汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金

2015 第三季度报告

基金管理人:汇丰晋信基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇丰晋信2016周期混合
交易代码	540001
前端交易代码	540001
后端交易代码	541001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年5月23日
报告期末基金份额总额	148,339,043.34份
投资目标	通过基于内在价值判断的股票投资方法、基于宏观经济/现金流/信用分析的固定收益证券研究和严谨的结构化投资流程,本基金期望实现与其承担的风险相对应的长期稳健回报,追求高于业绩比较基准的收益。
投资策略	1. 动态调整的资产配置策略 本基金投资的资产配置策略,随着投资人生命周期的延续和投资目标期限的临近,相应的从"进取",转变为"稳健",再转变为"保守",股票类资产比例逐步下降,而固定收益类资产比例逐步上升。 2. 以风险控制为前提的股票筛选策略 根据投研团队的研究成果,本基金首先筛选出股票市场中具有较低风险/较高流动性特征的股票;同时,再通过严格的基本面分析(CFROI为核心的财务分析、公司治理结构分析)和公司实地调研,最终挑选出质地优良的具有高收益风险比的优选股票。 3. 动态投资的固定收益类资产投资策略 在投资初始阶段,本基金债券投资将奉行较为"积极"的策略;随着目标期限的临近和达到,本基金债券投资将逐步转向"稳健"和"保守",在组合久期配置和个券选择上作相应变动。
业绩比较基准	1. 2016年6月1日前业绩比较基准 基金合同生效后至2016年5月31日,本基金业绩比较基准如下: 业绩比较基准 = X * MSCI中国A股指数+(1-X)*中债新综合指数(全价)其中X值见下表:

时间段	股票类资产比例%	X值(%)	(1-X)值(%)
基金合同生效之日至2007/5/31	0-65	45.5	54.5
2007/6/1-2008/5/31	0-60	42.0	58.0
2008/6/1-2009/5/31	0-55	38.5	61.5
2009/6/1-2010/5/31	0-45	31.5	68.5
2010/6/1-2011/5/31	0-40	28.0	72.0
2011/6/1-2012/5/31	0-35	24.5	75.5
2012/6/1-2013/5/31	0-25	17.5	82.5
2013/6/1-2014/5/31	0-20	14.0	86.0
2014/6/1-2015/5/31	0-15	10.5	89.5
2015/6/1-2016/5/31	0-10	7.0	93.0

注:
1.2008年11月11日,新华雷曼中国全债指数更名为新华巴克莱资本中国全债指数。
2.2010年12月16日,新华富时中国A全指更名为富时中国A全指。
3.2013年2月1日起,本基金2016年6月1日前的业绩比较基准由原先"X *富时中国A全指 +(1-X)*新华巴克莱资本中国全债指数",变更为"X *富时中国A全指 +(1-X)*中债新综合指数(全价)"。
4.2016年6月1日后业绩比较基准
2016年6月1日起,本基金业绩比较基准 = 银行活期存款利率(税后)
5.2015年4月1日起,本基金2016年6月1日前的业绩比较基准由原先"X *富时中国A全指 +(1-X)*中债新综合指数(全价)",变更为"X * MSCI中国A股指数+(1-X)*中债新综合指数(全价)"。

风险收益特征	本基金是一只生命周期基金,风险与收益水平会随着投资者目标时间期限的接近而逐步降低。 本基金的预期风险与收益在投资初始阶段属于中等水平;随着目标投资期限的逐步接近,本基金会逐步降低预期风险与收益水平,转变成为中低风险的证券投资基金;在临近目标期限和目标期限达到以后,本基金转变成为低风险的证券投资基金。
基金管理人	汇丰晋信基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	2,436,755.59
2.本期利润	-5,576,938.00
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0371
4.期末基金资产净值	215,133,443.62
5.期末基金份额净值	1.4503

注: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。上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(例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本基金基金合同生效之日(含基金合同生效之日)至2011/05/31(含2011/05/31)年管理费率为1.5%,年托管费率为0.25%。2011/06/01(含2011/06/01)至2016/05/31(含2016/05/31)年管理费率为0.75%,年托管费率为0.20%。2016/06/01起(含2016/06/01)年管理费率为0.38%,年托管费率为0.10%。

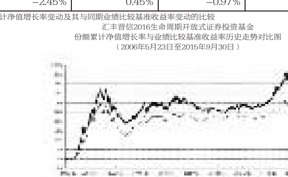
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-2.45%	0.45%	-0.97%	0.24%	-1.48%	0.21%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2006年5月23日至2015年9月30日)



