

中信建投稳惠债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:中信建投基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月26日

重要提示

基金管理人及董事承诺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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金资产不受损失。

基金的投资组合报告不承诺未来业绩表现,投资者应自行承担投资风险,投资者在做出投资决策前请仔细阅读基金的投资组合报告。

基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 中国建投稳惠. Includes details on fund code, launch date, and investment objectives.

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金资产不受损失。

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期(2017年07月01日至2017年09月30日).

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(不含公允价值变动损益)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。

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。

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

Table showing performance metrics for the fund compared to its benchmark over the last three months.

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



3.3其他指标

1、本基金合同于2017年3月3日生效,基金合同生效起至报告期末未滿一年。

2、根据本基金基金合同的约定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。

基金管理人

姓名 职务 任本基金的基金经理任期 证券从业年限 说明

许巍 基金经理 2017-03-03 3 0年 中国籍,1980年11月生,中国人民大学工学硕士,曾任招商基金研究员,现任招商基金基金经理。

许巍先生2011年参加工作,先后在非证券金融机构中国诚信集团公司、中信银行股份

中信建投稳惠C净值表现

Table with 6 columns: 阶段 (Period), 净值增长率 (Net Value Growth Rate), 业绩比较基准 (Benchmark), etc.

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



3.3其他指标

1、本基金合同于2017年3月3日生效,基金合同生效起至报告期末未滿一年。

2、根据本基金基金合同的约定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。

基金管理人

姓名 职务 任本基金的基金经理任期 证券从业年限 说明

许巍 基金经理 2017-03-03 3 0年 中国籍,1980年11月生,中国人民大学工学硕士,曾任招商基金研究员,现任招商基金基金经理。

许巍先生2011年参加工作,先后在非证券金融机构中国诚信集团公司、中信银行股份

中信建投稳利保本2号混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

市场方面,受到三季度地方债发行量较大,财政存款拉动影响,资金面紧张时间持续较长,加上对经济复苏的担忧,债券利率7月初触底后上行,9月中旬随着央行的投放,以及资金面宽松,银行体系流动性相对宽松,债券利率率先震荡。

操作方面,我们适当拉长久期以期增厚收益,同时加强股票仓位的操作。三季度债券收益率较二季度完成建仓,辅以短期杠杆进行套利。

截至报告期末,本基金资产净值为1.049元,本报告期净值增长率为0.87%,同期业绩比较基准收益率为0.51%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内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。

基金管理人

姓名 职务 任本基金的基金经理任期 证券从业年限 说明

王浩 基金经理 2015-11-11 3 年 中国籍,1980年2月生,中国人民大学金融学硕士,曾任招商基金研究员,现任招商基金基金经理。

王浩先生2011年参加工作,先后在非证券金融机构中国诚信集团公司、中信银行股份

中信建投稳利保本混合型基金

2017年第三季度报告

市场方面,受到三季度地方债发行量较大,财政存款拉动影响,资金面紧张时间持续较长,加上对经济复苏的担忧,债券利率7月初触底后上行,9月中旬随着央行的投放,以及资金面宽松,银行体系流动性相对宽松,债券利率率先震荡。

操作方面,我们适当拉长久期以期增厚收益,同时加强股票仓位的操作。三季度债券收益率较二季度完成建仓,辅以短期杠杆进行套利。

截至报告期末,本基金资产净值为1.0184元,本报告期净值增长率为0.83%,同期业绩比较基准收益率为0.48%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内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。

基金管理人

姓名 职务 任本基金的基金经理任期 证券从业年限 说明

王浩 基金经理 2015-11-11 3 年 中国籍,1980年2月生,中国人民大学金融学硕士,曾任招商基金研究员,现任招商基金基金经理。

王浩先生2011年参加工作,先后在非证券金融机构中国诚信集团公司、中信银行股份

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额(元) (Amount in Yuan).

5.1.1.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 代码 (Code), 名称 (Name), 公允价值 (Fair Value), 公允价值占净值比例 (Fair Value as % of Net Value).

