

# 中信建投睿信灵活配置混合型证券投资 基金更新招募说明书（更新）摘要 （2017 年第 1 号）

基金管理人：中信建投基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

二〇一七年三月

## 重要提示

中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)申请募集的准予注册文件名称为:《关于准予中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可〔2014〕1238号),注册日期为:2014年11月21日。本基金合同于2015年2月3日正式生效。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读招募说明书;基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日为2017年2月3日,有关财务数据和净值表现截止日为2016年12月31日,财务数据未经审计。

## 一、基金管理人

### (一) 基金管理人简况

名称：中信建投基金管理有限公司

住所：北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座19层

邮政编码：100010

法定代表人：蒋月勤

成立日期：2013年9月9日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监许可〔2013〕1108号

经营范围：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。

组织形式：有限责任公司

注册资本：30000万元

联系人：杨露露

电话：010-59100288

存续期间：永久存续

股权结构：中信建投证券股份有限公司占55%、航天科技财务有限责任公司占25%、江苏广传广播传媒有限公司占20%。

### (二) 主要人员情况

#### 1、董事会成员

蒋月勤先生，董事长，成都电子科技大学硕士研究生学历。曾任职中信证券交易部总经理、长盛基金管理有限公司总经理，现任中信建投证券股份有限公司党委委员、执委会委员、董事总经理，兼任中信建投基金管理有限公司董事长。

张杰女士，副董事长、总经理，首都师范大学本科学历。曾任中信建投证券股份有限公司经纪业务管理部行政负责人，现任中信建投基金管理有限公司副董事长、总经理。

陈瑛女士，董事，北京师范大学硕士研究生学历。曾任航天一院211厂总会计师、航天一院财务部副部长、航天一院发射技术及特种车事业部总会计师、航

天投资控股有限公司财务总监, 现任航天科技财务有限责任公司财务总监、中信建投基金管理有限公司董事。

周艳丽女士, 董事, 南京大学硕士研究生学历。曾任江苏省广播电视总台(集团)财务资产部财务主管、科长、主任助理、副主任。现任江苏省广播电视总台(集团)财务资产部副主任(主持工作)、中信建投基金管理有限公司董事。

袁野先生, 职工董事, 德国特里尔大学硕士研究生学历。曾任德国 HVB 银行卢森堡分行产品经理、中信建投证券股份有限公司资产管理部总监、中信建投基金管理有限公司总经理, 现任中信建投基金管理有限公司常务副总经理、职工董事, 兼任元达信资本管理(北京)有限公司执行董事。

杜宝成先生, 独立董事, 北京大学法律系硕士研究生学历。曾任北京市律师协会职员, 中国侨联华联律师事务所律师, 北京市融商律师事务所高级合伙人、律师, 现任北京市融商律师事务所主任、中信建投基金管理有限公司独立董事。

王汀汀先生, 独立董事, 北京大学博士研究生学历。现任中央财经大学副教授、中信建投基金管理有限公司独立董事。

王宏利女士, 独立董事, 北京师范大学硕士研究生学历。曾任北京瑞达会计师事务所部门副经理, 北京中洲光华会计师事务所高级经理, 天健正信会计师事务所合伙人兼事务所人力资源委员会委员兼北京所管理委员会委员, 大华会计师事务所合伙人兼事务所人力资源和薪酬考核委员会委员, 现任大华会计师事务所合伙人兼战略发展和市场管理委员会委员、中信建投基金管理有限公司独立董事。

王禹媚女士, 独立董事, 北京大学硕士研究生学历。曾任申银万国证券家电行业分析师、安信证券传媒行业分析师、中国国际金融有限公司研究部执行总经理、华泰证券股份有限公司研究所董事总经理, 现任华泰联合证券董事总经理、成长企业融资部负责人员、中信建投基金管理有限公司独立董事。

## 2、监事会成员

孔萍女士, 监事会主席, 中国人民大学硕士研究生学历。曾任中国工商银行财务处副科长, 华夏证券股份有限公司财务、稽核、清算部部门总经理, 现任中信建投证券股份有限公司运营管理部行政负责人、中信建投基金管理有限公司监事会主席。

