

# 中信建投稳溢保本混合型证券投资基金 2016 年年度报告 摘要

2016 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 28 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。普华永道中天会计师事务所（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 2016 年 5 月 19 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	中信建投稳溢保本
基金主代码	002640
交易代码	002640
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 5 月 19 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	938,758,640.27 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于股票等权益类资产和债券等固定收益类金融工具，通过科学的资产配置与严谨的风险管理，力争超越业绩比较基准、实现基金资产持续稳定增值。
投资策略	本基金运用恒定比例组合保险策略（Constant Proportion Portfolio Insurance，以下简称 CPPI 策略），动态调整固定收益类资产与权益类资产在基金组合中的投资比例，以确保本基金在保本周期到期时的本金安全，并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。
业绩比较基准	两年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属证券投资基金中的低风险品种，其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，高于货币市场基金。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在损失投资本金的风险。

### 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	zhoujp@cfund108.com	liaoy03@spdb.com.cn
客户服务电话		4009-108-108	95528
传真		010-59100298	021-63602540

## 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	2016年5月19日 (基金合同生效日)-2016年12月31日	2015年	2014年
本期已实现收益	6,378,161.11	-	-
本期利润	3,406,431.62	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0035	-	-
本期基金份额净值增长率	0.30%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.0034	-	-
期末基金资产净值	941,917,914.68	-	-
期末基金份额净值	1.003	-	-

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。

2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果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）。

3、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要低于所列数字。

### 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

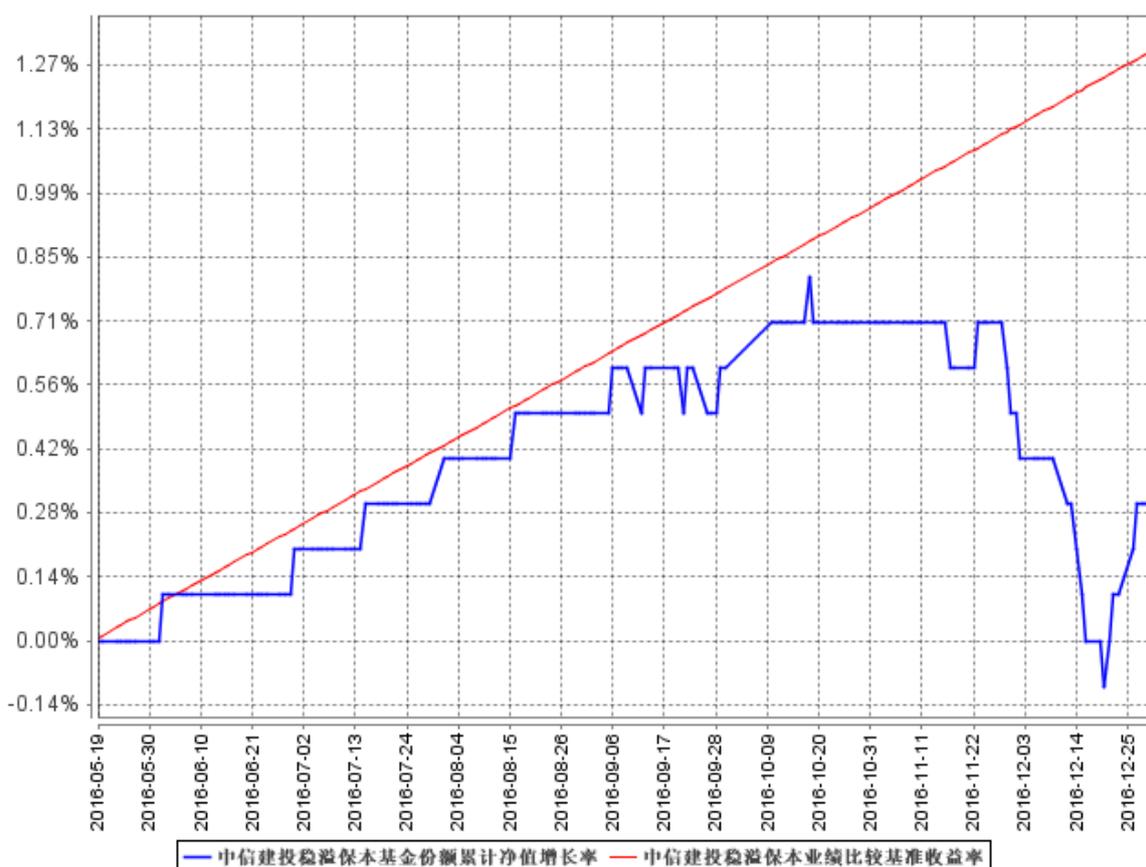
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.30%	0.05%	0.53%	0.01%	-0.83%	0.04%
过去六个月	0.10%	0.05%	1.06%	0.01%	-0.96%	0.04%
自基金合同 生效起至今	0.30%	0.04%	1.31%	0.01%	-1.01%	0.03%

