

**一、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基金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—中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2007年10月22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《证券投资基金信息披露内容与格式准则第4号——季度报告的内容与格式》第五条“基金经理报告中涉及的财务数据未经审计，但中国证监会或证券交易所另有规定的除外”的规定，本基金本期报告的财务数据未经审计。

中信基金管理有限责任公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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。投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

**二、基金产品概况**  
基金全称：中信稳定双利债券型证券投资基金  
基金简称：中信稳定双利债券型基金  
基金运作方式：契约型开放式基金

基金合同生效日：2006年1月20日  
报告期末基金份额总额：3,428,894,030.80份

报告类型：本基金主要投资于固定收益类资产，投资目标是在强调基金稳定的前提下，积极追求资产的长期增值。

投资策略：本基金主要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、信用风险以及流动性风险的前提下，采取顺势策略组合久期的动态调整，充分运用各种套利策略提升组合的绝对收益，实现基金净值的增值。

业绩比较基准：80%×中信债基指数+20%×税后一年定期存款利率

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。

基金经理人：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、主要财务指标和基金净值表现**

**(一) 主要财务指标**

项目 金额(单位：人民币元)

1.本期利润 210,833,306.83

2.本期利润减去本期公允价值变动损益后的净额 41,260,812.50

3.加权平均基金份额本期利润 0.0029

4.期末基金资产净值 3,696,224,634.83

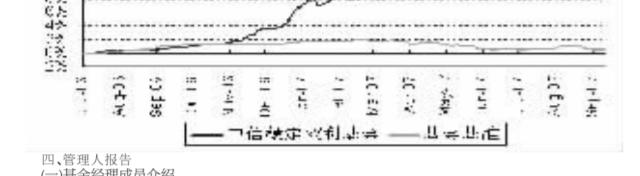
5.期末基金份额净值 1.0790

注：2007年7月1日基金重新评估后，原“基金本期净收益”名称调整为“本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额”，即“加权平均基金份额本期净收益”=第2项/(第1项+第3项)。

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列示的数字。

**(二) 基金净值表现**

中信稳定双利债券型基金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



四、管理人报告

**(一) 基金经理介绍**

张伟强先生，经济学硕士。7年证券从业经历，历任中信证券股份有限公司研究咨询部助理分析师，分析师，中信证券股份有限公司债券营销交易部经理，产品设计主管，总监等职。2006年7月加盟中信

**一、重要提示**  
中信经典配置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基金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—招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2007年10月23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《证券投资基金信息披露内容与格式准则第4号——季度报告的内容与格式》第五条“基金经理报告中涉及的财务数据未经审计，但中国证监会或证券交易所另有规定的除外”的规定，本基金本期报告的财务数据未经审计。

中信基金管理有限责任公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

**二、基金产品概况**  
基金全称：中信经典配置证券投资基金  
基金简称：中信经典配置  
基金运作方式：契约型开放式基金

基金合同生效日：2004年3月15日

报告期末基金份额总额：1,501,772,595.00份

投资目标：在长线投资的基础上，将战略资产配置与时机选择相结合，积极主动的精选证券，并充分利用创新工具作为动态配置的效率反馈和收益补充，实施全流程的风险管理，力求在风险可控、收益稳定的前提下，实现资本最大的长期增值。

投资策略：本基金的基本投资策略是采取自上而下与自下而上相结合的主动管理,详见本基金的基本策略。

业绩比较基准：沪深300指数\*20%+中债全指指数\*20%+一年定期存款利率

风险收益特征：沪深300指数\*20%+中债全指指数\*20%+一年定期存款利率

基金管理人：中信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

**三、主要财务指标和基金净值表现**

**(一) 主要财务指标**

项目 金额(单位：人民币元)

