

**中信建投智信物联网灵活配置
混合型证券投资基金更新招募说明书
（更新）摘要**

2017 年第【1】号

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

二〇一七年三月

重要提示

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”）募集申请已于 2015 年 8 月 5 日获得中国证监会证监许可(2015)1900 号文注册。并于 2016 年 3 月 31 日获得中国证监会证券基金机构监管部关于中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函（机构部函[2016]673 号），核准延长募集。本基金合同于 2016 年 8 月 3 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的管理风险，本基金的特定风险等。

本基金为灵活配置混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高预期风险和中高预期收益产品。本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金存在大类资产配置风险，有可能受到经济周期、市场环境或管理人对市场所处的经济周期和产业周期的判断不足等因素的影响，导致基金的大类资产配置比例偏离最优化水平，给基金投资组合的绩效带来风险。

本基金可投资中小企业私募债券，当基金所投资的中小企业私募债券之债务

人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降等，可能造成基金财产损失。此外，受市场规模及交易活跃程度的影响，中小企业私募债券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险，从而对基金收益造成影响。

投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本招募说明书、基金合同等信息披露文件，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2017 年 2 月 3 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 12 月 31 日，财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：中信建投基金管理有限公司

住所：北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街 2 号凯恒中心 B 座 19 层

邮政编码：100010

法定代表人：蒋月勤

成立日期：2013 年 9 月 9 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监许可〔2013〕1108 号

经营范围：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。

组织形式：有限责任公司

注册资本：30000 万元

联系人：杨露露

电话：010-59100288

存续期间：永久存续

股权结构：中信建投证券股份有限公司占 55%、航天科技财务有限责任公司占 25%、江苏广传广播传媒有限公司占 20%。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

蒋月勤先生，董事长，成都电子科技大学硕士研究生学历。曾任职中信证券交易部总经理、长盛基金管理有限公司总经理，现任中信建投证券股份有限公司党委委员、执委会委员、董事总经理，兼任中信建投基金管理有限公司董事长。

张杰女士，副董事长、总经理，首都师范大学本科学历。曾任中信建投证券股份有限公司经纪业务管理部行政负责人，现任中信建投基金管理有限公司副董事长、总经理。

陈瑛女士，董事，北京师范大学硕士研究生学历。曾任航天一院 211 厂总会计师、航天一院财务部副部长、航天一院发射技术及特种车事业部总会计师、航

天投资控股有限公司财务总监，现任航天科技财务有限责任公司财务总监、中信建投基金管理有限公司董事。

周艳丽女士，董事，南京大学硕士研究生学历。曾任江苏省广播电视总台（集团）财务资产部财务主管、科长、主任助理、副主任。现任江苏省广播电视总台（集团）财务资产部副主任（主持工作）、中信建投基金管理有限公司董事。

袁野先生，职工董事，德国特里尔大学硕士研究生学历。曾任德国 HVB 银行卢森堡分行产品经理、中信建投证券股份有限公司资产管理部总监、中信建投基金管理有限公司总经理，现任中信建投基金管理有限公司常务副总经理、职工董事，兼任元达信资本管理（北京）有限公司执行董事。

杜宝成先生，独立董事，北京大学法律系硕士研究生学历。曾任北京市律师协会职员，中国侨联华联律师事务所律师，北京市融商律师事务所高级合伙人、律师，现任北京市融商律师事务所主任、中信建投基金管理有限公司独立董事。

王汀汀先生，独立董事，北京大学博士研究生学历。现任中央财经大学副教授、中信建投基金管理有限公司独立董事。

王宏利女士，独立董事，北京师范大学硕士研究生学历。曾任北京瑞达会计师事务所部门副经理，北京中洲光华会计师事务所高级经理，天健正信会计师事务所合伙人兼事务所人力资源委员会委员兼北京所管理委员会委员，大华会计师事务所合伙人兼事务所人力资源和薪酬考核委员会委员，现任大华会计师事务所合伙人兼战略发展和市场管理委员会委员、中信建投基金管理有限公司独立董事。

