

# 中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
6.4 报表附注.....	23
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>50</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	50
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
7.6 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.....	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	56
7.8 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贵金属投资明细.....	56
7.9 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.....	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	56
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>58</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	58
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	59
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>60</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>61</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	63

---

<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>66</b>
11.1 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 .....	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>67</b>
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	
基金简称	中信建投睿利	
基金主代码	003308	
交易代码	003308	
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	
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	
报告期末基金份额总额	33,541,227.71 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C
下属分级基金的交易代码:	003308	004635
报告期末下属分级基金的份额总额	33,540,217.71 份	1,010.00 份

### 2.2 基金产品说明

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，在有效控制风险的前提下，通过积极灵活的资产配置和组合精选，充分把握市场机会，力求实现基金资产的持续稳健增值。
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（报刊资金面供需情况、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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信建投基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张乐久	郭明
	联系电话	010-57760122	(010) 66105799
	电子邮箱	zhanglj@csc.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009-108-108	95588
传真		010-59100298	(010) 66105798
注册地址		北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 17、19 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100010	100140
法定代表人		蒋月勤	易会满

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街 2 号凯恒中心 B 座 17、19 层
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,325.44	-0.32
本期利润	546,744.21	12.29
加权平均基金份额本期利润	0.0140	0.0127
本期加权平均净值利润率	1.39%	1.21%
本期基金份额净值增长率	1.47%	1.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	23,740.34	-0.32
期末可供分配基金份额利润	0.0007	-0.0003
期末基金资产净值	34,090,954.56	1,022.29
期末基金份额净值	1.0164	1.0122
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	1.64%	1.22%

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。

2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

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。

4、自 2017 年 5 月 10 日起对本基金增加 C 类基金份额类别；自 2017 年 5 月 10 日起开放中信建投睿利 C 的申赎业务；中信建投睿利 A 类基金本报告期为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日；中信建投睿利 C 类基金本报告期为 2017 年 5 月 26 日（首笔份额登记日）至 2017 年 6 月 30 日。

5、中信建投睿利 A 收取认购/申购费用，中信建投睿利 C 计提销售服务费，不收取认购/申购费用。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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

中信建投睿利 A

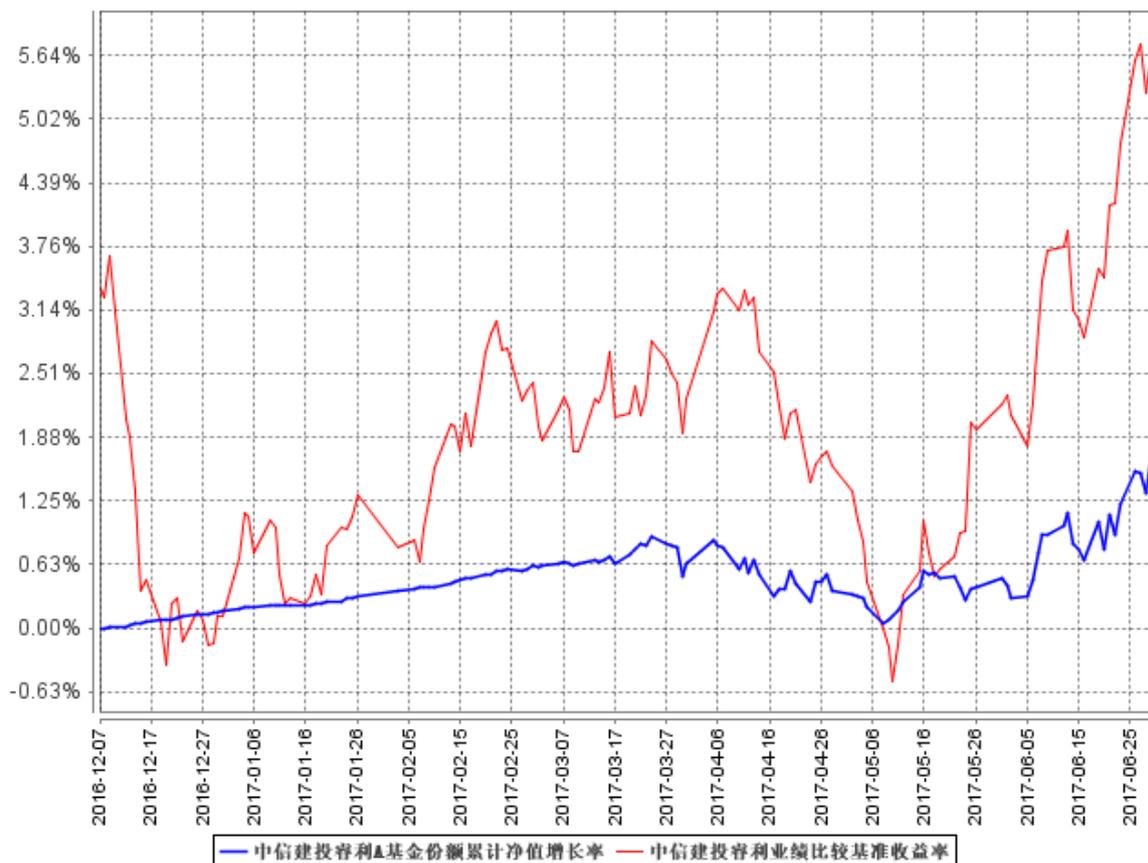
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.14%	0.21%	3.34%	0.41%	-2.20%	-0.20%
过去三个月	0.99%	0.16%	3.28%	0.38%	-2.29%	-0.22%
过去六个月	1.47%	0.12%	5.48%	0.35%	-4.01%	-0.23%
自基金合同生效起至今	1.64%	0.11%	5.61%	0.47%	-3.97%	-0.36%