注：1、本基金合同自 2016 年 5 月 19 日起生效，至本报告期末未满一年。

2、按基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。至本报告期末已完成建仓，建仓期结束后各项资产配置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率变动的比较

中信建投稳溢保本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



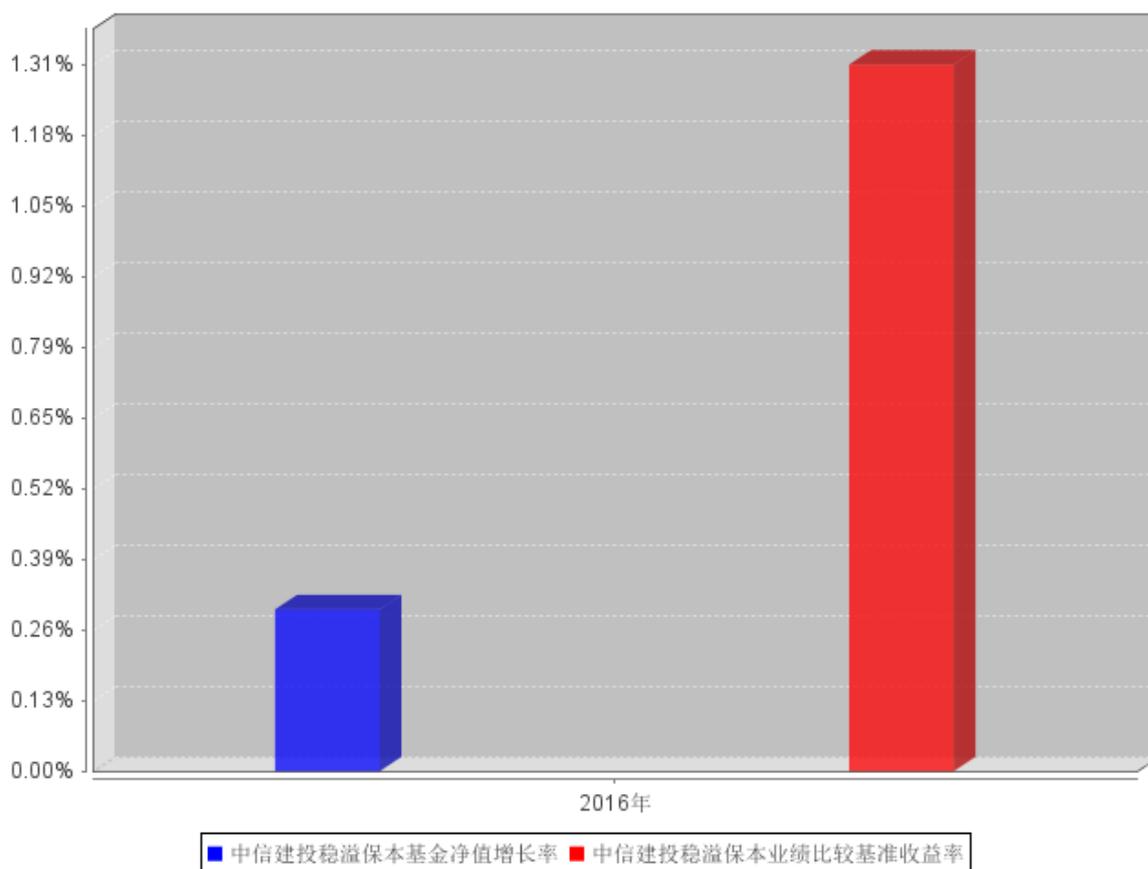
注：1、本基金合同自 2016 年 5 月 19 日起生效，至本报告期末未满一年。