5.1.1.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

5.1.1.6 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。

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 报告期初基金份额总额 (Report Start Total Shares), 报告期末基金份额总额 (Report End Total Shares).

5.7 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。

8.1 报告期内基金决策的其他重要信息

8.1 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

Table with 2 columns: 投资者类别 (Investor Category), 持有基金份额占净值比例 (Shareholding as % of Net Value).

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

6.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.10.1 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。

6.10.2 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。

6.10.3 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。

6.11 投资组合报告附注

5.1.1.1 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。

5.1.1.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

5.1.1.3 其他资产构成

5.1.0.3 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。

5.1.1 投资组合报告附注

5.1.1.1 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。

5.1.1.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

5.1.1.3 其他资产构成

5.1.1.4 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。

5.1.1.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

5.1.1.6 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。

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 报告期初基金份额总额 (Report Start Total Shares), 报告期末基金份额总额 (Report End Total Shares).

5.7 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。

8.1 报告期内基金决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,无影响投资者决策的其他重要信息。

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2号混合型证券投资基金合同》;

3、《中信建投稳利保本2号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。

基金管理人、基金托管人办公场所。

9.1 查询方式

投资者可以在营业时间内免费查询,也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司 二〇一七年十月二十六日

中信建投稳利保本2号混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

市场方面,受到三季度地方债发行量较大,财政存款拉动影响,资金面紧张时间持续较长,加上对经济复苏的担忧,债券利率7月初触底后上行,9月中旬随着央行的投放,以及资金面宽松,银行体系流动性相对宽松,债券利率率先震荡。

操作方面,我们适当拉长久期以期增厚收益,同时加强股票仓位的操作。三季度债券收益率较二季度完成建仓,辅以短期杠杆进行套利。

截至报告期末,本基金资产净值为1.049元,本报告期净值增长率为0.87%,同期业绩比较基准收益率为0.51%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内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。

基金管理人

姓名 职务 任本基金的基金经理任期 证券从业年限 说明

王浩 基金经理 2015-11-11 3 年 中国籍,1980年2月生,中国人民大学金融学硕士,曾任招商基金研究员,现任招商基金基金经理。

王浩先生2011年参加工作,先后在非证券金融机构中国诚信集团公司、中信银行股份

中信建投稳利保本混合型基金

2017年第三季度报告

市场方面,受到三季度地方债发行量较大,财政存款拉动影响,资金面紧张时间持续较长,加上对经济复苏的担忧,债券利率7月初触底后上行,9月中旬随着央行的投放,以及资金面宽松,银行体系流动性相对宽松,债券利率率先震荡。

操作方面,我们适当拉长久期以期增厚收益,同时加强股票仓位的操作。三季度债券收益率较二季度完成建仓,辅以短期杠杆进行套利。

截至报告期末,本基金资产净值为1.0184元,本报告期净值增长率为0.83%,同期业绩比较基准收益率为0.48%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内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。

基金管理人

姓名 职务 任本基金的基金经理任期 证券从业年限 说明

王浩 基金经理 2015-11-11 3 年 中国籍,1980年2月生,中国人民大学金融学硕士,曾任招商基金研究员,现任招商基金基金经理。

王浩先生2011年参加工作,先后在非证券金融机构中国诚信集团公司、中信银行股份

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:2017年10月26日

重要提示

基金管理人及董事承诺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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金资产不受损失。

基金的投资组合报告不承诺未来业绩表现,投资者应自行承担投资风险,投资者在做出投资决策前请仔细阅读基金的投资组合报告。

基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 中信建投稳利保本. Includes details on fund code, launch date, and investment objectives.

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金资产不受损失。

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期(2017年07月01日至2017年09月30日).

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(不含公允价值变动损益)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。

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。

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

Table showing performance metrics for the fund compared to its benchmark over the last three months.

