中信建投稳利保本混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1月22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2016年1月20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10月1日起至12月31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	136,815,130.64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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	3,051,550.88
2.本期利润	5,374,548.40
3.加权平均基金份额本期利润	0.0376
4.期末基金资产净值	153,416,402.13
5.期末基金份额净值	1.121

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。

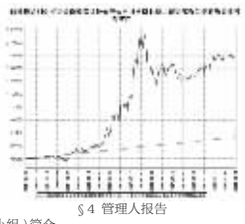
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	3.15%	0.42%	0.91%	0.01%	2.24%	0.41%

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年四季度,宏观经济增速依然未见反弹,没有了猪肉、蔬菜价格的支撑CPI呈现再度回落的态势,PPI依然通缩但幅度维持稳定。政策角度,经过前期的持续放松,四季度进入了政策的观察期,与此同时12月份美联储加息由预期成为了现实。

市场方面,债券市场依然延续三季度下行的方向和斜率,虽然11月初经历过一波反弹,但很快就再度下行,于12月份创出收益率新低并加速下行;股票市场经过三季度的探底、筑底以后,进入10月份出现了明显的反弹,一直延续到11月份,随后受到IPO重启、美联储加息及注册制改革推进等多重压制,最后一个月走出了一波高位震荡的行情。

操作方面,本基金在三季度整体低股票仓位的基础上,于三季度末小幅加仓,随后在10月份的反弹中获得了较好的收益,净值取得了不错增长,并一直保持一定股票仓位。

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1.121元,累计份额净值为1.221元,本报告期份额累计净值增长率为3.15%,同期业绩比较基准收益率为 0.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券市场受到经济增长低迷,货币政策主基调宽松的影响,整体来说还是有机会,但是从空间上来看,要有大幅下行还需要更多的刺激因素;而与此同时,由于上游行业的低迷一直持续,加上中央提出供给侧改革的措施,信用风险在快速上升,信用分化将会持续出现。因此产品的债券策略将以下游行业、中高等级的中短端债券和地方债、利率债等作为配置主体,其中利率债主要以中长端利率的波段操作为主。总体来说,债券主要是在控制信用风险的基础上,获得一定票息收益的作用。

股票市场来看,由于2016年经济整体的判断依然弱势,但是下有托底的弱势,政策方面托底与结构调整共同作用,货币政策依然宽松,财政政策可能有所加码。整体来看,流动性推动的市场依然有机会,但节奏上可能受到注册制、减持、汇率波动、美联储加息等影响,整体呈现震荡行情,主要寻找结构性机会。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期未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	20,842,728.00	13.44
	其中:股票	20,842,728.00	13.44
2	固定收益投资	113,827,881.10	73.42
	其中:债券	113,827,881.10	73.42
	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	14,000,221.00	9.03
	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	4,016,419.62	2.59
7	其他资产	2,349,106.63	1.52
8	合计	155,036,356.35	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	16,735,128.00	10.91
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	2,236,800.00	1.46
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	1,870,800.00	1.22
S	综合	-	-
	合计	20,842,728.00	13.59

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	600978	宜华木业	200,000	4,262,000.00	2.78
2	002446	盛路通信	100,000	3,710,000.00	2.42
3	300174	元力股份	109,954	3,518,528.00	2.29
4	603118	共进股份	60,000	2,823,000.00	1.84
5	002517	泰亚股份	40,000	2,421,600.00	1.58
6	600728	佳都科技	60,000	2,236,800.00	1.46
7	600136	道博股份	30,000	1,870,800.00	1.22

注:本基金本报告期末仅持有上述七只股票。

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	10,033,000.00	6.54
	其中:政策性金融债	10,033,000.00	6.54
4	企业债券	52,229,881.10	34.04
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	51,565,000.00	33.61
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	113,827,881.10	74.20

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	1382132	13宁通MTN1	100,000	10,552,000.00	6.88
2	101480003	14营口沿海MTN001	100,000	10,383,000.00	6.77
3	101461035	14中科集团MTN001	100,000	10,239,000.00	6.67
4	122227	13尖峰01	100,010	10,212,021.10	6.66
5	101453023	14中天MTN001	100,000	10,209,000.00	6.65

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	334,428.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,014,678.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,349,106.63

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	4,262,000.00	2.78	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	155,485,762.83
报告期期间基金总申购份额	2,338,709.49
减:报告期期间基金总赎回份额	21,009,341.68
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	136,815,130.64

§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10月27日发布了《中信建投稳利保本混合型证券投资基金第一次分红公告》,分红分案为1.00元/10份基金份额。

§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
2016年1月22日

中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1月22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2016年1月15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,投资者在做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10月1日起至12月31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10月1日 - 2015年12月31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	4,735,963.73	215,244.65
2. 本期利润	4,852,324.31	220,846.42
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0187	0.0175
4. 期末基金资产净值	279,509,010.57	13,491,635.18
5. 期末基金份额净值	1.077	1.068