1.按照基金合同的约定,自基金合同生效日(2006年5月23日)至2007年5月31日,本基金的资产配置比例为:股票类资产比例0-65%,固定收益类资产比例35-100%。本基金自基金合同生效日起不超过6个月内完成建仓,截止2006年11月23日,本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。
2.根据基金合同的约定,自2007年6月1日起至2008年5月31日,本基金的资产配置比例调整为:股票类资产比例0-60%,固定收益类资产比例40-100%。
3.根据基金合同的约定,自2008年6月1日起至2009年5月31日,本基金的资产配置比例调整为:股票类资产比例0-55%,固定收益类资产比例45-100%。
4.根据基金合同的约定,自2009年6月1日起至2010年5月31日,本基金的资产配置比例调整为:股票类资产比例0-45%,固定收益类资产比例55-100%。
5.根据基金合同的约定,自2010年6月1日起至2011年5月31日,本基金的资产配置比例调整为:股票类资产比例0-40%,固定收益类资产比例60-100%。
6.根据基金合同的约定,自2011年6月1日起至2012年5月31日,本基金的资产配置比例调整为:股票类资产比例0-35%,固定收益类资产比例65-100%。
7.根据基金合同的约定,自2012年6月1日起至2013年5月31日,本基金的资产配置比例调整为:股票类资产比例0-25%,固定收益类资产比例75-100%。
8.根据基金合同的约定,自2013年6月1日起至2014年5月31日,本基金的资产配置比例调整为:股票类资产比例0-20%,固定收益类资产比例80-100%。
9.根据基金合同的约定,自2014年6月1日起至2015年5月31日,本基金的资产配置比例调整为:股票类资产比例0-15%,固定收益类资产比例85-100%。
10.根据基金合同的约定,自2015年6月1日起至2016年5月31日,本基金的资产配置比例调整为:股票类资产比例0-10%,固定收益类资产比例90-100%。
11.基金合同生效日(2006年5月23日)至2007年5月31日,本基金的业绩比较基准 = 45.5%×富时中国A全指+54.5%×新华巴克莱资本中国全债指数;根据基金合同的约定,自2007年6月1日起至2008年5月31日,本基金的业绩比较基准调整为:42%×富时中国A全指+58%×新华巴克莱资本中国全债指数;自2008年6月1日起至2009年5月31日,本基金的业绩比较基准调整为:38.5%×富时中国A全指+61.5%×新华巴克莱资本中国全债指数;自2009年6月1日起至2010年5月31日,本基金的业绩比较基准调整为:31.5%×富时中国A全指+68.5%×新华巴克莱资本中国全债指数;自2010年6月1日起至2011年5月31日,本基金的业绩比较基准调整为:28%×富时中国A全指+72%×新华巴克莱资本中国全债指数;自2011年6月1日起至2012年5月31日,本基金的业绩比较基准调整为:24.5%×富时中国A全指+75.5%×新华巴克莱资本中国全债指数。自2012年6月1日起至2013年1月31日,本基金的业绩比较基准调整为:17.5%×富时中国A全指+82.5%×新华巴克莱资本中国全债指数。2013年2月1日起至2013年5月31日,本基金的业绩比较基准调整为"17.5%×富时中国A全指+82.5%×中债新综合指数(全价)"。2013年6月1日起至2014年5月31日,本基金的业绩比较基准调整为"14%×富时中国A全指+86%×中债新综合指数(全价)"。2014年6月1日起至2015年3月31日,本基金的业绩比较基准调整为"10.5%×富时中国A全指+89.5%×中债新综合指数(全价)"。2015年4月1日起至2015年5月31日,本基金的业绩比较基准修改为"10.5%×MSCI中国A股指数+89.5%×中债新综合指数(全价)"。2015年6月1日起至2016年5月31日,本基金的业绩比较基准调整为"7%×MSCI中国A股指数+93%×中债新综合指数(全价)"。
12.上述基金净值增长率的计算已包含本基金所投资股票在报告期产生的股票红利收益。同期业绩比较基准收益率的计算未包含新华富时中国A全指成份股在报告期产生的股票红利收益。
13.2008年11月11日,新华雷曼中国全债指数更名为新华巴克莱资本中国全债指数。
14.2010年12月16日,新华富时中国A全指更名为富时中国A全指。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李羿	本基金基金经理、汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金经理	2014年6月21日	-	6	李羿先生,硕士研究生,特许金融分析师。曾任上海浦东发展银行资金总部货币市场及固定收益交易员、交银康联人寿保险有限公司固定收益高级投资经理、汇丰晋信基金管理有限公司投资经理,现任本基金基金经理、汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金经理。
郑屹	本基金基金经理、汇丰晋信2026生命周期证券投资基金基金经理、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金基金经理	2013年4月27日	-	8	郑屹先生,工学硕士。曾任广发证券有限公司研究员、国泰基金管理有限公司研究员、汇丰晋信基金管理有限公司研究员。现任本基金基金经理、汇丰晋信2026生命周期证券投资基金基金经理、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期为本基金管理人公告郑屹、李羿先生担任本基金基金经理的日期;
2.证券从业年限为证券投资相关的工作经历年限。

