中信建投稳利保本混合型证券投资基金

2015 半年度报告摘要

2015年6月30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：2015年8月26日

§1 重要提示

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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年8月20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 。

本报告期自2015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	210,183,845.46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	liuye1@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		4009-108-108	95526
传真		010-59100298	010-66226045

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	基金管理人和基金托管人的办公场所

§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(2015年1月1日 － 2015年6月30日)
本期已实现收益	56,410,589.06
本期利润	59,237,645.45
加权平均基金份额本期利润	0.1943
本期基金份额净值增长率	19.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1971
期末基金资产净值	251,603,200.18
期末基金份额净值	1.197

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。

4、本基金合同自2014年9月26日起生效，至2015年6月30日未满一年。

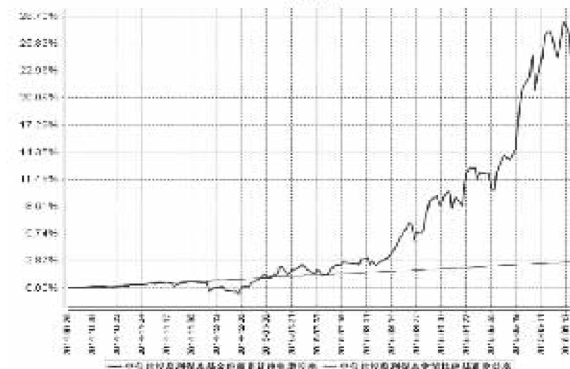
3.2 基金净值表现

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	-1.97%	1.10%	0.32%	0.01%	-2.29%	1.09%
过去三个月	12.82%	1.02%	0.92%	0.01%	11.90%	1.01%
过去六个月	19.10%	0.78%	1.84%	0.01%	17.26%	0.77%
自基金合同生效起至今	19.70%	0.64%	2.86%	0.01%	16.84%	0.63%

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



注：1、本基金基金合同于2014年9月26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。

§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8月获得中国证监会核准设立批复，并于2013年9月完成工商注册登记，正式成立，注册地北京，注册资本15000万元，具有基金管理资格，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，公募基金和特定客户资产管理业务得到长足发展，公司已成功发行了中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金、中信建投货币市场基金、中信建投稳利保本混合型证券投资基金、中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金、中信建投凤凰货币市场基金五只公募产品，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。公司已经与多家商业银行建立合作关系，与浦发银行、北京银行、上海银行、华夏银行、交通银行、北京农商行等开展业务合作。公司特定客户资产管理业务顺利开展，增速较快，截至2015年6月底，公司专户产品数量已达102只，规模近250亿元，在中国基金业协会公布的专户资产管理规模行业排名里，排名38位；产品类型涵盖股票、债券、期货、可交换债等，产品线已较齐备。除传统业务以外，公司也十分重视创新业务的开发，公司已经与移动互联网公司、传媒公司、第三方支付公司、商业银行、证券公司等合作，为客户提供余额理财等相关服务。

公司作为财富管理公司，秉承"忠于信，健于投"，追求稳健的投资收益，以回馈客户的信任。公司致力于打造资产管理行业一流的团队、最具影响力的品牌、最为稳定优秀的业绩，跻身国内一流基金管理公司的行列。

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	本基金的基金经理	2014年9月26日	-	5	中国籍，1982年2月生，中央财经大学证券投资专业硕士。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，从事投资研究工作。现任中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金、中信建投稳利保本混合型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期是指本基金基金合同生效之日。

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。

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

2015年上半年，宏观经济虽然出现了探底企稳的迹象，但还并没有实际稳定，通胀则一直保持低位；为防范经济下滑过快的风险，上半年政策刺激力度明显加大，上半年内三次降息，一次全面降准，两次定向降准，与此同时采取地方债置换的方式解决债务问题。但从实际的效果来看，虽然房地产市场量价出现回暖，但房地产投资并没有跟进回升，汽车家电等终端需求也显疲弱，整个实体经济依然低迷。

资本市场来看，债券市场对政策的敏感性在降低，一季度整体呈现震荡走势，二季度受到货币利率下行影响，短端收益率中枢明显下移，但长端收益率下降幅度明显偏弱，收益率曲线陡峭化走势明显；股票市场则走势分化，6月份之前创业板为代表的中小盘成长股大幅上涨，走势明显强于大盘股，随后市场出现了大幅下跌，大盘股则因为前期滞涨而跌幅较小。

