

中信建投睿溢混合型证券投资基金  
招募说明书（更新）摘要

2019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：上海浦东发展银行股份有限公司

二零一九年七月

## 重要提示

中信建投睿溢混合型证券投资基金（以下简称“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。中信建投稳溢保本混合型证券投资基金申请募集的准予注册文件名称为：《关于准予中信建投稳溢保本混合型证券投资基金注册的批复》（中国证监会证监许可〔2016〕687号）。本基金基金合同于2018年5月25日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对中信建投稳溢保本混合型证券投资基金的注册及其转型为本基金的备案，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

投资有风险，投资人申购基金份额时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资人自行承担。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。本基金将投资中小企业私募债券，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。中小企业私募债的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。信用风险指发债主体违约的风险，是中小企业私募债最大的风险。流动性风险是由于

中小企业私募债交投不活跃导致的投资者被迫持有到期的风险。市场风险是未来市场价格（利率、汇率、股票价格、商品价格等）的不确定性带来的风险，它影响债券的实际收益率。这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

本基金为混合型基金，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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。本更新的招募说明书所载内容截止日为 2019 年 5 月 25 日，有关财务数据和净值截止日为 2019 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。本基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

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17、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。曾任中信证券股份有限公司交易部总经理、长盛基金管理有限公司总经理等，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，兼任中信建投证券股份有限公司资产管理部行政负责人、中信建投基金管理有限公司董事长。

邱黎强先生，副董事长、总经理，北京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行政负责人等，现任中信建投基金管理有限公司副董事长、总经理，兼任元达信资本管理（北京）有限公司执行董事。

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等，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）财务资产部副主任等，现任江苏省广播电视总台（集团）财务资产部主任、中信建投基金管理有限公司董事，兼任江苏广电石湫影视基地有限公司董事、江苏广行天下汽车销售服务有限公司董事。

袁野先生，常务副总经理、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等，现任中信建投基金管理有限公司常务副总经理、职工董事。

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等，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。

王军先生，独立董事，中国农业大学博士研究生学历。现任中国农业大学经济管理学院金融系讲师及系副主任、中国农业大学中国期货与金融衍生品研究中心副主任兼秘书长、中国农业大学 MBA 教育中心副主任及党支部书记、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、天健光华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等，现任大华会计师事务所合伙人兼事务所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。

胡家勇先生，独立董事，中南财经大学博士研究生学历。曾任中南财经大学助教、讲师、副教授、教授等，现任中国社会科学院经济研究所研究员、中信建投基金管理有限公司独立董事，兼任国家社会科学基金评审组专家、中国博士后科学基金评审组专家、全国科技名词审定委员会委员、经济贸易名词审定委员会副主任。

## 2、监事会成员

陆亚女士，监事会主席，中国人民大学硕士学历。曾就职于中国人民大学教务

秘书、中国证券市场研究设计中心分析员、京都会计师事务所注册会计师、华夏证券业务主管等，现任中信建投证券股份有限公司首席风控师、风险管理部行政负责人、董事总经理、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、总经理等，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等，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，兼任南京市金陵文化科技小额贷款有限公司董事、江苏展响实业有限公司董事。

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、曾任中信建投基金管理有限公司总经理助理、特定资产管理部负责人等，现任元达信资本管理（北京）有限公司总经理、中信建投基金管理有限公司职工监事。

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、中信建投基金管理有限公司信息技术部负责人等，现任中信建投基金管理有限公司项目经理、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等，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。

邱黎强先生，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。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、中信建投基金管理有限公司督察长等，现任中信建投基金管理有限公司副总经理。

高翔先生，太原机械学院（现中北大学）本科学历。曾任广东深圳蛇口新欣软

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等，现任中信建投基金管理有限公司副总经理，兼任元达信资本管理（北京）有限公司执行监事。

张乐久先生，加拿大不列颠哥伦比亚大学硕士研究生学历。曾任中大期货有限公司研究员、太平洋证券股份有限公司研究员、中国证券监督管理委员会北京监管局主任科员、北京同瑞汇金管理有限公司合规专员等，现任中信建投基金管理有限公司督察长。

