中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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:2018年08月28日

§1 重要提示

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2018年8月24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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中信建投睿利	
基金主代码	003308	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月07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	23,069,886.61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	23,060,266.16份	9,620.45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(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。

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)66105798
	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)66105799

2.4 信息披露方式

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

§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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)	
	中信建投睿利A	中信建投睿利C
本期已实现收益	903,592.77	44.96
本期利润	-795,271.04	-599.09
本期基金份额净值增长率	-2.28%	-2.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末基金资产净值	22,271,306.28	9,209.95
期末基金份额净值	0.9658	0.9573

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。

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

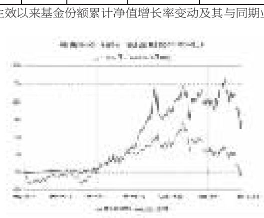
中信建投睿利A

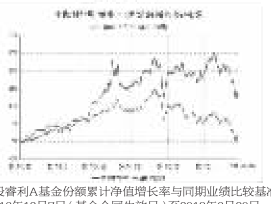
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.96%	1.10%	-4.50%	0.77%	-1.46%	0.33%
过去三个月	-4.59%	0.99%	-5.62%	0.68%	1.03%	0.31%
过去六个月	-2.28%	1.00%	-6.97%	0.69%	4.69%	0.31%
过去一年	12.96%	0.87%	-1.98%	0.57%	14.94%	0.30%
自基金合同生效起至今	14.81%	0.70%	0.48%	0.51%	14.33%	0.19%

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	-5.98%	1.10%	-4.50%	0.77%	-1.48%	0.33%
过去三个月	-4.64%	0.99%	-5.62%	0.68%	0.98%	0.31%
过去六个月	-2.42%	1.00%	-6.97%	0.69%	4.55%	0.31%
过去一年	12.59%	0.87%	-1.98%	0.57%	14.57%	0.30%
自基金合同生效起至今	13.96%	0.83%	1.45%	0.56%	12.51%	0.27%

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





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2018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2018年6月30日。

§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8月21日获得中国证监会核准设立批复,并于2013年9月9日完成工商注册登记,注册资本3亿元,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。公司全资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,主要经营特定客户资产管理业务和中国证监会许可的其他业务。

公司自成立以来积极拓展业务,公司专户管理资产月均规模根据中国证券投资基金业协会数据,连年位列前20名。截至2017年末,位居行业第13名。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;投研能力优秀,不断丰富和完善"宏微观相互印证"的大类资产配置研究框架,坚持价值投资和稳健投资的原则;投资业绩稳步上升,以良好的投资回报实现了投资人资产的保值增值。机构客户资源丰富,客户类别多,涵盖商业银行、证券公司、信托公司、财务公司、私募基金等客户资源。积极进行产品创新,响应十九大"金融服务实体经济"的号召,与政府相关部门共同开发国企改革基金;响应"调结构、降杠杆"的号召,成立产业基金,包含基础设施、环境治理、专项扶贫等关系国计民生的重大项目。

2017年度,公司荣获上交所、深交所"债券优秀交易商"荣誉称号,是行业113家基金公司中唯一一家在沪深交易所均获得该称号的公司。公司各项业务有序开展,为进一步发展奠定了良好的基础。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
周户	本基金的基金经理	2017-01-25	-	10年	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员、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。
王琦	本基金的基金经理、公司总经理助理、投资研究部负责人	2016-12-07	-	17年	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、清华永新信息工程有限公司企划部经理、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。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

2018年上半年,宏观经济平稳下滑,但经济预期则大幅度转向悲观。二季度GDP单季度同比增长6.8%,较一季度减速0.1个百分点,较去年同期减速0.2个百分点,宏观经济基本是缓步减速。然而,在宏观去杠杆、金融监管持续高压等背景下,社会融资规模持续减速,上半年同比增长9.83%,分别较去年同期和2017年年末减速2.97和2.17个百分点,同时,随着中美贸易摩擦的不断演进,市场对此的认识也不断深刻,宏观经济的预期则不断转向悲观。在经济减速的背景下,货币政策率先有所变化,4月以来连续两次降准,财政支出6月同比有所加速,但仍难以扭转经济下滑预期。

上半年,经济预期从平稳转向大幅悲观,而金融市场流动性,随着金融去杠杆的力度减弱,则比预期的宽松。在经济预期和流动性预期出现不同程度的波动的情况下,市场风格也变化较快。春节前,受益于经济复苏及油价上涨的板块,如银行、房地产、石油石化、煤炭等,涨幅居前。2月中旬至5月中下旬,在超跌反弹和短期流动性宽松超预期的背景下,创业板快速反弹,电子、计算机、通讯等TMT板块领涨。5月中下旬以后,随着降准的实施、环保政策的持续以及A股加入MSCI,龙头白马和局部周期股表现相对优异。但6月中下旬,经济预期进一步下滑,市场出现快速调整。

