

中信建投添鑫宝货币市场基金 2017 年第 1 季度报告

2017 年 3 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:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2017 年 4 月 21 日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、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法律责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定,于 2017 年 4 月 19 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。
本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

Table with 2 columns: Item (基金简称, 交易代码, etc.) and Value (中信建投添鑫宝, 002260, etc.)

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: Item (本期已实现收益, 本期利润, etc.) and Value (26,451,270.17, etc.)

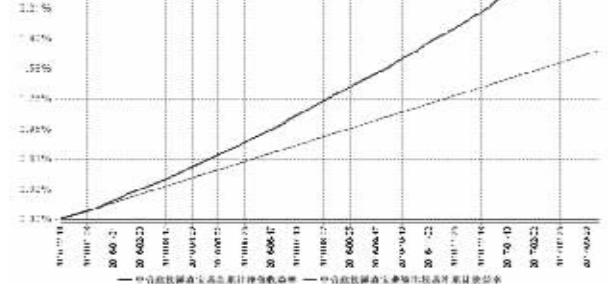
注:1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2. 本基金的利润分配按月结转基金份额。
3. 持有本基金或交易本基金时,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

Table with 6 columns: Stage (过去三个月), Net Return (0.8784%), Benchmark Return (0.0018%), etc.

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: Name (黄浩), Position (基金经理), Tenure (2016年5月25日), etc.

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。

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 管理人报告期内本基金运作遵守信情况的说明
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,基金运作整体合规,没有损害基金持有人利益。

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
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 报告期内基金投资策略和运作分析
2017 年一季度,中国经济积极因素明显增多,经济景气显著上升,需求和供给两旺。同时,随着供给侧结构性改革的推进和创新创业发展,企业效益继续改善。但我们看到,金融市场的资金成本仍然处于较高位置,信用风险事件多发,可能会对经济稳定健康发展产生一定掣肘。

本基金作为流动性管理工具,基金管理人在运作期间,一直秉持投资资产较高的流动性,保持灵活的剩余期限和操作节奏,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
本基金本报告期基金份额净值收益率为 0.8784%,同期业绩比较基准收益率为 0.3375%。

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

Table with 4 columns: Item (固定收益投资, 其中:债券, etc.), Amount (1,037,418,997.75), and Percentage (40.46%).

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: Item (报告期末按行业分类的股票投资金额), Amount (2,900), and Percentage (2.90%).

注:报告期内基金投资组合持仓比例占基金资产净值的比例与报告期内每日基金资产净值持仓比例的比例的简单平均值。

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

Table with 2 columns: Item (投资组合平均剩余期限), Value (69)

Table with 4 columns: Item (报告期末投资组合平均剩余期限最高值, 最低值), Value (70, 21)

报告期末投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明
本报告期内本基金未发生投资组合平均剩余期限超过 120 天的情形。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

Table with 5 columns: Item (序号, 平均剩余期限, 各期限资产占基金资产净值比例), Value (1, 30天以内, 51.63%)

5.4 报告期内投资组合平均剩余期限超过 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期限超过 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

Table with 5 columns: Item (序号, 债券品种, 摊余成本(元), 占基金资产净值比例), Value (1, 国债, 157,362,536.50, 6.77%)

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with 5 columns: Item (序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 摊余成本(元), 占基金资产净值比例), Value (1, 111718078, 华夏银行 CD078, 1,000,000, 98,099,881.97, 4.22%)

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

Table with 2 columns: Item (偏离度), Value (-0.0086%)

报告期内偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明
本基金报告期内未出现偏离度的绝对值达到 0.25% 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序的前十名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: Item (序号, 债券代码, 债券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例), Value (1, 1689159, 16 紫鑫 1A, 400,000, 4,484,000.00, 0.19%)

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,即以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收益并分配的方式,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

Table with 2 columns: Item (存出保证金, 应收证券清算款, etc.), Value (6,878,837.86)

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

Table with 5 columns: Item (报告期初基金份额总额, 报告期间基金总申购份额, etc.), Value (2,943,392,559.83)

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 5 columns: Item (序号, 交易方式, 交易日期, 交易金额(元), 适用费率), Value (1, 红利再投, 2017年1月3日, 393,736.46, 0.00%)

§ 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

Table with 4 columns: Item (序号, 投资者类别, 持有基金份额比例), Value (1, 机构投资者, 8.23%)

8.2 影响投资者决策的其他重要信息
本报告期内,无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 9 备查文件目录

- 1. 中国证监会核准基金募集的文件;
2. 《中信建投添鑫宝货币市场基金基金合同》;
3. 《中信建投添鑫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。

中信建投稳利保本 2 号混合型证券投资基金

2017 年第 1 季度报告

2017 年 3 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:北京银行股份有限公司
报告送出日期:2017 年 4 月 21 日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、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法律责任。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同约定,于 2017 年 4 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。
本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

Table with 2 columns: Item (基金简称, 交易代码, etc.) and Value (中信建投稳利保本 2 号, 001914, etc.)

