

中信建投智信物联网灵活配置混合型证券 投资基金 2017 年半年度报告 摘要

2017 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：中信银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中信建投智信物联网	
基金主代码	001809	
交易代码	001809	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 8 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	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	47,304,522.29 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中信建投智信物联网 A	中信建投智信物联网 C
下属分级基金的交易代码:	001809	004636
报告期末下属分级基金的份额总额	47,303,522.29 份	1,000.00 份

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×60%+中债综合指数收益率×40%
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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张乐久
	联系电话	010-57760122
	电子邮箱	zhanglj@csc.com.cn
客户服务电话	4009-108-108	95558
传真	010-59100298	010-85230024

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	www.cfund108.com
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

基金级别	中信建投智信物联网 A	中信建投智信物联网 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日- 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-917,414.97	9.66
本期利润	2,037,010.51	50.03
加权平均基金份额本期利润	0.0332	0.0500
本期基金份额净值增长率	3.85%	5.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.0244	0.0097
期末基金资产净值	48,521,052.16	1,050.03
期末基金份额净值	1.026	1.050

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、自 2017 年 5 月 10 日起对本基金增加 C 类基金份额类别：自 2017 年 5 月 10 日起开放中信建投智信物联网 A 和中信建投智信物联网 C 的申赎业务；中信建投智信物联网 A 类基金本报告期为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日；中信建投智信物联网 C 类基金本报告期为 2017 年 6 月 7 日（首笔份额登记日）至 2017 年 6 月 30 日。

5、中信建投智信物联网 A 收取认购/申购费用，中信建投智信物联网 C 计提销售服务费，不收取认购/申购费用。

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

中信建投智信物联网 A

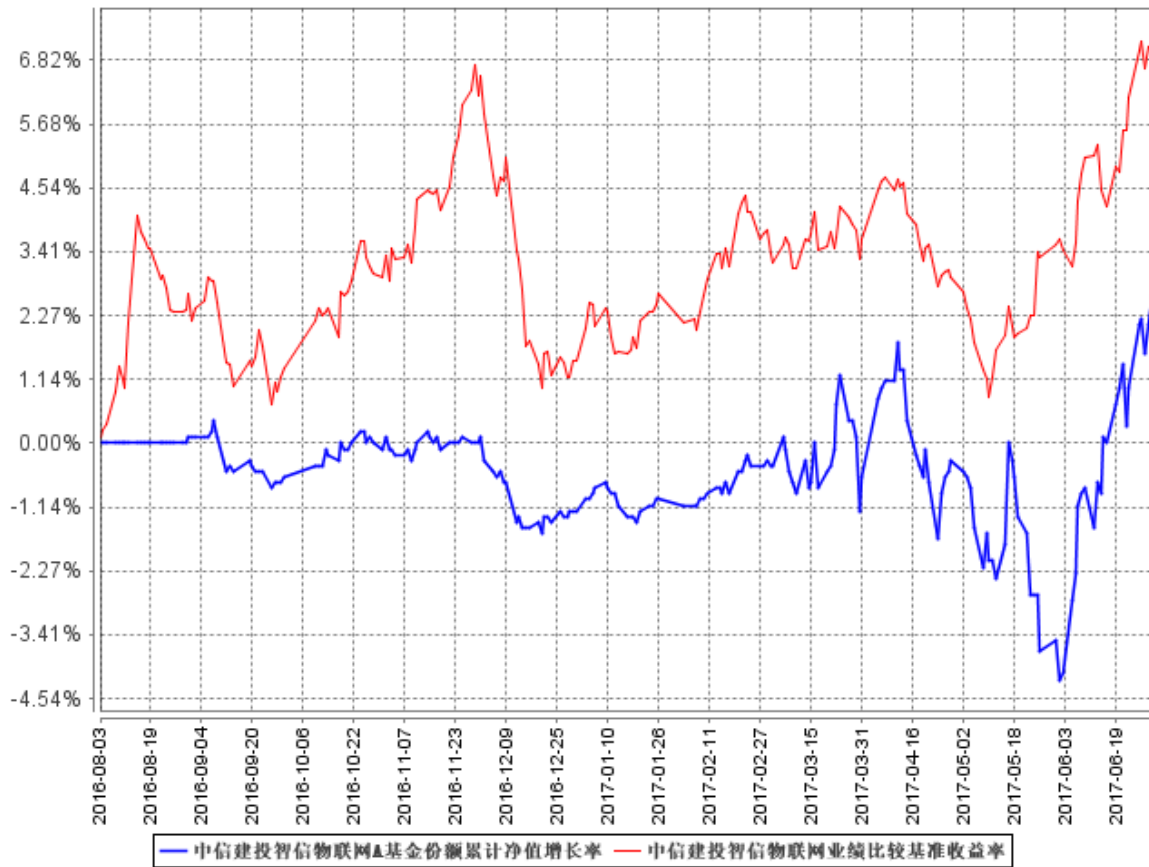
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.32%	0.66%	3.34%	0.41%	2.98%	0.25%
过去三个月	3.22%	0.66%	3.26%	0.38%	-0.04%	0.28%
过去六个月	3.85%	0.53%	5.46%	0.35%	-1.61%	0.18%
自基金合同生效起至今	2.60%	0.40%	7.01%	0.41%	-4.41%	-0.01%

