中信建投稳裕定期开放债券型证券投资基金 2019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:上海浦东发展银行股份有限公司
送出日期:2019年08月26日

§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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月22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。

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2019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

基金名称	中信建投稳裕定期开放债券型证券投资基金
基金简称	中信建投稳裕
基金主代码	003573
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月07日
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
报告期末基金份额总额	1,180,963,315.98份
基金合同存续期	不定期

注:基金管理人于2019年6月18日披露了《关于中信建投稳裕定期开放债券型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同的公告》,截至本报告期末,尚无首笔C类基金份额(基金代码:007552)。

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳定增值。
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	中债综合指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张乐久	胡波
	联系电话	010-57760122	021-61618888
	电子邮箱	zhanglj@csc.com.cn	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		4009-108-108	95528
传真		010-59100298	021-63602540

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	基金管理人及基金托管人住所

§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(2019年01月01日－2019年06月30日)
本期已实现收益	28,501,873.79
本期利润	20,775,927.32
加权平均基金份额本期利润	0.0128
本期基金份额净值增长率	1.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0129
期末基金资产净值	1,255,581,428.15
期末基金份额净值	1.0632

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)。

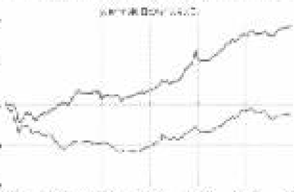
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.47%	0.03%	0.28%	0.03%	0.19%	0.00%
过去三个月	0.79%	0.05%	-0.24%	0.06%	1.03%	-0.01%
过去六个月	1.48%	0.05%	0.24%	0.06%	1.24%	-0.01%
过去一年	5.74%	0.09%	2.82%	0.06%	2.92%	0.03%
自基金合同生效起至今	9.86%	0.09%	-0.99%	0.08%	10.85%	0.01%

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(以下简称公司)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。

公司成立以来积极拓展业务,根据中国证券投资基金业协会数据,公司专户管理资产月均规模连续4年位列前20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。公司机构客户资源丰富,客户类别多,涵盖商业银行、证券公司、信托公司、财务公司、私募基金等客户类别。积极进行产品创新,响应十九大"金融服务实体经济"的号召,以金融产品支持直接融资,促进国企改革;响应"调结构、降杠杆"的号召,成立产业基金,包含基础设施、环境治理等关系国计民生的重大项目。

2018年度,公司荣获深圳证券交易所"优秀债券投资交易机构"的荣誉称号,荣获证券日报社"公募基金20年·金算盘最佳新锐管理人奖"奖项,荣获北京市怀柔区"2018年度经济发展突出贡献奖"奖项。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:任职日期	任本基金的基金经理(助理)期限:离任日期	证券从业年限	说明
许健	本基金的基金经理	2017-02-22	-	2年	中国籍,1987年1月生,中央财经大学统计学硕士。曾任中国邮政集团公司投资主办、中信银行股份有限公司固定收益投资经理。2016年12月加入中信建投基金管理有限公司,现任本公司投资部-固收投资部基金经理,担任中信建投稳裕定期开放债券型证券投资基金、中信建投稳福定期开放债券型证券投资基金、中信建投稳祥债券型证券投资基金基金经理。

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。许健先生2011年参加工作,先后在非证券金融机构中国邮政集团公司、中信银行股份有限公司从事投资工作,2016年12月加入本公司,2017年2月22日任本基金基金经理。

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

2019年上半年债券市场波动较大,总体来看,票息贡献高于久期贡献,信用债优于利率债。一季度极度悲观的经济预期和资金面宽松推动利率快速下行,二季度金融经济数据改善,悲观预期调整,风险偏好回升,利率出现超过40bp大幅调整;5月以后贸易战冲突升温,风险偏好回落,同时经济数据下行,利率出现回落;6月某银行托管事件后,中小银行融资难度较大,逐步传导至非银机构,影响导致中低评级信用债出现调整,长端利率小幅震荡,中短端信用债受益于资金面宽松表现较好。

本基金上半年通过准确预判国内外宏观经济形势,精确把握央行货币政策,控制产品仓位和久期,依据行业景气状况和研判优质企业个体,重视中高等级债券的票息收益,精确把握利率债波段交易,为持有人创造良好的收益。