#### 4、本基金基金经理

刘锋，北京大学工程硕士。曾任中信建投基金管理有限公司投资研究部研究员，现任中信建投基金管理有限公司投资部-股票投资部基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

王琦先生，简历同上。

栾江伟先生，北京协和医学院药物分析学硕士。曾任新华基金管理股份有限公司基金经理，现任中信建投基金管理有限公司投资部-股票投资部负责人。

刘博先生，英国华威大学金融学硕士。曾任沈阳序和科技开发有限公司总经理助理、中诚信国际信用评级有限责任公司分析师、招商证券股份有限公司研究员、中信建投证券股份有限公司固定收益部高级副总裁，现任中信建投基金管理有限公司投资部-固收投资部负责人。

周户先生，南开大学经济学硕士。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、国金证券股份有限公司及其下属基金公司研究员、中信建投基金管理有限公司投资研究部研究员，现任中信建投基金管理有限公司投资部-股票投资部基金经理。

许健先生，中央财经大学统计学硕士。曾任中国邮政集团公司投资主办、中信银行股份有限公司固定收益投资经理，现任中信建投基金管理有限公司投资部-固收投资部基金经理。

#### 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

本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“上海浦东发展银行”），基本信息如下：

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

成立时间：1992 年 10 月 19 日

经营范围：经中国人民银行和中国银行保险监督管理委员会批准，公司主营业务主要包括：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；经中国人民银行和中国银行保险监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：293.52 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105 号

联系人：胡波

联系电话：021-61618888

上海浦东发展银行自 2003 年开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于 2003 年设立基金托管部，2005 年更名为资产托管部，2013 年更名为资产托管与养老金业务部，2016 年进行组织架构优化调整，并



更名为资产托管部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心（含合肥分中心）五个职能处室。

目前，上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品，形成完备的产品体系，可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

## （二）主要人员情况

高国富，男，1956年出生，研究生学历，博士学位，高级经济师职称。曾任上海外高桥保税区开发（控股）公司总经理；上海外高桥保税区管委会副主任；上海万国证券公司代总裁；上海久事公司总经理；上海市城市建设投资开发总公司总经理；中国太平洋保险（集团）股份有限公司党委书记、董事长。现任上海浦东发展银行股份有限公司党委书记、董事长。第十二届全国政协委员。伦敦金融城中国事务顾问委员会委员，中欧国际工商学院理事会成员、国际顾问委员会委员，上海交通大学安泰经济管理学院顾问委员会委员。

刘信义，男，1965年出生，硕士研究生，高级经济师。曾任上海浦东发展银行上海地区总部副总经理，上海市金融服务办挂职任机构处处长、市金融服务办主任助理，上海浦东发展银行党委委员、副行长、财务总监，上海国盛集团有限公司总裁。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长。

孔建，男，1968年出生，博士研究生。历任工商银行山东省分行计划处科员、副主任科员，国际业务部、工商信贷处科长，资金营运处副处长，上海浦东发展银行济南分行信管处总经理，上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行资产托管部党支部书记、资产托管部总经理。

## （三）基金托管业务经营情况

截止2019年3月31日，上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为4614.20亿元，比去年末增加9.52%。托管证券投资基金共一百五十六只，分别为国泰金龙行业精选基金、国泰金龙债券基金、天治财富增长基金、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、嘉实优质企业基金、国联安货币基金、长信利众债券基金（LOF）、华富保本混合型证券投资基金、中海策略精选灵活配置混合基金、

