

中信建投睿信灵活配置混合型证券投资 基金更新招募说明书（更新）摘要

2020 年 2 月

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

重要提示

中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）申请募集的准予注册文件名称为：《关于准予中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2014〕1238号），注册日期为：2014年11月21日。本基金基金合同于2015年2月3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，但中国证监会对本基金募集的注册，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。

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，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的管理风险，本基金的特定风险等。

本基金为灵活配置混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高预期风险和中高预期收益产品。本基金存在大类资产配置风险，有可能受到经济周期、市场环境或管理人对市场所处的经济周期和产业周期的判断不足等因素的影响，导致基金的大类资产配置比例偏离最优化水平，给基金投资组合的绩效带来风险。

本基金可投资中小企业私募债券，当基金所投资的中小企业私募债券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降等，可能造成基金财产损失。此外，受市场规模及交易活跃程度的影响，中小企业私募债券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险，从而对基金收益造成影响。

投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。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他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。基金产品资料概要编制、披露与更新要求将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

本更新的招募说明书所载内容截止日为 2020 年 2 月 3 日，有关财务数据和净值截止日为 2019 年 12 月 31 日（财务数据未经审计）。本基金托管人交通银行股份有限公司复核了本次更新的招募说明书。

一、基金管理人

(一) 基金管理人简况

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，男，1966年12月生，中国国籍，汉族，中共党员，成都电子科技大学硕士研究生学历，籍贯江苏。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，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，兼任中信建投基金管理有限公司董事长。

邱黎强，男，1970年10月生，中国国籍，汉族，中共党员，北京大学硕士研究生学历，籍贯浙江。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。

邹舫，男，1978年生，毕业于中国人民大学会计学专业，博士研究生学历，曾任中国三峡总公司资产财务部主任科员、中电投云南国际电力投资有限公司财务部预算处副处长（主持工作）、中电投集团财务部资金处主管（主持工作）、中国康富国际租赁股份有限公司证券与投资部总经理兼董事长办公室主任等职。2017年4月进入航天科技财务有限责任公司工作，任公司总经理助理、董事会秘书兼战略发展部（董事会办公室）部长（主任）。

周艳丽，女，1972年3月生，中国国籍，汉族，民建会员，南京大学硕士研究生学历，籍贯山东。曾任江苏省广播电视总台（集团）财务资产部副主任，现任江苏省广播电视总台（集团）财务资产部主任。

袁野，男，1976年12月生，中国国籍，汉族，中共党员，德国特里尔大学硕士研究生学历，籍贯黑龙江。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。

胡家勇，男，1962年11月生，中国国籍，汉族，中共党员，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。

王军，男，1980年1月生，中国国籍，汉族，中共党员，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、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教育中心主任及党支部书记、中信建投基金管理有限公司独立董事。

袁冬梅，女，1966年10月生，中国国籍，汉族，中共党员，北京大学分校法律法学专业本科，获法学学士学位。曾任北京市对外经济律师事务所律师、北京市共和律师事务所创始合伙人/律师、北京天达共和律师事务所合伙人/律师，北京市人大常委会立法咨询专家。

佟岩，女，1977年生，北京理工大学管理与经济学院教授，博士生导师，北京理工大学专业学位联合教育中心主任，中国会计学会财务管理分会理事，入选北京国资委外部董事人才库。佟岩女士是中国人民大学会计学博士，伦敦国

王学院（King's College London）访问学者，中国注册会计师，财政部全国会计领军人才（学术类），北京市优秀人才培养资助对象。在专业领域主持国家基金课题 3 项、教育部基金课题 1 项，发表 A 类 CSSCI 期刊、SCI 论文和 EI 论文多篇。佟岩女士现为金牛化工（600722）和中公教育（002607）独立董事。

2、监事会成员

陆亚，女，1966 年 2 月生，中国国籍，民主党派人士，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。

李慧，女，1982 年生，毕业于北京航空航天大学经济管理学院管理科学与工程专业，博士研究生学历，2009 年 6 月进入航天科技财务有限责任公司工作，曾入选财务公司行业专业人才库。现任航天科技财务有限责任公司风险管理与法律部副部长。

周琰，女，1983 年 7 月生，中共党员，南京大学硕士研究生学历。现任江苏省广播电视总台（集团）金融投资中心投资部业务一部主任、中信建投基金管理有限公司监事。

张全，男，1979 年 6 月生，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。

谭淼，女，1978 年 12 月生，中共党员，中央财经大学本科学历。曾就职于华夏证券北京三里河路营业部客户服务部、华夏证券股份有限公司交易清算部、中信建投证券股份有限公司交易清算部、中信建投证券股份有限公司总裁办公室，现任中信建投基金管理有限公司总经理助理、中信建投基金管理有限公司职工监事。