中信建投智信物联网 C

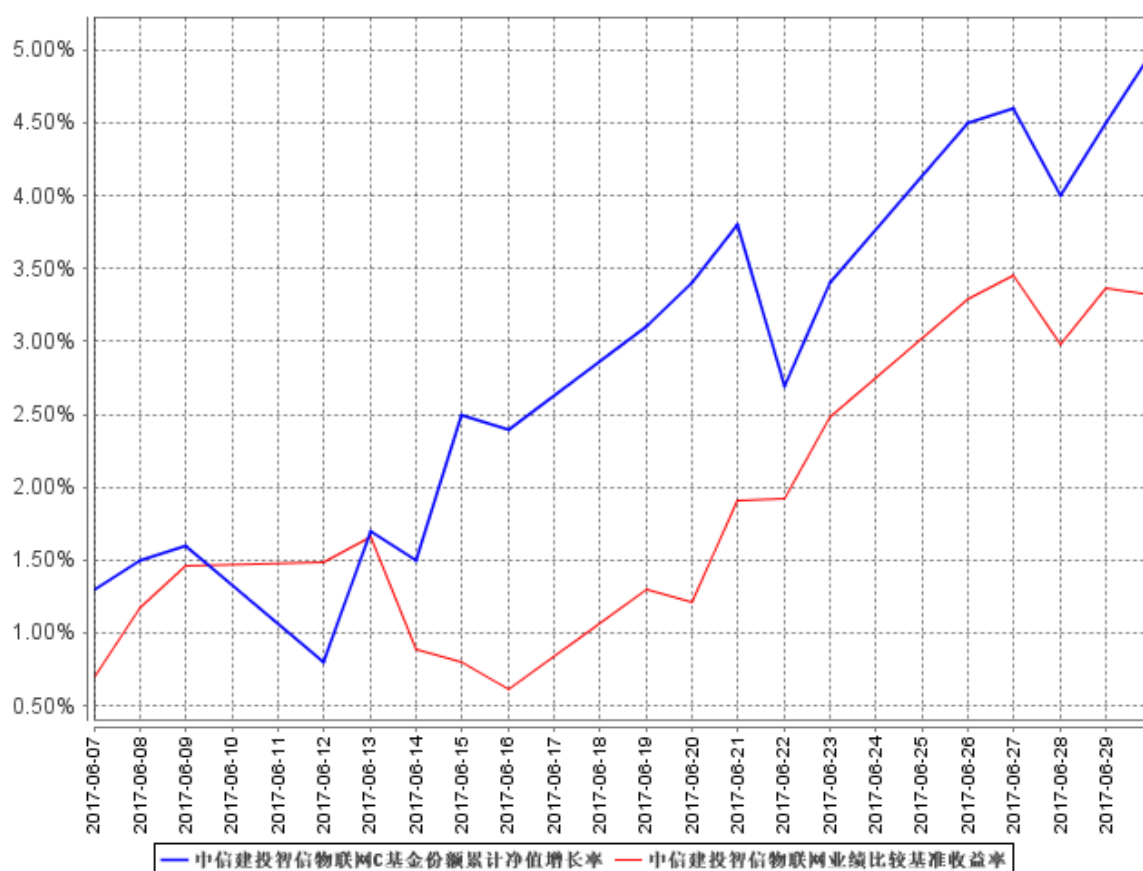
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	5.00%	0.64%	3.31%	0.43%	1.69%	0.21%