许会芳女士, 监事, 中国人民银行研究生部硕士研究生学历。曾任航天科技

财务有限责任公司风险管理与法律部副总经理，现任航天科技财务有限责任公司风险管理与法律部总经理、中信建投基金管理有限公司监事。

周琰女士，监事，南京大学硕士研究生学历。曾任江苏省广播电视总台投资管理部业务拓展科副科长，现任江苏省广播电视总台投资管理部业务拓展科科长、中信建投基金管理有限公司监事。

张全先生，职工监事，中国人民银行研究生部硕士研究生学历。曾就职于中信建投证券股份有限公司债券承销部、债券销售交易部、资本市场部，现任中信建投基金管理有限公司总经理助理、职工监事，兼任元达信资本管理（北京）有限公司总经理。

陈晨先生，职工监事，北京工业大学本科学历。曾就职于华夏证券股份有限公司信息技术部网络管理岗、中信建投证券股份有限公司信息技术部网络管理岗，现任中信建投基金管理有限公司信息技术部总监、职工监事。

王琦先生，职工监事，中国人民大学博士研究生学历。曾任大通证券股份有限公司研发中心研究员，中关村证券股份有限公司研发中心研究员，中信建投证券股份有限公司交易部总监。现任中信建投基金管理有限公司总经理助理、职工监事。

### 3、高级管理人员

蒋月勤先生，现任公司董事长，简历同上。

张杰女士，现任公司副董事长、总经理，简历同上。

袁野先生，现任公司常务副总经理、职工董事，简历同上。

周建萍女士，北京大学在职研究生学历。曾任航天科技财务有限责任公司投资部总经理、资产管理部总经理、交易部总经理，现任中信建投基金管理有限公司督察长，兼任元达信资本管理（北京）有限公司执行监事。

高翔先生，太原机械学院（现华北工学院）本科学历。曾任广东深圳蛇口新软件产业有限公司开发一部高级程序员，华夏证券深圳分公司电脑部副经理，鹏华基金管理有限公司信息技术部总监，大成基金管理有限公司信息技术部总监，中信建投基金管理有限公司总经理助理，现任中信建投基金管理有限公司副总经理。

### 4、本基金基金经理

王琦先生, 简历同上。

#### 5、投资决策委员会成员

袁野先生, 简历同上。

王琦先生, 简历同上。

王浩先生, 中央财经大学硕士研究生学历。曾任中信建投证券股份有限公司资产管理部研究员, 现任中信建投基金管理有限公司投资研究部基金经理。

周户先生, 南开大学硕士研究生, 曾任渤海证券股份有限公司研究员、广发证券股份有限公司研究员、国金证券及其下属基金公司研究员, 现任中信建投基金管理有限公司投资研究部基金经理。

黄海浩女士, 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, 现任中信建投基金管理有限公司投资研究部基金经理。

梁奇先生, 清华大学计算机科学与技术硕士。曾任汤森路透集团软件工程师、英大基金管理有限公司系统工程师、风险控制师, 现任职于中信建投基金管理有限公司稽控合规部风险管理岗。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### (一) 基金托管人概况

公司法定中文名称: 交通银行股份有限公司(简称: 交通银行)

公司法定英文名称: BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD

法定代表人: 牛锡明

住 所: 上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 188 号

邮政编码: 200120

注册时间: 1987 年 3 月 30 日

注册资本: 742.62 亿元

基金托管资格批文及文号: 中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。根据 2015 年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第 17 位，较上年上升 2 位；根据 2015 年美国《财富》杂志发布的世界 500 强公司排行榜，交通银行营业收入位列第 190 位，较上年上升 27 位。

截至 2016 年 9 月 30 日，交通银行资产总额为人民币 80,918.10 亿元。2016 年 1-9 月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 525.78 亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心(下文简称“托管中心”)。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

## (二) 主要人员情况

牛锡明先生，董事长、执行董事。

牛先生 2013 年 10 月至今任本行董事长、执行董事，2013 年 5 月至 2013 年 10 月任本行董事长、执行董事、行长，2009 年 12 月至 2013 年 5 月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生 1983 年毕业于中央财经大学金融系，获学士学位，1997 年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业，获硕士学位，1999 年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生，副董事长、执行董事、行长。

