

中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资
基金

更新招募说明书摘要

2018年第2号

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

二零一八年七月

重要提示

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”）申请募集的准予注册文件名称为：《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》（证监许可〔2016〕1962号），注册日期为：2016年8月29日。本基金合同于2016年12月7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。

本基金为发起式基金，在基金募集时，基金管理人运用其固有资金参与认购本基金的金额不低于1000万元，认购的基金份额持有期限不低于三年。基金管理人认购的基金份额持有期限满三年后，基金管理人将根据自身情况决定是否继续持有，届时，基金管理人有可能赎回认购的本基金份额。另外，基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于两亿元的，基金合同自动终止，投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

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2018年06月07日，有关财务数据和净值截止日为2018年03月31日（财务数据未经审计）。本基金托管人中国工商银行股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

目 录

重要提示.....	1
一、基金管理人.....	4
二、基金托管人.....	12
三、相关服务机构.....	16
四、基金的名称.....	25
五、基金的类型.....	25
六、基金的投资目标.....	25
七、基金的投资方向.....	26
八、基金的投资策略.....	26
九、基金的业绩比较基准.....	28
十、基金的风险收益特征.....	28
十一、基金的投资组合报告.....	28
十二、基金的业绩.....	33
十三、基金的费用与税收.....	34
十四、对招募说明书更新部分的说明.....	36

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

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可〔2013〕1108号

组织形式：有限责任公司

存续期限：永久存续

注册资本：30000万元人民币

联系人：杨露露

电话：010-59100288

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，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、研究发展部行政负责人，兼任中信建投基金管理有限公司董事长。

张杰女士，副董事长、总经理，首都师范大学本科学历。曾任华夏证券股份有限公司深圳振华路营业部经理、华夏证券股份有限公司深圳分公司经管部经理、华夏证券股份有限公司经管总部副经理、中信建投证券股份有限公司经纪业务管理部行政负责人、董事总经理，现任中信建投基金管理有限公司副董事长、总经理。

李聚合先生，副董事长，中国人民大学在职博士研究生学历。曾任国家发改委财政金融司副司长，长期从事宏观经济及财政货币政策研究，熟悉证券期货市场及社会信用体系建设情况。现任中信建投基金管理有限公司副董事长，兼任元达信资

本管理（北京）有限公司执行董事、中信建投证券股份有限公司董事总经理、交通信用研究院顾问委员会主任。

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，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，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，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会员、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，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。

王汀汀先生，独立董事，北京大学博士研究生学历。现任中央财经大学副教授、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，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，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

孔萍女士，监事会主席，中国人民大学硕士研究生学历。曾任中国工商银行财

务处副科长，华夏证券股份有限公司财务、稽核、清算部部门总经理，现任中信建投证券股份有限公司运营管理部行政负责人、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，现任航天科技财务有限责任公司结算部总经理、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，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，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，现任元达信资本管理（北京）有限公司项目经理、中信建投基金管理有限公司职工监事。

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，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。

张杰女士，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，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。

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，现任中信建投基金管理有限公司副总经理。

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，现任中信建投基金管理有限公司督察长，兼任稽控合规部负责人、公司董事会秘书。

4、本基金基金经理

王琦先生，简历同上。

周户先生，南开大学硕士研究生学历。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研究部基金经理。

5、投资决策委员会成员

袁野先生，简历同上。

王琦先生，简历同上。

王浩先生，中央财经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研究员，现任中信建投基金管理有限公司投资研究部基金经理。

周户先生，简历同上。

黄海浩女士，山东大学本科学历。曾任利顺金融(亚洲)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、国投瑞银基金管理有限公司交易部债券交易员，现任中信建投基金管理有限公司投资研究部基金经理。

梁奇先生，清华大学硕士研究生学历。曾任汤森路透集团软件工程师、英大基金管理有限公司系统工程师、风险控制师，现任职于中信建投基金管理有限公司稽控合规部风险管理岗。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

(7) 依法接受基金托管人的监督;

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告;

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(12) 保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

(14) 按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

(18) 组织并参加基金财产清算小组, 参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时, 及时报告中国证监会并通知基金托管人;

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时, 应当承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务, 基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时, 基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时, 应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

(23) 以基金管理人名义, 代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件, 《基金合同》不能生效, 基金管理人承担全部募集费用, 将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26) 建立并保存基金份额持有人名册;

