新沃通宝货币市场基金

2018年第四季度报告

2018年12月31日
基金管理人:新沃基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年一月二十二日

§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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月17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2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新沃通宝	
交易代码	001916	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年10月20日	
报告期末基金份额总额	2,442,842,498.68份	
投资目标	在控制投资组合风险,保持流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。本基金主要通过利率策略、骑乘策略、放大策略、信用债投资策略等投资策略以实现投资目标。	
业绩比较基准	同期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,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、混合型基金和债券型基金。	
基金管理人	新沃基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	新沃通宝A	新沃通宝B
下属分级基金的交易代码	001916	002302
报告期末下属分级基金的份额总额	785,334,586.21份	1,657,507,912.47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(2018年10月1日-2018年12月31日)	
	新沃通宝A	新沃通宝B
1. 本期已实现收益	7,433,302.37	18,849,274.52
2. 本期利润	7,433,302.37	18,849,274.52
3. 期末基金资产净值	785,334,586.21	1,657,507,912.47

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

新沃通宝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	0.8947%	0.0057%	0.3403%	0.0000%	0.5544%	0.0057%

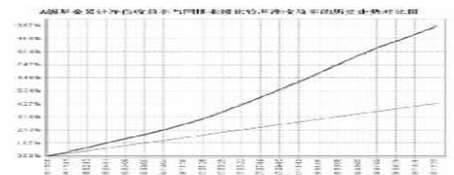
注:本基金收益分配按日结转份额。

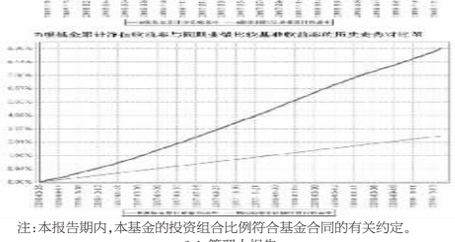
新沃通宝B

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	0.9559%	0.0057%	0.3403%	0.0000%	0.6156%	0.0057%

注:本基金收益分配按日结转份额。

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





注:本报告期内,本基金的投资组合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		
俞爍	本基金的基金经理	2016年12月2日	-	6年	复旦大学硕士,中国籍。2013年7月至2016年9月任职于国金证券,历任证券交易员、投资经理、投资主办;2016年10月加入新沃基金管理有限公司。

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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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制度指导意见》、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,本基金运作符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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制度指导意见》,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

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投凤凰货币A基金份额净值为1.000元,本报告期内,该类基金份额净值收益率为0.7247%,同期业绩比较基准收益率为0.3450%;截至报告期末中信建投凤凰货币B基金份额净值为1.000元,本报告期内,该类基金份额净值收益率为0.7856%,同期业绩比较基准收益率为0.3450%。

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)	占基金资产净值的比例(%)
1	固定收益投资	174,238,651.95	54.59
	其中:债券	152,236,728.97	47.69
	资产支持证券	22,001,922.98	6.89
2	买入返售金融资产	107,000,337.50	33.52
	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	28,234,937.48	8.85
4	其他资产	9,722,485.03	3.05
5	合计	319,196,411.96	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	-	5.91
	其中:买断式回购融资	-	1.02
2	报告期末债券回购融资余额	30,990,494.73	10.77
	其中:买断式回购融资	30,990,494.73	10.77

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	67
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

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	46.17	10.77
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	3.48	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	35.38	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	5.91	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	19.06	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	110.00	10.77

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	32,669,129.07	11.36
	其中:政策性金融债	32,669,129.07	11.36
4	企业债券	20,026,103.13	6.96
5	企业短期融资券	20,010,485.69	6.96
6	中期票据	-	-
7	同业存单	79,531,011.08	27.64
8	其他	-	-
9	合计	152,236,728.97	52.91
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	111884404	18徽商银行CD240	400,000	39,682,319.96	13.79
2	180404	18农发04	300,000	30,078,739.22	10.45
3	111781044	17杭州银行CD137	300,000	30,005,122.08	10.43
4	112352	16TCL01	200,000	20,026,103.13	6.96
5	011800662	18鞍钢SCP004	100,000	10,010,119.65	3.48
6	011801446	18路安SCP005	100,000	10,000,366.04	3.48
7	111812185	18北京银行CD185	100,000	9,843,569.05	3.42
8	018002	国开1302	25,900	2,590,389.85	0.90

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	0.1537%
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	0.0938%