彭先生 2013 年 11 月起任本行副董事长、执行董事，2013 年 10 月起任本行行长；2010 年 4 月至 2013 年 9 月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005 年 8 月至 2010 年 4 月任本行执行董事、副行长；2004 年 9 月至 2005 年 8 月任本行副行长；2004 年 6 月至 2004 年 9 月任本行董事、行长助理；2001 年 9 月至 2004 年 6 月任本行行长助理；1994

年至 2001 年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生 1986 年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁。

袁女士 2015 年 8 月起任本行资产托管业务中心总裁；2007 年 12 月至 2015 年 8 月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999 年 12 月至 2007 年 12 月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士 1992 年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005 年于新疆财经学院获硕士学位。

### (三) 基金托管业务经营情况

截至 2016 年 9 月 30 日，交通银行共托管证券投资基金 206 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产和 QDLP 资金等产品。

## 三、相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### (1) 直销中心

名称：中信建投基金管理有限公司

住所：北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室

法定代表人：蒋月勤

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街 2 号凯恒中心 B 座 19 层

传真：010-59100298

联系人：贾欣欣

客户服务电话：4009-108-108

网址：[www.cfund108.com](http://www.cfund108.com)

##### (2) 网上直销

直销网站：[www.cfund108.com](http://www.cfund108.com)



## 2、其他销售机构

### （1）交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：张宏革

联系电话：021-58781234

客服电话：95559

公司网站：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

### （2）中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

客户服务电话：95587、400-8888-108

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

### （3）渤海银行股份有限公司

网址：[www.cbhb.com.cn](http://www.cbhb.com.cn)

客户服务电话：400-888-8811

### （4）中国国际金融股份有限公司

网址：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

客户服务电话：400-910-1166

### （5）上海浦东发展银行股份有限公司

网址：<http://www.spdb.com.cn/chpage/c1/>

客户服务电话：95528

### （6）中信证券股份有限公司

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

客户服务电话：95548

### （7）中信期货有限公司

网址：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

客户服务电话：400-990-8826

（8）中信证券（山东）有限责任公司

网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

客户服务电话：95548

（9）嘉实财富管理有限公司

网址：[www.harvestwm.cn](http://www.harvestwm.cn)

客户服务电话：400-021-8850

（10）国金证券股份有限公司

网址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

客户服务电话：4001-600109

（11）北京农村商业银行

网址：<http://www.bjrcb.com/>

客户服务电话：4006696198

（12）上海天天基金销售有限公司

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

客户服务电话：4001818188

（13）信达证券股份有限公司

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

客户服务电话：95321

（14）上海陆金所资产管理有限公司

网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

客户服务电话：4008-219-031

（15）泰诚财富基金销售（大连）有限公司

网址：[www.taichengcaifu.com](http://www.taichengcaifu.com)

客户服务电话：400-6411-999

（16）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

客户服务电话：4000-766-123

(17) 浙江同花顺基金销售有限公司

网址: [www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

客户服务电话: 4008-773-772

(18) 大泰金石基金销售有限公司

网址: [www.dtfortune.com](http://www.dtfortune.com)

客户服务电话: 400-928-2266

(19) 上海凯石财富基金销售有限公司

网址: [www.lingxianfund.com](http://www.lingxianfund.com)

客户服务电话: 4000-178-000

(20) 珠海盈米财富管理有限公司

网址: [www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

客户服务电话: 020-89629066

(21) 北京钱景财富投资管理有限公司

网址: [www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

客户服务电话: 400-893-6885

(22) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

网址: [www.buyfunds.cn](http://www.buyfunds.cn)

客户服务电话: 400-027-9899

(23) 北京汇成基金销售有限公司

网址: [www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

客户服务电话: 400-619-9059

(24) 北京恒天明泽基金销售有限公司

网址: [www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

客户服务电话: 4008980618

(25) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

网址: <http://kenterui.jd.com>

客户服务电话: 400-098-8511

(26) 上海利得基金销售有限公司

网址: [www.leadfund.com.cn](http://www.leadfund.com.cn)

