# 中信建投稳利保本2号混合型证券投资基金

## 2016 第二季度 报告

2016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
报告送出日期:2016年7月19日

§1 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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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2016年7月15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,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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 中信建投稳利保本2号 |
| 交易代码 | 001914 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年11月11日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,711,455,543.73份 |
| 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,以下简称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产品,属证券投资基金中的低风险品种,其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,高于货币市场基金和债券型基金。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。 |
| 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 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2016年4月1日 — 2016年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 9,688,231.85 |
| 2.本期利润 | 8,644,202.63 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0050 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,740,083,757.09 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.017 |

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(不含公允价值变动损益)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。

2、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 本报告期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 | 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 | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.49% | 0.07% | 0.52% | 0.01% | -0.03% | 0.06% |

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

中信建投稳利保本2号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2015年11月11日生效,截至本报告期末,本基金基金合同生效不满一年。

2、截至本报告期末,本基金已完成建仓,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 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 | 2015年11月11日 | - | 6 | 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,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、中信建投稳盛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》、《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 公平交易专项说明

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

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年二季度,房地产市场保持较高活跃度,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,需求改善继续,经济数据保持稳定;与此同时,CPI二季度有所回落,而PPI通缩幅度持续收窄。政策角度,货币政策保持稳健,财政政策持续发力。

市场方面,进入二季度,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,信用市场出现了一波明显的收益率反弹,随后逐步回落,整个季度收益率呈现先上后下的走势;股票市场方面,二季度呈现震荡走势,上证指数4月底5月初经历了一波调整,随后整个5月在底部区域整理,6月底开始出现反弹,整体上2季度上证指数在2800点到3100点的区域震荡。

操作方面,由于对于二季度债券市场调整有所预判,本基金的债券持仓以短端品种为主,因此在二季度的债券市场调整中未受到明显损失;在二季度的股票投资中,对市场的判断相对一季度稍转乐观,本基金结合市场与产品净值积累状况,按照CPPI策略,进行了少量仓位的股票投资,在二季度末的反弹中对净值产生了一定积极贡献。

4.5 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1.017元,本报告期份额净值增长率为0.49%,同期业绩比较基准收益率为0.52%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 26,531,660.24 | 1.52 |
| | 其中:股票 | 26,531,660.24 | 1.52 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 1,635,992,000.00 | 93.77 |
| | 其中:债券 | 1,635,992,000.00 | 93.77 |
| | 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 | 49,500,274.25 | 2.84 |
| | 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 | 9,414,266.96 | 0.54 |
| 8 | 其他资产 | 23,314,866.42 | 1.34 |
| 9 | 合计 | 1,744,753,007.87 | 100.00 |

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

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 14,904,955.94 | 0.86 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,265,598.00 | 0.30 |
| 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 | 9,306.30 | 0.00 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 6,351,800.00 | 0.37 |
| 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 | 26,531,660.24 | 1.52 |

5.2.2 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持有沪港通股票。

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300296 | 利亚德 | 253,200 | 8,016,312.00 | 0.46 |
| 2 | 000002 | 万 科A | 260,000 | 6,351,800.00 | 0.37 |
| 3 | 000531 | 穗恒运A | 430,900 | 5,265,598.00 | 0.30 |
| 4 | 002688 | 金河生物 | 400,000 | 4,500,000.00 | 0.26 |
| 5 | 002366 | 台海核电 | 40,000 | 2,132,400.00 | 0.12 |
| 6 | 300512 | 中亚股份 | 1,873 | 187,150.16 | 0.01 |
| 7 | 300515 | 三德科技 | 1,354 | 63,461.98 | 0.00 |
| 8 | 300520 | 科大国创 | 926 | 9,306.30 | 0.00 |
| 9 | 002805 | 丰元股份 | 971 | 5,631.80 | 0.00 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 89,991,000.00 | 5.17 |
| | 其中:政策性金融债 | 89,991,000.00 | 5.17 |
| 4 | 企业债券 | 283,476,000.00 | 16.29 |
| 5 | 企业短期融资券 | 1,232,717,000.00 | 70.84 |
| 6 | 中期票据 | 29,808,000.00 | 1.71 |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,635,992,000.00 | 94.02 |

