



中信稳定双利债券型证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013年6月30日

基金从业经验,且具风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验,同时,根据基金管理机构制定的相关制度,估值工作决策机构的成员中不包括基金基金经理。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
根据《证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定,本基金本报告期实施利润分配2次,符合相关法律法规及基金合同的约定。

8.5 托管人报告

5.1 报告期内本基金管理人遵守法律法规情况
本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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,本托管人按照国家有关规定、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方面进行了监督,未发现基金管理人有关基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等相关内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人复核看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。

8.6 半年度财务会计报告(未经审计)

会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金
报告截止日:2013年6月30日

资产		附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
货币:				
银行存款			103,570,501.36	7,348,606.60
结算备付金			15,858,110.79	4,584,728.87
存出保证金			57,511.21	250,000.00
交易性金融资产			1,734,321,262.14	1,311,243,983.00
其中:股票投资			10,128,382.94	-
基金投资			1,700,192,879.20	1,311,243,983.00
货币支持证券投资			14,000,000.00	-
衍生金融资产			-	-
买入返售金融资产			-	-
应收证券清算款			2,917,256.26	4,983,180.82
应收股利			35,923,325.20	28,317,239.08
应收利息			-	-
应收申购款			892,728.60	1,988,264.08
递延所得税资产			-	-
其他资产			-	-
资产总计			1,883,540,695.56	1,358,716,002.45

负债和所有者权益		附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012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			642,099,649.70	32,000,000.00
应付证券清算款			25,377.29	-
应付赎回款			3,648,478.53	1,912,267.70
应付管理人报酬			739,448.40	740,289.96
应付托管费			227,522.59	227,781.51
应付销售服务费			455,045.20	455,563.06
应付交易费用			371,433.28	271,810.24
应交税费			2,191,311.60	2,191,311.60
应付利息			281,598.17	4,968.50
应付利润			-	-
递延所得税负债			-	-
其他负债			412,752.13	569,025.21
负债合计			650,452,616.89	38,373,017.78

所有者权益			本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
实收基金			1,398,698,552.60	1,277,932,701.71
未分配利润			34,389,526.07	42,041,282.96
所有者权益合计			1,233,088,078.67	1,320,342,984.67
负债所有者权益总计			1,883,540,695.56	1,358,716,002.45

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值1.0287元,基金份额总额1,198,698,552.60份。

6.2 利润表
会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		44,496,772.03	62,631,551.47
1.利息收入		44,949,408.41	30,132,981.31
其中:存款利息收入		33,044.44	168,587.42
债券利息收入		44,301,243.69	29,298,472.44
资产支持证券利息收入		46,474.52	-
买入返售金融资产收入		269,645.76	665,921.45
其他收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-996,190.15	11,186,669.67
其中:股票投资收益		-3,222,559.04	-2,083,702.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益		2,226,346.89	13,270,372.47
资产支持证券投资损益		-	-
衍生工具损益		-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		408,257.23	20,809,100.29
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		135,296.54	502,800.20
减:二、费用		16,155,074.07	9,844,039.16
1.管理费用		4,423,127.17	3,919,795.48
2.托管费		1,360,982.15	1,206,090.84
3.销售服务费		2,727,934.43	2,412,181.82
4.交易费用		133,288.44	128,237.93
5.利息支出		7,323,196.96	1,984,921.90
其中:卖出回购金融资产支出		1,323,196.96	1,984,921.90
6.其他费用		193,831.92	195,811.19
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		28,341,697.96	52,787,512.31
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		28,341,697.96	52,787,512.31

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		44,496,772.03	62,631,551.47
1.利息收入		44,949,408.41	30,132,981.31
其中:存款利息收入		33,044.44	168,587.42
债券利息收入		44,301,243.69	29,298,472.44
资产支持证券利息收入		46,474.52	-
买入返售金融资产收入		269,645.76	665,921.45
其他收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-996,190.15	11,186,669.67
其中:股票投资收益		-3,222,559.04	-2,083,702.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益		2,226,346.89	13,270,372.47
资产支持证券投资损益		-	-
衍生工具损益		-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		408,257.23	20,809,100.29
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		135,296.54	502,800.20
减:二、费用		16,155,074.07	9,844,039.16
1.管理费用		4,423,127.17	3,919,795.48
2.托管费		1,360,982.15	1,206,090.84
3.销售服务费		2,727,934.43	2,412,181.82
4.交易费用		133,288.44	128,237.93
5.利息支出		7,323,196.96	1,984,921.90
其中:卖出回购金融资产支出		1,323,196.96	1,984,921.90
6.其他费用		193,831.92	195,811.19
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		28,341,697.96	52,787,512.31
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		28,341,697.96	52,787,512.31