2、按基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。至本报告期末已完成建仓，建仓期结束后各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比

较

中信建投稳溢保本自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同自 2016 年 5 月 19 日起生效，至本报告期末未满一年。基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自成立以来未实施利润分配。

## § 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 9 月 9 日在北京正式注册成立，主要经营基金募集、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，依托强大的股东背景，经过 2014 年、2015 年的基础建设及资源、业务、经验的积累，公司业务呈现发展趋势。员工数量增长较快，团队建设进入加速期。公司多渠道拓展维护客户，已与多家财务公司、

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，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，并与移动互联网公司、传媒公司、第三方支付公司等合作，为客户提供余额、理财、类三方存管的相关服务。公司子公司元达信资本管理（北京）有限公司于 2015 年 6 月 8 日成立。公司及子公司资产管理规模快速增长，各项业务较成立之初获得了快速发展。公司秉承“忠于信，健于投”的经营理念，追求以稳健的投资及良好收益，回馈客户的信任。公司投资业绩稳步上升，以良好的投资回报实现了投资人资产的保值增值。

#### 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		
王浩	公司董事会秘书、本基金的基金经理	2016 年 5 月 19 日	-	7	中国籍，中央财经大学经济学硕士。2010 年 7 月至 2013 年 9 月任职于中信建投证券股份有限公司资产管理部，从事证券投资研究分析工作；2013 年 9 月至今任职于中信建投基金管理有限公司投资研究部，从事证券投资研究分析工作，担任中信建投稳利保本混合型证券投资基金、中信建投稳利保本 2 号混合型证券投资基金、中信建投稳溢保本混合型证券投资基金、中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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

2016 年下半年，固定资产投资和工业增加值基本持平，经济数据相对平稳；CPI 在 10 月份上升到 2 以上，达到了 2.1，随后维持在 2 以上，而受到大宗商品价格上涨的影响，PPI 在 9 月份转正以后持续上升，到 12 月份达到了 5.5 的水平，通胀风险略有抬头，但总体还处于良性状态。政策角度，7 月份开始对于银行理财资金的监管持续发酵，监管去杠杆动作坚决，中央工作会议定调货币政策保持中性，同时强调把防控金融风险放到更加重要的位置，确保不发生系统性金融风险。

债券市场方面，2016 年下半年随着对银行表外理财监管的发酵，加之央行在资金面的控制，债券市场去杠杆的压力在年底集中释放，同时带来债券市场一波强烈的调整，收益率上行，超过了年初水平。股票市场方面，三季度延续 6 月份的反弹，上证指数反弹至 3100 点附近后承压，整体在 2950-3100 点范围内小幅震荡；进入四季度，在保险资金举牌等带动下，市场开始反弹，上证指数 11 月底达到 3300 点的高点，随后市场出现调整，市场风格方面分化明显，低估值蓝筹表

现较好而中小创走势偏弱。

操作方面，本基金在三季度基本上以短久期高评级债券为主要配置方向，主要是考虑债券收益率处于历史低位，基于对委外杠杆的风险，理财增速的放缓的预判，以及考虑到短期经济企稳，货币政策态度转变，我们在配置上采取了较为保守的操作策略，因此，在去年底债券市场的调整中，基金净值回撤控制在较小的范围内，获得了阶段性排名的提升；股票配置角度，本基金结合 CPPI 策略予以少量配置，波段操作，以增强产品收益。

