

信诚货币市场证券投资基金

2022 年第 1 季度报告

2022 年 03 月 31 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：2022 年 04 月 21 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 2022 年 04 月 20 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 03 月 31 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	4,295,177,870.81 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	145,807,518.89 份	4,149,339,339.84 份	31,012.08 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（2022 年 01 月 01 日-2022 年 03 月 31 日）		
	信诚货币 A	信诚货币 B	信诚货币 E
1. 本期已实现收益	681,651.11	35,701,265.54	257.74
2. 本期利润	681,651.11	35,701,265.54	257.74
3. 期末基金资产净值	145,807,518.89	4,149,339,339.84	31,012.08

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	0.5059%	0.0014%	0.0863%	0.0000%	0.4196%	0.0014%
过去六个月	1.0207%	0.0014%	0.1745%	0.0000%	0.8462%	0.0014%
过去一年	1.9464%	0.0016%	0.3500%	0.0000%	1.5964%	0.0016%
过去三年	6.1203%	0.0018%	1.0510%	0.0000%	5.0693%	0.0018%
过去五年	13.4009%	0.0032%	1.7510%	0.0000%	11.6499%	0.0032%
自基金合同生效起至 今	41.5006%	0.0055%	4.0436%	0.0001%	37.4570%	0.0054%

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
----	------------	---------------	----------------	-----------------------	-----	-----

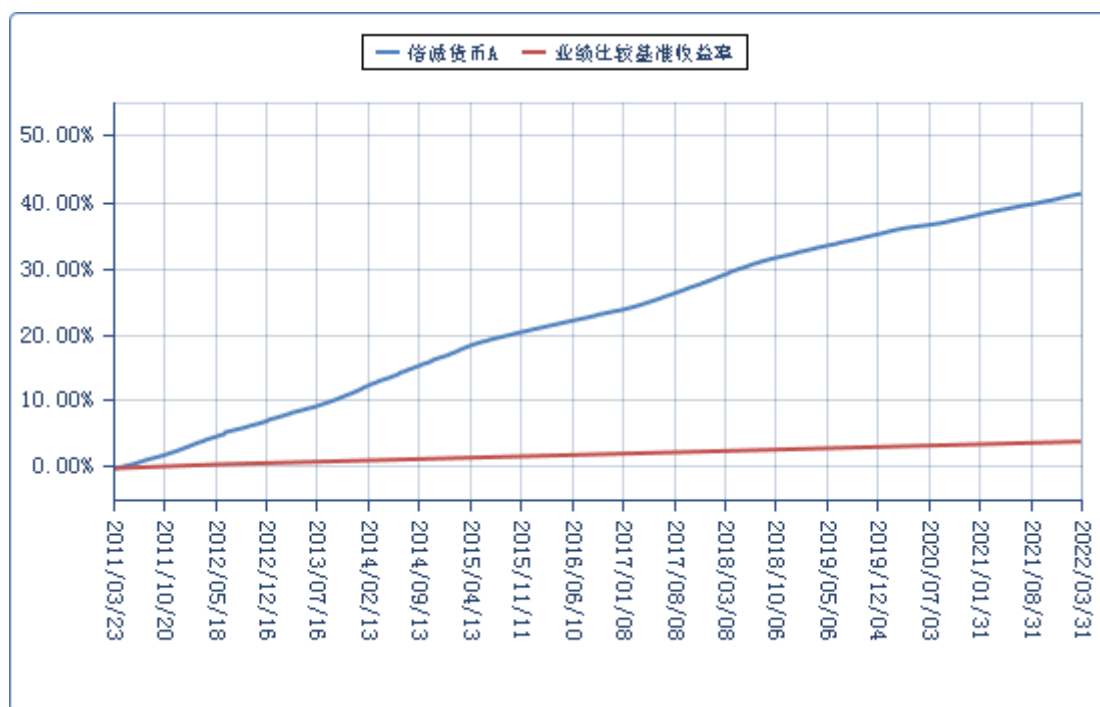
				准差④		
过去三个月	0.5653%	0.0014%	0.0863%	0.0000%	0.4790%	0.0014%
过去六个月	1.1417%	0.0014%	0.1745%	0.0000%	0.9672%	0.0014%
过去一年	2.1918%	0.0016%	0.3500%	0.0000%	1.8418%	0.0016%
过去三年	6.8877%	0.0018%	1.0510%	0.0000%	5.8367%	0.0018%
过去五年	14.7708%	0.0032%	1.7510%	0.0000%	13.0198%	0.0032%
自基金合同生效起至今	45.2985%	0.0055%	4.0436%	0.0001%	41.2549%	0.0054%