王禹媚女士，独立董事，北京大学硕士研究生学历。曾任申银万国证券家电行业分析师、安信证券传媒行业分析师、中国国际金融有限公司研究部执行总经理、华泰证券股份有限公司研究所董事总经理，现任华泰联合证券董事总经理、成长企业融资部负责人员、中信建投基金管理有限公司独立董事。

2、监事会成员

孔萍女士，监事会主席，中国人民大学硕士研究生学历。曾任中国工商银行财务处副科长，华夏证券股份有限公司财务、稽核、清算部部门总经理，现任中信建投证券股份有限公司运营管理部行政负责人、中信建投基金管理有限公司监事会主席。

许会芳女士，监事，中国人民银行研究生部硕士研究生学历。曾任航天科技

财务有限责任公司风险管理与法律部副总经理，现任航天科技财务有限责任公司风险管理与法律部总经理、中信建投基金管理有限公司监事。

周琰女士，监事，南京大学硕士研究生学历。曾任江苏省广播电视总台投资管理部业务拓展科副科长，现任江苏省广播电视总台投资管理部业务拓展科科长、中信建投基金管理有限公司监事。

张全先生，职工监事，中国人民银行研究生部硕士研究生学历。曾就职于中信建投证券股份有限公司债券承销部、债券销售交易部、资本市场部，现任中信建投基金管理有限公司总经理助理、职工监事，兼任元达信资本管理（北京）有限公司总经理。

陈晨先生，职工监事，北京工业大学本科学历。曾就职于华夏证券股份有限公司信息技术部网络管理岗、中信建投证券股份有限公司信息技术部网络管理岗，现任中信建投基金管理有限公司信息技术部总监、职工监事。

王琦先生，职工监事，中国人民大学博士研究生学历。曾任大通证券股份有限公司研发中心研究员，中关村证券股份有限公司研发中心研究员，中信建投证券股份有限公司交易部总监。现任中信建投基金管理有限公司总经理助理、职工监事。

3、高级管理人员

蒋月勤先生，现任公司董事长，简历同上。

张杰女士，现任公司副董事长、总经理，简历同上。

袁野先生，现任公司常务副总经理、职工董事，简历同上。

周建萍女士，北京大学在职研究生学历。曾任航天科技财务有限责任公司投资部总经理、资产管理部总经理、交易部总经理，现任中信建投基金管理有限公司督察长，兼任元达信资本管理（北京）有限公司执行监事。

高翔先生，太原机械学院（现华北工学院）本科学历。曾任广东深圳蛇口新软件产业有限公司开发一部高级程序员，华夏证券深圳分公司电脑部副经理，鹏华基金管理有限公司信息技术部总监，大成基金管理有限公司信息技术部总监，中信建投基金管理有限公司总经理助理，现任中信建投基金管理有限公司副总经理。

4、本基金基金经理

王琦先生，简历同上。

王浩先生，中央财经大学硕士研究生学历，曾任中信建投证券股份有限公司资产管理部研究员，现任中信建投基金管理有限公司投资研究部基金经理。

5、投资决策委员会成员

袁野先生，简历同上。

王琦先生，简历同上。

王浩先生，中央财经大学硕士研究生学历。曾任中信建投证券股份有限公司资产管理部研究员，现任中信建投基金管理有限公司投资研究部基金经理。

周户先生，南开大学硕士研究生，曾任渤海证券股份有限公司研究员、广发证券股份有限公司研究员、国金证券及其下属基金公司研究员，现任中信建投基金管理有限公司投资研究部基金经理。

黄海浩女士，山东大学物流工程工程学学士。曾任利顺金融(亚洲)有限责任公司交易部 Broker、平安利顺国际货币经纪有限责任公司交易部 Broker、国投瑞银基金管理有限公司交易部债券交易员，现任中信建投基金管理有限公司投资研究部基金经理。

梁奇先生，清华大学计算机科学与技术硕士。曾任汤森路透集团软件工程师、英大基金管理有限公司系统工程师、风险控制师，现任职于中信建投基金管理有限公司稽控合规部风险管理岗。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中信银行股份有限公司（简称“中信银行”）