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《证券投资基金法》及其他相关法规、中国证监会的规定和基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内本基金无有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了保护公司所管理的不同投资组合得到公平对待,充分保护基金份额持有人的合法权益,汇丰晋信基金管理有限公司根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理办法》、《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,制定了《汇丰晋信基金管理有限公司公平交易制度》。

《汇丰晋信基金管理有限公司公平交易制度》规定:在投资管理活动中应公平对待不同投资组合,严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。《公平交易制度》适用于投资的全过程,用以规范基金投资和相关工作,包括授权、研究分析、投资决策、交易执行,以及投资管理过程中涉及的行为监控和业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

报告期内,公司各相关部门均按照公平交易制度的规定进行投资管理活动、研究分析活动以及交易活动。同时,我公司切实履行了各项公平交易行为监控、分析评估及报告义务,并建立了相关记录。

报告期内,未发现本基金管理人存在不公平对待不同投资组合的,或直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司制定了《汇丰晋信基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》,加强防范不同投资组合之间可能发生的利益输送,密切监控可能会损害基金份额持有人利益的异常交易行为。

报告期内,公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《汇丰晋信基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》的规定,对同一投资组合以及不同投资组合中的交易行为进行了监控分析,未发现异常交易行为。

报告期内未发生各投资组合参与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的5%的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

股市的大幅回调使得本已步履蹒跚的经济下行压力骤增,811汇改导致人民币出现一定幅度贬值加重了看空中国经济的预期。央行再次实施了"双降",一年期存贷款基准利率降至了历史最低水平。央行在继续通过货币政策工具向市场投放资金填补外汇占款的缺口,并通过持续投放PSL操作释放长期资金以支持实体。

权益方面:2015年3季度沪深300指数下跌28.4%,按照中信行业指数分类,季度表现较好的行业是银行、餐饮旅游、医药,单季度跌幅分别为10.7%、18.5%、21.9%,而表现较差的行业是钢铁、煤炭、有色金属,跌幅都超过37%,其余23个行业指数跌幅在22%到36%之间。整体看,3季度市场表现为系统性下跌,除银行外,其余行业基本跌幅在20%-40%之间,上证综指从7月初的4200点下跌至9月底的3000点。

债券方面:收益曲线下行,其中前期反应迟钝的中长端也出现较大幅度下行。信用方面,整体收益率曲线较前期更为平坦化。虽然零星信用事件仍在爆发并逐步打破刚性兑付预期,但宽松的资金面和广义基金的配置需求使得信用利差略有收窄。

三季度中债新综合全价指数上涨1.13%,中债国债全价指数上涨1.27%,中债金融债全价指数上涨1.25%,中债信用债全价指数上涨1.26%,标普中国可转债指数下跌20.42%。

资产配置上,我们基本维持股票和债券配置比例。股票配置主要集中在TMT、化工、医药等行业。债券则继续以利率债和中高等级信用债为配置主力,维持较低可转换债券仓位,低配中低等级债券,回避高风险债券。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内基金业绩表现为-2.45%,同期业绩比较基准表现为-0.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计四季度经济下滑趋势将趋缓。然而,目前的经济增速中长期来看仍处于高位,将来仍将趋势下行。消费物价受到猪周期影响短期可能有所上行,但整体仍将维持低位。从基本面来看对债市仍然有利,且货币政策依然维持宽松使得利率风险较小。总体上我们将维持目前的组合久期,以利率债和中高等级信用债为主要配置标的。股票方面,预计4季度市场将出现震荡向上格局,将重点配置受益改革、转型预期的传统行业和行业趋势向好的新兴产业个股,行业配置上,相对看好TMT、医药、新能源、工业4.0、核电等行业。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	10,089,835.34	4.66
	其中:股票	10,089,835.34	4.66
2	固定收益投资	198,910,095.60	91.92
	其中:债券	198,910,095.60	91.92
	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	3,949,237.50	1.83
7	其他资产	3,434,305.00	1.59
8	合计	216,383,473.44	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,433,627.34	4.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	-	-
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	656,208.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	10,089,835.34	4.69