信诚货币 E

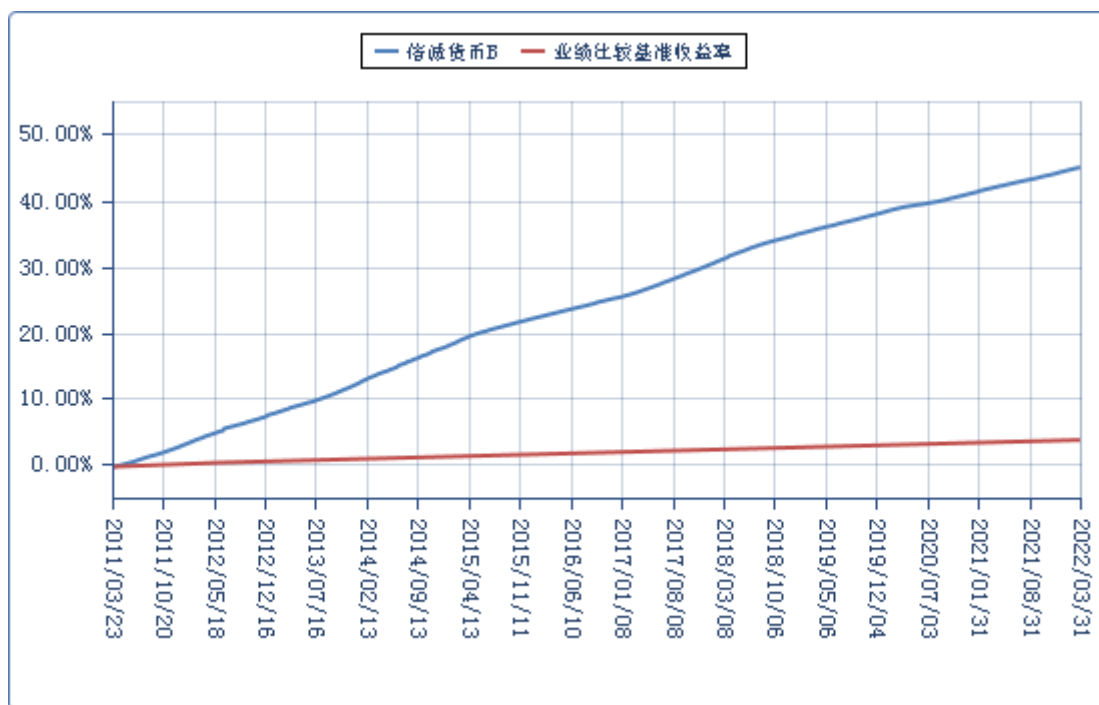
阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5051%	0.0014%	0.0863%	0.0000%	0.4188%	0.0014%
过去六个月	1.0200%	0.0014%	0.1745%	0.0000%	0.8455%	0.0014%
过去一年	1.9450%	0.0015%	0.3500%	0.0000%	1.5950%	0.0015%
过去三年	6.1023%	0.0018%	1.0510%	0.0000%	5.0513%	0.0018%
自基金合同生效起至今	11.9401%	0.0031%	1.6340%	0.0000%	10.3061%	0.0031%