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1889307	18和萃2优先	170,000	17,001,922.98	5.91
2	156376	18信易3	50,000	5,000,000.00	1.74

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按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	509.79
2	应收证券清算款	7,008,965.76
3	应收利息	2,710,708.40
4	应收申购款	2,301.08
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	9,722,485.03

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

	中信建投凤凰货币A	中信建投凤凰货币B
报告期期初基金份额总额	195,333,242.88	110,600,730.17
报告期期间基金总申购份额	127,456,518.44	20,662,244.72
报告期期间基金总赎回份额	125,460,896.30	40,890,753.09
报告期末基金份额总额	197,328,865.02	90,372,221.80

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	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	116847	联易融02	600,000	60,006,498.47	2.46

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提应收利息,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

5.9.2 报告期内,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	321.50
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	12,582,454.68
4	应收申购款	13,656,439.42
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	26,239,215.60

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因,本报告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

项目	新沃通宝A	新沃通宝B
报告期期初基金份额总额	1,034,510,981.87	1,557,441,279.00
报告期期间基金总申购份额	561,871,531.19	3,314,066,615.56
报告期期间基金总赎回份额	811,047,926.85	3,213,999,982.09
报告期期末基金份额总额	785,334,586.21	1,657,507,912.47

§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	申购	2018年10月15日	1,200,000.00	1,200,000.00	-
2	赎回	2018年10月19日	-1,200,000.00	-1,200,000.00	-
3	赎回	2018年10月25日	-155,232.75	-155,232.75	-
4	赎回	2018年10月25日	-444,767.25	-444,767.25	-
5	赎回	2018年10月25日	-300,000.00	-300,000.00	-
6	红利再投资	-	3,118.72	3,118.72	-
合计			-896,881.28	-896,881.28	

注:本基金的收益分配按日结转份额,列示在"红利再投资"项下一并披露。

§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

		报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
		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
	1	2018/10/09-2018/10/09	501,113,295.03	54,478,891.79	365,000,000.00		190,592,186.82	7.80%
产品特有风险								
报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下,如该投资者集中赎回,可能会增加基金的流动性风险。此外,由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产,可能对持有资产的价格形成冲击,增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产,加强防范流动性风险、市场风险,保护持有人利益。								

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

当持有基金份额比例达到或超过20%的投资人较大比例赎回且基金的现金头寸不足时,基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产,由此可能导致资金融入成本较高或较大冲击成本,造成基金财产损失、影响基金收益水平。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;
2、《新沃通宝货币市场基金基金合同》;
3、《新沃通宝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

基金管理人和/或基金托管人的办公场所。

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。

新沃基金管理有限公司
2019年1月22日

中信建投凤凰货币市场基金

2018年第四季度报告

2018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:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2019年01月22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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中信建投凤凰货币	
基金主代码	001006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年03月31日	
报告期末基金份额总额	287,701,086.82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结构配置比例。?	
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,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	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中信建投凤凰货币A	中信建投凤凰货币B
下属分级基金的交易代码	001006	004553
报告期末下属分级基金的份额总额	197,328,865.02份	90,372,221.80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(2018年10月01日-2018年12月31日)	
	中信建投凤凰货币A	中信建投凤凰货币B
1.本期已实现收益	1,505,614.64	684,775.42
2.本期利润	1,505,614.64	684,775.42
3.期末基金资产净值	197,328,865.02	90,372,221.80

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。@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

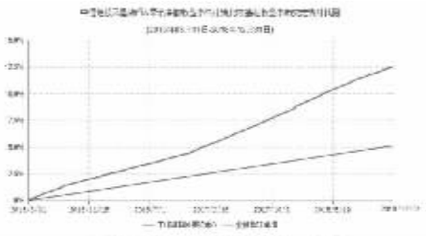
中信建投凤凰货币A净值表现

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	0.7247%	0.0071%	0.3450%	0.0000%	0.3797%	0.0071%

中信建投凤凰货币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	0.7856%	0.0071%	0.3450%	0.0000%	0.4406%	0.0071%

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



注:1、图1为中信建投凤凰货币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2015年3月31日(基金合同生效日)至2018年12月31日;@2、图2为中信建投凤凰货币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28日(首笔份额登记日)至2018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		
刘博	本基金的基金经理	2018-11-01	-	6年	中国籍,1983年10月生,英国华威大学金融学硕士。曾任沈阳华和科技开发有限公司总经理助理、中诚信国际信用评级有限责任公司分析师、招商证券股份有限公司研究员、中信建投证券股份有限公司固定收益部高级副总裁。2018年8月至今任职于中信建投基金管理有限公司投资研究部,担任投资研究部-固收投资部总监,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、中信建投山西国有企业债定期开放债券型证券投资基金基金经理。
黄海浩	本基金的基金经理	2016-05-25	-	7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。

