

中信建投稳利保本混合型证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

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

送出日期：2017 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 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。

本报告中财务资料经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
8.6 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.....	47
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47

8.8 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	47
8.9 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	47
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
8.12 投资组合报告附注	48
§9 基金份额持有人信息	49
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
9.3 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的情况	49
§10 开放式基金份额变动	49
§11 重大事件揭示	50
11.1 基金份额持有人大会决议	50
11.2 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	50
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
11.4 基金投资策略的改变	50
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
11.8 其他重大事件	52
§12 影响投资者决策的其他重要信息	59
§13 备查文件目录	59
13.1 备查文件目录	59
13.2 存放地点	60
13.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投稳利保本混合型证券投资基金
基金简称	中信建投稳利保本
基金主代码	000804
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
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
报告期末基金份额总额	1, 202, 416, 079. 86 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

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	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周建萍	刘晔
	联系电话	010-59100288	010-66223586
	电子邮箱	zhoujp@cfund108.com	liuyel@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		4009-108-108	95526
传真		010-59100298	010-66225039
注册地址		北京市怀柔区桥梓镇八龙桥	北京市西城区金融大街甲 17 号

	雅苑 3 号楼 1 室	首层
办公地址	北京市东城区朝内大街 2 号 凯恒中心 B 座 17、19 层	北京市西城区金融大街甲 17 号
邮政编码	100010	100033
法定代表人	蒋月勤	闫冰竹

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街 2 号凯恒中心 B 座 17、19 层
基金保证人	深圳市高新投集团有限公司	深圳市深南大道 7028 号时代科技大厦 22 层、23 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2016 年	2015 年	2014 年 9 月 26 日（基金合同生效日）-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	7,016,924.63	58,077,768.09	3,726,378.21
本期利润	-1,943,793.69	61,729,405.81	2,305,950.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0050	0.2671	0.0052
本期加权平均净值利润率	-0.49%	23.93%	0.52%
本期基金份额净值增长率	1.41%	21.63%	0.50%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	-3,981,459.07	16,601,271.49	1,985,063.96
期末可供分配基金份额利润	-0.0033	0.1213	0.0052
期末基金资产净值	1,198,434,620.79	153,416,402.13	381,660,065.98
期末基金份额净值	0.997	1.121	1.005
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末

基金份额累计净值增长率	23.96%	22.24%	0.50%
-------------	--------	--------	-------

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。

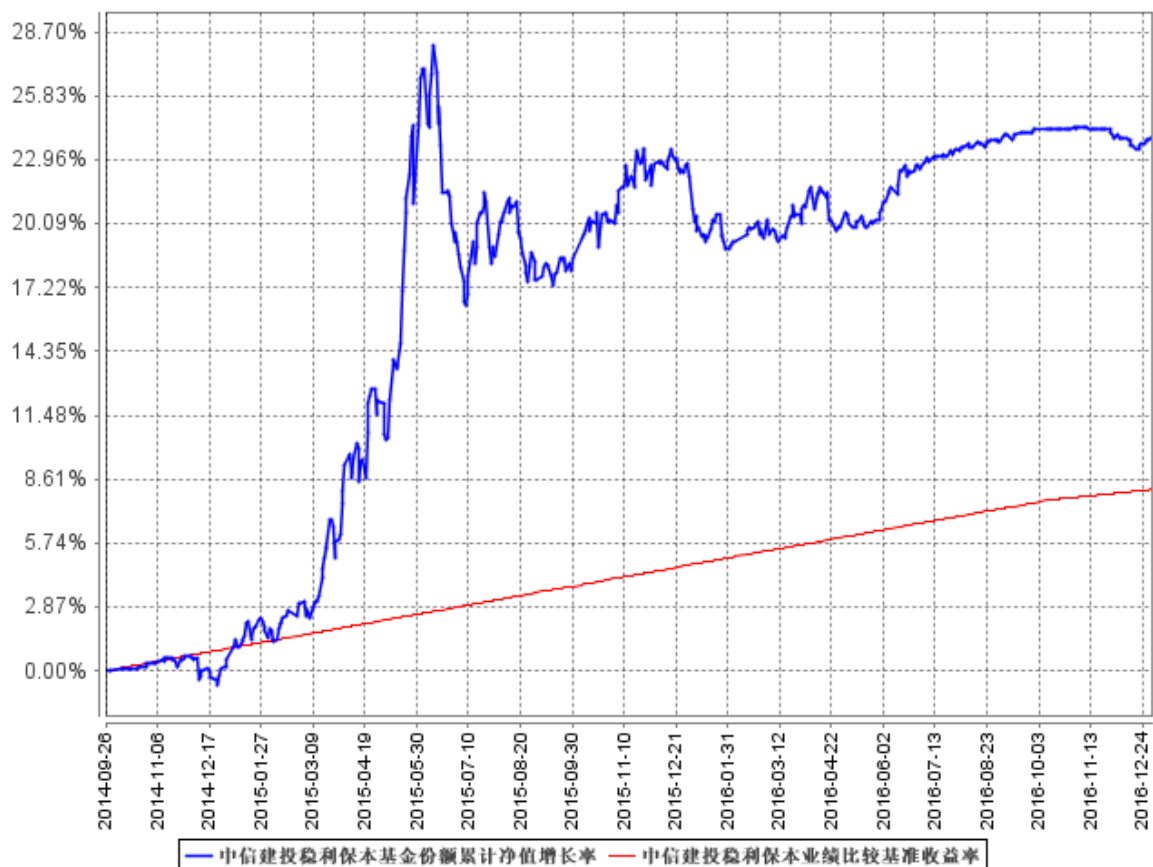
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-0.29%	0.06%	0.54%	0.01%	-0.83%	0.05%
过去六个月	1.05%	0.07%	1.43%	0.01%	-0.38%	0.06%
过去一年	1.41%	0.21%	3.24%	0.01%	-1.83%	0.20%
自基金合同生效起至今	23.96%	0.45%	8.14%	0.01%	15.82%	0.44%