#### 4.4.2 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 1.003 元，本报告期份额净值增长率为 0.30%，同期业绩比较基准收益率为 1.31%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年经济的平稳运行，需求方主要来自于基建投资与汽车购置税减免叠加房地产投资改善。展望 2017 年，地产投资有下行的压力，但是整体库存不高，投资增速基数不高，下行幅度或有限；随着 2014 年以来通缩趋势的逆转和供给侧改革带来的去产能全面执行，制造业民间投资筑底企稳；全球主要经济体去库存周期结束，开启新一轮补库周期，内需外需短期均企稳；制造业投资和出口贸易有望在 2017 年代替房地产投资托底经济。通胀角度，PPI 一季度冲高，CPI 小幅上行，未来 CPI 压力来自工业品向消费品的传导。财政政策维持积极，货币政策稳健偏中性，央行面临去杠杆与守住系统性风险的平衡。

债券市场来看，同业存单净增量继续创新高，显示杠杆尚未完全去除，监管去杠杆的方向依然不变；理财增速放缓，一季度 MPA 考核趋于严格，资金面面临高波动；海外方面，美联储加息的 3 月议息会议临近，全年加息次数或面临攀升，对国内货币政策施压。因此，从经济基本面和货币政策去杠杆的目标来看，暂时不支持债券收益率明显回落，但我们认为利率债和高评级债券的收益率进一步上升的空间也较为有限。从交易角度看，债券趋势性机会尚未看到，但从配置角度看，债券已经具备较好的票息价值。

股票市场来看，企业盈利 2016 年开始好转，并在 2017 年上半年仍保持合理增长，成为市场稳定的主要基础；市场整体估值合理，估值分化收窄，增长和盈利继续带动市场走向；全年来看市场处于一个震荡格局，机会总体来自于结构性和个股行情，个股投资机会丰富，龙头公司享受合理溢价；行业上关注消费类、改革主题、“一带一路”、生物医药及科技创新等方向。

## 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；公司与中证指数有限公司签署了《债券估值数据服务协议》，并依据其提供的估值价格对公司旗下基金持有的交易所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其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**

本基金自 2016 年 5 月 19 日（基金合同生效日）起至 2016 年 12 月 31 日止，期间未实施利润分配，符合相关法规和基金合同的规定。

#### **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**

本基金本报告期末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 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对中信建投稳溢保本混合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，对中信建投稳溢保本混合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。

本报告期内本基金未进行收益分配。

### 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 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	普华永道中天审字(2017)第 22724 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	中信建投稳溢保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的 中信建投稳溢保本混合型证券投资基金 (以下简称“中信建投稳溢保本基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 5 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 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 中信建投稳溢保本基金 的基金管理人 中信建投基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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

	<p>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。</p> <p>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管理层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。</p> <p>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。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述 中信建投稳溢保本基金 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了 中信建投稳溢保本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 5 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	许康玮 张勇
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国 · 上海市
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中信建投稳溢保本混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		5,837,937.34	-
结算备付金		217,126.65	-
存出保证金		31,360.99	-
交易性金融资产		887,612,920.00	-
其中：股票投资		10,473,920.00	-
基金投资		-	-
债券投资		877,139,000.00	-
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		39,700,419.55	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		10,044,342.94	-
应收股利		-	-
应收申购款		998.80	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		943,445,106.27	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		87,745.99	-
应付管理人报酬		960,084.07	-
应付托管费		160,014.03	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		64,004.46	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		255,343.04	-
负债合计		1,527,191.59	-
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		938,758,640.27	-
未分配利润		3,159,274.41	-
所有者权益合计		941,917,914.68	-
负债和所有者权益总计		943,445,106.27	-