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600172	黄河旋风	118,300	1,717,716.00	0.80
2	002366	丹甫股份	30,000	1,525,800.00	0.71
3	002102	冠福股份	125,000	1,076,250.00	0.50
4	300325	德威新材	90,100	948,753.00	0.44
5	300018	中元华电	43,200	915,408.00	0.43
6	000612	焦作万方	150,787	829,328.50	0.39
7	300169	天晟新材	100,263	770,019.84	0.36
8	002180	艾派克	20,000	720,000.00	0.33
9	300291	华录百纳	30,240	656,208.00	0.31
10	002038	双鹭药业	20,250	520,020.00	0.24

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	92,302,000.00	42.90
	其中:政策性金融债	92,302,000.00	42.90
4	企业债券	52,703,585.60	24.50
5	企业短期融资券	40,135,000.00	18.66
6	中期票据	-	-
7	可转债	13,769,510.00	6.40
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	198,910,095.60	92.46

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	060201	06国开01	200,000	20,036,000.00	9.31
2	130240	13国开40	100,000	10,613,000.00	4.93
3	1480462	14滁州城投债	100,000	10,463,000.00	4.86
4	080216	08国开16	100,000	10,460,000.00	4.86
5	150210	15国开10	100,000	10,404,000.00	4.84

5.6 报告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。
5.7 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。
5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未持有股指期货。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.10.2 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持有国债期货。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。
5.11.2
本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	24,122.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,402,329.42
5	应收申购款	7,852.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,434,305.00

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	6,426,350.00	2.99
2	128009	歌尔转债	5,171,160.00	2.40
3	110030	格力转债	650,750.00	0.30

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002102	冠福股份	1,076,250.00	0.50	重大事项
2	300169	天晟新材	770,019.84	0.36	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因,投资组合报告中,市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	154,633,354.71
报告期期间基金总申购份额	2,937,404.97
减:报告期期间基金总赎回份额	9,231,716.34
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	148,339,043.34

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期内,本基金管理人未持有本基金。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1) 中国证监会批准汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金设立的文件
2) 汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金基金合同
3) 汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金招募说明书
4) 汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金托管协议
5) 汇丰晋信基金管理有限公司开放式基金业务规则
6) 基金管理人业务资格批件和营业执照
7) 基金托管人业务资格批件和营业执照
8) 报告期内汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告
9) 中国证监会要求的其他文件
9.2 存放地点
上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼本基金管理人办公地址。
9.3 查阅方式
投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。
投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人。
客户服务中心电话:021-20376888
公司网址:http://www.hsbcjt.cn

汇丰晋信基金管理有限公司
2015年10月27日

中信建投稳利保本混合型证券投资基金

2015 第三季度报告

基金管理人:中信建投基金管理有限公司
基金托管人:北京银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中信建投稳利保本
交易代码	000804
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月26日
报告期末基金份额总额	155,485,762.83份
投资目标	本基金通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理,在严格控制风险的基础上,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金运用恒定比例组合保险策略(Constant Proportion Portfolio Insurance,简称CPPI策略),动态调整稳健资产与风险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。
基金管理人	中信建投基金管理有限公司
基金托管人	北京银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,384,371.85
2.本期利润	-2,882,788.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0162
4.期末基金资产净值	184,262,369.81
5.期末基金份额净值	1.185

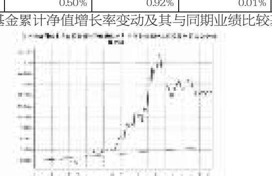
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-1.00%	0.50%	0.92%	0.01%	-1.92%	0.49%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王浩	本基金的基金经理	2014年9月26日	-	5	中国籍,1982年2月生,中央财经大学证券投资专业硕士。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、中信建投稳利保本混合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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度,宏观经济增速延续低迷态势,受到猪肉、蔬菜价格影响CPI略有反弹,而PPI通缩幅度继续扩大。政策角度,货币政策与财政政策延续积极态势,8月25日再次降准降息,同时推出了一系列稳增长的政策。

