

中信建投添鑫宝货币市场基金

招募说明书(更新)摘要

2018年第【2】号

基金管理人: 中信建投基金管理有限公司

基金托管人: 中信银行股份有限公司

重要提示

(一) 本次基金募集的准予注册文件名称为:《关于准予中信建投添鑫宝货币市场基金注册的批复》(证监许可【2015】2802号),注册日期为:2015年12月1日。本基金基金合同于2015年12月16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投资价值、市场前景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》等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,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,自行承担投资风险。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,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。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) 本更新的招募说明书所载内容截止日为 2018 年 6 月 16 日，有关财务数据和净值截止日为 2018 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。本基金托管人中信银行股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

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 17、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：持续经营

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。曾任中信证券股份有限公司交易部总经理、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、研究发展部行政负责人，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。曾任华夏证券股份有限公司深圳振华路营业部经理、华夏证券股份有限公司深圳分公司经管部经理、华夏证券股份有限公司经管总部副经理、中信建投证券股份有限公司经纪业务管理部行政负责人、董事总经理，现任中信建投基金管理有限公司副董事长、总经理。

李聚合先生，副董事长，中国人民大学在职博士研究生学历。曾任国家发改委财政金融司副司长，长期从事宏观经济及财政货币政策研究，熟悉证券期货市场及社会信用体系建设情况。现任中信建投基金管理有限公司副董事长，兼任元达信资本管理(北京)有限公司执行董事、中信建投证券股份有限公司董事总经理、交通信用研究院顾问委员会主任。

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)财务资产部副主任，现任江苏省广播电视总台(集团)财务资产部主任、中信建投基金管理有限公司董事，兼任江苏广电石湫影视基地有限公司董事、江苏广行天下汽车销售服务有限公司董事。

袁野先生，常务副总经理、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。

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，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、天健光华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事务所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。

胡家勇先生，独立董事，中南财经大学博士研究生学历。曾任中南财经大学助教、讲师、副教授、教授，现任中国社会科学院经济研究所研究员、中信建投基金管理有限公司独立董事，兼任国家社会科学基金评审组专家、中国博士后科学基金评审组专家、全国科技名词审定委员会委员、经济贸易名词审定委员会副主任。

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、董事总经理，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、总经理，现任航天科技财务有限责任公司结算部总经理、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，兼任南京市金陵文化科技小额贷款有限公司董事、江苏展响实业有限公司董事。

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，曾任中信建投基金管理有限公司总经理助理、特定资产管理部负责人，现任元达信资本管理（北京）有限公司总经理、中信建投基金管理有限公司职工监事。

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、中信建投基金管理有限公司信息技术部负责人，现任元达信资本管理（北京）有限公司项目经理、中信建投基金管理有限公司职工监事。

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。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、中信建投基金管理有限公司督察长，现任中信建投基金管理有限公司副总经理、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（现中北大学）本科学历。曾任广东深圳蛇口新欣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。

张乐久先生，加拿大不列颠哥伦比亚大学硕士研究生学历。曾任中大期货有限公司研究员、太平洋证券股份有限公司研究员、中国证券监督管理委员会北京监管局主任科员、北京同瑞汇金管理有限公司合规专员，现任中信建投基金管理有限公司督察长，兼任稽控合规部负责人、公司董事会秘书。

4、本基金基金经理

黄海浩女士, 山东大学本科学历。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, 现任中信建投基金管理有限公司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学历。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、国金证券股份有限公司及其下属基金公司研究员、中信建投基金管理有限公司投资研究部研究员, 现任中信建投基金管理有限公司投资研究部基金经理。

黄海浩女士, 简历同上。

梁奇先生, 清华大学硕士研究生学历。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控合规部风险管理岗。

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、基金托管人基本情况

名称: 中信银行股份有限公司(简称“中信银行”)

住所: 北京市东城区朝阳门北大街9号

办公地址: 北京市东城区朝阳门北大街9号

法定代表人: 李庆萍

成立时间: 1987年4月20日

组织形式: 股份有限公司

注册资本: 489.35亿元人民币

存续期间：持续经营

批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2004]125 号

联系人：中信银行资产托管部

联系电话：4006800000

传真：010-85230024

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；代理开放式基金业务；办理黄金业务；黄金进出口；开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者托管业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；保险兼业代理业务（有效期至 2017 年 09 月 08 日）。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动。）

