中信建投稳利保本混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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
送出日期:2018年08月28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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月24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。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者存款类金融机构,保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中信建投稳利保本
基金主代码	000804
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年09月26日
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
报告期末基金份额总额	843,388,316.56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,以下简称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。

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	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张乐久	刘晔
	联系电话	010-57760122	010-66223586
	电子邮箱	zhanglj@csc.com.cn	liuye1@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		4009-108-108	95526
传真		010-59100298	010-66225309

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	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办公场所

§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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)
本期已实现收益	4,812,563.62
本期利润	3,641,582.81
本期基金份额净值增长率	0.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末基金资产净值	872,987,719.60
期末基金份额净值	1.0351

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
过去一个月	0.11%	0.14%	0.16%	0.00%	-0.05%	0.14%
过去三个月	0.09%	0.12%	0.47%	0.01%	-0.38%	0.11%
过去六个月	0.39%	0.13%	0.94%	0.01%	-0.55%	0.12%
过去一年	2.49%	0.10%	1.92%	0.01%	0.57%	0.09%
过去三年	7.51%	0.23%	8.19%	0.01%	-0.68%	0.22%
自基金合同生效起至今	28.69%	0.35%	11.28%	0.01%	17.41%	0.34%

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

§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21日获得中国证监会核准设立批复,并于2013年9月9日完成工商注册登记,注册资本3亿元,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。公司全资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,主要经营特定客户资产管理业务和中国证监会许可的其他业务。

公司自成立以来积极拓展业务,公司专户管理资产月均规模根据中国证券投资基金业协会数据,连年位列前20名。截至2017年末,位居行业第13名。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的收益,回馈客户的信任;投研能力优秀,不断丰富和完善"宏微观相互印证"的大类资产配置研究框架,坚持价值投资和稳健投资的原则;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。机构客户资源丰富,客户类别多,涵盖商业银行、证券公司、信托公司、财务公司、私募基金等客户资源。积极进行产品创新,响应十九大"金融服务实体经济"的号召,与政府相关部门共同开发国企改革基金;响应"调结构、降杠杆"的号召,成立产业基金,包含基础设施、环境治理、专项扶贫等关系国计民生的重大项目。

2017年度,公司荣获上交所、深交所"债券优秀交易商"荣誉称号,是行业113家基金公司中唯一一家在沪深交易所均获得该称号的公司。公司各项业务有序开展,为进一步发展奠定了良好的基础。

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	本基金的基金经理	2014-09-26	-	8年	中国籍,1982年2月生,中央财经大学经济学硕士。曾就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。现任本公司投资研究部基金经理,担任中信建投稳利保本混合型证券投资基金、中信建投聚利混合型证券投资基金、中信建投睿溢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。
颜灵珊	本基金的基金经理	2017-02-16	2018-06-05	4年	中国籍,1989年11月生,中国人民大学管理学硕士(财务方向)。曾任招商证券股份有限公司研究员。2016年8月加入我公司,曾任投资研究部基金经理,因离职于2018年6月注销基金经理资格。

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。首任基金经理,任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产,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。

4.3.2 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

二季度以来,工业增加值不及预期、固定资产投资增速创多年以来新低、消费市场继续回落,宏观经济数据几乎全线走弱。资金面相对宽松,4月25日定向降准落地,置换9000亿元MLF,同时释放增量资金约4000亿元。整个二季度,A股各主要指数均维持震荡下跌走势。国内金融去杠杆、中美贸易摩擦等事件性因素是2018年市场调整的重要外在因素;而2017年底以及2018年初高度趋同的一致预期、交易头寸的过度拥挤是市场调整的主要内因。投资者对确定性的追逐已经使得内需消费板块的很多个股性价比明显降低,而周期、成长、金融、地产或受制于经济下行预期,或受制于货币、产业政策等因素,均未出现趋势性反转行情。我们对于2018年的市场整体风险有所警惕,希望能够通过选择优质公司并通过仓位控制来防范风险。但就中长期而言,我们看到一些公司的基本面仍然非常良好,估值也相对合理。因此,在可预见的未来依旧有很好的投资机会值得把握。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投稳利保本基金份额净值为1.0351元,本报告期内,基金份额净值增长率为0.39%,同期业绩比较基准收益率为0.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度以来,工业增加值不及预期、固定资产投资增速创多年以来新低、消费市场继续回落,宏观经济数据几乎全线走弱。资金面相对宽松,4月25日定向降准落地,置换9000亿元MLF,同时释放增量资金约4000亿元。整个二季度,A股各主要指数均维持震荡下跌走势。国内金融去杠杆、中美贸易摩擦等事件性因素是2018年市场调整的重要外在因素;而2017年底以及2018年初高度趋同的一致预期、交易头寸的过度拥挤是市场调整的主要内因。投资者对确定性的追逐已经使得内需消费板块的很多个股性价比明显降低,而周期、成长、金融、地产或受制于经济下行预期,或受制于货币、产业政策等因素,均未出现趋势性反转行情。我们对于2018年的市场整体风险有所警惕,希望能够通过选择优质公司并通过仓位控制来防范风险。但就中长期而言,我们看到一些公司的基本面仍然非常良好,估值也相对合理。因此,在可预见的未来依旧有很好的投资机会值得把握。

