

中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：中信建投基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

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。本半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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 27 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
7.6 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	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	42
7.8 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贵金属投资明细	42
7.9 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	42
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.11 投资组合报告附注	42
§8 基金份额持有人信息	43

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
8.3 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.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	44
§10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	46
§11 备查文件目录.....	46
11.1 备查文件目录.....	46
11.2 存放地点.....	46
11.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	中信建投稳信一年	
基金主代码	000503	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 1 月 27 日	
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	301,054,230.97 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中信建投稳信一年 A	中信建投稳信一年 C
下属分级基金的交易代码:	000503	000504
报告期末下属分级基金的份额总额	136,812,798.51 份	164,241,432.46 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严控风险和保持资产流动性的基础上，力争实现资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金将密切跟踪分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定类属资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取的投资策略主要包括债券类属配置策略、久期管理策略、收益率曲线策略、回购放大策略、信用债券投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。	
业绩比较基准	银行一年期定期存款利率(税后)+1.2%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种，其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。	
	中信建投稳信一年 A	中信建投稳信一年 C

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周建萍	廖原
	联系电话	010-59100288	021-61618888
	电子邮箱	service@cfund108.com	liaoy03@spdb.com.cn
客户服务电话		4009-108-108	95528
传真		010-59100298	021-63602540
注册地址		北京市怀柔区桥梓镇八龙	上海市中山东一路 12 号

	桥雅苑 3 号楼 1 室	
办公地址	北京市东城区朝阳门内大街 2 号凯恒中心 E 座二层	上海市中山东一路 12 号
邮政编码	100010	200120
法定代表人	蒋月勤	吉晓辉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cfund108.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街 2 号凯恒中心 E 座 2 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	中信建投稳信一年 A	中信建投稳信一年 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 27 日 - 2014 年 6 月 30 日)	报告期(2014 年 1 月 27 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,136,145.64	3,480,904.03
本期利润	4,585,985.87	5,219,222.09
加权平均基金份额本期利润	0.0335	0.0318
本期加权平均净值利润率	3.31%	3.14%
本期基金份额净值增长率	3.40%	3.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	3,136,145.64	3,480,904.03
期末可供分配基金份额利润	0.0229	0.0212
期末基金资产净值	141,398,784.38	169,460,654.55
期末基金份额净值	1.034	1.032
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	3.40%	3.20%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中信建投稳信一年 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.88%	0.05%	0.35%	0.01%	0.53%	0.04%
过去三个月	2.58%	0.06%	1.04%	0.01%	1.54%	0.05%
自基金合同生效起至今	3.40%	0.06%	1.78%	0.01%	1.62%	0.05%