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

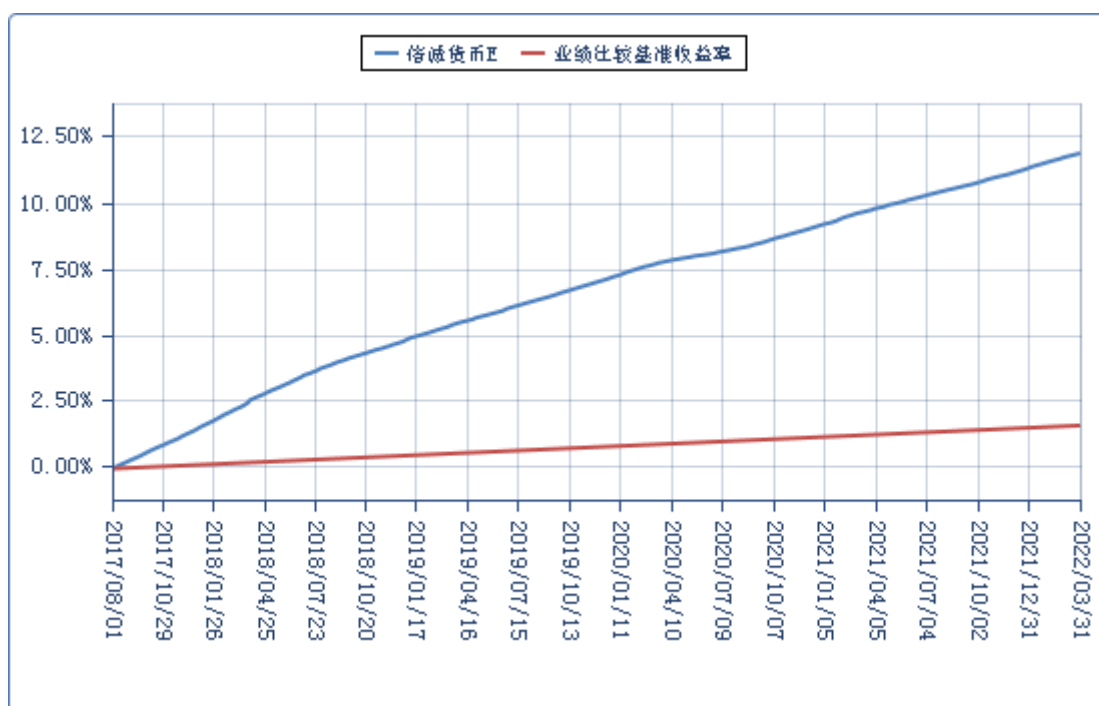
信诚货币 A



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	固定收益部副总监、基金经理	2016 年 03 月 18 日	-	12	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

2022 年一季度,海外疫情整体缓和,欧美各国防疫措施普遍放松。俄乌冲突爆发,引发全球大宗商品价格上升和全球金融市场动荡。美欧通胀仍在高位,3 月联储加息落地,5 月可能开启缩表,年内紧缩节奏逐步明确。国内方面,1-2 月社融企稳回升,且经济数据好于预期。但年内需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力仍然较大,5.5%左右的增长目标意味着今年稳增长政策力度较强,财政托底经济意愿明显,地方债发行节奏前倾,基建项目发力靠前。地产需求端政策持续放松,多地下调房贷利率,但高频数据显示地产需求仍未企稳。3 月以来国内疫情迅速升温,深圳、上海等地疫情防控政策升级对经济活动影响较大,工业生产、地产投资、社零等经济指标短期将受到较强冲击。通胀方面,基数影响下 PPI 延续回落趋势,但环比动能仍然偏强,CPI 整体处于低位。

货币政策方面,央行强调发挥总量和结构双重功能,加大对实体经济的支持,流动性保持稳中偏宽的状态。1 月 OMO 和 MLF 降息,同时 1/5 年 LPR 利率非对称调降,政策靠前发力,为宽信用创造条件。

