中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金

2015 半年度 报告摘要

2015年6月30日

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
送出日期:2015年8月26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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年8月18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。

本报告期自2015年2月3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	中信建投睿信
基金主代码	000926
交易代码	000926
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月3日
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
报告期末基金份额总额	160,578,390.70份
基金合同存续期	不定期

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,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
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	年化收益率7%
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

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周建萍	汤嵩彦
	联系电话	010-59100288	95559
	电子邮箱	zhoujp@cfund108.com	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		4009-108-108	95559
传真		010-59100298	021-62701216

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	http://www.cfund108.com.cn
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(2015年2月3日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	87,454,259.65
本期利润	103,109,359.46
加权平均基金份额本期利润	0.2426
本期基金份额净值增长率	18.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1869
期末基金资产净值	190,586,104.93
期末基金份额净值	1.187

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。

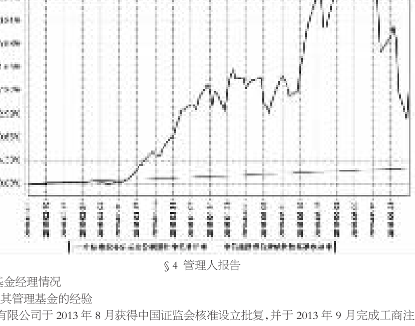
4、本基金合同自2015年2月3日起生效,本期财务报表的实际编制期间系2015年2月3日(合同生效日期)至2015年6月30日止。

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

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	-8.06%	3.41%	0.62%	0.02%	-8.68%	3.39%
过去三个月	9.50%	2.57%	1.76%	0.02%	7.74%	2.55%
自基金合同生效起至今	18.70%	2.06%	2.88%	0.02%	15.82%	2.04%

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



§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月获得中国证监会核准设立批复,并于2013年9月完成工商注册登记,正式成立,注册地北京,注册资本15000万元,具有基金管理资格,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。

公司成立以来,公募基金和特定客户资产管理业务得到长足发展,公司已成功发行了中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金、中信建投货币市场基金、中信建投稳利保本混合型证券投资基金、中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金、中信建投凤凰货币市场基金五只公募产品,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。公司已经与多家商业银行建立合作关系,与浦发银行、北京银行、上海银行、华夏银行、交通银行、北京农商行等开展业务合作。公司特定客户资产管理业务顺利开展,增速较快,截至2015年6月底,公司专户产品数量已达102只,规模近250亿元,在中国基金业协会公布的专户资产管理规模行业排名里,排名38位;产品类型涵盖股票、债券、期货、可交换债等,产品线已较齐备。除传统业务以外,公司也十分重视创新业务的开发,公司已经与移动互联网公司、传媒公司、第三方支付公司、商业银行、证券公司等合作,为客户提供余额理财等相关服务。

公司作为财富管理公司,秉承"忠于信,健于投",追求稳健的投资收益,以回馈客户的信任。公司致力于打造资产管理行业一流的团队、最具影响力的品牌、最为稳定优秀的业绩,跻身国内一流基金管理公司的行列。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王琦	投资研究部部门总经理、本基金投资经理	2015年2月3日	-	14年	中国籍,1974年7月生,中国人民大学金融学博士,具基金从业资格。1998年8月至2000年7月在中国技术进出口总公司工作,担任中技开发公司投资经理职务;2000年8月至2001年6月在清华永新信息工程有限公司工作,担任企划部经理职务;2001年7月至2003年7月在大通证券股份有限公司工作,担任研发中心行业研究员;2003年8月至2007年1月在中关村证券股份有限公司工作,担任研发中心行业研究员;2007年2月至2014年2月在中信建投证券股份有限公司工作,担任交易部总监职务,主要从事证券投资研究分析工作。2014年3月至今任职于中信建投基金管理有限公司投资研究部,担任部门总经理职务,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。现任睿信灵活配置混合型证券投资基金基金经理

注:1、任职日期是指本基金基金合同生效之日。

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

2015年上半年,宏观经济整体呈现"增长探底将稳未稳,通货膨胀维持低位"的格局,在此背景下,政策刺激力度持续加大,半年内三次降息,一次全面降准,两次定向降准,地方债加速置换。但从金融来看,宽货币仍未成功过渡到宽信用,除商品房销售明细改善外,实体经济需求依然低迷。映射到资本市场,债券市场对政策敏感度有所下降,总体维持震荡;股票市场呈现出明显的结构分化行情,小盘成长股在大的创新潮流驱动及杠杆支撑下,大幅上涨,大盘股则受制于宏观经济低迷维持平淡。从5月中旬开始,在一系列监管加强特别是去杠杆化的政策压迫下,市场大幅下跌,大盘股则因为前期滞涨、杠杆率低,跌幅较小。