注：1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.003 元，基金份额总额 938,758,640.27 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2016 年 5 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：中信建投稳溢保本混合型证券投资基金

本报告期： 2016 年 5 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 5 月 19 日(基 金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		12,268,901.70	-
1. 利息收入		15,447,980.46	-
其中：存款利息收入		3,152,755.40	-
债券利息收入		9,594,168.40	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,701,056.66	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-754,019.71	-
其中：股票投资收益		-857,190.81	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		103,171.10	-
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）		-2,971,729.49	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		546,670.44	-
<b>减：二、费用</b>		8,862,470.08	-
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	7,220,059.91	-
2. 托管费	7.4.8.2.2	1,203,343.28	-
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		140,348.48	-
5. 利息支出		21,403.89	-
其中：卖出回购金融资产支出		21,403.89	-
6. 其他费用		277,314.52	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		3,406,431.62	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		3,406,431.62	-

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中信建投稳溢保本混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 5 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 5 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 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）	993,096,235.85	-	993,096,235.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	3,406,431.62	3,406,431.62
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）	-54,337,595.58	-247,157.21	-54,584,752.79
其中：1. 基金申购款	735,123.41	2,587.16	737,710.57
2. 基金赎回款	-55,072,718.99	-249,744.37	-55,322,463.36
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）	938,758,640.27	3,159,274.41	941,917,914.68
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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：本基金合同自 2016 年 5 月 19 日起生效。

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：

<u>蒋月勤</u>	<u>高翔</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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中信建投稳溢保本混合型证券投资基金(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[2016]第 687 号《关于准予中信建投稳溢保本混合型证券投资基金注册的批复》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《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 606 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 5 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 993,096,235.85 份基金份额,其中认购资金利息折合 234,779.66 份基金份额。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银行(以下简称“浦发银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行交易的债券、股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、货币市场工具、权证、股指期货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,但需符合中国证监会的相关规定。本基金的基金资产包括固定收益类资产和权益类资产,固定收益类资产为国内依法发行交易的债券、货币市场工具等,其中债券包括国债、金融债、央行票据、地方政府债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、资产支持证券、债券回购等。权益类资产为股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等。本基金的投资组合比例为:债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%,其中基金应保留不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府

债券；股票、权证、股指期货等权益类资产占基金资产的比例不高于 40%。本基金的业绩比较基准为：两年期银行定期存款税后收益率。

根据《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的保本周期每两年为一个周期。本基金第一个保本周期自基金合同生效日起至两年后的对应日止；本基金第一个保本周期后的各保本周期自本基金届时公告的保本周期起始之日起至两年后对应日止。如该对应日为非工作日或该公历年不存在该对应日，则顺延至下一个工作日。本基金保证人为基金管理人的保本义务提供不可撤销的连带责任担保。保证范围为基金持有人认购并持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于其保本金额的差额部分。保证期间为基金保本周期到期日起六个月止。保本周期届满时，保证人或保本义务人符合法律法规有关保证人或保本义务人资质要求，同意继续提供保本保障或基金管理人认可的其他机构同意提供保本保障，并与本基金管理人签订保证合同，同时本基金满足法律法规和基金合同规定的保本基金存续要求的情况下，本基金将转入下一保本周期。如保本周期到期后，本基金未能符合保本基金存续条件，本基金转型为非保本基金，基金名称变更为“中信建投睿溢混合型证券投资基金”，基金投资、基金费率、分红方式等相关内容也将根据基金合同的约定做相应修改，在报中国证监会备案后，提前在临时公告或更新的基金招募说明书中予以说明。

本基金第一个保本周期由北京中关村科技融资担保有限公司作为保证人，为基金管理人的保本义务提供不可撤销的连带责任担保。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金的保本周期安排列示如下：

保本周期到期日：2018 年 5 月 21 日

份额数：938,109,468.94

最大保本线：1.000

截至 2016 年 12 月 31 日基金份额净值：1.003

#### 7.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 5 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 5 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

