

# 信诚货币市场证券投资基金

## 2021 年第 2 季度报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 07 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 07 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，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 04 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	信诚货币		
基金主代码	550010		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011 年 03 月 23 日		
报告期末基金份额总额	2,351,856,132.34 份		
投资目标	本基金在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的投资收益率。		
投资策略	本基金将综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,在保证基金资产的安全性和流动性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。同时,通过对国内外宏观经济走势、货币政策和财政政策的研究,结合对货币市场利率变动的预期,进行积极的投资组合管理。		
业绩比较基准	活期存款利率(税后)		
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高流动性、低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。		
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	信诚货币 A	信诚货币 B	信诚货币 E
下属分级基金的交易代码	550010	550011	004849

报告期末下属分级基金的份额总额	175,111,545.36 份	2,126,546,267.13 份	50,198,319.85 份
-----------------	------------------	--------------------	-----------------

注：本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起变更为“中信保诚基金管理有限公司”。

本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

### § 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（2021 年 04 月 01 日-2021 年 06 月 30 日）		
	信诚货币 A	信诚货币 B	信诚货币 E
1. 本期已实现收益	1,025,397.21	15,518,384.83	296,332.63
2. 本期利润	1,025,397.21	15,518,384.83	296,332.63
3. 期末基金资产净值	175,111,545.36	2,126,546,267.13	50,198,319.85

注：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。由于本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。

#### 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

信诚货币 A

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	0.4698%	0.0023%	0.0873%	0.0000%	0.3825%	0.0023%
过去六个月	1.0070%	0.0025%	0.1736%	0.0000%	0.8334%	0.0025%
过去一年	1.9815%	0.0020%	0.3500%	0.0000%	1.6315%	0.0020%
过去三年	6.6351%	0.0024%	1.0510%	0.0000%	5.5841%	0.0024%
过去五年	13.8999%	0.0033%	1.7510%	0.0000%	12.1489%	0.0033%
自基金合同生效起至 今	39.4511%	0.0056%	3.7808%	0.0001%	35.6703%	0.0055%

信诚货币 B

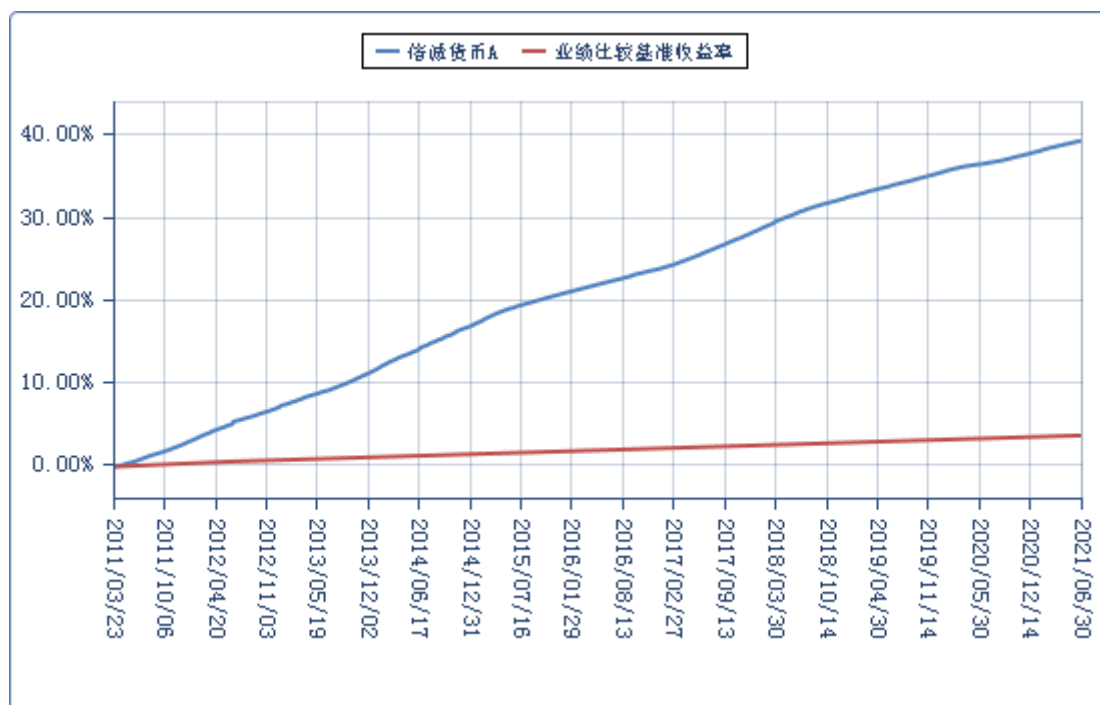
阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.5303%	0.0023%	0.0873%	0.0000%	0.4430%	0.0023%
过去六个月	1.1272%	0.0024%	0.1736%	0.0000%	0.9536%	0.0024%
过去一年	2.2261%	0.0020%	0.3500%	0.0000%	1.8761%	0.0020%
过去三年	7.4064%	0.0024%	1.0510%	0.0000%	6.3554%	0.0024%
过去五年	15.2751%	0.0033%	1.7510%	0.0000%	13.5241%	0.0033%
自基金合同生效起至 今	42.9361%	0.0056%	3.7808%	0.0001%	39.1553%	0.0055%