市场方面,债券市场受经济增长低迷及政策宽松支持,收益率加速下行,长端利率再创新低;股票市场则受到去杠杆等一系列规范措施的影响,出现大幅下跌,并且多次出现流动性严重不足的局面。

操作方面,本基金在二季度末已经大幅降低了权益投资仓位,从而较好的规避了市场的大幅下跌,期间以小仓位参与了7月市场的反弹,取得了不错的效果,总体来看,三季度在市场出现剧烈下跌的过程中,净值保持平稳,很好地保存了上半年的投资收益。

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1.185元,本报告期份额净值增长率为-1.00%,同期业绩比较基准收益率为0.92%。

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年四季度,在长周期因素影响下,宏观经济指标出现大幅反弹的可能性不大,但同时作为领先指标的货币供应数据已经企稳,随着各项稳增长政策效果的显现,预计四季度宏观经济下行幅度有限。通胀角度,虽然预计猪肉价格的上涨周期依然延续,但是其余各项指标依然疲弱,预计通胀水平暂时不会大幅回升,依然维持较低水平。在这样的经济背景下,预计四季度债券市场风险不大,而机会也相对有限;股票市场则依然处于筑底的阶段,可能出现阶段性反弹机会,但整体来说市场在修养阶段。本季度基金管理人将会在控制仓位的基础上,积极参与反弹机会,但依然以控制风险,防范净值回撤,获取稳定收益为主要目标。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期末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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	22,548,097.12	11.93
	其中:股票	22,548,097.12	11.93
2	固定收益投资	154,939,673.80	81.98
	其中:债券	154,939,673.80	81.98
	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	7,383,066.84	3.91
7	其他资产	4,118,003.16	2.18
8	合计	188,988,840.92	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	22,548,097.12	12.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	-	-
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	22,548,097.12	12.24

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000625	长安汽车	300,000	4,428,000.00	2.40
2	002179	中航光电	99,937	3,539,768.54	1.92
3	600978	宜华木业	200,000	2,964,000.00	1.61
4	300292	吴通通讯	90,000	2,884,500.00	1.57
5	300439	美康生物	90,000	2,743,200.00	1.49
6	300090	盛运环保	120,000	2,167,200.00	1.18
7	000782	美达股份	155,201	1,952,428.58	1.06
8	000418	小天鹅A	100,000	1,869,000.00	1.01

注:本基金本报告期末仅持有上述八只股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,104,000.00	10.91
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	63,375,673.80	34.39
5	企业短期融资券	20,189,000.00	10.96
6	中期票据	51,271,000.00	27.83
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	154,939,673.80	84.09

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150307	15进出07	200,000	20,104,000.00	10.91
2	1382132	13宇通MTN1	100,000	10,411,000.00	5.65
3	101453023	14中天MTN001	100,000	10,266,000.00	5.57
4	101461035	14中科集团MTN001	100,000	10,243,000.00	5.56
5	101480003	14营口沿海MTN001	100,000	10,182,000.00	5.53

5.6 报告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
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.7 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
注:本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8 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权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未投资股指期货。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本着谨慎原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,参与股指期货的投资,以改善组合的风险收益特性。
本基金本报告期末未投资股指期货。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未投资国债期货。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1
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。
5.11.2
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。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	436,968.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,681,034.41
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,118,003.16

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600978	宜华木业	2,964,000.00	1.61	重大事项停牌

5.11.6 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,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	210,183,845.46
报告期期间基金总申购份额	959,974.12
减:报告期期间基金总赎回份额	55,658,056.75
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	155,485,762.83

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
注:本报告期内,基金管理人未持有本基金份额。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
注:本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2015年7月9日发布了《中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告》,由张杰女士担任公司总经理,董事长蒋月勤先生不再代行总经理职务。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、中国证监会核准基金募集的文件;
2、《中信建投稳利保本混合型证券投资基金基金合同》;
3、《中信建投稳利保本混合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;
5、基金托管人业务资格批件、营业执照。
9.2 存放地点
基金管理人、基金托管人办公场所。
9.3 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
2015年10月27日

中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金

2015 第三季度报告

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
报告送出日期:2015年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2015年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中信建投稳信一年	
交易代码	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	
报告期末基金份额总额	272,174,396.86份	
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。	
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	
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	259,536,178.24份	12,638,218.62份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)	
	中信建投稳信一年A	中信建投稳信一年C
1. 本期已实现收益	3,715,856.33	166,355.30
2. 本期利润	5,286,424.29	242,301.79
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0204	0.0192
4. 期末基金资产净值	274,656,686.26	13,270,788.76
5. 期末基金份额净值	1.058	1.050

