

中信建投货币市场基金

2017年第4季度报告

2017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:2018年01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2018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，投资人购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构，基金管理人也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2017年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	中信建投货币
基金主代码	000738
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年08月05日
报告期末基金份额总额	49,183,755.21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，属于证券投资基金中的低

	风险品种，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	
下属分级基金的基金简称	中信建投货币A	中信建投货币B
下属分级基金的交易代码	000738	004554
报告期末下属分级基金的份额总额	12,890,336.97份	36,293,418.24份

§ 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(2017年10月01日 - 2017年12月31日)	
	中信建投货币A	中信建投货币B
1. 本期已实现收益	169,602.51	382,334.11
2. 本期利润	169,602.51	382,334.11
3. 期末基金资产净值	12,890,336.97	36,293,418.24

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

中信建投货币A净值表现

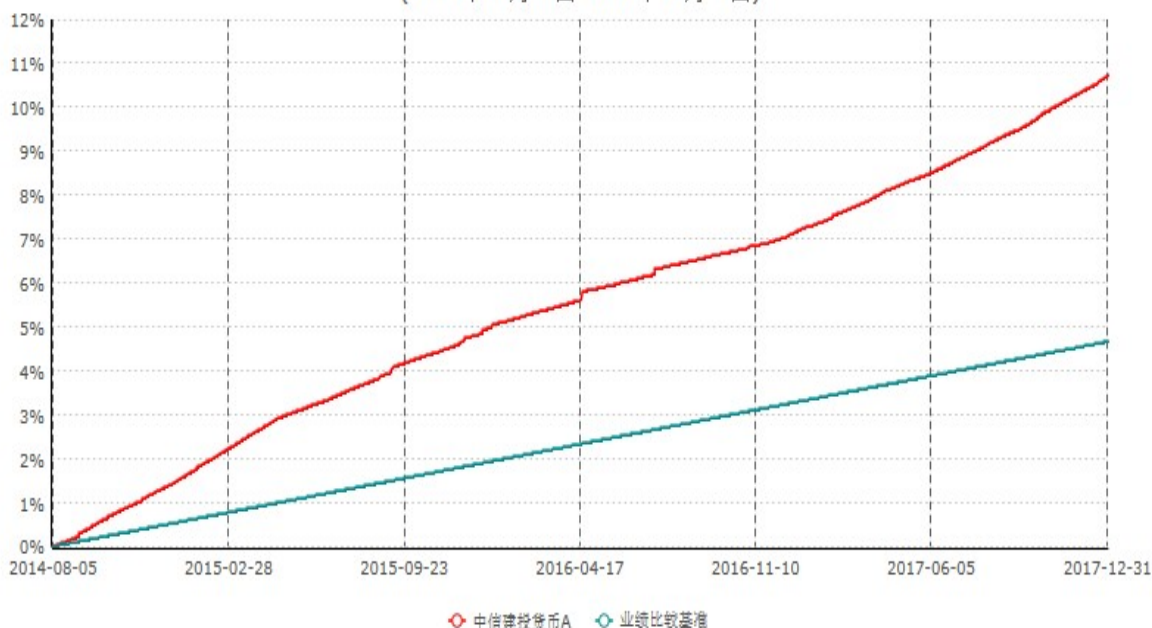
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9924%	0.0035%	0.3450%	0.0000%	0.6474%	0.0035%

中信建投货币B净值表现

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	1.0534%	0.0035%	0.3450%	0.0000%	0.7084%	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A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2014年08月05日-2017年12月31日)



中信建投货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年09月01日-2017年12月31日)



注：1、图 1 为中信建投货币市场 A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图，绘图日期为 2014 年 8 月 5 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日；

2、图 2 为中信建投货币市场 B 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图，绘图日期为 2017 年 9 月 1 日（首笔份额登记日）至 2017 年 12 月 31 日。

§ 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	2016-05-25	-	6年	中国籍, 1985年10月生, 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, 中信建投基金管理有限公司交易部交易员。现任本公司投资研究部基金经理, 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、中信建投稳惠债券型证券投资基金、中信建投稳祥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。首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

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遵规守信情况说明

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场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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度经济数据整体上不弱于三季度，制造业PMI及非制造业商务活动指数表现平稳。现阶段价格对制造业影响较大，出厂价格指数及原材料购进价格指数回升。央行的第四季度例会对货币政策的表述“实施好稳健中性的货币政策，切实管住货币供给总闸门，综合运用多种货币政策工具，保持货币信贷及社会融资规模合理增长，维护流动性合理稳定，提升金融运行效率和服务实体经济能力，有效控制宏观杠杆率”，这可能意味着2018年对于货币闸门的控制将更为严格，流动性稳定的重要性或让位于信贷与社融合理增长。

本基金作为流动性管理工具，基金管理人在运作期间，一直保持投资组合较高的流动性，保持灵活的剩余期限和操作节奏。坚持规范运作、审慎投资，为基金持有人谋求安全、稳定的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投货币A基金份额净值为1.000元；本报告期内，基金份额净值收益率为0.9924%，同期业绩比较基准收益率为0.345%；截至报告期末中信建投货币B基金份额净值为1.000元；本报告期内，基金份额净值收益率为1.0534%，同期业绩比较基准收益率为0.345%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未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	19,020,398.91	38.51
	其中：债券	19,020,398.91	38.51
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,382,125.07	6.85
	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	26,530,057.81	53.72
4	其他资产	455,320.33	0.92
5	合计	49,387,902.12	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	3.30
	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	85
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	33