本基金采取相对稳健的投资策略,一季度权益投资仓位维持中性。在股票投资方面,结构相对均衡,较好的把握住了春节前的行情。二季度权益投资仓位保持平稳。在股票投资方面,投资策略为回归业绩,二季度大部分时间业绩表现相对较好,但未能避免6月末的白马股下跌,导致产品净值有所下降。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投睿利A基金份额净值为0.9658元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-2.28%,同期业绩比较基准收益率为-6.97%;截至报告期末中信建投睿利C基金份额净值为0.9573元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-2.42%,同期业绩比较基准收益率为-6.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年,宏观经济仍保持较强韧性,制造业投资不断回升,企业盈利仍保持高位,然而,经济预期则大幅度转向悲观。展望下半年,货币政策和财政政策边际上有可能不断宽松。7月出台的理财新规细则好于预期,宏观去杠杆有望转变为稳杠杆,同时,在经济下行压力仍然存在、物价存在温和上涨压力的背景下,货币政策有可能边际宽松,金融监管政策有可能力度减弱。与此同时,按照财政支出的规律,下半年财政支出的力度有可能强于上半年,同时,地方政府存量的信用风险有可能受控,财政政策也有可能边际宽松。在中美贸易摩擦持续的背景下,尽管供给侧改革和环保政策持续,货币政策和财政政策边际宽松的力度将决定紧信用的环境改善的幅度,将影响经济预期改善的幅度。在这样的政策背景下,基建投资有可能企稳回升,设备投资有望持续改善,消费有可能较为平稳,出口下滑趋势可能持续,国内经济有可能维持去库存状态,PPI有望回落,CPI存在超预期的可能。总体来讲,宏观政策边际改善的幅度,将是下半年经济预期的重要变量。紧信用的环境改善的幅度,局部领域有望进入成长回升期,同时,在中美贸易摩擦不断演化的背景下,经济减速预期仍将持续,未来经济增长仍存在较大不确定性。

展望下半年,尽管经济减速预期将持续,但在宏观政策边际改善,流动性维持较为宽松的状态下,权益市场仍将存在结构性的投资机会,如金融、化工、电子、农林牧渔、轻工、计算机、食品饮料、餐饮旅游、环保、交通运输、医药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方法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审核,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

根据《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》约定,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收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的20%。本基金管理人于2018年4月9日发布分红公告,向截至2018年4月10日止本基金登记注册的份额持有人,按每10份基金份额分配红利人民币1.823元,A类基金实际分配收益金额为人民币6,172,421.06元,C类基金实际分配收益金额为人民币184.12元。

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对基金份额持有人进行了一次利润分配,分配金额为6,172,605.18元。

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2018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:2018年06月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	1,330,507.20	1,022,423.55
结算备付金	81,473.21	274,707.80
存出保证金	13,863.23	18,820.19
交易性金融资产	19,993,927.77	13,135,785.00
其中:股票投资	18,846,751.00	11,650,957.00
基金投资	-	-
债券投资	1,147,176.77	1,484,828.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,000,000.00	11,000,000.00
应收证券清算款	821.92	161,795.23
应收利息	33,505.55	49,049.33
应收股利	-	-
应收申购款	93,555.97	998.80
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	22,547,654.85	25,663,579.90
负债和所有者权益	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	335,349.76
应付赎回款	135,958.56	40,142.11
应付管理人报酬	28,966.02	32,054.10
应付托管费	4,827.69	5,342.35
应付销售服务费	2.80	0.31
应付交易费用	22,965.32	40,382.95
应交税费	1.59	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	74,416.64	150,044.73
负债合计	267,138.62	603,316.31
所有者权益:		
实收基金	23,069,886.61	21,330,136.35
未分配利润	-789,370.38	3,730,127.24
所有者权益合计	22,280,516.23	25,060,263.59
负债和所有者权益总计	22,547,654.85	25,663,579.90

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.9658元,基金份额总额23,069,886.61份。其中,A类基金份额净值0.9658元,A类基金份额23,060,266.16份;C类基金份额净值0.9573元,C类基金份额9,620.45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:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
一、收入	-422,688.16	1,050,010.18
1.利息收入	100,195.95	791,742.97
其中:存款利息收入	9,547.81	26,683.08
债券利息收入	18,879.57	30,541.10
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	71,768.57	734,518.79
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	1,026,900.55	-326,303.44
其中:股票投资收益	836,718.00	-348,424.21
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,291.55	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	188,891.00	22,120.77
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-1,699,507.86	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)	149,723.20	43,139.27
减:二、费用	373,181.97	503,253.68
1. 管理人报酬	176,932.54	294,585.30
2. 托管费	29,488.81	49,097.58
3. 销售服务费	4.66	0.35
4. 交易费用	82,142.27	22,980.80
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	0.14	-
7. 其他费用	84,613.55	136,589.65
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-795,870.13	546,756.50
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-795,870.13	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:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06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)	21,330,136.35	3,730,127.24	25,060,263.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-795,870.13	-795,870.13
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)	1,739,750.26	2,448,977.69	4,188,727.95
其中:1.基金申购款	22,320,127.81	3,204,487.18	25,524,614.99
2.基金赎回款	-20,580,377.55	-755,509.49	-21,335,887.04
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)	-	-6,172,605.18	-6,172,605.18
五、期末所有者权益(基金净值)	23,069,886.61	-789,370.38	22,280,516.23
项目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06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

