售证券_银行间	19,400,149.10	-
买入返售证券_交易所	21,760,000.00	-
合计	41,160,149.10	-
项目	上年度末 2015年12月31日	
	账面余额	其中: 买断式逆回购
买入返售证券_交易所	350,000,000.00	-



买入返售证券_银行间	372,801,059.73	303,800,476.23
合计	722,801,059.73	303,800,476.23

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量(张)	估值总额	其中：已出售或再质押总额
合计					-	-	-
项目	上年度末 2015年12月31日						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量(张)	估值总额	其中：已出售或再质押总额
1	011519005	15 国电 SCP005	2016年1月5日	100.41	1,000,000	100,410,000.00	-
2	011512003	15 华能 SCP003	2016年1月5日	100.49	1,000,000	100,490,000.00	-
3	011503006	15 中石化 SCP006	2016年1月5日	100.10	1,000,000	100,100,000.00	-
合计					3,000,000	301,000,000.00	-

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	1,908.87	7,874.67
应收定期存款利息	-	55,486.09
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	23.50	-
应收债券利息	213,369.15	4,786,243.76
应收买入返售证券利息	54,729.20	104,077.42
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	2,399.58	-
合计	272,430.30	4,953,681.94

注：“其他”为应收资产支持证券利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	4,310.61	23,367.53
合计	4,310.61	23,367.53

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	359,000.00	109,000.00
合计	359,000.00	109,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,232,546,045.01	1,232,546,045.01
本期申购	380,677,492.38	380,677,492.38
本期赎回(以“-”号填列)	-1,542,926,058.81	-1,542,926,058.81
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	70,297,478.58	70,297,478.58

注：本期申购包含红利再投资份额及金额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	3,567,671.25	-	3,567,671.25
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-3,567,671.25	-	-3,567,671.25
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	54,579.99	151,414.52
定期存款利息收入	781,000.01	29,220,506.24
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	6,912.38	30,269.59
其他	-	-
合计	842,492.38	29,402,190.35

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期间及上年度可比期间均无买卖股票差价收入。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	578,511.09	5,487,098.89
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-

合计	578,511.09	5,487,098.89
----	------------	--------------

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	333,502,738.36	2,788,899,400.74
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	325,096,898.47	2,743,038,926.82
减：应收利息总额	7,827,328.80	40,373,375.03
买卖债券差价收入	578,511.09	5,487,098.89

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间未发生债券投资相关的赎回价差收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间未发生债券投资相关的申购价差收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
卖出资产支持证券成交总 额	11,999,877.02	-
减：卖出资产支持证券成本 总额	11,945,409.69	-
减：应收利息总额	54,725.35	-
资产支持证券投资收益	-258.02	-

注：本基金上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期间及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期间及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期间及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期间及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期间及上年度可比期间无衍生工具投资收益。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期间及上年度可比期间无衍生工具投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期间及上年度可比期间无股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期间及上年度可比期间无公允价值变动收益。

#### 7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期间及上年度可比期间无其他收入。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	88.50	475.00
合计	88.50	475.00

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年
----	----------------------	----------------------------

	年 12 月 31 日	12 月 31 日
审计费用	50,000.00	90,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
账户服务费	36,200.00	45,200.00
合计	386,200.00	435,200.00

#### 7.4.7.21 分部报告

-

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
华夏银行股份有限公司	基金的托管人、基金销售机构
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
航天科技财务有限责任公司	基金管理人的股东
江苏广传广播传媒有限公司	基金管理人的股东
中信建投期货有限公司	与基金管理人同一控股股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
中信建投证券 股份有限公司	535,760,000.00	100.00%	4,603,058,000.00	100.00%

##### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付 的管理费	555,522.06	6,514,307.97
其中：支付销售机构的 客户维护费	57,264.78	430,678.18

注：支付基金管理人 中信建投基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.33% / 当年天数。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	168,581.23	1,974,032.62

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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

### 7.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中信建投基金管理有限公司	302,080.07
中信建投证券股份有限公司	17,600.62
华夏银行股份有限公司	12,532.41
中信建投期货有限公司	1.38
合计	332,214.48
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中信建投基金管理有限公司	4,268,811.13
中信建投证券股份有限公司	141,287.41
华夏银行股份有限公司	171,135.66
合计	4,581,234.20

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。基金销售服务费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。



### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
基金合同生效日（2014年8月5日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	20,151,473.55	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	20,151,473.55	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	28.6660%	-

注：期间申购/买入总份额含红利再投资份额。

#### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2016年12月31日		2015年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华夏银行股份有限公司——个人业务部	577,978.86	0.8222%	566,041.04	0.0459%
航天科技财务有限责任公司	45,082.70	0.0641%	30,000,000.00	2.4340%

