

中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金

2018 年半年度报告

2018 年 06 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:2018 年 08 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

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2018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2018年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	52
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	52
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	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	53
§8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.3 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情况	54

§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
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.....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§12 备查文件目录.....	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中信建投智信物联网	
基金主代码	001809	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年08月03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	30,635,521.45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	30,608,515.42份	27,006.03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。
--	----------------------------

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	李修滨
	联系电话	010-57760122	4006800000
	电子邮箱	zhanglj@csc.com.cn	lixubini@citicbank.com
客户服务电话		4009-108-108	95558
传真		010-59100298	010-85230024
注册地址		北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室	北京市东城区朝阳门北大街9号
办公地址		北京市东城区朝内大街2号凯恒中心B座17、19层	北京市东城区朝阳门北大街9号
邮政编码		100010	100010
法定代表人		蒋月勤	李庆萍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17、19层
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国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

§ 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(2018年01月01日-2018年06月30日)	
	中信建投智信物联网A	中信建投智信物联网C
本期已实现收益	-2,700,871.49	110,544.37
本期利润	-6,262,673.45	744,643.57
加权平均基金份额本期利润	-0.1934	0.3415
本期加权平均净值利润率	-18.48%	29.74%
本期基金份额净值增长率	-17.24%	-19.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配利润	-2,138,220.55	-776.10
期末可供分配基金份额利润	-0.0699	-0.0287
期末基金资产净值	28,470,294.87	26,229.93
期末基金份额净值	0.9301	0.9713
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-6.99%	-2.87%

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、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	-4.54%	1.99%	-4.50%	0.77%	-0.04%	1.22%
过去三个月	-14.53%	1.57%	-5.62%	0.68%	-8.91%	0.89%
过去六个月	-17.24%	1.44%	-6.97%	0.69%	-10.27%	0.75%
过去一年	-9.35%	1.27%	-1.98%	0.57%	-7.37%	0.70%
自基金合同生效起至今	-6.99%	0.96%	4.92%	0.50%	-11.91%	0.46%

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
过去一个月	-4.56%	1.99%	-4.50%	0.77%	-0.06%	1.22%
过去三个月	-16.28%	1.62%	-5.62%	0.68%	-10.66%	0.94%
过去六个月	-19.07%	1.46%	-6.97%	0.69%	-12.10%	0.77%

过去一年	-7.50%	1.32%	-1.98%	0.57%	-5.52%	0.75%
自基金合同生效起至今	-2.87%	1.29%	1.27%	0.56%	-4.14%	0.73%

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累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年08月03日-2018年06月30日)



中信建投智信物联网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06月07日-2018年06月30日)



§ 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21日获得中国证监会核准设立批复，并于2013年9月9日完成工商注册登记，注册资本3亿元，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。公司全资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，主要经营特定客户资产管理业务和中国证监会许可的其他业务。

公司自成立以来积极拓展业务，公司专户管理资产月均规模根据中国证券投资基金业协会数据，连年位列前20名。截至2017年末，位居行业第13名。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；投研能力优秀，不断丰富和完善“宏微观相互印证”的大类资产配置研究框架，坚持价值投资和稳健投资的原则；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。机构客户资源丰富，客户类别多，涵盖商业银行、证券公司、信托公司、财务公司、私募基金等客户资源。积极进行产品创新，响应十九大“金融服务实体经济”的号召，与政府相关部门共同开发国企改革基金；响应“调结构、降杠杆”的号召，成立产业基金，包含基础设施、环境治理、专项扶贫等关系国计民生的重大项目。

2017年度，公司荣获上交所、深交所“债券优秀交易商”荣誉称号，是行业113家基金公司中唯一一家在沪深交易所均获得该称号的公司。公司各项业务有序开展，为进一步发展奠定了良好的基础。

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		
王浩	本基金的基金经理	2016-08-03	-	8年	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、中信建投聚利混合型证券投资基金、中信建投睿溢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基金经理。
周紫光	本基金的基金经理	2017-05-27	-	8年	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。首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