谭保民，男，1984 年 2 月生，中共党员，中央民族大学本科学历。曾任中银国际证券有限责任公司北京营业部客服经理、国金证券股份有限公司基金筹备组注册登记会计、国金通用基金管理有限公司基金清算部高级注册登记会计，现

任中共中信建投基金管理有限公司纪律检查委员会纪委委员、中信建投基金管理有限公司运营管理部总监、中信建投基金管理有限公司职工监事。

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，兼任中信建投基金管理有限公司首席信息官、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

邱黎强先生，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

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD

法定代表人/负责人：任德奇

住 所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

邮政编码：200336

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.63 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。根据 2019 年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第 11 位，连续五年跻身全球银行 20 强；根据 2019 年美国《财富》杂志发布的世界 500 强公司

排行榜，交通银行营业收入位列第 150 位，较上年提升 18 位。

截至 2019 年 9 月 30 日，交通银行资产总额为人民币 99,328.79 亿元。2019 年 1-9 月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 601.47 亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心(下文简称“托管中心”)。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

(二) 主要人员情况

任德奇先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

任先生 2018 年 8 月起任本行副董事长、执行董事、行长；2016 年 12 月至 2018 年 6 月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015 年 10 月至 2018 年 6 月兼任中银香港(控股)有限公司非执行董事，2016 年 9 月至 2018 年 6 月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014 年 7 月至 2016 年 11 月任中国银行副行长，2003 年 8 月至 2014 年 5 月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988 年 7 月至 2003 年 8 月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生 1988 年于清华大学获工学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁，高级经济师。

袁女士 2015 年 8 月起任本行资产托管业务中心总裁；2007 年 12 月至 2015 年 8 月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999 年 12 月至 2007 年 12 月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士 1992 年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005 年于新疆财经学院获硕士学位。

(三) 基金托管业务经营情况

截至 2019 年 9 月 30 日，交通银行托管证券投资基金 436 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、QDIE 资金、全国社保基金、

养老保障管理基金、企业年金基金、职业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产、RQDII 证券投资资产和 QDLP 资金等产品。

三、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构

(1) 直销中心

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

(2) 网上直销

直销网站：www.cfund108.com

2、其他销售机构

(1) 交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

传真：021-58408483

联系人：孙昊

网址：www.bankcomm.com

客户服务电话：95559

公司网站：www.bankcomm.com

(2) 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

联系人：权唐

客户服务电话：95587、400-8888-108

网址：www.csc108.com

（3）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

传真：022-58316259

网址：www.cbhb.com.cn

客户服务电话：95541

（4）中国国际金融股份有限公司

住所：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：金立群

传真：010-65058065

联系人：郭含光、景鑫

网址：www.cicc.com.cn

客户服务电话：010-65051166

（5）上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 500 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：姜基彬

网址：www.spdb.com.cn

客户服务电话：95528

（6）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 号中信证券大厦

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

网址：www.cs.ecitic.com

客户服务电话：95548

（7）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

客户服务电话：400-990-8826

（8）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：<http://sd.citics.com>

客户服务电话：95548

（9）嘉实财富管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元、北京市朝

阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

联系人：李雯

传真：021-20280110

网址：www.harvestwm.cn

客服电话：400-021-8850

（10）国金证券股份有限公司

住所：成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

传真：028-86690126

联系人：杜晶、黎建平

网址：www.gjq.com.cn

客户服务电话：95310

（11）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

网址：www.bjrcb.com

客户服务电话：96198

（12）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

客户服务电话：400-181-8188

（13）信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

传真：010-63080978

联系人：任立秋

网址：www.cindasc.com

客户服务电话：95321

（14）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

网址：www.lufunds.com

客户服务电话：400-821-9031

（15）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中路 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路 3 号

法定代表人：林卓

传真：0411-84396536

联系人：姜焕洋

网址：www.haojiyoujijin.com

客户服务电话：400-6411-999

（16）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

网址: www.antfortune.com

客户服务电话: 95188

(17) 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

网址: www.5ifund.com

客户服务电话: 400-877-3772

(18) 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

网址: www.dtfunds.com

客户服务电话: 400-928-2266

(19) 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

(20) 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：吴煜浩

网址：www.yingmi.cn

客户服务电话：020-89629066

（21）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

（22）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

（23）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

网址：www.hcjijin.com

客户服务电话：400-619-9059

（24）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

网址：www.chtfund.com

客户服务电话：400-898-0618

（25）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

网址：<http://fund.jd.com/>

客户服务电话：95118、400-098-8511

（26）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：王晓明

网址：<http://a.leadfund.com.cn/>

客户服务电话：400-067-6266

（27）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

（28）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

电话：010-52609656

传真：010-68854009

客户服务电话：400-188-5687

网址：www.buyforyou.com.cn

（29）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：上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层