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

四、基金管理人承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《销售办法》、《运作办法》、《信息披露办法》等法律法规的行为, 并承诺建立健全内部控制制度, 采取有效措施, 防止违法行为的发生。

2、基金管理人的禁止行为:

(1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

(2) 不公平地对待公司管理的不同基金财产;

(3) 利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5) 侵占、挪用基金财产;

(6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他

人从事相关的交易活动;

(7) 玩忽职守, 不按照规定履行职责;

(8) 法律、行政法规以及中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理, 强化职业操守, 督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范, 诚实信用、勤勉尽责, 不从事以下活动:

(1) 越权或违规经营;

(2) 违反法律法规、基金合同或托管协议;

(3) 故意损害基金份额持有人或基金合同其他当事人的合法权益;

(4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;

(5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;

(6) 玩忽职守、滥用职权, 不按照规定履行职责;

(7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息, 或泄露因职务便利获取的未公开信息, 利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

(8) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易;

(9) 违反证券交易所业务规则, 利用对敲、倒仓等非法手段操纵市场价格, 扰乱市场秩序;

(10) 贬损同行, 以提高自己;

(11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成份;

(12) 以不正当手段谋求业务发展;

(13) 有悖社会公德, 损害证券投资基金人员形象;

(14) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金经理承诺

(1) 依照有关法律法规和基金合同的规定, 本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

(2) 不得利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益;

(3) 不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定, 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密, 尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息, 或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

(4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

五、基金管理人的内部控制制度

内部控制是指基金管理人为防范和化解风险，保证经营运作符合基金管理人发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施控制程序与控制措施而形成的系统。基金管理人结合自身具体情况，建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，并制定了科学完善的内部控制制度。

1、内部控制目标

(1) 保证基金管理人经营运作遵守国家法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

(2) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现持续、稳定、健康发展。

(3) 确保基金管理人和基金财务及其他信息的真实、准确、及时、完整。

2、内部控制原则

(1) 健全性原则。内部控制机制覆盖基金管理人的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 有效性原则。通过科学的内部控制手段和方法，建立合理的内部控制程序，维护内部控制的有效执行。

(3) 独立性原则。基金管理人各机构、部门和岗位职责保持相对独立，基金资产、固有财产、其他资产的运作相互分离。

(4) 相互制约原则。基金管理人内部部门和岗位的设置权责分明、相互制衡。

(5) 成本效益原则。基金管理人运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3、内部控制内容

基金管理人的内部控制要求建立：不相容职务相分离的机制、完善的岗位责任制、规范的岗位管理措施、完整的信息资料保全系统、严格的授权控制、有效的风险防范系统和快速反应机制等。基金管理人遵守国家有关法律法规，遵循合法合规性原则、全面性原则、审慎性原则和适时性原则，制订了系统完善的内部控制制度。内部控制的内容包括投资管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制以及内部稽核控制等。

4、基金管理人关于内部控制制度声明书

(1) 基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确。

(2) 基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人业务发展不断完善内部控制制度。

二、基金托管人

一、基金托管人基本情况

(一) 基金托管人概况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币35,640,625.71万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

(二) 主要人员情况

截至2017年末，中国工商银行资产托管部共有员工230人，平均年龄33岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三) 基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2017年末，中国工商银行共托管证券投资基金815只。自2003年以来，本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的54项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得

国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

二、基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017共十一次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402审阅，获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

(1) 合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2) 完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和

监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风

险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

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) 中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

联系人：洪渊

联系电话：010-66105799

客服电话：95588

网站：www.icbc.com.cn

(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) 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