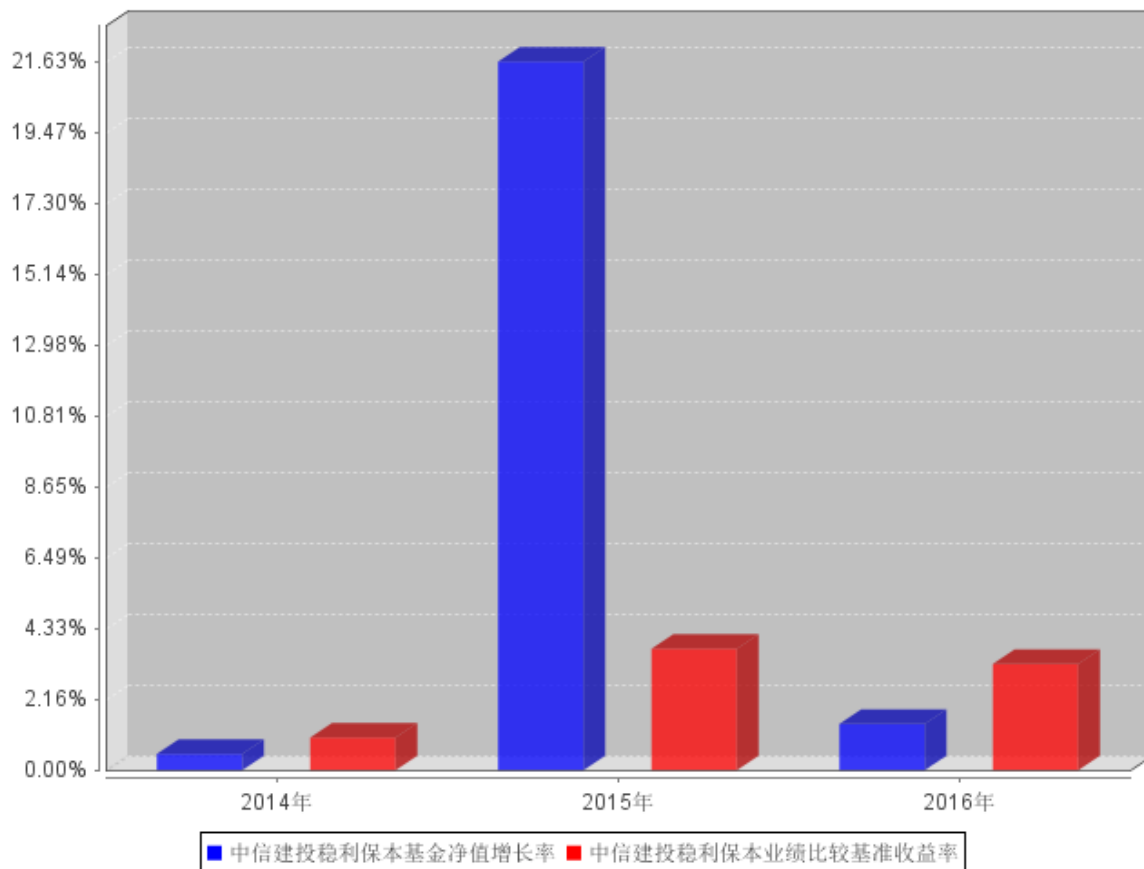
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中信建投稳利保本基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中信建投稳利保本自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年 度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2016	1.3000	15,027,718.56	-	15,027,718.56	注：-
2015	1.0000	14,524,671.44	-	14,524,671.44	注：-
2014	-	-	-	-	注：-
合计	2.3000	29,552,390.00	-	29,552,390.00	注：-

§ 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于 2013 年 9 月 9 日在北京正式注册成立，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。公司成立以来，依托强大的股东背景，经过 2014 年、2015 年的基础设施建设及资源、业务、经验的积累，公司业务呈现发展趋势。员工数量增长较快，团队建设进入加速期。公司多渠道拓展维护客户，已与多家财务公司、商业银行、信托公司、证券公司、私募基金和上市公司开展了合作，在定向增发、新股申购、结构化债券投资等多个领域开展了业务，并与移动互联网公司、传媒公司、第三方支付公司等合作，为客户提供余额、理财、类三方存管的相关服务。公司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。公司及子公司资产管理规模快速增长，各项业务较成立之初获得了快速发展。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收益，回馈客户的信任。公司投资业绩稳步上升，以良好的投资回报实现了投资人资产的保值增值。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王浩	公司董事会秘书、本基金的基金经理	2014 年 9 月 26 日	-	7	中国籍，中央财经大学经济学硕士。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，从事证券投资研究分析工作，担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、中信建投稳溢保本混合型证券投资基金、中信建投智信物联网灵活配置混合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。

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合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《中信建投基金管理有限公司公平交易管理办法》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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

2016 年上半年，需求恢复程度超出预期，基建投资也在财政和信贷支持下保持高速，在房地产和基建的双重托力下，需求有所改善，经济数据保持稳定；一季度 CPI 延续了去年四季度的回升态势，二季度再度回落到 2 以内，整体上相对稳定，而 PPI 则在商品价格的带动下持续回升；下半年，固定资产投资和工业增加值基本持平，经济数据相对平稳；CPI 在 10 月份上升到 2 以上，达到了 2.1，随后维持在 2 以上，而受到大宗商品价格上涨的影响，PPI 在 9 月份转正以后持续上升，到 12 月份达到了 5.5 的水平，通胀风险略有抬头，但总体还处于良性状态。政策角度，稳货币宽财政的方向十分明显，货币政策方面半年内只有一次降准，而财政政策则持续积极，改革措施不断推出；7 月份开始对于银行理财资金的监管持续发酵，监管去杠杆动作坚决，中央工作会议定调货币政策保持中性，同时强调把防控金融风险放到更加重要的位置，确保不发生系统性金融风险。