注：除基金管理人之外的其他关联方持有上述基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华夏银行股份有限公司	7,694,837.36	112,913.32	363,647,000.50	338,081.25

注：本基金的银行存款由基金托管人 华夏银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
3,489,795.98	160,085.70	-82,210.43	3,567,671.25	-

#### 7.4.12 ( 2016 年 12 月 31 日 ) 本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司风险控制与合规委员会、督察长、公司风险管理委员会、稽核合规部以及各个业务部门组成。公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理

的整个流程进行评估和改进。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与合规委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由稽控合规部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行华夏银行，其他定期存款存放在具有基金托管资格的股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于信用等级在 AA+ 级以下的债券与非金融企业债务融资工具，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的资产支持证券余额为 453,900.00 元，均为长期信用评级 AAA 级(2015 年 12 月 31 日：无)。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	-	60,063,696.28
A-1 以下	-	-

未评级	17,852,233.88	19,849,684.43
合计	17,852,233.88	79,913,380.71

注：以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外按长期信用评级的债券投资(2015 年 12 月 31 日：无)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。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，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2016 年 12 月 31 日，除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,694,837.36	-	-	-	7,694,837.36
结算备付金	261,041.10	-	-	-	261,041.10
交易性金融资产	21,322,327.57	-	-	-	21,322,327.57
买入返售金融资产	41,160,149.10	-	-	-	41,160,149.10
应收利息	-	-	-	272,430.30	272,430.30
应收申购款	-	-	-	320.00	320.00
资产总计	70,438,355.13	-	-	272,750.30	70,711,105.43
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	17,971.89	17,971.89
应付托管费	-	-	-	5,446.04	5,446.04
应付销售服务费	-	-	-	13,615.08	13,615.08
应付交易费用	-	-	-	4,310.61	4,310.61
应付利润	-	-	-	13,283.23	13,283.23
其他负债	-	-	-	359,000.00	359,000.00
负债总计	-	-	-	413,626.85	413,626.85
利率敏感度缺口	70,438,355.13	-	-	-140,876.55	70,297,478.58
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	643,647,000.50	-	-	-	643,647,000.50
交易性金融资产	210,253,288.62	-	-	-	210,253,288.62
买入返售金融资产	722,801,059.73	-	-	-	722,801,059.73
应收利息	-	-	-	4,953,681.94	4,953,681.94

应收申购款	-	-	-	1,344,382.00	1,344,382.00
资产总计	1,576,701,348.85	-	-	6,298,063.94	1,582,999,412.79
负债					
应付证券清算款	-	-	-	350,000,000.00	350,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	109,437.02	109,437.02
应付托管费	-	-	-	33,162.75	33,162.75
应付销售服务费	-	-	-	82,906.82	82,906.82
应付交易费用	-	-	-	23,367.53	23,367.53
应付利润	-	-	-	95,493.66	95,493.66
其他负债	-	-	-	109,000.00	109,000.00
负债总计	-	-	-	350,453,367.78	350,453,367.78
利率敏感度缺口	1,576,701,348.85	-	-	-344,155,303.84	1,232,546,045.01

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，若市场利率变动 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不会产生重大变动(2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	21,273,400.00	30.26	210,795,000.00	17.10
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	21,273,400.00	30.26	210,795,000.00	17.10

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 21,322,327.57 元，无属于第一或第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第二层次 210,253,288.62 元，无属于第一或第三层次的余额)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	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	其他各项资产	272,750.30	0.39
5	合计	70,711,105.43	100.00

### 8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

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	0.56	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	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%。

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 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	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	3

#### 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。



### 8.3.2 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	-

### 8.4 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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	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	-	-

### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	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

### 8.7 “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	0.1089%
报告期内偏离度的最低值	-0.1941%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0419%

注：上表中“偏离情况”根据报告期内各交易日数据计算。

#### 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正偏离度的绝对值达到或超过 0.5%的情况。

### 8.8 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1689159	16 紫鑫 1A(总价)	10,000.00	453,900.00	0.65

### 8.9 投资组合报告附注

#### 8.9.1

本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持为人民币 1.0000 元。

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，在其剩余期限内按实际利率法摊销，每日计提损益。

### 8.9.2

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。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
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

### 8.9.4 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
5,224	13,456.64	59,370,002.67	84.46%	10,927,475.91	15.54%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	35,398.24	0.0504%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 8 月 5 日）基金份额总额	910,926,136.50
本报告期期初基金份额总额	1,232,546,045.01
本报告期基金总申购份额	380,677,492.38
减:本报告期基金总赎回份额	1,542,926,058.81
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	70,297,478.58

注：总申购份额含红利再投资份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2016 年 2 月 3 日，王琦先生任中信建投基金职工监事、任巧二女士不再任职工监事。