联系人：朱萍

客户服务电话：95528

网址：www.spdb.com.cn

(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

电话：021-54509998-7019

传真：021-64385308

联系人：潘世友

网址：www.1234567.com.cn

客户服务电话：400-181-8188

(5) 上海陆金所资产管理有限公司

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：郭坚

电话：021-20665952

传真：021-22066653

联系人：宁博宇

网址：www.lufunds.com

客户服务电话：400-821-9031

(6) 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

电话：18205712248

联系人：韩爱彬

网址：www.antfortune.com

客户服务电话：95188

(7) 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

电话：0571-88911818-8653

传真：0571-88910240

联系人：胡璇

网址：www.5ifund.com

客户服务电话：400-877-3772

(8) 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

电话：13671788303

传真：021-20324199

联系人：刘璐

网址：www.dtfunds.com

客户服务电话：400-928-2266

(9) 北京钱景财富投资管理有限公司

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

电话：010-57418829

传真：010-57569671

联系人：魏争

客户服务电话：400-678-5095

网址：www.niuji.net

(10) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

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

电话：010-89189289、18910325400

传真：010-89180000

联系人：万容

网址：<http://fund.jd.com/>

客户服务电话：95118、400-098-8511

(11) 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

电话：021-50583533

传真：021-50583633

联系人：曹怡晨

网址：<http://a.leadfund.com.cn/>

客户服务电话：400-067-6266

(12) 中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

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

电话：010-60833722

传真：010-60833739

联系人：陈忠

网址：www.cs.ecitic.com

客户服务电话：95548

(13) 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

电话：0755-23953913

传真：0755-83217421

联系人：洪诚

网址：www.citicsf.com

客户服务电话：400-990-8826

(14) 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：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

网址：www.citicssd.com

客户服务电话：95548

(15) 北京格上富信投资顾问有限公司

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

电话: 010-85594745

传真: 010-65983333

客户服务电话: 400-066-8586

网址: www.igesafe.com

(16) 北京微动利投资管理有限公司

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: 梁洪军

联系人: 季长军

电话: 010-68854005

传真: 010-68854009

客户服务电话: 400-8196-665

网址: www.buyforyou.com.cn

(17) 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

电话: 021-20613635

传真: 021-68596916

联系人: 胡轶隼

网址: www.ehowbuy.com

客户服务电话: 400-700-9665

(18) 中期资产管理有限公司

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

电话：010-65807865

传真：010-65807864

客服电话：010-65807609

网址：www.cifcofund.com

(19) 上海云湾投资管理有限公司

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

电话：021-20538888

传真：021-20538999

客服电话：400-820-1515

网址：www.zhengtongfunds.com

(20) 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

客户服务电话：400-8877-780、023-63600049

网址：www.cfc108.com

(21) 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

电话：010-63130889-8369

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

(22) 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
电话：0755-83516089
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

(23) 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
联系电话：0755-86722853
传真：0755-86725180
客服电话：0755-86722851
网址：<http://www.flyingfund.com.cn>

(24) 乾道金融信息服务（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
电话：010-62062880
传真：010-82057741
联系人：高雪超
网址：www.qiandaojr.com
客户服务电话：4000888080

(25) 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

电话:18501904963

传真:010-50877697

联系人:曹砚财

网址:www.xiquefund.com

客户服务电话:0891-6177483

(26) 天津万家财富资产管理有限公司

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

电话:010-59013825

联系人:邵玉磊

(27) 上海攀赢金融信息服务有限公司

注册地址:上海市闸北区广中西路1207号306室

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路488号太平金融大厦603室

法定代表人:田为奇

电话:021-68889082

联系人:吴卫东

网址:www.pytz.cn

客户服务电话:021-68889082

(28) 南京苏宁基金销售有限公司

所在地址: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:刘汉青

客户服务电话:95177

公司网站:www.snjijin.com

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、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：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人：杨绍信 联系人：张勇 联系电话：021-23238888 传真：021-23238800 经办注册会计师：许康玮、张勇

四、基金的名称

中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

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。

七、基金的投资方向

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%。

八、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、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。

5、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。

6、资产支持证券投资策略

资产支持证券是指由金融机构作为发起机构，将信贷资产等具有稳定现金流的资产信托给受托机构，由受托机构向投资机构发行，以该财产所产生的现金支付其收益的证券。本基金通过对资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

九、基金的业绩比较基准

$60\% \times \text{沪深300指数收益率} + 40\% \times \text{中债综合指数收益率}$

沪深300指数是由中证指数有限公司编制，综合反映了沪深证券市场内大市值公司的整体状况。中债综合指数是由中央国债登记结算公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

如果今后市场中出现更具有代表性的业绩比较基准，或者更科学的业绩比较基准，或者该基准利率停止发布，基金管理人认为有必要作相应调整时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，经与基金托管人协商一致后，变更本基金的业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年7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2018年3月31日（摘自本基金2018年第一季度报告），本报告中所列财务数据未经审计。

