

**中信建投睿溢混合型证券投资基金（中信建投稳溢保本混
合型证券投资基金）**

2018 年第 2 季度报告

2018 年 06 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:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2018 年 07 月 19 日

目录

§1 重要提示	4
§2 基金产品概况	4
2.1 基金基本情况(转型后)	4
2.1 基金基本情况(转型前)	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.2 基金净值表现(转型后)	7
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	7
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	7
3.2 基金净值表现(转型前)	8
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	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明	10
4.3 公平交易专项说明	10
4.3.1 公平交易制度的执行情况	10
4.3.2 异常交易行为的专项说明	10
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	10
4.5 报告期内基金的业绩表现	10
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	11
§5 投资组合报告(转型后)	11
5.1 报告期末基金资产组合情况	11
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	11
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	12
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	12
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	13
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	13
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	13
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	13
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	14
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	14
5.11 投资组合报告附注	14
§5 投资组合报告（转型前）	14
5.1 报告期末基金资产组合情况	14
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	15
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	16
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	16
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	16
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	16
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	16
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	16
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	16
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	17
5.11 投资组合报告附注	17
§6 开放式基金份额变动(转型后)	18
§6 开放式基金份额变动(转型前)	18
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	18
§8 影响投资者决策的其他重要信息	19

8.1 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.....	19
8.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	19
§9 备查文件目录.....	19
9.1 备查文件目录.....	19
9.2 存放地点.....	19
9.3 查阅方式.....	19

§ 1 重要提示

基金管理人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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年7月17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。

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。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中，原中信建投稳溢保本混合型证券投资基金报告期自2018年4月1日至2018年5月24日止，中信建投睿溢混合型证券投资基金报告期自2018年5月25日至2018年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况(转型后)

基金简称	中信建投睿溢
基金主代码	002640
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年05月25日
报告期末基金份额总额	66,255,443.79份
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，通过科学的资产配置与严谨的风险管理，力争超越业绩比较基准、实现基金资产持续稳定增值。
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（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。

业绩比较基准	沪深300指数收益率×20%+中债总财富指数收益率×80%
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风险、中高预期收益的品种。
基金管理人	中信建投基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

2.1 基金基本情况(转型前)

基金简称	中信建投稳溢保本
基金主代码	002640
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年05月19日
报告期末基金份额总额	123,818,927.07份
投资目标	本基金通过固定收益类资产与权益类资产的动态配置和有效的组合管理，在严格控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金运用恒定比例组合保险策略（Constant Proportion Portfolio Insurance,以下简称CPPI策略），动态调整固定收益类资产与权益类资产在基金组合中的投资比例，以确保本基金在保本周期到期时的本金安全，并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。具体而言，本基金的投资策略包括大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略和权益类资产投资策略。
业绩比较基准	两年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品，属证券投资基金中的低风险品种，其预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在损失投资本金的风险。
基金管理人	中信建投基金管理有限公司

基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
基金保证人	北京中关村科技融资担保有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标(转型后)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年05月25日 - 2018年06月30日）
1. 本期已实现收益	580,145.71
2. 本期利润	531,599.31
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0066
4. 期末基金资产净值	69,530,818.66
5. 期末基金份额净值	1.0494

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、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。

3、报告期自2018年5月25日至2018年6月30日止。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年04月01日 - 2018年05月24日）
1. 本期已实现收益	1,956,610.14
2. 本期利润	895,759.42
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0014
4. 期末基金资产净值	129,184,567.25
5. 期末基金份额净值	1.0433

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、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。

3、报告期自2018年4月1日至2018年5月24日止。

3.2 基金净值表现(转型后)

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	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.58%	0.12%	-0.75%	0.25%	1.33%	-0.13%