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

中信建投智信物联网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



中信建投智信物联网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



注：1、图 1 为中信建投智信物联网 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 8 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日；

2、图 2 为中信建投智信物联网 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 6 月 7 日（首笔份额登记日）至 2017 年 6 月 30 日；

3、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；

4、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，建仓期结束时基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§ 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 9 月 9 日在北京正式注册成立，主要经营基金募集、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。公司子公司元达信资本管理（北京）有限公司于 2015 年 6 月 8 日成立。依托强大的股东背景，经过 2014 年、2015 年、2016

年的基础建设及资源、业务、经验的积累，公司业务呈现发展趋势。公司秉承“忠于信，健于投”的经营理念，追求以稳健的投资及良好的收益，回馈客户的信任，公司投资业绩稳健，以良好的投资回报实现了投资人资产的保值增值。公司机构客户资源丰富，涵盖商业银行、证券公司、信托公司、财务公司等客户资源；深度开展各类客户的拓展维护，与大型商业银行及农村商业银行均开展不同程度的合作。公司构建了涵盖风险收益高中低各类产品在内的产品体系，公募基金涵盖混合型、债券型、货币型等多种产品类型；专户产品在量化投资、资产证券化等多个领域均取得了良好的业绩；同时公司积极践行“金融服务实体经济的本质要求”，与相关政府部门、金融机构共同开发国企改革基金、产业基金等创新业务，通过产品创新和业务创新为国家经济政策的调整 and 实体经济的发展贡献应有之力。

公司积极践行社会责任，在各项工作中均以保护投资者、合作伙伴利益为基础；在 2016 年获得怀柔区“2016 年度经济发展贡献奖”奖项。同时，公司在固定收益等专业领域业绩卓著，在 2016 年获得上海证券交易所“2016 年度优秀债券交易商”奖项、2014-2015 年连续两年获得中金所“国债期货优秀市场拓展团队”奖项。

2017 年公司本着“回归本源、夯实基础、稳中求进、再绘蓝图”的指导思想，提升投研实力，加快产品创新，拓展销售渠道，不断增强公司核心竞争力。

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	本基金的基金经理、公司总经理助理、投资研究部负责人	2016 年 8 月 3 日	-	16	中国籍，1974 年 7 月生，中国人民大学金融学博士。曾任中技开发公司投资经理、清华永新信息工程有限公司企划部经理、大通证券股份有限公司研发中心行业研究员、中关村证券股份有限公司研发中心行业研究员、中信建投证券股份有限公司交易部总监。2014 年 3 月加入中信建投基金管理有限公司，现担任公司总经理助理及投资研究部部门总经理，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，现任中信建投智信物联网灵活

					配置混合型证券投资基金、中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。
王浩	本基金的基金经理	2016 年 8 月 3 日	-	7	中国籍，1982 年 2 月生，中央财经大学经济学硕士。曾就职于中信建投证券股份有限公司资产管理部，从事证券投资研究分析工作。现任本公司投资研究部基金经理，担任中信建投稳利保本混合型证券投资基金、中信建投稳利保本 2 号混合型证券投资基金、中信建投稳溢保本混合型证券投资基金、中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金、中信建投睿康混合型证券投资基金基金经理。
周紫光	本基金的基金经理	2017 年 5 月 27 日	-	7	中国籍，1983 年 7 月生，大连理工大学工学硕士。2009 年 9 月至 2010 年 6 月在江海证券有限责任公司担任研究员，从事电力设备与新能源行业研究等工作；2010 年 6 月至 2014 年 5 月在平安证券有限责任公司担任研究员，从事电力设备与新能源行业研究等工作；2014 年 5 月至 2016 年 3 月在方正证券有限责任公司担任研究员，从事电力设备与新能源行业研究等工作；2016 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，从事证券投资研究分析工作，担任中信建投智信物联网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。

