

(上接B243版)

单位:人民币元

资产 本期末 2019年06月05日 上年度末 2018年12月31日

银行存款 828,678,077 266,044,440

结算备付金 312,338,361 1,180,865,936

存出保证金 8,095,92 5,798,97

交易性金融资产 17,441,430,70 96,661,170,950

其中:股票投资 - -

基金投资 - -

债券投资 15,437,630,70 86,661,170,950

资产支持证券投资 2,003,900,000 -

衍生金融资产 - -

买入返售金融资产 10,000,000,000 26,584,279,081

应收证券款 3,102,278,057 -

应收利息 446,791,21 1,568,954,31

应收股利 - -

应收申购款 - -

递延所得税资产 - -

其他资产 - -

资产总计 32,139,599,933 116,267,113,64

负债和所有者权益 本期末 2019年06月05日 上年度末 2018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 31,500,000,000 -

应付证券款 2,909,665,75 -

应付赎回款 - -

应付管理人报酬 2,903,01 50,130,40

应付托管费 800,86 14,322,9

应付技术服务费 194,95 1,677,40

应付交易费用 1,850,85 2,190,94

应付税费 8,719,34 44,477,55

应付利息 - -

应付利润 - -

应付股息 - -

应付红利 - -

应付优先股股息 - -

应付普通股股息 32,139,599,933 116,267,113,64

注:1、报告截止日2019年6月5日,基金总资产总额27,011,546,877元,其中A类基金份额净值为1.0794元,基金份额总额23,635,925,83;C类基金份额净值1.0645元,基金份额总额3,375,621,04。

2、本财务报表的实际编制期间为2019年1月1日至2019年6月5日(基金转型日前)。

6.2 利润表

会计主体:中信建投稳健定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2019年01月01日至2019年06月05日

单位:人民币元

项目 本期(2019年01月01日至2019年06月05日) 上年度可比期间(2018年01月01日至2018年06月30日)

一、收入 1,707,565,48 4,946,712,15

1.利息收入 1,432,62,638 3,835,92,58

其中:存款利息收入 34,423,33 62,14,21

债券利息收入 1,206,69,461 3,737,74,50

资产支持证券投资收入 19,962,51 -

买入返售金融资产收入 111,566,44 46,53,57

其他利息收入 - -

2.投资收益(损失以“-”填列) 712,35,967 -8,199,403,66

其中:股息红利收益 - -

基金投资收益 711,409,43 8,199,403,56

资产支持证券投资收益 95,02,5 -

贵金属投资收益 - -

衍生工具收益 - -

股权投资收益 - -

6.公司价值变动收益(损失以“-”号填列) -437,32,088 8,704,163,51

4.利息收入(损失以“-”号填列) - -

5.其他收入(损失以“-”号填列) 5,159,92 -

减:二、费用 489,21,490 1,206,166,64

1.管理人报酬 209,856,76 534,22,78

2.托管费 59,956,09 152,63,63

3.销售收入费 8,676,25 15,409,72

4.交易费用 1,189,11 3,674,42

5.利息支出 80,966,27 393,76,09

其中:卖出回购金融资产支出 90,996,27 393,76,09

6.税金及附加 3,27,312 10,23,67

7.其他费用 125,283,36 99,22,63

利得(损失):(亏损以“-”号填列) 1,218,443,52 3,137,665,51

6.其他收入(损失以“-”号填列) 5,159,92 -

减:二、费用 489,21,490 1,206,166,64

1.管理人报酬 209,856,76 534,22,78

2.托管费 59,956,09 152,63,63

3.销售收入费 8,676,25 15,409,72

4.交易费用 1,189,11 3,674,42

5.利息支出 80,966,27 393,76,09

其中:卖出回购金融资产支出 90,996,27 393,76,09

6.税金及附加 3,27,312 10,23,67

7.其他费用 125,283,36 99,22,63

利得(损失):(亏损以“-”号填列) 1,218,443,52 3,137,665,51

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中信建投稳健定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2019年01月01日至2019年06月05日

单位:人民币元

项目 本期(2019年01月01日至2019年06月05日) 上年度可比期间(2018年01月01日至2018年06月30日)

一、期初所有者权益(基金净值) 79,732,389,96 4,737,031,75

1.实收基金 - 1,218,443,52

其中:存款类基金 34,423,33 62,14,21

债券类基金 1,206,69,461 3,737,74,50

资产支持证券类基金 19,962,51 -

买入返售金融资产类基金 111,566,44 46,53,57

其他类基金 - -

2.未分配利润 - -

其中:存款类基金 34,423,33 62,14,21

债券类基金 1,206,69,461 3,737,74,50

资产支持证券类基金 19,962,51 -

买入返售金融资产类基金 111,566,44 46,53,57

其他类基金 - -

3.期初所有者权益(基金净值) 79,732,389,96 4,737,031,75

减:本期计提的基金净值减少额 -3,735,621,04

4.本期实现的净损益 -3,735,621,04

5.期末所有者权益(基金净值) 79,732,389,96 3,600,669,94

6.3.2 本期所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中信建投稳健定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2019年01月01日至2019年06月05日

单位:人民币元

项目 本期(2019年01月01日至2019年06月05日) 上年度可比期间(2018年01月01日至2018年06月30日)

一、期初所有者权益(基金净值) 79,732,389,96 4,737,031,75

1.实收基金 - 1,218,443,52

其中:存款类基金 34,423,33 62,14,21

债券类基金 1,206,69,461 3,737,74,50

资产支持证券类基金 19,962,51 -

买入返售金融资产类基金 111,566,44 46,53,57

其他类基金 - -

2.未分配利润 - -

其中:存款类基金 34,423,33 62,14,21

债券类基金 1,206,69,461 3,737,74,50

资产支持证券类基金 19,962,51 -

买入返售金融资产类基金 111,566,44 46,53,57

其他类基金 - -

3.期初所有者权益(基金净值) 79,732,389,96 4,737,031,75

减:本期计提的基金净值减少额 -3,735,621,04

4.本期实现的净损益 -3,735,621,04

5.期末所有者权益(基金净值) 79,732,389,96 3,600,669,94

6.3.3 本期所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中信建投稳健定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2019年01月01日至2019年06月05日

单位:人民币元

项目 本期(2019年01月01日至2019年06月05日) 上年度可比期间(2018年01月01日至2018年06月30日)

一、期初所有者权益(基金净值) 79,732,389,96 4,737,031,75

1.实收基金 - 1,218,443,52

其中:存款类基金 34,423,33 62,14,21

债券类基金 1,206,69,461 3,737,74,50

资产支持证券类基金 19,962,51 -

买入返售金融资产类基金 111,566,44 46,53,57

其他类基金 - -

2.未分配利润 - -

其中:存款类基金 34,423,33 62,14,21

债券类基金 1,206,69,461 3,737,74,50

资产支持证券类基金 19,962,51 -

买入返售金融资产类基金 111,566,44 46,53,57

其他类基金 - -

3.期初所有者权益(基金净值) 79,732,389,96 4,737,031,75

减:本期计提的基金净值减少额 -3,735,621,04

4.本期实现的净损益 -3,735,621,04

5.期末所有者权益(基金净值) 79,732,389,96 3,600,669,94

6.3.4 本期所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中信建投稳健定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2019年01月01日至2019年06月05日