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。公司分管运营领导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、稽控合规部、运营管理部的主要负责人,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、有效的估值政策和流程:

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

2.由估值委员会确认基金持有的投资品种是否采用估值方法确定公允价值,若确定用估值方法计算公允价值,则在参考基金业协会的意见或第三方意见后确定估值方法;

3.由估值委员会计算该投资品种的公允价值,并将计算结果提交公司管理层;

4.公司管理层审批后,该估值方法方可实施。

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

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

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

4.7 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实施利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 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

本基金本报告期末未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

在本报告期内,本基金托管人在托管中信建投稳利保本混合型证券投资基金(以下称"本基金")过程中,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,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

在本报告期内,本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配情况、投资组合报告的内容("金融工具风险及管理"部分、以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内),保证复核内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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:中信建投稳利保本混合型证券投资基金

报告截止日:2018年06月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	55,388,102.81	52,299,298.61
结算备付金	907,850.91	1,924,687.71
存出保证金	181,366.03	67,196.48
交易性金融资产	715,751,316.00	891,336,780.90
其中:股票投资	39,146,316.00	62,300,536.70
基金投资	-	-
债券投资	646,680,000.00	829,036,244.20
资产支持证券投资	29,925,000.00	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	86,000,000.00	10,000,000.00
应收证券清算款	33,541.64	1,664,631.66
应收利息	16,169,976.10	22,940,877.32
应收股利	-	-
应收申购款	-	198,023.71
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	874,432,153.49	980,431,496.39
负债和所有者权益	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	207,275.29	1,018,148.18
应付管理人报酬	866,791.51	1,018,625.33
应付托管费	144,465.26	169,770.87
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	78,399.57	88,259.83
应交税费	46,754.11	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	100,748.15	206,168.15
负债合计	1,444,433.89	2,500,972.36
所有者权益:		
实收基金	834,969,769.47	938,953,398.95
未分配利润	38,017,950.13	38,977,125.08
所有者权益合计	872,987,719.60	977,930,524.03
负债和所有者权益总计	874,432,153.49	980,431,496.39

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.0351元,基金份额总额843,388,316.56份。

6.2 利润表

会计主体:中信建投稳利保本混合型证券投资基金

本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
一、收入	11,326,568.16	23,841,039.75
1.利息收入	19,981,403.34	18,883,518.32
其中:存款利息收入	1,171,401.57	25,941.45
债券利息收入	17,959,388.41	16,121,102.20
资产支持证券利息收入	306,806.58	-
买入返售金融资产收入	543,806.78	2,736,474.67
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-7,786,411.27	-1,546,806.06
其中:股票投资收益	-8,278,742.75	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	123,767.39	-1,546,806.06
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	368,564.09	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-1,170,980.81	6,205,925.79
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	302,556.90	298,401.70
减:二、费用	7,684,985.35	8,379,270.90
1. 管理人报酬	5,493,756.33	7,033,645.95
2. 托管费	915,625.99	1,172,274.29
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	534,349.48	1,525.00
5. 利息支出	606,913.18	15,268.66
其中:卖出回购金融资产支出	606,913.18	15,268.66
6. 税金及附加	5,933.16	-
7. 其他费用	128,407.21	156,557.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	3,641,582.81	15,461,768.85
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	3,641,582.81	15,461,768.85

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中信建投稳利保本混合型证券投资基金

本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06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)	938,953,398.95	38,977,125.08	977,930,524.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,641,582.81	3,641,582.81
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)	-103,983,629.48	-4,600,757.76	-108,584,387.24
其中:1.基金申购款	2,546,085.26	115,489.31	2,661,574.57
2.基金赎回款	-106,529,714.74	-4,716,247.07	-111,245,961.81
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)	834,969,769.47	38,017,950.13	872,987,719.60
项目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06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)	1,190,416,695.88	8,017,924.91	1,198,434,620.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,461,768.85	15,461,768.85
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)	-53,606,751.15	-714,762.20	-54,321,513.35
其中:1.基金申购款	1,346,879.17	19,104.56	1,365,983.73
2.基金赎回款	-54,953,630.32	-733,866.76	-55,687,497.08
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)	1,136,809,944.73	22,764,931.56	1,159,574,876.29

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:

蒋月勤	高翔	陈莉君
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中信建投稳利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[2014]914号《关于准予中信建投稳利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《中信建投稳利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,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证出具安永华明(2014)验字第60952150_A17号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信建投稳利保本混合型证券投资基金基金合同》于2014年9月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为464,708,417.18份基金份额,其中认购资金利息折合32,923.00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,基金托管人为北京银行股份有限公司(以下简称"北京银行"),担保人为深圳市高新投集团有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投稳利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,包括国内依法发行上市的股票(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、股指期货等权益类金融工具,债券等固定收益类金融工具(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)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稳健资产和风险资产,稳健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。风险资产为股票(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、货币市场工具等稳健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(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券;股票、权证、股指期货等风险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《中信建投稳利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"中信建投稳利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。

根据《中信建投稳利保本混合型证券投资基金保本周期到期及转入下一保本周期相关规则的公告》和《关于中信建投稳利保本混合型证券投资基金提前结束过渡期申购、进行基金份额折算并转入第二个保本周期的公告》,本基金第一个保本周期自2014年9月26日起至2016年9月26日止,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,将在第一个保本周期到期后转入第二个保本周期。根据《关于中信建投稳利保本混合型证券投资基金份额折算和过渡期申购确认结果的公告》的有关规定,本基金的基金管理人中信建投基金管理有限公司确定2016年10月11日为本基金的基金份额折算日,对当日登记在册的全体基金份额持有人持有的基金份额进行了折算。基金份额折算比例为1.01007465,折算后基金份额净值为1.000元。本基金第二个保本周期自2016年10月12日起至2018年10月12日止,由深圳市高新投集团有限公司为本基金的第二个保本周期提供不可撤销的连带责任保证。

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》、《中信建投稳利保本混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年半年度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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018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 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相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与上年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2018年1月1日至2018年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

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。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和资产支持证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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,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其他各类应收款项等。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。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产和其他各类应付款项。

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,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的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证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,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

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、债券投资和资产支持证券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;估值日无交易且最近交易未发生影响公允价值计量的的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

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1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 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。

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。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认列。

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认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

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个人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个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分确认为利息收入。

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;于处置时,其处置价格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,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、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,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为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。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,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,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,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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) 本基金的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,不需要披露分部信息。

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:

(1) 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[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》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。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、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) 于2016年5月1日前,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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 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
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
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
北京银行股份有限公司("北京银行")	基金托管人、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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30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	119,351,620.15	27.70%	-	-

注:上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 债券交易

无。

6.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	445,000,000.00	27.89%	-	-

注:上年度可比期间未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30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	63,411.45	23.24%	10,024.61	13.50%
关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30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:上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,493,756.33	7,033,645.95
其中:支付销售机构的客户维护费	3,688,448.15	4,646,848.85

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,逐日累计至每月月末,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×1.20%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	915,625.99	1,172,274.29

注:支付基金托管人 北京银行 的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月末,按月支付。其计算公式为:

每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 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

无。

6.4.8.5 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 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
北京银行股份有限公司	5,388,102.81	29,001.74	1,947,692.26	22,560.50

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

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 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2018年6月30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39,146,316.00元,属于第二层次的余额为676,605,000.00元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次的余额为人民币59,440,339.70元,第二层次的余额为831,896,441.20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,本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2018年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日:同)。

(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) 除公允价值和增值税外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	39,146,316.00	4.48
	其中:股票	39,146,316.00	4.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	676,605,000.00	77.38
	其中:债券	646,680,000.00	73.95
	资产支持证券	29,925,000.00	3.42
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	86,000,000.00	9.83
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	56,295,953.72	6.44
8	其他各项资产	16,384,883.77	1.87
9	合计	874,432,153.49	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	21,038,366.00	2.41
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	18,107,950.00	2.07
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	39,146,316.00	4.48

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资港股通股票。

7.3 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300188	美亚柏科	308,000	5,636,400.00	0.65
2	603707	健友股份	158,200	4,291,966.00	0.49
3	002410	广联达	150,000	4,159,500.00	0.48
4	000977	浪潮信息	160,000	3,816,000.00	0.44
5	300296	利亚德	270,000	3,477,600.00	0.40
6	002439	启明星辰	150,000	3,183,000.00	0.36
7	300003	乐普医疗	80,000	2,934,400.00	0.34
8	300009	安科生物	150,000	2,766,000.00	0.32
9	300047	天源迪科	170,000	2,652,000.00	0.30
10	300369	绿盟科技	231,500	2,477,050.00	0.28