本基金于2月初成立,在"投资时钟"的资产配置框架指导下,"衰退后期"的配置以股票为主,具体的行业配置方面,优选了受益于宽松货币政策且业绩良好的地产、非银金融行业,同时重点配置了新能源与环保产业链,从估值与安全性角度出发,对互联网金融等主题配置比例较低。从实际结果来看,虽然在5、6月份的大幅调整中,地产和非银行业表现出一定的安全性,但总体来看上半年表现低迷,拖累了净值增长。尽管如此,股票市场前所未有的巨幅震荡,特别是部分交易日出现流动性完全消失的"千股跌停"局面,仍然提醒管理人时刻重视风险控制,以适度的风险承担为投资者获取合理的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金基金份额净值为1.187元,本报告期份额净值增长率为18.70%;同期业绩比较基准收益率为2.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然上半年经济刺激政策力度已经达到历史较高水平,但受制于人口大周期变动、地方政府运行机制改革等因素,实体经济尚未出现明显企稳迹象。但综合企业库存、现金流以及毛利率等指标来看,下半年实体经济企稳概率较大,乐观预期下甚至可能出现小幅的回升迹象。通货膨胀水平将较上半年有所提高,但总体仍然温和。预计政策依然友好,财政政策力度有望继续加大。

"经济企稳、通胀温和"的宏观背景十分有利于股票市场,债券市场配置价值不大。但另一方面,过去两年来除大盘蓝筹股外的股票品种涨幅巨大,估值与杠杆率水平达到历史较高水平,在去杠杆化导致的巨幅波动后政府集中多种力量救市,使得对市场的分析面临更多不确定因素,但出现单边下跌或上涨的可能性都不大,结构性机会仍然具备,但热点方向将与上半年明显不同。

综合各项因素,本基金下半年的资产配置仍将以股票为主,具体配置中将坚持稳健的风格,强调个股品种的风险收益比,精选公司业绩持续增长,估值合理且具有提升空间的价值品种。操作上注重风险控制,争取为投资者获取稳健的绝对收益回报。

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6.4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。公司总经理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、交易部、产品设计、稽控合规部、运营管理部的主要负责人及基金经理(若负责人认为必要,可适当增减委员会委员),主要负责投资品种估值政策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;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.由投资研究部估值小组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,并报交公司管理层,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

本基金自2015年2月3日(合同生效日期)起至2015年6月30日止期间未实施利润分配。

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

本基金自2015年2月3日(合同生效日期)起至2015年6月30日止期间未发生基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情形。

§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

2015年上半年度,基金托管人在中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2015年上半年度,中信建投基金管理有限公司在中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2015年上半年度,由中信建投基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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:中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款		10,432,726.81	-
结算备付金		1,869,532.44	-
存出保证金		227,891.05	-
交易性金融资产		171,907,562.51	-
其中:股票投资		161,719,562.51	-
基金投资		-	-
债券投资		10,188,000.00	-
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		15,000,000.00	-
应收证券清算款		3,996,946.32	-
应收利息		219,216.34	-
应收股利		-	-
应收申购款		98,004.61	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		203,751,880.08	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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		3,138,791.35	-
应付赎回款		9,014,465.90	-
应付管理人报酬		243,824.75	-
应付托管费		40,637.44	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		603,758.75	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		124,296.96	-
负债合计		13,165,775.15	-
所有者权益:			
实收基金		160,578,390.70	-
未分配利润		30,007,714.23	-
所有者权益合计		190,586,104.93	-
负债和所有者权益总计		203,751,880.08	-

注:1、报告截止日2015年6月30日,基金份额净值人民币1.187元,基金份额总额160,578,390.70份。

2、本基金本报告期系2015年2月3日(合同生效日期)至2015年6月30日止,无上年度可比数据。

6.2 利润表

会计主体:中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年2月3日(基金合同生效日)至2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年2月3日(基金合同生效日)至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入		107,161,472.79	-
1.利息收入		3,356,397.42	-
其中:存款利息收入		881,396.22	-
债券利息收入		66,851.40	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,408,149.80	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		85,757,986.95	-
其中:股票投资收益		84,908,262.60	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
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		849,724.35	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		15,655,099.81	-
4. 汇兑收益 (损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		2,391,988.61	-
减:二、费用		4,052,113.33	-
1.管理人报酬		2,279,440.76	-
2.托管费		379,906.84	-
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		1,268,000.46	-
5.利息支出		10,527.53	-
其中:卖出回购金融资产支出		10,527.53	-
6.其他费用		114,237.74	-
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		103,109,359.46	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		103,109,359.46	-