从债券市场来看,一季度海外经济和地缘政治形势复杂,国内市场博弈宽信用与宽货币,长端利率整体先下后上,春节前经济转弱预期偏强叠加央行降息,10 年国债收益率下行突破 2.7%,节后宽信用预期逐渐发酵,收益率回升至 2.79%;信用债方面,民企地产债风险持续释放,同时理财赎回较多给市场带来明显扰动,信用利差整体上行,银行资本债调整幅度较大;权益市场跌幅明显,转债下跌幅度小于股票,一季度沪深 300 下跌 14.5%,中证转债指数下跌 8.4%。

组合配置上,主要以流动性管理为主,整体配置较为中性,1 月 2 月受降准降息影响,短端利率持续维持低位,随着季末银行存款缺口较大,存单利率高企,组合拉长剩余期限至 60 天,并辅以一定杠杆增厚收益。

展望 2022 年二季度,海外疫情影响逐渐减弱,美国通胀短期仍处于高位,联储 5 月加息 50bp 可能性

较大，缩表开启且节奏逐步加快或将对二季度流动性和风险偏好有一定扰动。俄乌谈判久拖不决，海外不确定性仍然存在。国内方面，疫情形势较为严峻但仍实行动态清零政策，对经济预期和消费恢复产生较大压制。财政靠前发力背景下，基建投资对经济仍有支撑，但就业和地产高频数据较差显示稳增长压力较大，微观主体预期偏弱，且今年基建是提前发力而非大幅扩张，二季度之后稳增长主要仍然看地产逐步放松后的效果和消费等居民端的需求恢复情况。短期政策稳增长诉求仍然较强，地产政策持续放松，地产硬着陆风险降低，边际上对稳增长预期有较大提振作用。货币政策整体仍然偏宽松，降息、降准等窗口有望重新开启。

债券市场投资方面，中美利差压缩至较低水平，长端利率债收益率进一步下行空间有限，但疫情对经济扰动明显，且地产、基建存在多重约束情况下，宽信用难以大幅超预期，利率大幅上行的空间也不足，整体仍以区间震荡为主，短期来看，稳增长背景下宽松政策进一步发力的预期增强，长端利率或存在交易性机会；信用策略上，短端流动性仍将保持稳定，信用利差有所恢复，整体信用债特别是偏中短久期的高等级信用债目前仍有一定的杠杆票息价值。

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 0.5059%，同期业绩比较基准收益率为 0.0863%；信诚货币 B 份额净值收益率为 0.5653%，同期业绩比较基准收益率为 0.0863%；信诚货币 E 份额净值收益率为 0.5051%，同期业绩比较基准收益率为 0.0863%。

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	4,303,943,295.08	95.50
	其中：债券	4,303,943,295.08	95.50
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	186,431,824.08	4.14
4	其他资产	16,574,651.14	0.37
5	合计	4,506,949,770.30	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	3.25	
	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	210,012,772.60	4.89
	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	62
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	62
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	21

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	36.44	4.89
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	18.59	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动	-	-

	利率债		
3	60 天（含）—90 天	32.02	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	11.79	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	5.36	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	104.19	4.89

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	390,227,378.99	9.09
	其中：政策性金融债	390,227,378.99	9.09
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	795,645,595.19	18.52
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,118,070,320.90	72.59
8	其他	-	-
9	合计	4,303,943,295.08	100.20
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	170206	17 国开 06	2,100,000	218,250,764.65	5.08
2	012280765	22 光明 SCP002	2,000,000	200,127,018.41	4.66
3	112112050	21 北京银行 CD050	2,000,000	199,899,941.99	4.65
4	112106128	21 交通银行	2,000,000	199,694,677.66	4.65