2016 年 5 月 27 日，基金管理人发布《中信建投货币市场基金关于变更基金经理的公告》，增聘黄海浩女士为本基金的基金经理。

2016 年 6 月 22 日，基金管理人发布《中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，任命高翔先生为基金管理人副总经理。

2016 年 7 月 6 日，基金管理人发布《中信建投货币市场基金关于变更基金经理的公告》，本基金的基金经理索隽石先生离任。

2016 年 12 月 23 日，陈瑛女士、周艳丽女士任中信建投基金董事，石明磊先生、安冉女士不再任中信建投基金董事；王禹媚任中信建投基金独立董事，陈冬华不再任中信建投基金独立董事。

基金托管人华夏银行股份有限公司于 2016 年 4 月 14 日在网站披露了《华夏银行股份有限

公司关于资产托管部高级管理人员变更的公告》。经中国证券投资基金业协会批准备案，聘任陈秀良先生和徐昊光先生为资产托管部副总经理，毛剑鸣先生不再担任资产托管部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人于 2016 年 4 月 5 日发布《中信建投基金管理有限公司关于旗下基金更换会计师事务所的公告》，将会计师事务所由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）改聘为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

报告期内应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元，该审计机构自 2016 年 4 月 5 日起为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券	2	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48 号）的规定及本基金管理人的《中信建投基金管理有限公司交易席位管理办法》，本基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

(1) 证券经纪商的选择由基金管理人分管投资研究、市场的领导及投资研究部、特定资产管理部、稽控合规部负责人组成的办公会议集体讨论决定，经公司办公会通过，办理相关的租用席位或开户事宜。

(2) 投资研究部、特定资产管理部按照《券商评估细则》共同完成对各往来证券经纪商的评估，评估结果作为调整确定个别证券经纪商的交易金额及比率限制的参考。

(3) 评估实行评分制，具体如下：

分配权重（100 分）=基础服务（45%）+特别服务（45%）+销售服务（10%）。

基础服务占 45%权重，由研究员负责打分；特别服务占 45%权重，由投资研究部负责人和研究员共同打分；销售服务占 10%权重，由投资研究部负责人打分。

基础服务包括：报告、电话沟通、路演、联合调研服务等；

特别服务包括：深度推荐公司、单独调研、带上市公司上门路演、约见专家、委托课题、人员培养、重大投资机会等；

销售服务包括：日常沟通、重点推荐的沟通、投资研究工作的支持和配合。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本基金本报告期末新增和剔除交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投证券	-	-	535,760,000.00	100.00%	-	-

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期末发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

### 11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下开放式基金 2015 年年度最后一个市场交易日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 1 月 1 日
2	中信建投基金增加渤海银行股份有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 1 月 6 日
3	中信建投货币市场基金 2015 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 1 月 22 日
4	中信建投货币市场基金暂停大额申购公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 2 月 2 日
5	中信建投货币市场基金增加销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 2 月 23 日
6	中信建投基金增加杭州数米基金销售有限公司为多只基金的销售机构及参加费率优惠活动	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 2 月 24 日

	的公告		
7	中信建投基金增加上海长量基金销售有限公司为多只基金的销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 3 月 1 日
8	中信建投基金增加深圳富济财富管理有限公司为多只基金的销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 3 月 18 日
9	中信建投货币市场基金招募说明书（更新）（2016 年第 1 号）	管理人网站	2016 年 3 月 21 日
10	中信建投货币市场基金招募说明书（更新）摘要（2016 年第 1 号）	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 3 月 21 日
11	中信建投货币市场基金 2015 年年度报告	管理人网站	2016 年 3 月 26 日
12	中信建投货币市场基金 2015 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 3 月 26 日
13	中信建投基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为多只基金的销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 3 月 28 日
14	中信建投货币市场基金暂停大额申购公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 3 月 30 日
15	中信建投基金管理有限公司关于旗下基金更换会计师事务所的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 4 月 5 日
16	关于调整中信建投货币市场基金机构投资者申购最低金额和最低持有份额数额限制的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 4 月 7 日
17	中信建投基金管理有限公司关于上海陆金所资产管理有限公司费率调整的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 4 月 14 日
18	中信建投货币市场基金 2016 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 4 月 21 日
19	中信建投基金管理有限公司关于参加金融界费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 4 月 22 日
20	中信建投基金增加大泰金石投资管理有限公司为多只基金的销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 4 月 27 日
21	中信建投基金增加北京电盈基金销售有限公司为多只基金的销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 4 月 29 日