债券市场方面，债券市场春节过后收益率随即继续下行并创下新低，信用利差也出现了小幅

收窄；而二季度市场经历了一定震荡，受到监管对银行委外业务收紧，以及部分债券违约事件影响，信用市场 4、5 月份出现了一波明显的收益率反弹，进入 6 月份后逐步回落；下半年随着对银行表外理财监管的发酵，加之央行在资金面的控制，债券市场去杠杆的压力在年底集中释放，同时带来债券市场一波强烈的调整，收益率上行，超过了年初水平。股票市场方面，进入 2016 年经历了一波快速的下跌，1 月底上证指数即创下 2015 年以来的新低，2 月份经历了剧烈的震荡，直至 3 月份，随着经济呈现恢复态势，市场才逐渐企稳；二季度初市场表现平淡，直至 6 月底开始出现反弹；三季度延续 6 月份的反弹，上证指数反弹至 3100 点附近后承压，整体在 2950-3100 点范围内小幅震荡；进入四季度，在保险资金举牌等带动下，市场开始反弹，上证指数 11 月底达到 3300 点的高点，随后市场出现调整，市场风格方面分化明显，低估值蓝筹表现较好而中小创走势偏弱。

操作方面，本基金在年初下跌过程中快速降低了股票仓位，很好地控制了回撤的幅度，并积极增加股票仓位参与 3 月份的反弹；二季度本基金延续了波段操作的方式，在 6 月底的反弹中获得了非常好的效果；本基金在三季度末结束第一个保本期，三季度期间完成了产品的第二次分红，因保本期结束要求大部分资产保持以现金形式，因此本基金在 8 月下旬以后大幅减仓债券和股票资产，9 月份中旬以后基本以货币资产持仓为主；四季度初进入第二个保本周期，彼时债券收益率处于历史低位，而资金面随着央行 8 月开始锁短放长，整体呈现紧平衡，基于对委外杠杆的风险，理财增速的放缓的预判，以及考虑到短期经济企稳，货币政策态度转变，我们采取了较为保守的操作策略包括短久期，中等仓位等，并且随着利率变化获取波段收益。因此，在去年底债券市场的调整中，基金净值回撤幅度很小，为未来产品投资打下基础。

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 0.997 元，本报告期份额净值增长率为 1.41%，同期业绩比较基准收益率为 3.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年经济的平稳运行，需求方主要来自于基建投资与汽车购置税减免叠加房地产投资改善。展望 2017 年，地产投资有下行的压力，但是整体库存不高，投资增速基数不高，下行幅度或有限；随着 2014 年以来通缩趋势的逆转和供给侧改革带来的去产能全面执行，制造业民间投资筑底企稳；全球主要经济体去库存周期结束，开启新一轮补库周期，内需外需短期均企稳；制造业投资和出口贸易有望在 2017 年代替房地产投资托底经济。通胀角度，PPI 一季度冲高，CPI 小幅上行，未来 CPI 压力来自工业品向消费品的传导。财政政策维持积极，货币政策稳健偏中性，央

行面临去杠杆与守住系统性风险的平衡。

债券市场来看，同业存单净增量继续创新高，显示杠杆尚未完全去除，监管去杠杆的方向依然不变；理财增速放缓，一季度 MPA 考核趋于严格，资金面面临高波动；海外方面，美联储加息的 3 月议息会议临近，全年加息次数或面临攀升，对国内货币政策施压。因此，从经济基本面和货币政策去杠杆的目标来看，暂时不支持债券收益率明显回落，但我们认为利率债和高评级债券的收益率进一步上升的空间也较为有限。从交易角度看，债券趋势性机会尚未看到，但从配置角度看，债券已经具备较好的票息价值。

股票市场来看，企业盈利 2016 年开始好转，并在 2017 年上半年仍保持合理增长，成为市场稳定的主要基础；市场整体估值合理，估值分化收窄，增长和盈利继续带动市场走向；全年来看市场处于一个震荡格局，机会总体上来自于结构性和个股行情，个股投资机会丰富，龙头公司享受合理溢价；行业上关注消费类、改革主题、“一带一路”、生物医药及科技创新等方向。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人结合法律法规和业务发展需要，进一步修订、完善了公司内部制度；组织多项合规培训，加强员工的风险意识和合规意识；针对投资研究等重点业务，加大检查力度，促进公司业务合法合规、稳健经营；积极参与新产品、新业务的设计，提出合规建议，对基金的宣传推介、基金投资交易等方面积极开展各项合规管理工作，有效防范风险，规避违规行为的发生。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金遵循下列报表附注所述的估值政策和估值原则对基金持有的资产和负债进行估值。

为确保估值政策和估值原则的合理合法性，公司成立估值委员会和风险内控小组。公司总经理任估值委员会负责人，委员包括督察长、投资研究部、特定资产管理部、交易部、产品设计、稽核合规部、运营管理部的主要负责人及基金经理（若负责人认为必要，可适当增减委员会委员），主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。

在严格遵循公平、合理原则下，公司制订了健全、有效的估值政策流程：

1. 运营管理部基金会计每天按照相关政策对基金资产和负债进行估值并计算基金净值，公司

与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值；公司与中证指数有限公司签署了《债券估值数据服务协议》，并依据其提供的估值价格对公司旗下基金持有的交易所固定收益品种进行估值。

2. 由投资研究部估值小组确认基金持有的投资品种是否采用估值方法确定公允价值，若确定用估值方法计算公允价值，则在参考基金业协会的意见或第三方意见后确定估值方法；

3. 由估值委员会计算该投资品种的公允价值，并将计算结果提交公司管理层；

4. 公司管理层审批后，该估值方法方可实施。

为了确保旗下基金持有投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性，风险内控小组应定期对估值政策、程序及估值方法进行审查，并建立风险防控标准。在考虑投资策略的情况下，公司旗下的不同基金持有的同一证券的估值政策、程序及相关的方法应保持一致。除非产生需要更新估值政策或程序的情形，已确定的估值政策和程序应当持续适用。

估值委员会应互相协助定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后应及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订建议由估值委员会提议，并提交公司管理层，待管理层审批后方可实施。公司旗下基金在采用新投资策略或投资新品种时，应由估值委员会对现有估值政策和程序的适用性做出评价。