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

上半年，国内宏观经济高位运行中有所回落，6月终端需求走弱，验证了之前市场对今年经济基本面增速下行的担忧。股市方面，年初先是金融板块冲高回落，而后创业板上涨，但受国内去杠杆和中美贸易纠纷影响，投资者普遍对科技行业、制造业及上游周期性行业表示悲观，因此4月开始消费相关行业受到青睐，而在新增资金较少的情况下，股市整体呈现了严重的结构性差异。但是进入六月，市场的悲观情绪扩大，指数出现较大跌幅，上证综指6月单月下跌8%。

操作方面，上半年产品组合仓位变化不大，主要是调整持仓结构和优选个股为主，但由于物联网主题相关行业上半年多数跌幅较大，产品组合也表现不佳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投智信物联网A基金份额净值为0.9301元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-17.24%，同期业绩比较基准收益率为-6.97%；截至报告期末中信建投智信物联网C基金份额净值为0.9713元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-19.07%，同期业绩比较基准收益率为-6.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为经济缓慢下行的压力犹在，一方面是去年基数影响，一方面是贸易纠纷对出口的影响将会显现，而国内相关政策仍存在诸多不确定性。受此影响，我们认为A股市场将维持震荡走势，周期性板块存在因为政策转暖的反弹机会，但可看好的中长期主线仍是消费和成长板块。落实到物联网主题相关，我们相对看好半导体、消费电子、计算机、5G、智能交通、智慧能源等相关方向，并将继续从中精选优质公司进行配置。

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及其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20个工作日基金份额持有人数量不满200人的情形。

本基金自2018年1月5日至2018年4月4日连续59个工作日、自2018年4月20日起至2018年6月29日连续48个工作日资产净值低于5000万元。

§ 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2018年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，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2018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：2018年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	6,328,166.65	17,392,127.58
结算备付金		105,849.65	195,027.58
存出保证金		28,912.09	44,778.75
交易性金融资产	6.4.7.2	22,183,962.18	40,877,167.68
其中：股票投资		22,183,962.18	40,807,470.00
基金投资		-	-
债券投资		-	69,697.68
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	607.29	1,330.65
应收股利		-	-
应收申购款		6,488.03	10,970.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		28,653,985.89	58,521,402.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
负债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	3,965,232.34
应付赎回款		2,939.88	72,206.95
应付管理人报酬		35,731.24	57,771.64
应付托管费		4,764.14	7,702.89
应付销售服务费		10.84	384.52
应付交易费用	6.4.7.7	39,627.54	46,240.95
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	74,387.45	150,099.83
负债合计		157,461.09	4,299,639.12
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	30,635,521.45	47,663,831.89
未分配利润	6.4.7.1 0	-2,138,996.65	6,557,931.47
所有者权益合计		28,496,524.80	54,221,763.36
负债和所有者权益总计		28,653,985.89	58,521,402.48

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额总额30,635,521.45份。其中A类基金份额净值0.9301元，基金份额总额30,608,515.42份；C类基金份额净值0.9713元，基金份额总额27,006.03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：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年06月30日
----	-----	---------------------------	--------------------------------

一、收入		-4,918,663.97	2,872,276.64
1. 利息收入		15,140.99	305,969.83
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	15,138.70	36,720.18
债券利息收入		2.29	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）		-2,231,946.09	-434,576.00
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-2,288,546.05	-388,749.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	688.98	-113,190.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.1 3.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.1 4	-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 5	-	-
股利收益	6.4.7.1 6	55,910.98	67,363.86
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	-2,927,702.76	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）	6.4.7.1 8	225,843.89	46,416.96
减：二、费用		599,365.91	835,216.10

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	267,184.90	455,180.49
2. 托管费	6.4.10.2.2	35,624.65	60,690.75
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,092.43	0.23
4. 交易费用	6.4.7.19	196,634.69	172,760.00
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	95,829.24	146,584.63
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-5,518,029.88	2,037,060.54
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-5,518,029.88	2,037,060.54

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: 2018年01月01日至2018年06月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06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)	47,663,831.89	6,557,931.47	54,221,763.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,518,029.88	-5,518,029.88
三、本期基金份额交易产生的基金净值	-17,028,310.44	-3,178,898.24	-20,207,208.68

变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	29,569,151.11	3,550,334.14	33,119,485.25
2. 基金赎回款	-46,597,461.55	-6,729,232.38	-53,326,693.93
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)	30,635,521.45	-2,138,996.65	28,496,524.80
项 目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06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	47,304,522.29	1,217,579.90	48,522,102.19