信诚货币 E

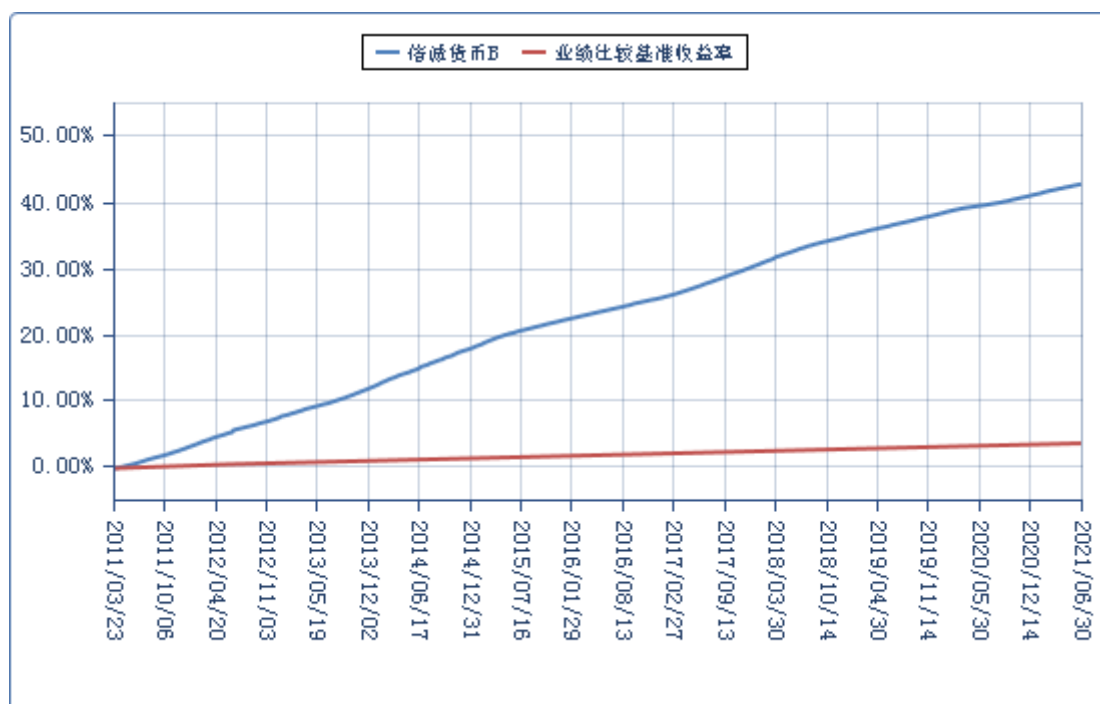
阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.4683%	0.0022%	0.0873%	0.0000%	0.3810%	0.0022%
过去六个月	1.0049%	0.0024%	0.1736%	0.0000%	0.8313%	0.0024%
过去一年	1.9799%	0.0019%	0.3500%	0.0000%	1.6299%	0.0019%
过去三年	6.6155%	0.0024%	1.0510%	0.0000%	5.5645%	0.0024%
自基金合同生效起至 今	10.3186%	0.0033%	1.3712%	0.0000%	8.9474%	0.0033%