在采用估值政策和程序时，估值委员会应当审查并充分考虑参与估值流程各部门及人员的经验、专业胜任能力和独立性，通过参考行业协会估值意见、参考托管行及其他独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《中信建投稳利保本混合型证券投资基金基金合同》约定，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 5%。

本基金管理人于 2016 年 9 月 13 日发布分红公告，向截至 2016 年 9 月 21 日止本基金登记在册的份额持有人，按每 10 份基金份额分配红利人民币 1.300 元，实际分配收益金额为人民币 15,027,718.56 元。

4.9 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

在本报告期内，本基金托管人在托管中信建投稳利保本混合型证券投资基金（以下称“本基金”）过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配情况、投资组合报告的内容（“金融工具风险及管理”部分、以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内），保证复核内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 22723 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中信建投稳利保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的中信建投稳利保本混合型证券投资基金(以下简称“中信建投稳利保本基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是中信建投稳利保本基金的基金管理人中信建投基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表, 并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。 我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为, 上述中信建投稳利保本基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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, 公允反映了中信建投稳利保本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	许 康 玮 张 勇
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国 · 上海市
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 中信建投稳利保本混合型证券投资基金

报告截止日: 2016 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	35,023,844.89	3,725,407.36
结算备付金		-	291,012.26
存出保证金		30,114.06	334,428.08

交易性金融资产	7.4.7.2	850,969,000.00	134,670,609.10
其中：股票投资		-	20,842,728.00
基金投资		-	-
债券投资		850,969,000.00	113,827,881.10
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	308,221,422.33	14,000,221.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	6,292,876.17	2,014,678.55
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,200,537,257.45	155,036,356.35
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	601,810.37
应付赎回款		283,400.36	-
应付管理人报酬		1,222,333.47	159,150.11
应付托管费		203,722.26	26,525.02
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	27,146.31	777,468.72
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	366,034.26	55,000.00
负债合计		2,102,636.66	1,619,954.22
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,190,416,695.88	136,815,130.64
未分配利润	7.4.7.10	8,017,924.91	16,601,271.49
所有者权益合计		1,198,434,620.79	153,416,402.13
负债和所有者权益总计		1,200,537,257.45	155,036,356.35

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 0.997 元，基金份额总额 1,202,416,079.86 份。

7.2 利润表

会计主体：中信建投稳利保本混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		3,984,988.44	69,453,095.26
1. 利息收入		12,430,673.22	11,899,365.98
其中：存款利息收入	7.4.7.11	81,734.97	127,515.84
债券利息收入		9,586,000.30	11,707,471.08
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,762,937.95	64,379.06
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		116,286.26	52,168,473.27
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-444,129.72	50,785,940.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	502,120.41	1,149,245.06
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	58,295.57	233,288.13
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-8,960,718.32	3,651,637.72
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	398,747.28	1,733,618.29
减：二、费用		5,928,782.13	7,723,689.45
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,441,675.44	3,113,747.70
2. 托管费	7.4.10.2.2	740,279.33	518,957.95
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	274,104.21	1,451,288.82
5. 利息支出		56,734.47	2,243,268.41
其中：卖出回购金融资产支出		56,734.47	2,243,268.41
6. 其他费用	7.4.7.20	415,988.68	396,426.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,943,793.69	61,729,405.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,943,793.69	61,729,405.81

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中信建投稳利保本混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	136,815,130.64	16,601,271.49	153,416,402.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,943,793.69	-1,943,793.69
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）	1,053,601,565.24	8,388,165.67	1,061,989,730.91
其中：1. 基金申购款	1,125,127,656.57	11,456,728.30	1,136,584,384.87
2. 基金赎回款	-71,526,091.33	-3,068,562.63	-74,594,653.96
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）	-	-15,027,718.56	-15,027,718.56
五、期末所有者权益（基金净值）	1,190,416,695.88	8,017,924.91	1,198,434,620.79
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）	379,675,002.02	1,985,063.96	381,660,065.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	61,729,405.81	61,729,405.81
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）	-242,859,871.38	-32,588,526.84	-275,448,398.22
其中：1. 基金申购款	8,655,568.86	940,387.45	9,595,956.31
2. 基金赎回款	-251,515,440.24	-33,528,914.29	-285,044,354.53
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净	-	-14,524,671.44	-14,524,671.44

值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	136,815,130.64	16,601,271.49	153,416,402.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>蒋月勤</u>	<u>高翔</u>	<u>陈莉君</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中信建投稳利保本混合型证券投资基金(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[2014]914 号《关于准予中信建投稳利保本混合型证券投资基金注册的批复》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《中信建投稳利保本混合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,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证出具安永华明(2014)验字第 60952150_A17 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信建投稳利保本混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 9 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 464,708,417.18 份基金份额,其中认购资金利息折合 32,923.00 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,基金托管人为北京银行股份有限公司(以下简称“北京银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投稳利保本混合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,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、货币市场工具、权证、股指期货等权益类金融工具,债券等固定收益类金融工具(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、资产支持证券、债券回购等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金的基金资产包括稳健资产和风险资产,稳健资产为国内依法发行交易的债券、货币市场工具等,其中债券包括国债、金融债、央行票据、地方政府债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、资产支持证券、债券回购等。风险资产为股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等。本基金的投资组合比例为:债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于 60%,其中基金应保留不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;

股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例不高于 40%。本基金的业绩比较基准为：两年期银行定期存款税后收益率。

根据《中信建投稳利保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的保本周期每两年为一个周期。本基金第一个保本周期自基金合同生效日起至两年后的对应日止；本基金第一个保本周期后的各保本周期自本基金届时公告的保本周期起始之日起至两年后对应日止。如该对应日为非工作日或该公历年不存在该对应日，则顺延至下一个工作日。本基金保证人为基金管理人的保本义务提供不可撤销的连带责任担保。保证范围为基金持有人认购并持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于其保本金额的差额部分。保证期间为基金保本周期到期日起六个月止。保本周期届满时，保证人或保本义务人符合法律法规有关保证人或保本义务人资质要求，同意继续提供保本保障或基金管理人认可的其他机构同意提供保本保障，并与本基金管理人签订保证合同，同时本基金满足法律法规和基金合同规定的保本基金存续要求的情况下，本基金将转入下一保本周期。如保本周期到期后，本基金未能符合保本基金存续条件，本基金转型为非保本基金，基金名称变更为“中信建投稳利混合型证券投资基金”，基金投资、基金费率、分红方式等相关内容也将根据基金合同的约定做相应修改，在报中国证监会备案后，提前在临时公告或更新的基金招募说明书中予以说明。