(基金净值)			
--------	--	--	--

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

高翔

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（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%。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与上年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2018年1月1日至2018年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类 金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类 金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产和其他各类应付款项。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

本基金本报告期未发生外币交易。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，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，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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) 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
活期存款	6,328,166.65
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-

合计	6,328,166.65
----	--------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	23,822,655.72	22,183,962.18	-1,638,693.54
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	23,822,655.72	22,183,962.18	-1,638,693.54

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日

应收活期存款利息	546.59
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	47.60
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	13.10
合计	607.29

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
交易所市场应付交易费用	39,627.54
银行间市场应付交易费用	-
合计	39,627.54

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3.69
预提费用	74,383.76
合计	74,387.45

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 中信建投智信物联网A

金额单位：人民币元

项目 (中信建投智信物联网A)	本期2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	39,099,708.97	39,099,708.97
本期申购	4,842,260.84	4,842,260.84
本期赎回(以“-”号填列)	-13,333,454.39	-13,333,454.39
本期末	30,608,515.42	30,608,515.42

6.4.7.9.2 中信建投智信物联网C

金额单位：人民币元

项目 (中信建投智信物联网C)	本期2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	8,564,122.92	8,564,122.92
本期申购	24,726,890.27	24,726,890.27
本期赎回(以“-”号填列)	-33,264,007.16	-33,264,007.16
本期末	27,006.03	27,006.03

注：申购含转换入份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 中信建投智信物联网A

单位：人民币元

项目 (中信建投智信物联网A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,161,398.37	682,724.69	4,844,123.06
本期利润	-2,700,871.49	-3,561,801.96	-6,262,673.45
本期基金份额交易产生的变动数	-864,020.07	144,349.91	-719,670.16

其中：基金申购款	426,619.22	-177,474.28	249,144.94
基金赎回款	-1,290,639.29	321,824.19	-968,815.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	596,506.81	-2,734,727.36	-2,138,220.55

6.4.7.10.2 中信建投智信物联网C

单位：人民币元

项目 (中信建投智信物联网C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,639,704.23	74,104.18	1,713,808.41
本期利润	110,544.37	634,099.20	744,643.57
本期基金份额交易产生的变动数	-1,748,238.27	-710,989.81	-2,459,228.08
其中：基金申购款	3,140,395.58	160,793.62	3,301,189.20
基金赎回款	-4,888,633.85	-871,783.43	-5,760,417.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,010.33	-2,786.43	-776.10

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日
活期存款利息收入	13,710.52
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,104.72
其他	323.46
合计	15,138.70

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期

	2018年01月01日至2018年06月30日
卖出股票成交总额	88,991,714.32
减：卖出股票成本总额	91,280,260.37
买卖股票差价收入	-2,288,546.05

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	688.98
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	688.98

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	71,912.39
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	71,200.00
减：应收利息总额	23.41
买卖债券差价收入	688.98

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
股票投资产生的股利收益	55,910.98
基金投资产生的股利收益	-
合计	55,910.98

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
1. 交易性金融资产	-2,927,702.76
——股票投资	-2,929,205.08
——债券投资	1,502.32
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-

合计	-2,927,702.76
----	---------------

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
基金赎回费收入	225,826.94
其他	16.95
合计	225,843.89

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
交易所市场交易费用	196,634.69
银行间市场交易费用	-
合计	196,634.69

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	49,588.57
汇划手续费	2,845.48
帐户维护费	18,600.00
合计	95,829.24

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本报告报出日，本基金无需说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

本基金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。

6.4.9.2 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
中信银行股份有限公司	基金托管人、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
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
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
江苏省广传广播传媒有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06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	41,624,794.16	25.29%	127,827,629.93	78.84%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
中信建投 证券股份 有限公司	71,912.39	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	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 债券回 购成交 总额的 比例
中信建投 证券股份 有限公司	-	-	210,700,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日			
	当期佣金	占当期	期末应付佣金余额	占期末应

		佣金总量的比例		付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	22,115.04	23.77%	2,318.99	5.85%
关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06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	67,914.76	78.17%	11,152.04	37.02%