注:本基金本报告期系2015年2月3日(合同生效日期)至2015年6月30日止,无上年度可比数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年2月3日 至 2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年2月3日(基金合同生效日)至2015年6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)	739,433,057.45	-	739,433,057.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	103,109,359.46	103,109,359.46
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)	-578,854,666.75	-73,101,645.23	-651,956,311.98
其中:1.基金申购款	20,767,046.29	3,253,359.83	24,020,406.12
2.基金赎回款	-599,621,713.04	-76,355,005.06	-675,976,718.10
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)	160,578,390.70	30,007,714.23	190,586,104.93
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-

注:本基金本报告期系2015年2月3日(合同生效日期)至2015年6月30日止,无上年度可比数据。

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	蒋月勤	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

中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金"),系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[2014]1238号《关于核准中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的注册,由中信建投基金管理有限公司于2015年1月8日至2015年1月31日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证出具安永华明(2015)验字第60952150_A06号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2015年2月3日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的有效净认购金额为人民币739,260,631.15元,有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币172,426.30元,以上实收基金合计为人民币739,433,057.45元,折合739,433,057.45份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为中信建投基金管理公司,基金托管人为交通银行银行股份有限公司。

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,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:年化收益率7%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

2014年11月13日,中国证券投资基金业协会发布《关于发布 @< 泄□と□ 蹲驶□鹨敌 □峁乐岛怂愎ぶ履〤榈赜? 015年1季度固定收益品种的估值处理标准 @> 耐◘ □贰 1 净□鹇蒂砣司 □胂喙赝泄芤□小ll.峒剖 κ 辜袼□ □桃恢拢□? 015年3月23日起,对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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2015年6月30日的财务状况以及2015年2月3日(合同生效日期)至2015年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

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

会计政策变更的说明可参见6.4.2会计报表的编制基础。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间对于证券交易所上市的股票,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,采用指数收益法等估值技术进行估值。具体说明可参见10.8其他重大事件。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正事项。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

6.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资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,股权的股息、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。

6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,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,暂减按25%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;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、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
航天科技财务有限责任公司	基金管理人的股东
江苏广传广播传媒有限公司	基金管理人的股东
上海浦东发展银行股份有限公司	基金代销机构

注:以下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

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年2月3日(基金合同生效日)至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	1,039,825,346.94	91.22%	-	-

注:本基金于2015年2月3日成立,无上年度可比期间数据。

债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易,本基金于2015年2月3日成立,无上年度可比期间数据。

债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年2月3日(基金合同生效日)至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	12,480,300,000.00	99.28%	-	-

注:本基金于2015年2月3日成立,无上年度可比期间数据。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年2月3日(基金合同生效日)至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	532,767.06	88.37%	532,767.06	88.37%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

注:本基金于2015年2月3日成立,无上年度可比期间数据。

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 2015年2月3日(基金合同生效日)至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,279,440.76	-
其中:支付销售机构的客户维护费	1,212,315.84	-

注:1、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1.2%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×1.2% ÷ 当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产里列支的费用项目。其中,本报告期应支付交通银行股份有限公司的客户维护费为673,490.08元;应支付中信建投证券股份有限公司的客户维护费为537,253.75元;应支付上海浦东发展银行银行股份有限公司的客户维护费为1,572.01元。

3、本基金的合同于2015年2月3日生效,无上年度可比期间数据。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年2月3日(基金合同生效日)至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	379,906.84	-

注:1、支付基金托管人北京银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%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×0.2% / 当年天数。

2、本基金的合同于2015年2月3日生效,无上年度可比期间数据。

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费计提项目。

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

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易,本基金于2015年2月3日成立,无上年度可比期间数据。

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

本基金基金管理人本报告期间未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
航天科技财务有限责任公司	29,999,000.00	18.6818%	-	-
中信建投证券股份有限公司	9,999,000.00	6.2269%		

注:本基金于2015年2月3日成立,无上年度可比期间数据。

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 2015年2月3日(基金合同生效日)至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	10,432,726.81	113,874.68	-	-

注:本基金于2015年2月3日成立,无上年度可比期间数据。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券,本基金于2015年2月3日成立,无上年度可比期间数据。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需说明的其他关联交易事项,本基金于2015年2月3日成立,无上年度可比期间数据。

6.4.9 期末(2015年6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

金额单位:人民币元

债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
132002	15天集EB	2015年6月11日	2015年7月2日	新发	100.00	100.00	1,400	140,000.00	140,000.00	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票本基金本报告期末未持有流通受限股票。