根据《中信建投稳利保本混合型证券投资基金保本周期到期及转入下一保本周期相关规则的公告》和《关于中信建投稳利保本混合型证券投资基金提前结束过渡期申购、进行基金份额折算并转入第二个保本周期的公告》，本基金第一个保本周期自 2014 年 9 月 26 日起至 2016 年 9 月 26 日止，本基金满足法律法规和基金合同规定的保本基金存续要求，将在第一个保本周期到期后转入第二个保本周期。根据《关于中信建投稳利保本混合型证券投资基金份额折算和过渡期申购确认结果的公告》的有关规定，本基金的基金管理人中信建投基金管理有限公司确定 2016 年 10 月 11 日为本基金的基金份额折算日，对当日登记在册的全体基金份额持有人持有的基金份额进行了折算。基金份额折算比例为 1.01007465，折算后基金份额净值为 1.000 元。本基金第二个保本周期自 2016 年 10 月 12 日起至 2018 年 10 月 12 日止，由深圳市高新投集团有限公司为本基金的第二个保本周期提供不可撤销的连带责任保证。

7.4.2 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》、《中信建投稳利保本混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度, 即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外, 均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 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、债券投资和资产支持证券投资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公允价值变动计入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和其他各类应付款项。

7.4.4.4 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已宣告但尚未发放的现金股利、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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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：(1) 保本周期内：仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；(2) 本基金转型为“中信建投稳利混合型证券投资基金”后：基金收益分配方式分为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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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和债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[2008]38号《关于进一步规范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、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；

若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的首次投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 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)，按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	35,023,844.89	3,725,407.36
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	35,023,844.89	3,725,407.36

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	857,698,508.26	850,969,000.00	-6,729,508.26
	合计	857,698,508.26	850,969,000.00	-6,729,508.26
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	857,698,508.26	850,969,000.00	-6,729,508.26	

项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	20,679,593.24	20,842,728.00	163,134.76
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	43,795,881.10	617,548.28
	银行间市场	70,032,000.00	1,450,527.02
	合计	113,827,881.10	2,068,075.30
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	132,439,399.04	134,670,609.10	2,231,210.06

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	308,221,422.33	-
合计	308,221,422.33	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	14,000,221.00	-
合计	14,000,221.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均无在买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日

应收活期存款利息	7,052.41	2,257.97
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	144.10
应收债券利息	5,866,787.33	2,009,974.78
应收买入返售证券利息	419,021.58	2,136.26
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	14.85	165.44
合计	6,292,876.17	2,014,678.55

注：“其他”为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	15.96	776,647.72
银行间市场应付交易费用	27,130.35	821.00
合计	27,146.31	777,468.72

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,034.26	-
预提费用	365,000.00	55,000.00
合计	366,034.26	55,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	136,815,130.64	136,815,130.64
本期申购	948,656,133.13	948,656,133.13

本期赎回（以“-”号填列）	-51,483,104.95	-51,483,104.95
2017年10月11日 基金拆分/份额折算前	1,033,988,158.82	1,033,988,158.82
基金拆分/份额折算变动份额	10,417,072.51	-
本期申购	178,255,075.96	176,471,523.44
本期赎回（以“-”号填列）	-20,244,227.43	-20,042,986.38
本期末	1,202,416,079.86	1,190,416,695.88

注：根据《关于中信建投稳利保本混合型证券投资基金份额折算和过渡期申购确认结果的公告》的有关规定，本基金的基金管理人中信建投基金管理有限公司确定 2016 年 10 月 11 日为本基金的基金份额折算日。当日基金资产净值为 1,044,405,231.33 元，折算前基金份额总额为 1,033,988,158.82 份，折算前基金份额净值为 1.010 元。基金份额折算比例为 1.01007465，折算后基金份额总额为 1,044,405,231.33 份，折算后基金份额净值为 1.000 元。中信建投基金管理有限公司已根据上述折算比例，对 2016 年 10 月 11 日登记在册的全体基金份额持有人持有的基金份额进行了折算。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,512,401.68	-2,911,130.19	16,601,271.49
本期利润	7,016,924.63	-8,960,718.32	-1,943,793.69
本期基金份额交易产生的变动数	47,056,318.29	-38,668,152.62	8,388,165.67
其中：基金申购款	52,308,587.45	-40,851,859.15	11,456,728.30
基金赎回款	-5,252,269.16	2,183,706.53	-3,068,562.63
本期已分配利润	-15,027,718.56	-	-15,027,718.56
本期末	58,557,926.04	-50,540,001.13	8,017,924.91

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	73,167.29	102,493.97
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	6,910.27	19,369.56
其他	1,657.41	5,652.31
合计	81,734.97	127,515.84

注：“其他”为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
卖出股票成交总额	106,463,793.77	621,159,793.30
减：卖出股票成本总额	106,907,923.49	570,373,853.22
买卖股票差价收入	-444,129.72	50,785,940.08

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	502,120.41	1,149,245.06
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	502,120.41	1,149,245.06

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	383,251,510.36	368,233,705.35
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	378,231,299.95	358,418,580.12
减：应收利息总额	4,518,090.00	8,665,880.17
买卖债券差价收入	502,120.41	1,149,245.06

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生债券投资相关的赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生债券投资相关的申购价差收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期间及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期间及上年度可比期间无赎回贵金属差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期间及上年度可比期间无申购贵金属差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期间及上年度可比期间无衍生工具投资收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期间及上年度可比期间无衍生工具投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	58,295.57	233,288.13
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	58,295.57	233,288.13

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-8,960,718.32	3,651,637.72
——股票投资	-163,134.76	-2,313,758.78
——债券投资	-8,797,583.56	5,965,396.50
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-8,960,718.32	3,651,637.72