6.4 利润表
会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		44,496,772.03	62,631,551.47
1.利息收入		44,949,408.41	30,132,981.31
其中:存款利息收入		33,044.44	168,587.42
债券利息收入		44,301,243.69	29,298,472.44
资产支持证券利息收入		46,474.52	-
买入返售金融资产收入		269,645.76	665,921.45
其他收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-996,190.15	11,186,669.67
其中:股票投资收益		-3,222,559.04	-2,083,702.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益		2,226,346.89	13,270,372.47
资产支持证券投资损益		-	-
衍生工具损益		-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		408,257.23	20,809,100.29
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		135,296.54	502,800.20
减:二、费用		16,155,074.07	9,844,039.16
1.管理费用		4,423,127.17	3,919,795.48
2.托管费		1,360,982.15	1,206,090.84
3.销售服务费		2,727,934.43	2,412,181.82
4.交易费用		133,288.44	128,237.93
5.利息支出		7,323,196.96	1,984,921.90
其中:卖出回购金融资产支出		1,323,196.96	1,984,921.90
6.其他费用		193,831.92	195,811.19
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		28,341,697.96	52,787,512.31
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		28,341,697.96	52,787,512.31

6.5 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		1,277,932,701.71	42,041,282.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		-	28,341,697.96
三、本期利润分配产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)		-79,234,149.11	-3,349,216.20
其中:1.基金申购款		602,881,849.69	37,245,385.34
2.基金赎回款		-682,115,998.80	-30,694,501.54
三、本期经营活动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)		-	-33,013,238.65
四、本期利润分配产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)		-	-33,013,238.65
五、期末所有者权益(基金净值)		1,198,698,552.60	34,389,526.07
六、期末所有者权益(基金净值)		1,198,698,552.60	34,389,526.07

6.6 资产负债表
会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		1,201,590,909.35	10,075,494.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		-	52,787,512.31
三、本期利润分配产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)		21,136,183.14	2,124,805.38
其中:1.基金申购款		196,108,963.10	7,663,911.43
2.基金赎回款		-174,972,779.96	-5,539,105.75
三、本期经营活动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)		-	-12,417,704.85
四、本期利润分配产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)		-	-12,417,704.85
五、期末所有者权益(基金净值)		1,222,727,092.49	52,839,567.02

6.7 资产负债表
会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

6.8 资产负债表
会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

6.9 资产负债表
会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

6.10 资产负债表
会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

6.11 资产负债表
会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

6.12 资产负债表
会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

6.13 资产负债表
会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

6.14 资产负债表
会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

6.15 资产负债表
会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

6.16 资产负债表
会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

6.17 资产负债表
会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

6.4.4.2.1 基金管理费
单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至 2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至 2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,423,127.17	3,919,795.48
其中:支付销售机构的客户维护费	276,214.17	223,032.32

注:①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.65%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。
②基金管理人报酬计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.65%/当年天数。
③客户维护费是指基金管理人向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,不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.4.2.2 基金托管费
单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至 2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至 2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,360,982.15	1,206,090.84

注:①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。
②基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.4.2.3 销售服务费
单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	当期发生的基金应支付的销售服务费
华夏基金管理有限公司	292,878.08	-
中国建设银行	1,303,544.14	-
中信证券	67,516.07	-
合计	1,663,938.29	-

注:①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。
②基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.4.2.4 销售服务费
单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	当期发生的基金应支付的销售服务费
华夏基金管理有限公司	169,802.93	-
中国建设银行	1,309,243.38	-
中信证券	70,944.05	-
合计	1,549,990.36	-

注:①支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给基金管理人,再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。
②基金销售服务费计算公式为:日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.4.4.1 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的情况。
6.4.4.4.2 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的情况。

6.4.4.5 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 2013年1月1日至 2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至 2012年6月30日
中国建设银行	142,384.59	7,516,582.78

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。
6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.8 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.9 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.10 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.11 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.12 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.13 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.14 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.15 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.16 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.17 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.18 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.19 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.20 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.21 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.22 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.23 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.24 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.25 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况