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合规守信情况的说明

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

2017 年上半年，经济展现较强的韧性，GDP 实际增速均保持在 6.9%，相对平稳，GDP 名义增速同比一季度达到 11.83%，二季度小幅回落到 11.44%。在出口改善、投资增速保持高位，工业增加值逐步回升的情况下，经济数据保持稳中向好。而中观层面的设备更新替代需求明显的回升，以及微观层面企业盈利的改善，也侧面的印证供给有限的情况下，需求的温和增长。

通胀风险预期减弱，总体处于良性状态。CPI 处于相对低位，PPI 高位回落后企稳。CPI 在 1 月份达到上半年高位 2.55%，随后 2、3 月份下行到 0.8%和 0.9%，4-6 月份逐步上行到 1.2%、1.5%和 1.5%。PPI 先冲高后逐月回落，6 月份企稳在 5.5%。

政策角度，始于去年中以来对于银行理财资金的监管持续发酵，货币政策继续保持稳健中性，同时确保不发生系统性金融风险，央行一季度将表外理财纳入 MPA 考核，并且两次提高公开市场回购利率和 MLF 等政策利率，抬升资金成本的中枢，而二季度未上调 MLF 和公开市场利率，各项指

标显示金融去杠杆已经取得一定成效。

市场方面，1 月中下旬开始市场企稳反弹，特别是春节过后，随着资金回流，加之经济企稳带来的上市公司业绩回升，市场出现了一波较大幅度的反弹，主要以消费升级和周期回暖相关行业涨幅居前；2 季度初市场整体出现了一波较大幅度的下跌，上证指数在 3000 点附近企稳反弹，创业板指则调整到了 1700 点附近，对比来看，依然是主板走势较强，下跌较少而反弹力度也更强；整体来看，市场回归基本面和业绩的趋势明显，业绩确定、估值合理的个股走势强劲，而高估值股票依然面临较大的压力。

操作方面，由于产品主题方向以成长股为主，1 月初考虑到成长股依然没有摆脱调整压力，采取了低仓位精选个股的方式；在反弹中，产品逐步提高仓位，积极参与反弹，并且精选投资方向，以景气较高、业绩增长确定性较好的方向为主要投资方向，取得了一定净值增长；二季度产品继续保持仓位水平，力主以精选个股平滑市场波动，取得了较好的效果，二季度产品净值获得新高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.026 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.85%，同期业绩比较基准收益率为 5.46%；本基金 C 类基金份额净值为 1.050 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.00%，同期业绩比较基准收益率为 3.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年下半年，三季度经济走势预计仍然较为平稳，四季度经济存在一定不确定性，与此同时，企业盈利能力保持强势。欧洲改善继续利好出口，国内地产库存处于低位，地产投资增速降幅有限，盈利改善或带动制造业投资持续回升，产能周期开启。不确定性来自于企业杠杆，政府杠杆，以及居民杠杆被限制住之后，融资需求的回落，是否会对经济的传导产生负面的影响。

市场角度来看，企业盈利能力的强势成为行情稳定的重要因素，随着经济稳定恢复的持续验证，相关资源类行业将会迎来一波盈利驱动的行市；随着制造业投资的持续回升，制造类企业也将迎来较好的投资时点；成长股角度来看，下半年迎来业绩释放和验证期，估值与成长匹配的标的将成为投资重点。

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。公司分管运营领导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、稽控合规部、运营管理部的主要负责人，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（适用于非货币基金）或影子定价（适用于货币基金和理财类基金）；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固定收益品种进行估值。

2. 由估值委员会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考核，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、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，并提交公司管理层，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