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裕基金份额净值为1.0632元,本报告期内,基金份额净值增长率为1.48%,同期业绩比较基准收益率为0.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019年下半年宏观经济处于温和下滑的状态,但是考虑到社融增速相比去年有所改善,经济并没有失速的风险。因此,下半年债券市场预计仍是大幅震荡行情。一方面,发达国家经济增速下行、全球央行陆续进入降息区间、外部局势扰动不确定性较强,利率趋势仍然处于下行通道。但是在政策逆周期调控、通胀预期升温等潜在因素影响下,利率波动可能较大。整体来看票息优势仍然相对较强,把握交易性机会也会有不错的收益空间,同时在金融去杠杆的环境下仍需注意信用风险和流动性冲击的潜在影响。

本基金下半年债市投资仍然坚持票息杠杆策略为主,把握利率交易性机会。同时注意预防流动性风险,注意识别金融去杠杆被波及的信用债主体,对中低等级民企和部分城投仍然保持谨慎。争取为基金持有人带来可持续的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定,本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度,明确基金估值的程序和技术;建立了估值委员会,由公司分管运营领导任估值委员会主任,委员包括督察长、投资部、研究部、特定资产管理部、稽控合规部、运营管理部的部门负责人。本基金管理人使用可靠的估值业务系统,估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术,导致基金资产净值的变化在0.25%以上的,对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值价格的最终决策和执行。

本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议,由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据,由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《中信建投稳裕定期开放债券型证券投资基金基金合同》约定,本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。本基金管理人于2019年5月7日发布分红公告,向截至2019年5月9日止本基金登记注册的份额持有人,按每10份基金份额分配红利人民币0.3500元,实际分配收益金额为人民币41,333,605.68元。

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

本报告期内,上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"本托管人")在对中信建投稳裕定期开放债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全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

本报告期内,本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对中信建投稳裕定期开放债券型证券投资基金的投资运作进行了监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金报告期内进行了一次利润分配,分配金额为41,333,605.68元。

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

本报告期内,由中信建投基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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:中信建投稳裕定期开放债券型证券投资基金
报告截止日:2019年06月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:		
银行存款	51,083,422.72	41,974,417.52
结算备付金	18,508,587.38	6,746,291.43
存出保证金	125,059.91	48,054.82
交易性金融资产	1,524,058,790.11	986,158,633.70
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,524,058,790.11	986,158,633.70
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	70,083,305.12	664,442,436.67
应收证券清算款	35,000,000.00	-
应收利息	30,782,502.83	21,477,078.63
应收股利	-	-
应收申购款	-	111,162.14
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,729,641,668.07	1,720,958,074.91
负债和所有者权益	本期末 2019年06月30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	407,999,743.50	-
应付证券清算款	65,000,033.60	1,030,286.60
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	308,668.30	346,767.65
应付托管费	82,311.56	81,629.04
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	26,185.67	14,329.21
应交税费	237,799.28	76,998.72
应付利息	310,749.23	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	94,748.78	160,000.00
负债合计	474,060,239.92	1,710,011.22
所有者权益:		
实收基金	1,180,963,315.98	1,588,243,953.07
未分配利润	74,618,112.17	131,004,110.62
所有者权益合计	1,255,581,428.15	1,719,248,063.69
负债和所有者权益总计	1,729,641,668.07	1,720,958,074.91

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.0632元,基金份额总额1,180,963,315.98份。

6.2 利润表

会计主体:中信建投稳裕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30日

单位:人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入	28,495,124.88	3,535,273.92
1.利息收入	37,477,028.27	2,318,111.04
其中:存款利息收入	821,561.03	72,273.67
债券利息收入	35,992,080.85	2,192,219.29
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	663,386.39	53,618.08
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-1,255,963.12	10,843.96
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,255,963.12	10,843.96
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	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-7,725,946.47	1,206,318.92
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.20	-
减:二、费用	7,719,197.56	736,928.13
1. 管理人报酬	2,612,550.38	197,898.47
2. 托管费	696,680.13	39,579.67
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	51,353.82	2,700.66
5. 利息支出	4,148,685.36	393,144.38
其中:卖出回购金融资产支出	4,148,685.36	393,144.38
6. 税金及附加	52,333.93	3,215.76
7. 其他费用	157,593.94	100,389.19
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	20,775,927.32	2,798,345.79
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	20,775,927.32	2,798,345.79

