

中信建投添鑫宝货币市场基金

[2017]第一季度报告

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2017年4月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会对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。
基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2017年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策、基金管理人和基金托管人不存在虚假记载、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2017年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中信建投添鑫宝
交易代码	002260
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月16日
报告期末基金份额总额	2,323,727,832.93份
投资目标	在保持基金资产的低风险和流动性前提下，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形势、货币及利率政策、市场及其影响因素的分析，以长期持有的角度，结合对基金资产配置的判断，以上述分析为基础，本基金将根据不同的类别资产的收益水平（不同期限到期日的理财产品、投资方式以及投资品种），结合各类资产的波动特征（投资期限、投资品种、投资金额等）进行资产配置（投资等级、波动性），制定各资产类别的比例并进行动态调整。
投资组合报告	报告期期末资产配置情况
§ 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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1. 本期已实现收益	26,451,270.17
2. 本期利润	26,451,270.17
3. 期末基金资产净值	2,323,727,832.93

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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、持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。
3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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(%)	净值基准收益率(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率差(%)	①-③	②-④
过去三个月	0.0784%	0.0018%	0.3376%	0.0000%	0.0400%	0.0018%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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. 本基金的利润分配方式为按份分红。

3. 持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1.1 本基金报告期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(%)	净值基准收益率(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率差(%)	①-③	②-④
过去三个月	0.0784%	0.0018%	0.3376%	0.0000%	0.0400%	0.0018%

3.2.1.2 本基金报告期份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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. 本基金的利润分配方式为按份分红。

3. 持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。

3.2.2.1 本基金报告期份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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. 本基金的利润分配方式为按份分红。

3. 持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。

3.2.2.2 本基金报告期份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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. 本基金的利润分配方式为按份分红。

3. 持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。

3.2.3.1 本基金报告期份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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. 本基金的利润分配方式为按份分红。

3. 持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。

3.2.3.2 本基金报告期份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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. 本基金的利润分配方式为按份分红。

3. 持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。

3.2.3.3 本基金报告期份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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. 本基金的利润分配方式为按份分红。

3. 持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。

3.2.3.4 本基金报告期份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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. 本基金的利润分配方式为按份分红。

3. 持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。

3.2.3.5 本基金报告期份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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. 本基金的利润分配方式为按份分红。

3. 持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。

3.2.3.6 本基金报告期份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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. 本基金的利润分配方式为按份分红。

3. 持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。

3.2.3.7 本基金报告期份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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. 本基金的利润分配方式为按份分红。

3. 持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。

3.2.3.8 本基金报告期份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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. 本基金的利润分配方式为按份分红。

3. 持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。

3.2.3.9 本基金报告期份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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. 本基金的利润分配方式为按份分红。

3. 持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。

3.2.3.10 本基金报告期份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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. 本基金的利润分配方式为按份分红。

3. 持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。

3.2.3.11 本基金报告期份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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. 本基金的利润分配方式为按份分红。

3. 持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。

3.2.3.12 本基金报告期份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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. 本基金的利润分配方式为按份分红。

3. 持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。

3.2.3.13 本基金报告期份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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. 本基金的利润分配方式为按份分红。

3. 持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。

3.2.3.14 本基金报告期份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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. 本基金的利润分配方式为按份分红。

3. 持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。

3.2.3.15 本基金报告期份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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. 本基金的利润分配方式为按份分红。

3. 持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。

3.2.3.16 本基金报告期份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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. 本基金的利润分配方式为按份分红。

3. 持有人认购或申购本基金时，不需缴纳任何费用。

3.2.3.17 本基金报告期份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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，本期已实现收益加上本期公