中信建投睿利 C

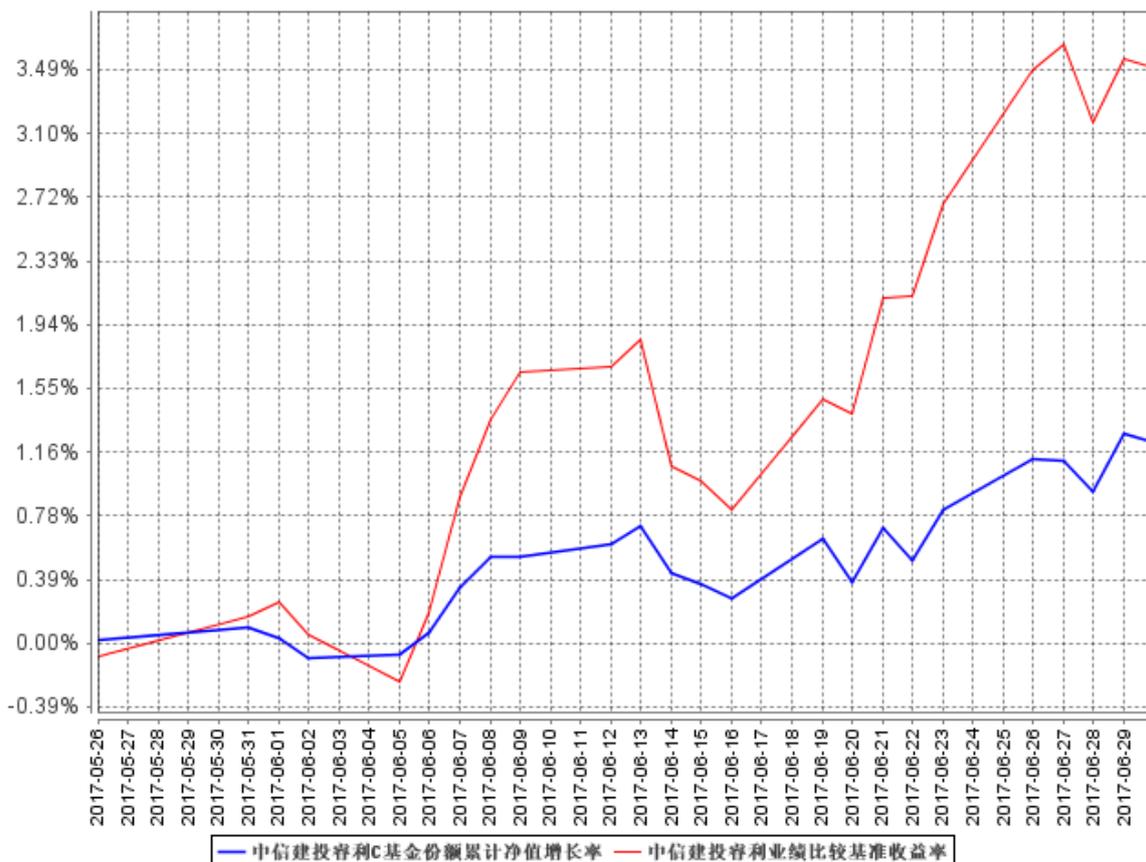
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.12%	0.21%	3.34%	0.41%	-2.22%	-0.20%
自基金合同生效起至今	1.22%	0.20%	3.51%	0.39%	-2.29%	-0.19%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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A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



中信建投睿利C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、图 1 为中信建投睿利 A 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，绘图日期为 2016 年 12 月 7 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日；

2、图 2 为中信建投睿利 C 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，绘图日期为 2017 年 5 月 26 日（首笔份额登记日）至 2017 年 6 月 30 日。