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	276,747.28	1,730,558.29
其他	122,000.00	3,060.00
合计	398,747.28	1,733,618.29

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	264,483.21	1,447,154.82
银行间市场交易费用	9,621.00	4,134.00
合计	274,104.21	1,451,288.82

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	65,000.00	55,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行划款费	14,788.68	11,426.57

帐户维护费	36,200.00	30,000.00
合计	415,988.68	396,426.57

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《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[2016]140 号)，要求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，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 关联方关系

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、基金注册登记机构、基金销售机构
北京银行股份有限公司(“北京银行”)	基金托管人、基金代销机构
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
中信建投期货有限公司	与基金管理人同一控股股东
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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
中信建投证券 股份有限公司	-	-	647,897,083.31	55.39%

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
中信建投证券 股份有限公司	26,583,946.90	82.17%	22,718,397.22	66.23%

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	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	695,000,000.00	49.57%	1,080,000,000.00	84.91%

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信建投证券 股份有限公司	324,741.92	46.33%	400,516.34	51.57%

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	4,441,675.44
其中：支付销售机构的客户维护费	2,802,651.43	1,775,794.39

注：1、支付基金管理人中信建投基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2% 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×1.2% ÷ 当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产里列支的费用项目。其中，本报告期应支付北京银行股份有限公司的客户维护费为 835,990.88 元；应支付中信建投证券股份有限公司的客户维护费为 340,342.69 元；应支付中信建投期货有限公司的客户维护费为 47.88 元。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
	当期发生的基金应支付的托管费	740,279.33

注：支付基金托管人北京银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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×0.2% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

7.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
北京银行股份有限公司	35,023,844.89	73,167.29	3,725,407.36	102,493.97

注：本基金的活期存款由基金托管人北京银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序	除息日	每 10 份	现金形式	再投资形式	本期利润分
---	-----	--------	------	-------	-------

号	权益 登记日	场内	场外	基金份额分 红 数	发放总额	发放总额	配 合 计	备注
1	2016 年 9 月 21 日	-	2016 年 9 月 21 日	1.3000	15,027,718.56		-15,027,718.56	
合 计	-	-		1.3000	15,027,718.56		-15,027,718.56	

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司风险控制与合规委员会、督察长、公司风险管理委员会、稽核合规部以及各个业务部门组成。公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与合规委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由稽核合规部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法

去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行北京银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
A-1	49,589,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	622,732,000.00	-
合计	672,321,000.00	-

注：以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
AAA	108,443,000.00	20,301,169.28

AAA 以下	10,097,000.00	85,221,921.64
未评级	-	10,314,762.04
合计	118,540,000.00	115,837,852.96

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 12 月 31 日，除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	35,023,844.89	-	-	-	35,023,844.89
存出保证金	30,114.06	-	-	-	30,114.06
交易性金融资产	732,429,000.00	118,540,000.00	-	-	850,969,000.00
买入返售金融资产	308,221,422.33	-	-	-	308,221,422.33
应收利息	-	-	-	6,292,876.17	6,292,876.17
资产总计	1,075,704,381.28	118,540,000.00	-	6,292,876.17	1,200,537,257.45
负债					
应付赎回款	-	-	-	283,400.36	283,400.36
应付管理人报酬	-	-	-	1,222,333.47	1,222,333.47
应付托管费	-	-	-	203,722.26	203,722.26
应付交易费用	-	-	-	27,146.31	27,146.31
其他负债	-	-	-	366,034.26	366,034.26
负债总计	-	-	-	2,102,636.66	2,102,636.66
利率敏感度缺口	1,075,704,381.28	118,540,000.00	-	4,190,239.51	1,198,434,620.79
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,725,407.36	-	-	-	3,725,407.36
结算备付金	291,012.26	-	-	-	291,012.26
存出保证金	334,428.08	-	-	-	334,428.08
交易性金融资	30,327,021.10	83,500,860.00	-	20,842,728.00	134,670,609.10

产					
买入返售金融资产	14,000,221.00	-	-	-	14,000,221.00
应收利息	-	-	-	2,014,678.55	2,014,678.55
资产总计	48,678,089.80	83,500,860.00	-	-22,857,406.55	155,036,356.35
负债					
应付证券清算款	-	-	-	601,810.37	601,810.37
应付管理人报酬	-	-	-	159,150.11	159,150.11
应付托管费	-	-	-	26,525.02	26,525.02
应付交易费用	-	-	-	777,468.72	777,468.72
其他负债	-	-	-	55,000.00	55,000.00
负债总计	-	-	-	1,619,954.22	1,619,954.22
利率敏感度缺口	48,678,089.80	83,500,860.00	-	-21,237,452.33	153,416,402.13

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	1,614,123.85	522,916.94
市场利率上升 25 个基点	-1,605,942.85	-518,492.85	

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	-	-	20,842,728.00	13.59
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	850,969,000.00	71.01	113,827,881.10	74.20
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	850,969,000.00	71.01	134,670,609.10	87.78

7.4.14 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 2016 年 12 月 31 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 850,969,000 元，无属于第一层次和第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次的余额为人民币 16,580,728.00 元，属于第二层次的余额为人民币 118,089,881.10 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	固定收益投资	850,969,000.00	70.88
	其中：债券	850,969,000.00	70.88
	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	308,221,422.33	25.67
	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	35,023,844.89	2.92
7	其他各项资产	6,322,990.23	0.53
8	合计	1,200,537,257.45	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002019	亿帆医药	7,188,006.76	4.69
2	002643	万润股份	6,819,749.00	4.45
3	002688	金河生物	5,938,932.24	3.87
4	300182	捷成股份	5,853,544.09	3.82
5	300296	利亚德	4,731,810.19	3.08
6	002245	澳洋顺昌	4,191,106.00	2.73
7	002410	广联达	3,621,204.83	2.36
8	002335	科华恒盛	3,589,018.12	2.34
9	000060	中金岭南	3,255,132.00	2.12
10	000625	长安汽车	2,901,094.00	1.89
11	601799	星宇股份	2,836,812.00	1.85
12	002445	中南文化	2,768,694.00	1.80
13	600584	长电科技	2,731,696.70	1.78
14	002475	立讯精密	2,584,189.14	1.68
15	002567	唐人神	2,445,357.14	1.59
16	300219	鸿利智汇	2,416,342.00	1.58
17	002522	浙江众成	2,375,418.00	1.55
18	002597	金禾实业	2,258,800.36	1.47
19	000531	穗恒运 A	2,091,924.00	1.36
20	600038	中直股份	2,091,693.00	1.36