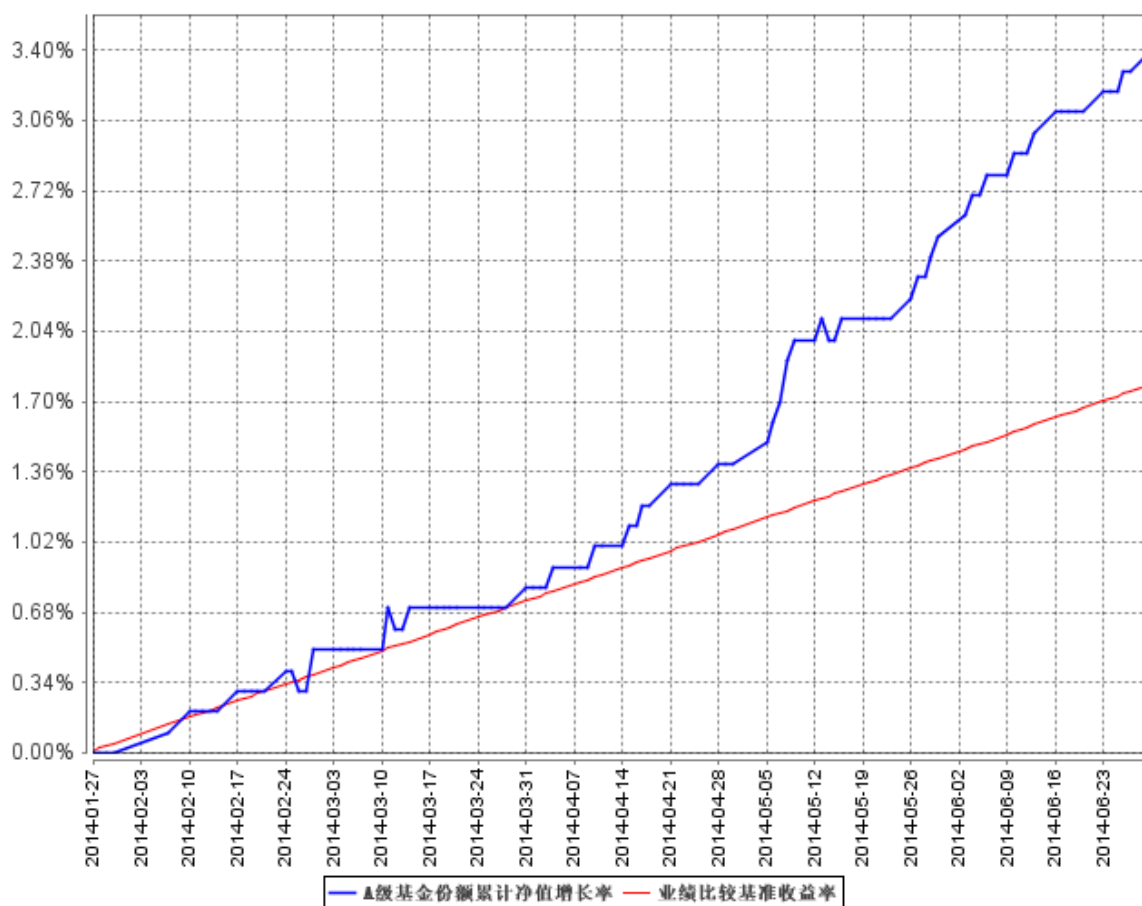
中信建投稳信一年 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.88%	0.06%	0.35%	0.01%	0.53%	0.05%
过去三个月	2.48%	0.05%	1.04%	0.01%	1.44%	0.04%
自基金合同生效起至今	3.20%	0.05%	1.78%	0.01%	1.42%	0.04%