### 3.3 其他指标

本基金本报告期间无需要披露的其他基金净值表现指标。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中信建投基金管理有限公司于 2013 年 9 月 9 日在北京正式注册成立，主要经营基金募集、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。公司子公司元达信资本管理（北京）有限公司于 2015 年 6 月 8 日成立。依托强大的股东背景，经过 2014 年、2015 年、2016 年的基础建设及资源、业务、经验的积累，公司业务呈现发展趋势。公司秉承“忠于信，健于投”的经营理念，追求以稳健的投资及良好的收益，回馈客户的信任，公司投资业绩稳健，以良好的投资回报实现了投资人资产的保值增值。公司机构客户资源丰富，涵盖商业银行、证券公司、信托公司、财务公司等客户资源；深度开展各类客户的拓展维护，与大型商业银行及农村商业银行均开展不同程度的合作。公司构建了涵盖风险收益高中低各类产品在内的产品体系，公募基金涵盖混合型、债券型、货币型等多种产品类型；专户产品在量化投资、资产证券化等多个领域均取得了良好的业绩；同时公司积极践行“金融服务实体经济的本质要求”，与相关政府部门、金融机构共同开发国企改革基金、产业基金等创新业务，通过产品创新和业务创新为国家经济政策的调整 and 实体经济的发展贡献应有之力。

公司积极践行社会责任，在各项工作中均以保护投资者、合作伙伴利益为基础；在 2016 年获得怀柔区“2016 年度经济发展贡献奖”奖项。同时，公司在固定收益等专业领域业绩卓著，在 2016 年获得上海证券交易所“2016 年度优秀债券交易商”奖项、2014-2015 年连续两年获得中金所“国债期货优秀市场拓展团队”奖项。

2017 年公司本着“回归本源、夯实基础、稳中求进、再绘蓝图”的指导思想，提升投研实力，加快产品创新，拓展销售渠道，不断增强公司核心竞争力。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王琦	本基金的基金经理、公司总经	2016 年 12 月 7 日	-	16	中国籍，1974 年 7 月生，中国人民大学金融学博士。曾任中技开发公司投资经理、清华永新信息工

	理助理、 投资研 究部负 责人				程有限公司企划部经理、 大通证券股份有限公司研 发中心行业研究员、中关 村证券股份有限公司研发 中心行业研究员、中信建 投证券股份有限公司交易 部总监。2014 年 3 月加入 中信建投基金管理有限公司，现担任公司总经理助 理及投资研究部部门总经 理，负责公募产品的整体 投资与研究支持，从事证 券投资研究分析工作，现 任中信建投智信物联网灵 活配置混合型证券投资基 金、中信建投睿利灵活配 置混合型发起式证券投资 基金基金经理。
周户	本基金 的基金 经理	2017 年 1 月 25 日	-	9	中国籍，1982 年 2 月生， 南开大学经济学硕士。曾 任苏州博思堂经纪顾问有 限公司市场分析师、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、国金通用基金 管理有限公司研究员、国 金证券股份有限公司研究 员。2014 年 6 月至今任职 于中信建投基金管理有限

					公司投资研究部，现担任中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金、中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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制度指导意见》，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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金处于成立初期，前 6 个月处于建仓期。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。二季度随着市场预期的好转，不断提高仓位，产品净值不断提升。在股票投资方面，基于稳健策略，仓位并未大幅提升，但在板块配置上与市场节奏较为一致，上半年前期阶段较好的布局了成长性确定的板块，如食品饮料、医药、餐饮旅游等，后期阶段不断提升金融和周期类板块的比重，产品净值不断提升。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.0164 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.47%，同期业绩比较基准收益率为 5.48%；本基金 C 类基金份额净值为 1.0122 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.22%，同期业绩比较基准收益率为 3.51%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济缓步提升，波动性依然较小，出口和工业增加值波动性有所放大，景气指数改善明显。展望下半年，国内经济处于库存窄幅波动阶段，PPI 有望回落，CPI 预期回升，设备投资有望持续改善。政策面，财政政策偏积极，货币政策维持稳健。总体来讲，经济复苏预期加强，局部领域有望进入成长回升期，但库存波动强度有待观察，房地产和金融监管政策的不断出台，为未来经济增长增添不确定性。

展望下半年，尽管经济复苏预期不断加强，但在政策监管的高压下，流动性维持偏紧状态，投资性机会更多以结构性为主，电子、化工、金融、医药、轻工、食品饮料、农林牧渔、餐饮旅游、环保等行业仍将存在配置机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金遵循下列报表附注所述的估值政策和估值原则对基金持有的资产和负债进行估值。