博时安丰18个月基金（LOF）、易方达裕丰回报基金、鹏华丰泰定期开放基金、汇添富双利增强债券基金、中信建投稳信债券基金、华富恒财定开债券基金、汇添富和聚宝货币基金、工银目标收益一年定开债券基金、北信瑞丰宜投宝货币基金、中海医药健康产业基金、国寿安保尊益信用纯债基金、华富国泰民安灵活配置混合基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安鑫享混合基金、长安鑫利优选混合基金、工银瑞信生态环境基金、天弘新价值混合基金、嘉实机构快线货币基金、鹏华REITs封闭式基金、华富健康文娱基金、国寿安保稳定回报基金、金鹰改革红利基金、易方达裕祥回报债券基金、国联安鑫禧基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新活力混合基金、鑫元汇利债券型基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券基金、富安达长盈灵活配置混合型基金、中信建投睿溢混合型证券投资基金、工银瑞信恒享纯债基金、长信利发债券基金、博时景发纯债基金、鑫元得利债券型基金、中银尊享半年定开基金、鹏华兴盛灵活配置混合型证券投资基金、华富元鑫灵活配置基金、东方红战略沪港深混合基金、博时富发纯债基金、博时利发纯债基金、银河君信混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、兴业启元一年定开债券基金、工银瑞信瑞盈18个月定开债券基金、中信建投稳裕定开债券基金、招商招怡纯债债券基金、中加丰享纯债债券基金、长安泓泽纯债债券基金、银河君耀灵活配置混合基金、广发汇瑞3个月定期开放债券发起式证券投资基金、汇安嘉汇纯债债券基金、南方宣利定开债券基金、招商兴福灵活配置混合基金、博时鑫润灵活配置混合基金、兴业裕华债券基金、易方达瑞通灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、易方达瑞程混合基金、华福长富一年定开债券基金、中欧骏泰货币基金、招商招华纯债债券基金、汇安丰融灵活配置混合基金、汇安嘉源纯债债券基金、国泰普益混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、鑫元合丰纯债债券基金、博时鑫惠混合基金、国泰润利纯债基金、华富天益货币基金、汇安丰华混合基金、汇安沪深300指数增强型证券投资基金、汇安丰恒混合基金、交银施罗德启通灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证500指数基金、南方和利定开债券基金、鹏华丰康债券基金、兴业安润货币基金、兴业瑞丰6个月定开债券基金、兴业裕丰债券基金、易方达瑞弘混合基金、银河犇利灵活配置混合基金、长安鑫富领先混合基金、万家现金增利货币基金、上银慧增利货币市场基金、易方达瑞富灵活配置证券投资基金、博时富腾纯债债券型证券投资基金、安信工业4.0主题沪港深精选混合基金、民生加银鑫顺债券型基金、万家天添宝货币基金、长安鑫珏主题轮动混合基

金、中欧瑾泰灵活配置混合基金、中银证券安弘债券基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券基金、广发高端制造股票型发起式基金、永赢永益债券基金、南方安福混合基金、中银证券聚瑞混合基金、太平改革红利精选灵活配置混合基金、富荣富乾债券型证券投资基金基金、国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金、前海开源景鑫灵活配置混合型证券投资基金、前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金、中海沪港深多策略灵活配置混合型基金基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、前海开源盛鑫灵活配置混合型证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富国颐利纯债债券型证券投资基金、华安安浦债券型证券投资基金、南方泽元债券型证券投资基金、鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型基金、新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金基金、中银中债3-5年期农发行债券指数证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、平安大华惠锦纯债债券型证券投资基金、华夏鼎通债券型证券投资基金、鑫元全利债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、嘉实致盈债券型证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信瑞福纯债债券型证券投资基金、广发景智纯债债券型证券投资基金、东兴品牌精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债1-3年国开行债券指数证券投资基金、融通通捷债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金、中欧瑾泰债券型证券投资基金、国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金、博时中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金、银河家盈纯债债券型证券投资基金、博时富永纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、南方畅利定期开放债券型发起式证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金、华安安泰定期开放债券型发起式证券投资基金、华富中证5年恒定久期国开债指数型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金等。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额销售机构

##### 1、直销机构

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

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、其他销售机构

###### （1）上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市中山东一路12号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

