中信建投货币市场基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:中信建投基金管理有限公司
基金托管人:华夏银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月21日

§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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月19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。

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。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中信建投货币
交易代码	000738
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年05月15日
报告期末基金份额总额	56,500,839.34份
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将通过对宏观经济发展态势、金融监管政策、财政与货币政策、市场及其结构变化和短期的资金供需等因素的分析,形成对市场短期利率走势的判断。在以上分析的基础上,本基金将根据不同类别资产的收益率水平(不同剩余期限到期收益率、利息支付方式以及再投资便利性),结合各类资产的流动性特征(日均成交量、交易方式、市场容量)和风险特征(信用等级、波动性),决定各类资产的配置比例和期限匹配情况。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中低风险的品种,其长期平均的风险和预期收益率低于股票基金、混合基金和债券基金。
基金管理人	中信建投基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1. 本期已实现收益	392,669.49
2. 本期利润	392,669.49
3. 期末基金资产净值	56,500,839.34

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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金的利润分配按日结转基金份额。

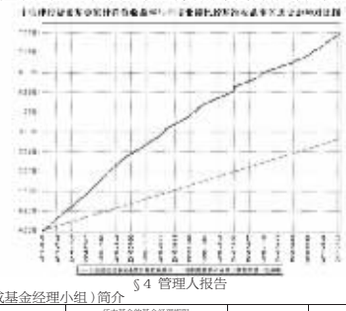
3、持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7089%	0.0048%	0.3494%	0.0000%	0.3595%	0.0048%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§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		
黄海浩	本基金的基金经理	2016年8月25日	-	6	中国籍,1985年10月生,山东大学物流工程工科学学士,曾任利顺金融(深圳)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,现任瑞银基金管理有限公司交易部债券交易员,中信建投基金管理有限公司交易部交易员。现任本公司投资研究部基金经理,担任中信建投稳定顺开放债券型证券投资基金,中信建投货币市场基金,中信建投风盈货币市场基金,中信建投添鑫定货币市场基金,中信建投稳裕定期开放债券型证券投资基金,中信建投稳健债券型证券投资基金,中信建投稳利债券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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金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和运用基金资产,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非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年一季度,宏观经济企稳迹象更加明显,PPI大幅回升,CPI明显回落后低位震荡。货币政策有所收紧,财政政策保持偏积极态势,同时房地产限购限贷力度进一步加大。

尽管经济显现企稳迹象,但在货币和房地产政策收紧,并购重组审核力度明显加强的情况下,股票表现分化明显,稳定成长的家电、食品饮料,以及受益于基建与“一带一路”预期的建筑、建材等板块强势明显,受行业景气回落以及重组受限的传媒、农业等板块跌幅居前。

本基金在一季度中主要以股票配置为主,尽管基金管理人较好判断了宏观经济走势,并布局了部分景气回升板块,但组合内也有少数品种表现不佳,一季度净值仅有微幅回升。展望后市,基金管理人对经济继续温和复苏以及组合个股前景均有良好预期和信心, 相信未来一个阶段能够为持有人带来合理回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.035元,本报告期份额净值增长率为0.29%,同期业绩比较基准收益率为1.52%。

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20个工作日基金份额持有人数量不满200人的情形。

本基金自2017年2月22日起,截至本报告期末,已连续28个工作日资产净值低于五千万元。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	17,948,950.00	39.46
	其中:股票	17,948,950.00	39.46
2	基金投资	-	
3	固定收益投资	5,023,500.00	11.04
	其中:债券	5,023,500.00	11.04
	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	19,000,000.00	41.77
	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	1,381,523.15	3.04
8	其他资产	2,137,648.26	4.70
9	合计	45,491,621.41	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	债券品种	摊余成本(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	3,601,156.20	6.37
	其中:政策性金融债	3,601,156.20	6.37
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	3,998,709.36	7.08
6	中期票据	-	-
7	同业存单	15,181,344.06	28.11
8	其他	-	-
9	合计	23,481,209.61	41.56
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111606525	16招商银行CD042	90,000	8,917,203.58	15.78
2	111712022	17北京银行CD022	70,000	6,964,134.47	12.33
3	011697010	16沪华信SCP006	40,000	3,998,709.36	7.08
4	170301	17进出01	26,000	2,593,409.84	4.59
5	140347	14进出47	10,000	1,007,746.36	1.78

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	-0.0206%
报告期内偏离度的最低值	-0.1081%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0682%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内未出现负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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十名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1689159	16家盛1A	10,000	112,100.00	0.20

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金估值采用摊余成本法,即计价对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内按实际利率法摊销,每日计提损益。本基金通过每日计算收益并分配的方式,使基金份额净值始终保持在1.0000元。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	794.44
3	应收利息	151,911.81
4	应收申购款	10,345.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	163,051.25