为确保估值政策和估值原则的合理合法性，公司成立估值委员会和风险内控小组。公司分管运营领导任估值委员会负责人，委员包括督察长、投资研究部、特定资产管理部、稽控合规部、运营管理部的主要负责人，主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。

在严格遵循公平、合理原则下，公司制订了健全、有效的估值政策流程：

1. 运营管理部基金会计每天按照相关政策对基金资产和负债进行估值并计算基金净值，公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用于非货币基金）或影子定价（适用于货币基金和理财类基金）；公司与中证指数有限公司签署了《债券估值数据服务协议》，并依据其提供的估值价格对公司旗下基金持有的交易所有关固定收益品种进行估值。

2. 由估值委员会确认基金持有的投资品种是否采用估值方法确定公允价值，若确定用估值方法计算公允价值，则在参考基金业协会的意见或第三方意见后确定估值方法；

3. 由估值委员会计算该投资品种的公允价值，并将计算结果提交公司管理层；

4. 公司管理层审批后，该估值方法方可实施。

为了确保旗下基金持有投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性，风险内控小组应定期对估值政策、程序及估值方法进行考核，并建立风险防控标准。在考虑投资策略的情况下，公司旗下的不同基金持有的同一证券的估值政策、程序及相关的方法应保持一致。除非产生需要更新估值政策或程序的情形，已确定的估值政策和程序应当持续适用。

估值委员会应互相协助定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后应及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订建议由估值委员会提议，并提交公司管理层，待管理层审批后方可实施。公司旗下基金在采用新投资策略或投资新品种时，应由估值委员会对现有估值政策和程序的适用性做出评价。

在采用估值政策和程序时，估值委员会应当审查并充分考虑参与估值流程各部门及人员的经验、专业胜任能力和独立性，通过参考行业协会估值意见、参考托管行及其他独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金的管理人——中信建投基金管理有限公司在中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中信建投基金管理有限公司编制和披露的中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	659,263.07	18,162,057.89
结算备付金		285,547.13	-
存出保证金		3,626.05	-
交易性金融资产	6.4.7.2	13,595,806.37	-
其中：股票投资		11,105,056.37	-
基金投资		-	-
债券投资		2,490,750.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	19,800,000.00	29,530,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	62,314.59	130,693.51
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		34,406,557.21	47,822,751.40
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		125,869.98	-
应付管理人报酬		42,362.12	46,940.28
应付托管费		7,060.36	7,823.39
应付销售服务费		0.30	-
应付交易费用	6.4.7.7	14,848.37	175.29
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	124,439.23	-
负债合计		314,580.36	54,938.96
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	33,541,227.71	47,686,882.68
未分配利润	6.4.7.10	550,749.14	80,929.76
所有者权益合计		34,091,976.85	47,767,812.44
负债和所有者权益总计		34,406,557.21	47,822,751.40

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0164 元，基金份额总额 33,541,227.71 份。其中，A 类基金份额净值 1.0164 元，A 类基金份额 33,540,217.71 份；B 类基金份额净值 1.0122 元，B 类基金份额 1,010.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		1,050,010.18	-
1.利息收入		791,742.97	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	26,683.08	-
债券利息收入		30,541.10	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		734,518.79	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-326,303.44	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-348,424.21	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	22,120.77	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	541,431.38	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	43,139.27	-
<b>减：二、费用</b>		503,253.68	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	294,585.30	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	49,097.58	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	0.35	-
4. 交易费用	6.4.7.19	22,980.80	-

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	136,589.65	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		546,756.50	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		546,756.50	-

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	47,686,882.68	80,929.76	47,767,812.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	546,756.50	546,756.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-14,145,654.97	-76,937.12	-14,222,592.09
其中：1.基金申购款	508,546.64	3,219.44	511,766.08
2.基金赎回款	-14,654,201.61	-80,156.56	-14,734,358.17

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	33,541,227.71	550,749.14	34,091,976.85
项目	上年度可比期间		
	2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>蒋月勤</u>	<u>高翔</u>	<u>陈莉君</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]1962 号《关于核准中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》的注册，由中信建投基金管理有限公司于 2016 年 10 月 19 日至 2016 年 12 月 2 日向社会公开募集，募集期结束经普华永道会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具普华永道中天验字（2016）第 1356 号验资报告后，向中国证监会报送基金注册材料。基金合同于 2016 年 12 月 7 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 47,666,946.61 元，有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 19,936.07 元，以上实收基金合计为人民币 47,686,882.68 元，折合 47,686,882.68 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为中信建投基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《关于中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金增加 C 类基金份额并调整基金合同和托管协议中相关条款的公告》，自 2017 年 5 月 10 日起，对本基金增加 C 类份额类别，原有的基金份额在增加收取销售服务费的 C 类份额后，全部自动转换为本基金 A 类份额。本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类份额；从本基金资产中计提销售服务费，并不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类份额。本基金两类基金份额分别设置代码，分别公布基金份额净值和基金份额累计净值。