中信银行（601998.SH、0998.HK）成立于 1987 年，原名中信实业银行，是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一，是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行，并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外。伴随中国经济的快速发展，中信实业银行在中国金融市场改革的大潮中逐渐成长壮大，于 2005 年 8 月，正式更名“中信银行”。2006 年 12 月，以中国中信集团和中信国际金融控股有限公司为股东，正式成立中信银行股份有限公司。同年，成功引进战略投资者，与欧洲领先的西班牙对外银行（BBVA）建立了优势互补的战略合作关系。2007 年 4 月 27 日，中信银行在上海交易所和香港联合交易所成功同步上市。2009 年，中信银行成功收购中信国际金融控股有限公司（简称：中信国金）70.32% 股权。经过三十年的发展，中信银行已成为国内资本实力最雄厚的商业银行之一，是一家快速增长并具有强大综合竞争力的全国性股份制商业银行。2009 年，中信银行通过了美国 SAS70 内部控制审订并获得无保留意见的 SAS70 审订报告，表明了独立公正第三方对中信银行托管服务运作流程的风险管理和内

部控制的健全有效性全面认可。

二、主要人员情况

孙德顺先生，中信银行执行董事、行长。孙先生自 2016 年 7 月 20 日起任本行行长。孙先生同时担任中信银行（国际）董事长。此前，孙先生于 2014 年 5 月至 2016 年 7 月任本行常务副行长；2014 年 3 月起任本行执行董事；2011 年 12 月至 2014 年 5 月任本行副行长，2011 年 10 月起任本行党委副书记；2010 年 1 月至 2011 年 10 月任交通银行北京管理部副总裁兼交通银行北京市分行党委书记、行长；2005 年 12 月至 2009 年 12 月任交通银行北京市分行党委书记、行长；1984 年 5 月至 2005 年 11 月在中国工商银行海淀区办事处、海淀区支行、北京分行、数据中心（北京）等单位工作，期间，1995 年 12 月至 2005 年 11 月任中国工商银行北京分行行长助理、副行长，1999 年 1 月至 2004 年 4 月曾兼任中国工商银行数据中心（北京）总经理；1981 年 4 月至 1984 年 5 月就职于中国人民银行。孙先生拥有三十多年的中国银行业从业经验。孙先生毕业于东北财经大学，获经济学硕士学位。

张强先生，中信银行副行长，分管托管业务。张先生自 2010 年 3 月起任本行副行长。此前，张先生于 2006 年 4 月至 2010 年 3 月任本行行长助理、党委委员，期间，2006 年 4 月至 2007 年 3 月曾兼任总行公司银行部总经理。张先生 2000 年 1 月至 2006 年 4 月任本行总行营业部副总经理、常务副总经理和总经理；1990 年 9 月至 2000 年 1 月先后在本行信贷部、济南分行和青岛分行工作，曾任总行信贷部副总经理、总经理、分行副行长和行长。自 1990 年 9 月至今，张先生一直为本行服务，在中国银行业拥有近三十年从业经历。张先生为高级经济师，先后于中南财经大学（现中南财经政法大学）、辽宁大学获得经济学学士学位、金融学硕士学位。

杨洪先生，现任中信银行资产托管部总经理，硕士研究生学历，高级经济师，教授级注册咨询师。先后毕业于四川大学和北京大学工商管理学院。曾供职于中国人民银行四川省分行、中国工商银行四川省分行。1997 年加入中信银行，相继任中信银行成都分行信贷部总经理、支行行长，总行零售银行部总经理助理兼市场营销部总经理、贵宾理财部总经理、中信银行贵阳分行党委书记、行长，总行行政管理部总经理。

三、基金托管业务经营情况

2004年8月18日,中信银行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批准,取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则,切实履行托管人职责。

截至2017年末,中信银行已托管144只公开募集证券投资基金,以及基金公司、证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产,托管总规模达到8.06万亿元人民币。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