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	13,832,989.10	58.97
	其中：股票	13,832,989.10	58.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,257,220.95	5.36
	其中：债券	1,257,220.95	5.36
	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	7,000,000.00	29.84
	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	1,291,530.89	5.51
8	其他资产	76,455.24	0.33
9	合计	23,458,196.18	100.00

2、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	1,163,250.00	5.04
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,589,585.10	24.21
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	500,650.00	2.17

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	300,000.00	1.30
J	金融业	4,697,495.00	20.35
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,582,009.00	6.85
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	13,832,989.10	59.91

(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。

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	601888	中国国旅	29,900	1,582,009.00	6.85
2	600036	招商银行	51,000	1,483,590.00	6.43
3	600486	扬农化工	30,000	1,437,000.00	6.22
4	601288	农业银行	320,000	1,251,200.00	5.42
5	000998	隆平高科	45,000	1,163,250.00	5.04

6	601939	建设银行	140,000	1,085,000.00	4.70
7	600426	华鲁恒升	55,000	875,600.00	3.79
8	300296	利亚德	30,000	753,600.00	3.26
9	601318	中国平安	10,500	685,755.00	2.97
10	600729	重庆百货	17,000	500,650.00	2.17

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	1,200,240.00	5.20
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)	56,980.95	0.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,257,220.95	5.45

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	019563	17国债09	12,000	1,200,240.00	5.20
2	128035	大族转债	410	48,001.57	0.21
3	128029	太阳转债	69	8,979.38	0.04

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。

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。

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。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(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。

(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。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(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。

(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。

(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。

11、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	20,252.28
2	应收证券清算款	609.70

3	应收股利	-
4	应收利息	39,712.16
5	应收申购款	15,881.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	76,455.24

(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)、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。

(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。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2018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。

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	2.42%	1.02%	-1.44%	0.70%	3.86%	0.32%
2017年1月1日-2017年12月31日	17.29%	0.52%	11.14%	0.38%	6.15%	0.14%
2016年12月7日(基	0.16%	0.01%	0.13%	0.97%	0.03%	-0.96%

金合同生效日)-2016 年12月31日						
-------------------------	--	--	--	--	--	--

中信建投睿利C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	2.33%	1.02%	-1.44%	0.70%	3.77%	0.32%
2017年5月26日 (首笔份额登记 日)-2017年12月 31日	16.79%	0.66%	9.07%	0.41%	7.72%	0.25%

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3月31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3月31日；

十三、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、基金的账户开户费用、账户维护费用；

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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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3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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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3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3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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本更新招募说明书依据《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》及其他有关法律法规的要求，对2018年1月18日公布的《中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》进行了更新，本招募说明书所载内容截止日为2018年06月07日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年03月31日，主要修改内容如下：

1、针对“重要提示”部分，更新了内容截止日，财务数据和净值表现截止日。

2、针对“第一部分 前言”部分，更新了前言相关法规信息。

3、针对“第二部分 释义”部分，更新了释义相关信息。

4、针对“第三部分 基金管理人”部分，更新了基金管理人主要人员情况相关信息。

5、针对“第四部分 基金托管人”部分，更新了基金托管人相关信息。

6、针对“第五部分 相关服务机构”部分，更新了代销机构相关信息。

7、针对“第八部分 基金份额的申购与赎回”部分，更新了基金份额的申购与赎回相关信息。

- 8、针对“第九部分 基金的投资”部分，更新了基金的投资组合报告相关信息。
- 9、针对“第十部分 基金的业绩”部分，更新了基金的业绩比较基准收益率相关信息。
- 10、针对“第十二部分 基金资产估值”部分，更新了基金资产估值相关信息。
- 11、针对“第十六部分 基金的信息披露”部分，更新了基金的信息披露相关信息。
- 12、针对“第十七部分 风险揭示”部分，更新了流动性风险相关信息。
- 13、针对“第二十部分 基金托管协议的内容摘要”部分，更新了基金托管协议的内容摘要相关信息。
- 14、针对“第二十二部分 其他应披露事项”部分，更新了其他应披露事项相关信息。
- 15、针对“第二十四部分 备查文件”部分，更新了落款日期。

中信建投基金管理有限公司

【2018年7月】