注：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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	267,184.90	455,180.49
其中：支付销售机构的客户维护费	142,557.03	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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018 年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	35,624.65	60,690.75

注：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。

6.4.10.2.3 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 2018年01月01日至2018年06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	-	23.77	23.77
中信银行 股份有限 公司	-	4,065.84	4,065.84
合计	-	4,089.61	4,089.61
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06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

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》，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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 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

无。

6.4.10.5 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 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06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	6,328,166.65	13,710.52	18,103,116.60	33,289.78

注：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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金本报告期未实施利润分配。

6.4.12 期末（2018年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司风险控制与合规委员会、督察长、公司风险管理委员会、稽控合规部以及各个业务部门组成。公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与合规委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由稽控合规部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性

分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可接受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中信银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

报告期末，本基金未持有短期信用评级的债券投资（上年度末：同）。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

报告期末，本基金未持有短期信用评级的资产支持证券投资（上年度末：同）。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

报告期末，本基金未持有短期信用评级的同业存单投资（上年度末：同）。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	69,697.68
未评级	-	-
合计	-	69,697.68

注：报告期末，本基金未持有长期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

报告期末，本基金未持有长期信用评级的资产支持证券投资（上年度末：同）。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

报告期末，本基金未持有长期信用评级的同业存单投资（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2018年6月30日，本基金所承担的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自2017年10月1日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投

资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产如下表所示：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年06 月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	6,328,166.65	-	-	-	6,328,166.65
结算备付金	105,849.65	-	-	-	105,849.65
存出保证金	28,912.09	-	-	-	28,912.09
交易性金融资产	-	-	-	22,183,962.18	22,183,962.18
应收利息	-	-	-	607.29	607.29
应收申购款	-	-	-	6,488.03	6,488.03
资产总计	6,462,928.39	-	-	22,191,057.50	28,653,985.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,939.88	2,939.88
应付管理人报酬	-	-	-	35,731.24	35,731.24
应付托管费	-	-	-	4,764.14	4,764.14
应付销售服务费	-	-	-	10.84	10.84
应付交易费用	-	-	-	39,627.54	39,627.54
其他负债	-	-	-	74,387.45	74,387.45
负债总计	-	-	-	157,461.09	157,461.09
利率敏感度缺口	6,462,928.39	-	-	22,033,596.41	28,496,524.80
上年度末 2017年12 月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	17,392,127.58	-	-	-	17,392,127.58
结算备付金	195,027.58	-	-	-	195,027.58
存出保证金	44,778.75	-	-	-	44,778.75
交易性金融资产	-	-	69,697.68	40,807,470.00	40,877,167.68

应收利息	-	-	-	1,330.65	1,330.65
应收申购款	-	-	-	10,970.24	10,970.24
资产总计	17,631,933.91	-	69,697.68	40,819,770.89	58,521,402.48
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,965,232.34	3,965,232.34
应付赎回款	-	-	-	72,206.95	72,206.95
应付管理人报酬	-	-	-	57,771.64	57,771.64
应付托管费	-	-	-	7,702.89	7,702.89
应付销售服务费	-	-	-	384.52	384.52
应付交易费用	-	-	-	46,240.95	46,240.95
其他负债	-	-	-	150,099.83	150,099.83
负债总计	-	-	-	4,299,639.12	4,299,639.12
利率敏感度缺口	17,631,933.91	-	69,697.68	36,520,131.77	54,221,763.36

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2018年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2017年12月31日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.13%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上

市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	22,183,962.18	77.85	40,807,470.00	75.26
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	22,183,962.18	77.85	40,807,470.00	75.26

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
	业绩比较基准上升5%	1,894,564.37	3,388,633.21
	业绩比较基准下降5%	-1,894,564.37	-3,388,633.21

6.4.14 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2018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22,183,962.18元，无属于第二、三层次的余额（2017年12月31日：属于第一层次的余额为40,478,767.68元，属于第二层次的余额为398,400.00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2018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。

(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10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。

(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	22,183,962.18	77.42
	其中：股票	22,183,962.18	77.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	6,434,016.30	22.45

8	其他各项资产	36,007.41	0.13
9	合计	28,653,985.89	100.00

7.2 报告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

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	13,660,380.00	47.94
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,523,582.18	29.91
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	22,183,962.18	77.85