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的说明

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,基金运作符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本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

四季度经济继续下行,社融数据仍未有明显反弹,资金面整体宽裕。虽然年底非银机构融资利率出现较为明显的上升,但并未有超预期的波动。本季度短端收益率曲线非常陡峭,同为加权90天期限的组合,子弹型配置性价比相对优于哑铃。因此,我们增加了3个月左右期限的存单配置,降低存款比例,以获取较为显著的骑乘收益。在交易成本可控的情况下,尽力保持组合的最优。同时,我们增加了逆回购的配置比例,在10月及11月主要在交易所进行逆回购资金融出,在12月将资金转入银行间进行逆回购资金融出,以获取更高的收益。@7整体上,本基金作为流动性管理工具,基金管理人在2018年四季度运作期间,一直保持投资组合较高的流动性,保持较为灵活的操作节奏。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凤凰货币A基金份额净值为1.000元,本报告期内,该类基金份额净值收益率为0.7247%,同期业绩比较基准收益率为0.3450%;截至报告期末中信建投凤凰货币B基金份额净值为1.000元,本报告期内,该类基金份额净值收益率为0.7856%,同期业绩比较基准收益率为0.3450%。

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)	占基金资产净值比例(%)
1	固定收益投资	174,238,651.95	54.59
	其中:债券	152,236,728.97	47.69
	资产支持证券	22,001,922.98	6.89
2	买入返售金融资产	107,000,337.50	33.52
	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	28,234,937.48	8.85
4	其他资产	9,722,485.03	3.05
5	合计	319,196,411.96	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	-	5.91
	其中:买断式回购融资	-	1.02
2	报告期末债券回购融资余额	30,990,494.73	10.77
	其中:买断式回购融资	30,990,494.73	10.77

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	67
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

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	46.17	10.77
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	3.48	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	35.38	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	5.91	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	19.06	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	110.00	10.77

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	32,669,129.07	11.36
	其中:政策性金融债	32,669,129.07	11.36
4	企业债券	20,026,103.13	6.96
5	企业短期融资券	20,010,485.69	6.96
6	中期票据	-	-
7	同业存单	79,531,011.08	27.64
8	其他	-	-
9	合计	152,236,728.97	52.91
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	111884404	18徽商银行CD240	400,000	39,682,319.96	13.79
2	180404	18农发04	300,000	30,078,739.22	10.45
3	111781044	17杭州银行CD137	300,000	30,005,122.08	10.43
4	112352	16TCL01	200,000	20,026,103.13	6.96
5	011800662	18鞍钢SCP004	100,000	10,010,119.65	3.48
6	011801446	18路安SCP005	100,000	10,000,366.04	3.48
7	111812185	18北京银行CD185	100,000	9,843,569.05	3.42
8	018002	国开1302	25,900	2,590,389.85	0.90

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	0.1537%
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	0.0938%

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1889307	18和萃2优先	170,000	17,001,922.98	5.91
2	156376	18信易3	50,000	5,000,000.00	1.74

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	509.79
2	应收证券清算款	7,008,965.76
3	应收利息	2,710,708.40
4	应收申购款	2,301.08
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	9,722,485.03

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

	中信建投凤凰货币A	中信建投凤凰货币B
报告期期初基金份额总额	195,333,242.88	110,600,730.17
报告期期间基金总申购份额	127,456,518.44	20,662,244.72
报告期期间基金总赎回份额	125,460,896.30	40,890,753.09
报告期末基金份额总额	197,328,865.02	90,372,221.80

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	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	116847	联易融02	600,000	60,006,498.47	2.46

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提应收利息,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

5.9.2 报告期内,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	321.50
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	12,582,454.68
4	应收申购款	13,656,439.42
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	26,239,215.60

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因,本报告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

项目	新沃通宝A	新沃通宝B
报告期期初基金份额总额	1,034,510,981.87	1,557,441,279.00
报告期期间基金总申购份额	561,871,531.19	3,314,066,615.56
报告期期间基金总赎回份额	811,047,926.85	3,213,999,982.09
报告期期末基金份额总额	785,334,586.21	1,657,507,912.47

§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