		CD128			
5	112103072	21 农业银行 CD072	2,000,000	199,226,530.21	4.64
6	112295301	22 杭州银行 CD078	2,000,000	198,997,170.43	4.63
7	012280549	22 光明 SCP001	1,500,000	150,235,696.91	3.50
8	012102905	21 中化工 SCP011	1,300,000	131,716,005.77	3.07
9	210312	21 进出 12	1,300,000	131,167,344.03	3.05
10	012102878	21 中铝集 SCP006	1,000,000	101,438,528.40	2.36

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	0.0520%
报告期内偏离度的最低值	0.0022%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0213%

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

国家开发银行于 2022 年 3 月 21 日受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监罚决字[2022]8 号)。

北京银行股份有限公司于 2021 年 9 月 26 日、2021 年 11 月 24 日分别受到北京银保监局的处罚（京银保监罚决字[2021]26 号、京银保监罚决字[2021]30 号）。

交通银行股份有限公司于 2021 年 7 月 13 日、2021 年 8 月 13 日、2021 年 10 月 20 日、2022 年 3 月 21 日分别受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行处罚、国家外汇管理局上海市分局的处罚（银保监罚决字[2021]28 号、银罚字[2021]23 号、上海汇管罚字[2021]3111210701 号、银保监罚决字[2022]15 号）。

中国农业银行股份有限公司于 2021 年 12 月 8 日、2022 年 3 月 21 日分别受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字[2021]38 号、银保监罚决字[2022]12 号）。

杭州银行股份有限公司于 2021 年 5 月 18 日受到中国银保监会浙江监管局处罚（浙银保监罚决字[2021]25 号）。

中国进出口银行于 2021 年 7 月 13 日、2022 年 3 月 21 日分别受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字[2021]31 号、银保监罚决字[2022]9 号）。

对“17 国开 06、21 北京银行 CD050、21 交通银行 CD128、21 农业银行 CD072、22 杭州银行 CD078、21 进出 12”的投资决策程序的说明：本基金管理人定期回顾、长期跟踪研究该等投资标的的信用资质，我们认为，该处罚事项未对前述发行主体的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对该等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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	16,574,651.14
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	16,574,651.14

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	124,869,923.78	6,102,757,427.80	76,120.20
报告期期间基金总申购份额	114,370,202.03	10,968,630,147.23	257.74
减：报告期期间基金总赎回份额	93,432,606.92	12,922,048,235.19	45,365.86
报告期期末基金份额总额	145,807,518.89	4,149,339,339.84	31,012.08

§ 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	2022年01月04日	13,126.12	13,126.12	0.00
2	红利再投	2022年01月05日	3,287.26	3,287.26	0.00
3	红利再投	2022年01月06日	4,544.77	4,544.77	0.00
4	红利再投	2022年01月07日	2,711.88	2,711.88	0.00
5	红利再投	2022年01月10日	7,971.67	7,971.67	0.00
6	红利再投	2022年01月11日	2,647.11	2,647.11	0.00
7	红利再投	2022年01月12日	2,547.14	2,547.14	0.00
8	申购	2022年01月13日	100,000,000.00	100,000,000.00	0.00
9	红利再投	2022年01月13日	2,430.13	2,430.13	0.00
10	红利再投	2022年01月14日	8,580.04	8,580.04	0.00
11	红利再投	2022年01月17日	25,168.61	25,168.61	0.00
12	红利再投	2022年01月18日	8,382.51	8,382.51	0.00
13	申购	2022年01月19日	70,000,000.00	70,000,000.00	0.00
14	红利再投	2022年01月19日	8,384.98	8,384.98	0.00
15	红利再投	2022年01月20日	12,355.24	12,355.24	0.00
16	红利再投	2022年01月21日	12,519.24	12,519.24	0.00
17	红利再投	2022年01月24日	37,816.10	37,816.10	0.00
18	红利再投	2022年01月25日	12,701.47	12,701.47	0.00
19	红利再投	2022年01月26日	12,813.34	12,813.34	0.00
20	红利再投	2022年01月27日	13,047.61	13,047.61	0.00
21	红利再投	2022年01月28日	21,631.03	21,631.03	0.00
22	红利再投	2022年02月07日	129,574.90	129,574.90	0.00
23	红利再投	2022年02月08日	14,343.48	14,343.48	0.00
24	红利再投	2022年02月09日	16,522.57	16,522.57	0.00