客户服务电话：400-921-7755

（27）北京格上富信投资顾问有限公司

网址：www.igesafe.com

客户服务电话：400-066-8586

（28）北京微动利投资管理有限公司

网址：www.buyforyou.com.cn

客户服务电话：400-819-6665

（29）上海长量基金销售投资顾问有限公司

网址：www.erichfund.com

客户服务电话：400-820-2899

（30）深圳富济财富管理有限公司

网址：www.jinqianwo.cn

客户服务电话 0755-83999907

（31）北京电盈基金销售有限公司

网址：www.5ijh.com

客户服务电话：400-100-3391

3、基金管理人可根据《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》和本基金基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

（二）登记机构

名称：中信建投基金管理有限公司

住所：北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室

法定代表人：蒋月勤

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座19层

电话：010-59100228

传真：010-59100298

联系人：陈莉君

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 层  
办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 层  
负责人：俞卫锋  
电话：021-31358666  
传真：021-31358600  
经办律师：黎明、孙睿  
联系人：黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）  
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼  
办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼  
法定代表人：杨绍信  
电话：021-23238888  
传真：021-23238800  
联系人：张勇  
经办注册会计师：许康玮、张勇

## 四、基金的名称

中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金

## 五、基金的类型

混合型证券投资基金

## 六、基金的运作方式

契约型开放式

## 七、基金的投资目标

本基金主要投资于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，力争实现基金资产的长期稳健增值。

## 八、基金的投资范围

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（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、股指期货等权益类金融工具，债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0-95%；中小企业私募债占基金资产净值的比例不超过 20%；权证投资占基金资产净值的比例不超过 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

## 九、基金的投资策略、决策依据和决策程序

### （一）基金的投资策略

#### 1、资产配置策略

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。

#### 2、股票投资策略

本基金的股票投资策略包括行业配置策略和个股投资策略。

##### （1）行业配置策略

本基金首先研究分析不同行业的盈利模式、与宏观经济周期的关系以及行业

自身的生命周期,之后在判断当期宏观经济所处周期位置的基础上,结合行业的盈利模式,优选当期盈利增长最为确定及增速较快的行业,进行重点配置。

## (2) 个股投资策略

本基金在个股投资方面采用“自上而下”和“自下而上”相结合的策略,一部分个股选择景气状况反转向好的行业龙头,一部分个股选择自身发展空间广阔,同时业绩预期加速增长的品种。

## 3、债券投资策略

对于固定收益类资产的选择,本基金将以价值分析为主线,在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理,并主要通过类属配置与债券选择两个层次进行投资管理。在类属配置层次,结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析,根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征,定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整,确定类属资产的最优权重。在券种选择上,本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。

## 4、中小企业私募债券投资策略

本基金将在严格控制信用风险的基础上,通过严谨的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资于私募债券。本基金依靠内部信用评级,以深入的企业基本面分析为基础,结合定性和定量方法,注重对企业未来偿债能力的分析评估,并及时跟踪其信用风险的变化。

在综合考虑债券信用资质、债券收益率和期限的前提下,重点选择资质较好、收益率较好、期限匹配的中小企业私募债券进行投资。

## 5、股指期货投资策略

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,旨在通过股指期货实现基金的套期保值。

### (1) 套保时机选择策略

根据本基金对经济周期运行不同阶段的预测和对市场情绪、估值指标的跟踪分析,决定是否对投资组合进行套期保值以及套期保值的现货标的及其比例。

### (2) 期货合约选择和头寸选择策略

在套期保值的现货标的确认之后,根据期货合约的基差水平、流动性等因素选择合适的期货合约;运用多种量化模型计算套期保值所需的期货合约头寸;对套期保值的现货标的 Beta 值进行动态的跟踪,动态调整套期保值的期货头寸。

### (3) 保证金管理

本基金将根据套期保值的时间、现货标的的波动性动态地计算所需的结算准备金,避免因保证金不足被迫平仓导致的套保失败。

## 6、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具,其投资原则为有利于基金资产增值。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,立足于无风险套利,尽量减少组合净值波动率,力求稳健的超额收益。