5.9.4 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

单位:份

报告期期初基金份额总额	70,297,478.58
报告期期间基金总申购份额	25,613,253.12
报告期期间基金总赎回份额	39,409,892.36
报告期期末基金份额总额	56,500,839.34

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投资份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2017年1月3日	7,426.92	0.00	0.00%
2	红利再投	2017年1月4日	1,897.98	0.00	0.00%
3	红利再投	2017年1月5日	1,807.75	0.00	0.00%
4	红利再投	2017年1月6日	905.26	0.00	0.00%
5	红利再投	2017年1月9日	3,885.29	0.00	0.00%
6	红利再投	2017年1月10日	1,289.70	0.00	0.00%
7	红利再投	2017年1月11日	1,309.16	0.00	0.00%
8	红利再投	2017年1月12日	1,288.79	0.00	0.00%
9	红利再投	2017年1月13日	1,251.87	0.00	0.00%
10	红利再投	2017年1月16日	2,558.82	0.00	0.00%
11	红利再投	2017年1月17日	853.35	0.00	0.00%
12	红利再投	2017年1月18日	820.97	0.00	0.00%
13	红利再投	2017年1月19日	821.81	0.00	0.00%
14	红利再投	2017年1月20日	1,167.46	0.00	0.00%
15	红利再投	2017年1月23日	4,585.77	0.00	0.00%
16	红利再投	2017年1月24日	1,531.28	0.00	0.00%
17	红利再投	2017年1月25日	1,533.94	0.00	0.00%
18	基金申购	2017年1月26日	1,000,000.00	1,000,000.00	0.00%
19	红利再投	2017年1月26日	1,472.84	0.00	0.00%
20	红利再投	2017年2月3日	12,393.09	0.00	0.00%
21	红利再投	2017年2月6日	4,516.65	0.00	0.00%
22	红利再投	2017年2月7日	1,504.80	0.00	0.00%
23	红利再投	2017年2月8日	1,501.77	0.00	0.00%
24	红利再投	2017年2月9日	1,411.14	0.00	0.00%
25	红利再投	2017年2月10日	1,357.49	0.00	0.00%
26	红利再投	2017年2月13日	13,417.86	0.00	0.00%
27	红利再投	2017年2月14日	1,297.69	0.00	0.00%
28	红利再投	2017年2月15日	1,333.36	0.00	0.00%
29	红利再投	2017年2月16日	1,308.45	0.00	0.00%
30	红利再投	2017年2月17日	1,444.81	0.00	0.00%
31	红利再投	2017年2月20日	4,296.32	0.00	0.00%
32	红利再投	2017年2月21日	1,503.84	0.00	0.00%
33	红利再投	2017年2月22日	1,421.91	0.00	0.00%
34	红利再投	2017年2月23日	1,517.32	0.00	0.00%
35	红利再投	2017年2月24日	1,702.41	0.00	0.00%
36	红利再投	2017年2月27日	5,133.84	0.00	0.00%
37	红利再投	2017年2月28日	1,714.42	0.00	0.00%
38	红利再投	2017年3月1日	1,725.97	0.00	0.00%
39	红利再投	2017年3月2日	1,694.82	0.00	0.00%
40	红利再投	2017年3月3日	1,701.79	0.00	0.00%
41	红利再投	2017年3月6日	4,818.11	0.00	0.00%
42	红利再投	2017年3月7日	1,608.18	0.00	0.00%
43	红利再投	2017年3月8日	1,524.78	0.00	0.00%
44	红利再投	2017年3月9日	1,594.91	0.00	0.00%
45	红利再投	2017年3月10日	1,579.09	0.00	0.00%
46	红利再投	2017年3月13日	4,764.12	0.00	0.00%
47	红利再投	2017年3月14日	1,590.06	0.00	0.00%
48	红利再投	2017年3月15日	1,595.64	0.00	0.00%
49	红利再投	2017年3月16日	1,718.17	0.00	0.00%
50	红利再投	2017年3月17日	1,857.97	0.00	0.00%
51	红利再投	2017年3月20日	5,571.33	0.00	0.00%
52	红利再投	2017年3月21日	1,857.61	0.00	0.00%
53	红利再投	2017年3月22日	1,861.67	0.00	0.00%
54	红利再投	2017年3月23日	1,863.99	0.00	0.00%
55	红利再投	2017年3月24日	1,937.25	0.00	0.00%
56	红利再投	2017年3月27日	5,694.84	0.00	0.00%
57	红利再投	2017年3月28日	1,900.04	0.00	0.00%
58	红利再投	2017年3月29日	1,906.38	0.00	0.00%
59	红利再投	2017年3月30日	1,964.45	0.00	0.00%
60	红利再投	2017年3月31日	2,294.31	0.00	0.00%
合计			1,149,670.51	1,000,000.00	