### 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

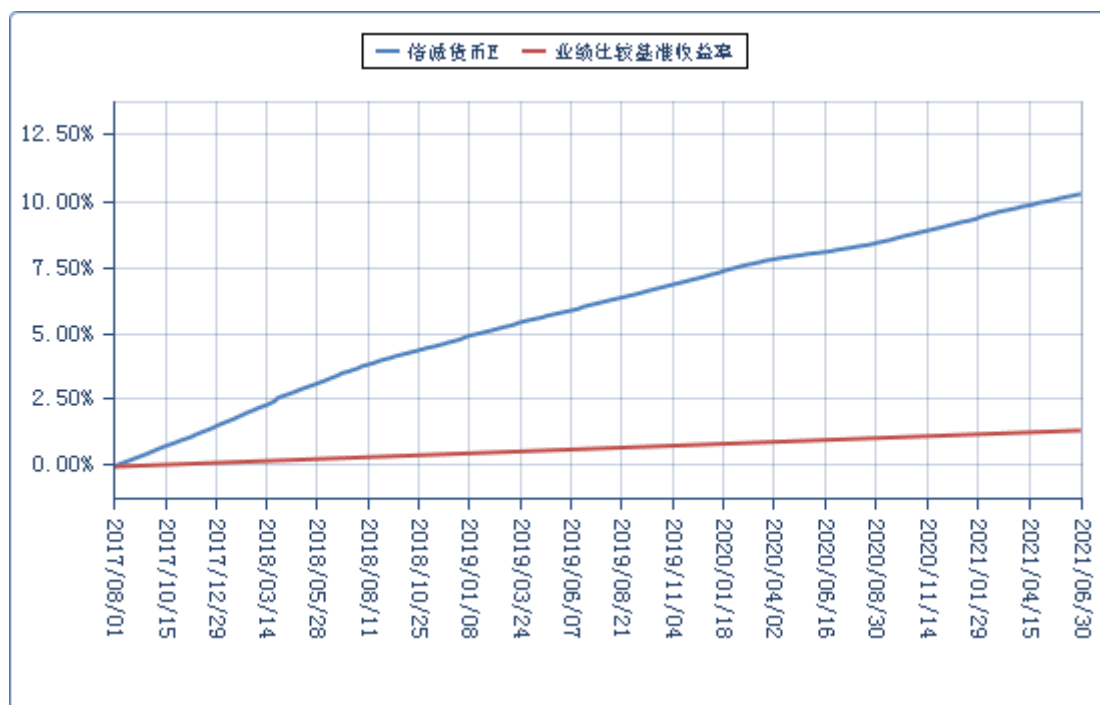
信诚货币 A



信诚货币 B



信诚货币 E



## § 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		
席行懿	本基金基金经理、固定收益部副总监	2016年03月18日	-	11	席行懿女士，工商管理硕士。曾任职于德勤华永会计师事务所，担任高级审计师。2009年11月加入中信保诚基金管理有限公司，历任基金会计经理、交易员、固定收益研究员。现任固定收益部副总监，信诚货币市场证券投资基金、中信保诚景华债券型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、信诚智惠金货币市场基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金、中信保诚景裕中短债债券