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、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 本报告期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

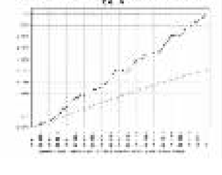
中信建投稳信一年A

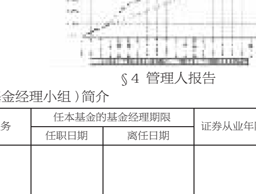
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.93%	0.06%	0.74%	0.01%	1.19%	0.05%

中信建投稳信一年C

阶段	净值增长率①	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	1.84%	0.05%	0.74%	0.01%	1.10%	0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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





§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王浩	本基金的基金经理	2014年1月27日	-	5	中国籍,1982年2月生,中央财经大学证券投资专业硕士。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、中信建投稳利保本混合型证券投资基金基金经理。
索隽石	本基金的基金经理	2014年1月27日	-	5	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、中信建投凤凰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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度,经济增速仍处在长周期下台阶的过程中。通胀方面,CPI同比增速保持在2%以下,PPI同比跌幅逐月扩大。

在固定资产投资增速回落、地产投资增速下平台的背景下,融资需求继续放缓。工业品通缩、工业企业利润跌幅扩大也突出反应了中国经济现阶段面临的深层次问题。反应融资需求的同业存款利率、票据贴现利率在低位徘徊、权益市场的大幅调整与暂停IPO多重利好共振,引发了众多机构对债券市场的追捧。

三季度,债券收益率加速下行、长端利率更再创新低,而转债类资产遭遇正股与溢价率双杀。

本基金在三季度,通过清仓转债、维持杠杆操作、适当拉长久期、积极一级申购,并通过积极参与金融债波段操作,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

截至报告期末,本基金A类基金份额净值为1.058元,本报告期份额净值增长率为1.93%;C类基金份额净值为1.050元,本报告期份额净值增长率为1.84%;同期业绩比较基准收益率为0.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,经济潜在增速下台阶、投资增速下台阶等长周期因素依然对债市形成支撑。由于外汇占款负增长、实际利率仍然较高,货币政策仍有宽松空间。

在国务院"降低社会融资成本"、加强地方政府性债务管理的政策背景下,货币市场呈现较为宽松态势、信用扩张依旧较为疲软。人民币实际有效汇率高企也制约了经济回升,债券类标准资产的需求得到支撑。但另一方面也要防范一致预期下,股市风险偏好回升等结构性冲击造成的机构资产负债表调整。

本管理人将结合本产品风险收益特点,保持合理的组合久期和杠杆水平,力求获取确定性的持有收益。此外,本管理人将通过一级申购新债、债券波段操作,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 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期末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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	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	285,000,587.40	97.98
	其中:债券	285,000,587.40	97.98
	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	1,149,056.80	0.40
7	其他资产	4,731,114.78	1.63
8	合计	290,880,758.98	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
5.3 报告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
本基金本报告期末未持有股票。
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	36,920,587.40	12.82
5	企业短期融资券	126,060,000.00	43.78
6	中期票据	122,020,000.00	42.38
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	285,000,587.40	98.98

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101567001	15西王MTN001	200,000	20,530,000.00	7.13
2	101559008	15太阳MTN001	200,000	20,524,000.00	7.13
3	101554022	15七匹狼MTN001	200,000	20,474,000.00	7.11
4	101554032	15鲁宏桥MTN002	200,000	20,254,000.00	7.03
5	041562012	15中建租赁CP001	200,000	20,210,000.00	7.02

5.6 报告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。
5.7 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。
5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.9.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未投资国债期货。
5.9.2 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投资国债期货。
5.9.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。
5.10 投资组合报告附注
5.10.1
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。
5.10.2
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。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,587.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,726,527.71
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,731,114.78

5.10.4 报告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。
5.10.5 报告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投资股票。
5.10.6 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。

§6 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
报告期期初基金份额总额	259,536,178.24	12,638,218.62
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	259,536,178.24	12,638,218.62

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期内,基金管理人未持有本基金份额。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2015年7月9日发布了《中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告》,由张杰女士担任公司总经理,董事长蒋月勤先生不再代行总经理职务。

§9 备查文件目录

9.1 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;
5、基金托管人业务资格批件、营业执照。
9.2 存放地点
基金管理人、基金托管人办公场所。
9.3 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
2015年10月27日