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

| 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(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 150222 | 15国开22 | 900,000 | 89,991,000.00 | 5.17 |
| 2 | 122395 | 15富力债 | 500,000 | 51,815,000.00 | 2.98 |
| 3 | 041554079 | 15珠海科CP002 | 500,000 | 50,250,000.00 | 2.89 |
| 4 | 112272 | 15金科01 | 500,000 | 50,230,000.00 | 2.89 |
| 5 | 011588005 | 15微投资SCP005 | 500,000 | 50,210,000.00 | 2.89 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 172,735.03 |
| 2 | 应收证券清算款 | 259,126.58 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 22,883,004.81 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 23,314,866.42 |

5.11.4 报告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可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000002 | 万 科A | 6,351,800.00 | 0.37 | 临时停牌 |
| 2 | 300512 | 中亚股份 | 187,150.16 | 0.01 | 新股锁定 |
| 3 | 300515 | 三德科技 | 63,461.98 | 0.00 | 新股锁定 |
| 4 | 300520 | 科大国创 | 9,306.30 | 0.00 | 新股锁定 |
| 5 | 002805 | 丰元股份 | 5,631.80 | 0.00 | 新股锁定 |

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,774,105,189.27 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 434,620.12 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 63,084,265.66 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,711,455,543.73 |

§7 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

本报告期内,基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 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。

§9 备查文件目录

9.1 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2号混合型证券投资基金基金合同》;

3、《中信建投稳利保本2号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。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所。

9.3 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
2016年7月19日

# 中信建投医改灵活配置混合型证券投资基金

## 2016 第二季度 报告

2016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:渤海银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月19日

§1 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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人渤海银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月15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,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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 中信建投医改 |
| 交易代码 | 002408 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年4月6日 |
| 报告期末基金份额总额 | 61,645,296.30份 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于医疗改革受益(包括但不限于医疗信息化和数字医疗、生物制药、慢病管理、精准医疗等)股票等权益类资产和债券等固定收益类金融工具,通过灵活的资产配置与严谨的风险管理,力求超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金采用自上而下的策略,通过对宏观经济基本面(包括经济运行周期、财政及货币政策、产业政策等)的分析判断,和对流动性水平(包括资金面供需情况、证券市场估值水平等)的深入研究,分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益,并据此对本基金资产在股票、债券、现金之间的投资比例进行动态调整。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*60%+中债综合指数收益率*40% |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中中高预期风险、中高预期收益的品种。 |
| 基金管理人 | 中信建投基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 渤海银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2016年4月6日 — 2016年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 1,051,794.45 |
| 2.本期利润 | 1,052,394.45 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0072 |
| 4.期末基金资产净值 | 62,254,801.01 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.010 |

注:1、本基金基金合同于2016年4月6日生效,截至报告期末不足一个季度。

2、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。

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。

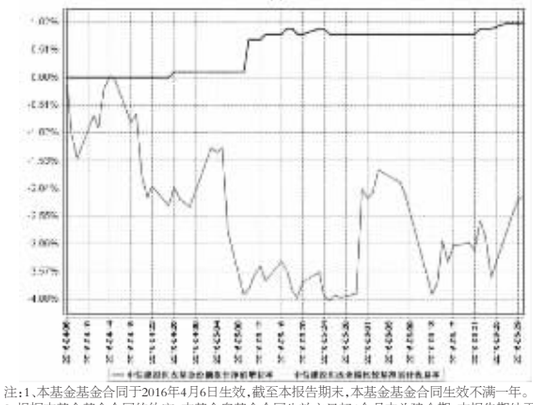
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 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 | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.00% | 0.09% | -2.18% | 0.61% | 3.18% | -0.52% |

