中信建投货币市场基金

2014 年度 报告摘要

2014年12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:华夏银行股份有限公司
送出日期:2015年3月27日

§1 重要提示

1.1 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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料经审计,安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2014年8月5日(基金合同生效日)起至2014年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中信建投货币
基金主代码	000738
交易代码	000738
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年8月5日
基金管理人	中信建投基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	624,704,263.32份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性前提下,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发展态势、金融监管政策、财政与货币政策、市场及其结构变化和短期的资金供需等因素的分析,形成对市场短期利率走势的判断。在以上分析的基础上,本基金将根据不同类别资产的收益率水平(不同剩余期限到期收益率、利息支付方式以及再投资便利性),结合各类资产的流动性特征(日均成交量、交易方式、市场流量)和风险特征(信用等级、波动性),决定各类资产的配置比例和期限匹配情况。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
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。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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		中信建投基金管理有限公司	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周建萍	徐昊光
	联系电话	010-59100288	010-85238982
	电子邮箱	zhoujp@cfund108.com	bjxhg@hxb.com.cn
客户服务电话		4009-108-108	95577
传真		010-59100298	010-85238680

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年8月5日(基金合同生效日)-2014年12月31日	2013年	2012年
本期已实现收益	9,918,961.24	-	-
本期利润	9,918,961.24	-	-
本期净值收益率	1.52%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	-	-	-
期末基金资产净值	624,704,263.32	-	-
期末基金份额净值	1.0000	-	-

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日结转基金份额。

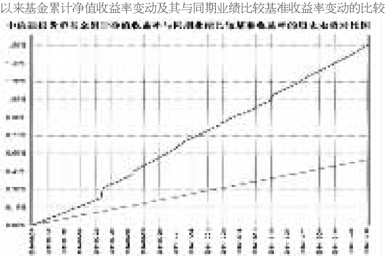
3、持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

3.2 基金净值表现

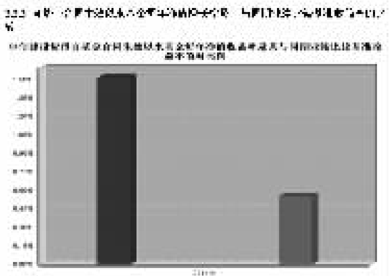
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.94%	0.00%	0.34%	0.00%	0.60%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.52%	0.01%	0.55%	0.00%	0.96%	0.01%

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



[illegible]



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2014	9,844,980.71	12.64	73,967.89	9,918,961.24	
合计	9,844,980.71	12.64	73,967.89	9,918,961.24	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中信建投基金管理有限公司于2013年8月获得中国证监会核准设立批复,并于2013年9月完成工商注册登记,正式成立,注册地北京,注册资本15000万元,具有基金管理资格,经营基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

公司成立以来,公募基金和特定客户资产管理业务得到长足发展,公司已于2014年成功发行了中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金、中信建投货币市场基金、中信建投稳利保本混合型证券投资基金三支公募产品,投资业绩稳步上升,以良好的投资回报实现了投资人资产的保值增值。公司已经与多家商业银行建立合作关系,与浦发银行、北京银行、上海银行、华夏银行等开展业务合作。公司特定客户资产管理业务平稳起航,顺利开展,与多家财务公司、商业银行、信托公司、证券公司、私募基金和上市公司开展了合作或建立合作意向,在定向增发、结构化债券投资等多个领域开展了业务。除传统业务以外,公司也十分重视创新业务的开发,公司已经与移动互联网公司、传媒公司、第三方支付公司、商业银行、证券公司合作,为客户提供余额理财等相关服务。

公司作为财富管理公司,秉承“忠于信,健于投”,追求以稳健的投资及收益,回馈于客户的信任。公司致力于经过长期努力跻身国内一流基金管理公司的行列,拥有资产管理行业一流的团队、最具影响力的品牌、最为稳定优秀的业绩,资产管理规模进入业内前列。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
索隽石	本基金的基金经理	2014年8月5日	-	4	中国籍,1983年8月生,北京大学软件工程硕士,FRM、CQF认证,具备银行间本币市场交易员、基金从业资格。2010年7月至2013年9月任职于信达证券固定收益部,从事固定收益证券投资相关工作;2013年10月至今任职于中信建投基金管理有限公司投资研究部,从事投资研究相关工作。现任中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金、中信建投货币市场基金基金经理。