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过120天。

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	14.26	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	36.60	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	15.25	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	18.15	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	15.23	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.49	-

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	10,584,486.70	21.52
	其中：政策性金融债	10,584,486.70	21.52
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	3,500,183.73	7.12
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,935,728.48	10.04
8	其他	-	-
9	合计	19,020,398.91	38.67
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	111713077	17浙商银行CD077	50,000	4,935,728.48	10.04
2	170408	17农发08	40,000	3,992,526.40	8.12
3	170410	17农发10	40,000	3,992,475.41	8.12
4	011788003	17恒信租赁SCP002	35,000	3,500,183.73	7.12
5	170301	17进出01	26,000	2,599,484.89	5.29

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	0.0445%
报告期内偏离度的最低值	-0.0937%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0346%
------------------------	---------

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名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法，即计价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，在剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益。本基金通过每日计算并分配收益的方式，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	355,075.32
4	应收申购款	100,245.01
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	455,320.33

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

	中信建投货币A	中信建投货币B
报告期期初基金份额总额	7,410,613.01	35,919,799.14
报告期期间基金总申购份额	39,605,467.54	30,375,513.16
报告期期间基金总赎回份额	34,125,743.58	30,001,894.06
报告期期末基金份额总额	12,890,336.97	36,293,418.24

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投和基金份额自动升降级调整份额；基金总赎回份额含基金份额自动升降级调减份额。

§ 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	交易金额	适用费率
1	红利转投	2017-10-09	29,140.60	-	-
2	红利转投	2017-10-10	2,895.87	-	-
3	红利转投	2017-10-11	2,896.19	-	-
4	红利转投	2017-10-12	2,906.61	-	-
5	红利转投	2017-10-13	6,805.57	-	-
6	红利转投	2017-10-16	8,752.40	-	-
7	红利转投	2017-10-17	2,423.57	-	-
8	红利转投	2017-10-18	2,223.02	-	-
9	红利转投	2017-10-19	2,268.18	-	-
10	红利转投	2017-10-20	1,864.71	-	-
11	红利转投	2017-10-23	6,724.77	-	-
12	红利转投	2017-10-24	2,300.61	-	-
13	红利转投	2017-10-25	6,138.13	-	-
14	红利转投	2017-10-26	2,421.47	-	-
15	红利转投	2017-10-27	2,452.96	-	-
16	红利转投	2017-10-30	7,379.22	-	-
17	红利转投	2017-10-31	2,221.87	-	-
18	红利转投	2017-11-01	2,318.31	-	-
19	红利转投	2017-11-02	2,442.65	-	-
20	红利转投	2017-11-03	2,564.90	-	-
21	红利转投	2017-11-06	7,923.70	-	-

22	红利转投	2017-11-07	2,525.72	-	-
23	红利转投	2017-11-08	2,539.44	-	-
24	红利转投	2017-11-09	2,542.69	-	-
25	红利转投	2017-11-10	2,557.62	-	-
26	红利转投	2017-11-13	7,692.66	-	-
27	红利转投	2017-11-14	2,437.51	-	-
28	红利转投	2017-11-15	2,339.88	-	-
29	红利转投	2017-11-16	2,354.32	-	-
30	红利转投	2017-11-17	2,358.66	-	-
31	红利转投	2017-11-20	7,084.22	-	-
32	红利转投	2017-11-21	2,369.97	-	-
33	红利转投	2017-11-22	3,108.11	-	-
34	红利转投	2017-11-23	2,354.67	-	-
35	红利转投	2017-11-24	2,365.42	-	-
36	红利转投	2017-11-27	7,117.89	-	-
37	红利转投	2017-11-28	2,377.95	-	-
38	红利转投	2017-11-29	2,151.77	-	-
39	红利转投	2017-11-30	2,668.29	-	-
40	红利转投	2017-12-04	7,531.13	-	-
41	红利转投	2017-12-05	2,577.95	-	-
42	红利转投	2017-12-06	2,583.31	-	-
43	红利转投	2017-12-07	2,402.31	-	-
44	红利转投	2017-12-08	2,403.66	-	-
45	红利转投	2017-12-11	7,223.16	-	-
46	红利转投	2017-12-12	2,409.44	-	-
47	红利转投	2017-12-13	2,413.74	-	-
48	红利转投	2017-12-14	2,424.21	-	-
49	红利转投	2017-12-15	2,429.58	-	-
50	红利转投	2017-12-18	7,297.69	-	-
51	红利转投	2017-12-19	2,393.64	-	-
52	红利转投	2017-12-20	6,952.88	-	-
53	红利转投	2017-12-21	2,560.70	-	-
54	红利转投	2017-12-22	2,562.95	-	-

55	红利转投	2017-12-25	7,647.76	-	-
56	红利转投	2017-12-26	2,553.62	-	-
57	红利转投	2017-12-27	2,702.16	-	-
58	红利转投	2017-12-28	5,623.96	-	-
59	红利转投	2017-12-29	3,001.93	-	-
合计			246,058.85	0.00	

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20171009-20171229	23,685,278.48	-	-	23,902,196.76	48.60%
	2	20171218-20171218	-	20,000,000.00	20,000,000.00	-	-

产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，由可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 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

二〇一八年一月二十日