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）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货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%；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%。

本基金的业绩比较基准为：60%×沪深 300 指数收益率+40%×中债综合指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策与上年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融

资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产和其他各类应付款项。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参

考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公

允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费及销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股

票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公

司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	659,263.07
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	659,263.07

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	10,551,874.99	11,105,056.37	553,181.38
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,502,500.00	2,490,750.00
	银行间市场	-	-
	合计	2,502,500.00	2,490,750.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	13,054,374.99	13,595,806.37	541,431.38

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_固定平 台	19,800,000.00	-
合计	19,800,000.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	284.21
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	128.50
应收债券利息	18,342.47
应收买入返售证券利息	43,557.81
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.60
合计	62,314.59

注：“其他”为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	14,848.37
银行间市场应付交易费用	-
合计	14,848.37

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
	2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	466.90
预提费用	123,972.33
合计	124,439.23

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中信建投睿利 A		
项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	47,686,882.68	47,686,882.68
本期申购	507,536.64	507,536.64
本期赎回(以“-”号填列)	-14,654,201.61	-14,654,201.61
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	33,540,217.71	33,540,217.71

金额单位：人民币元

中信建投睿利 C		
项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	-	-
本期申购	1,010.00	1,010.00
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,010.00	1,010.00

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中信建投睿利 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	80,929.76	-	80,929.76
本期利润	5,325.44	541,418.77	546,744.21
本期基金份额交易产生的变动数	-62,514.86	-14,422.26	-76,937.12
其中：基金申购款	2,192.98	1,026.46	3,219.44
基金赎回款	-64,707.84	-15,448.72	-80,156.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,740.34	526,996.51	550,736.85

单位：人民币元

中信建投睿利 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	-0.32	12.61	12.29
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-

其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-0.32	12.61	12.29

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	7,768.85
定期存款利息收入	16,400.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,502.24
其他	11.99
合计	26,683.08

注：“其他”为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	6,231,978.25
减：卖出股票成本总额	6,580,402.46
买卖股票差价收入	-348,424.21

注：本基金合同自 2016 年 12 月 7 日起生效，无上年度可比数据。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期间无买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期间无买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期未发生债券投资相关的赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未发生债券投资相关的申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期间无买卖贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期间无买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期间无贵金属赎回差价收入。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期间无贵金属申购差价收入。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期间衍生工具投资收益。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期间无衍生工具投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日

股票投资产生的股利收益	22,120.77
基金投资产生的股利收益	-
合计	22,120.77

注：本基金合同自 2016 年 12 月 7 日起生效，无上年度可比数据。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	541,431.38
——股票投资	553,181.38
——债券投资	-11,750.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	541,431.38

注：本基金合同自 2016 年 12 月 7 日起生效，无上年度可比数据。

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	43,139.27
合计	43,139.27

注：本基金合同自 2016 年 12 月 7 日起生效，无上年度可比数据。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	22,980.80
银行间市场交易费用	-
合计	22,980.80

注：本基金合同自 2016 年 12 月 7 日起生效，无上年度可比数据。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	109,177.14
银行划款费	1,117.32
账户维护费	1,500.00
合计	136,589.65

注：本基金合同自 2016 年 12 月 7 日起生效，无上年度可比数据。

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本报告报出日，本基金无需说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金的托管人、基金代销机构
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
航天科技财务有限责任公司	基金管理人的股东
中信建投期货有限公司	与基金管理人同一股东、基金代销机构
江苏广传广播传媒有限公司	基金管理人的股东
元达信资本管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	294,585.30	-
其中：支付销售机构的客户维护费	139,217.86	-

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

2、本基金合同自 2016 年 12 月 7 日起生效，无上年度可比数据。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	49,097.58	-

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

2、本基金合同自 2016 年 12 月 7 日起生效，无上年度可比数据。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C	合计
中信建投基金管理有限 公司	0.00	0.35	0.35
中信建投证券股份有限 公司	0.00	0.00	0.00
中国工商银行股份有限 公司	0.00	0.00	0.00
中信建投期货有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	0.35	0.35
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C	合计

注：1、根据《关于中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金增加 C 类基金份额并调整基金合同和托管协议中相关条款的公告》，自 2017 年 5 月 10 日起，对本基金增加 C 类份额类别，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.40% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给注册登记机构，经注册登记机构代付给各个基金销售机构。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额基金资产净值

2、本基金合同自 2016 年 12 月 7 日起生效，无上年度可比数据。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 7 日）持有的基金份额	10,000,800.00	0.00
期初持有的基金份额	10,000,800.00	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额	10,000,800.00	0.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	29.820000%	0.000000%