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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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

银行存款、结算备付金、卖出回购金融资产款等,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

(1)各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币161,719,562.51元,无属于第二层次的余额为人民币10,188,000.00元,无属于第三层级的余额。

(2)公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具,因个别停牌股票改由"指数收益法"进行估值而在第一层次和第二层次之间出现过无重大几次转换,具体请参考"10.8其他重要事项"。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

2、承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

3、其他事项

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	161,719,562.51	79.37
	其中:股票	161,719,562.51	79.37
2	固定收益投资	10,188,000.00	5.00
	其中:债券	10,188,000.00	5.00
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	15,000,000.00	7.36
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	12,302,259.25	6.04
7	其他各项资产	4,542,058.32	2.23
8	合计	203,751,880.08	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	11,325.00	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	92,418,247.75	48.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	248,330.00	0.13
E	建筑业	1,836,000.00	0.96
F	批发和零售业	-	-
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	9,987,396.42	5.24
J	金融业	23,354,700.00	12.25
K	房地产业	18,562,550.00	9.74
L	租赁和商务服务业	22,565.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	15,278,448.34	8.02
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	161,719,562.51	84.85

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	占基金资产净值比例(%)
1	002146	荣盛发展	1,485,004	18,562,550.00	9.74
2	000625	长安汽车	800,000	16,920,000.00	8.88
3	601318	中国平安	200,000	16,388,000.00	8.60
4	300090	盛运环保	515,000	11,443,300.00	6.00
5	300274	阳光电源	350,000	10,699,500.00	5.61
6	000978	桂林旅游	700,000	10,640,000.00	5.58
7	600176	中国巨石	392,555	10,622,538.30	5.57
8	002531	天顺风能	700,000	10,213,000.00	5.36
9	300017	网宿科技	150,001	6,963,046.42	3.65
10	000776	广发证券	300,000	6,795,000.00	3.57

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000776	广发证券	53,161,128.85	27.89
2	600000	浦发银行	48,620,359.57	25.51
3	601318	中国平安	39,220,368.77	20.58
4	000625	长安汽车	31,291,100.79	16.42
5	002202	金风科技	31,040,261.36	16.29
6	002146	荣盛发展	30,173,590.20	15.83
7	600881	亚泰集团	21,571,769.95	11.32
8	300274	阳光电源	18,696,947.44	9.81
9	603008	喜临门	16,583,229.77	8.70
10	601633	长城汽车	14,771,610.23	7.75
11	300090	盛运环保	14,620,305.20	7.67
12	600176	中国巨石	14,108,841.73	7.40
13	002271	东方雨虹	13,716,008.80	7.20
14	300017	网宿科技	13,587,434.00	7.13
15	000978	桂林旅游	12,713,160.44	6.67
16	000400	许继电气	12,237,482.08	6.42
17	002293	罗莱家纺	12,000,534.86	6.30
18	601166	兴业银行	11,777,500.00	6.18
19	600048	保利地产	10,321,113.75	5.42
20	002033	丽江旅游	10,255,494.60	5.38
21	300291	华录百纳	9,650,427.38	5.06
22	300342	天银机电	9,282,708.30	4.87
23	300003	乐普医疗	9,152,093.55	4.80
24	600686	金龙汽车	9,108,426.00	4.78
25	600835	上海机电	8,649,164.00	4.54
26	000709	河北钢铁	8,431,711.82	4.42
27	002531	天顺风能	8,237,091.55	4.32
28	601179	中国西电	7,437,855.00	3.90
29	600037	歌华有线	7,132,689.00	3.74
30	002470	金正大	7,057,636.78	3.70
31	002054	德美化工	6,988,603.54	3.67
32	600153	建发股份	6,471,334.39	3.40
33	002273	水晶光电	6,306,608.66	3.31
34	002373	千方科技	5,811,205.26	3.05
35	300028	金亚科技	5,708,663.37	3.00
36	000498	山东路桥	5,574,019.04	2.92
37	002521	齐峰新材	5,094,184.16	2.67
38	000722	湖南发展	4,920,690.00	2.58
39	002632	道明光学	4,821,247.50	2.53
40	300237	美晨科技	4,601,670.57	2.41
41	600466	蓝光发展	4,344,914.00	2.28
42	002195	二三四五	3,950,000.00	2.07
43	000678	襄阳轴承	3,859,000.00	2.02