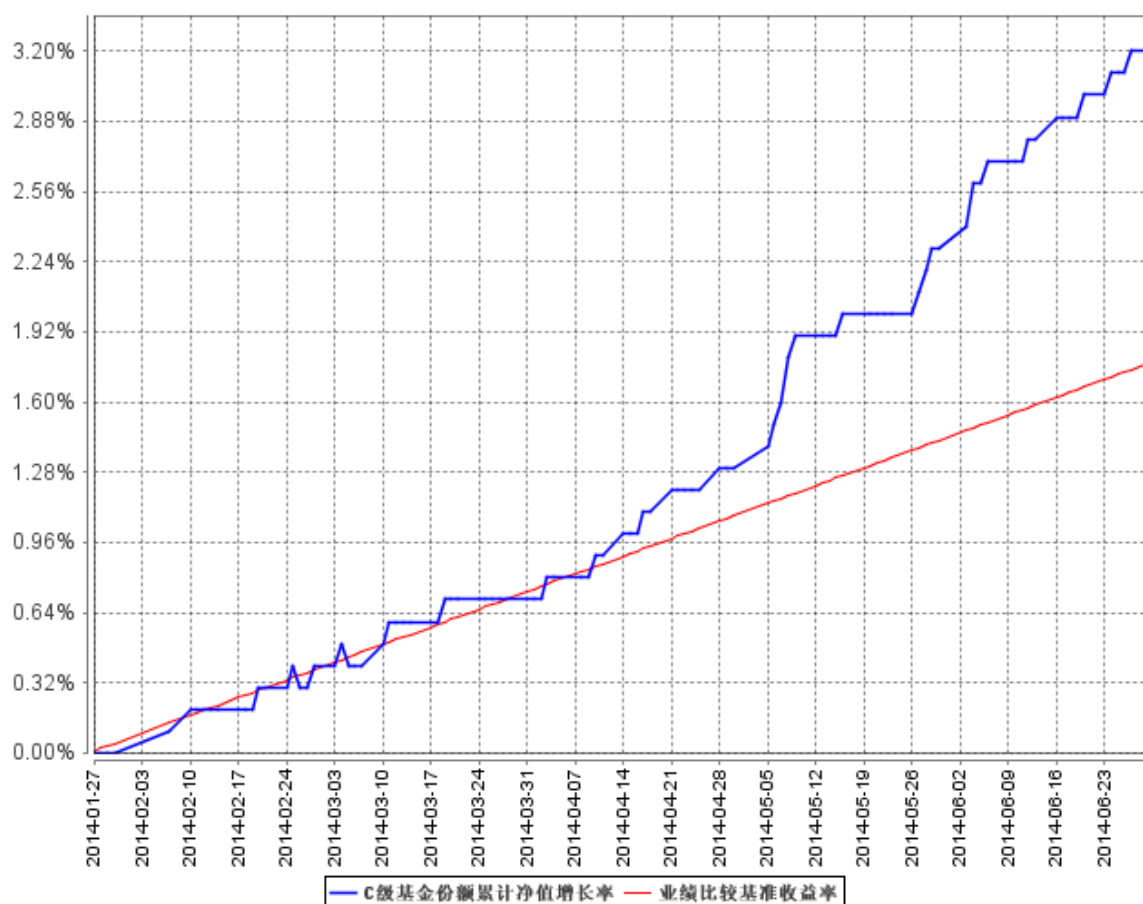
注：（1）本基金尚处于建仓期，根据中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金基金合同，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同约定。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：（1）本基金尚处于建仓期，根据中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金基金合同，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约定。

3.3 其他指标

无。

§ 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，公司首支债券型基金已于 2014 年初成功发行，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、北京农商行、中信银行、上海银行、

工商银行开展业务合作，与建设银行、邮储银行确定了合作意向。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、新股申购、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、类三方存管的相关服务。

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 1 月 27 日	—	3	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。曾任职于信达证券固定收益部，从事固定收益证券投资、交易相关工作，现任中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金基金经理。
王浩	本基金的	2014 年 1 月	—	3	中国籍，

	基金经理	27 日			1982 年 2 月生，中央财经大学证券投资专业硕士。曾任职于中信建投证券股份有限公司资产管理部，从事投资研究工作，现任中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金基金经理。
--	------	------	--	--	--

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合规守信情况的说明

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》、《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 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 年上半年，投资与消费需求惯性下滑，随着“微刺激”政策陆续推出，经济增速仍有回落但幅度有所收窄。通胀方面，CPI 同比明显回落，PPI 同比跌幅收窄，通胀水平保持低位。在国务院提出“降低社会融资成本”的政策背景下，央行先后两次定向降准，支持信贷资源配置到“三农”、小微企业等领域，同时联手监管部门进一步规范同业业务。在经济增长放缓、通胀保持低位、资金面预期向好、同业监管落地等利好刺激下，债市市场走出一波牛市行情，各期限收益率整体下行。利率品种在牛市行情得到确认后，收益率曲线整体平坦下行。信用债方面，在赚钱效应带动下各机构风险偏好有所回升，收益率曲线跟随利率品种整体下行。