## (二) 基金管理人运用基金财产的决策依据和决策程序

### 基金管理人运用基金财产的决策依据、决策程序

#### 1、投资决策依据

- (1) 有关法律、法规和基金合同的有关规定。
- (2) 经济运行态势和证券市场走势。
- (3) 投资对象的风险收益配比。

#### 2、投资决策程序

(1) 投资决策支持: 研究人员、基金经理及相关人员根据独立研究及各咨询机构的研究方案,向投资决策委员会提出宏观经济分析方案和投资策略方案等决策支持。

(2) 投资原则的制定: 投资决策委员会在遵守国家有关法律、法规和基金合同的有关规定的前提下,根据研究人员和基金经理的有关方案,决定基金投资的主要原则,对基金投资组合的资产配置比例等提出指导性意见。

(3) 研究支持: 研究分析人员根据投资决策委员会的决议,为基金经理提供各类分析方案和投资建议,也可根据基金经理的要求进行有关的研究。

(4) 制定投资决策: 基金经理按照投资决策委员会决定的投资原则,根据研究分析人员提供的投资建议以及自己的分析判断,做出具体的投资决策。

(5) 风险控制与评估: 风险管理委员会定期召开会议,听取投资研究部、



基金经理、风险控制人员对基金投资组合进行的风险评估,并提出风险控制意见。

(6) 组合的调整: 基金经理有权根据环境的变化和实际的需要, 在其权限范围内对组合进行调整, 超出其权限的调整, 需报投资决策委员会审批。

## 十、基金的业绩比较标准

年化收益率 7%。

本基金在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期增值。以“年化收益率 7%”作为业绩比较基准可以较好地反映本基金的投资目标。

如果今后法律法规发生变化, 或者市场变化导致本业绩比较基准不再适用, 又或者市场出现更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的业绩比较基准, 则本基金管理人将视情况经与本基金托管人协商同意后调整本基金的业绩比较基准并报中国证监会备案, 并及时公告, 但不需要召开基金份额持有人大会。

## 十一、基金的风险收益特征

本基金属于混合型基金, 其预期的风险和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。

## 十二、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本投资组合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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金基金合同规定, 于 2017 年 1 月复核了本投资组合报告中的财务指标、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。

本报告中财务资料取自《中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告》, 数据截止日为 2016 年 12 月 31 日, 未经审计。

### 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	25,390,924.88	52.48
	其中：股票	25,390,924.88	52.48
2	固定收益投资	6,953,094.60	14.37
	其中：债券	6,953,094.60	14.37
	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	12,379,134.37	25.59
	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	3,321,933.17	6.87
7	其他各项资产	336,761.80	0.70
8	合计	48,381,848.82	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (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	17,608,800.00	36.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,167,040.00	2.44
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	4,782,894.88	9.99
J	金融业	-	-
K	房地产业	913,000.00	1.91
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	1,051,210.20	1.68
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	919,190.00	1.92
S	综合	-	-
	合计	25,390,924.88	53.05

(2) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资港股通股票。

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	占基金资产净值比例（%）
1	002688	金河生物	280,000	2,828,000.00	5.91
2	300182	捷成股份	250,048	2,577,994.88	5.39
3	000338	潍柴动力	250,000	2,490,000.00	5.20
4	002202	金风科技	140,000	2,395,400.00	5.01
5	600079	人福医药	100,000	1,995,000.00	4.17
6	600409	三友化工	200,000	1,878,000.00	3.92
7	002597	金禾实业	110,000	1,719,300.00	3.59
8	601929	吉视传媒	390,000	1,634,100.00	3.41
9	600978	宜华生活	150,000	1,597,500.00	3.34
10	002037	久联发展	80,000	1,369,600.00	2.86

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	4,994,000.00	10.43
	其中：政策性金融债	4,994,000.00	10.43
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）	1,959,094.60	4.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,953,094.60	14.53

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	120210	12 国 开 10	50,000	4,994,000.00	10.43
2	132001	14 宝 钢 EB	17,000	1,924,570.00	4.02
3	132007	16 凤 凰 EB	330	34,524.60	0.07

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。

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。

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。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

(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。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资股指期货。

11、投资组合报告附注

(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。

(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。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	34,555.13
2	应收证券清算款	200,541.67
3	应收股利	-
4	应收利息	101,665.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	336,761.80

(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) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