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本基金本报告期未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 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金 2017 年上半年基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，中信建投基金管理有限公司在中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，中信建投基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		18,103,116.60	2,993,024.10
结算备付金		39,134.99	131,627.16
存出保证金		43,035.52	22,263.25
交易性金融资产		31,189,047.93	19,292,920.00
其中：股票投资		31,189,047.93	9,229,920.00
基金投资		-	-
债券投资		-	10,063,000.00
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		-	54,800,404.70
应收证券清算款		-	-
应收利息		1,688.73	286,188.66
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		9,117.64	-
资产总计		49,385,141.41	77,526,427.87
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		-	-
应付赎回款		586,190.39	11,671.47
应付管理人报酬		62,245.95	100,602.37
应付托管费		8,299.44	13,413.68
应付销售服务费		0.23	-
应付交易费用		30,121.63	43,263.68
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		176,181.58	250,029.32
负债合计		863,039.22	418,980.52
所有者权益：			
实收基金		47,304,522.29	78,033,931.26

未分配利润		1,217,579.90	-926,483.91
所有者权益合计		48,522,102.19	77,107,447.35
负债和所有者权益总计		49,385,141.41	77,526,427.87

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，中信建投智信物联网 A 基金份额净值 1.026 元，基金份额总额 47,303,522.29 份；中信建投智信物联网 C 基金份额净值 1.050 元，基金份额总额 1,000.00 份。中信建投智信物联网份额总额合计为 47,304,522.29 份。

6.2 利润表

会计主体：中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		2,872,276.64	-
1.利息收入		305,969.83	-
其中：存款利息收入		36,720.18	-
债券利息收入		53,013.70	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		216,235.95	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-434,576.00	-
其中：股票投资收益		-388,749.86	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-113,190.00	-
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		67,363.86	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		2,954,465.85	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		46,416.96	-
减：二、费用		835,216.10	-
1. 管理人报酬		455,180.49	-
2. 托管费		60,690.75	-
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	0.23	-
4. 交易费用		172,760.00	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		146,584.63	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,037,060.54	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,037,060.54	-

注：本基金合同于 2016 年 8 月 3 日生效，无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	78,033,931.26	-926,483.91	77,107,447.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	2,037,060.54	2,037,060.54
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）	-30,729,408.97	107,003.27	-30,622,405.70
其中：1.基金申购款	507,098.58	-5,720.43	501,378.15
2.基金赎回款	-31,236,507.55	112,723.70	-31,123,783.85
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）	47,304,522.29	1,217,579.90	48,522,102.19
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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：本基金合同于 2016 年 8 月 3 日生效，无上年度可比期间。

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
基金管理人负责人

 高翔
主管会计工作负责人

 陈莉君
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2015]第 1900 号《关于准予中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1007 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 8 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 234,704,259.11 份基金份额，其中认购资金利息折合 72,767.74 份基金份额。本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)。

根据《关于中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并调整基金合同和托管协议中相关条款的公告》，自 2017 年 5 月 10 日起，对本基金增加 C 类份额类别，原有

的基金份额在增加收取销售服务费的 C 类份额后,全部自动转换为本基金 A 类份额。本基金根据所收取费用的差异,将基金份额分为不同类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用,不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类份额;从本基金资产中计提销售服务费,并不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类份额。本基金两类基金份额分别设置代码,分别公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为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(包括主板、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)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 0-95%,其中,投资于物联网相关的证券资产的比例不低于非现金基金资产的 80%;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:沪深 300 指数收益率 \times 60%+中债综合指数收益率 \times 40%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.4.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《关于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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 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、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司	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
中信建投期货有限公司	与基金管理人同一控股股东、基金代销机构

6.4.7 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。

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	127,827,629.93	78.84%	-	-

注：本基金合同于 2016 年 8 月 3 日生效，无上年度可比期间。

6.4.7.1.2 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易，本基金合同于 2016 年 8 月 3 日生效，无上年度可比期间。

6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	210,700,000.00	100.00%	-	-

注：本基金合同于 2016 年 8 月 3 日生效，无上年度可比期间。

6.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易，本基金合同于 2016 年 8 月 3 日生效，无上年度可比期间。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017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	67,914.76	78.17%	11,152.04	37.02%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

2、本基金合同于 2016 年 8 月 3 日生效，无上年度可比期间。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	455,180.49
其中：支付销售机构的客户维护费	267,996.71	-

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 1.50% 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×1.50% / 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。

3、本基金合同于 2016 年 8 月 3 日生效，无上年度可比期间。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	60,690.75	-

注：1、支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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×0.20% / 当年天数。

