

中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3月31日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

重要提示 基金管理人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...

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预示其未来表现。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。

本报告自2017年1月1日起至3月31日止。

基金产品概况 基金名称:中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

基金代码:003908 基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2016年12月7日 报告期末基金份额总额:36,911,677.90份

投资目标 本基金主要投资于股票等权益类金融工具和债券等固定收益类金融工具...

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(包括经济增长、通胀及货币政策)的分析判断...

业绩比较基准 沪深300指数收益率x60%+中债综合指数收益率x40%

风险收益特征 本基金属于混合型证券投资基金,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...

基金管理人:中信建投基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

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(2017年1月1日至2017年3月31日)

1.本期已实现收益 226,340.07 2.本期利润 216,037.92

3.加权平均基金份额本期利润 0.0050 4.期末基金资产净值 37,149,349.61

5.期末基金份额净值 1.0064

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...

2.本基金基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,在申购基金份额时已从基金申购款项中扣除...

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

过去三个月 0.47% 0.02% 2.13% -1.60% -0.27%

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

中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金自基金合同生效以来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图

注:1.本基金基金合同于2016年12月7日生效,基金合同生效起至报告期末未满一年。

2.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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 说明

王琦 本基金的基金经理 2016年12月7日 16 中国籍,1974年7月生,中国人民大学金融学硕士...

周户 本基金的基金经理 2017年1月25日 9 中国籍,1983年2月生,南开大学经济学硕士...

注:1.任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。

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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《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...

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 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 报告期内基金投资策略和运作分析 2017年一季度,宏观经济企稳态势持续,出口延续改善,CPI触底反弹,但PPI触底反弹,财政政策保持积极态势,但货币政策逐步收紧,金融监管力度加强,房地产调控力度加大。

在经济企稳持续,政策温和收紧的环境下,上证综指强于创业板,但大部分时间均以震荡为主,市场风格有所转变,受益经济企稳及涨价预期的煤炭、钢铁、电子、机械、有色、石油石化等板块仍维持上涨,但相对表现弱于成长性确定的家电、食品饮料,同时,受益于“一带一路”、国企改革等预期的建筑、建材、交通运输板块涨幅居前。

本基金处于建仓初期,一季度以固定收益投资为主,较好的分享了资金利率提升的机会,为股票投资积累了一定的安全垫。在股票投资方面,尽管基金管理人较好的布局了成长性确定的板块,如食品饮料、医药等,但基于稳健策略,仓位并未快速提升,一季度净值仅有微弱上涨。展望后市,基金管理人认为结构性机会仍将存在,同时对组合个股前景均有良好预期和信心,相信未来一个阶段能够为持有人带来合理回报。

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1.0064元,本报告期净值增长率为0.47%,同期业绩比较基准收益率为2.13%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 本基金本报告期内本基金管理人无应说明预警事项。

85 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 4,735,476.40 12.47 其中:股票 4,735,476.40 12.47

2 固定收益投资 2,500,750.00 6.59 其中:债券 2,500,750.00 6.59

3 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 29,500,000.00 77.70

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 451,090.03 1.19

8 其他资产 779,428.60 2.05 9 合计 37,966,745.03 100.00

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 - - B 采矿业 - - C 制造业 3,633,006.40 9.78

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 425,120.00 1.14 H 住宿和餐饮业 - -

I 信息技术、软件和信息技术服务业 99,250.00 0.27 J 金融业 307,970.00 0.83

K 房地产业 - - 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 104,130.00 0.28 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 4,735,476.40 12.75

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有通过沪港通机制投资的港股。

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 000423 东阿阿胶 14,000 918,400.00 2.47

2 300447 金信股份 14,000 666,260.00 1.79

3 002653 海思科 36,000 551,520.00 1.48

4 603328 依依电子 12,958 437,980.40 1.18

5 600729 重庆百货 16,000 425,120.00 1.14

6 601965 中国汽研 35,000 357,350.00 0.96

7 600643 爱建集团 23,000 307,970.00 0.83

8 002531 天顺风能 30,000 219,600.00 0.59

9 000998 隆平高科 8,000 166,000.00 0.45

10 002823 惠华药业 6,000 132,360.00 0.36

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 国债债券 2,500,750.00 6.73

2 央行票据 - - 3 金融债券 - -

其中:政策性金融债 - - 4 企业债券 - -

5 中期票据 - - 6 短期融资券 - -

7 可转债(可交换债) - - 8 同业存单 - -

9 其他 - - 10 合计 2,500,750.00 6.73

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 010213 02国债(13) 25,000 2,500,750.00 6.73

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 本期国债期货持仓和损益明细

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 本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 529.41

2 应收证券清算款 734,327.13

3 应收股利 -

4 应收利息 43,583.92

5 应收申购款 988.14

6 预收账款 -

7 其他 -

8 其他 -

9 合计 779,428.60

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 本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

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。

86 开放式基金份额变动情况

报告期末基金份额总额 47,686,882.68

报告期间基金总申购份额 389,692.88

减:报告期间基金总赎回份额 11,164,897.66

报告期间基金净申购份额(份额减少以“-”填列) 324,485.10

报告期末基金份额总额 36,911,677.90

87 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

报告期末管理人持有的本基金份额 10,000,800.00

报告期末管理人持有的基金份额 0.00

报告期末管理人持有的基金份额 0.00

报告期末管理人持有的基金份额 10,000,800.00

报告期末管理人持有的基金份额占报告期末基金份额总额的比例 27.09

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

88 报告期末发起式基金发起资金持有基金份额情况

项目 持有份额占基金总份额的比例(%) 发起份额总额 发起份额占基金总份额的比例(%) 发起份额承诺持有期限

基金管理人自有资金 10,000,800.00 27.09 10,000,800.00 27.09 3年

基金管理人高级管理人员 247,549.75 0.67 - - -

基金管理人股东 - - - - -

其他 - - - - -

合计 10,009,051.92 28.97 10,000,800.00 27.09

89 影响投资者决策的其他重要信息 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者 持有基金份额比例达到或超过20%的期初 期初 赎回 持有基金份额比例

机构投资者 1 20170101-20170331 10,000,800.00 - - 10,000,800.00 27.09

本基金本报告期不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况,请投资者注意本基金的流动性风险和集中度风险。

9.2 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。

10 备查文件目录 1. 中国证监会核准基金募集的文件;

2. 《中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》;

3. 《中信建投睿利灵活配置混合型发起式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。

10.2 存放地点 基金管理人、基金托管人办公场所。

10.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.2 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。

10 备查文件目录 1. 中国证监会核准基金募集的文件;

2. 《中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》;

3. 《中信建投睿利灵活配置混合型发起式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内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

9.3 查阅方式 投资者可以在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。