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: Item (本期已实现收益, 本期利润, etc.) and Value (8,763,141.06, etc.)

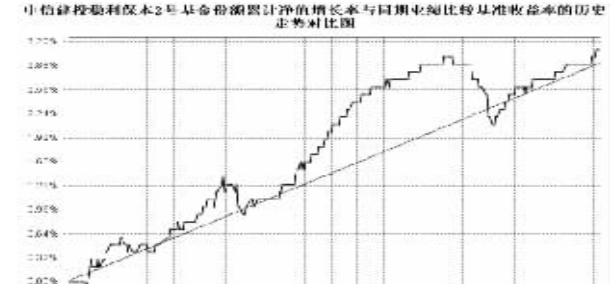
注:1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平低于所列数字。

3.2 基金净值表现

Table with 6 columns: Stage (过去三个月), Net Return (0.68%), Benchmark Return (0.04%), etc.

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: Name (王浩), Position (基金经理), Tenure (2015年11月11日), etc.

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。

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 管理人报告期内本基金运作遵守信情况的说明
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,基金运作整体合规,没有损害基金持有人利益。

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
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 报告期内基金投资策略和运作分析
2017 年一季度,固定资产投资和工业增加值小幅回升,经济数据尚可;CPI 在 2 月份下行到 0.8%,3 月份 0.9%,而受到大宗商品价格上涨的影响,PII 在 2 月份达到了 7.8% 的高位,随后小幅回落至 3 月份的 7.6% 的水平,通胀风险预期减弱,总体处于良性状态。政策层面,始于去年中以来对于银行理财资金的监管持续发酵,货币政策继续保持稳健中性,同时确保不发生系统性金融风险,央行一季度将表外理财纳入 MPA 考核,并且两次提高公开市场回购利率和 MLF 等政策利率,抬升资金成本的中枢。

市场方面,在监管的压力和资金面的阶段性冲击下,整体呈现震荡走势,利率债经过一波显著的调整后有所回落盘整,同业存款的利率高企,迫使信用债的利率难以明显下行,随着资金面而波动,信用债净融资量持续为负,而信用利差仍处于相对低位。

操作方面,保本 2 号自去年底进入第二个保本期,今年 11 月 13 日结束,配置时对于保本的剩余期限也有所考虑。一季度债券收益率处于震荡,然而监管压力和收益率的震荡冲击存在,基于对冲击的时点判断,以及考虑到短期经济企稳,货币政策态度转变,我们采取了较为保守的操作策略包括短久期,中等仓位等,并且择机在季末利率高点加仓,随着利率变化获取波段收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至报告期末,本基金份额净值为 1.031 元,本报告期份额净值增长率为 0.68%,同期业绩比较基准收益率为 0.51%。

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

Table with 4 columns: Item (权益投资, 其中:股票, etc.), Amount (10,426,201.60), and Percentage (6.69%).

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: Item (代码, 行业类别, 公允价值(元)), Value (A 农林牧渔, 0)

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通机制投资的港股。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: Item (序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例), Value (1, 000063, 中兴通讯, 199,960, 3,391,321.60, 0.24%)

Table with 4 columns: Item (代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例), Value (A 农林牧渔, 0)

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: Item (代码, 行业类别, 公允价值(元)), Value (A 农林牧渔, 0)

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通机制投资的港股。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: Item (序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例), Value (1, 000063, 中兴通讯, 199,960, 3,391,321.60, 0.24%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: Item (序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例), Value (1, 国债, 88,935,600.00, 6.31%)

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: Item (序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例), Value (1, 111791652, 17 杭州银行 CD042, 1,000,000, 96,740,000.00, 6.86%)

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策
根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: Item (存出保证金, 应收证券清算款, etc.), Value (82,361.19)

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期内,基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 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
本报告期内,未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息
本报告期内,无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 9 备查文件目录

- 1. 中国证监会核准基金募集的文件;
2. 《中信建投稳利保本 2 号混合型证券投资基金基金合同》;
3. 《中信建投稳利保本 2 号混合型证券投资基金托管协议》;
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。

基金管理人、基金托管人办公场所。
9.2 存放地点
基金管理人、基金托管人办公场所。

9.3 查阅方式
投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司 2017 年 4 月 21 日