

## 中信建投货币市场基金

## [2014]第四季度报告

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:华夏银行股份有限公司

报告送出日期:2015年1月19日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事及董事会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、完整性承担个别及连带责任。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据基金合同规定，于2015年1月15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，保证核对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。投资人投资有风险，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2014年10月1日起至2014年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 中信建投货币

交易代码 000738

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2014年8月5日

报告期末基金份额总额 624,704,263.32份

投资目标 在保持资金货币的流动性及高流动性前提下，力争实现超越同业比较基准的回报回报。

本基金通过对宏观经济、政策、金融监管政策、财政及货币政策、市场及机构变化和短期的货币供给等多方面的分析，通过定期调整资产配置比例，力争在控制风险的前提下，实现超越同业比较基准的回报。

投资策略 本基金通过定期调整资产配置比例，力争在控制风险的前提下，实现超越同业比较基准的回报。

投资决策 本基金通过定期调整资产配置比例，力争在控制风险的前提下，实现超越同业比较基准的回报。

风险收益特征 本基金属于货币市场基金中风险最低品种，其长期平均的风险和预期收益水平低于股票基金、混合基金和债券基金。

基金管理人 中信建投基金管理有限公司

基金托管人 华夏银行股份有限公司

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2014年10月1日-2014年12月31日)

1. 本期已实现收益 5,319,241.72

2. 本期利润 5,319,241.72

3. 期末未分配利润 624,704,263.32

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) 本基金不持有以人认购或交易基金的各项费用。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.9413% 0.0036% 0.3403% 0.0000% 0.6010% 0.0036%

注: 本基金收入分配按收益结转份额。

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

图: 2014年8月5日-2014年12月31日, 中信建投货币基金净值走势图

注: (1) 本基金基金合同于2014年8月5日生效，基金合同生效日起至报告期末未满一年。

(2) 根据本基金合同的约定，本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期，本报告期处于建仓期内。

§ 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

索爽石 本基金的基金经理 2014年8月5日 - 4 中信建投, 1983年7月生, 北京大学软件工程硕士, FRM, CQF认证, 具备银行间本币市场交易员资格, 曾任职于中信证券资产管理部, 现任中信建投基金管理有限公司基金经理, 管理货币市场基金。

注: (1) 任职日期是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 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本报告期内, 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》、《证券投资基金销售行为管理办法》、《证券投资基金评价公司公平交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规, 诚实守信、勤勉尽责地管理基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金持有人谋取最大利益。本报告期内, 基金运作符合法律法规、合同约定的基金投资操作规范。

4.3 公平交易专项说明

4.4 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执行公平交易, 未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.5 异常交易行为的专项说明