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中信建投稳裕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30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019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)	1,588,243,953.07	131,004,110.62	1,719,248,063.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,775,927.32	20,775,927.32
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)	-407,280,637.09	-35,828,320.09	-443,108,957.18
其中:1.基金申购款	277,336,348.62	23,425,604.58	300,761,953.20
2.基金赎回款	-684,616,985.71	-59,253,924.67	-743,870,910.38
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)	-	-41,333,605.68	-41,333,605.68
五、期末所有者权益(基金净值)	1,180,963,315.98	74,618,112.17	1,255,581,428.15
项目	上年度可比期间 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)	124,591,174.22	1,250,649.00	125,841,823.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,798,345.79	2,798,345.79
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)	-39,794,505.62	-747,273.25	-40,541,778.87
其中:1.基金申购款	20,313.73	570.50	20,884.23
2.基金赎回款	-39,814,819.35	-747,843.75	-40,562,663.10
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)	84,796,668.60	3,301,721.54	88,098,390.14

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

中信建投稳裕定期开放债券型证券投资基金(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[2016]第2326号《关于准予中信建投稳裕定期开放债券型证券投资基金注册的批复》的核准,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《中信建投稳裕定期开放债券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,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证出具普华永道中天验字(2016)第1322号验资报告。经向中国证监会备案,《中信建投稳裕定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2016年11月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,050,383,419.33份基金份额,其中认购资金利息折合22.01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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《关于中信建投稳裕定期开放债券型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同的公告》,自2019年6月18日起,本基金增加C类基金份额类别,本基金的原有基金份额全部自动划归为本基金A类基金份额。增加基金份额类别后,本基金分设A类、C类两类基金份额,两类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。本基金根据申购费、销售服务费等收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。其中:在投资者申购时收取申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为A类基金份额。从本类别基金资产中计提销售服务费而在投资者申购时不收取申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为C类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投稳裕定期开放债券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,包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不主动投资股票和权证等权益类金融工具,因持有可转换债券转股所得的股票、因所持股票派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证,应当在其可上市交易之日起10个交易日内卖出。基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%。但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每次开放期前10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内,基金投资不受上述比例限制。开放期内,本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合指数。

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》、《中信建投稳裕定期开放债券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2019年半年度的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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019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 重要会计政策和会计估计

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为2019年1月1日至2019年6月30日。

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、资产支持证券投资和衍生工具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变动计入当期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款和其他各类应付款项等。

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、资产支持证券投资和衍生工具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日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,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及由基金管理人缴纳的增值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,并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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和托管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

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、债券投资和资产支持证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债金融估值中心有限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[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》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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

本报告期与本基金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
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
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
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
元达信资本管理(北京)有限公司	基金管理人的子公司

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

无。

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日:成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日:成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	1,098,336,701.89	72.59%	173,826,624.91	100.00%

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 2019年01月01日至2019年06月30日:成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日: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	10,905,900,000.00	84.06%	1,431,100,000.00	100.00%

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,612,550.38	197,898.47
其中:支付销售机构的客户维护费	163,075.79	3,953.63

注:支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提,逐日累计至每月月底,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×0.30%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	696,680.13	39,579.67

注:支付基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.08%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费＝前一日基金资产净值×0.08%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给中信建投基金管理有限公司,再由中信建投基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。C类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.40%。其计算公式为:

日销售服务费＝前一日C类基金资产净值×0.40%/当年天数。

2、本基金本报告期无应支付关联方的销售服务费。

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

单位:人民币元

本期 2019年01月01日至2019年06月30日

银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额:基金买入	债券交易金额:基金卖出	基金逆回购:交易金额	基金逆回购:利息收入	基金正回购:交易金额	基金正回购:利息支出
上海浦东发展银行股份有限公司	-	30,898,893.29	-	-	-	-

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2019年06月30日:持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	上年度末 2018年12月31日:持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
元达信资本管理(北京)有限公司	14,862,267.14	1.2585%	14,862,267.14	0.9358%

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 2019年01月01日至2019年06月30日:期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日:期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	51,083,422.72	712,868.96	309,754.39	61,802.85