本基金在上半年，通过积极参与金融债波段、精选信用品种、控制各券和组合久期等操作，在稳健的操作策略下分享到了债券的牛市上涨行情。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金 A 级份额净值为 1.034 元，份额累计净值为 1.034 元；本基金 C 级份额净值为 1.032 元，份额累计净值为 1.032 元。报告期内，本基金 A 级份额净值增长率为 3.4%，同期业绩比较基准收益率为 1.78%；本基金 C 级份额净值增长率为 3.2%，同期业绩比较基准收益率为 1.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济基本面在政策托底下有望阶段性企稳。CPI 同比受低基数因素影响，三季度仍将保持低位，但需要关注四季度后的反弹压力。资金面来看，在国务院“降低社会融资成本”的政策背景下，央行有意愿维护资金面的平稳，预计货币市场利率仍将维持在当前水平。经济增长方面，虽然商品房销售面积同比增速、房地产开发投资增速等数据仍在下行通道，对三季度的债券市场形成了利好支撑。但同时也要看到，在政策面总理多次提到要确保完成全年经济社会发展目标任务，各地政府稳增长措施也陆续推出助力经济企稳。

债券牛市在一季度的犹豫中酝酿、在二季度的利好兑现下爆发，而进入三季度在经济阶段性企稳及政策托底的背景下市场风险偏好有所回升，债券类资产将面临更多的纠结与不确定性。三季度，资金面面临季节性上行压力及新股发行带来的冲击，考虑到货币政策仍未到退出时点，预计债券市场收益率将由资金面、市场预期变化驱动走出震荡行情。四季度，要密切关注经济回暖的程度以及通胀回升的力度，警惕市场收益率上行风险。

本管理人将密切关注经济基本面和政策走向，积极调整组合结构，保持合理的组合久期和杠

杆水平，在获取配置性收益的同时，通过发掘结构性机会、一级申购机会增强收益，力争在控制风险的前提下为持有人创造持续稳定的收益。

4.6 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 6.4 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、稽核合规部、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；

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查，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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未发生利润分配的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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合规守信、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，对中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中信建投基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	1,242,607.98	—
结算备付金		717,442.81	—
存出保证金		39,872.51	—
交易性金融资产	6.4.7.2	441,540,735.20	—

其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		441,540,735.20	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	6,863,360.37	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		450,404,018.87	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		138,999,236.80	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		178,210.82	-
应付托管费		50,917.37	-
应付销售服务费		55,518.07	-
应付交易费用	6.4.7.7	6,952.38	-
应交税费		-	-
应付利息		128,094.30	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	125,650.20	-
负债合计		139,544,579.94	-
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	301,054,230.97	-
未分配利润	6.4.7.10	9,805,207.96	-
所有者权益合计		310,859,438.93	-
负债和所有者权益总计		450,404,018.87	-

注：

1. 报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额总额为 301,054,230.97 份，A 类基金份额净值 1.034 元，A 类基金份额总额 136,812,798.51 份，C 类基金份额净值为 1.032 元，C 类基金份额总额 164,241,432.46 份；
2. 本基金的基金合同于 2014 年 1 月 27 日生效，截至 2014 年 6 月 30 日，本基金运作未满 1 年，无上年度可比数据

6.2 利润表

会计主体：中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014 年 1 月 27 日(基 金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		12,037,042.76	-
1.利息收入		7,548,251.44	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,220,865.35	-
债券利息收入		5,174,334.28	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		153,051.81	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,300,633.03	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,300,633.03	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,188,158.29	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、费用		2,231,834.80	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	900,752.77	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	257,357.98	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	280,697.86	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,608.03	-
5. 利息支出		654,907.32	-
其中：卖出回购金融资产支出		654,907.32	-
6. 其他费用	6.4.7.20	132,510.84	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,805,207.96	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,805,207.96	-

注：本基金的合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 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）	301,054,230.97	-	301,054,230.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,805,207.96	9,805,207.96
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）	301,054,230.97	9,805,207.96	310,859,438.93
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 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：本基金的合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>蒋月勤</u>	<u>陈莉君</u>	<u>陈莉君</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)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]第 1625 号《关于核准中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金募集的批复》核准，由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金以定期开放方式运作，其封闭期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)一年的期间。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日起一年。首个封闭期结束之后第一个工作日起进入首个开放期，下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起(包括改日)的一年，以此类推。本基金每个开放期 5 至 20 个工作日。