					型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---------------

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在本报告期内, 本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚货币市场证券投资基金基金合同》、《信诚货币市场证券投资基金招募说明书》的约定, 本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度, 加强内部管理, 规范基金运作。本报告期内, 基金运作合法合规, 没有发生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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度》, 公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职, 投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程, 确保各投资组合享有公平的投资决策机会, 建立公平交易的制度环境; 交易环节加强交易执行的内部控制, 利用恒生交易系统公平交易相关程序, 及其它的流程控制, 确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的公平; 公司同时不断完善和改进公平交易分析系统, 在事后加以了严格的行为监控, 分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好, 未发现违背公平交易的相关情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 未发现本基金与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。报告期内, 未出现参与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% 的交易 (完全复制的指数基金除外)。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年 2 季度, 全球疫苗接种持续推进, 主要发达国家疫情整体稳定, 海外生产修复对中国出口仍有较强支撑。国内方面, 社融增速逐步回落, 工业生产保持平稳, 制造业投资持续向好, 房地产投资犹有韧性, 消费缓慢修复, 工业企业利润处于相对高位。通胀方面, 大宗商品价格上涨推动 PPI 持续超预期

期，但 CPI 在猪价压制下整体仍然维持低位。

货币政策方面，央行依然维持稳字当头的整体基调，保持流动性合理充裕，2 季度货币市场利率仍围绕政策利率波动。7 月 9 日央行超预期全面降准，政策结构性宽松倾向加强。

从债券市场看，2 季度在社融增速见顶回落、流动性保持平稳、地方债供给压力弱于预期等因素影响下，10 年国债收益率从 3.20% 小幅下行至 3.08%；信用债方面，各类品种信用利差均下行至历史偏低位置，信用债市场整体情绪有所修复但尾部风险仍存。

组合配置上，4 月 5 月是缴税大月，组合主要以流动性管理为主，6 月组合拉长剩余期限至 60 天，维持中性杠杆操作，配置上以 1M 搭配 3M 同业存单和存款配置为主。

展望 3 季度，预计海外经济将延续复苏趋势，重点关注美联储 QE 缩减进程。国内方面，当前经济呈现生产边际转弱，需求端修复结构分化特征。其中需求端的出口、房地产投资和基建投资有所回落，制造业投资和消费持续修复。下半年来看，全球供应链修复和高基数影响下，预计出口增速将有所回落，且净出口对经济的贡献将明显下降；在货币政策实际操作稳中趋松的情况下，社融增速下行速度或有所放缓；在实体经济层面，房地产投资和基建均将延续走弱，经济修复的内生动能主要来源于制造业投资和消费的修复幅度。在经济增长边际放缓的背景下，货币政策易松难紧，且针对下半年经济放缓的压力将采取结构性宽松的货币政策，以应对内外部不断上升的不确定性。

债券市场投资方面，超预期全面降准背景下，预计短期内资金面稳定性将进一步加强，长端利率有望小幅下行；信用方面，在信用分化环境中，仍然建议选择中高等级信用债进行投资，且当前信用期限利差较为陡峭，可以适当考虑资质较好的信用债的久期价值。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，信诚货币 A 份额净值收益率为 0.4698%，同期业绩比较基准收益率为 0.0873%；信诚货币 B 份额净值收益率为 0.5303%，同期业绩比较基准收益率为 0.0873%；信诚货币 E 份额净值收益率为 0.4683%，同期业绩比较基准收益率为 0.0873%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元（基金份额持有人数量不满二百人）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	1,856,955,417.78	77.01
	其中：债券	1,856,955,417.78	77.01
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	300,010,570.02	12.44
	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	201,528,164.52	8.36
4	其他资产	52,926,152.69	2.19
5	合计	2,411,420,305.01	100.00

### 5.2 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	2.74	
	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	57,949,851.02	2.46
	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	57
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	57
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	18

注：本基金合同约定，本基金管理人将动态确定并控制投资组合平均剩余期限在 120 天以内，以规避较长期限债券的利率风险。

**报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明**

本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余期限超过 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	61.72	2.46
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30 天（含）—60 天	6.36	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60 天（含）—90 天	18.19	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90 天（含）—120 天	2.11	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00
5	120 天（含）—397 天（含）	11.90	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00
	合计	100.28	2.46

**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**

本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

**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	160,249,117.57	6.81
	其中：政策性金融债	160,249,117.57	6.81
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,500,007.72	0.06
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,695,206,292.49	72.08
8	其他	-	-
9	合计	1,856,955,417.78	78.96