8.4.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值
----	------	------	----------	-----------

				比例 (%)
1	002019	亿帆医药	7,846,755.50	5.11
2	002688	金河生物	6,880,729.47	4.49
3	002643	万润股份	6,055,842.00	3.95
4	300296	利亚德	5,887,500.08	3.84
5	300182	捷成股份	5,682,734.84	3.70
6	002245	澳洋顺昌	4,810,774.00	3.14
7	002410	广联达	3,635,094.77	2.37
8	002335	科华恒盛	3,491,582.33	2.28
9	002446	盛路通信	3,360,630.20	2.19
10	000060	中金岭南	3,307,999.50	2.16
11	601799	星宇股份	2,933,893.00	1.91
12	002445	中南文化	2,871,054.00	1.87
13	300174	元力股份	2,861,217.43	1.87
14	002475	立讯精密	2,847,071.13	1.86
15	000625	长安汽车	2,746,424.20	1.79
16	002522	浙江众成	2,725,805.15	1.78
17	600584	长电科技	2,696,272.45	1.76
18	603118	共进股份	2,568,777.00	1.67
19	002567	唐人神	2,450,415.50	1.60
20	300219	鸿利智汇	2,406,999.56	1.57

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	86,228,330.25
卖出股票收入（成交）总额	106,462,693.77

8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,108,000.00	5.02
	其中：政策性金融债	60,108,000.00	5.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	547,001,000.00	45.64
6	中期票据	118,540,000.00	9.89

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	125,320,000.00	10.46
9	其他	-	-
10	合计	850,969,000.00	71.01

注：由于四舍五入的原因金额占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.6 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	150417	15 农发 17	600,000	60,108,000.00	5.02
2	011698661	16 鲁黄金 SCP012	500,000	49,780,000.00	4.15
2	011698686	16 深圳航空 SCP008	500,000	49,780,000.00	4.15
3	011698681	16 振华石油 SCP005	500,000	49,775,000.00	4.15
4	011698675	16 同方 SCP006	500,000	49,750,000.00	4.15
5	011698652	16 厦翔业 SCP013	500,000	49,725,000.00	4.15

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期内本基金未运用股指期货进行投资，也无期间损益。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内本基金未运用股指期货进行投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内本基金未运用国债期货进行投资。

8.11.2 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，也无期间损益。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内本基金未运用国债期货进行投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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本期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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	30,114.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,292,876.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,322,990.23

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
8,200	146,636.11	22,380,680.34	1.86%	1,180,035,399.52	98.14%

9.2 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	5,000.78	-

9.3 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的情况

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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年9月26日）基金份额总额	464,708,417.18
本报告期期初基金份额总额	136,815,130.64
本报告期基金总申购份额	1,126,911,209.09
减：本报告期基金总赎回份额	71,727,332.38
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	10,417,072.51
本报告期期末基金份额总额	1,202,416,079.86

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

2016 年 2 月 3 日，王琦先生任中信建投基金职工监事、任巧二女士不再任职工监事。

2016 年 6 月 22 日，基金管理人发布《中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，任命高翔先生为基金管理人副总经理。

2016 年 12 月 23 日，陈瑛女士、周艳丽女士任中信建投基金董事，石明磊先生、安冉女士不再任中信建投基金董事；王禹媚任中信建投基金独立董事，陈冬华不再任中信建投基金独立董事。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人于 2016 年 4 月 5 日发布《中信建投基金管理有限公司关于旗下基金更换会计师事务所的公告》，将会计师事务所由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）改聘为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

报告期内应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 65,000.00 元，该审计机构自 2016 年 4 月 5 日起为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	90,137,599.23	46.82%	65,917.50	46.82%	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	78,004,869.88	40.51%	57,045.37	40.51%	-
安信证券	2	24,393,658.53	12.67%	17,838.72	12.67%	-

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研究、市场领导及投资研究部、特定资产管理部、稽核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，办理相关的租用席位或开户事宜。

（2）投资研究部、特定资产管理部按照《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。

11.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	5,352,321.56	16.54%	82,000,000.00	5.85%	-	-

中信建投证券	26,583,946.90	82.17%	695,000,000.00	49.57%	-	-
国金证券	414,557.50	1.28%	-	-	-	-
安信证券	-	-	625,000,000.00	44.58%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下开放式基金 2015 年年度最后一个市场交易日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 1 月 1 日
2	中信建投基金增加渤海银行股份有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 1 月 6 日
3	中信建投基金管理有限公司关于《指数熔断当日调整旗下基金开放时间的公告》	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 1 月 7 日
4	中信建投基金参加渤海银行股份有限公司费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 1 月 20 日
5	中信建投稳利保本混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 1 月 22 日
6	中信建投基金增加杭州数米基金销售有限公司为多只基金的销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 2 月 24 日
7	中信建投基金增加上海长量基金销售有限公司为多只基金的销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 3 月 1 日
8	中信建投基金增加深圳富济财富管理有限公司为多只基金的销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 3 月 18 日
9	中信建投稳利保本混合型证券投资	管理人网站	2016 年 3 月 25 日