1.本期利润 796,002,393.65

2.本期利润减去本期公允价值变动损益后的净额 884,599,062.98

3.加权平均基金份额本期利润 0.0322

4.期末基金资产净值 3,481,281,224.29

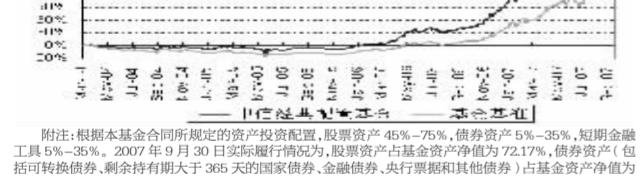
5.期末基金份额净值 2.3181

注：2007年7月1日基金重新评估后，原“基金本期净收益”名称调整为“本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额”，即“加权平均基金份额本期净收益”=第2项/(第1项+第3项)。

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列示的数字。

**(二) 基金净值表现**

中信经典配置基金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

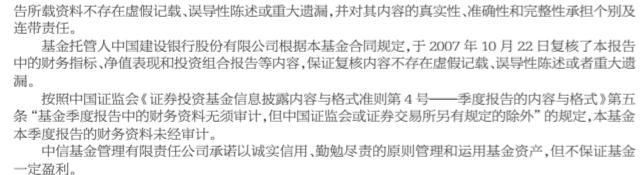


附注：根据本基金合同约定的资产负债配置，股票资产 45%-70%，债券资产 5%-35%，短期金融工具 5%-35%。2007 年 9 月 30 日实际行业配置为：股票资产占基金资产净值为 72.17%，债券资产（包括可转债、债券、债券型基金）占基金资产净值为 13.29%，短期金融工具占基金资产净值为 10.80%。

四、管理人报告

**(一) 基金经理介绍**

中信经典配置基金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



附注：根据本基金合同约定的资产负债配置，股票资产 45%-70%，债券资产 5%-35%，短期金融工具 5%-35%。2007 年 9 月 30 日实际行业配置为：股票资产占基金资产净值为 72.17%，债券资产（包括可转债、债券、债券型基金）占基金资产净值为 13.29%，短期金融工具占基金资产净值为 10.80%。

四、管理人报告

**(一) 基金经理介绍**

中信红利精选股票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基金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—中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2007年10月22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《证券投资基金信息披露内容与格式准则第4号——季度报告的内容与格式》第五条“基金经理报告中涉及的财务数据未经审计，但中国证监会或证券交易所另有规定的除外”的规定，本基金本期报告的财务数据未经审计。

中信基金管理有限责任公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

**二、基金产品概况**  
基金全称：中信红利精选股票型证券投资基金  
基金简称：中信红利精选  
基金运作方式：契约型开放式基金

基金合同生效日：2006年11月17日

报告期末基金份额总额：4,338,198,028.29份

投资目标：本基金将在严格控制投资风险管理的前提下，主要投资于盈利能力增长稳定的红利股，追求稳定的股息收入和一定的资本增值。

投资策略：本基金遵循价值投资的理念，以红利股为主要投资对象，通过自上而下的方法精选个股并获取股息收入和资本的长期增值。以价值和短期金融工具作为降低组合风险的策略性投资工具，通过适当的资产配置来降低整体的系统性风险。（详见本基金的基本情况和招募说明书）

业绩比较基准：80%×沪深300指数+20%×一年定期存款利率

风险收益特征：本基金是一只股票型基金，遵循积极主动的投资理念，以盈利增长稳定的高股息和分红能力较强的股票类品种，在投资组合中属于中等风险的基金产品。本基金力争在严格控制风险的前提下实现基金资产的长期稳健增值。

基金管理人：中信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

**三、主要财务指标和基金净值表现**

**(一) 主要财务指标**

项目 金额(单位：人民币元)

1.本期利润 3,427,699,620.09

2.本期利润减去本期公允价值变动损益后的净额 1,329,234,708.35

3.加权平均基金份额本期利润 0.0368

4.期末基金资产净值 11,836,222,326.54

5.期末基金份额净值 2.7294

2007 年 7 月 1 日基金重新评估后，原“基金本期净收益”名称调整为“本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额”，即“加权平均基金份额本期净收益”=第2项/(第1项+第3项)。

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列示的数字。

**(二) 基金净值表现**

中信红利精选股票型基金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

中信红利精选股票型基金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