注:本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管,按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

无。

6.4.9 期末(2019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

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
111912026	19北京银行CD026	2019-07-02	97.02	1,000,000	97,020,000.00
合计				1,000,000	97,020,000.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额317,000,000.00,于2019年7月1日、2019年7月2日(先后)到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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2019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二层次的余额为1,524,058,790.11元,无属于第一或第三层次的余额(2018年12月31日:第二层次的余额为986,158,633.70元,无属于第一或第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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2019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(2018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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,524,058,790.11	88.11
	其中:债券	1,524,058,790.11	88.11
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	70,083,305.12	4.05
	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	69,592,010.10	4.02
8	其他各项资产	65,907,562.74	3.81
9	合计	1,729,641,668.07	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

无余额。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

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

无余额。

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

无。

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

无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

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	51,985,000.00	4.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	340,344,990.11	27.11
	其中:政策性金融债	238,132,990.11	18.97
4	企业债券	677,104,800.00	53.93
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	357,604,000.00	28.48
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	97,020,000.00	7.73
9	其他	-	-
10	合计	1,524,058,790.11	121.38

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	111912026	19北京银行CD026	1,000,000	97,020,000.00	7.73
2	108602	国开1704	600,000	60,606,000.00	4.83
3	018007	国开1801	600,000	60,522,000.00	4.82
4	018082	农发1902	600,000	60,048,000.00	4.78
5	108604	国开1805	562,983	56,956,990.11	4.54

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

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

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

本基金通过对基本面和资金面的分析,对国债市场走势做出判断,以作为确定国债期货的头寸方向和额度的依据。当中长期经济高速增长,通货膨胀压力浮现,央行政策趋于紧缩时,本基金建立国债期货空单进行套期保值,以规避利率风险,减少利率上升带来的亏损;反之,在经济增长趋于回落,通货膨胀率下降,甚至通货紧缩出现时,本基金通过建立国债期货多单,以获取更高的收益。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无余额。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

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	125,059.91
2	应收证券清算款	35,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	30,782,502.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,907,562.74

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

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	机构投资者:持有份额	机构投资者:占总份额比例	个人投资者:持有份额	个人投资者:占总份额比例
239	4,941,269.10	1,180,355,205.23	99.9485%	608,110.75	0.0515%

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	10,764.50	0.0009%

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2016年11月07日)基金份额总额	1,050,383,419.33
本报告期期初基金份额总额	1,588,243,953.07
本报告期基金总申购份额	277,336,348.62
减:本报告期基金总赎回份额	684,616,985.71
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,180,963,315.98

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

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

2019年1月25日,邱黎强同志正式履行基金管理人总经理职务,蒋月勤董事长不再代行总经理职务。

2019年3月20日,邱黎强同志兼任元达信资本管理(北京)有限公司执行董事,任期三年,李聚合同志不再兼任元达信资本管理(北京)有限公司执行董事。

本报告期内,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

本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内,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

本报告期内,无基金管理人、托管人及其高级管理人员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:成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金:佣金	占当期佣金总量的比例	备注
方正证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-

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:成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易:成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易:成交金额	占当期权证成交总额的比例	基金交易:成交金额	占当期基金成交总额的比例
方正证券	414,835,427.31	27.41%	2,067,315,000.00	15.94%	-	-	-	-
中信建投证券	1,098,336,701.89	72.59%	10,905,900,000.00	84.06%	-	-	-	-

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部、研究部、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)投资部、研究部按照《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,由投资部、研究部负责人和研究员共同打分;

销售服务占10%权重,由投资部、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。

§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

投资者类别	序号	报告期内持有基金份额变化情况:持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	报告期末持有基金情况:持有份额	份额占比
机构	1	20190101-20190106 20190410-20190508	360,270,355.93	-	360,270,355.93	0.00	0.00%
机构	2	20190101-20190630	377,133,603.95	-	0.00	377,133,603.95	31.9344%
机构	3	20190101-20190630	742,251,809.24	-	0.00	742,251,809.24	62.8514%

产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,有可能对基金净值产生一定的影响,甚至可能引发基金的流动性风险。

11.2 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。

中信建投基金管理有限公司
二〇一九年八月二十六日