本基金在对央行宽松政策判断的前提下，一季度债券方面采取中等久期，适度杠杆率和较高资质的债券配置策略，二季度后在对长端品种相对谨慎的前提下，信用债配置采取了短久期、高评级的保守投资策略；与此同时，本基金根据CPPI策略和产品净值增长情况，逐步加大了权益类投资比例，以成长股配置为主，获得了较好的投资收益，并且在6月中旬主动大幅降低了权益投资仓位，从而很大程度上减少了市场下跌对净值的冲击。

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1.197元，本报告期份额净值增长率为19.10%，同期业绩比较基准收益率为1.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济增速和通胀水平虽依然处在底部区域，但二季度货币政策带动房地产销售火热，可能逐步向投资链条延伸，加之前期财政政策效果的逐步显现，有望带动经济在下半年实现企稳，乐观预期下可能出现小幅的回升。政策角度来看，经济虽然可能企稳，但反弹力度依然偏弱，因而货币政策仍在宽松周期中，财政政策加码还会继续。

从债券市场角度来看，二季度短端收益率出现大幅下行，目前期限利差处于历史较高水平，在货币政策依然宽松的背景下，长端品种吸引力凸显，但受制于地方债供给的加大和经济在下半年企稳的预期，下行空间也有限，难以突破前期低点。股票市场角度来看，前期的剧烈下跌，一定程度上释放了前期上涨和加杠杆过快积累的风险，经过监管一系列救市措施，市场有望逐步稳定；而从中长期来看，许多股票也已经在估值上出现了吸引力；因此，总体判断市场将会维持震荡格局，但许多个股的投资机会已经逐步显现。

综合各项因素，本基金下半年的债券配置采取较短久期和较高评级的策略，与此同时，在控制风险和仓位的前提下，积极寻找具有投资价值的股票，争取为投资者获取稳健的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金遵循下列6.4 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，委员包括稽察长、投资研究部、特定资产管理部、交易部、产品设计、稽控合规部、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有关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.由估值委员会审议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核，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及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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金自2015年1月1日起至2015年6月30日止期间未实施利润分配。

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

本基金自2015年1月1日起至2015年6月30日止期间未发生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损害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内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本半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：中信建投稳利保本混合型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产：			
银行存款		7,520,564.70	4,584,996.82
结算备付金		1,217,785.74	6,368,838.53
存出保证金		458,518.40	31,733.05
交易性金融资产		240,155,565.02	444,198,266.16
其中：股票投资		19,675,045.12	56,204,062.24
基金投资		-	-
债券投资		220,480,519.90	387,994,203.92
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		-	-
应收证券清算款		3,263,832.87	1,000,000.00
应收利息		4,211,754.61	5,089,306.06
应收股利		-	-
应收申购款		21,739.13	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		256,849,760.47	461,273,140.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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		-	76,499,725.75
应付证券清算款		-	405,012.60
应付赎回款		4,217,343.53	2,056,066.42
应付管理人报酬		275,584.08	405,246.11
应付托管费		45,930.71	67,541.02
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		502,687.17	81,200.30
应交税费		-	-
应付利息		-	37,302.27
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		205,014.80	60,980.17
负债合计		5,246,560.29	79,613,074.64
所有者权益：			
实收基金		210,183,845.46	379,675,002.02
未分配利润		41,419,354.72	1,985,063.96
所有者权益合计		251,603,200.18	381,660,065.98
负债和所有者权益总计		256,849,760.47	461,273,140.62

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值人民币1.197元，基金份额总额210,183,845.46份。

6.2 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：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入		64,861,016.52	-
1.利息收入		7,797,146.62	-
其中：存款利息收入		63,395.47	-
债券利息收入		7,692,673.00	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		41,078.15	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）		52,906,426.80	-
其中：股票投资收益		51,880,418.22	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		809,147.50	-
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		216,861.08	-
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）		2,827,056.39	-
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）		-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）		1,330,386.71	-
减：二、费用		5,623,371.07	-
1. 管理人报酬		1,977,093.08	-
2. 托管费		329,515.46	-
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		944,490.98	-
5. 利息支出		2,212,938.01	-
其中：卖出回购金融资产支出		2,212,938.01	-
6. 其他费用		159,333.54	-
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		59,237,645.45	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		59,237,645.45	-

注：本基金于2014年9月26日成立，无上年度可比期间数据。

6.3 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：2015年1月1日 至 2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6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）	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（本期净利润）	-	59,237,645.45	59,237,645.45
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）	-169,491,156.56	-19,803,354.69	-189,294,511.25
其中：1.基金申购款	5,356,885.25	437,689.57	5,794,574.82
2.基金赎回款	-174,848,041.81	-20,241,044.26	-195,089,086.07
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）	210,183,845.46	41,419,354.72	251,603,200.18

项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-

注：本基金于2014年9月26日成立，无上年度可比期间数据。

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______ ______蒋月勤______ ______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