本基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集 301,045,641.95 元，已经安永华明中天会计师事务所有限公司安永华明验字(2014)第 60952150_A01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2014 年 1 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额为 301,063,319.02 份，其中对应 A 类份额 136,821,886.56 份和 C 类份额 164,241,432.46 份。其中认购资金利息折合 17,677.07 份基金份额，其中对应 A 类份额折合为 9,088.05 份，C1 类份额折合为 8,589.02 份。本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(简称：“浦发银行”)。

经中国证监会基金监管部基金部函[2014]49 号审核同意，中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金于 2014 年 1 月 27 日正式成立。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金基

金合同》的有关规定，本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、货币市场工具、股票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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前三个月、开放期内及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，在运作周期内，本基金不受上述 5%的限制。本基金的业绩比较基准为银行一年期定期存款税后利率+1.2%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 27 日至 2014 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期内会计政策未发生变更。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日。本期财务报表的实际编制期间系 2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币为人民币，除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。

本基金目前暂无为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，

参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和估值定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(4) 本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

①上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值。

②未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值。

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算。

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值。

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值。

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理。

2) 债券投资

①证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的

收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值。

②证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值。

③未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

④在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

3) 权证投资

①上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值。

②未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量。

③因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值。

5) 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金融资产公允价值的，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如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。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。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额，即实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的所得税后的净额确认为利息收入。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理费、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

若期末未分配利润中的未实现部分（包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等）为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；

若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分后的余额）。

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额；本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 20%；若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金当期收益应先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资。基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式，选择采取红利再投资形式的，同一类别基金份额的分红资金将按红利发放日该类别的基金份额净值自动转成相应的同一类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

6.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(b) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《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》采用估值技术确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内会计政策未发生变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内会计估计未发生变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内未发生差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	1,242,607.98

定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,242,607.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	98,045,761.98	98,515,735.20
	银行间市场	340,306,814.93	343,025,000.00
	合计	438,352,576.91	441,540,735.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	438,352,576.91	441,540,735.20	3,188,158.29

注：本基金的合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或衍生金融负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	741.25
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	322.80
应收债券利息	6,862,278.32
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	18.00
合计	6,863,360.37

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	6,952.38
合计	6,952.38

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	125,650.20
合计	125,650.20

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中信建投稳信一年 A		
项目	本期 2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	136,812,798.51	136,812,798.51
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	136,812,798.51	136,812,798.51

金额单位：人民币元

中信建投稳信一年 C		
项目	本期 2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	164, 241, 432. 46	164, 241, 432. 46
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	164, 241, 432. 46	164, 241, 432. 46

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中信建投稳信一年 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3, 136, 145. 64	1, 449, 840. 23	4, 585, 985. 87
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3, 136, 145. 64	1, 449, 840. 23	4, 585, 985. 87

单位：人民币元

中信建投稳信一年 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3, 480, 904. 03	1, 738, 318. 06	5, 219, 222. 09
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3, 480, 904. 03	1, 738, 318. 06	5, 219, 222. 09

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	114,259.28
定期存款利息收入	2,095,046.23
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	11,399.43
其他	160.41
合计	2,220,865.35

注：本基金合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内未发生因买卖股票而取得的差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月27日(基金合同生效日)至2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	156,933,700.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	152,110,356.68
减：应收利息总额	3,522,710.89
债券投资收益	1,300,633.03

注：本基金合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未发生资产支持证券投资。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内未发生贵金属投资。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内未发生买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内未发生贵金属赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内未发生贵金属申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期末未发生买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期末未发生其他衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期末未发生股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,188,158.29
——股票投资	—
——债券投资	3,188,158.29
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	3,188,158.29

本基金的合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期末未发生其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	883.03
银行间市场交易费用	4,725.00
合计	5,608.03

注：本基金的合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	20,701.20
信息披露费	104,949.00
银行划款费	5,960.64
开户费	900.00
合计	132,510.84