注:1、任职日期是指本基金基金合同生效之日。

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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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制度指导意见》、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和运用基金资产,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,基金运作整体合法合规,没有损害基金持有人利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《中信建投基金管理有限公司公平交易管理办法》。公司通过科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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制度指导意见》,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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本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 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年本基金运作期内,中央经济延续了“新常态”的基调,政策方面重改革轻增长、强调定向并淡化全面刺激。四季度经济增长延续三季度的疲软走势,工业增加值月同比增速运行在8%以下的历史较低水平。通胀方面保持低位,CPI环比增速已接近10年以来的历史低位,同比增速逐步回落至1.4%;受大宗商品价格尤其是原油价格下跌拖累,PPI环比、同比的跌幅都呈现扩大态势。但另外一方面,在9月30日央行提出首套房“认房不认贷”、10月中旬降低公积金贷款购房门槛、10月29日国务院常务会议提出“稳定住房消费”的说法、11月21日央行降息等系列政策的刺激下,房地产市场有所回暖,销售数据环比明显改善。

债市市场在诸多利好因素兑现推动下,收益率一度大幅下行,利率债、信用债收益率更是创下2014年内新低。但进入12月份,在股市走强、资金面季节性紧张、人民币汇率贬值、特别是中登公司发布《关于加强企业债券回购风险管理相关措施的通知》等因素叠加的冲击下,资金市场收益率一度大幅上行、短期债券收益率也反弹100bp-200bp。后随着SLO投放、MLF续作以及年末财政存款的释放,带来了资金面的回暖、短债收益率也有所下行。

本基金在四季度,通过合理安排回购及存款到期日、适当降低短融仓位,在应对流动性冲击、估值上行压力的同时,阶段性提升了组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期份额净值收益率为1.5150%,同期业绩比较基准收益率为0.5511%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年,通胀保持低位、投资增速下台阶、企业去库存等基本面利好因素仍然对债券市场形成支撑。货币政策方面,除了定向宽松工具的使用外,我们判断全面降息有不超过2次、降准在3次以内,时点集中在上半年。财政政策方面,预计2015年赤字率将从2.1%提升至2.3%,环比来看2015年财政政策基调讲较2014年更为积极。综合基本面因素来看,我们判断债券牛市行情接近尾部,一季度在货币政策呵护、机构配置需求等因素支持下收益率或进一步触底,一季度后随着经济企稳概率加大收益率或触底回升。

货币市场利率方面,回顾2014年下半年,随着美元明显走强、我国外部流动性趋紧、国内货币宽松政策的效果受制于人民币汇率走势。受制于年中美联储加息、利率市场化、下半年经济企稳回升、IPO等季节性因素影响,我们认为货币市场利率有望在上半年见底回升。

基于以上的判断,在保证流动性、资产安全的前提下,我们适度安排短期融资券的配置比例、通过合理安排协议存款、银行间逆回购、交易所逆回购等品种的期限及到期时点,以求获取较好的投资收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,基金管理人结合法律法规和业务发展需要,进一步修订、完善了公司内部制度;组织多项合规培训,加强员工的风险意识和合规意识;针对投资研究等重点业务,加大检查力度,促进公司业务合法合规、稳健经营;积极参与新产品、新业务的设计,提出合规建议,对基金的宣传推介、基金投资交易等方面积极开展各项合规管理工作,有效防范风险,规避违规行为的发生。

本报告期内,本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心,坚持基金份额持有人利益优先的原则,提高监察稽核工作的科学性和有效性,切实保障基金安全、合规运作。

4.7管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金遵循下列7.4 报表附注所述的估值政策和估值原则对基金持有的资产和负债进行估值。

为确保估值政策和估值原则的合理合法性,公司成立估值委员会和风险内控小组。公司总经理任估值委员会负责人,委员包括督察长、投资研究部、特定资产管理部、交易部、产品设计、稽控合规部、运营管理部的主要负责人及基金经理(若负责人认为必要,可适当增减委员会委员),主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算,并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。

在严格遵循公平、合理原则下,公司制订了健全、有效的估值政策流程:

1.运营管理部基金会计每天按照相关政策对基金资产和负债进行估值并计算基金净值,公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》,并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值(适用于非货币基金)或影子定价(适用于货币基金和理财类基金);

2.由投资研究部估值小组确认基金持有的投资品种是否采用估值方法确定公允价值,若确定用估值方法计算公允价值,则在参考基金业协会的意见或第三方意见后确定估值方法;

3.由估值委员会计算该投资品种的公允价值,并将计算结果提交公司管理层;

