

# 信诚薪金宝货币市场基金2015年年度报告摘要

## 2015 年 度 报 告 摘 要

规要求行提示,在日常工作中通过多种形式加强对员工职业操守的教育和监督,并开展法规培训。本年

会计主体:信诚薪金宝货币市场基金

本报告期: 2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

11.2.2交易所市场债券正回购于本报告期末,本基金未持有交易所市场正回购交易而作

为抵押的债券。

1.1.3持有于理解和/分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的此事项。

2.1期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	银行存款及存放同业	3,406,077.78	23.50
2	其中:债券	3,406,077.78	23.50
3	资产支持证券	-	-
4	买入返售金融资产	1,666,327.94	11.43
5	其中:买断式回购的买入逆回购金融资产	-	-
6	银行存款及存放同业合计	9,234,048.04	63.14
7	其他金融资产	176,540.79	1.24
8	合计	14,488,511.06	100.00

2.2债券回购融资情况

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	-
2	其中:买断式回购融资	-	-
3	报告期末债券回购融资余额	538,128.47	3.86
4	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的比例

报告期内融资余额超过基金资产净值的20%说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

2.3基金投资组合平均剩余期限

2.3.1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	91
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	101
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	62

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,以规避超

期限投资的利率风险。

2.3.2 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 (%)	各期限债券占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	25.71	3.86
2	30天以上-60天	17.67	-
3	60天以上-90天	-	-
4	90天以上-180天	18.71	31.66
5	180天以上-397天(含)	9.21	-
6	397天以上	-	-
7	合计	102.96	3.86

2.4期末投资组合品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值的比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,092,120.00	7.83
4	其中:政策性金融债	1,092,120.00	7.83
5	企业债券	-	-
6	中期票据	2,015,680.79	14.46
7	短期融资券	-	-
8	合计	3,406,077.78	24.42
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

2.5期末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	债券面值(元)	摊余成本	占基金资产净值的比例 (%)
1	150206	15国开06	3,500,000	351,200,311.11	2.52
2	150202	15国开02	1,000,000	100,150,372.37	1.15
3	150411	15农发11	1,500,000	150,276,362.52	1.09
4	150403	15农发03	1,500,000	150,219,623.73	1.08
5	150211	15国开11	1,300,000	130,267,616.62	0.93
6	150416	15农发16	1,000,000	100,068,068.06	0.72
7	04156016	16农发016	1,000,000	99,584,567.26	0.72
8	04157002	15国债02	1,000,000	99,949,513.70	0.72
9	04156104	15国债04	1,000,000	99,946,912.28	0.72
10	11151603	15国债03	1,000,000	99,901,326.87	0.71

2.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

序号	偏离情况
1	报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数
2	报告期内偏离度的最高值
3	报告期内偏离度的最低值
4	报告期内偏离度绝对值最大的前10个交易日

2.7期末投资组合占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

2.8基金本报告期末未持有资产支持证券。

2.9投资组合报告期末基金资产净值

2.8.1 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

时的溢价与折价,在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。

2.8.2 本基金报告期内未发生持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券

的摊余成本超过当日基金资产净值的0.5%的情况。

2.8.3 本基金报告期内前十名证券的发行主体本期末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、处罚的情况。

2.8.4 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	有价证券	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	136,540.79
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	合计	136,540.79

2.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计数可能存在尾差。

3.基金份额持有人信息

3.1期末基金份额持有人户数及持有人结构

序号	项目	金额
1	持有基金份额	-
2	机构投资者	-
3	个人投资者	-
4	合计	-

3.2期末基金管理人及从业人持有本基金的情况

基金管理人及从业人持有本基金	持有基金份额	占基金总份额比例
基金管理人及从业人持有本基金	10,106,300.24	0.07%

3.3期末基金管理人及从业人持有本基金的情况

基金管理人及从业人持有本基金	持有基金份额	占基金总份额比例
基金管理人及从业人持有本基金	10,106,300.24	0.07%

4 开放式基金份额变动

项目	金额
报告期末基金份额总额	374,965,560.00
报告期内基金份额总额	9,234,048.04
报告期内基金份额总额	146,308,115.23
报告期内基金份额总额	141,600,446.74

5 重大事件揭示

5.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

5.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门

1.报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门

经信诚基金管理有限公司第二届董事会第48次会议审议通过,聘任吕昌先生担任信诚基金总经理

职务。本基金管理人已于2015年4月3日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了《信诚基金管

理有限公司关于总经理聘任的公告》。自聘任总经理聘任之日起,本公司董事长张燕女士不再代行总经理职务。

上述变更事项已按规定向中国证监会证券投资基金业协会及上海证监局报备。

经信诚基金管理有限公司第二届董事会第五十三次会议审议通过,聘任周浩先生担任公司督察长职务。

自聘任督察长聘任之日起,本公司副总经理唐春先生不再代行督察长职务。本基金管理人已于2015年9月26日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了《信诚基金管

理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。上述变更事项已按规定向中国证监会证券投资基金业协会及上海证监局报备。

2.报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门

未发生重大人事变动。

5.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

5.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

5.5 为基金提供审计的会计师事务所情况

本基金年度审计会计师事务所为普华永道会计师事务所,普华永道会计师事务所的报酬为人民币100,000元。该会计师事务所自

本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

5.6 管理人、托管人及高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内,管理人、托管人及高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人已于2015年7月29日收到上海证监局《关于对信诚基金管理有限公司采取责令改正措施

的决定》(沪证监决〔2015〕47号),公函载明违法违规事实,并对整改决定书面通知。公司认真落实改

正要求,加强制度和流程建设,进一步提升公司内部控制和风险管理能力,并已按照上海证监局要求

提交了整改报告。除上述情况外,报告期内管理人、托管人的托管业务部门及其他高级管理人员未受稽查

或处罚。

5.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

5.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

券商名称	交易单元	成交金额	占当期股票成交金额的比例	佣金	占当期股票佣金的比例	备注
长城证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

5.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

券商名称	交易单元	成交金额	占当期债券成交金额的比例	佣金	占当期债券佣金的比例	备注
长城证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注:本基金租用券商的研究实力和客户服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位租赁券商的研究实

力和客户服务能力进行评估,并综合考虑证券券商的综合实力,由研究总监和基金运营总监审核批准。

5.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过0.5%的情况。

5.9 影响投资者决策的其他重要信息

无