

中信建投稳裕定期开放债券型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3月31日

中信建投稳溢保本混合型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3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:上海浦东发展银行股份有限公司

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...

基金管理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2017年4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...

Table with 2 columns: 基金名称, 中信建投稳裕; 基金代码, 003573; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日期, 2016年11月7日; 报告期末基金份额总额, 1,050,378,250.05份; 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...

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日至2017年3月31日); 1.本期已实现收益, 9,162,089.65; 2.本期利润, 9,197,806.61; 3.加权平均基金份额本期利润, 0.0088; 4.期末基金资产净值, 1,040,923,888.33; 5.期末基金份额净值, 0.9910

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...

Table with 6 columns: 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, 业绩比较基准收益标准差④, ①-③, ②-④; 过去三个月, 0.90%, 0.09%, -1.24%, 0.07%, 2.14%, 0.02%

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

Table with 2 columns: 姓名, 职务; 姓名: 黄海浩, 职务: 基金经理; 姓名: 许隽, 职务: 基金经理; 姓名: 顾灵曦, 职务: 基金经理

注:1、本基金基金合同于2016年11月7日生效,基金合同生效起至报告期末未满一年。 2、本基金尚处于建仓期,根据中信建投稳裕定期开放债券型证券投资基金合同,本基金自基金合同生效之日起6个月内基金的投资组合比例符合基金合同约定。

Table with 2 columns: 报告期初基金份额总额, 1,050,383,419.33; 报告期末基金份额总额, 1,050,378,250.05; 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; 7.2 基金管理人持有本基金份额; 7.3 基金管理人持有本基金份额; 7.4 基金管理人持有本基金份额

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 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明 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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《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,为基金份额持有人谋求最大利益...

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。

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元); 1 权益投资, -; 2 其中:股票, -; 3 固定收益投资, 1,234,602,936.70; 4 其中:债券, 1,234,602,936.70; 5 贵金属投资, -; 6 买入返售金融资产, 300,000,395.00; 7 银行存款和结算备付金合计, 30,327,311.37; 8 其他资产, 19,471,422.74; 9 合计, 1,584,402,065.81

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合 5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

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

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

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

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 5.9.3 本期国债期货投资评价

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

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元); 1 存出保证金, 298,871.26; 2 应收证券清算款, -; 3 应收股利, -; 4 应收利息, 19,172,551.48; 5 其他应收款, -; 6 其他流动资产, -; 7 待摊费用, -; 8 其他, -; 9 合计, 19,471,422.74

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 5.10.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券 5.10.6 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况

5.10.7 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况 5.10.8 本报告期投资报告附注的其他文字描述部分

5.10.9 本报告期投资报告附注的其他文字描述部分 5.10.10 本报告期投资报告附注的其他文字描述部分

Table with 2 columns: 报告期末持有基金份额变动情况, 报告期末持有基金情况; 序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间, 期初份额, 申购份额, 赎回份额, 持有份额, 份额占比

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 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明 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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《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,为基金份额持有人谋求最大利益...

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

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...

基金管理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2017年4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...

Table with 2 columns: 基金名称, 中信建投稳溢保本; 基金代码, 002640; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日期, 2016年5月19日; 报告期末基金份额总额, 903,432,828.14份; 投资目标, 本基金通过固定收益类资产与权益类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...

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合 5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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

Table with 6 columns: 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, 业绩比较基准收益标准差④, ①-③, ②-④; 过去三个月, 0.70%, 0.04%, 0.51%, 0.01%, 0.19%, 0.03%

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

Table with 2 columns: 姓名, 职务; 姓名: 王浩, 职务: 基金经理; 姓名: 顾灵曦, 职务: 基金经理

注:1、本基金基金合同于2016年5月19日生效,基金合同生效起至报告期末未满一年。 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约定。

Table with 2 columns: 姓名, 职务; 姓名: 王浩, 职务: 基金经理; 姓名: 顾灵曦, 职务: 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 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明 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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《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,为基金份额持有人谋求最大利益...