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 7 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-

占基金总份额比例		
----------	--	--

注：本基金合同自 2016 年 12 月 7 日起生效，无上年度可比数据。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	659,263.07	7,768.85	-	-

注：1、本基金的活期存款由基金托管人工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

2、本基金合同自 2016 年 12 月 7 日起生效，无上年度可比数据。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司风险控制与合规委员会、督察长、公司风险管理委员会、稽核合规部以及各个业务部门组成。公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与合规委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由稽核合规部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中信银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险

可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、政策性金融债及央行票据以外的债券投资。本基金基金合同于 2016 年 12 月 7 日生效，上年度末本基金尚处于建仓期内，未持有债券投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2017 年 6 月 30 日，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产如下表所示：

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	659,263.07	-	-	-	659,263.07
结算备付金	285,547.13	-	-	-	285,547.13
存出保证金	3,626.05	-	-	-	3,626.05
交易性金融资产	2,490,750.00	-	-	-11,105,056.37	13,595,806.37
买入返售金融资产	19,800,000.00	-	-	-	19,800,000.00
应收利息	-	-	-	62,314.59	62,314.59
资产总计	23,239,186.25	-	-	-11,167,370.96	34,406,557.21
负债					
应付赎回款	-	-	-	125,869.98	125,869.98
应付管理人报酬	-	-	-	42,362.12	42,362.12
应付托管费	-	-	-	7,060.36	7,060.36
应付销售服务费	-	-	-	0.30	0.30
应付交易费用	-	-	-	14,848.37	14,848.37

其他负债	-	-	-	124,439.23	124,439.23
负债总计	-	-	-	314,580.36	314,580.36
利率敏感度缺口	23,239,186.25	-	-	-10,852,790.60	34,091,976.85
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	18,162,057.89	-	-	-	18,162,057.89
买入返售金融资产	29,530,000.00	-	-	-	29,530,000.00
应收利息	-	-	-	130,693.51	130,693.51
资产总计	47,692,057.89	-	-	130,693.51	47,822,751.40
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	46,940.28	46,940.28
应付托管费	-	-	-	7,823.39	7,823.39
应付交易费用	-	-	-	175.29	175.29
负债总计	-	-	-	54,938.96	54,938.96
利率敏感度缺口	47,692,057.89	-	-	75,754.55	47,767,812.44

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，若市场利率变动 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不会产生重大变动(2016 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的

影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)
交易性金融资产-股票投资	11,105,056.37	32.57	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	2,490,750.00	7.31	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	13,595,806.37	39.88	-	-

注：本基金基金合同于 2016 年 12 月 7 日生效，上年度末本基金尚处于建仓期内，未持有股票投资。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变
----	----------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月 30日）	上年度末（2016年12月 31日）
	业绩比较基准上升 5%	360,198.78	-
	业绩比较基准下降 5%	-360,198.78	-

注：本基金基金合同于 2016 年 12 月 7 日生效，上年度末本基金尚处于建仓期内，未持有股票投资，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 11,105,056.37 元，属于第二层次的余额为 2,490,750.00 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：无属于第一层次、第二层次及第三层次的余额)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31

日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	11,105,056.37	32.28
	其中：股票	11,105,056.37	32.28
2	固定收益投资	2,490,750.00	7.24
	其中：债券	2,490,750.00	7.24
	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	19,800,000.00	57.55
	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	944,810.20	2.75
7	其他各项资产	65,940.64	0.19
8	合计	34,406,557.21	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	704,640.00	2.07
B	采矿业	569,800.00	1.67
C	制造业	4,777,115.00	14.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	317,800.00	0.93
F	批发和零售业	751,520.00	2.20
G	交通运输、仓储和邮政业	248,800.00	0.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	504,417.37	1.48
J	金融业	1,733,820.00	5.09
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	892,144.00	2.62
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	605,000.00	1.77
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	11,105,056.37	32.57

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	000423	东阿阿胶	14,000	1,006,460.00	2.95
2	601888	中国国旅	29,600	892,144.00	2.62
3	600729	重庆百货	28,000	751,520.00	2.20
4	000998	隆平高科	32,000	704,640.00	2.07
5	600873	梅花生物	120,000	680,400.00	2.00