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

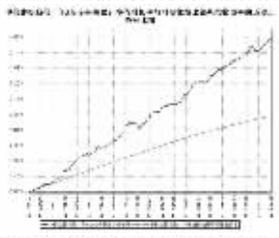
中信建投稳信一年A

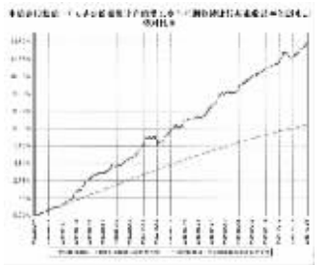
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.06%	0.65%	0.01%	1.15%	0.05%

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	1.71%	0.07%	0.65%	0.01%	1.06%	0.06%

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	2015年12月29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、中信建投添鑫宝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年四季度,经济增速仍未见底。通胀增速保持历史中位数以下,原油等资源品的跌价加剧了PPI的跌幅。

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。

四季度,债券市场继续牛市行情。

本基金在四季度,通过一级申购转债、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1.077元,本报告期份额净值增长率为1.80%;C类基金份额净值为1.068元,本报告期份额净值增长率为1.71%;同期业绩比较基准收益率为0.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望一季度,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汇率波动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

本基金本报告期未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	221,579,319.80	75.55
	其中:债券	221,579,319.80	75.55
	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	67,000,540.50	22.84
	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	727,803.61	0.25
7	其他资产	3,984,300.72	1.36
8	合计	293,291,964.63	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注: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

注: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	98,999,319.80	33.79
5	企业短期融资券	40,248,000.00	13.74
6	中期票据	82,076,000.00	28.01
7	可转债	256,000.00	0.09
8	其他	-	-
9	合计	221,579,319.80	75.62

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	101559008	15太阳MTN001	200,000	20,770,000.00	7.09
2	101567001	15西王MTN001	200,000	20,692,000.00	7.06
3	112272	15金科01	201,050	20,486,995.00	6.99
4	101554012	15心连心MTN001	200,000	20,414,000.00	6.97
5	101567003	15玉皇化工MTN001	200,000	20,200,000.00	6.89
5	122494	15华夏05	200,000	20,200,000.00	6.89

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

注:本基金本报告期未投资国债期货。

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	4,688.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,979,612.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,984,300.72

5.10.4 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	123001	蓝标转债	256,000.00	0.09

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期未投资股票。

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

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12月31日发布了《中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金关于变更基金经理的公告》。

§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
2016年1月22日

英大现金宝

【2015】第四季度报告

基金管理人:英大基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2016年01月22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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	英大现金宝
基金主代码	000912
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月10日
报告期末基金份额总额	733,186,126.71
投资目标	本基金投资于固定收益类资产,在有效控制投资组合风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益,追求长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金投资策略将结合现金需求安排和货币市场利率预测,在保证基金资产安全性和流动性的基础上,获取较高的收益。
业绩比较基准	同期7天通知存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。
基金管理人	英大基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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10月01日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	1,815,701.78
2.本期利润	1,815,701.78
3.期末基金资产净值	733,186,126.71

注:①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。

②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。

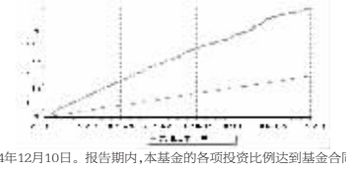
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

主要财务指标	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7675%	0.0137%	0.3403%	0.0000%	0.4272%	0.0137%

注:本基金成立于2014年12月10日,业绩比较基准是同期七天通知存款利率(税后)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金成立于2014年12月10日。报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§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		
张琳娜	本基金基金经理	2014年12月10日		9	对外经济贸易大学金融学硕士,9年基金从业经历。先后任益民基金管理有限公司集中交易部交易员、副总经理等职务。2012年3月加入英大基金管理有限公司,曾任公司交易管理部副总经理(主持工作),现任固定收益部副总经理。

注:注:①任职日期说明:首位基金经理的任职日期为基金合同生效的日期,继任基金经理的任职日期为该基金经理经监管机构审核通过后公司公开披露的日期。

②证券从业年限的计算标准: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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《英大现金宝货币市场基金基金合同》、《英大现金宝货币市场基金招募说明书》的约定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生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

报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定,从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关,通过公司新上线的公平交易系统监测和人工复核等方式在各个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,本基金不存在参与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%的情况,且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年四季度债市收益率震荡下行,十年国债季度末比季度初下行40BP,一年期存款利率下调25BP至1.50%,存款准备金率下调50基点。美联储于2015年12月正式步入加息通道,人民币贬值加速,因IPO重启叠加年末,资金价格稍有走高,但幅度较小。

本基金在四季度继续增持短融,并小幅调整了债券持仓,通过存款和逆回购的组合控制流动性风险,组合收益较为稳定。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金本报告期的份额净值收益率为0.7675%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

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,本基金未出现连续二十个工作日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