	资基金 2015 年年度报告		
10	中信建投稳利保本混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 3 月 25 日
11	中信建投基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为多只基金的销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 3 月 28 日
12	中信建投基金管理有限公司关于旗下基金更换会计师事务所的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 4 月 5 日
13	中信建投基金管理有限公司关于上海陆金所资产管理有限公司费率调整的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 4 月 14 日
14	中信建投稳利保本基金 2016 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 4 月 21 日
15	中信建投基金管理有限公司关于参加金融界费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 4 月 22 日
16	中信建投基金增加大泰金石投资管理有限公司为多只基金的销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 4 月 27 日
17	中信建投基金增加北京电盈基金销售有限公司为多只基金的销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 4 月 29 日
18	中信建投基金管理有限公司关于上海天天基金销售有限公司费率调整的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 5 月 5 日
19	中信建投基金管理有限公司关于杭州数米基金销售有限公司费率调整的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 5 月 5 日

20	中信建投稳利保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2016 年第 1 号）	管理人网站	2016 年 5 月 10 日
21	中信建投稳利保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2016 年第 1 号）	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 5 月 10 日
22	中信建投基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为多只基金的销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 5 月 16 日
23	中信建投基金增加珠海盈米财富管理有限公司为多只基金的销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 5 月 23 日
24	中信建投基金增加北京农村商业银行股份有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 6 月 1 日
25	中信建投基金管理有限公司关于上海陆金所资产管理有限公司费率调整的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 6 月 6 日
26	中信建投基金管理有限公司关于浙江同花顺基金销售有限公司费率调整的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 6 月 6 日
27	中信建投稳利保本混合型证券投资基金开放定期定额投资业务公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 6 月 24 日
28	中信建投基金管理有限公司旗下开放式基金参与上海陆金所资产管理有限公司定投业务的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 6 月 24 日
29	中信建投基金管理有限公司旗下	中国证监会指定报	2016 年 6 月 28 日

	开放式基金参与北京新浪仓石基金销售有限公司定投业务的公告	刊及管理人网站	
30	中信建投基金增加北京钱景财富投资管理有限公司为多只基金的销售机构及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 6 月 29 日
31	中信建投基金管理有限公司旗下开放式基金参与北京钱景财富投资管理有限公司定投业务的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 6 月 30 日
32	中信建投基金管理有限公司关于旗下开放式证券投资基金 2016 年半年度最后一个市场交易日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 7 月 1 日
33	中信建投基金管理有限公司旗下开放式基金参与上海天天基金销售有限公司定投业务的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 7 月 8 日
34	中信建投基金增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 7 月 13 日
35	中信建投基金管理有限公司关于旗下基金通过武汉市伯嘉基金销售有限公司开展定投申购业务的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 7 月 13 日
36	中信建投稳利保本混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 7 月 19 日
37	中信建投基金管理有限公司关于调整旗下基金天天基金销售平台申购金额下限及最低持有金额下	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 7 月 25 日

	限的公告		
38	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金暂停参加泰诚财富基金销售（大连）有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 8 月 12 日
39	中信建投基金管理有限公司关于调整旗下基金同花顺基金销售平台申购金额下限及最低持有金额下限的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 8 月 12 日
40	中信建投稳利保本混合型证券投资基金 2016 年半年度报告	管理人网站	2016 年 8 月 25 日
41	中信建投稳利保本混合型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 8 月 25 日
42	中信建投稳利保本混合型证券投资基金第二次分红公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 9 月 13 日
43	中信建投稳利保本混合型证券投资基金修改基金合同公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 9 月 20 日
44	中信建投稳利保本混合型证券投资基金基金合同	管理人网站	2016 年 9 月 20 日
45	中信建投稳利保本混合型证券投资基金保本周期到期及转入下一个保本周期相关规则的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 9 月 20 日
46	中信建投基金增加汇成基金销售有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 9 月 23 日
47	《中信建投稳利保本混合型证券投资基金第二次分红公告》更正公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 9 月 23 日
48	中信建投稳利保本混合型证券投资	中国证监会指定报	2016 年 9 月 26 日

	资基金保本周期到期及转入下一保本周期的提示性公告	刊及管理人网站	
49	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信建投证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016年9月28日
50	中信建投基金管理有限公司关于旗下基金通过中信建投证券股份有限公司参与定投申购业务及费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016年9月28日
51	中信建投稳利保本混合型证券投资基金增加上海浦东发展银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016年9月28日
52	中信建投稳利保本混合型证券投资基金增加中信银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016年9月30日
53	关于中信建投稳利保本混合型证券投资基金通过微信服务平台过渡期申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016年9月30日
54	中信建投稳利保本混合型证券投资基金增加中国工商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016年9月30日
55	关于中信建投稳利保本混合型证券投资基金通过网上通联渠道过渡期申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016年10月10日
56	关于中信建投稳利保本混合型证券投资基金提前结束过渡期申购、进行基金份额折算并转入第二个保本周期的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016年10月12日

57	关于中信建投稳利保本混合型证券投资基金份额折算和过渡期申购确认结果的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 10 月 13 日
58	中信建投基金增加北京恒天明泽基金销售有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 10 月 13 日
59	中信建投稳利保本混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 10 月 26 日
60	中信建投基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 10 月 28 日
61	中信建投基金增加天津国美基金销售有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 11 月 4 日
62	中信建投稳利保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2016 年第 2 号）	管理人网站	2016 年 11 月 9 日
63	中信建投稳利保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2016 年第 2 号）	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 11 月 9 日
64	中信建投基金管理有限公司关于旗下基金通过北京新浪仓石基金销售有限公司购买费率调整的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 11 月 11 日
65	中信建投基金增加上海利得基金销售有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 11 月 15 日
66	中信建投基金增加中信证券股份有限公司为多只基金的销售机构	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 11 月 23 日

	的公告		
67	中信建投基金增加中信期货有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 11 月 23 日
68	中信建投基金增加中信证券（山东）有限责任公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 11 月 23 日
69	中信建投基金管理有限公司关于旗下基金通过北京肯特瑞财富投资管理有限公司开展定投申购业务的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 12 月 1 日
70	中信建投基金增加北京格上富信投资顾问有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 12 月 2 日
71	中信建投基金管理有限公司关于旗下基金通过北京格上富信投资顾问有限公司开展定投申购业务的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 12 月 6 日
72	中信建投基金增加北京微动利投资管理有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2016 年 12 月 8 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无需要披露的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所。

13.3 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
2017年3月31日