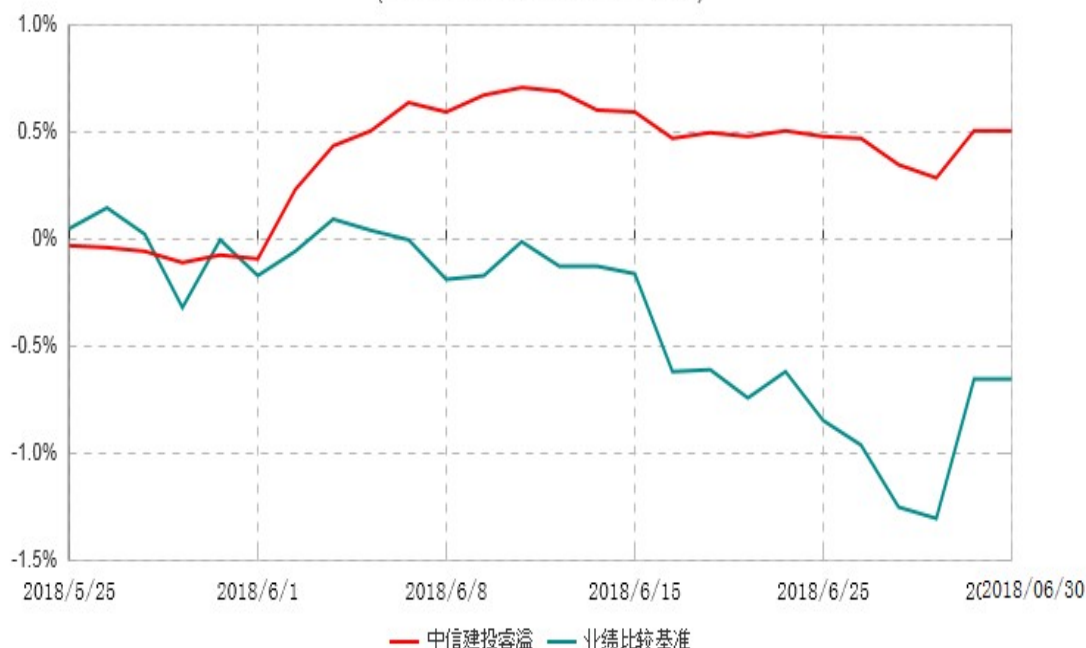
注：1、本基金由中信建投稳溢保本混合型证券投资基金转型而来并于2018年5月25日合同生效，因此上表报告期间的起始日为2018年5月25日。截止本报告期末本基金合同生效未满一个季度。

2、本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×20%+中债总财富指数收益率×80%。

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

中信建投睿溢混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年05月25日-2018年06月30日)



注：1、本基金由中信建投稳溢保本混合型证券投资基金转型而来并于2018年5月25日合同生效，上图报告期间的起始日为2018年5月25日。截止本报告期末本基金合同生效未满一个季度。

2、本基金建仓期为自基金合同生效日起的六个月。截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

3.2 基金净值表现(转型前)

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	①-③	②-④
过去三个月	0.14%	0.08%	0.30%	0.01%	-0.16%	0.07%

注：根据《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，2018年5月21日为本基金的第一个保本周期到期日。

在本基金保本周期到期期间，即2018年5月21日（含）至2018年5月24日（含）本基金接受赎回申请，不接受申购申请。自2018年5月25日，“中信建投稳溢保本混合型证券投资基金”转型为“中信建投睿溢混合型证券投资基金”，因此上表报告期间的结束日为2018年5月24日。本基金转型前以两年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准。

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

中信建投稳溢保本混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年05月19日-2018年05月24日)



注：根据《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，2018年5月21日为本基金的第一个保本周期到期日。

在本基金保本周期到期期间，即2018年5月21日（含）至2018年5月24日（含）本基金接

受赎回申请，不接受申购申请。自2018年5月25日，“中信建投稳溢保本混合型证券投资基金”转型为“中信建投睿溢混合型证券投资基金”，因此上图报告期间的结束日为2018年5月24日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王浩	本基金的基金经理	2016-05-19	-	8年	中国籍，1982年2月生，中央财经大学经济学硕士。曾就职于中信建投证券股份有限公司资产管理部，从事证券投资研究分析工作。现任本公司投资研究部基金经理，担任中信建投稳利保本混合型证券投资基金、中信建投聚利混合型证券投资基金、中信建投睿溢混合型证券投资基金、中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金。
颜灵珊	本基金的基金经理	2017-02-16	2018-06-05	4年	中国籍，1989年11月生，中国人民大学管理学硕士（财务方向）。曾任招商证券股份有限公司研究员。2016年8月加入我公司，曾任投资研究部基金经理，因离职于2018年6月注销基金经理资格。
刘锋	本基金的基金经理	2018-06-05	-	3年	中国籍，1987年7月生，北京大学工程硕士。2014年7月加入中信建投基金管理有限公司，曾任投资研究部研究员，现任中信建投睿溢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。首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