	的公告		
22	中信建投基金管理有限公司关于上海天天基金销售有限公司费率调整的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 5 月 5 日
23	中信建投基金管理有限公司关于杭州数米基金销售有限公司费率调整的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 5 月 5 日
24	中信建投基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为多只基金的销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 5 月 16 日
25	中信建投基金增加珠海盈米财富管理有限公司为多只基金的销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 5 月 23 日
26	中信建投货币市场基金关于变更基金经理的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 5 月 27 日
27	中信建投基金管理有限公司关于上海陆金所资产管理有限公司费率调整的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 6 月 6 日
28	中信建投基金管理有限公司关于浙江同花顺基金销售有限公司费率调整的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 6 月 6 日
29	中信建投货币市场基金暂停大额申购公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 6 月 6 日
30	中信建投货币市场基金开放定期定额投资业务公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 6 月 24 日
31	中信建投基金管理有限公司旗下开放式基金参与上海陆金所资产管理有限公司定投业务的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 6 月 24 日
32	中信建投基金管理有限公司旗下开放式基金参与北京新浪仓石基金销售有限公司定投业务的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 6 月 28 日
33	中信建投基金增加北京钱景财富投资管理有限公司为多只基金的销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 6 月 29 日
34	中信建投基金管理有限公司旗下开放式基金参与北京钱景财富投资管理有限公司定投业务的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 6 月 30 日
35	中信建投基金管理有限公司关	中国证监会指定报刊及管理	2016 年 7 月 1 日



	于旗下开放式证券投资基金 2016 年半年度最后一个市场交易日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值的公告	人网站	
36	中信建投货币市场基金关于变更基金经理的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 7 月 6 日
37	中信建投基金管理有限公司旗下开放式基金参与上海天天基金销售有限公司定投业务的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 7 月 8 日
38	中信建投基金增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 7 月 13 日
39	中信建投基金管理有限公司关于旗下基金通过武汉市伯嘉基金销售有限公司开展定投申购业务的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 7 月 13 日
40	中信建投货币市场基金 2016 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 7 月 19 日
41	中信建投基金管理有限公司关于调整旗下基金天天基金销售平台申购金额下限及最低持有金额下限的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 7 月 25 日
42	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金暂停参加泰诚财富基金销售（大连）有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 8 月 12 日
43	中信建投基金管理有限公司关于调整旗下基金同花顺基金销售平台申购金额下限及最低持有金额下限的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 8 月 12 日
44	中信建投货币市场基金 2016 年半年度报告	管理人网站	2016 年 8 月 25 日
45	中信建投货币市场基金 2016 年半年度报告摘要	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 8 月 25 日
46	《中信建投货币市场基金 2016 年半年度报告摘要》更正公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 8 月 30 日
47	中信建投货币市场基金招募说明书（更新）（2016 年第 2 号）	管理人网站	2016 年 9 月 14 日
48	中信建投货币市场基金招募说明书（更新）摘要（2016 年第 2 号）	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 9 月 14 日
49	中信建投基金增加北京汇成基	中国证监会指定报刊及管理	2016 年 9 月 23 日

	金销售有限公司为多只基金的销售机构的公告	人网站	
50	中信建投货币市场基金暂停大额申购公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 9 月 28 日
51	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信建投证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 9 月 28 日
52	中信建投基金管理有限公司关于旗下基金通过中信建投证券股份有限公司参与定投申购业务及费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 9 月 28 日
53	中信建投基金增加北京恒天明泽基金销售有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 10 月 13 日
54	中信建投货币市场基金 2016 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 10 月 26 日
55	中信建投基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 10 月 28 日
56	中信建投基金增加天津国美基金销售有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 11 月 4 日
57	中信建投基金管理有限公司关于旗下基金通过北京新浪仓石基金销售有限公司购买费率调整的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 11 月 11 日
58	中信建投基金增加上海利得基金销售有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 11 月 15 日
59	中信建投基金增加中信证券股份有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 11 月 23 日
60	中信建投基金增加中信期货有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 11 月 23 日
61	中信建投基金增加中信证券（山东）有限责任公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 11 月 23 日
62	中信建投基金管理有限公司关于旗下基金通过北京肯特瑞财富投资管理有限公司开展定投申购业务的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 12 月 1 日
63	中信建投基金增加北京格上富	中国证监会指定报刊及管理	2016 年 12 月 2 日

	信投资顾问有限公司为多只基金的销售机构的公告	人网站	
64	中信建投基金管理有限公司关于旗下基金通过北京格上富信投资顾问有限公司开展定投申购业务的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 12 月 6 日
65	中信建投基金增加北京微动利投资管理有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 12 月 8 日
66	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	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 12 月 22 日
67	中信建投货币市场基金基金合同	管理人网站	2016 年 12 月 22 日
68	中信建投货币市场基金托管协议	管理人网站	2016 年 12 月 22 日
69	中信建投货币市场基金暂停大额申购公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 12 月 26 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无需要披露的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所。

### 13.3 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 3 月 31 日