

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:2019年04月19日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员声明不存在虚假记载、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。
本基金托管人的法定代表人、托管部门负责人及从事基金托管业务的高级管理人员声明不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告告期中财务资料未经审计。

本报告告期1月1日至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中信建投稳健一年
基金主代码	000603
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年10月27日
报告期末基金份额总额	79,732,389,069份

投资目标 在严格控制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。

本基金将通过对宏观经济分析判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，通过深入研究和综合评估，把握市场机会，适时调整资产配置比例，并依据内部的投资评级系统，挖掘价值低估的标的品种。

本基金采取的资产配置策略包括但不限于债券类配置策略、久期策略、收益率曲线策略、信用策略、投资期限策略等，在消极投资的基础上，力图实现绝对收益增值。

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，属于中低风险收益的基金品种，其预期风险和预期收益水平低于货币基金，高于股票型基金及混合型基金。

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

报告送出日期:2019年04月19日

报告期告期中财务资料未经审计。

报告期告期1月1日至3月31日止。

中信建投稳健定期开放债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

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不公平交易的情况。

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运作分析

一季度遵循周期策略相对组合，对债券投资者情绪产生一定的负面影响，尤其是在2018年债市牛市之后的股价走势使债市观望情绪较浓，存在跨期的行为。信用方面，民企信用的信用利差仍处于高位，信用利差渗透的情况如下，高等级品种收益较其他品种下行明显。展望二季度，在基本面偏弱的格局下，股票牛市不会冲击债券市场。在地产下行周期中，社融M2增速很难真正意义上实现企稳回升，在未来很长一段时间内预计会看到这两个指标的持续下行。

叠加央行控制整体融资成本，债市仍有交易性机会。

为降低资金在雷铤风险爆发背景下的风险暴露，一季度运作期间本基金适当降低了国债质押券的头寸，努力为投资者争取安全的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投稳健一年A基金份额净值为1.0747元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为13.1%，同期业绩比较基准收益率为0.58%；截至报告期末中信建投稳健一年C基金份额净值为1.0508元，本报告期内，该类基金份额净值增长率率为1.22%，同期业绩比较基准收益率为0.58%。

4.6 报告期内持有人数持续二十二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 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	-	-
2	其中:股票	-	-
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	71,356,778,310	83.19
5	其中:债券	68,358,778,310	70.69
6	资产支持证券	3,000,000,000	35.60
7	贵金属投资	-	-
8	衍生工具投资	-	-
9	买入返售金融资产	10,000,000,000	11.66
10	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
11	银行存款和结算备付金合计	3,199,193,310	3.73
12	其他资产	1,223,732,460	1.43
13	合计	85,781,703,080	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通股票投资组合

无。

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

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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十名债券投资

无。

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组合

无。

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十名贵金属投资明细

无。

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十名权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

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	7,500,077
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,216,225,681
4	应收利息	5,009,500,000
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	1,223,732,460

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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，分项之和可能与合计项之间可能存在尾差。

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	113911	光大转债	2,412,730,000	2.23
2	113908	电气转债	1,585,324,000	1.35
3	113913	国科转债	1,420,320,000	1.16
4	128304	铁城转债	62,322,700	0.07

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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

序号	份额代码	份额名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	74,965,618,894	中信建投稳健一年A	74,965,618,894	4,763,771,12
2	74,965,618,894	中信建投稳健一年C	0.00	0.00
3	0.00	中信建投稳健一年A	0.00	0.00
4	0.00	中信建投稳健一年C	0.00	0.00

§ 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的变动情况

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情况

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.3 影响投资者决策的其他重要信息

§ 8 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

序号	持有人类别	持有人姓名或名称	期初份额(份)	期初份额占比(%)	申购份额(份)	赎回份额(份)	持有份额(份)	份额占比(%)
1	机构	20190101	30,000,000	30.00	30,000,000	-	30,000,000	30.00%
2	个人	20190103	30,000,000	30.00	30,000,000	-	30,000,000	30.00%
3	机构	20190104	30,000,000	30.00	30,000,000	-	30,000,000	30.00%

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予基金募集注册的文件；