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所有股票投资明细

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002202	金风科技	190,000	2,401,600.00	8.43
2	300373	扬杰科技	62,000	1,773,200.00	6.22
3	002138	顺络电子	110,000	1,761,100.00	6.18
4	002180	纳思达	60,000	1,647,600.00	5.78
5	002384	东山精密	54,000	1,296,000.00	4.55
6	002410	广联达	45,000	1,247,850.00	4.38
7	002456	欧菲科技	70,000	1,129,100.00	3.96
8	300567	精测电子	14,000	1,114,400.00	3.91
9	300369	绿盟科技	103,500	1,107,450.00	3.89
10	002475	立讯精密	45,000	1,014,300.00	3.56
11	300098	高新兴	119,791	955,932.18	3.35
12	300188	美亚柏科	50,000	915,000.00	3.21
13	002368	太极股份	30,000	872,100.00	3.06
14	002439	启明星辰	40,000	848,800.00	2.98
15	600570	恒生电子	15,000	794,250.00	2.79
16	300458	全志科技	42,000	752,640.00	2.64
17	002153	石基信息	25,000	725,000.00	2.54
18	300166	东方国信	40,000	589,200.00	2.07
19	000977	浪潮信息	20,000	477,000.00	1.67
20	300047	天源迪科	30,000	468,000.00	1.64
21	300003	乐普医疗	8,000	293,440.00	1.03

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	300373	扬杰科技	2,658,708.00	4.90

2	603993	洛阳钼业	2,544,500.00	4.69
3	002475	立讯精密	2,189,593.00	4.04
4	600362	江西铜业	2,051,299.00	3.78
5	002202	金风科技	2,044,046.00	3.77
6	002410	广联达	1,997,858.00	3.68
7	300383	光环新网	1,959,326.52	3.61
8	000651	格力电器	1,826,490.68	3.37
9	002531	天顺风能	1,761,593.00	3.25
10	002138	顺络电子	1,694,814.00	3.13
11	002180	纳思达	1,600,673.00	2.95
12	300369	绿盟科技	1,565,136.00	2.89
13	300027	华谊兄弟	1,551,100.00	2.86
14	300458	全志科技	1,536,428.00	2.83
15	000938	紫光股份	1,534,923.60	2.83
16	002439	启明星辰	1,513,240.00	2.79
17	603799	华友钴业	1,470,556.00	2.71
18	300059	东方财富	1,358,650.00	2.51
19	300618	寒锐钴业	1,240,000.00	2.29
20	600388	龙净环保	1,127,562.50	2.08
21	300098	高新兴	1,116,239.00	2.06
22	603986	兆易创新	1,104,000.00	2.04

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	603799	华友钴业	4,588,934.00	8.46
2	603993	洛阳钼业	2,517,600.00	4.64
3	600362	江西铜业	2,391,307.00	4.41
4	603328	依顿电子	2,339,132.00	4.31
5	600031	三一重工	2,310,129.00	4.26

6	002273	水晶光电	2,061,784.14	3.80
7	002456	欧菲科技	2,038,599.00	3.76
8	600388	龙净环保	1,971,775.86	3.64
9	600584	长电科技	1,947,433.64	3.59
10	000651	格力电器	1,894,091.00	3.49
11	601636	旗滨集团	1,861,500.00	3.43
12	300383	光环新网	1,814,589.45	3.35
13	002709	天赐材料	1,636,104.00	3.02
14	000938	紫光股份	1,594,675.00	2.94
15	002531	天顺风能	1,542,273.00	2.84
16	300059	东方财富	1,517,078.43	2.80
17	300027	华谊兄弟	1,454,804.00	2.68
18	002048	宁波华翔	1,431,256.00	2.64
19	000823	超声电子	1,356,296.00	2.50
20	601799	星宇股份	1,349,523.00	2.49
21	603111	康尼机电	1,301,819.50	2.40
22	300618	寒锐钴业	1,286,675.00	2.37
23	603986	兆易创新	1,187,480.00	2.19
24	300037	新宙邦	1,167,357.00	2.15
25	000333	美的集团	1,164,392.00	2.15
26	002475	立讯精密	1,156,371.44	2.13
27	600563	法拉电子	1,140,182.46	2.10
28	002493	荣盛石化	1,128,831.00	2.08
29	600581	八一钢铁	1,109,528.00	2.05
30	002180	纳思达	1,102,914.60	2.03

