

中融货币市场基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人: 中融基金管理有限公司
基金托管人: 南京银行股份有限公司
送出日期: 2018 年 03 月 30 日

5.2 基金简介

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: Item and Content. Includes fund name (中融货币市场基金), code (000847), and other basic details.

2.2 基金产品说明

Table with 2 columns: Item and Content. Details investment objectives, strategies, and risk characteristics.

2.3 基金管理人及基金托管人

Table listing fund manager (中融基金管理有限公司) and custodian (南京银行股份有限公司) details.

2.4 信息披露方式

Table with 2 columns: Item and Content. Lists reporting methods and website (http://www.zrfunds.com.cn/).

5.3 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

Table showing financial metrics for 2017, 2016, and 2015. Includes net income, net assets, and other key figures.

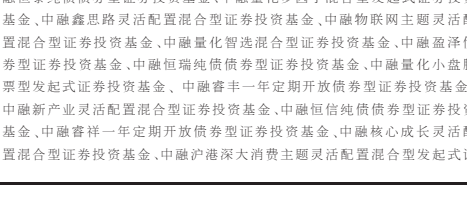
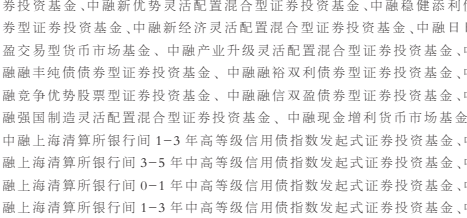
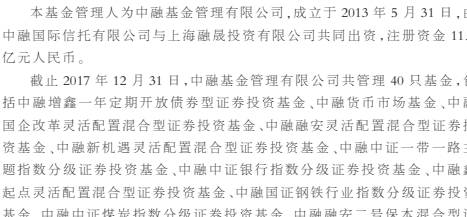
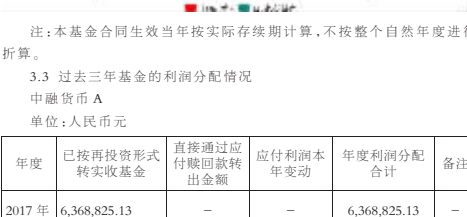
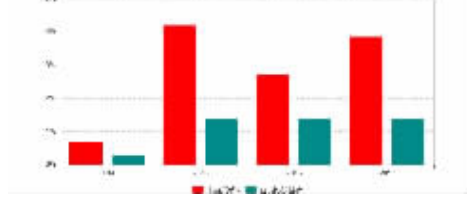
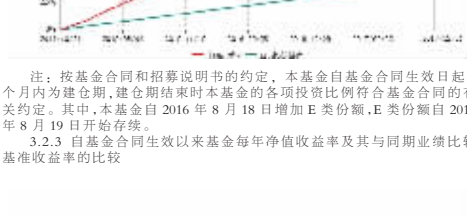
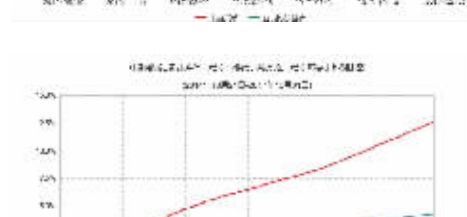
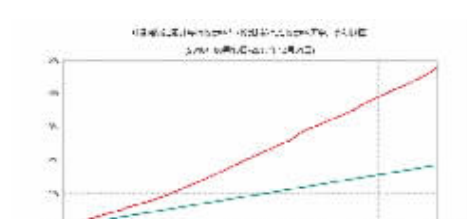
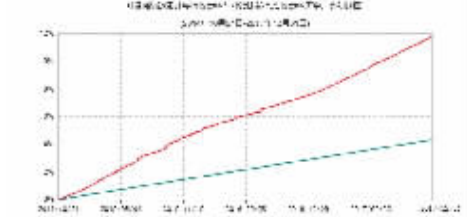
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table comparing fund performance with benchmark (中融货币 C) over various periods (3 months, 6 months, 1 year).

中融货币 C

Table showing performance comparison between the fund and benchmark (中融货币 C) for different periods.



4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

Table listing fund managers and assistants, including names, positions, and tenure.

注: (1) 上述任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的信息日期填写。
(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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
报告期内, 本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定, 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, 为基金份额持有人谋求最大利益, 本基金运作管理符合有关法律法规的规定和基金合同的约定, 无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度和内部控制
公司制定了《公平交易管理制度》, 按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定, 从组织架构、岗位设置、业务流程、系统建设和风险控制、内控制度和信息披露等多方面, 确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合, 杜绝不同投资组合之间进行利益输送, 保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况
根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 本公司制定了《公平交易管理制度》并严格执行, 公司通过建立科学、审慎的投资决策体系, 加强交易分配环节的内部控制, 在研究、决策、交易执行等环节, 通过制度、流程、技术等手段, 确保公平交易制度的有效执行。