6	300347	泰格医药	25,000	605,000.00	1.77
7	600584	长电科技	37,000	593,850.00	1.74
8	300308	中际装备	13,000	534,690.00	1.57
9	300166	东方国信	37,559	504,417.37	1.48
10	600188	兖州煤业	35,000	428,400.00	1.26
11	002572	索菲亚	10,000	410,000.00	1.20
12	601601	中国太保	12,000	406,440.00	1.19
13	601336	新华保险	7,000	359,800.00	1.06
14	601628	中国人寿	13,000	350,740.00	1.03
15	300230	永利股份	20,000	330,800.00	0.97
16	601800	中国交建	20,000	317,800.00	0.93
17	601318	中国平安	6,000	297,660.00	0.87
18	002185	华天科技	40,000	289,600.00	0.85
19	600428	中远海特	40,000	248,800.00	0.73
20	002078	太阳纸业	30,000	220,500.00	0.65
21	000063	中兴通讯	8,000	189,920.00	0.56
22	601339	百隆东方	30,000	178,500.00	0.52
23	601211	国泰君安	8,000	164,080.00	0.48
24	000563	陕国投 A	30,000	155,100.00	0.45
25	600309	万华化学	5,000	143,200.00	0.42
26	601225	陕西煤业	20,000	141,400.00	0.41
27	600110	诺德股份	5,000	70,450.00	0.21
28	600809	山西汾酒	2,000	69,380.00	0.20
29	600519	贵州茅台	100	47,185.00	0.14
30	300398	飞凯材料	700	12,180.00	0.04

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600729	重庆百货	1,093,414.00	2.29
2	000423	东阿阿胶	841,228.00	1.76
3	601888	中国国旅	778,873.00	1.63
4	000998	隆平高科	738,403.00	1.55
5	300447	全信股份	707,970.00	1.48
6	600873	梅花生物	685,855.00	1.44
7	300347	泰格医药	620,865.00	1.30
8	600584	长电科技	602,365.00	1.26
9	300166	东方国信	590,579.23	1.24
10	002653	海思科	587,550.00	1.23
11	600009	上海机场	501,240.00	1.05
12	000597	东北制药	491,030.00	1.03
13	300308	中际装备	463,799.00	0.97
14	000930	中粮生化	447,220.00	0.94
15	601965	中国汽研	432,450.00	0.91
16	603328	依顿电子	428,874.22	0.90
17	600188	兖州煤业	415,949.00	0.87
18	002572	索菲亚	391,430.00	0.82
19	601601	中国太保	383,180.00	0.80
20	601628	中国人寿	358,527.00	0.75

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300447	全信股份	594,638.00	1.24
2	002653	海思科	551,454.00	1.15
3	000597	东北制药	490,488.49	1.03
4	600009	上海机场	465,606.00	0.97
5	000930	中粮生化	440,820.00	0.92
6	601965	中国汽研	388,250.00	0.81
7	603328	依顿电子	385,069.76	0.81
8	600729	重庆百货	382,530.00	0.80
9	600643	爱建集团	333,754.00	0.70
10	000657	中钨高新	251,060.00	0.53
11	002531	天顺风能	210,102.00	0.44
12	000565	渝三峡 A	188,800.00	0.40
13	600566	济川药业	167,000.00	0.35
14	000888	峨眉山 A	146,700.00	0.31
15	600030	中信证券	132,179.00	0.28
16	002262	恩华药业	125,468.00	0.26
17	000066	中国长城	124,560.00	0.26
18	600582	天地科技	105,400.00	0.22
19	000978	桂林旅游	97,110.00	0.20
20	300166	东方国信	94,000.00	0.20

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	17,132,277.45
卖出股票收入（成交）总额	6,231,954.25

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,490,750.00	7.31
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	2,490,750.00	7.31

### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	010213	02 国债(13)	25,000	2,490,750.00	7.31

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 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。

#### 7.10.2 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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内本基金未运用国债期货进行投资。

#### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期内本基金未运用国债期货进行投资。

#### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内本基金未运用国债期货进行投资。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1

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。

#### 7.12.2

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。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	3,626.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	62,314.59
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,940.64

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份 额比例
中 信 建 投 睿 利 A	385	87,117.45	10,099,809.90	30.11%	23,440,407.81	69.89%
中 信 建 投 睿 利 C	1	1,010.00	0.00	0.00%	1,010.00	100.00%
合计	386	86,894.37	10,099,809.90	30.11%	23,441,417.81	69.89%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	中信建投 睿利 A	545,822.49	1.627400%
	中信建投 睿利 C	0.00	0.000000%
	合计	545,822.49	1.627400%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金	中信建投睿利 A	10~50

投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中信建投睿利 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中信建投睿利 A	50~100
	中信建投睿利 C	0
	合计	50~100

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,800.00	29.82	10,000,800.00	29.82	3 年
基金管理人高级管理人员	247,549.75	0.74	-	-	-
基金经理等人员	545,822.49	1.63	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,794,172.24	32.18	10,000,800.00	29.82	-