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	75,585,957.63
卖出股票收入（成交）总额	88,991,714.32

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所有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	28,912.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	607.29
5	应收申购款	6,488.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,007.41

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存在流通受限的股票。

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

份额级别	持有人	户均持有	持有人结构
------	-----	------	-------

	户数 (户)	的基金份 额	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	860	35,591.30	-	-	30,608,515.42	100.00%
中信建投智信物联网C	4	6,751.51	-	-	27,006.03	100.00%
合计	863	35,498.87	-	-	30,635,521.45	100.00%

8.2 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	1,303,463.13	4.2585%
	中信建投智信物联网C	1,804.85	6.6831%
	合计	1,305,267.98	4.2606%

8.3 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	0
	中信建投智信物联网C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	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08月03日)基金份额总额	234,704,259.11	1,000.00
本报告期期初基金份额总额	39,099,708.97	8,564,122.92
本报告期基金总申购份额	4,842,260.84	24,726,890.27
减：本报告期基金总赎回份额	13,333,454.39	33,264,007.16
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	30,608,515.42	27,006.03

§ 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

报告期内无基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内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	
申万宏源证券	1	66,939,862.59	40.67%	35,565.39	38.23%	-
招商证券	1	56,013,015.20	34.03%	35,361.47	38.01%	-
中信建投证券	2	41,624,794.16	25.29%	22,115.04	23.77%	-

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： $\text{分配权重（100分）} = \text{基础服务（45%）} + \text{特别服务（45%）} + \text{销售服务（10%）}$ 。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	71,912.39	100.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信建投基金管理有限公司关于旗下开放式证券投资基金2017年年度最后一个自然日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-01-02
2	关于增加上海攀赢金融信息服务有限公司为中信建投基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-01-18
3	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4季度报告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-01-20
4	中信建投基金管理有限公司关于临时调整旗下基金所持有的部分停牌股票估值方法	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-02-07

	的公告		
5	中信建投基金管理有限公司关于旗下基金通过上海利得基金销售有限公司参与定投业务的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-02-07
6	中信建投基金管理有限公司关于临时调整旗下基金持有的部分停牌股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-02-08
7	中信建投基金管理有限公司关于临时调整旗下基金持有的部分停牌股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-03-02
8	中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金增加招商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-03-09
9	中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金增加招商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-03-12
10	中信建投基金管理有限公司增加宜信普泽投资顾问（北京）有限公司为多只基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-03-15
11	中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2018年第1号）及摘要	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-03-20
12	关于中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同及托管协议的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-03-23
13	中信建投智信物联网灵活配	管理人网站	2018-03-23

	置混合型证券投资基金基金合同		
14	中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金托管协议	管理人网站	2018-03-23
15	中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金2017年年度报告及摘要	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-03-30
16	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信银行股份有限公司开通定投业务的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-04-09
17	中信建投基金管理有限公司关于临时调整旗下基金所持有的部分停牌股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-04-21
18	中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金2018年第1季度报告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-04-23
19	中信建投基金管理有限公司关于调整旗下基金所持有的“中兴通讯”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-04-24
20	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金开通网上直销平台定投业务及开展定投费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-05-28
21	中信建投基金管理有限公司关于调整旗下基金所持有的“中兴通讯”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-06-14
22	中信建投基金增加南京苏宁基金销售有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-06-15

23	中信建投基金管理有限公司关于临时调整旗下基金持有的部分停牌股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-06-20
24	中信建投基金管理有限公司关于调整旗下基金持有的“中兴通讯”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-06-20
25	中信建投基金管理有限公司关于临时调整旗下基金持有的部分停牌股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-06-22
26	中信建投基金管理有限公司关于旗下开放式证券投资基金2018年半年度最后一个市场交易日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2018-06-30

§ 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

基金管理人于2018年3月23日披露了《关于中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同及托管协议的公告》、《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》、《中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《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》；
- 3、《中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司

二〇一八年八月二十八日