4.公司管理层审批后,该估值方法方可实施。

为了确保旗下基金持有投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性,风险内控小组应定期对估值政策、程序及估值方法进行审核,并建立风险防控标准。在考虑投资策略的情况下,公司旗下的不同基金持有的同一证券的估值政策、程序及相关的方法应保持一致。除非产生需要更新估值政策或程序的情形,已确定的估值政策和程序应当持续适用。

估值委员会应互相协助定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后应及时修订估值方法,以保证其持续适用。估值政策和程序的修订建议由估值委员会提议,并提交公司管理层,待管理层审批后方可实施。公司旗下基金在采用新投资策略或投资新品种时,应由估值委员会对现有估值政策和程序的适用性做出评价。

在采用估值政策和程序时,估值委员会应当审查并充分考虑参与估值流程各部门及人员的经验、专业胜任能力和独立性,通过参考行业协会估值意见、参考托管行及其他独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合,减少或避免估值偏差的发生。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配方式为红利再投资,每日将当日收益结转为基金份额,当日收益参与下一日基金收益分配,并按日结转到投资者基金账户。本年度基金应分配利润为9,918,961.24元,已全部分配,符合法律法规和《基金合同》的相关规定。

4.9报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人华夏银行股份有限公司在对中信建投信货币市场基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对中信建投货币市场基金的投资运作进行了监督,对基金资产净值的计算、每万份基金净收益和7日年化收益率的计算、基金利润分配、基金费用开支等进行了认真的复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内基金已分配利润为9,918,961.24元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中信建投基金管理有限公司编制和披露的中信建投货币市场基金2014年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,认为以上内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2014)审字第60952150_A14号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	中信建投货币市场基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的中信建投货币市场基金财务报表,包括2014年12月31日的资产负债表,2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人中信建投基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了中信建投货币市场基金2014年12月31日的财务状况以及2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	汤 骏	贺 耀
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国北京	
审计报告日期	2015年3月27日	

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:中信建投货币市场基金

报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产:			
银行存款		308,138,315.86	-
结算备付金		707,500.00	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		200,369,010.45	-
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		200,369,010.45	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		110,120,805.18	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		5,809,026.64	-
应收股利		-	-
应收申购款		10,000.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		625,154,658.13	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		153,048.93	-
应付托管费		46,378.47	-
应付销售服务费		115,946.11	-
应付交易费用		11,053.41	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		73,967.89	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		50,000.00	-
负债合计		450,394.81	-
所有者权益:			
实收基金		624,704,263.32	-
未分配利润		-	-
所有者权益合计		624,704,263.32	-
负债和所有者权益总计		625,154,658.13	-

注:1、报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额624,704,263.32份。

2、本期财务报表的实际编制期间系2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日止,无上年度可比期间数据。

7.2 利润表

会计主体:中信建投货币市场基金

本报告期:2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入		11,947,750.01	-
1.利息收入		11,409,061.25	-
其中:存款利息收入		6,287,481.71	-
债券利息收入		2,935,499.69	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,186,079.85	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		538,688.76	-
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		538,688.76	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		-	-
减:二、费用		2,028,788.77	-
1. 管理人报酬		890,721.48	-
2. 托管费		269,915.68	-
3. 销售服务费		674,788.88	-
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		41,962.73	-
其中:卖出回购金融资产支出		41,962.73	-
6. 其他费用		151,400.00	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		9,918,961.24	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		9,918,961.24	-

注:本基金本报告期系2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日止,无上年度可比期间数据。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中信建投货币市场基金

本报告期:2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	910,926,136.50	-	910,926,136.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	9,918,961.24	9,918,961.24
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-286,221,873.18	-	-286,221,873.18
其中:1.基金申购款	294,150,196.65	-	294,150,196.65
2.基金赎回款	-580,372,069.83	-	-580,372,069.83
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-9,918,961.24	-9,918,961.24
五、期末所有者权益(基金净值)	624,704,263.32	-	624,704,263.32
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	-	-	-

注:本基金本报告期系2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日止,无上年度可比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

蒋月勤	袁野	陈莉君
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中信建投货币市场基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]665号《关于核准中信建投货币市场基金的募集的批复》的注册,由中信建投基金管理有限公司于2014年7月21日至2014年8月1日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证出具安永华明(2014)验字第60952150_A12号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2014年8月5日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的有效净认购金额为人民币910,893,971.32元,有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币32,165.18元,以上实收基金合计为人民币910,926,136.50元,折合910,926,136.50份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为中信建投基金管理公司,基金托管人为华夏银行股份有限公司。

