

# 中融日日盈交易型货币市场基金

## 2016年第2季度报告

2016年06月30日

基金管理人：中融基金管理有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

报告送出日期：2016年07月19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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年7月18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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至2016年6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	中融日盈
基金主代码	511930
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年11月30日
报告期末基金份额总额	28,793,913.30份
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金将根据宏观经济走势、货币政策、短期资金市场状况等因素对利率走势进行综合判断，并根据利率预期动态调整基金投资组合的平均剩余期限，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、久期控制策略</li> <li>2、资产类属配置策略</li> <li>3、时机选择策略</li> <li>4、套利策略</li> </ol>
业绩比较基准	七天通知存款利率（税后）
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。
基金管理人	中融基金管理有限公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司

注：本基金份额净值为100.00元。

### § 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（2016年04月01日-2016年06月30日）
1. 本期已实现收益	4,837,779.55
2. 本期利润	4,837,779.55
3. 期末基金资产净值	2,879,391,330.32

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、本基金利润分配是按日结转份额。

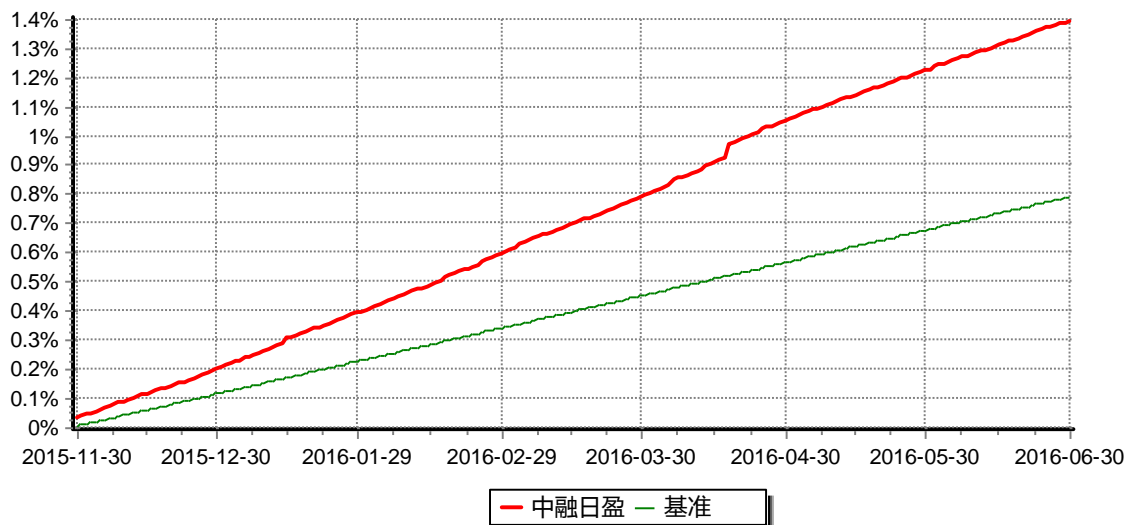
#### 3.2 基金净值表现

##### 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

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	0.5916%	0.0052%	0.3366%	0.0000%	0.2550%	0.0052%

##### 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

中融日日盈交易型货币市场基金  
 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2015年11月30日至2016年06月30日）



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

## § 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		
李倩	本基金、中融融安二号保本、中融货币基金经理	2015-11-30	-	9年	李倩女士，中国国籍，毕业于对外经济贸易大学金融学专业，本科学历，具有基金从业资格，证券从业年限9年。2007年7月至2014年7月曾任银华基金管理有限公司交易管理部交易员，固定收益部基金经理助理。2014年7月加入中融基金管理有限公司，任固收投资部(北京)基金经理, 2015年11月至今任本基金基金经理。

注：（1）基金经理李倩女士任职日期指本基金基金合同生效之日。

（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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、《中融日日盈交易型货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》。公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发生异常交易行为。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度债券市场行情先抑后扬。四月份多重利空积聚，叠加信用风险事件爆发、营改增冲击，债市收益率调整剧烈。进入五月后债市情绪趋于平稳，利空逐步消化，基本面和资金面更趋于有利于债市的方向，收益率曲线得到了修复，但信用利差继续扩大。六月英国脱欧预期实现，全球避险情绪持续升温，债券市场继续向好，中长端下行明显，接近年内低点。

