

中信现金优势货币市场基金

2008年度报告摘要

基金管理人:中信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇〇九年三月二十六日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事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、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招行银行股份有限公司根据本基金合同约定，对本年度报告草案进行了核查，确认报告的内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

基金管理人过去未向投资人披露过年度报告正文。

本报告摘要摘录自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告中财务资料经审计，安永华明会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，投资人欲知详情。

本报告期自2008年1月1日起至2008年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况	
基金简称	中信现金
交易代码	288101
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年4月20日
报告期末基金份额总额	647,420,746.91份
基金合同延续	不定期

2.2 基金产品说明	
投资目标	在保持安全性、高流动性的前提下获得高于投资基准的回报。
结合货币市场利率的预测与现金需求安排，采取现金流管理策略进行货币市场工具投资，以便在保证基金财产的安全性和流动性的基础上，获得较高的收益。	
业绩比较基准	本基金以中国银行公布的“一年期定期存款的税后收益率”作为业绩比较基准。
风险收益特征	基金投资于货币市场工具，属于低风险品种。

2.3 基金管理人和基金托管人	
项目	基金管理人 基金托管人
名称	中信基金管理有限责任公司 招商银行股份有限公司
姓名	章月平 张燕
信息披露负责人	章月平 张燕
联系电话	010-82028888 0755-83199004
电子邮箱	service@cticfunds.com yan_zhang@cmcbchina.com
客户服务电话	010-82251898 95555
传真	010-82253396 0755-83195201

2.4 信息披露方式	
登载基金年度报告的管理人互联网网址	http://funds.cticfunds.com
基金年度报告备置地点	北京市朝阳区裕民路12号中国国际科技会展中心A座2层

3.1 主要会计数据和财务指标	
单位:人民币元	
3.1.1期间数据和指标	2008年 2007年 2006年
本期已实现收益	22,465,307.81 19,481,485.24 45,080,132.74
本期利润	22,465,307.81 19,481,485.24 45,080,132.74
本期平均净值收益率	4.6792% 3.4589% 1.9397%
3.1.2月度数据和指标	2008年 2007年 2006年
期末基金净值	647,420,746.91 941,030,073.17 626,997,108.00
期末基金总份额	1,0000 1,0000 1,0000

注:①本基金无持有以认购或申购基金的款项。②本期已实现收益指本期利息收入、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已实现价值变动收益,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,本期已实现收益与本期利润的金额相等。

③本基金按日计提份额。

④基金净值表现。

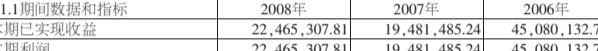
3.2.1基金净值表现及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值		份额净值收益率		业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
	①	②	③	④					
过去三个月	1.3552%	0.0232%	0.8314%	0.0018%	0.5238%	0.0214%			
过去六个月	2.3056%	0.0187%	1.8365%	0.0016%	0.4691%	0.0171%			
过去一年	4.6792%	0.0157%	3.8249%	0.0012%	0.8543%	0.0145%			
过去三年	10.4006%	0.0107%	8.5546%	0.0025%	1.8460%	0.0082%			
自基金合同生效	11.9636%	0.0098%	9.8346%	0.0025%	2.1290%	0.0073%			
效截至至今									

注:上述主要财务指标根据中国证监会2005年3月25日颁布的《证券投资基金信息披露编报规则第5号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》中的要求计算及披露。

3.2.2基金合同生效以来基金份额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

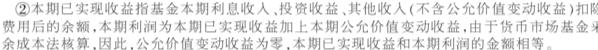
中信现金优势货币市场基金	
(2005年4月20日至2008年12月31日)	



注:①根据中信现金优势基金的基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同规定的投资范围、投资组合的有关规定。

3.2.3基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与其同期业绩比较基准收益率的比较

中信现金优势货币市场基金	
(2005年4月20日至2008年12月31日)	



注:①根据中信现金优势基金的基金合同规定,本基金每年度将公布当年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较。

3.3过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元	
2008年 再投资形式发放总额 备注	-
2007年 19,481,485.24	-
2006年 45,080,132.74	-
合计 87,026,925.79	-

4 管理人报告	
---------	--

4.1基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及基金经理的经验

中信基金管理有限责任公司由中信证券股份有限公司、国家开发投资公司、上海久事公司、中海信托投资有限公司共同发起设立,经中国证监会证监基字[2003]107号文批准,于2003年10月15日正式成立,注册资本金为1亿元人民币。经中国证监会证监基字[2007]120号文批准,国家开发投资公司、上海久事公司、中海信托投资有限公司将其持有的本公司股权转让给中信证券投资有限公司,上述股权转让已完,公司由中信全资持有。

2004年3月至2006年7月期间,公司共募集4只开放式证券投资基金,分别为中信经典配置证券投资基金、中信现金优势货币市场基金、中信红利精选股票型证券投资基金和中信稳健双利债券型证券投资基金。公司自成立伊始,始终严格控制风险,做好客户服务,维护基金份额持有人利益。

4.1.2基金经理(或基金经理助理)及基金经理简介

李广云 基金经理 2007年7月7日 8年

注:①任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

2.证券从业人员从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

基金管理人声明:在报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。

基金管理人勤勉尽责地履行了《基金法》及其他有关法律法规、基金合同的约定。

4.3基金管理人对报告期内公平交易制度、公平交易原则的执行情况的专项说明

报告期内,本基金未发生不公平交易行为。

按中国证监会令[2007]41号文《关于规范证券投资基金公平交易行为的指导意见》,本基金在投资决策及投资交易过程中,未出现明显异常交易行为。

4.4基金管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1本基金的表现

截至2008年12月31日,基金七日年化收益率达到了1.806%,年度总回报率为4.6792%,折年收益率超越比较基准——一年期人民币定期存款利率约0.843个百分点。

4.4.2投资组合分析

报告期内,本基金进一步完善了公平交易制度,确保不同基金在买卖同一证券时,按照时间优先、比例分配的原则分配基金买卖成交金额,公司信息系统中设置了公平交易模块,不同基金向同类同一证券完全通过系统进行比例分配,实现公平交易。

按中国证监会令[2007]41号文《关于规范证券投资基金公平交易行为的指导意见》,本基金在投资决策及投资交易过程中,未出现明显异常交易行为。

4.4.3异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发现异常交易行为。

4.4.4基金管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.5本基金的表现

截至2008年12月31日,基金七日年化收益率达到了1.806%,年度总回报率为4.6792%,折年收益率超越比较基准——一年期人民币定期存款利率约0.843个百分点。

4.4.6期间费用分析

由于本基金的费用较低,所以本基金的费用较少。

4.4.7货币市场基金的流动性风险分析

报告期内,本基金的流动性风险较小。

4.4.8投资组合报告

截至2008年12月31日,本基金的资产配置