住所：北京市东城区朝阳门北大街9号

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街9号

法定代表人：李庆萍

成立时间：1987年4月7日

组织形式：股份有限公司

注册资本：489.35亿元人民币

存续期间：持续经营

批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2004]125 号

联系人：中信银行资产托管部

联系电话：4006800000

传真：010-85230024

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；代理开放式基金业务；办理黄金业务；黄金进出口；开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者托管业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；保险兼业代理业务（有效期至 2017 年 09 月 08 日）。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动。）

中信银行（601998.SH、0998.HK）成立于 1987 年，原名中信实业银行，是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一，是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行，并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外。伴随中国经济的快速发展，中信实业银行在中国金融市场改革的大潮中逐渐成长壮大，于 2005 年 8 月，正式更名“中信银行”。2006 年 12 月，以中国中信集团和中信国际金融控股有限公司为股东，正式成立中信银行股份有限公司。同年，成功引进战略投资者，与欧洲领先的西班牙对外银行（BBVA）建立了优势互补的战略合作关系。2007 年 4 月 27 日，中信银行在上海交易所和香港联合交易所成功同步上市。2009 年，中信银行成功收购中信国际金融控股有限公司（简称：中信国金）70.32% 股权。经过近三十年的发展，中信银行已成为国内资本实力最雄厚的商业银行之一，是一家快速增长并具有强大综合竞争力的全国性商业银行。

2009 年，中信银行通过了美国 SAS70 内部控制审订并获得无保留意见的 SAS70 审订报告，表明了独立公正第三方对中信银行托管服务运作流程的风险管理和内部控制的健全有效性全面认可。

（二）主要人员情况

孙德顺先生，中信银行执行董事、行长。孙先生自 2016 年 7 月 20 日起任本行行长。孙先生同时担任中信银行（国际）董事长。此前，孙先生于 2014 年 5 月至 2016 年 7 月任本行常务副行长；2014 年 3 月起任本行执行董事；2011 年 12 月至 2014 年 5 月任本行副行长，2011 年 10 月起任本行党委副书记；2010 年 1 月至 2011 年 10 月任交通银行北京管理部副总裁兼交通银行北京市分行党委书记、行长；2005 年 12 月至 2009 年 12 月任交通银行北京市分行党委书记、行长；1984 年 5 月至 2005 年 11 月在中国工商银行海淀区办事处、海淀区支行、北京分行、数据中心（北京）等单位工作，期间，1995 年 12 月至 2005 年 11 月任中国工商银行北京分行行长助理、副行长，1999 年 1 月至 2004 年 4 月曾兼任中国工商银行数据中心（北京）总经理；1981 年 4 月至 1984 年 5 月就职于中国人民银行。孙先生拥有三十多年的中国银行业从业经验。孙先生毕业于东北财经大学，获经济学硕士学位。

张强先生，中信银行副行长，分管托管业务。张先生自 2010 年 3 月起任本行副行长。此前，张先生于 2006 年 4 月至 2010 年 3 月任本行行长助理、党委委员，期间，2006 年 4 月至 2007 年 3 月曾兼任总行公司银行部总经理。张先生 2000 年 1 月至 2006 年 4 月任本行总行营业部副总经理、常务副总经理和总经理；1990 年 9 月至 2000 年 1 月先后在本行信贷部、济南分行和青岛分行工作，曾任总行信贷部副总经理、总经理、分行副行长和行长。自 1990 年 9 月至今，张先生一直为本行服务，在中国银行业拥有近三十年从业经历。张先生为高级经济师，先后于中南财经大学（现中南财经政法大学）、辽宁大学获得经济学学士学位、金融学硕士学位。