中信建投稳利保本混合型证券投资基金（以下简称"本基金"），系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》的注册，由中信建投基金管理有限公司于2014年9月12日至2014年9月24日向社会公开募集，募集期结束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号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2014年9月26日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的有效认购金额为人民币464,675,494.18元，有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币32,923.00元，以上实收基金合计为人民币464,708,417.18元，折合464,708,417.18份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均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。

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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行交易的债券、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，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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%。本基金业绩比较基准为：两年期银行定期存款税后收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称"企业会计准则"）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》 第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

采用若干修订后/新会计准则：

2014年1至3月，财政部制定了《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》和《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》和《企业会计准则第33号——合并财务报表》，上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月，财政部修订了《企业会计准则第37号——金融工具列报》，在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

2014年11月13日，中国证券投资基金业协会发布《关于发布<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>的通知》。本基金管理人经与相关托管银行、会计师事务所协商一致，自2015年3月23日起，对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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除6.4.5.2会计估计变更的说明所述外，与最近一期年度报告相一致。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

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》，自2015年3月23日起，本基金管理人对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格进行估值。详情请见本基金管理人于2015年3月24日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站发布的《关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正事项。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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、基金注册登记机构、基金销售机构
北京银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
北京中关村科技融资担保有限公司	基金保证人
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
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。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	82.45%	-	-

注：本基金于2014年9月26日成立，无上年度可比期间数据。

6.4.8.1.2债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	2,454,964.89	100.00%	-	-

注：本基金于2014年9月26日成立，无上年度可比期间数据。

6.4.8.1.3债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	1,080,000,000.00	91.76%	-	-

注：本基金于2014年9月26日成立，无上年度可比期间数据。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易，本基金于2014年9月26日成立，无上年度可比期间数据。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30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	330,686.69	77.14%	400,516.34	80.34%

注：本基金于2014年9月26日成立，无上年度可比期间数据。

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 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,977,093.08	-
其中：支付销售机构的客户维护费	1,132,556.20	-

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731,987.25元；应支付中信建投证券股份有限公司的客户维护费为400,568.95元。

3、保证费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。本会计期间应支付基金保证人北京中关村科技融资担保有限公司的保证费为326,000.33元。

4、本基金的合同于2014年9月26日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	329,515.46	-

注：1、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。

2、本基金的合同于2014年9月26日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易，本基金于2014年9月26日成立，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末运用固有资金投资本基金，本基金于2014年9月26日成立，无上年度可比期间数据。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	7,520,564.70	46,080.24	-	-

注：1、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。

2、本基金的合同于2014年9月26日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券，本基金于2014年9月26日成立，无上年度可比期间数据。

6.4.8.7 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，本基金于2014年9月26日成立，无上年度可比期间数据。

6.4.9 期末（ 2015年6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

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300487	蓝晓科技	2015年6月24日	2015年7月8日	新股流通受限	14.83	14.83	500	7,415.00	7,415.00	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000863	三湘股份	2015年2月16日	重大事项	11.12	2015年7月24日	8.27	500,000	3,735,329.46	5,560,000.00	-
000782	美达股份	2015年6月8日	重大事项	21.12	-	-	155,201	4,113,860.15	3,277,845.12	-
600978	宜华木业	2015年6月18日	重大事项	18.59	-	-	200,000	3,557,383.33	3,718,000.00	-

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

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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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

银行存款、结算备付金、卖出回购金融资产款等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1)各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币88,406,719.90元，属于第二层次的余额为人民币151,748,845.12元，无属于第三层级的余额。

(2)公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转换。

本基金本报告期间持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

2、承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

3、其他事项

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	19,675,045.12	7.66
	其中：股票	19,675,045.12	7.66
2	固定收益投资	220,480,519.90	85.84
	其中：债券	220,480,519.90	85.84
	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	-	-
	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	8,738,350.44	3.40
7	其他各项资产	7,955,845.01	3.10
8	合计	256,849,760.47	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,087,445.12	2.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	3,277,600.00	1.30
K	房地产业	9,310,000.00	3.70
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	19,675,045.12	7.82

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000863	三湘股份	500,000	5,560,000.00	2.21
2	002146	荣盛发展	300,000	3,750,000.00	1.49
3	600978	宜华木业	200,000	3,718,000.00	1.48
4	000782	美达股份	155,201	3,277,845.12	1.30
5	601318	中国平安	40,000	3,277,600.00	1.30
6	603589	口子窖	2,000	50,680.00	0.02
7	300485	赛升药业	500	33,505.00	0.01
8	300487	蓝晓科技	500	7,415.00	0.00