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:

蒋月勤	高翔	陈莉君
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")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]第1962号《关于准予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》的核准,由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,业经普华永道中天会计师事务所(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。经向中国证监会备案,《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》于2016年12月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为47,686,882.68份基金份额,其中认购资金利息折合19,936.07份基金份额。本基金的基金管理人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(以下简称"工商银行")。

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,本基金增加C类基金份额类别,本基金的原有基金份额全部自动划归为本基金A类基金份额。增加基金份额类别后,本基金分设A类、C类两类基金份额,两类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。本基金根据申购费、销售服务费等收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。其中:在投资者申购时收取申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为A类基金份额。从本类别基金资产中计提销售服务费而在投资者申购时不收取申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为C类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定,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(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%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,000,800.00基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

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7.4.4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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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2018年1月1日至2018年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

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;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

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基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列,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、托管费和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

每一基金份额享有同等分配权。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。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若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,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

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[2017]13号《中国证监会关于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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)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)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的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所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的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[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)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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
航天科技财务有限责任公司	基金管理人的股东
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
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
中信建投期货股份有限公司	与基金管理人同一控股股东、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
江苏省广传广播传媒有限公司	基金管理人的股东

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无。

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 债券交易

无。

6.4.8.1.4 债券回购交易

无。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	176,932.54	294,585.30
其中:支付销售机构的客户维护费	52,714.87	139,217.86

注: 支付基金管理人中信建投基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	29,488.81	49,097.58

注: 支付基金托管人工商银行股份有限公司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:

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.8.2.3 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 2018年01月01日至2018年06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	-	1.81	1.81
中信建投证券股份有限公司	-	2.81	2.81
合计	-	4.62	4.62
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06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	-	0.35	0.35
合计	-	0.35	0.35

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%年费率计提,逐日累计至每月月末,按月支付给中信建投基金管理有限公司,再由中信建投基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:C类基金日销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中信建投睿利A

份额单位:份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
基金合同生效日(2016年12月07日)持有的基金份额	10,000,800.00	10,000,800.00
报告期初持有的基金份额	10,000,800.00	10,000,800.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,800.00	10,000,800.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	43.35%	29.82%

中信建投睿利C

份额单位:份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
基金合同生效日(2016年12月07日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

6.4.8.4.2 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

无。

6.4.8.5 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 2018年01月01日至2018年06月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日 期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,330,507.20	6,312.43	659,263.07	7,768.85

注: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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300740	御家汇	2018-06-19	重大资产重组	29.91	-	-	1,000	29,570.00	29,910.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 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2018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18,893,817.77元,属于第二层次的余额为1,100,110.00元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:属于第一层次的余额为10,851,697.00元,属于第二层次的余额为2,284,088.00元,无属于第三层次的余额)。

(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2018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(2017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	18,846,751.00	83.59
	其中:股票	18,846,751.00	83.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,147,176.77	5.09
	其中:债券	1,147,176.77	5.09
	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	1,000,000.00	4.44
	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	1,411,980.41	6.26
8	其他各项资产	141,746.67	0.63
9	合计	22,547,654.85	100.00

7.2 报告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	94,300.00	0.42
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,590,412.00	43.04
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	498,050.00	2.24
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	935,690.00	4.20
J	金融业	6,253,310.00	28.07
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,474,989.00	6.62
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	18,846,751.00	84.59

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

7.3 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

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600426	华鲁恒升	109,000	1,917,310.00	8.61
2	601318	中国平安	29,500	1,728,110.00	7.76
3	600036	招商银行	61,000	1,612,840.00	7.24
4	601888	中国国旅	22,900	1,474,989.00	6.62
5	002078	太阳纸业	122,000	1,182,180.00	5.31
6	600486	扬农化工	20,000	1,118,600.00	5.02
7	601288	农业银行	320,000	1,100,800.00	4.94
8	601939	建设银行	160,000	1,048,000.00	4.70
9	000001	平安银行	84,000	763,560.00	3.43
10	600176	中国巨石	69,000	705,870.00	3.17