杨洪先生，现任中信银行资产托管部总经理，硕士研究生学历，高级经济师，教授级注册咨询师。先后毕业于四川大学和北京大学工商管理学院。曾供职于中国人民银行四川省分行、中国工商银行四川省分行。1997 年加入中信银行，相继任中信银行成都分行信贷部总经理、支行行长，总行零售银行部总经理助理兼市场营销部总经理、贵宾理财部总经理、中信银行贵阳分行党委书记、行长，总行行政管理部总经理。

（三）基金托管业务经营情况

2004 年 8 月 18 日，中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监

督管理委员会批准，取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则，切实履行托管人职责。

截至 2016 年末，中信银行已托管 119 只公开募集证券投资基金，以及证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII 等其他托管资产，托管总规模达到 6.57 万亿元人民币。

三、相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

(1) 直销中心

名称：中信建投基金管理有限公司

住所：北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室

法定代表人：蒋月勤

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街 2 号凯恒中心 B 座 19 层

传真：010-59100298

联系人：贾欣欣

客户服务电话：4009-108-108

网址：www.cfund108.com

(2) 网上直销

直销网站：www.cfund108.com

2、其他销售机构

(1) 中信银行股份有限公司

网址：bank.ecitic.com

客户服务电话：95558

(2) 中信建投证券股份有限公司

网址：www.csc108.com

客户服务电话：95587、400-8888-108

(3) 中信建投期货

网址：<http://www.cfc108.com/main/index.shtml>

客户服务电话：400-8877-780

（4）上海浦东发展银行股份有限公司

网址：<http://www.spdb.com.cn/chpage/c1/>

客户服务电话：95528

（5）中信证券股份有限公司

网址：www.cs.ecitic.com

客户服务电话：95548

（6）中信期货有限公司

网址：www.citicsf.com

客户服务电话：400-990-8826

（7）中信证券（山东）有限责任公司

网址：www.zxwt.com.cn

客户服务电话：95548

（8）交通银行

网址：<http://www.bankcomm.com/>

客户服务电话：95559

（9）北京农村商业银行

网址：<http://www.bjrcb.com/>

客户服务电话：4006696198

（10）上海天天基金销售有限公司

网址：www.1234567.com.cn

客户服务电话：4001818188

（11）一路财富

网址：www.yilucaifu.com

客户服务电话：4000011566

（12）上海陆金所资产管理有限公司

网址：www.lufunds.com

客户服务电话：4008-219-031

（13）中泰证券股份有限公司

网址：<http://www.zts.com.cn/>

客户服务电话：95538

（14）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

网址：www.fund123.cn

客户服务电话：4000-766-123

（15）浙江同花顺基金销售有限公司

网址：www.5ifund.com

客户服务电话：4008-773-772

（16）大泰金石基金销售有限公司

网址：www.dtfortune.com

客户服务电话：400-928-2266

（17）上海凯石财富基金销售有限公司

网址：www.lingxianfund.com

客户服务电话：4000-178-000

（18）珠海盈米财富管理有限公司

网址：www.yingmi.cn

客户服务电话：020-89629066

（19）北京钱景财富投资管理有限公司

网址：www.qianjing.com

客户服务电话：400-893-6885

（20）武汉市伯嘉基金销售有限公司

网址：www.buyfunds.cn

客户服务电话：400-027-9899

（21）北京汇成基金销售有限公司

网址：www.fundzone.cn

客户服务电话：400-619-9059

（22）北京恒天明泽基金销售有限公司

网址：www.chtfund.com

客户服务电话：4008980618

(23) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

网址：<http://kenterui.jd.com>

客户服务电话：400-098-8511

(24) 上海利得基金销售有限公司

网址：www.leadfund.com.cn

客户服务电话：400-921-7755

(25) 北京格上富信投资顾问有限公司

网址：www.igesafe.com

客户服务电话：400-066-8586

(26) 北京微动利投资管理有限公司

网址：www.buyforyou.com.cn

客户服务电话：400-819-6665

3、基金管理人可根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和本基金基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