本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括:现金,通知存款,一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,短期融资券,剩余期限在397 天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:七天通知存款税后利率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2014年12月31日的财务状况以及2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日止。

7.4.4.2记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3金融资产和金融负债的分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为交易性金融资产及贷款和应收款项。本基金持有的交易性金融资产主要包括债券投资等。

本基金的金融负债于初始确认时归类为其他金融负债。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

本基金的金融资产初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内,本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值;

本基金的金融负债于初始确认时以公允价值计量,并以摊余成本进行后续计量;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认,即从本基金账户和资产负债表内予以转销;

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,终止确认该金融负债或其一部分;

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债;

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

1、债券投资

买入银行间同业市场交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资按实际支付的全部价款入账,其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,作为应收利息单独核算,不构成债券投资成本,对于贴息债券,该等利息应作为债券投资成本;

卖出银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。出售债券的成本按移动加权平均法结转;

2、回购协议

本基金持有的回购协议(封闭式回购)以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值采用摊余成本法,其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益或损失。

本基金金融工具的估值方法具体如下:

1、银行存款

本基金持有的银行存款以本金列示,按银行实际协议利率逐日计提利息;

2、债券投资

本基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入;

3、回购协议

(1)本基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息;

(2)本基金持有的买断式回购以协议成本列示,所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时,若双方都能履约,则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约,则继续持有现金资产;若融券业务到期无法履约,则继续持有债券资产,实际持有的相关资产按其性质进行估值;

4、其他

(1)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(2) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一估值日,采用其他可参考公允价值指标,对基金持有的估值对象进行重新评估,即“影子定价”。当“影子定价”确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度的绝对值达到或超过0.25%时,基金管理人应根据风险控制的需要调整组合。其中,对于偏离度的绝对值达到或超过0.50%的情形,基金管理人应编制并披露临时报告;

(3)如有新增事项,按国家最新规定估值。

7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

7.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为人民币1.00元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8收入/(损失)的确认和计量

1、存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与帐面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示。另外,根据中国证监会基金部通知(2006)22号文《关于货币市场基金提前支取定期存款有关问题的通知》的规定,因提前支取导致的利息损失由基金管理公司承担;

2、债券利息收入按实际持有期内逐日计提。附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入;

3、买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提;

4、债券投资收益于卖出债券成交日确认,并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账;

5、其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.9费用的确认和计量

1、基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%的年费率逐日计提;

2、基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率逐日计提;

3、基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提;

4、卖出回购证券支出,按卖出回购金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

5、其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.10基金的收益分配政策

1、本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权;

2、本基金收益分配方式为红利再投资,免收再投资的费用;

3、“每日分配、每日支付”。本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,且每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后2位,小数点后第3位按去尾原则处理;

4、本基金根据每日收益情况,将当日收益全部分配,若当日已实现收益大于零时,为投资人记正收益;若当日已实现收益小于零时,为投资人记负收益;若当日已实现收益等于零时,当日投资人不记收益;

5、本基金每日进行收益计算并分配时,每日收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式,投资人可通过赎回基金份额获得现金收益;投资人在每日累计收益支付时,若当日净收益大于零时,则增加投资者基金份额;若当日净收益等于零时,则保持投资者基金份额不变;基金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零,若当日净收益小于零时,则缩减投资者基金份额;

6、当日申购的基金份额自下一个工作日起,享有基金的收益分配权益;当日赎回的基金份额自下一个工作日起,不享有基金的收益分配权益;

7、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.11其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正事项。

7.4.6 税项

7.4.6.1 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

7.4.6.2 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
江苏广传广播传媒有限公司	基金管理人的股东
航天科技财务有限责任公司	基金管理人的股东
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东
华夏银行股份有限公司	基金的托管人、基金销售机构
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金于2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2债券交易

本基金于2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	468,400,000.00	100.00%	-	-

注:本基金于2014年8月5日成立,无上年度可比期间数据。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金于2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间未发生应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	890,721.48	-
其中:支付销售机构的客户维护费	230,623.22	-

注:1、基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的0.33%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.33%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产里列支的费用项目。本报告期应支付华夏银行股份有限公司的客户维护费为208,966.85元。

3、本基金于2014年8月5日成立,无上年度可比期间数据。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	269,915.68	-

注:1、基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.10%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

2、本基金于2014年8月5日成立,无上年度可比期间数据。

7.4.8.2.3 销售服务费

金额单位:人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中信建投基金管理有限公司	214,177.78
华夏银行股份有限公司	351,795.98
合计	565,973.76