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



3.3其他指标

1、本基金合同于2017年8月11日生效,基金合同生效起至报告期末未滿一年。

2、根据本基金基金合同的约定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。

基金管理人

姓名 职务 任本基金的基金经理任期 证券从业年限 说明

王浩 基金经理 2015-11-11 3 年 中国籍,1980年2月生,中国人民大学金融学硕士,曾任招商基金研究员,现任招商基金基金经理。

王浩先生2011年参加工作,先后在非证券金融机构中国诚信集团公司、中信银行股份

中信建投稳利保本混合型基金

2017年第三季度报告

市场方面,受到三季度地方债发行量较大,财政存款拉动影响,资金面紧张时间持续较长,加上对经济复苏的担忧,债券利率7月初触底后上行,9月中旬随着央行的投放,以及资金面宽松,银行体系流动性相对宽松,债券利率率先震荡。

操作方面,我们适当拉长久期以期增厚收益,同时加强股票仓位的操作。三季度债券收益率较二季度完成建仓,辅以短期杠杆进行套利。

截至报告期末,本基金资产净值为1.0184元,本报告期净值增长率为0.83%,同期业绩比较基准收益率为0.48%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内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。

基金管理人

姓名 职务 任本基金的基金经理任期 证券从业年限 说明

王浩 基金经理 2015-11-11 3 年 中国籍,1980年2月生,中国人民大学金融学硕士,曾任招商基金研究员,现任招商基金基金经理。

王浩先生2011年参加工作,先后在非证券金融机构中国诚信集团公司、中信银行股份

中信建投稳利保本混合型基金

2017年第三季度报告

市场方面,受到三季度地方债发行量较大,财政存款拉动影响,资金面紧张时间持续较长,加上对经济复苏的担忧,债券利率7月初触底后上行,9月中旬随着央行的投放,以及资金面宽松,银行体系流动性相对宽松,债券利率率先震荡。

操作方面,我们适当拉长久期以期增厚收益,同时加强股票仓位的操作。三季度债券收益率较二季度完成建仓,辅以短期杠杆进行套利。

截至报告期末,本基金资产净值为1.0184元,本报告期净值增长率为0.83%,同期业绩比较基准收益率为0.48%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内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。

基金管理人

姓名 职务 任本基金的基金经理任期 证券从业年限 说明

王浩 基金经理 2015-11-11 3 年 中国籍,1980年2月生,中国人民大学金融学硕士,曾任招商基金研究员,现任招商基金基金经理。

王浩先生2011年参加工作,先后在非证券金融机构中国诚信集团公司、中信银行股份

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:2017年10月26日

重要提示

基金管理人及董事承诺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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金资产不受损失。

基金的投资组合报告不承诺未来业绩表现,投资者应自行承担投资风险,投资者在做出投资决策前请仔细阅读基金的投资组合报告。

基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 中信建投稳利保本. Includes details on fund code, launch date, and investment objectives.

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金资产不受损失。

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期(2017年07月01日至2017年09月30日).

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(不含公允价值变动损益)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。

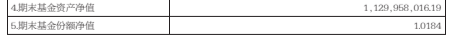
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

Table showing performance metrics for the fund compared to its benchmark over the last three months.

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



3.3其他指标

1、本基金合同于2017年8月11日生效,基金合同生效起至报告期末未滿一年。

2、根据本基金基金合同的约定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。

基金管理人

姓名 职务 任本基金的基金经理任期 证券从业年限 说明

王浩 基金经理 2015-11-11 3 年 中国籍,1980年2月生,中国人民大学金融学硕士,曾任招商基金研究员,现任招商基金基金经理。

王浩先生2011年参加工作,先后在非证券金融机构中国诚信集团公司、中信银行股份

中信建投稳利保本混合型基金

2017年第三季度报告

市场方面,受到三季度地方债发行量较大,财政存款拉动影响,资金面紧张时间持续较长,加上对经济复苏的担忧,债券利率7月初触底后上行,9月中旬随着央行的投放,以及资金面宽松,银行体系流动性相对宽松,债券利率率先震荡。

操作方面,我们适当拉长久期以期增厚收益,同时加强股票仓位的操作。三季度债券收益率较二季度完成建仓,辅以短期杠杆进行套利。