25	申购	2022 年 02 月 10 日	30,000,000.00	30,000,000.00	0.00
26	红利再投	2022 年 02 月 10 日	12,826.89	12,826.89	0.00
27	红利再投	2022 年 02 月 11 日	14,123.40	14,123.40	0.00
28	红利再投	2022 年 02 月 14 日	41,651.61	41,651.61	0.00
29	红利再投	2022 年 02 月 15 日	13,721.70	13,721.70	0.00
30	红利再投	2022 年 02 月 16 日	13,657.10	13,657.10	0.00
31	红利再投	2022 年 02 月 17 日	13,618.49	13,618.49	0.00
32	红利再投	2022 年 02 月 18 日	13,647.33	13,647.33	0.00
33	红利再投	2022 年 02 月 21 日	41,185.24	41,185.24	0.00
34	红利再投	2022 年 02 月 22 日	13,724.38	13,724.38	0.00
35	红利再投	2022 年 02 月 23 日	13,767.78	13,767.78	0.00
36	红利再投	2022 年 02 月 24 日	13,919.14	13,919.14	0.00
37	红利再投	2022 年 02 月 25 日	14,035.98	14,035.98	0.00
38	红利再投	2022 年 02 月 28 日	53,610.32	53,610.32	0.00
39	红利再投	2022 年 03 月 01 日	14,150.72	14,150.72	0.00
40	红利再投	2022 年 03 月 02 日	30,457.67	30,457.67	0.00
41	红利再投	2022 年 03 月 03 日	14,133.53	14,133.53	0.00
42	红利再投	2022 年 03 月 04 日	13,696.17	13,696.17	0.00
43	红利再投	2022 年 03 月 07 日	40,341.63	40,341.63	0.00
44	红利再投	2022 年 03 月 08 日	13,204.07	13,204.07	0.00
45	红利再投	2022 年 03 月 09 日	13,250.01	13,250.01	0.00
46	红利再投	2022 年 03 月 10 日	13,186.94	13,186.94	0.00
47	红利再投	2022 年 03 月 11 日	14,011.29	14,011.29	0.00
48	红利再投	2022 年 03 月 14 日	40,005.14	40,005.14	0.00
49	红利再投	2022 年 03 月 15 日	13,201.15	13,201.15	0.00
50	红利再投	2022 年 03 月 16 日	13,174.98	13,174.98	0.00
51	红利再投	2022 年 03 月 17 日	13,272.42	13,272.42	0.00
52	红利再投	2022 年 03 月 18 日	13,171.01	13,171.01	0.00
53	红利再投	2022 年 03 月 21 日	39,577.76	39,577.76	0.00
54	红利再投	2022 年 03 月 22 日	13,205.10	13,205.10	0.00
55	红利再投	2022 年 03 月 23 日	13,163.82	13,163.82	0.00
56	红利再投	2022 年 03 月 24 日	13,063.54	13,063.54	0.00
57	红利再投	2022 年 03 月 25 日	13,056.23	13,056.23	0.00
58	红利再投	2022 年 03 月 28 日	39,726.96	39,726.96	0.00
59	红利再投	2022 年 03 月 29 日	12,768.50	12,768.50	0.00
60	红利再投	2022 年 03 月 30 日	14,769.51	14,769.51	0.00
61	红利再投	2022 年 03 月 31 日	29,816.36	29,816.36	0.00
合计			201,095,001.07	201,095,001.07	

§ 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

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。

中信保诚基金管理有限公司
2022 年 04 月 21 日