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.cfund108.com 网站的半年度报告正文。

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初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例(%)
1	002258	利尔化学	7,383,664.33	0.76
2	002475	立讯精密	7,309,353.34	0.75
3	000651	格力电器	7,063,729.10	0.72
4	600362	江西铜业	6,841,695.57	0.70
5	002410	广联达	6,230,930.00	0.64
6	601398	工商银行	6,179,686.50	0.63
7	601939	建设银行	5,851,774.00	0.60
8	601233	桐昆股份	5,596,471.00	0.57
9	601318	中国平安	5,571,791.52	0.57
10	600388	龙净环保	5,448,923.20	0.56
11	603707	健友股份	5,431,521.55	0.56
12	300188	美亚柏科	5,331,717.20	0.55
13	300133	华策影视	4,752,136.00	0.49
14	300369	绿盟科技	4,560,846.00	0.47
15	600486	扬农化工	4,434,574.62	0.45
16	002439	启明星辰	4,212,555.00	0.43
17	002174	游族网络	4,102,463.00	0.42
18	000063	中兴通讯	4,003,871.00	0.41
19	000100	TCL集团	3,987,380.00	0.41
20	603019	中科曙光	3,975,913.00	0.41

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例(%)
1	600362	江西铜业	11,472,868.40	1.17
2	002258	利尔化学	8,561,518.00	0.88
3	600584	长电科技	8,182,545.20	0.84
4	600176	中国巨石	7,744,270.56	0.79
5	000651	格力电器	7,428,641.00	0.76
6	600031	三一重工	7,172,203.00	0.73
7	002475	立讯精密	7,032,234.40	0.72
8	601636	旗滨集团	6,666,379.00	0.68
9	002493	荣盛石化	6,484,640.50	0.66
10	600585	海螺水泥	6,235,625.00	0.64
11	002648	卫星石化	6,153,762.06	0.63
12	002573	清新环境	5,540,198.00	0.57
13	600388	龙净环保	5,363,854.60	0.55
14	601939	建设银行	5,281,808.87	0.54
15	002019	亿帆医药	5,043,299.98	0.52
16	601398	工商银行	5,025,676.50	0.51
17	601318	中国平安	5,016,562.00	0.51
18	300133	华策影视	4,956,900.00	0.51
19	000968	蓝焰控股	4,876,707.00	0.50
20	601233	桐昆股份	4,809,666.00	0.49

7.4.3 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	210,032,568.31
卖出股票收入(成交)总额	220,876,370.61

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	60,000,000.00	6.87
	其中:政策性金融债	60,000,000.00	6.87
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	90,383,000.00	10.35
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	496,297,000.00	56.85
9	其他	-	-
10	合计	646,680,000.00	74.08

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	170308	17进出08	600,000	60,000,000.00	6.87
2	111713073	17浙商银行CD073	600,000	57,396,000.00	6.57
3	011800494	18平安租赁SCP004	500,000	50,185,000.00	5.75
4	111809181	18浦发银行CD181	500,000	49,520,000.00	5.67
5	111892995	18广州农村商业银行CD005	500,000	48,890,000.00	5.60

7.7 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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	149294	宁远02A1	300,000	29,925,000.00	3.43

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持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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,也无期间损益。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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本期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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	181,366.03
2	应收证券清算款	33,541.64
3	应收股利	-
4	应收利息	16,169,976.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,384,883.77

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 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。

§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

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
5,560	151,688.55	21,305,566.83	2.5262%	822,082,749.73	97.4738%

8.2 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	0.00%

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情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2014年09月26日)基金份额总额	464,708,417.18
本报告期期初基金份额总额	948,416,343.91
本报告期基金总申购份额	2,571,811.46
减:本报告期基金总赎回份额	107,599,838.81
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	843,388,316.56

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

基金管理人于2018年6月7日披露了《中信建投稳利保本混合型证券投资基金关于变更基金经理的公告》,基金经理颜灵珊女士于2018年6月5日离任。

报告期内无基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务,报告期内未发生变更。

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。

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	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	
长江证券	1	56,667,930.17	13.15%	41,441.37	15.19%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	163,060,023.40	37.84%	119,245.79	43.70%	-
中信建投证券	2	119,351,620.15	27.70%	63,411.45	23.24%	-
安信证券	3	91,829,365.20	21.31%	48,789.08	17.88%	-

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

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

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

(3)评估实行评分制,具体如下:

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

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

基础服务包括:报告、电话沟通、路演、联合调研服务等;

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

销售服务包括:日常沟通、重点推荐的沟通、研究投资工作的支持和配合。

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

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	809,693.71	82.94%	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	166,574.12	17.06%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	445,000,000.00	27.89%	-	-	-	-
安信证券	-	-	1,150,500,000.00	72.11%	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期内,未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2018年3月23日披露了《关于中信建投稳利保本混合型证券投资基金修改基金合同及托管协议的公告》、《中信建投稳利保本混合型证券投资基金基金合同》、《中信建投稳利保本混合型证券投资基金托管协议》;

基金管理人于2018年6月7日披露了《中信建投稳利保本混合型证券投资基金关于变更基金经理的公告》。

中信建投基金管理有限公司

二〇一八年八月二十八日