法定代表人：张跃伟

传真：021-20691861

联系人：党敏

网址：www.erichfund.com

客户服务电话：400-820-2899

（30）深圳富济基金销售有限公司

住所：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元

办公地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元

法定代表人：祝中村

传真：0755-83999926

联系人：曾瑶敏

网址：www.jinqianwo.cn

客户服务电话：0755-83999907

（31）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

（32）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

（33）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

客户服务电话：400-700-9665

（34）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：010-65807865

客服电话：010-65807609

网址：<http://www.cifcofund.com>

（35）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

客户服务电话：400-680-2123

（36）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：高雪超

网址：www.qiandaojr.com

客户服务电话：4000888080

（37）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

客户服务电话：0891-6177483

（38）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：邵玉磊

网址：www.wanjiawealth.com

客户服务电话：010-59013895

（39）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：贾海霞

传真：0755-86725180

客服电话：0755-86722851

网址：<http://www.flyingfund.com.cn>

（40）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：李春芳

网址：www.cgws.com

客户服务电话：400-666-6888、0755-33680000

（41）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：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

联系人：张慧

传真：025-66008800-887226

客服电话：95177

网址：www.snjjin.com

（42）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：8.jrj.com.cn

客户服务电话：400-850-7771

（43）一路财富（北京）基金销售股份有限公司

住所：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702 室

法定代表人：吴雪秀

传真：010-88312099

联系人：徐越

网址：www.yilucaifu.com

客户服务电话：400-001-1566

（44）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

客户服务电话：400-111-0889

（45）北京新浪仓石基金销售有限公司

住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块

新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区东北旺东路 10 号院东区 3 号楼为明大厦 C 座

法定代表人：赵芯蕊

传真：010-62676582

联系人：李唯

网址：www.xincai.com:

客户服务电话：010-62675369

（46）中信建投期货有限公司

住所：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

办公地址：重庆市渝中区中山三路 107 号皇冠大厦 11 楼

法定代表人：彭文德

传真：023-86769647

联系人：刘芸

网址：www.cfc108.com

客户服务电话：400-8877-780

（47）中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

传真：0531-68889185

联系人：吴阳

网址：www.zts.com.cn

客户服务电话：95538

（48）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

客户服务电话：400-166-6788

（49）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

客户服务电话：400-820-5369

（50）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

（51）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

客户服务电话：400-1286-800

（52）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：陈耀庭

传真：021-50498825

联系人：王一彦

网址：www.longone.com.cn

客户服务电话：95531、400-888-8588

（53）恒泰证券股份有限公司

住所：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

办公地址：呼和浩特市新城区海拉尔东街满世书香苑恒泰证券办公楼

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

网址：www.cnht.com.cn

客户服务电话：4001966188

（54）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：王旋

联系人：董亚芳

网址：www.hgcpcb.com

客户服务电话：4000-555-671

（55）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

客户服务电话：400-673-7010

3、基金管理人可根据《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》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、孙睿

联系人：黎明

（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

中信建投睿信灵活配置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，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。

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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0-95%；中小企业私募债占

基金资产净值的比例不超过 20%；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%。

九、基金的投资策略、决策依据和决策程序

（一）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

本基金首先研究分析不同行业的盈利模式、与宏观经济周期的关系以及行业自身的生命周期，之后在判断当期宏观经济所处周期位置的基础上，结合行业的盈利模式，优选当期盈利增长最为确定及增速较快的行业，进行重点配置。

（2）个股投资策略

本基金在个股投资方面采用“自上而下”和“自下而上”相结合的策略，一部分个股选择景气状况反转向好的行业龙头，一部分个股选择自身发展空间广阔，同时业绩预期加速增长的品种。

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，通过严谨的投资决策流程、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。

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。

（二）基金管理人运用基金财产的决策依据和决策程序

基金管理人运用基金财产的决策依据、决策程序

1、投资决策依据

- (1) 有关法律、法规和基金合同的有关规定。
- (2) 经济运行态势和证券市场走势。
- (3) 投资对象的风险收益配比。

2、投资决策程序

(1) 投资决策支持：研究人员、基金经理及相关人员根据独立研究及各咨询机构的研究方案，向投资决策委员会提出宏观经济分析方案和投资策略方案等决策支持。

(2) 投资原则的制定：投资决策委员会在遵守国家有关法律、法规和基金合同的有关规定的情况下，根据研究人员和基金经理的有关方案，决定基金投资的主要原则，对基金投资组合的资产配置比例等提出指导性意见。