(二) 登记机构

名称：中信建投基金管理有限公司

住所：北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室

法定代表人：蒋月勤

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座19层

电话：010-59100228

传真：010-59100298

联系人：陈莉君

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层

办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、陆奇

联系人：陆奇

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：张勇

经办注册会计师：许康玮、张勇

四、基金的名称

中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

混合型证券投资基金

六、基金的运作方式

契约型开放式

七、基金的投资目标

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。

八、基金的投资范围

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的

股票（包括主板、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）。

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%，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%。

九、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金采用自上而下的策略，通过对宏观经济基本面（包括经济运行周期、财政及货币政策、产业政策等）的分析判断，和对流动性水平（包括资金面供需情况、证券市场估值水平等）的深入研究，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，并据此对本基金资产在股票、债券、现金之间的投资比例进行动态调整。

2、股票投资策略

本基金将根据以下原则，在基金合同约定的投资比例范围内制定并适时调整股票配置比例及投资策略：

本基金通过对物联网相关子行业的深入分析，以及对行业内相关股票的研究挖掘，寻找物联网相关企业的投资价值。

（1）物联网主题的界定

物联网主要是指在“万物互联”的网络生态基础上，借助于通讯和网络连接等手段，实现物与物、人与物、人与人之间信息交换的智能生态系统。大体上

来说，物联网是指通过红外感应器、全球定位系统、射频识别（RFID）、激光扫描器等信息传感设备，按约定的协议，把任何物品与互联网相连接，进行信息交换和通信，以实现智能化识别、定位、跟踪、监控和管理的一种网络概念。

从物联网相关的运用角度来说，本基金所指的物联网概念主要涉及以下相关子行业：智能家居、智能医疗、智能交通、智能物流、智能电网、智能电力、智能农业、智能安防、智慧城市、智能建筑、智能水务、智能汽车、商业智能、智能工业、平安城市等。与此同时，物联网的概念本身会随着技术的进步而不断更新，基金管理人将持续跟踪相关行业的最新技术及商业模式发展，并对物联网概念具体涉及的行业进行更新和调整。

（2）相关子行业的配置

物联网相关的各个子行业众多，发展阶段各不相同，因此所面临的政策环境、技术阶段、社会认知度及资本市场的关注度等因素存在很大差异，从而导致不同时期不同子行业的表现可能存在较大差异，由此，基金适时在不同子行业之间进行资产配置的调整有利于提高总体收益，具体配置需要结合以下因素：

A、政策

本基金管理人将结合各个子行业的发展阶段，密切跟踪政府相关政策的出台及执行情况，前瞻性地重点配置于那些受益于政策或者未来可能的政策变化的相关行业。

B、技术发展阶段

物联网作为科技创新行业，技术的发展与变革可能会对物联网行业造成深远的影响，技术和工艺的创新和发展，会很大程度上影响相关子行业的发展。因此，本基金管理人将密切关注相关科学技术领域的最新进展，并重点配置于那些有技术或工艺突破的相关子行业。

C、社会认知

物联网的发展大多数是各个传统行业“智能化”、“物联网化”的过程，而社会的认知和认同对于各个子行业发展有较大影响，尤其是在政策和技术都已具备的条件下，整个社会的认知程度将成为相关行业“智能化”、“物联网化”能否成功的关键。

D、市场短期

中短期内，市场对于各个子行业的热度和追捧不尽相同，基金管理人将在分析短期宏观经济形势，市场流动性情况及市场关注度的基础上，前瞻性地配置于各个阶段预期收益率预期较高的子行业。

（3）个股选择

具体在个股选择方面，本基金所界定的符合物联网主题相关要求的上市公司分为两类：第一类是目前已经满足相关条件，被界定为物联网相关子行业成分股的上市公司；第二类则是当前仍未被界定为物联网相关子行业，但是未来与物联网相关的业务或者转型可能成为其主要利润来源的上市公司。基金管理人将对两类公司分别进行系统地分析，最终确定投资标的股票，构建投资组合。