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	112109164	21 浦发银行 CD164	2,000,000	199,732,392.75	8.49
2	112111116	21 平安银行 CD116	2,000,000	199,718,468.12	8.49
3	112116098	21 上海银行 CD098	2,000,000	198,937,675.49	8.46
4	210301	21 进出 01	1,100,000	110,017,018.90	4.68
5	112010238	20 兴业银行 CD238	1,000,000	100,000,000.00	4.25
6	112182883	21 徽商银行 CD082	1,000,000	99,863,219.87	4.25
7	112198252	21 广州农村商业银行 CD032	1,000,000	99,856,469.95	4.25
8	112106123	21 交通银行 CD123	1,000,000	99,852,708.02	4.25
9	112004082	20 中国银行 CD082	1,000,000	99,834,897.27	4.24
10	112198681	21 青岛农商行 CD081	1,000,000	99,820,737.71	4.24

### 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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0400%
报告期内偏离度的最低值	-0.0063%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0173%

#### 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 报告期末按摊余成本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。

### 5.9.2 基金投资前十名证券的发行主体本期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、处罚说明

上海浦东发展银行股份有限公司于 2020 年 8 月 10 日、2020 年 12 月 11 日、2021 年 4 月 23 日分别受到上海银保监局、国家外汇管理局上海市分局和中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚（沪银保监银罚决字[2020]12 号、上海汇管罚字[2020]20200007 号、沪银保监罚决字[2021]9 号），因于 2013 年至 2019 年期间存在未按专营部门制规定开展同业业务等多项违法违规事实被责令改正，并处罚款共计 2100 万元；因违反公正、公平、诚信原则，违规开展外汇市场交易，违反银行交易记录管理规定等违法事实被责令限期改正，并处罚款 140 万元；因未按规定开展代销业务被责令改正，并处罚款共计 760 万元。

平安银行股份有限公司于 2020 年 10 月 16 日、2021 年 5 月 28 日分别收到宁波银保监局、中国银保监会云南监管局的处罚（甬银保监罚决字（2020）66 号、云银保监罚决字（2021）34 号），因贷款资金用途管控不到位、借贷搭售等违法违规事项，被合计罚款人民币 100 万元；因贷款用途审查监控不到位等违法违规事实被处以罚款人民币 210 万元。

上海银行股份有限公司分别于 2020 年 8 月 14 日、2020 年 11 月 18 日、2021 年 4 月 25 日收到上海银保监局的 3 份处罚（沪银保监银罚决字[2020]14 号、沪银保监银罚决字（2020）25 号、沪银保监罚决字（2021）31 号），上海银行因违规向资本金不足、“四证”不全的房地产项目发放贷款，以其他贷款科目发放房地产开发贷款等违法违规行为被责令改正，没收违法所得 27.155092 万元，罚款 1625 万元，罚没合计 1652.155092 万元；因 2014 年至 2018 年绩效考核管理严重违反审慎经营规则、2018 年未按规定延期支付 2017 年度绩效薪酬被责令改正，并处罚款共计 80 万元；因未按照规定进行信息披露被责令改正，并处罚款 30 万元。

兴业银行股份有限公司于 2020 年 8 月 31 日、2020 年 9 月 4 日分别受到中国银保监会福建监管局、

中国人民银行福州中心支行处罚（闽银保监罚决字〔2020〕24号、福银罚字〔2020〕35号），兴业银行因向同业投资用途不合规等违法违规行为被没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元；因向无证机构提供转接清算服务等违法违规行为被给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款。

广州农村商业银行股份有限公司于 2021 年 4 月 1 日收到中国银保监会广东监管局的处罚（粤银保监罚决字〔2021〕15号），因贷款业务严重违反审慎经营规则被罚款 50 万元。