注: 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.cfund108.com 网站的半年度报告正文。

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	601888	中国国旅	2,997,060.70	11.96
2	601318	中国平安	2,001,228.29	7.99
3	002008	大族激光	1,969,834.00	7.86
4	600426	华鲁恒升	1,769,375.82	7.06
5	600486	扬农化工	1,730,790.00	6.91
6	002415	海康威视	1,637,512.70	6.53
7	002258	利尔化学	1,526,425.00	6.09
8	000998	隆平高科	1,431,918.00	5.71
9	000063	中兴通讯	1,419,660.00	5.66
10	002078	太阳纸业	1,299,872.00	5.19
11	600584	长电科技	1,211,966.00	4.84
12	300059	东方财富	1,027,900.40	4.10
13	000001	平安银行	941,792.00	3.76
14	600036	招商银行	931,499.92	3.72
15	603799	华友钴业	896,698.00	3.58
16	600028	中国石化	888,500.00	3.55
17	600176	中国巨石	831,530.00	3.32
18	002202	金风科技	733,128.00	2.93
19	002439	启明星辰	677,919.00	2.71
20	300373	扬杰科技	676,011.00	2.70
21	002572	索菲亚	663,593.00	2.65
22	000725	京东方A	621,500.00	2.48
23	601939	建设银行	592,565.00	2.36
24	600703	三安光电	561,700.00	2.24
25	002470	金正大	555,904.00	2.22
26	000651	格力电器	519,504.00	2.07

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	601888	中国国旅	2,241,694.95	8.95
2	002258	利尔化学	1,563,809.00	6.24
3	002008	大族激光	1,513,416.00	6.04
4	603799	华友钴业	1,452,786.40	5.80
5	002415	海康威视	1,444,537.50	5.76
6	000998	隆平高科	1,431,431.00	5.71
7	600426	华鲁恒升	1,195,465.70	4.77
8	000063	中兴通讯	1,147,155.00	4.58
9	300383	光环新网	1,143,660.00	4.56
10	000423	东阿阿胶	1,053,480.00	4.20
11	002439	启明星辰	871,422.04	3.48
12	600486	扬农化工	859,621.60	3.43
13	600584	长电科技	790,718.00	3.16
14	601233	桐昆股份	750,327.00	2.99
15	600028	中国石化	749,774.00	2.99
16	601318	中国平安	717,900.00	2.86
17	300296	利亚德	711,489.00	2.84
18	300373	扬杰科技	583,736.00	2.33
19	600416	湘电股份	583,566.00	2.33
20	300059	东方财富	555,672.36	2.22
21	600703	三安光电	542,549.00	2.16

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	37,876,679.18
卖出股票收入(成交)总额	29,814,008.55

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	1,100,110.00	4.94
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)	47,066.77	0.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,147,176.77	5.15

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	019571	17国债17	11,000	1,100,110.00	4.94
2	128035	大族转债	410	47,066.77	0.21

7.7 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

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

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

无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

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	13,863.23
2	应收证券清算款	821.92
3	应收股利	-
4	应收利息	33,505.55
5	应收申购款	93,555.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	141,746.67

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
中信建投睿利A	663	34,781.70	10,000,800.00	43.3681%	13,059,466.16	56.6319%
中信建投睿利C	6	1,603.41	-	-	9,620.45	100.00%
合计	669	34,484.14	10,000,800.00	43.3500%	13,069,086.61	56.6500%

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	602,404.87	2.6123%
	中信建投睿利C	95.51	0.9928%
	合计	602,500.38	2.6116%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中信建投睿利A	10~50
	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	43.35%	10,000,800.00	43.35%	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	602,404.87	2.61%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	95.51	0.00%	-	-	-
合计	10,603,300.38	45.96%	10,000,800.00	43.35%	-

§9 开放式基金份额变动

单位:份

	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07日)基金份额总额	47,686,882.68	-
本报告期期初基金份额总额	21,329,126.35	1,010.00
本报告期基金总申购份额	22,309,536.30	10,591.51
减:本报告期基金总赎回份额	20,578,396.49	1,981.06
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	23,060,266.16	9,620.45

§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

报告期内无基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

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

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	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
国金证券	1	28,583,079.00	42.23%	18,044.53	38.96%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	3,232,981.40	4.78%	2,040.98	4.41%	-
长江证券	1	35,874,627.33	53.00%	26,235.02	56.64%	-

§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	序号	报告期内持有基金份额变化情况 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20180630	10,000,800.00	-	-	10,000,800.00	43.35%
	2	20180410-20180419	-	11,755,962.38	11,755,962.38	-	0.00%
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

基金管理人于2018年3月23日披露了《关于中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金修改基金合同及托管协议的公告》、《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》、《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》。

中信建投基金管理有限公司

二〇一八年八月二十八日