注:1、基金销售服务费每日计提,按月支付。基金销售服务费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应计提的销售服务费

E为前一日的基金资产净值

2、本基金的合同于2014年8月5日生效,无上年度可比期间数据。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2014年12月31日		上年度末 2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华夏银行股份有限公司--个人业务部	304,532,768.79	48.7500%	-	-
航天科技财务有限公司	50,010,191.98	8.0100%		

注:本基金于2014年8月5日成立,无上年度可比数据。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华夏银行股份有限公司	1,138,315.86	36,349.36	-	-

注:1、本基金的活期银行存款由基金托管人华夏银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。

2、本基金于2014年8月5日成立,无上年度可比期间数据。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于2014年8月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.9 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、应付管理人报酬等,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

(1)各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为人民币200,369,010.45元,无属于第一层次及第三层次的余额。

(2)公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,在第一层次和第二层次之间无重大转换。

本基金本报告期持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2015年3月27日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	200,369,010.45	32.05
	其中:债券	200,369,010.45	32.05
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	110,120,805.18	17.61
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	308,845,815.86	49.40
4	其他各项资产	5,819,026.64	0.93
5	合计	625,154,658.13	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.66	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	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净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期末发生债券正回购的资金余额超过资产净值的20%的情形。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	62
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	110
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	5

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金本报告期内未发生投资组合平均剩余期限超过180天的情形。

8.3.2 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(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	60.99	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	12.49	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	17.66	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	8.00	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.14	-

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,078,478.26	8.02
	其中:政策性金融债	50,078,478.26	8.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	150,290,532.19	24.06
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	200,369,010.45	32.07
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

8.5 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	140429	14农发29	500,000	50,078,478.26	8.02
2	011484003	14宁沪高SCP003	400,000	40,011,873.40	6.40
3	041451017	14太不锈CP002	300,000	30,238,459.92	4.84
4	011428009	14北车SCP009	300,000	30,032,943.28	4.81
5	041458077	14浙小商CP003	200,000	20,009,951.78	3.20
6	041469057	14鲁西化工CP002	200,000	20,000,460.78	3.20
7	041460097	14华南工业CP001	100,000	9,996,843.03	1.60

8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.17%
报告期内偏离度的最低值	-0.11%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.07%

8.7 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

本基金本报告期期末未持有资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 本基金计价采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.000元。

8.8.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

8.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

8.8.4 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	5,809,026.64
4	应收申购款	10,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	5,819,026.64

8.8.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
847	737,549.31	621,005,371.71	99.41%	3,698,881.61	0.59%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	159,860.86	0.0256%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2014年8月5日)基金份额总额	910,926,136.50
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	294,150,196.65
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	580,372,069.83
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	624,704,263.32

注:上述总申购份额含红利再投资份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2014年9月29日江苏省广播电视总台(集团)投资管理部业务拓展科副科长、江苏省盛世广宏无线科技传播有限公司监事、江苏联威投资有限公司监事周琰同志出任中信建投基金管理有限公司监事。

本报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬50,000.00元人民币。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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注:1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的规定及本基金管理人的《中信建投基金管理有限公司交易席位管理办法》,基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准,具体如下:

(1)证券经纪商的选择由基金管理人分管投资研究、市场领导及投资研究部、特定资产管理部、稽控合规部负责人组成的办公会议集体讨论决定,经公司总经理办公会通过后,办理相关的租用席位或开户事宜。

(2)投资研究部、特定资产管理部按照《券商评估细则》共同完成对各往来证券经纪商的评估,评估办法作为调整确定个别证券经纪商的交易金额及比率限制的参考。

(3)评估实行评分制,具体如下:

分配权重(100分)=基础服务(45%)+特别服务(45%)+销售服务(10%)。

基础服务占45%权重,由研究员负责打分;特别服务占45%权重,由投资研究部负责人和研究员共同打分;销售服务占10%权重,由投资研究部负责人打分。

基础服务包括:报告、电话沟通、路演、联合调研服务等;

特别服务包括:深度推荐公司、单独调研、带上市公司上门路演、约见专家、委托课题、人员培养、重大投资机会等;

销售服务包括:日常沟通、重点推荐的沟通、研究投资工作的支持和配合。

2、根据以上标准进行考察后,基金管理人确定券商,与被选择的券商签订委托协议,并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本基金本报告期末新增和剔除交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	-	-	468,400,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期未发生偏离度绝对值超过0.5%的情况。

中信建投基金管理有限公司
2015年3月27日