徽商银行股份有限公司分别于 2020 年 8 月 7 日、2020 年 9 月 30 日、2020 年 11 月 20 日收到中国人民银行合肥中心支行、安徽银保监局的 3 份处罚（（合银）罚字〔2020〕3号、皖银保监罚决字〔2020〕25号、皖银保监罚决字〔2020〕39号），徽商银行因备案类账户开立未及时备案等违法违规行为被警告，并处罚款 49.5 万元；因同业业务专营部门管理不到位等违法违规行为被罚款 290 万元；因同业业务投资不审慎、理财业务严重违反审慎经营规则、未落实统一授信管理要求被罚款 175 万元。

中国银行股份有限公司于 2020 年 12 月 1 日、2021 年 5 月 17 日受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2020〕60号、银保监罚决字〔2021〕11号），因“原油宝”产品风险事件相关违法违规行为被罚款 5050 万元；因违规向关系人发放信用贷款等违法违规事实被罚没 8761.355 万元。

对“21 浦发银行 CD164”、“21 平安银行 CD116”、“21 上海银行 CD098”、“20 兴业银行 CD238”、“21 广州农村商业银行 CD032”、“21 徽商银行 CD082”和“20 中国银行 CD082”的投资决策程序的说明：本基金管理人定期回顾、长期跟踪研究该投资标的的信用资质，我们认为，该处罚事项未对上述银行的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对上述投资标的的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

除此之外，其余本基金投资的前十名证券的发行主体均没有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。

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	701.16
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,718,181.14
4	应收申购款	51,207,270.39
5	其他应收款	-

6	其他	-
7	合计	52,926,152.69

#### 5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中摊余成本占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信诚货币 A	信诚货币 B	信诚货币 E
报告期期初基金份额总额	269,486,961.69	2,268,174,121.01	87,462.62
报告期期间基金总申购份额	89,423,770.75	3,710,516,279.00	250,296,432.63
减：报告期期间基金总赎回份额	183,799,187.08	3,852,144,132.88	200,185,575.40
报告期期末基金份额总额	175,111,545.36	2,126,546,267.13	50,198,319.85

### § 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（份）	交易金额（元）	适用费率
1	红利再投	2021年04月01日	4,704.07	4,704.07	-
2	红利再投	2021年04月02日	7,338.75	7,338.75	-
3	红利再投	2021年04月06日	12,286.15	12,286.15	-
4	强制调增	2021年04月06日	81,770.74	81,770.74	-
5	强制调减	2021年04月06日	-81,770.74	-81,770.74	-
6	基金转换(出)	2021年04月06日	-50,000,000.00	-49,999,000.00	-
7	红利再投	2021年04月07日	4.00	4.00	-
8	红利再投	2021年04月08日	3.49	3.49	-
9	红利再投	2021年04月09日	3.16	3.16	-
10	红利再投	2021年04月12日	9.99	9.99	-
11	红利再投	2021年04月13日	3.08	3.08	-
12	红利再投	2021年04月14日	3.01	3.01	-
13	红利再投	2021年04月15日	3.09	3.09	-
14	红利再投	2021年04月16日	3.06	3.06	-
15	红利再投	2021年04月19日	9.45	9.45	-
16	红利再投	2021年04月20日	3.15	3.15	-
17	红利再投	2021年04月21日	6.74	6.74	-
18	红利再投	2021年04月22日	3.06	3.06	-
19	红利再投	2021年04月23日	6.94	6.94	-
20	红利再投	2021年04月26日	16.07	16.07	-