A、第一类上市公司

对于第一类上市公司，本基金将采用定量与定性相结合的研究方法选择个股。本基金将基于公司财务指标，深入分析公司的基本面价值，选择财务和资产状况良好且盈利能力较强的公司结合相关财务模型的分析，形成对标的股票的初步判断。接下来，基金管理人投资研究人员将通过案头研究和实地调研等基本面研究方法，深入剖析影响公司未来投资价值的驱动因素，重点从市场竞争格局、盈利效率、技术升级、公司治理、短期事件等多个角度分析，挖掘公司的投资价值。

B、第二类上市公司

对于第二类上市公司，除了采用对于第一类上市公司的定量和定性分析方法外，还会重点关注该公司的业务构成指标和行业占比指标，分析公司主营业务与物联网相关业务的比例；物联网相关业务产生的利润占比；以及该公司物联网相关业务未来的成长性等。

3、债券投资策略

对于固定收益类资产的选择，本基金将以价值分析为主线，在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，并主要通过类属配置与债券选择两个层次进行投资管理。在类属配置层次，结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。在券种选择上，本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，重点选择那些流动性较好、风险水平合理、

到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。

4、中小企业私募债券投资策略

本基金将在严格控制信用风险的基础上，通过严密的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资于私募债券。本基金依靠内部信用评级，以深入的企业基本面分析为基础，结合定性和定量方法，注重对企业未来偿债能力的分析评估，并及时跟踪其信用风险的变化。

在综合考虑债券信用资质、债券收益率和期限的前提下，重点选择资质较好、收益率较好、期限匹配的中小企业私募债券进行投资。

5、股指期货投资策略

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，旨在通过股指期货实现基金的套期保值。

6、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，立足于无风险套利，尽量减少组合净值波动率，力求稳健的超额收益。

7、资产支持证券投资策略

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

十、基金的业绩比较标准

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%。

本基金选择沪深 300 指数和中债综合指数分别做为基金股票资产和债券、货币市场工具等其他资产的业绩比较基准。沪深 300 指数能够反映沪深市场的整体表现。中债综合指数的选样债券的信用类别覆盖全面，期限构成宽泛。选用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

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

十一、基金的风险收益特征

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。

十二、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本投资组合报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2017 年 1 月复核了本投资组合报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 12 月 31 日（摘自本基金 2016 年第 4 季度报告），本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	9,229,920.00	11.91
	其中：股票	9,229,920.00	11.91
2	固定收益投资	10,063,000.00	12.98
	其中：债券	10,063,000.00	12.98
	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	54,800,404.70	70.69
	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	3,124,651.26	4.03
7	其他各项资产	308,451.91	0.40

8	合计	77,526,427.87	100.00
---	----	---------------	--------

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,048,600.00	9.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,000,320.00	1.30
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	-	-
J	金融业	1,181,000.00	1.53
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	9,229,920.00	11.97

(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港股通股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明

细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000059	华锦股份	150,000	1,785,000.00	2.31
2	000063	中兴通讯	100,000	1,595,000.00	2.07
3	000777	中核科技	70,000	1,566,600.00	2.03

4	000066	长城电脑	100,000	1,244,000.00	1.61
5	600816	安信信托	50,000	1,181,000.00	1.53
6	600452	涪陵电力	24,000	1,000,320.00	1.30
7	000725	京东方A	300,000	858,000.00	1.11

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,063,000.00	13.05
	其中：政策性金融债	10,063,000.00	13.05
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,063,000.00	13.05

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明

细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	140216	14 国开 16	100,000	10,063,000.00	13.05

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资股指期货。

11、投资组合报告附注

(1) 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	22,263.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	286,188.66
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	308,451.91