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。

4.6 报告期内基金的利润分配和收益确认情况

4.7 报告期内基金的销售费用情况

4.8 报告期内基金的申购赎回费用情况

4.9 报告期内基金的交易费用情况

4.10 报告期内基金的其他费用情况

4.11 报告期内基金的交易费用情况

4.12 报告期内基金的其他费用情况

4.13 报告期内基金的其他费用情况

4.14 报告期内基金的其他费用情况

4.15 报告期内基金的其他费用情况

4.16 报告期内基金的其他费用情况

4.17 报告期内基金的其他费用情况

4.18 报告期内基金的其他费用情况

4.19 报告期内基金的其他费用情况

4.20 报告期内基金的其他费用情况

4.21 报告期内基金的其他费用情况

4.22 报告期内基金的其他费用情况

4.23 报告期内基金的其他费用情况

4.24 报告期内基金的其他费用情况

4.25 报告期内基金的其他费用情况

4.26 报告期内基金的其他费用情况

4.27 报告期内基金的其他费用情况

4.28 报告期内基金的其他费用情况

4.29 报告期内基金的其他费用情况

4.30 报告期内基金的其他费用情况

4.31 报告期内基金的其他费用情况

4.32 报告期内基金的其他费用情况

4.33 报告期内基金的其他费用情况

4.34 报告期内基金的其他费用情况

4.35 报告期内基金的其他费用情况

4.36 报告期内基金的其他费用情况

4.37 报告期内基金的其他费用情况

4.38 报告期内基金的其他费用情况

4.39 报告期内基金的其他费用情况

4.40 报告期内基金的其他费用情况

4.41 报告期内基金的其他费用情况

4.42 报告期内基金的其他费用情况

4.43 报告期内基金的其他费用情况

4.44 报告期内基金的其他费用情况

4.45 报告期内基金的其他费用情况

4.46 报告期内基金的其他费用情况

4.47 报告期内基金的其他费用情况

4.48 报告期内基金的其他费用情况

4.49 报告期内基金的其他费用情况

4.50 报告期内基金的其他费用情况

4.51 报告期内基金的其他费用情况

4.52 报告期内基金的其他费用情况

4.53 报告期内基金的其他费用情况

4.54 报告期内基金的其他费用情况

4.55 报告期内基金的其他费用情况

4.56 报告期内基金的其他费用情况

4.57 报告期内基金的其他费用情况

4.58 报告期内基金的其他费用情况

4.59 报告期内基金的其他费用情况

4.60 报告期内基金的其他费用情况

4.61 报告期内基金的其他费用情况

4.62 报告期内基金的其他费用情况

4.63 报告期内基金的其他费用情况

4.64 报告期内基金的其他费用情况

4.65 报告期内基金的其他费用情况

4.66 报告期内基金的其他费用情况

4.67 报告期内基金的其他费用情况

4.68 报告期内基金的其他费用情况

4.69 报告期内基金的其他费用情况

4.70 报告期内基金的其他费用情况

4.71 报告期内基金的其他费用情况

4.72 报告期内基金的其他费用情况

4.73 报告期内基金的其他费用情况

4.74 报告期内基金的其他费用情况

4.75 报告期内基金的其他费用情况

4.76 报告期内基金的其他费用情况

4.77 报告期内基金的其他费用情况

4.78 报告期内基金的其他费用情况

4.79 报告期内基金的其他费用情况

4.80 报告期内基金的其他费用情况

4.81 报告期内基金的其他费用情况

4.82 报告期内基金的其他费用情况

4.83 报告期内基金的其他费用情况

4.84 报告期内基金的其他费用情况

4.85 报告期内基金的其他费用情况

4.86 报告期内基金的其他费用情况

4.87 报告期内基金的其他费用情况

4.88 报告期内基金的其他费用情况

4.89 报告期内基金的其他费用情况

4.90 报告期内基金的其他费用情况

4.91 报告期内基金的其他费用情况

4.92 报告期内基金的其他费用情况

4.93 报告期内基金的其他费用情况

4.94 报告期内基金的其他费用情况

4.95 报告期内基金的其他费用情况

4.96 报告期内基金的其他费用情况

4.97 报告期内基金的其他费用情况

4.98 报告期内基金的其他费用情况

4.99 报告期内基金的其他费用情况

4.10 报告期内基金的其他费用情况

4.11 报告期内基金的其他费用情况

4.12 报告期内基金的其他费用情况

4.13 报告期内基金的其他费用情况

4.14 报告期内基金的其他费用情况

4.15 报告期内基金的其他费用情况

4.16 报告期内基金的其他费用情况

4.17 报告期内基金的其他费用情况

4.18 报告期内基金的其他费用情况

4.19 报告期内基金的其他费用情况

4.20 报告期内基金的其他费用情况

4.21 报告期内基金的其他费用情况

4.22 报告期内基金的其他费用情况

4.23 报告期内基金的其他费用情况

4.24 报告期内基金的其他费用情况

4.25 报告期内基金的其他费用情况

4.26 报告期内基金的其他费用情况

4.27 报告期内基金的其他费用情况

4.28 报告期内基金的其他费用情况

4.29 报告期内基金的其他费用情况

4.30 报告期内基金的其他费用情况