(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。

### 十三、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

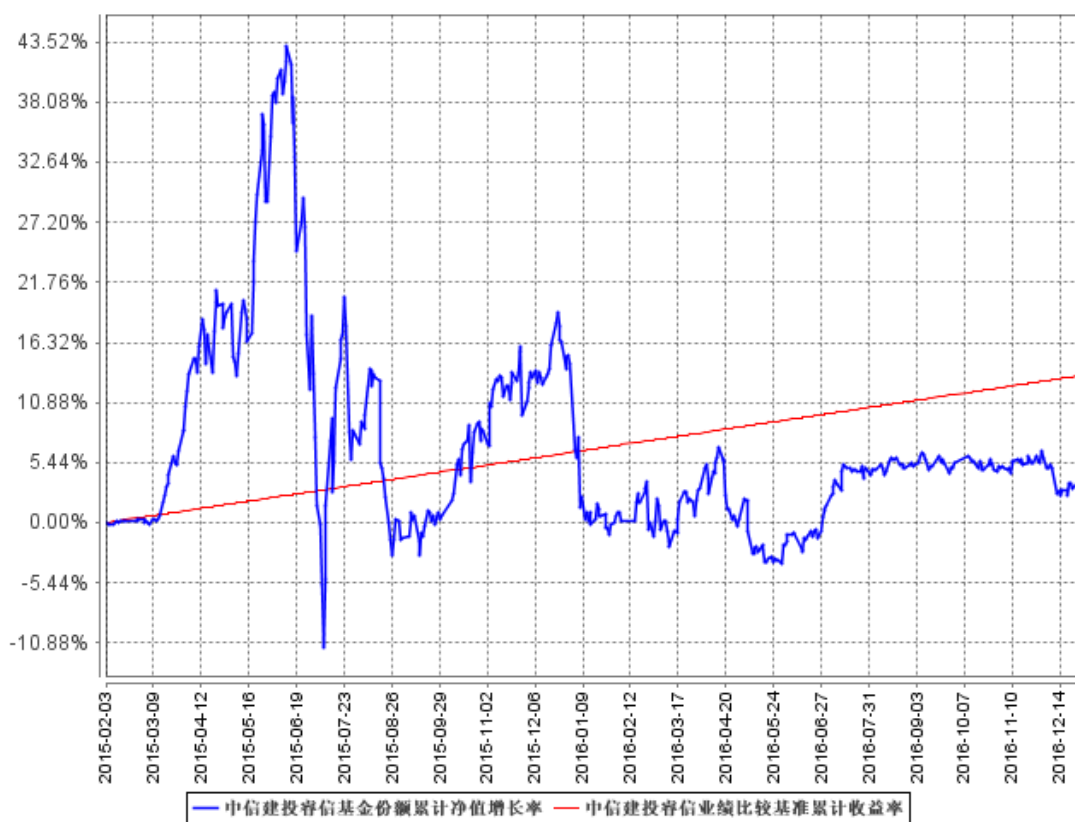
#### 1、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	-2.09%	0.49%	1.58%	0.02%	-3.67%	0.47%
过去六个月	1.88%	0.47%	3.21%	0.02%	-1.33%	0.45%
2016年1月1 日-2016年6	-11.45%	1.31%	3.28%	0.02%	-14.73%	1.29%

月 30 日						
2015年2月3日(基金合同生效日) -2015年12月31日	14.40%	2.24%	6.37%	0.02%	8.03%	2.22%

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

中信建投睿信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



## 十四、基金的费用和税收

### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费;
- 2、基金托管人的托管费;
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用、银行账户维护费用；
- 8、证券/期货开户费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 3—9 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## (三) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### (四)基金税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十五、对招募说明书更新部分的说明

本更新的招募说明书依据《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》及其他有关法律法规的要求，对《中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》进行了更新，本更新招募说明书主要更新的内容如下：

1. 更新了“第三部分 基金管理人”的“主要人员情况”的相关内容。
2. 更新了“第四部分 基金托管人”的相关内容。
3. 更新了“第五部分 相关服务机构”的相关内容。
4. 更新了“第六部分 基金的募集”的相关内容。
5. 更新了“第九部分 基金的投资”的“基金的投资组合报告”的相关内容。
6. 更新了“第十部分 基金的业绩”的相关内容。
7. 更新了“第二十二部分 其他应披露的事项”，列示了本基金自上次招募说明书更新截止日以来的临时公告和定期报告事项。

中信建投基金管理有限公司

二〇一七年三月