传真：021-63602431

联系人：虞谷云、周毅

客户服务电话：95528

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

###### （2）北京银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：张东宁

传真：010-66226045

联系人：周黎

客户服务电话：95526

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

（3）北京农村商业银行股份有限公司

住所：北京市西城区阜成门内大街 410 号

办公地址：北京市西城区金融大街 9 号金融街中心 B 座

法定代表人：乔瑞

传真：010-63229478

联系人：董张丽

客户服务电话：96198

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

（4）上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼

法定代表人：其实

传真：021-64385308

联系人：夏雯

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

客户服务电话：95021、4001818188

（5）上海陆金所基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：王之光

传真：021-22066653

联系人：程晨

客户服务电话：400-821-9031

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

（6）渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河东区海河东路 218 号

办公地址：天津市河东区海河东路 218 号

法定代表人：李伏安

联系人：王婷婷

联系方式：022-58555896

传真：022-58316259

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

（7）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心西塔14层

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

客户服务电话：95188

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

（8）浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人：凌顺平

传真：0571-88910240

联系人：李珍珍

客户服务电话：400-877-3772

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

（9）大泰金石基金销售有限公司

住所：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室

办公地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼

法定代表人：袁顾明

传真：021-20324199

联系人：赵明

客户服务电话：400-928-2266

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

（10）北京电盈基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1号楼36层3603室

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦F座12层B室

法定代表人：程刚

联系人：张旭

传真：010-56176117

客服电话：400-100-3391

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

（11）上海凯石财富基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

传真：021-63332523

联系人：李晓明

客服电话：4000 178 000

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

（12）珠海盈米基金销售有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 B1201-1203

法定代表人：肖雯

传真：020-89629011

联系人：邱香香

客户服务电话：020-89629066

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

（13）北京钱景基金销售有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

传真：010-57569671

联系人：魏争

客户服务电话：400-678-5095

网址：[www.niuji.net](http://www.niuji.net)

（14）武汉市伯嘉基金销售有限公司

地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第 7 栋  
23 层 1 号、4 号

法定代表人：陶捷

联系人：孔繁

客户服务电话：027-87006003

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

（15）北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人：王伟刚

传真：010-62680827

联系人：于伟伟

客户服务电话：400-619-9059

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

（16）北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层

法定代表人：梁越

传真：010-56810630

联系人：张敏

客户服务电话：400-898-0618

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

（17）北京肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部

法定代表人：江卉

传真：010-89180000

联系人：黄立影

客户服务电话：95118、400-098-8511

网址：<http://fund.jd.com>

（18）上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路5475号1033室



办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

传真：021-50583633

联系人：陈洁

客户服务电话：400-067-6266

网址：<http://a.leadfund.com.cn/>

（19）中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

传真：010-60833739

联系人：马静懿

客户服务电话：95548

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

（20）中信期货有限公司

住所：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305、14 层

法定代表人：张皓

传真：0755-83217421

联系人：王佳

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

客户服务电话：400-990-8826

（21）中信证券（山东）有限责任公司

住所：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：山东省青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

传真：0532-68722193

联系人：孙秋月

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

客户服务电话：95548

（22）北京格上富信基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：李悦章

联系人：张林

传真：010-65983333

客户服务电话：400-066-8586

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

（23）北京微动利基金销售有限公司

注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

法定代表人：季长军

联系人：王伟丽

传真：010-68854009

客户服务电话：400-8196-665

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

（24）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

传真：021-68596916

联系人：徐超逸

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

客户服务电话：400-700-9665

（25）北京中期时代基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号

办公地址：北京市朝阳区光华路 16 号中期大厦 2 层

法定代表人：姜新

联系人：侯英建

传真：010-65807864

客服电话：010-65807609

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

（26）上海云湾基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层

法定代表人：戴新装

联系人：江辉

传真：021-20538999

客服电话：400-820-1515

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

（27）中信建投期货有限公司

办公地址：重庆市渝中区中山三路107号上站大楼11-B,名义层11-A,8-B4,9-

B、C

法定代表人：彭文德

联系人：刘芸

客户服务电话：400-8877-780、023-63600049

网址：[www.cfc108.com](http://www.cfc108.com)