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 7 日）基金份额总额	47,686,882.68	-
本报告期期初基金份额总额	47,686,882.68	-
本报告期基金总申购份额	507,536.64	1,010.00
减：本报告期基金总赎回份额	14,654,201.61	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	33,540,217.71	1,010.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2017 年 1 月 25 日增聘周户为本基金的基金经理。

报告期内无基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，报告期内未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人收到中国证券监督管理委员会北京监管局（以下简称“北京证监局”）《关于对中信建投基金管理有限公司采取责令改正行政监管措施的决定》（[2017]33 号）及对相关责任人采取监管谈话的行政监管措施、北京证监局《关于对中信建投基金管理有限公司采取责令改正行政监管措施的决定》（[2017]36 号），要求基金管理人限期进行整改。

基金管理人高度重视整改工作，及时制定了整改方案并落实，按时向北京证监局报送了整改报告。截至报告期末，基金管理人已完成全部的整改工作。

报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
东吴证券	1	6,078,241.00	26.02%	3,229.35	22.01%	-
国金证券	1	8,071,087.72	34.54%	5,095.32	34.73%	-
兴业证券	1	3,902,598.00	16.70%	2,463.70	16.79%	-
长江证券	1	5,312,328.98	22.74%	3,884.71	26.48%	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）及《中信建投基金管理有限公司公募基金交易单元管理办法》的规定，本基金管理人制定了提供交易单元的证券公司的选择标准，具体如下：

（1）公司选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强的证券公司，向其租用交易单元。

（2）证券公司的选择由公司投资研究部负责人根据证券公司的投资研究服务质量及评估结果作出交易单元租用或撤销的相关决定。经公司分管领导同意后，方可办理相关的租用事宜。投资研究部应定期向公司总经理、市场部、特定资产管理部、稽控合规部负责人等组成的办公会议汇报选择证券公司的相关依据。

（3）评估实行评分制，具体如下：

分配权重（100分）=基础服务（45%）+特别服务（45%）+销售服务（10%）。

打分由投资研究部负责人和研究员共同完成。

基础服务包括：报告、电话沟通、路演、联合调研服务等；

特别服务包括：深度推荐公司、单独调研、带上市公司上门路演、约见专家、委托课题、人员培养、重大投资机会等；

销售服务包括：日常沟通、重点推荐的沟通、研究投资工作的支持和配合。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

3、投资研究部每月完成对各往来证券公司的研究服务评估，评估结果作为调整确定个别证券公司的交易金额及比率限制的参考。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券	2,502,500.00	100.00%	134,100,000.00	19.33%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	559,770,000.00	80.67%	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信建投基金管理有限公司关于旗下开放式证券投资基金 2016 年年度最后一个市场交易日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017 年 1 月 3 日
2	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017 年 1 月 10 日
3	关于中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金资产净值及基金份额净值的公告	管理人网站	2017 年 1 月 10 日
4	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金开放	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017 年 1 月 13 日

	定期定额投资业务公告		
5	中信建投基金管理有限公司 关于旗下开放式基金在上海 天天基金销售有限公司开通 定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报 刊及管理人网站	2017 年 1 月 13 日
6	关于中信建投睿利灵活配置 混合型发起式证券投资基金 申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报 刊及管理人网站	2017 年 1 月 13 日
7	中信建投睿利灵活配置混合 型发起式证券投资基金关于 增聘基金经理的公告	中国证监会指定报 刊及管理人网站	2017 年 1 月 26 日
8	中信建投基金管理有限公司 关于旗下部分基金参加中国 工商银行股份有限公司基金 申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报 刊及管理人网站	2017 年 3 月 31 日
9	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	中国证监会指定报 刊及管理人网站	2017 年 4 月 21 日
10	中信建投基金增加中期资产 管理有限公司为多只基金的 销售机构的公告	中国证监会指定报 刊及管理人网站	2017 年 4 月 21 日
11	中信建投基金增加上海好买 基金销售有限公司为多只基 金的销售机构的公告	中国证监会指定报 刊及管理人网站	2017 年 4 月 21 日
12	中信建投基金增加上海云湾 投资管理有限公司为多只基 金的销售机构的公告	中国证监会指定报 刊及管理人网站	2017 年 4 月 24 日
13	中信建投睿利灵活配置混合 型发起式证券投资基金基金	管理人网站	2017 年 5 月 10 日

	合同（2017 年 5 月修订）		
14	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（2017 年 5 月修订）	管理人网站	2017 年 5 月 10 日
15	关于中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金增加 C 类基金份额并调整基金合同和托管协议中相关条款的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017 年 5 月 15 日
16	关于公司副董事长兼任子公司执行董事的公告	管理人网站	2017 年 6 月 29 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170630	10,000,800.00	0.00	0.00	10,000,800.00	29.82%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，为发起式份额，尚在承诺持有期限内。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所。

### 12.3 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

2017年8月29日