(1) 直销中心

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

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) 网上直销

直销网站: www.cfund108.com

2、代销机构

(1) 中信建投证券股份有限公司

住所: 北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址: 北京市东城区朝内大街188号

法定代表人: 王常青

联系人: 权唐

客户服务电话: 95587、400-8888-108

网址: www.csc108.com

(2) 上海攀赢金融信息服务有限公司

注册地址: 上海市闸北区广中西路 1207 号 306 室

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴银城中路 488 号太平金融大厦 603 室

法定代表人: 田为奇

电话: 021-68889082

联系人: 吴卫东

网址: www.pytz.cn

客户服务电话: 021-68889082

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、陆奇

联系人：陆奇

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

中信建投添鑫宝货币市场基金

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。

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

1、资产配置策略

本基金将通过对宏观经济发展态势、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(成交活跃度、发行规模)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,优先选择内部信用评级较高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成交活跃度、发行规模,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。

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 2018 年 3 月 31 日(摘自本基金 2018 年第 1 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	2,909,223,960.12	55.24
	其中: 债券	2,909,223,960.12	55.24
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	210,100,635.15	3.99
	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	2,121,968,609.73	40.29
4	其他资产	24,824,980.17	0.47
5	合计	5,266,118,185.17	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	1.86	
	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	558,048,120.97	11.91
	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%。

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	86
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	36

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。

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	18.92	11.91
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	9.46	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	59.31	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	5.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	18.74	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	111.85	11.91

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	564,271,798.06	12.04
	其中：政策性金融债	564,271,798.06	12.04
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	400,503,417.96	8.55
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,944,448,744.10	41.49
8	其他	-	-

9	合计	2,909,223,960.12	62.08
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	111810137	18 兴业银行 CD137	3,000,000	293,467,046.62	6.26
2	111710600	17 兴业银行 CD600	2,495,000	247,850,786.92	5.29
3	111811065	18 平安银行 CD065	2,000,000	198,325,311.05	4.23
4	111893068	18 杭州银行 CD010	2,000,000	198,248,871.22	4.23
5	111894056	18 南京银行 CD045	2,000,000	197,974,877.62	4.22
6	170211	17 国开 11	1,350,000	134,642,368.99	2.87
7	180201	18 国开 01	1,000,000	99,956,051.56	2.13
8	170207	17 国开 07	1,000,000	99,919,117.16	2.13
9	170410	17 农发 10	1,000,000	99,892,027.39	2.13
10	111893098	18 徽商银行 CD038	1,000,000	99,124,435.61	2.12

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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0861%
报告期内偏离度的最低值	0.0062%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0237%

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。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

八、投资组合报告附注

1、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	24,824,980.17
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	24,824,980.17

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 2018 年 3 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	①-③	②-④

				准差④		
2018年1月1日~2018年3月31日	0.9341%	0.0007%	0.3375%	0.0000%	0.5966%	0.0007%
2017年1月1日~2017年12月31日	3.7363%	0.0012%	1.3688%	0.0000%	2.3675%	0.0012%
2016年1月1日~2016年12月31日	2.2288%	0.0013%	1.3725%	0.0000%	0.8563%	0.0013%
2015年12月16日(基金合同生效日)~2015年12月31日	0.0579%	0.0001%	0.0600%	0.0000%	-0.0021%	0.0001%

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

中信建投添鑫宝货币市场基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年12月16日-2018年03月31日)



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、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 10、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 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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%,本基金可以对不同份额类别设定不同的销售服务费率并在招募说明书中列示。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4-10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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对《中信建投添鑫宝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 前言”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“第八部分 基金份额的申购与赎回”的相关内容；

7、更新了“第九部分 基金的投资”的相关内容，“基金投资组合报告”经托管人复核；

- 8、更新了“第十部分 基金的业绩”的相关内容，并经托管人复核；
- 9、更新了“第十二部分 基金资产估值”的相关内容；
- 10、更新了“第十六部分 基金的信息披露”的相关内容；
- 11、更新了“第十七部分 风险揭示”的相关内容；
- 12、更新了“第二十部分 基金托管协议的内容摘要”的相关内容；
- 13、更新了“第二十二部分 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

2018年7月