§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

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	20170101-20170104	20,008,259.19	10,968.48	20,019,224.67	-	-
	2	20170101-20170331	20,151,473.86	1,147,381.19	-	21,298,855.74	37.76
产品特有风险							
本基金本报告期间存在单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况,请投资人注意本基金的流动性和投资者集中度风险。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《中信建投货币市场基金合同》;

3、《中信建投货币市场基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅,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4月21日

中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

【2017】第一季度报告

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
报告送出日期:2017年4月21日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月18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。

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。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中信建投睿利
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
报告期末基金份额总额	36,911,677.90份
投资目标	本基金主要投资于股票等权益类金融工具和债券等固定收益类金融工具,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(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×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,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中中高预期风险、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	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	226,340.07
2.本期利润	216,037.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.0060
4.期末基金资产净值	37,149,349.61
5.期末基金份额净值	1.0064

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

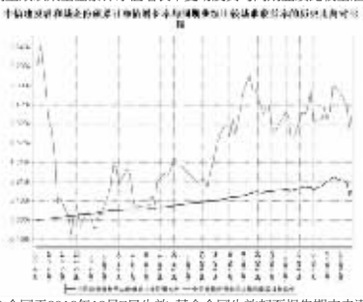
2、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

3.2 基金净值表现

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	0.47%	0.05%	2.13%	0.22%	-1.66%	-0.27%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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

2、本基金尚处于建仓期内,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个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§4 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		
王琦	本基金的基金经理,公司公募投资部投资决策委员会委员	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,曾任中海证券股份有限公司从事投资、研究工作。现任本公司产品与金融工程部基金经理,担任中信建投睿信灵活配置混合型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,曾任为州博思信息咨询顾问有限公司市场分析员、德邦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。

注:1、任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金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非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年一季度,宏观经济企稳态势持续,出口延续改善,CPI触底缓升,但PPI触顶缓降。财政政策保持偏积极态势,但货币政策缓步收紧,金融监管力度加强,房地产调控力度进一步加大。

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

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

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0064元,本报告期净值增长率为0.47%,同期业绩比较基准收益率为2.13%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,735,476.40	12.47
	其中:股票	4,735,476.40	12.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,500,750.00	6.59
	其中:债券	2,500,750.00	6.59
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	29,500,000.00	77.70
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	451,090.03	1.19
8	其他资产	779,428.60	2.05
9	合计	37,966,745.03	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	166,000.00	0.45
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,633,006.40	9.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	425,120.00	1.14
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	99,250.00	0.27
J	金融业	307,970.00	0.83
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	104,130.00	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,735,476.40	12.75

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通机制投资的港股。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000423	东阿阿胶	14,000	918,400.00	2.47
2	300447	全信股份	14,000	666,260.00	1.79
3	002653	海思科	36,000	551,520.00	1.48
4	603228	欣旺电子	12,958	437,980.40	1.18
5	600729	重庆百货	16,000	425,120.00	1.14
6	601965	中国汽研	35,000	357,350.00	0.96
7	600643	爱建集团	23,000	307,970.00	0.83
8	002531	天顺风能	30,000	219,600.00	0.59
9	000998	隆平高科	8,000	166,000.00	0.45
10	002262	恩华药业	6,000	132,360.00	0.36

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,500,750.00	6.73
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	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	2,500,750.00	6.73

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010213	02国债(12)	25,000	2,500,750.00	6.73

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	529.41
2	应收证券清算款	734,327.13
3	应收股利	-
4	应收利息	43,583.92
5	应收申购款	988.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	779,428.60

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	47,686,882.68
报告期期间基金总申购份额	389,692.88
减:报告期期间基金总赎回份额	11,164,897.66
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金份额总额	36,911,677.90

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,800.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期末管理人持有的本基金份额	10,000,800.00
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	27.09

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末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	27.09	10,000,800.00	27.09	3年
基金管理人高级管理人员	247,549.76	0.67	-	-	-
基金经理等人员	446,666.57	1.21	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,695,015.92	28.97	10,000,800.00	27.09	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	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	20170101-20170331	10,000,800.00	-	-	10,000,800.00	27.09
产品特有风险							
本基金本报告期间存在单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况,请投资人注意本基金的流动性和投资者集中度风险。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,无影响投资者决策的其他重要信息。

§10 备查文件目录

10.1 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。

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所。

10.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅,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4月21日

中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金

【2017】第一季度报告

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
报告送出日期:2017年4月21日

§1 重要提示

基金