

# 中信建投聚利混合型证券投资基金

2019年第4季度报告

2019年12月31日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:北京银行股份有限公司

报告送出日期:2020年01月18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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年1月16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2019年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 中信建投聚利  |
| 基金主代码      | 001914  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2017年11月17日   |
| 报告期末基金份额总额 | 34,195,214.33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           | 北京银行股份有限公司              |             |
| 下属分级基金的基金简称     | 中信建投聚利A                 | 中信建投聚利C     |
| 下属分级基金的交易代码     | 001914                  | 006845      |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 33,673,360.92份          | 521,853.41份 |

### § 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(2019年10月01日 - 2019年12月31日) |            |
|-----------------|--------------------------------|------------|
|                 | 中信建投聚利A                        | 中信建投聚利C    |
| 1. 本期已实现收益      | 468,704.01                     | 7,169.84   |
| 2. 本期利润         | 528,615.10                     | 3,073.91   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0147                         | 0.0077     |
| 4. 期末基金资产净值     | 31,458,266.81                  | 545,383.82 |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9342                         | 1.0451     |

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。

#### 3.2 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

###### 中信建投聚利A净值表现

| 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 | 1.38%  | 0.59%     | 2.62%      | 0.16%         | -1.24% | 0.43% |

###### 中信建投聚利C净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|----------|-----------|--------------|-----|-----|
|    |        |          |           |              |     |     |

|       |       |       |       |       |        |       |
|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
|       |       | ②     | 率③    | 准差④   |        |       |
| 过去三个月 | 1.27% | 0.59% | 2.62% | 0.16% | -1.35% | 0.43% |

### 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

中信建投聚利A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年11月17日-2019年12月31日)



中信建投聚利C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年06月24日-2019年12月31日)



注：1、本基金由中信建投稳利保本 2 号混合型证券投资基金转型而来，并于 2017 年 11 月 17 日合同生效。

2、图 1 为中信建投聚利 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 2017 年 11 月 17 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日。图 2 为中信建投聚利 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 2019 年 6 月 24 日（首笔份额登记日）至 2019 年 12 月 31 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 |        |  |
| 谢玮 | 本基金的基金经理 | 2018-06-05  | -    | 2年     | 中国籍，1984年9月生，中国社会科学院研究生院经济学博士。曾任中证金融研究院博士后，从事资本市场研究工作；2016年9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，现任本公司投资部-股票投资部基金经理，担任中信建投聚利混合型证券投资基金、中信建投医改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。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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。谢玮同志2014年9月至2016年9月任中证金融研究院博士后，从事资本市场研究工作，2016年9月加入中信建投基金管理有限公司，从事投资研究工作，2018年6月5日任本基金基金经理。

### 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

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

四季度，我们继续以固收打底并以医药和黄金两大板块为主构建权益增强，在对年内部分获利标的了结的同时增配部分2020年看好的标的，产品净值创出了4月份以来的年内新高，为基金持有人带来了较为丰厚且稳定的持仓收益。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投聚利A基金份额净值为0.9342元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.38%，同期业绩比较基准收益率为2.62%；截至报告期末中信建投聚利C基金份额净值为1.0451元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.27%，同期业绩比较基准收益率为2.62%。

### 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2018年9月27日起至报告期末已连续306个工作日资产净值低于5000万元。

## § 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   | 12,653,787.00 | 39.14         |
|    | 其中：股票  | 12,653,787.00 | 39.14         |
| 2  | 基金投资   | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资 | 12,007,200.00 | 37.14         |
|    | 其中：债券  | 12,007,200.00 | 37.14         |
|    | 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          | 6,400,000.00  | 19.80  |
|   | 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      | 956,890.73    | 2.96   |
| 8 | 其他资产              | 310,732.06    | 0.96   |
| 9 | 合计                | 32,328,609.79 | 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         | -            | -            |
| B  | 采矿业              | 2,189,390.00 | 6.84         |
| C  | 制造业              | 8,421,505.00 | 26.31        |
| 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           | 732,200.00   | 2.29         |
| 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       | 343,362.00   | 1.07         |
| 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          | 967,330.00   | 3.02         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -            | -            |

|   |    |               |       |
|---|----|---------------|-------|
| S | 综合 | -             | -     |
|   | 合计 | 12,653,787.00 | 39.54 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

### 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  | 300595 | 欧普康视 | 26,800 | 1,268,444.00 | 3.96         |
| 2  | 000661 | 长春高新 | 2,800  | 1,251,600.00 | 3.91         |
| 3  | 300685 | 艾德生物 | 14,000 | 935,480.00   | 2.92         |
| 4  | 002821 | 凯莱英  | 7,000  | 906,500.00   | 2.83         |
| 5  | 000975 | 银泰黄金 | 65,000 | 884,650.00   | 2.76         |
| 6  | 600547 | 山东黄金 | 27,000 | 880,740.00   | 2.75         |
| 7  | 603939 | 益丰药房 | 10,000 | 732,200.00   | 2.29         |
| 8  | 603456 | 九洲药业 | 50,000 | 697,000.00   | 2.18         |
| 9  | 300003 | 乐普医疗 | 20,500 | 678,140.00   | 2.12         |
| 10 | 300357 | 我武生物 | 15,200 | 671,080.00   | 2.10         |

### 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      | 12,007,200.00 | 37.52        |
| 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        | 12,007,200.00 | 37.52        |



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  | 019611 | 19国债01 | 120,000 | 12,007,200.00 | 37.52        |

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

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

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   | 28,082.40  |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,145.75   |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 266,017.03 |
| 5  | 应收申购款   | 15,486.88  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |

|   |    |            |
|---|----|------------|
| 8 | 合计 | 310,732.06 |
|---|----|------------|

**5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无余额。

**5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无余额。

**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

|                               | 中信建投聚利A       | 中信建投聚利C    |
|-------------------------------|---------------|------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 39,659,968.92 | 434,209.83 |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 358,753.37    | 487,797.66 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 6,345,361.37  | 400,154.08 |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>(份额减少以“-”填列) | 0.00          | 0.00       |
| 报告期期末基金份额总额                   | 33,673,360.92 | 521,853.41 |

**§ 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**

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**

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**§ 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**

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、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投聚利混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投聚利混合型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。

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 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

2020年01月18日