（28）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座9层

法定代表人：陈操

传真：010-58325282

联系人：刘宝文

网址：<http://8.jrj.com.cn/>

客户服务电话：400-850-7771

（29）深圳前海汇联基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区粤兴二道6号武汉大学深圳产学研大楼B815

办公地址：深圳市南山区软件产业基地4栋D座三楼

法定代表人：万勇

联系人：蒋晋文

传真：0755-86725180

客服电话：0755-86722851

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

（30）长城证券股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

传真：0755-83515567

联系人：徐锦山

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

客户服务电话：400-666-6888、0755-33680000

（31）乾道盈泰基金销售（北京）有限公司

住所：北京市海淀区东北旺村南 1 号楼 7 层 7117 室

办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室

法定代表人：王兴吉

传真：010-82057741

联系人：赵靖伟

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

客户服务电话：4000888080

（32）喜鹊财富基金销售有限公司

注册地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

办公地址：北京市朝阳区北苑路安苑里 1 号奇迹大厦 6 层

法定代表人：陈皓

传真：010-50877697

联系人：张萌

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

客户服务电话：0891-6177483

**（33）万家财富基金销售（天津）有限公司**

住所：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人：李修辞

联系人：李明然

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

客户服务电话：010-59013895

**（34）上海长量基金销售有限公司**

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

传真：021-20691861

联系人：党敏

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

客户服务电话：400-820-2899

**（35）天津国美基金销售有限公司**

住所：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层 202-124 室

办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 9 层

法定代表人：丁东华

传真：010-59287825

联系人：郭宝亮

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

客户服务电话：400-111-0889

**（36）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

传真：010-65182261

联系人：权唐

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

客户服务电话：400-8888-108

（37）南京苏宁基金销售有限公司

住所：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

传真：025-66008800-887226

联系人：张慧

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

客户服务电话：95177

（38）北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

传真：010-61840699

联系人：侯芳芳

网址：<https://danjuanapp.com>

客户服务电话：400-159-9288

（39）东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

传真：021-50498825

联系人：王一彦

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

客户服务电话：95531、400-888-8588

（40）泰诚财富基金销售（大连）有限公司

住所：辽宁省大连市沙河口区星海公园 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海公园 3 号

法定代表人：林卓

传真：0411-84396536

联系人：张晓辉

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

客户服务电话：400-6411-999

（41）上海联泰基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层

法定代表人：燕斌

传真：021-52975270

联系人：兰敏

网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

客户服务电话：400-166-6788

（42）北京植信基金销售有限公司

住所：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106-67

办公地址：北京市朝阳区盛世龙源国食苑10号楼

法定代表人：杨纪峰

传真：010-67767615

联系人：吴鹏

网址：[www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

客户服务电话：400-680-2123

（43）济安财富（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

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

客户服务电话：400-673-7010

（44）上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济  
发展区）

办公地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

法定代表人：王翔

传真：021-55085991

联系人：李关洲

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

客户服务电话：400-820-5369

（45）和耕传承基金销售有限公司

住所：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503

办公地址：郑州市郑东新区东风南路康宁街新发展大厦 503

法定代表人：王璇

联系人：董亚芳

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

客户服务电话：4000-555-671

（46）深圳前海财厚基金销售有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区深圳湾科技生态园三千 11 栋 A 座 3608 室

法定代表人：杨艳平

传真：0755-26640652

联系人：莫婉

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

客户服务电话：400-1286-800

3、基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》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、陆奇

联系人：陆奇

### （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：上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼

法定代表人：李丹

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：张勇

经办注册会计师：张勇、郭蕙心

## 四、基金的名称

中信建投睿溢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。

## 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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的0%-40%；其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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保证金以后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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

### 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

本基金关注的重点包括行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。

### （2）个股投资策略

本基金在选定品牌类上市公司的股票作为主要配置方向后，将对个股逐一进行梳理和筛选，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，自下而上精选个股。