21	红利再投	2021 年 04 月 27 日	5.65	5.65	-
22	红利再投	2021 年 04 月 28 日	12.13	12.13	-
23	红利再投	2021 年 04 月 29 日	3.31	3.31	-
24	红利再投	2021 年 04 月 30 日	3.47	3.47	-
25	红利再投	2021 年 05 月 06 日	21.43	21.43	-
26	红利再投	2021 年 05 月 07 日	3.42	3.42	-
27	红利再投	2021 年 05 月 10 日	9.67	9.67	-
28	红利再投	2021 年 05 月 11 日	3.20	3.20	-
29	红利再投	2021 年 05 月 12 日	3.00	3.00	-
30	红利再投	2021 年 05 月 13 日	3.15	3.15	-
31	红利再投	2021 年 05 月 14 日	3.11	3.11	-
32	红利再投	2021 年 05 月 17 日	9.45	9.45	-
33	红利再投	2021 年 05 月 18 日	3.13	3.13	-
34	红利再投	2021 年 05 月 19 日	10.48	10.48	-
35	红利再投	2021 年 05 月 20 日	3.28	3.28	-
36	红利再投	2021 年 05 月 21 日	3.26	3.26	-
37	红利再投	2021 年 05 月 24 日	12.41	12.41	-
38	红利再投	2021 年 05 月 25 日	3.42	3.42	-
39	红利再投	2021 年 05 月 26 日	7.19	7.19	-
40	红利再投	2021 年 05 月 27 日	3.57	3.57	-
41	申购	2021 年 05 月 28 日	20,000,000.00	20,000,000.00	-
42	红利再投	2021 年 05 月 28 日	3.59	3.59	-
43	强制调增	2021 年 05 月 28 日	81,980.35	81,980.35	-
44	强制调减	2021 年 05 月 28 日	-81,980.35	-81,980.35	-
45	申购	2021 年 05 月 31 日	155,000,000.00	155,000,000.00	-
46	红利再投	2021 年 05 月 31 日	5,518.18	5,518.18	-
47	红利再投	2021 年 06 月 01 日	9,790.90	9,790.90	-
48	红利再投	2021 年 06 月 02 日	9,659.15	9,659.15	-
49	红利再投	2021 年 06 月 03 日	9,735.19	9,735.19	-
50	红利再投	2021 年 06 月 04 日	9,525.43	9,525.43	-
51	红利再投	2021 年 06 月 07 日	28,453.47	28,453.47	-
52	红利再投	2021 年 06 月 08 日	9,345.42	9,345.42	-
53	红利再投	2021 年 06 月 09 日	9,338.15	9,338.15	-
54	红利再投	2021 年 06 月 10 日	9,360.43	9,360.43	-
55	红利再投	2021 年 06 月 11 日	9,460.87	9,460.87	-
56	红利再投	2021 年 06 月 15 日	38,380.19	38,380.19	-
57	红利再投	2021 年 06 月 16 日	9,111.86	9,111.86	-
58	红利再投	2021 年 06 月 17 日	10,027.04	10,027.04	-

59	红利再投	2021 年 06 月 18 日	9,621.65	9,621.65	-
60	红利再投	2021 年 06 月 21 日	29,337.29	29,337.29	-
61	红利再投	2021 年 06 月 22 日	9,517.51	9,517.51	-
62	红利再投	2021 年 06 月 23 日	9,539.82	9,539.82	-
63	赎回	2021 年 06 月 24 日	-35,000,000.00	-35,000,000.00	-
64	红利再投	2021 年 06 月 24 日	9,635.78	9,635.78	-
65	红利再投	2021 年 06 月 25 日	8,786.27	8,786.27	-
66	赎回	2021 年 06 月 28 日	-10,000,000.00	-10,000,000.00	-
67	红利再投	2021 年 06 月 28 日	24,333.33	24,333.33	-
68	赎回	2021 年 06 月 29 日	-60,000,000.00	-60,000,000.00	-
69	红利再投	2021 年 06 月 29 日	7,462.02	7,462.02	-
70	红利再投	2021 年 06 月 30 日	3,911.41	3,911.41	-
合计			20,304,389.94	20,305,389.94	

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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	2021-04-02 至 2021-04-06, 2021-04-21 至 2021-05-10	302,816,060.73	451,928,034.62	754,744,095.35	-	-
产品特有风险							
<p>本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：</p> <p>(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和</p>							



收益水平;

- (3) 因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动;
- (4) 基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;
- (5) 大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、信诚货币市场证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、信诚货币市场证券投资基金基金合同
- 4、信诚货币市场证券投资基金招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

### 10.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

### 10.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅,也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅,公司网址为 [www.citicprufunds.com.cn](http://www.citicprufunds.com.cn)。

中信保诚基金管理有限公司  
2021 年 07 月 20 日