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十三、基金的业绩

基金业绩截止日为 2016 年 12 月 31 日。

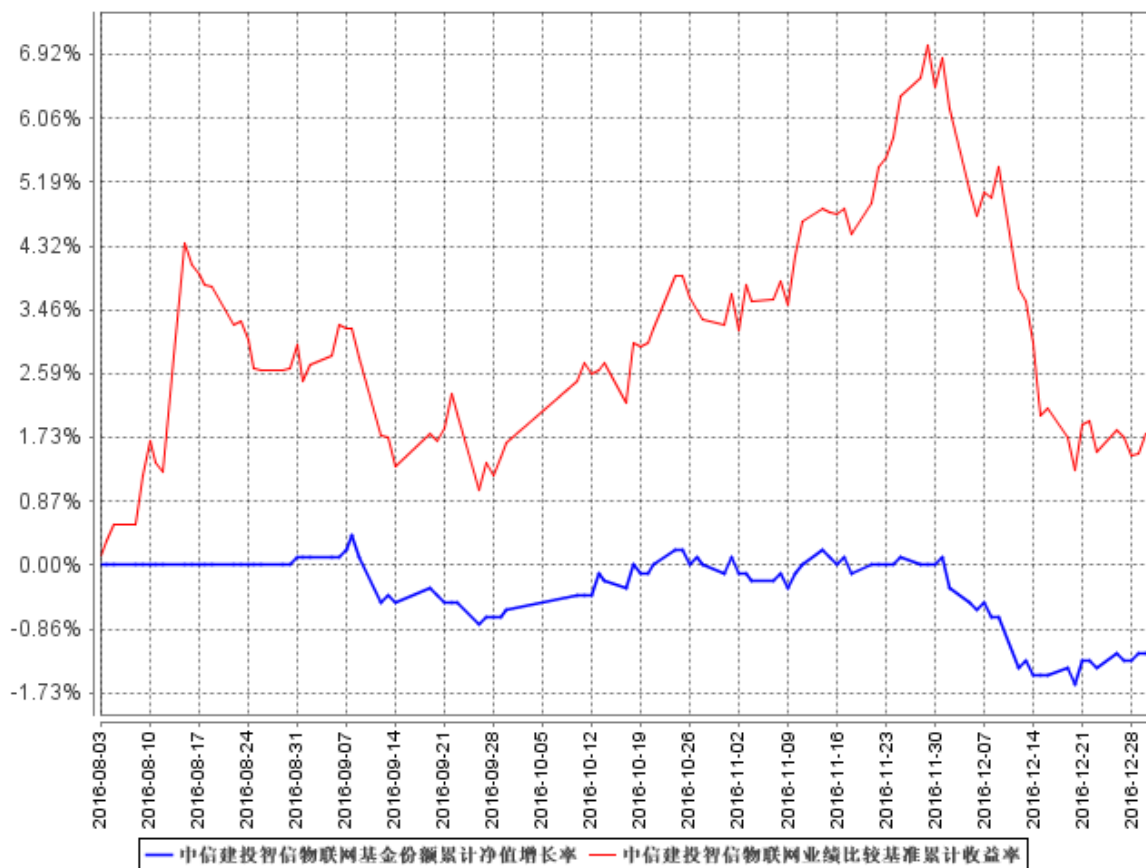
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差 ②	业绩比 较基准 收益率 ③	业绩比 较基准 收益 率标准 差 ④	①—③	②—④
过去三个月	-0.60%	0.17%	0.13%	0.45%	-0.73%	-0.28%

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

中信建投智信物联网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、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，截至报告期末，本基金尚处于建仓期内。

十四、基金的费用和税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用、账户维护费用；
- 8、基金的账户开户费用；

9、因投资港股通标的股票而产生的各项费用；

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 3—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本更新的招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对首次公布的《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》进行了更新，本更新招募说明书主要更新的内容如下：

1. 更新了“第三部分 基金管理人”的“主要人员情况”的相关内容。
2. 更新了“第四部分 基金托管人”的相关内容。
3. 更新了“第五部分 相关服务机构”的相关内容。
4. 更新了“第六部分 基金的募集”的相关内容。
5. 更新了“第七部分 基金合同的生效”的相关内容。
6. 更新了“第九部分 基金的投资”的“基金的投资组合报告”的相关内容。
7. 新增了“第十部分 基金的业绩”的相关内容。
8. 新增了“第二十二部分 其他应披露事项”的相关内容，列示了本基金自首次披露招募说明书以来的临时公告和定期报告事项。

中信建投基金管理有限公司

二〇一七年三月