

中信建投凤凰货币市场基金

[2015] 第四季度报告

5.1

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	固定收益类资产	130,304,099.44	24.00
其中：债券		130,304,099.44	24.00
资产支持证券		-	-
2	买入返售金融资产	189,171,269.64	34.95
其中：买断式回购的买入返售金融资产		189,170,284.64	33.53
3	银行存款和结算备付金合计	219,600,948.00	40.47
4	其他资产	3,696,080.01	0.68
5	合计	642,961,296.00	100.00

5.2

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	报告期初债券回购融资余额	1.03
其中：买断式回购		0.00
2	报告期末债券回购融资余额	1.03
其中：买断式回购		0.00
3	报告期债券回购融资余额	1.03
其中：买断式回购的买入返售金融资产		1.03
4	报告期债券回购融资余额	1.03
5	合计	1.03

5.3

5.3 报告期投资组合平均剩余期限

投资目标 有选择地投资于货币市场工具和高流动性资产，力争实现超越业绩比较基准的回报。

投资策略 本基金通过对宏观经济及货币政策、市场结构及投资品种的分析，结合对货币市场工具和高流动性资产的评估，不同时期根据宏观经济、资金供求以及市场利率变化，适时调整资产配置比例，以期获得长期稳定的投资收益。

业绩比较基准 七天通知存款利率加上0.5%的浮动利率。

5.4

5.4 报告期债券回购融资情况

注：报告期内债券回购余额占基金资产净值的比例为报告期每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均数。

债券正回购的金额占基金资产净值的20%的说明

注：报告期内债券回购余额占基金资产净值未超过基金资产净值的20%。

5.5 报告期投资组合平均剩余期限

5.5.1 报告期投资组合平均剩余期限基本情况

投资目标 天天通知存款利率加上0.5%的浮动利率。

业绩比较基准 七天通知存款利率加上0.5%的浮动利率。

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，其预期收益和风险水平低于股票型基金、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 中国建设银行股份有限公司

5.5.2 报告期主要财务指标和基金净值表现

注：报告期内主要财务指标和基金净值表现

5.5.3 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.4 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.5 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.6 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.7 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.8 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.9 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.10 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.11 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.12 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.13 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.14 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.15 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.16 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.17 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.18 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.19 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.20 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.21 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.22 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.23 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.24 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.25 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.26 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.27 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.28 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.29 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.30 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.31 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.32 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.33 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.34 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.35 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.36 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.37 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.38 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.39 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.40 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.41 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.42 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.43 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.44 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.45 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.46 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.47 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.48 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.49 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.50 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.51 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.52 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.53 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.54 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.55 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.56 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.57 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.58 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.59 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.60 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.61 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.62 报告期主要财务指标

注：报告期内主要财务指标

5.5.63 报告期主要财务指标