注：本基金的合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比区间期间数据。

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期内无其他或有事项的说明。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期内无资产负债表日后事项的说明。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信建投期货有限公司	同一控股股东、基金代销机构
江苏省广播电视集团有限公司	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、基金代销机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期末与通过关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	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 成交总额的 比例
中信建投证券股份	329,416,618.00	100.00%	-	-

注：本基金的合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比期间数据。

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 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	1,504,011,000.00	100.00%	-	-

注：本基金的合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内未发生应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	900,752.77	-
其中：支付销售机构的客	110,468.61	-

户维护费		
------	--	--

注：

1. 支付基金管理人中信建投基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.70%÷当年天数。

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，不属于从基金资产中列支的费用项目。

3. 本基金的合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	257,357.98	-

注：1. 支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

2. 本基金的合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投稳信一年 A	中信建投稳信一年 C	合计
中信建投基金管理有限公司	-	26.08	26.08
上海银行股份有限公司	-	16.94	16.94
上海浦东发展银行股份有限公司	-	112.82	112.82
中信建投期货有限公司	-	1,042.65	1,042.65
中信建投证券股份有限公司	-	279,499.37	279,499.37
合计	-	280,697.86	280,697.86
获得销售服务费的	上年度可比期间		

各关联方名称	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投稳信一年 A	中信建投稳信一年 C	合计

注：

- 1、本基金的合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比期间数据。
- 2、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。基金销售服务费按前一日 CB 类基金资产净值计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.40%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	21,000,000.00	2,301.37
上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

注：本基金的合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

中信建投稳信一年 A				
关联方名称	本期末 2014 年 6 月 30 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
江苏省广播电视集团有限公司	30,000,800.00	13.2900%	-	-
航天科技财务有	40,001,400.00	9.9700%		

限责任公司				
-------	--	--	--	--

注：本基金的合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.5 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 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	1,242,607.98	491,425.95	-	-

注：本基金的合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内没有其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期内未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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因认购新发/暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的正回购余额为 110,999,254.50 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1080020	10 宁河西债	2014 年 7 月 21 日	101.42	200,000	20,284,000.00
1282535	12 正泰	2014 年 7 月	100.67	200,000	20,134,000.00

	MTN1	21 日			
1182372	11 金正大 MTN1	2014 年 7 月 21 日	101.19	200,000	20,238,000.00
041464026	14 甘国投 CP001	2014 年 7 月 7 日	100.60	100,000	10,060,000.00
041464033	14 甘公投 CP001	2014 年 7 月 7 日	100.39	200,000	20,078,000.00
041460058	14 鲁商 CP002	2014 年 7 月 1 日	100.31	200,000	20,062,000.00
041461039	14 华信资产 CP001	2014 年 7 月 1 日	99.85	10,000	998,500.00
合计				1,110,000	111,854,500.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的正回购余额为 27,999,982.30 元，于 2014 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司风险控制与合规委员会、督察长、公司风险管理委员会、稽核合规部以及各个业务部门组成。公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与合规委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由稽核合规部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投

资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行上海浦东发展银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
A-1	170,420,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	170,420,000.00	-

注：本基金的合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
AAA	50,367,749.00	-
AAA 以下	169,442,986.20	-
未评级	51,310,000.00	-
合计	271,120,735.20	-

注：本基金的合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,242,607.98	-	-	-	1,242,607.98
结算备付金	717,442.81	-	-	-	717,442.81
存出保证金	-	-	-	39,872.51	39,872.51
交易性金融资产	216,394,542.00	225,146,193.20	-	-	441,540,735.20
应收利息	-	-	-	6,863,360.37	6,863,360.37
资产总计	218,354,592.79	225,146,193.20	-	6,903,232.88	450,404,018.87
负债					
卖出回购金融资产款	138,999,982.30	-	-	-	138,999,982.30