-

### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2015]101 号《关于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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税, 对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对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, 股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,

解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人、基金代销机构
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
航天科技财务有限责任公司	基金管理人的股东
江苏广传广播传媒有限公司	基金管理人的股东
中信建投期货有限公司	与基金管理人同一控股股东、基金代销机构

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 5 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
中信建投证券 股份有限公司	47,185,970.01	41.83%	-	-

##### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 5 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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 股份有限公司	20,161,854.31	100.00%	-	-

### 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 2016年5月19日(基金合同生效日)至 2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	1,398,000,000.00	100.00%	-	-

### 7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年5月19日(基金合同生效日)至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
中信建投证券 股份有限公司	25,070.25	34.32%	9,233.35	16.64%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例 (%)

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 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 2016年5月19日(基金合同生 效日)至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付 的管理费	7,220,059.91	-

其中：支付销售机构的客户维护费	3,699,167.59	-
-----------------	--------------	---

注：支付基金管理人 中信建投基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.20% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 5 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,203,343.28	-

注：支付基金托管人 浦发银行 的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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

#### 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

本基金本报告期末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

本基金的管理人于本报告期末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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末持有本基金份额。

#### 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		上年度可比期间	
	2016 年 5 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 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
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银	5,837,937.34	702,728.01	-	-

行” )				
------	--	--	--	--

注：本基金的银行存款由基金托管人 浦发银行 保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

### 7.4.9 期末（ 2016 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

本基金本报告期末持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

#### 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 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 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

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金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一层次的余额为 10,473,920.00 元，属于第二层次的余额为 877,139,000.00 元，无属于第三

层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	权益投资	10,473,920.00	1.11
	其中：股票	10,473,920.00	1.11
2	固定收益投资	877,139,000.00	92.97
	其中：债券	877,139,000.00	92.97
	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	39,700,419.55	4.21
	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	6,055,063.99	0.64
7	其他各项资产	10,076,702.73	1.07
8	合计	943,445,106.27	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,292,600.00	0.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,000,320.00	0.11
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,181,000.00	0.13
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,473,920.00	1.11

### 8.2.2 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港股通股票。

### 8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000066	长城电脑	200,000	2,488,000.00	0.26
2	000059	华锦股份	150,000	1,785,000.00	0.19
3	000063	中兴通讯	100,000	1,595,000.00	0.17
4	000777	中核科技	70,000	1,566,600.00	0.17
5	600816	安信信托	50,000	1,181,000.00	0.13
6	600452	涪陵电力	24,000	1,000,320.00	0.11
7	000725	京东方 A	300,000	858,000.00	0.09

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	002475	立讯精密	7,028,806.59	0.75
2	002020	京新药业	6,220,670.47	0.66
3	000063	中兴通讯	5,065,733.00	0.54
4	002366	台海核电	4,492,623.28	0.48
5	002437	誉衡药业	4,353,744.12	0.46
6	600873	梅花生物	3,337,055.11	0.35
7	002245	澳洋顺昌	2,990,567.00	0.32
8	002688	金河生物	2,947,081.24	0.31
9	600452	涪陵电力	2,841,740.00	0.30
10	000066	长城电脑	2,606,609.00	0.28
11	601198	东兴证券	2,443,915.00	0.26
12	300210	森远股份	2,301,663.84	0.24
13	002445	中南文化	2,268,143.00	0.24
14	000777	中核科技	2,119,504.00	0.23
15	000338	潍柴动力	2,023,228.30	0.21

16	000059	华锦股份	1,608,250.00	0.17
17	600406	国电南瑞	1,517,953.00	0.16
18	600816	安信信托	1,206,101.02	0.13
19	002531	天顺风能	1,156,060.20	0.12
20	601766	中国中车	1,078,250.00	0.11