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600000	浦发银行	51,076,311.36	26.80
2	000776	广发证券	48,285,543.76	25.34
3	002202	金风科技	34,227,314.17	17.96
4	600881	亚泰集团	31,397,326.09	16.47
5	601318	中国平安	28,876,480.28	15.15
6	002293	罗莱家纺	24,870,019.28	13.05
7	002146	荣盛发展	24,761,487.94	12.99
8	603008	喜临门	17,100,872.00	8.97
9	000625	长安汽车	17,077,836.62	8.96
10	002271	东方雨虹	15,878,673.73	8.33
11	601633	长城汽车	15,697,763.23	8.24
12	600176	中国巨石	13,551,968.29	7.11
13	601166	兴业银行	13,051,733.87	6.85
14	300291	华录百纳	12,106,847.08	6.35
15	600686	金龙汽车	9,801,065.12	5.14
16	000709	河北钢铁	9,647,249.56	5.06
17	002054	德美化工	9,594,893.29	5.03
18	300028	金亚科技	9,296,484.07	4.88
19	600048	保利地产	9,282,000.00	4.87
20	300274	阳光电源	8,774,589.00	4.60
21	300017	网宿科技	7,916,894.93	4.15
22	002470	金正大	7,832,860.54	4.11
23	600153	建发股份	7,535,099.00	3.95
24	600835	上海机电	7,031,974.54	3.69
25	002632	道明光学	7,012,155.92	3.68
26	002033	丽江旅游	6,733,395.48	3.53
27	600037	歌华有线	6,699,671.54	3.52
28	002273	水晶光电	6,609,134.48	3.47
29	002373	千方科技	6,231,301.00	3.27
30	300237	美晨科技	6,187,882.70	3.25
31	000400	许继电气	5,838,243.00	3.06
32	002521	齐峰新材	5,307,977.00	2.79
33	000722	湖南发展	4,975,412.00	2.61
34	002531	天顺风能	4,927,540.02	2.59
35	000498	山东路桥	4,806,352.00	2.52
36	600466	蓝光发展	4,423,633.00	2.32
37	000678	襄阳轴承	4,155,586.22	2.18
38	300003	乐普医疗	4,003,946.73	2.10

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	600,738,643.09
卖出股票收入(成交)总额	539,558,862.99

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,048,000.00	5.27
	其中:政策性金融债	10,048,000.00	5.27
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	140,000.00	0.07
8	其他	-	-
9	合计	10,188,000.00	5.35

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	140230	14国开30	100,000	10,048,000.00	5.27
2	132002	15天集EB	1,400	140,000.00	0.07

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告未进行国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告未进行国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告未进行国债期货投资。

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 本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	227,891.05
2	应收证券清算款	3,996,946.32
3	应收股利	-
4	应收利息	219,216.34
5	应收申购款	98,004.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,542,058.32

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

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

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		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,101	76,429.51	40,883,252.49	25.46%	119,695,138.21	74.54%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,536,868.35	0.9571%

8.4 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的情况

项目	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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2015年2月3日)基金份额总额	739,433,057.45
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	20,767,046.29
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	599,621,713.04
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	160,578,390.70

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期间,本基金未召开基金份额持有人大会。

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

基金管理人总经理袁野先生于2015年4月23日离任,转任公司常务副总经理,离任期间由公司董事长代行总经理职务。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期间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

本基金本报告期间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

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

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、托管人的托管业务部门及其高级管理人员在本报告期间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

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券	2	1,039,825,346.94	91.22%	532,767.06	88.37%	-
国泰君安	2	38,844,791.70	3.41%	27,595.52	4.58%	-
海通证券	1	21,917,144.00	1.92%	15,569.66	2.58%	-
广发证券	2	39,361,868.44	3.45%	26,959.01	4.49%	-

注:1、本基金根据中国证监会《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)的规定及本基金管理人的《中信建投基金管理有限公司交易席位管理办法》,基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准,具体如下:

(1)证券经纪商的选择由基金管理人分管投资研究、市场领导及投资研究部、特定资产管理部、稽控合规部负责人组成的办公会议集体讨论决定,经公司总经理办公会通过后,办理相关的租用席位或开户事宜。

(2)投资研究部、特定资产管理部按照《券商评估细则》共同完成对各往来证券经纪商的评估,评估办法作为调整确定个别证券经纪商的交易金额及比率限制的参考。

(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%)。

基础服务占45%权重,由研究员负责打分;特别服务占45%权重,由投资研究部负责人和研究员共同打分;销售服务占10%权重,由投资研究部负责人打分。

基础服务包括:报告、电话沟通、路演、联合调研服务等;

特别包括: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委托协议,并报中国证监会备案及通知基金托管人。

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	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投证券	-	-	12,480,300,000.00	99.28%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	91,000,000.00	0.72%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期间无影响投资者决策的其他重要信息。

中信建投基金管理有限公司
2015年8月26日