(3) 研究支持：研究分析人员根据投资决策委员会的决议，为基金经理提供各类分析方案和投资建议，也可根据基金经理的要求进行有关的研究。

(4) 制定投资决策：基金经理按照投资决策委员会决定的投资原则，根据研究分析人员提供的投资建议以及自己的分析判断，做出具体的投资决策。

(5) 风险控制与评估：风险管理委员会定期召开会议，听取投资研究部、基金经理、风险控制人员对基金投资组合进行的风险评估，并提出风险控制意见。

(6) 组合的调整：基金经理有权根据环境的变化和实际的需要，在其权限范围内对组合进行调整，超出其权限的调整，需报投资决策委员会审批。

十、基金的业绩比较标准

年化收益率 7%。

本基金在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期增值。以“年化收益率 7%”作为业绩比较基准可以较好地反映本基金的投资目标。

如果今后法律法规发生变化，或者市场变化导致本业绩比较基准不再适用，又或者市场出现更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的业绩比较基准，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本基金的业绩比较基准并报中国证监会备案，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预期风险、中高预期收益的品种。

十二、基金投资组合报告

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2020年2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12月31日(摘自本基金2019年第4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	91,507,474.85	92.82
	其中:股票	91,507,474.85	92.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,727,750.00	3.78
	其中:债券	3,727,750.00	3.78
	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	3,212,275.11	3.26
8	其他资产	136,008.85	0.14

9	合计	98,583,508.81	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	41,135,153.41	41.83
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	1,575,000.00	1.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	288,250.40	0.29
J	金融业	48,502,493.00	49.32
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	6,578.04	0.01
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	91,507,474.85	93.05
--	----	---------------	-------

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。

(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	601166	兴业银行	468,000	9,266,400.00	9.42
2	600036	招商银行	244,200	9,177,036.00	9.33
3	600887	伊利股份	290,000	8,972,600.00	9.12
4	600016	民生银行	1,296,632	8,181,747.92	8.32
5	601318	中国平安	90,000	7,691,400.00	7.82
6	600000	浦发银行	600,000	7,422,000.00	7.55
7	600519	贵州茅台	4,500	5,323,500.00	5.41
8	601658	邮储银行	796,578	4,548,460.38	4.62
9	600309	万华化学	80,000	4,493,600.00	4.57
10	000651	格力电器	65,000	4,262,700.00	4.33

(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	3,727,750.00	3.79
	其中：政策性金融债	3,727,750.00	3.79
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	3,727,750.00	3.79

(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	018007	国开1801	37,000	3,727,750.00	3.79

(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

无余额。

(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

无余额。

(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

无余额。

(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本期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	27,624.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	55,804.00
5	应收申购款	52,580.10
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	136,008.85

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、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	601658	邮储银行	4,548,460.38	4.62	首次公开发行网下中签

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 12 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。

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

中信建投睿信 A

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
2019年1月1日-2019年12月31日	16.49%	1.10%	5.50%	0.02%	10.99%	1.08%
2018年1月1日-2018年12月31日	-29.50%	1.05%	5.81%	0.02%	-35.31%	1.03%
2017年1月1日-2017年12月31日	-9.57%	0.87%	6.17%	0.02%	-15.74%	0.85%
2016年1月1日-2016年12月31日	-9.79%	0.98%	6.60%	0.02%	-16.39%	0.96%
2015年2月3日(基金合同生效日)-2015年12月31日	14.40%	2.24%	6.37%	0.02%	8.03%	2.22%

中信建投睿信 C

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
2019年1月1日-2019年12月31日	16.37%	1.10%	6.28%	0.02%	10.09%	1.08%
2018年1月1日-2018年12月31日	-29.74%	1.06%	6.71%	0.02%	-36.45%	1.04%
2017年5月17日(首笔份额登记日)-2017年12月31日	-2.42%	1.03%	4.39%	0.02%	-6.81%	1.01%

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

中信建投睿信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
(2015年02月03日-2019年12月31日)



中信建投睿信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
(2017年05月17日-2019年12月31日)



注：1、图 1 为中信建投睿信 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 2015 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日；
2、图 2 为中信建投睿信 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 17 日(首笔份额登记日)至 2019 年 12 月 31 日。

十四、基金费用和税收

(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、银行账户维护费用；
- 9、证券/期货开户费用；
- 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 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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 0.10%。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 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

销售服务费每日计提，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资金划拨指令，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、公休假等，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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、其他有关法律法规及基金合同的要求，对《中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》进行了更新，本更新的招募说明书主要更新内容如下：

- 1、更新了“第五部分 相关服务机构”的相关内容；
- 2、更新了“第九部分 基金的投资”的相关内容，基金投资组合报告经托管人复核；
- 3、更新了“第十部分 基金的业绩”的相关内容，并经托管人复核；
- 4、更新了“第十四部分 基金费用与税收”的相关内容；
- 5、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

2020年2月