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

中信建投医改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2016年4月6日生效,截至本报告期末,本基金基金合同生效不满一年。

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,本报告期处于建仓期内。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 刘宁 | 本基金的基金经理 | 2016年4月6日 | - | 5 | 中国籍,1984年6月生,北京工业大学光学硕士,曾任天相顾问投资分析部TMT组组长;建信人寿资产管理部权益投资专员;嘉合基金权益投资二部基金经理;现任中信建投基金管理有限公司投资研究部基金经理,担任中信建投医改灵活配置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,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指导意见》、《中信建投睿信灵活配置证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规,没有运用基金资产进行内幕交易、操纵市场或进行损害基金份额持有人利益的关联交易,基金运作整体合法合规。基金管理人将继续本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产,在基金规范运作和严格控制风险的基础上,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

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

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 报告期内基金投资策略和运作分析

由于英国脱欧事件增加了国际市场的不确定性,美联储对加息时机的讨论更为谨慎,使投资者对16年加息次数预期从年初的4次下调为1次,但进入加息周期的预期并未改变。欧洲和日本央行仍存在扩大货币宽松的需要,但长期国债利率的不断下降加大了银行、保险业的风险,货币宽松的边际效用下降使各国央行的传统工具难于起作用。国内经济处于衰退的后期,"L型"经济底成为市场的共识,调控重点转为供给侧改革和降金融杠杆同时进行,下半年信用债到期规模进入高峰,违约事件将进一步增多,但积极的财政政策和政府行政能力使总体风险可控。

第二季度,监管政策从临床、生产至到流通环节细则逐步落地,整体执行力度强、时间表清晰,监管框架逐步向发达国家趋同,未来将有效地促进行业公司转型升级。在医保费用总量控制的目标下,调整医疗服务和药品耗材的占比,整合规范商业流通渠道,将使医事服务行为从以药养医回归到医疗本身,长期利好各领域龙头公司、研发创新型公司。

本基金以绝对收益为导向,力求获得超越行业基准的回报。上半年大宗商品价格反弹,商品期货的投资回报率高于股票等其他类资产,A股小盘股存在一定的结构性机会,但我们认为风险偏好修复带来的结构性机会存在较大不确定性。在股票、债券、货币的大类资产配置框架指导下,第二季度本基金以固定收益投资为主,适当参与了主题股票的结构性机会,展望第三季度基金将择机参与主题股票的配置机会。

4.5 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1.010元,本报告期份额净值增长率为1.00%,同期业绩比较基准收益率为-2.18%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 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 | 2,999,700.00 | 4.73 |
| | 其中:债券 | 2,999,700.00 | 4.73 |
| | 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 | 58,000,150.00 | 91.38 |
| | 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 | 532,459.25 | 0.84 |
| 8 | 其他资产 | 1,939,267.59 | 3.06 |
| 9 | 合计 | 63,471,576.84 | 100.00 |

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 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持有沪港通股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 2,999,700.00 | 4.82 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,999,700.00 | 4.82 |

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

| 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(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 019518 | 15国债18 | 30,000 | 2,999,700.00 | 4.82 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 10,360.97 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,837,996.77 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 90,909.85 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,939,267.59 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资股票。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日(2016年4月6日)基金份额总额 | 246,232,430.19 |
| 报告期期初基金份额总额 | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 1,511,912.61 |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 186,099,046.50 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 61,645,296.30 |

§7 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

本报告期内,基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《中信建投医改灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《中信建投医改灵活配置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。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所。

9.3 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
2016年7月19日

# 中信建投添鑫宝货币市场基金

## 2016 第二季度 报告

2016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:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月19日