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 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不公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度以来，工业增加值不及预期、固定资产投资增速创多年以来新低、消费市场继续回落，宏观经济数据几乎全线走弱。资金面相对宽松，4月25日定向降准落地，置换9000亿元MLF，同时释放增量资金约4000亿元。整个二季度，A股各主要指数均维持震荡下跌走势。国内金融去杠杆、中美贸易摩擦等事件性因素是2018年市场调整的重要外在因素；而2017年底以及2018年初高度趋同的一致预期、交易头寸的过度拥挤是市场调整的主要内因。投资者对确定性的追逐已经使得内需消费板块的很多个股性价比明显降低，而周期、成长、金融、地产或受制于经济下行预期，或受制于货币、产业政策等因素，均未出现趋势性反转行情。2018年5月21日，产品第一个保本期到期，我们根据合同约定，将持有资产及时变现应对到期赎回，2018年5月25日起“中信建投稳溢保本混合型证券投资基金”转型为“中信建投睿溢混合型证券投资基金”。其后，我们根据市场状况，主要配置固收类资产，以少量资产投资股票市场，精选个股，在6月份市场下跌的过程中依然取得了一定正收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末基金份额净值为1.0494元，累计份额净值1.0494；自基金转型以来，基金份额净值增值率为0.58%，同期业绩比较基准收益率为-0.75%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情形。

§ 5 投资组合报告(转型后)

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	3,520,577.00	5.05
	其中：股票	3,520,577.00	5.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	46,322,600.00	66.40
	其中：债券	46,322,600.00	66.40
	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	15,000,000.00	21.50
	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	4,677,535.88	6.70
8	其他资产	246,940.38	0.35
9	合计	69,767,653.26	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)	占基金资产净值的比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,520,577.00	5.06
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	-	-
	合计	3,520,577.00	5.06

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	000651	格力电器	21,000	990,150.00	1.42
2	002572	索菲亚	17,000	547,060.00	0.79
3	603707	健友股份	20,000	542,600.00	0.78
4	002415	海康威视	14,100	523,533.00	0.75
5	002035	华帝股份	15,000	366,450.00	0.53
6	600519	贵州茅台	400	292,584.00	0.42
7	002078	太阳纸业	20,000	193,800.00	0.28
8	300296	利亚德	5,000	64,400.00	0.09

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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,026,600.00	10.11
	其中：政策性金融债	7,026,600.00	10.11
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	39,296,000.00	56.52
9	其他	-	-
10	合计	46,322,600.00	66.62

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	111816177	18上海银行C D177	100,000	9,904,000.00	14.24
2	111818157	18华夏银行C D157	100,000	9,904,000.00	14.24
3	111815297	18民生银行C D297	100,000	9,802,000.00	14.10
4	111899833	18宁波银行C D118	100,000	9,686,000.00	13.93
5	018005	国开1701	70,000	7,026,600.00	10.11

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

无。

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

无。

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

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

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 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	92,134.61
2	应收证券清算款	14,239.73
3	应收股利	-
4	应收利息	140,566.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	246,940.38

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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。

§ 5 投资组合报告（转型前）

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	1,815,500.00	0.68
	其中：股票	1,815,500.00	0.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	265,698,558.77	99.23
8	其他资产	244,938.14	0.09
9	合计	267,758,996.91	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)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,815,500.00	1.41
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	-	-
	合计	1,815,500.00	1.41

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	600309	万华化学	50,000	1,815,500.00	1.41

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

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 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	108,439.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	136,499.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	244,938.14

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600309	万华化学	1,815,500.00	1.41	停牌

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。

§ 6 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

基金合同生效日的基金份额总额	123,818,927.07
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	11,322.25
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	57,574,805.53
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	66,255,443.79

§ 6 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

报告期期初基金份额总额	667,220,178.30
报告期期间基金总申购份额	4,504.10
减：报告期期间基金总赎回份额	543,405,755.33
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	123,818,927.07

§ 7 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（转型后）

本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

本报告期内，基金管理人未运用固有资本投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

本报告期内，基金管理人未运用固有资本投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本报告期内，未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2018年5月16日披露了《关于中信建投稳溢保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及中信建投睿溢混合型证券投资基金转型运作后相关业务规则的公告》、《关于修订中信建投稳溢保本混合型证券投资基金基金合同的公告》、《中信建投睿溢混合型证券投资基金基金合同》、《中信建投睿溢混合型证券投资基金托管协议》、《中信建投睿溢混合型证券投资基金招募说明书》；

基金管理人于2018年5月17日披露了《关于中信建投稳溢保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及中信建投睿溢混合型证券投资基金转型运作后相关业务规则的第一次提示性公告》；

基金管理人于2018年5月18日披露了《关于中信建投稳溢保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及中信建投睿溢混合型证券投资基金转型运作后相关业务规则的第二次提示性公告》；

基金管理人于2018年5月25日披露了《中信建投睿溢混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务公告》；

基金管理人于2018年6月7日披露了《中信建投睿溢混合型证券投资基金关于变更基金经理的公告》。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投睿溢混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投睿溢混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 5、《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金托管协议》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、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
二〇一八年七月十九日