4.3.3 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。
4.4 管理人对报告期内基金的投资情况和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2017 年, 国内经济温和复苏, PPI 高位回落, CPI 温和上涨, 随着供给侧改革和行业去产能的推进, 工业品价格有所抬升, 经济韧性较强。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至报告期末中融货币 A 基金份额净值为 1.000 元; 本报告期内, 基金份额净值增长率为 1.3828%; 同期业绩比较基准收益率为 1.3500%; 截至报告期末中融货币 B 基金份额净值为 1.000 元; 本报告期内, 基金份额净值增长率为 1.3405%; 同期业绩比较基准收益率为 1.3500%; 截至报告期末中融货币 C 基金份额净值为 1.000 元; 本报告期内, 基金份额净值增长率为 1.088%; 同期业绩比较基准收益率为 1.3500%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
预计 2018 年经济的韧性依然存在, 去杠杆和严监管的基调仍将持续, 货币政策也将延续“稳健中性”的思路, 叠加外围市场环境企稳, 信用债、受益于企业盈利改善, 现金流稳定, 叠加目前收益率水平已经上升到历史高位, 配置价值凸显, 资金面继续去杠杆; 货币、定期存款、债券、资产价格走低, 跨月和跨季关键时点非银资金需求上升。

4.4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4.4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
4.4.8 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4.4.9 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
4.4.10 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4.4.11 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
4.4.12 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4.4.13 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
4.4.14 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4.4.15 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
4.4.16 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

财务报表是否经过审计

是

审计意见类型: 标准无保留意见

6.2 审计报告的基本内容

审计报告: 我们审计了中融货币市场基金的财务报表, 包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表, 2017 年度的利润表, 所有者权益变动表以及相关的财务报表附注。我们认为, 后附的中融货币市场基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制, 公允反映了中融货币市场基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

形成审计意见的基础: 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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下所承担的责任。按照中国注册会计师审计准则的规定, 我们不对中融货币市场基金的其他事项发表任何意见或提供任何保证。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。

强调事项: 无
其他事项: 无

管理层的责任和注册会计师的责任: 中融货币市场基金管理层(以下简称“管理层”)对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息, 但不包括财务报表和我们出具的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息, 我们也不对其他信息发表任何鉴证结论。结合我们对财务报表的审计, 我们的责任是阅读其他信息, 在此过程中, 考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的其他信息存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作, 如果我们确定其他信息存在重大错报, 我们应当报告该事实。在这方面, 我们无任何责任提供报告。

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证, 并出具包含审计意见的审计报告。合理保证并非绝对保证, 并不保证能发现所有舞弊或错误。舞弊或错误可能导致财务报表发生重大错报, 如果存在, 我们未能发现, 这可能是因为: (1) 舞弊或错误涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上, 未能发现由舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于疏忽或失误导致的重大错报的风险; (2) 了解或识别舞弊或错误的难度; (3) 管理层通过精心策划的舞弊或错误规避了我们的审计程序, 但并非非内部控制的有效性发表意见。此外, 我们可能无法发现所有舞弊或错误。此外, 我们可能无法发现所有舞弊或错误。此外, 我们可能无法发现所有舞弊或错误。此外, 我们可能无法发现所有舞弊或错误。

注册会计师对财务报表审计的责任: 我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证, 并出具包含审计意见的审计报告。合理保证并非绝对保证, 并不保证能发现所有舞弊或错误。舞弊或错误可能导致财务报表发生重大错报, 如果存在, 我们未能发现, 这可能是因为: (1) 舞弊或错误涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上, 未能发现由舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于疏忽或失误导致的重大错报的风险; (2) 了解或识别舞弊或错误的难度; (3) 管理层通过精心策划的舞弊或错误规避了我们的审计程序, 但并非非内部控制的有效性发表意见。

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)
注册会计师的姓名: 徐德、马剑英
会计师事务所的地址: 中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
审计报告日期: 2018-03-22

57 年度财务报表

7.1 资产负债表

Balance Sheet table showing assets and liabilities as of 2017 and 2016.

7.2 所有者权益

Equity table showing components of equity as of 2017 and 2016.

7.3 所有者权益变动表

Equity Movement Statement table showing changes in equity components for 2017.

7.3 所有者权益(基金净值)变动表会计主体: 中融货币市场基金

本报告期: 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日

Table showing changes in equity components for 2017.

项目: 上期期末余额, 本期期初余额, 本期增加额, 本期减少额, 期末余额

7.4 关联方关系: 关联方名称, 与本公司的关系

Table listing related parties and their relationships with the company.

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告所采用的会计政策、会计估计一致。
7.4.2 差错更正: 无
7.4.3 关联方关系: 关联方名称, 与本公司的关系

Table showing related party transactions for 2017 and 2016.

7.4.4.1 关联方往来余额

Table showing related party balances as of 2017 and 2016.

7.4.4.2 关联方往来余额

Table showing related party balances as of 2017 and 2016.

7.4.4.3 关联方往来余额

Table showing related party balances as of 2017 and 2016.

7.4.4.4 关联方往来余额

Table showing related party balances as of 2017 and 2016.

7.4.4.5 关联方往来余额

Table showing related party balances as of 2017 and 2016.

7.4.4.6 关联方往来余额

Table showing related party balances as of 2017 and 2016.

7.4.4.7 关联方往来余额

Table showing related party balances as of 2017 and 2016.

7.4.4.8 关联方往来余额

Table showing related party balances as of 2017 and 2016.

7.4.4.9 关联方往来余额

Table showing related party balances as of 2017 and 2016.

7.4.4.10 关联方往来余额

Table showing related party balances as of 2017 and 2016.