#### 8.4.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002475	立讯精密	7,957,499.40	0.84
2	002020	京新药业	6,167,847.55	0.65
3	002366	台海核电	4,424,677.00	0.47
4	002437	誉衡药业	4,366,397.46	0.46
5	600873	梅花生物	3,353,465.38	0.36
6	000063	中兴通讯	3,122,591.00	0.33
7	002688	金河生物	2,730,416.68	0.29
8	002245	澳洋顺昌	2,364,724.00	0.25
9	300210	森远股份	2,308,889.80	0.25
10	002445	中南文化	2,266,538.70	0.24
11	601198	东兴证券	2,234,707.00	0.24
12	000338	潍柴动力	1,825,960.62	0.19
13	600452	涪陵电力	1,800,484.08	0.19
14	600406	国电南瑞	1,541,664.00	0.16
15	601766	中国中车	1,090,250.00	0.12
16	002531	天顺风能	1,026,944.02	0.11
17	000501	鄂武商 A	800,872.86	0.09
18	601933	永辉超市	787,100.00	0.08
19	000777	中核科技	463,141.00	0.05

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	62,169,761.16
卖出股票收入（成交）总额	50,634,170.55

### 8.5 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	49,950,000.00	5.30
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	19,482,000.00	2.07
5	企业短期融资券	738,601,000.00	78.41
6	中期票据	69,106,000.00	7.34
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	877,139,000.00	93.12

### 8.6 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	011699610	16 深航技	500,000	50,095,000.00	5.32
2	011698290	16 夏港务 SCP004	500,000	49,955,000.00	5.30
3	160209	16 国开 09	500,000	49,950,000.00	5.30
3	011698118	16 云能投 SCP004	500,000	49,950,000.00	5.30
4	011698124	16 象屿 SCP005	500,000	49,935,000.00	5.30
4	011698134	16 航空厦门 SCP007	500,000	49,935,000.00	5.30
5	011698119	16 东航集 SCP003	500,000	49,930,000.00	5.30

## 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 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持有贵金属。

## 8.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期内本基金未运用股指期货进行投资，也无期间损益。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内本基金未运用股指期货进行投资。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内本基金未运用国债期货进行投资。

### 8.11.2 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持有国债期货，也无期间收益。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内本基金未运用国债期货进行投资。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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	31,360.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,044,342.94
5	应收申购款	998.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,076,702.73

### 8.12.4 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处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

### 8.12.6 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
4,734	198,301.36	100,623,970.52	10.72%	838,134,669.75	89.28%

## 9.2 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	0.00	0.0000%

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年5月19日）基金份额总额	993,096,235.85
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	735,123.41
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	55,072,718.99
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	938,758,640.27

## § 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

2016年2月3日，王琦先生任中信建投基金职工监事、任巧二女士不再任职工监事。

2016年6月22日，基金管理人发布《中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，

任命高翔先生为基金管理人副总经理。

2016 年 12 月 23 日，陈瑛女士、周艳丽女士任中信建投基金董事，石明磊先生、安冉女士不再任中信建投基金董事；王禹媚任中信建投基金独立董事，陈冬华不再任中信建投基金独立董事。

自 2016 年 1 月起，基金托管人进行组织架构优化调整并变更部门名称，聘任刘长江同志为资产托管部总经理。

### 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

基金管理人于 2016 年 4 月 5 日发布《中信建投基金管理有限公司关于旗下基金更换会计师事务所的公告》，将会计师事务所由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）改聘为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

报告期内应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 80,000.00 元整，该审计机构自 2016 年 5 月 19 日（基金合同生效日）起为本基金提供审计服务。

### 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	

方正证券	1	65,617,961.70	58.17%	47,986.51	65.68%	-
中信建投证券	2	47,185,970.21	41.83%	25,070.25	34.32%	-

### 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
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	20,161,854.31	100.00%	1,398,000,000.00	100.00%	-	-

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，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。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无需要披露的其他重要信息。

中信建投基金管理有限公司  
2017 年 3 月 31 日