

中信建投医改灵活配置混合型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3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:渤海银行股份有限公司 报告送出日期:2017年4月21日

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...

Table with 2 columns: 基金产品概况, 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, etc.

主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日至2017年3月31日)

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(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额...

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益差④, ①-③, ②-④

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益差④, ①-③, ②-④

注:1、本基金基金合同于2016年4月6日生效,基金合同生效起至报告期末未满一年。

2、根据本基金基金合同的约定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

Table with 6 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限, 证券从业年限, 说明

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。

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》...

4.3 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》...

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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析 第一季度,医药指数略涨,在中信29个一级行业排20名,相对市场指数仍较弱。

4.5 报告期内基金的业绩表现 截至报告期末,本基金份额净值为1.017元,本报告期净值增长率为0.39%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 本基金本报告期末发生连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人的情形。

基金自2016年11月24日起,截至本报告期末,已连续85个工作日资产净值低于五千万。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占总资产的比例(%)

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

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.2 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。

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

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 本基金本报告期末未持有债券投资。

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

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.3 本期国债期货投资评价

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,未发现本报告期末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

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 基金期初基金份额总额, 基金期末基金份额总额

中信建投基金管理有限公司 2017年4月21日

中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3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:中信银行股份有限公司 报告送出日期:2017年4月21日

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...

Table with 2 columns: 基金产品概况, 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, etc.

主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日至2017年3月31日)

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...

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益差④, ①-③, ②-④

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益差④, ①-③, ②-④

注:1、本基金基金合同于2016年8月3日生效,基金合同生效起至报告期末未满一年。

2、根据本基金基金合同的约定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

Table with 6 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限, 证券从业年限, 说明

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。

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》...

4.3 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》...

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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析 2017年一季度,固定资产配置和工业增加小幅回升,经济数据尚可,CPI在2月份下行到0.8%,3月份0.9%。

4.5 报告期内基金的业绩表现 截至报告期末,本基金份额净值为0.994元,本报告期份额净值增长率为0.61%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 本基金本报告期末发生连续二十个工作日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。

5.5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占总资产的比例(%)

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

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.2 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。

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

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 本基金本报告期末未持有债券投资。

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

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.3 本期国债期货投资评价

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,未发现本报告期末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

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

中信建投基金管理有限公司 2017年4月21日