2、本基金的合同于 2016 年 8 月 3 日生效，无上年度可比期间。

6.4.7.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投智信物联网 A	中信建投智信物联网 C	合计
中信建投基金管理有限公司	-	0.23	0.23
合计	-	0.23	0.23
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投智信物联网 A	中信建投智信物联网 C	合计

注：1、根据《关于中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并调整基金合同和托管协议中相关条款的公告》，自 2017 年 5 月 10 日起，对本基金增加 C 类份额类别，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%。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

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付给注册登记机构，经注册登记机构代付给各个基金销售机构。

2、本基金合同于 2016 年 8 月 3 日生效，无上年度可比期间。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易，本基金合同于 2016 年 8 月 3 日生效，无上年度可比期间。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期末运用自有资金投资本基金，本基金合同于 2016 年 8 月 3 日生效，无上年度可比期间。

6.4.7.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额，本基金合同于 2016 年 8 月 3 日生效，无上年度可比期间。

6.4.7.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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
中信银行股份有限公司	18,103,116.60	33,289.78	-	-

注：1、本基金的活期存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

2、本基金合同于 2016 年 8 月 3 日生效，无上年度可比期间。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券，本基金合同于 2016 年 8 月 3 日生效，无上年度可比期间。。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600050	中国联通	2017年4月5日	临时停牌	7.47	-	-	200,000	1,546,477.00	1,494,000.00	-

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9 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

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 31,189,047.93 元，无属于第二层次和第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 9,229,920.00 元，属于第二层次的余额为 10,063,000.00 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中

发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，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	31,189,047.93	63.15
	其中：股票	31,189,047.93	63.15
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	18,142,251.59	36.74
7	其他各项资产	53,841.89	0.11
8	合计	49,385,141.41	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	1,272,600.00	2.62
C	制造业	23,703,250.70	48.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,826,800.00	3.76
E	建筑业	-	-
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	4,386,397.23	9.04
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	-	-
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	31,189,047.93	64.28

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	000063	中兴通讯	100,000	2,374,000.00	4.89
2	300166	东方国信	175,861	2,361,813.23	4.87
3	300296	利亚德	119,866	2,253,480.80	4.64
4	600452	涪陵电力	40,000	1,826,800.00	3.76
5	002456	欧菲光	100,000	1,817,000.00	3.74
6	600884	杉杉股份	110,000	1,811,700.00	3.73
7	002635	安洁科技	45,000	1,629,900.00	3.36
8	600050	中国联通	200,000	1,494,000.00	3.08
9	002138	顺络电子	80,000	1,486,400.00	3.06
10	002475	立讯精密	50,000	1,462,000.00	3.01

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	002635	安洁科技	3,285,296.00	4.26
2	002456	欧菲光	3,005,198.47	3.90
3	600884	杉杉股份	2,501,845.00	3.24
4	300296	利亚德	2,359,407.80	3.06
5	300166	东方国信	2,327,944.54	3.02
6	002475	立讯精密	2,316,584.00	3.00
7	300007	汉威科技	2,204,926.00	2.86
8	600038	中直股份	2,166,938.00	2.81
9	000066	中国长城	2,152,446.00	2.79
10	000651	格力电器	2,079,520.00	2.70
11	603328	依顿电子	1,962,830.66	2.55
12	300133	华策影视	1,692,404.16	2.19
13	002074	国轩高科	1,644,431.40	2.13
14	000039	中集集团	1,638,164.00	2.12
15	002008	大族激光	1,632,643.14	2.12
16	601600	中国铝业	1,552,500.00	2.01
17	600050	中国联通	1,546,477.00	2.01
18	002185	华天科技	1,523,300.00	1.98
19	300202	聚龙股份	1,477,196.00	1.92
20	002273	水晶光电	1,452,973.00	1.88

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	000059	华锦股份	3,227,804.00	4.19
2	000066	中国长城	3,107,564.00	4.03
3	600340	华夏幸福	2,299,020.00	2.98
4	002635	安洁科技	2,119,638.23	2.75