§1 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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18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,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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 中信建投添鑫宝 |
| 交易代码 | 002260 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年12月16日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,964,824,377.57份 |
| 投资目标 | 在保持基金资产的低风险和高流动性前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将通过对宏观经济发展态势、财政与货币政策、市场及其结构变化和短期的资金供需等因素的分析,形成对市场短期利率走势的判断。在以上分析的基础上,本基金将根据不同类别资产的收益率水平(不同剩余期限到期收益率、利息支付方式以及提投资便利性),结合各类资产的流动性特征(成交活跃度、发行规模)和风险特征(信用等级、波动性),决定各类资产的配置比例和期限结构配置情况。 |
| 业绩比较基准 | 七天通知存款税后利率 |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。 |
| 基金管理人 | 中信建投基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2016年4月1日 — 2016年6月30日) |
|---|---|
| 1. 本期已实现收益 | 6,287,809.74 |
| 2. 本期利润 | 6,287,809.74 |
| 3. 期末基金资产净值 | 2,964,824,377.57 |

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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金的利润分配按月结转基金份额。

3、持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

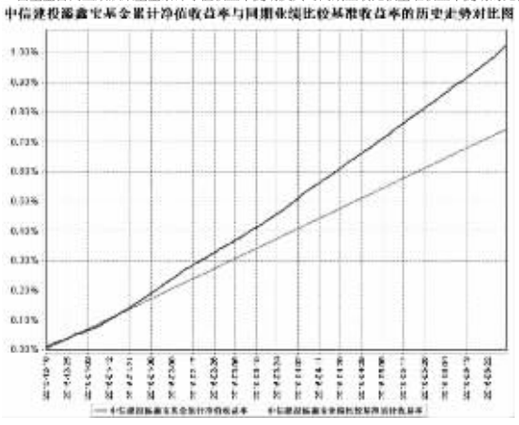
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 0.5259% | 0.0007% | 0.3413% | 0.0000% | 0.1846% | 0.0007% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中信建投添鑫宝基金累计净值收益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2015年12月16日生效,截至本报告期末,本基金基金合同生效不满一年。

2、截至本报告期末,本基金已完成建仓,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 索霁石 | 本基金的基金经理 | 2014年1月27日 | - | 6 | 中国籍,1983年8月生,北京大学软件工程硕士,FRM、CQF认证,具备银行间本币市场交易员、基金从业资格,曾就职于信达证券固定收益部,从事固定收益证券投资相关工作;现就职于中信建投基金管理有限公司投资研究部,从事投资研究相关工作,担任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、中信建投风盈货币市场基金、中信建投添鑫宝货币市场基金基金经理。 |
| 黄海浩 | 本基金的基金经理 | 2016年5月25日 | - | 5 | 中国籍,1985年10月生,山东大学物流工程工程学学士,曾任利顺金融(亚洲)有限责任公司交易部Broker、平安利顺国际货币经纪有限责任公司交易部Broker、国投瑞银基金管理有限公司交易部债券交易员,中信建投基金管理有限公司交易部交易员,现任投资研究部基金经理,担任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、中信建投风盈货币市场基金、中信建投添鑫宝货币市场基金基金经理。 |

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,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指导意见》、《中信建投睿信灵活配置证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规,没有运用基金资产进行内幕交易、操纵市场或进行损害基金份额持有人利益的关联交易,基金运作整体合法合规。基金管理人将继续本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产,在基金规范运作和严格控制风险的基础上,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易指导意见》,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

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年二季度,整体来看资金面仍然维持相对宽松的状态,但也出现了资金利率波动的情况。4月,债市在央行货币政策预期、美联储6、7月加息预期等的干扰下收益率回调明显。随着5月经济数据公布,市场机构对债券的配置需求更为积极主动,收益率一路下行明显。

展望2016下半年,目前中国经济仍处于L型平台探底的阶段,国企改革、供给侧改革等一系列改革会对经济增长可能产生一定影响。在经济下行的背景下,央行需要维持相对宽松的货币环境,防止系统性风险的爆发。因此我们认为央行货币政策态度趋于中性,以维稳为主。在坚持审慎操作、确保组合安全性和流动性的前提下,我们加强投资风险控制,平衡配置债券、存单、存款等,精细管理现金资产,努力为投资者创造合理稳定的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报