本组合在二季度为应对半年末对资金面的冲击，采取防守策略，保持较低的杠杆和较短的久期。合理安排组合现金流，并择机在半年末资金价格冲高时增配好收益资产以提高组合收益。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金单位净值增长率为0.5916%，同期业绩比较收益率为0.3366%。

## 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

英国脱欧实现后，全球避险情绪升温，宽松预期再起，倒逼美国加息预期延缓。国

内基本面方面仍无亮眼表现，基建独木难撑。整体环境仍有利于债市，尤其长债。政策方面，在供给侧改革的基调下，我们难再现大水漫观式货币宽松，资金价格大概率维持低位震荡，下行突破概率不大，上行弹性宽裕。

本基金将坚持货币市场基金作为流动性管理工具的定位，密切关注货币政策、经济基本面地变化，随时调整组合策略，保持良好的流动性和适中的组合久期。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告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	2,371,500,741.93	75.94
	其中：债券	2,371,500,741.93	75.94
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	505,002,392.50	16.17
	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	235,513,205.58	7.54
4	其他资产	10,761,761.37	0.34
5	合计	3,122,778,101.38	100.00

### 5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	5.14	
	其中：买断式回购融资	—	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	242,499,678.75	8.42
	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个交易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**

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%。

**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	65
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	113
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	30

**报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明**

本报告期内投资组合平均剩余期限未有超过120天的情况。

**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	47.96	8.42
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)–60天	13.53	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)–90天	30.42	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)–180天	7.60	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	180天(含)–397天(含)	8.57	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	108.08	8.42

## 5.4 报告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	179,899,843.06	6.25
	其中：政策性金融债	179,899,843.06	6.25
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	589,981,407.11	20.49
6	中期票据	100,653,377.16	3.50
7	同业存单	1,500,966,114.60	52.13
8	其他	—	—
9	合计	2,371,500,741.93	82.36
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

## 5.5 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

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	111609164	16浦发CD164	2,000,000	199,467,042.28	6.93
2	1282254	12中石油MTN2	1,000,000	100,653,377.16	3.50
3	071626001	16兴业证券 CP001	1,000,000	100,055,620.42	3.47
4	111610321	16兴业CD321	1,000,000	100,000,387.99	3.47
5	071603005	16中信CP005	1,000,000	99,983,322.65	3.47
6	111608194	16中信CD194	1,000,000	99,350,752.62	3.45
7	111617122	16光大CD122	1,000,000	99,350,533.02	3.45
8	111618147	16华夏CD147	1,000,000	99,322,424.35	3.45
9	111694725	16齐鲁银行	1,000,000	99,302,379.77	3.45



		CD020			
10	111694698	16广州农村商业银行CD099	1,000,000	96,937,727.76	3.37

## 5.6 “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	0.1866%
报告期内偏离度的最低值	0.0238%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0714%

## 5.7 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。

## 5.8 投资组合报告附注

### 5.8.1 基金计价方法说明。

本基金所持有的债券采用摊余成本法进行估值，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或折价，在其剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

5.8.2 本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 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本期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。

### 5.8.4 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	10,761,761.37

4	应收申购款	—
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	10,761,761.37

#### 5.8.5 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，各比例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

报告期期初基金份额总额	7,435,369.08
报告期期间基金总申购份额	25,739,293.79
减：报告期基金总赎回份额	4,380,749.57
报告期期末基金份额总额	28,793,913.30

注：1、总申购份额含红利再投的基金份额；

2、本基金份额净值为100.00元。

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期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) 中国证监会准予中融日日盈交易型货币市场基金募集的文件
- (2) 《中融日日盈交易型货币市场基金基金合同》
- (3) 《中融日日盈交易型货币市场基金招募说明书》
- (4) 《中融日日盈交易型货币市场基金托管协议》
- (5) 《中融基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (6) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (7) 基金托管人业务资格批件和营业执照

(8) 中国证监会要求的其他文件

## 9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所

## 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件

咨询电话：中融基金管理有限公司客户服务 400-160-6000（免长途话费），（010）85003210

网址：<http://www.zrfunds.com.cn/>

中融基金管理有限公司  
二〇一六年七月十九日