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

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	002146	荣盛发展	16,291,730.80	4.27
2	600767	运盛实业	13,168,402.00	3.45
3	002373	千方科技	12,162,365.82	3.19
4	601318	中国平安	8,930,529.04	2.34
5	601988	中国银行	8,811,000.00	2.31
6	300291	华录百纳	8,419,734.97	2.21
7	600223	鲁商置业	7,965,915.05	2.09
8	002033	丽江旅游	7,743,397.95	2.03
9	300306	远方光电	7,110,808.00	1.86
10	300325	德威新材	6,952,777.90	1.82
11	600068	葛洲坝	6,904,445.18	1.81
12	601688	华泰证券	6,733,554.20	1.76
13	002156	通富微电	6,524,878.42	1.71
14	300352	北信源	6,519,957.00	1.71
15	002470	金正大	6,514,433.44	1.71
16	601628	中国人寿	6,392,014.16	1.67
17	000024	招商地产	6,377,194.42	1.67
18	002202	金风科技	5,947,068.95	1.56
19	601166	兴业银行	5,908,792.50	1.55
20	002056	横店东磁	5,712,931.70	1.50

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

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	600767	运盛实业	15,250,788.40	4.00
2	002373	千方科技	14,114,305.01	3.70
3	000625	长安汽车	13,685,682.45	3.59
4	002156	通富微电	12,425,939.68	3.26
5	300352	北信源	12,364,789.00	3.24
6	002146	荣盛发展	12,278,567.66	3.22
7	300291	华录百纳	11,972,021.78	3.14
8	002033	丽江旅游	10,829,820.48	2.84
9	601166	兴业银行	10,630,873.98	2.79
10	300325	德威新材	10,098,062.00	2.65
11	600223	鲁商置业	9,931,972.28	2.60
12	000978	桂林旅游	9,539,980.37	2.50
13	300306	远方光电	9,222,791.60	2.42
14	600016	民生银行	8,944,054.73	2.34
15	002293	罗莱家纺	8,922,830.58	2.34
16	002389	南洋科技	8,802,282.00	2.31
17	601988	中国银行	8,672,001.00	2.27
18	002104	恒宝股份	7,804,683.90	2.04
19	002470	金正大	7,540,103.95	1.98
20	600068	葛洲坝	7,498,028.13	1.96

7.4.3 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	343,882,743.77
卖出股票收入（成交）总额	430,758,372.78

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,146,000.00	8.01
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	89,517,519.90	35.58
5	企业短期融资券	30,207,000.00	12.01
6	中期票据	80,610,000.00	32.04
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	220,480,519.90	87.63

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	1382132	13宇通MTN1	200,000	20,552,000.00	8.17
2	122068	11海螺01	200,000	20,310,000.00	8.07
3	122227	13尖峰01	200,010	20,199,009.90	8.03
4	122214	12大秦债	200,000	20,160,000.00	8.01
5	150307	15进出07	200,000	20,146,000.00	8.01

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1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。

7.10.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末进行国债期货投资。

7.11.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末进行国债期货投资。

7.11.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末进行国债期货投资。

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	458,518.40
2	应收证券清算款	3,263,832.87
3	应收股利	-
4	应收利息	4,211,754.61
5	应收申购款	21,739.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,955,845.01

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300487	蓝晓科技	7,415.00	0.00	新股锁定

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	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
2,896	72,577.29	6,598,518.24	3.14%	203,585,327.22	96.86%

8.3 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	115,849.01	0.0600%

8.4 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	0~10
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（ 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	379,675,002.02
本报告期基金总申购份额	5,356,885.25
减：本报告期基金总赎回份额	174,848,041.81
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	210,183,845.46

§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

中信建投基金管理有限公司总经理袁野先生于2015年4月23日离任，转任公司常务副总经理，离任期间由公司董事长代行总经理职务。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

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。

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		应支付该券商的佣金		备注
		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	
中信建投证券股份有限公司	2	647,897,083.31	82.45%	330,686.69	77.14%	-
国金证券股份有限公司	2	127,155,366.38	16.18%	90,331.24	21.07%	-
安信证券股份有限公司	1	10,777,947.38	1.37%	7,656.58	1.79%	-

注：1、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》，本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、市场的领导及投资研究部、特定资产管理部、稽控合规部负责人组成的办公会议集体讨论决定，经公司办公会通过后，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，评估结果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、投资研究工作的支持和配合。

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。

3、本基金本报告期末新增和剔除交易单元。

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		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
中信建投证券股份有限公司	2,454,964.89	100.00%	1,080,000,000.00	91.76%	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	97,000,000.00	8.24%	-	-

中信建投基金管理有限公司

2015年8月26日