

# 中信稳定双利债券型证券投资基金 2007年第二季度报告

**重要提示**  
中信稳定双利债券型证券投资基金管理人——中信基金管理有限责任公司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。  
本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2007年7月13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。  
按照中国证监会《证券投资基金管理暂行办法》第四章——季度报告的内容与格式》第五条“基金年度报告应当在每年结束之日起4个月内编制完成并公告，但因特殊情况不能按时完成的，经中国证监会同意，可以适当延长，但应说明原因。基金管理人应当在公告前向中国证监会报告”之规定，本基金本报告期内财务数据未经审计。

(一)基金的基本情况  
基金名称：中信稳定双利债券型证券投资基金  
基金简称：中信稳定双利债券基金  
基金运作方式：契约型开放式  
基金合同生效日期：2006年7月10日  
报告期末基金资产净值总额：3,392,764,152.64份

投资目标：本基金将根据宏观经济运行状况、货币政策走势及利率走势的综合判断，在控制利率风险、通胀风险和信用风险的基础上，采用久期匹配策略组合久期的滚动调整，充分运用各种盈利策略提升组合的绝对回报率，实现基金净值的稳定增长。

投资策略：本基金将根据宏观经济运行状况、货币政策走势及利率走势的综合判断，在控制利率风

险、通胀风险和信用风险的基础上，采用久期匹配策略组合久期的滚动调整，充分运用各种盈利策

略提升组合的绝对回报率，实现基金净值的稳定增

长。

风险收益特征：本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金，高于货币市

场基金。

基金管理人：中信基金管理有限责任公司  
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

三、主要财务指标  
(一) 主要财务指标

项目	金额(单位:人民币元)			
基金本期期初余额	165,770,369.50			
期末基金资产净值	3,296,267,850.80			
加权平均基金份额本期净收益	0.0487			
期末基金份额净值	1.0600			
上述本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。				
二、(二) 基金净值表现 与同期业绩比较基准收益率比较表				
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
本报告期	36.4%	0.21%	-12.1%	0.05%
1. 中信稳定双利债券型基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比				
4. 报告期内基金持有人数变动情况				
5. 报告期内基金资产组合情况				
6. 投资组合报告附注				

7. 其他需要说明的事项

8. 备查文件目录

9. 其他重要事项

10. 其他需要说明的事项

11. 其他需要说明的事项

12. 其他需要说明的事项

13. 其他需要说明的事项

14. 其他需要说明的事项

15. 其他需要说明的事项

16. 其他需要说明的事项

17. 其他需要说明的事项

18. 其他需要说明的事项

19. 其他需要说明的事项

20. 其他需要说明的事项

21. 其他需要说明的事项

22. 其他需要说明的事项

23. 其他需要说明的事项

24. 其他需要说明的事项

25. 其他需要说明的事项

26. 其他需要说明的事项

27. 其他需要说明的事项

28. 其他需要说明的事项

29. 其他需要说明的事项

30. 其他需要说明的事项

31. 其他需要说明的事项

32. 其他需要说明的事项

33. 其他需要说明的事项

34. 其他需要说明的事项

35. 其他需要说明的事项

36. 其他需要说明的事项

37. 其他需要说明的事项

38. 其他需要说明的事项

39. 其他需要说明的事项

40. 其他需要说明的事项

41. 其他需要说明的事项

42. 其他需要说明的事项

43. 其他需要说明的事项

44. 其他需要说明的事项

45. 其他需要说明的事项

46. 其他需要说明的事项

47. 其他需要说明的事项

48. 其他需要说明的事项

49. 其他需要说明的事项

50. 其他需要说明的事项

51. 其他需要说明的事项

52. 其他需要说明的事项

53. 其他需要说明的事项

54. 其他需要说明的事项

55. 其他需要说明的事项

56. 其他需要说明的事项

57. 其他需要说明的事项

58. 其他需要说明的事项

59. 其他需要说明的事项

60. 其他需要说明的事项

61. 其他需要说明的事项

62. 其他需要说明的事项

63. 其他需要说明的事项

64. 其他需要说明的事项

65. 其他需要说明的事项

66. 其他需要说明的事项

67. 其他需要说明的事项

68. 其他需要说明的事项

69. 其他需要说明的事项

70. 其他需要说明的事项

71. 其他需要说明的事项

72. 其他需要说明的事项

73. 其他需要说明的事项

74. 其他需要说明的事项

75. 其他需要说明的事项

76. 其他需要说明的事项

77. 其他需要说明的事项

78. 其他需要说明的事项

79. 其他需要说明的事项

80. 其他需要说明的事项

81. 其他需要说明的事项

82. 其他需要说明的事项

83. 其他需要说明的事项

84. 其他需要说明的事项

85. 其他需要说明的事项

86. 其他需要说明的事项

87. 其他需要说明的事项

88. 其他需要说明的事项

89. 其他需要说明的事项

90. 其他需要说明的事项

91. 其他需要说明的事项

92. 其他需要说明的事项

93. 其他需要说明的事项

94. 其他需要说明的事项

95. 其他需要说明的事项

96. 其他需要说明的事项

97. 其他需要说明的事项

98. 其他需要说明的事项

99. 其他需要说明的事项

100. 其他需要说明的事项

101. 其他需要说明的事项

102. 其他需要说明的事项

103. 其他需要说明的事项

104. 其他需要说明的事项

105. 其他需要说明的事项

106. 其他需要说明的事项

107. 其他需要说明的事项

108. 其他需要说明的事项

109. 其他需要说明的事项

110. 其他需要说明的事项

111. 其他需要说明的事项

112. 其他需要说明的事项

113. 其他需要说明的事项

114. 其他需要说明的事项

115. 其他需要说明的事项

116. 其他需要说明的事项

117. 其他需要说明的事项

118. 其他需要说明的事项

119. 其他需要说明的事项

120. 其他需要说明的事项

121. 其他需要说明的事项

122. 其他需要说明的事项

123. 其他需要说明的事项

124. 其他需要说明的事项

125. 其他需要说明的事项

126. 其他需要说明的事项

127. 其他需要说明的事项

128. 其他需要说明的事项

129. 其他需要说明的事项

130. 其他需要说明的事项

131. 其他需要说明的事项

132. 其他需要说明的事项

133. 其他需要说明的事项

134. 其他需要说明的事项

135. 其他需要说明的事项

136. 其他需要说明的事项

137. 其他需要说明的事项

138. 其他需要说明的事项

139. 其他需要说明的事项

140. 其他需要说明的事项

141. 其他需要说明的事项

142. 其他需要说明的事项

143. 其他需要说明的事项