5	002008	大族激光	2,093,992.35	2.72
6	603328	依顿电子	1,825,193.36	2.37
7	600038	中直股份	1,743,501.00	2.26
8	000777	中核科技	1,642,448.00	2.13
9	300133	华策影视	1,628,355.56	2.11
10	000039	中集集团	1,623,972.00	2.11
11	002074	国轩高科	1,602,087.49	2.08
12	601600	中国铝业	1,446,000.00	1.88
13	002456	欧菲光	1,360,129.17	1.76
14	600048	保利地产	1,347,700.00	1.75
15	002045	国光电器	1,289,200.00	1.67
16	300426	唐德影视	1,283,851.50	1.67
17	300066	三川智慧	1,274,281.00	1.65
18	300202	聚龙股份	1,272,512.00	1.65
19	002475	立讯精密	1,269,056.00	1.65
20	000651	格力电器	1,268,253.00	1.64

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	90,814,537.73
卖出股票收入（成交）总额	71,318,095.79

7.5 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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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

本基金本报告期末投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

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

本报告期内本基金未运用国债期货进行投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期内本基金未运用国债期货进行投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内本基金未运用国债期货进行投资。

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

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	43,035.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,688.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	9,117.64
8	其他	-
9	合计	53,841.89

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600050	中国联通	1,494,000.00	3.08	停牌

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

份额级别	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
中信建投智信物联网 A	976	48,466.72	-	-	47,303,522.29	100.00%
中信	1	1,000.00	-	-	1,000.00	100.00%

建投智信物联网 C						
合计	977	48,418.14	-	-	47,304,522.29	100.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中信建投智信物联网 A	1,189,974.61	2.5156%
	中信建投智信物联网 C	1,000.00	100.0000%
	合计	1,190,974.61	2.5177%

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	份额级别	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	中信建投智信物联网 A	>100
	中信建投智信物联网 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中信建投智信物联网 A	10~50
	中信建投智信物联网 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信建投智信物联网 A	中信建投智信物联网 C

基金合同生效日（2016 年 8 月 3 日）基金份额总额	234,704,259.11	-
本报告期期初基金份额总额	78,033,931.26	-
本报告期基金总申购份额	506,098.58	1,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	31,236,507.55	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	47,303,522.29	1,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

基金管理人于 2017 年 5 月 27 日增聘周紫光为本基金的基金经理。

报告期内无基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内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

报告期内本基金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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，报告期内未发生变更。

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

报告期内，基金管理人收到中国证券监督管理委员会北京监管局（以下简称“北京证监局”）《关于对中信建投基金管理有限公司采取责令改正行政监管措施的决定》（[2017]33 号）及对相关责任人采取监管谈话的行政监管措施、北京证监局《关于对中信建投基金管理有限公司采取责令改正行政监管措施的决定》（[2017]36 号），要求基金管理人限期进行整改。

基金管理人高度重视整改工作，及时制定了整改方案并落实，按时向北京证监局报送了整改报告。截至报告期末，基金管理人已完成全部的整改工作。

报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	127,827,629.93	78.84%	67,914.76	78.17%	-
申万宏源证券	1	26,871,164.01	16.57%	14,276.66	16.43%	-
招商证券	1	7,433,839.58	4.59%	4,692.93	5.40%	-

注：1、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）及《中信建投基金管理有限公司公募基金交易单元管理办法》的规定，本基金管理人制定了提供交易单元的证券公司的选择标准，具体如下：

（1）公司选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强的证券公司，向其租用交易单元。

（2）证券公司的选择由公司投资研究部负责人根据证券公司的投资研究服务质量及评估结果作出交易单元租用或撤销的相关决定。经公司分管领导同意后，方可办理相关的租用事宜。投资研究部应定期向公司总经理、市场部、特定资产管理部、稽控合规部负责人等组成的办公会议汇报选择证券公司的相关依据。

（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%）。

打分由投资研究部负责人和研究员共同完成。

基础服务包括：报告、电话沟通、路演、联合调研服务等；

特别服务包括：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交易单元租用协议，并通知基金托管人。

3、投资研究部每月完成对各往来证券公司的研究服务评估，评估结果作为调整确定个别证券公司的交易金额及比率限制的参考。

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	-	-	210,700,000.00	100.00%	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内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
2017 年 8 月 29 日