应付管理人 报酬	-	-	-	178,210.82	178,210.82
应付托管费	-	-	-	50,917.37	50,917.37
应付销售服 务费	-	-	-	55,518.07	55,518.07
应付交易费 用	-	-	-	6,952.38	6,952.38
应付利息	-	-	-	128,094.30	128,094.30
其他负债	-	-	-	125,650.20	125,650.20
负债总计	138,999,982.30	-	-	545,343.14	139,544,579.94
利率敏感度 缺口	79,354,610.49	225,146,193.20	-	6,357,889.74	310,859,438.93
上年度末 2013 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
负债					

注：（1）表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

（2）本基金的合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	1,440,324.33	-
	市场利率上升 25 个基点	-1,430,962.96	-

注：本基金的合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及

组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	—	—	—	—
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	441,540,735.20	142.04	—	—
合计	441,540,735.20	142.04	—	—

注：本基金的合同于 2014 年 1 月 27 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的债券，且以摊余成本计价，因此无重大市场价格风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—

2	固定收益投资	441,540,735.20	98.03
	其中：债券	441,540,735.20	98.03
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,960,050.79	0.44
7	其他各项资产	6,903,232.88	1.53
8	合计	450,404,018.87	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.5 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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	51,310,000.00	16.51
	其中：政策性金融债	51,310,000.00	16.51
4	企业债券	118,799,735.20	38.22
5	企业短期融资券	170,420,000.00	54.82
6	中期票据	101,011,000.00	32.49
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	441,540,735.20	142.04

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	140201	14 国开 01	500,000	51,310,000.00	16.51
2	1080020	10 宁河西债	200,000	20,284,000.00	6.53
3	1182372	11 金正大 MTN1	200,000	20,238,000.00	6.51
4	1282535	12 正泰 MTN1	200,000	20,134,000.00	6.48
5	041454029	14 玉皇化工 CP002	200,000	20,106,000.00	6.47

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未进行资产支持证券投资。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未发生贵金属投资。

7.9 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

本基金本报告期内未进行权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未进行国债期货投资。

7.10.2 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进行国债期货投资。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未进行国债期货投资。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

本基金本报告期末投资股票。

7.11.3 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	39,872.51
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	6,863,360.37
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,903,232.88

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未进行股票投资。

7.11.6 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，分项之和合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	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
中 信 建 投 稳 信 一年 A	378	361,938.62	103,030,035.36	75.31%	33,782,763.15	24.69%
中 信 建 投 稳 信	3,798	43,244.19	1,565,113.00	0.95%	162,676,319.46	99.05%

一年 C						
合计	4,176	72,091.53	104,595,148.36	34.74%	196,459,082.61	65.26%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中信建投稳信一年 A	5,402,531.81	3.9488%
	中信建投稳信一年 C	-	-
	合计	5,402,531.81	1.7945%

8.3 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	份额级别	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	中信建投稳信一年 A	100 万份以上
	中信建投稳信一年 C	-
	合计	100 万份以上
本基金基金经理持有本开放式基金	中信建投稳信一年 A	0 至 10 万份（含）
	中信建投稳信一年 C	-
	合计	0 至 10 万份（含）

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信建投稳信一年 A	中信建投稳信一年 C
基金合同生效日（2014 年 1 月 27 日）基金份额总额	136,812,798.51	164,241,432.46
本报告期期初基金份额总额	136,812,798.51	164,241,432.46
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-

减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
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	136,812,798.51	164,241,432.46

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 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

经上海浦东发展银行股份有限公司决定，其资产托管与养老金业务部原总经理李桦同志自 2014 年 4 月起不再担任其资产托管与养老金业务部总经理职务。

本报告期，基金管理人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未变动。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金
------	------	-----------

	交易单元 数量	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	备注
中信建投证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-

10.7.2 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	329,416,618.00	100.00%	1,504,011,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于中信建投稳信一年基金增加上海银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2014 年 1 月 15 日
2	关于中信建投稳信一年基金增加中信建投期货为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2014 年 1 月 17 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投稳信定期开放债券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；

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

11.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司
2014 年 8 月 27 日