## 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，通过严密的投资决策流程、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。

对于中小企业私募债券，本基金的投资策略以持有到期为主，所投资的中小企业私募债券的剩余期限不超过每一运作周期的剩余封闭运作期。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，动态的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。

## 十、基金的业绩比较基准

沪深 300 指数收益率\*20%+中债总财富指数收益率\*80%

沪深 300 指数选取了 A 股市场上规模最大、流动性最好的 300 只股票作为其成份股，较好地反映了 A 股市场的总体趋势，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中债总财富指数的编制参考了中国债券市场中部分核心成员的收益率估值数据，以更好地反映债券价格信息，是目前市场上较有影响力的债券投资业绩比较基准。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，又或者市场推出更具权威、且更能够表征混合型基金风险收益特征的指数，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业绩比较基准，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2019年6月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。

本投资组合报告所载数据截至2019年3月31日（摘自本基金2019年第1季度报告），本报告中所列财务数据未经审计。

### （一）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	11,935,147.00	39.66
	其中：股票	11,935,147.00	39.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,941,580.00	52.97
	其中：债券	15,941,580.00	52.97
	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	1,446,554.99	4.81
8	其他资产	771,663.56	2.56
9	合计	30,094,945.55	100.00

（二）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	10,511,547.00	35.11
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	169,600.00	0.57
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,254,000.00	4.19
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	11,935,147.00	39.86

2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

（三）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	600519	贵州茅台	2,300	1,964,177.00	6.56
2	000651	格力电器	40,000	1,888,400.00	6.31
3	002415	海康威视	45,000	1,578,150.00	5.27
4	002008	大族激光	33,500	1,413,700.00	4.72
5	002304	洋河股份	10,000	1,304,200.00	4.36
6	002027	分众传媒	200,000	1,254,000.00	4.19
7	002311	海大集团	42,000	1,184,400.00	3.96
8	002035	华帝股份	84,000	1,178,520.00	3.94
9	600036	招商银行	5,000	169,600.00	0.57

（四）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	15,941,580.00	53.24
	其中：政策性金融债	15,941,580.00	53.24
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	15,941,580.00	53.24
----	----	---------------	-------

（五）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	180211	18国开11	100,000	10,141,000.00	33.87
2	018005	国开1701	58,000	5,800,580.00	19.37

（六）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。

（七）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。

（八）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。

（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

（十一）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	7,601.64



2	应收证券清算款	309,510.20
3	应收股利	-
4	应收利息	454,057.65
5	应收申购款	494.07
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	771,663.56

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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、基金的业绩

基金业绩截止日为2019年3月31日。

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。

（一）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	12.36%	0.68%	6.22%	0.29%	6.14%	0.39%

2018年5月25日-2018年12月31日	-6.15%	0.47%	-0.10%	0.28%	-6.05%	0.19%
------------------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

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年。

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%。

（二）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



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年。

2、根据本基金基金合同的约定，本基金自基金合同生效之日起6个月为建仓期，建仓期结束后本基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

## 十四、基金的费用与税收

### （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、销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、账户开户费用和账户维护费；
- 10、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 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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。

### 3、销售服务费

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年费率为 0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

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。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

销售服务费每日计算，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销售服务费划款指令，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登记机构，经登记机构代付给各个基金销售机构。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 4—10 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的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的各项纳税主体，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》、《公开募集开放式基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规的要求，对《中信建投睿溢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“第八部分 基金份额的申购与赎回”的相关内容；
- 5、更新了“第十四部分 基金费用与税收”的相关内容；
- 6、更新了“第九部分 基金的投资”的相关内容，基金的投资组合报告经托管人复核；
- 7、更新了“第十部分 基金的业绩”的相关内容，并经托管人复核；
- 8、更新了“第二十二部分 其他应披露事项”，列示了本次更新期间与本基金相关的公告事项。

中信建投基金管理有限公司

2019年7月