

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

2017 年 12 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

送出日期:2018 年 03 月 30 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 3 月 26 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。

本报告中财务资料经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
8.3 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	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
8.6 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	58
8.7 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	58
8.8 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	58
8.9 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	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
8.12 投资组合报告附注.....	58
§9 基金份额持有人信息.....	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
9.3 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.....	60
§10 开放式基金份额变动.....	61
§11 重大事件揭示.....	61
11.1 基金份额持有人大会决议.....	61
11.2 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.....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
11.4 基金投资策略的改变.....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
11.8 其他重大事件.....	63
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
12.1 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.....	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
§13 备查文件目录.....	69
13.1 备查文件目录.....	69
13.2 存放地点.....	69
13.3 查阅方式.....	69

§ 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	47,663,831.89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	39,099,708.97份	8,564,122.92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
	联系电话	010-55760122
	电子邮箱	zhanglj@csc.com.cn
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	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金年度报告备置地点	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
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
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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2017年		2016年8月3日（基金合同生效日）-2016年12月31日	
	中信建投智信物联网A	中信建投智信物联网C	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	3,407,556.48	1,065,332.65	-590,186.47	-
本期利润	5,219,324.82	789,520.24	-837,133.18	-
加权平均基金份额本期利润	0.1077	0.2413	-0.0065	-
本期加权平均净值利润率	10.38%	21.00%	-0.65%	-
本期基金份额净值增长率	13.76%	20.01%	-1.20%	-
3.1.2 期末数据和指标	2017年末		2016年末	
期末可供分配利润	4,161,398.37	1,639,704.23	-926,483.91	-
期末可供分配基金份额利润	0.1064	0.1915	-0.0119	-
期末基金资产净值	43,943,832.03	10,277,931.33	77,107,447.35	-
期末基金份额净值	1.1239	1.2001	0.9880	-
3.1.3 累计期末指标	2017年末		2016年末	
基金份额累计净值增长率	12.39%	20.01%	-1.20%	-

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2016年8月3日起生效，无上年可比期间为2016年8月3日至2016年12月31日。

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
过去三个月	-0.89%	1.26%	2.58%	0.48%	-3.47%	0.78%
过去六个月	9.54%	1.09%	5.37%	0.42%	4.17%	0.66%
过去一年	13.76%	0.86%	11.14%	0.39%	2.62%	0.47%
自基金合同生效起至今	12.39%	0.73%	12.78%	0.41%	-0.39%	0.32%

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

过去三个月	3.40%	1.42%	2.58%	0.48%	0.82%	0.94%
过去六个月	14.30%	1.17%	5.37%	0.42%	8.93%	0.75%
自基金合同生效起至今	20.01%	1.12%	8.86%	0.42%	11.15%	0.70%

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-2017年12月31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-2017年12月31日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同自 2016 年 8 月 3 日起生效。基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



注：中信建投智信物联网 C 基金份额的首笔份额登记日为 2017 年 6 月 7 日。基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自成立以来未实施利润分配。

§ 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4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、保险公司、财务公司、私募基金等；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、市值管理基金、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和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 2016-2017 年连续两年获得怀柔区“年度经济发展贡献奖”。同时，公司在固定收益等专业领域业绩卓著，荣获全国银行间同业拆借中心“2017 年度银行间本币市场交易 300 强”、中央国债登记结算有限责任公司“2017 年度中债优秀成员”、深圳证券交易所“2017 年度优秀债券交易商”、上海证券交易所“2016 年度优秀债券交易商”、“2017 年度优秀债券交易商”、中金所“2014 年度国债期货优秀市场拓展团队”、“2015 年度国债期货优秀市场拓展团队”荣誉称号。

2018 年，公司将努力提升投研实力，加快产品创新，加大与机构客户合作，增强核心竞争力，实现管理规模平稳增长，将公司打造成为国内有特色的基金管理公司。

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	-	7 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	2017-05-	-	7 年	中国籍，1983 年 7 月生，大连理

	基金经理	27			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。
王琦	公司总经理助理、投资研究部负责人	2016-08-03	2017-09-13	16年	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，现任中信建投睿利灵活配置混合型发起式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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《中信建投基金管理有限公司公平交易管理办法》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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年我国宏观经济在质疑中走进新时代，一方面实体产业继续进行供给侧改革和发展新经济，另一方面金融行业开展去杠杆，导致一些落后的、环保不达标的、负债不健康的中小企业退出，而规模以上中大型企业盈利能力持续好转，结合市场无风险利率上升，整体市场投资偏向龙头白马，风格偏向上证50为代表的蓝筹。

操作方面，本基金作为主题基金，主题内股票多为成长股，本基金恪守合同约定，

抓住了在消费电子和新能源汽车板块景气阶段的投资机会，此外也参与了部分周期股的行情。

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1.1239元;本报告期内,基金份额净值增长率为13.76%,同期业绩比较基准收益率为11.14%;截至报告期末中信建投智信物联网C基金份额净值为1.2001元;本报告期内,基金份额净值增长率为20.01%,同期业绩比较基准收益率为8.86%。

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2018年,因为处于经济发展转型阶段和金融去杠杆持续效应影响,房地产投资和基建投资增速都有可能下滑,但源于规模以上企业资产负债表修复和海外经济持续转好,制造业投资和出口有望托底经济。美国加息进程将对全球市场影响较大,同时需要关注国内无风险利率进一步上升的可能。

市场角度来看,低估值的蓝筹白马在2017年涨幅较大,缩小了板块之间以及大小市值个股之间的估值差异,但短期看市场投资风格并不会发生逆转,投资机会仍将存在于估值相对低的绩优白马龙头之间,待中小创板块风险释放完毕以及业绩增速得到确认之后,其投资机会也可能到来。操作方面,本基金将继续恪守合同约定,主要择机配置优质成长股,加强风险控制,在可能的震荡市中寻找结构性和个股行情。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,基金管理人结合法律法规和业务发展的需要,进一步修订、完善了公司内部制度;组织多项合规培训,加强员工的风险意识和合规意识;针对投资研究等重点业务,加大检查力度,促进公司业务合法合规、稳健经营;积极参与新产品、新业务的设计,提出合规建议,对基金的宣传推介、基金投资交易等方面积极开展各项合规管理工作,有效防范风险,规避违规行为的发生。

本报告期内,本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心,坚持基金份额持有人利益优先的原则,提高监察稽核工作的科学性和有效性,切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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审查，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。

4.8 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。

4.9 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2017年6月26日至2017年9月8日连续57个工作日、自2017年10月12日起至2017年12月27日连续55个工作日资产净值低于5000万元，截止本报告期末上述情形已消除。

§ 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 年度的投资运作，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 2017 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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 20300号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金 全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了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

	<p>“中信建投智信物联网基金”)的财务报表,包括2017年12月31日的资产负债表,2017年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了中信建投智信物联网基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中信建投智信物联网基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>无。</p>
<p>其他事项</p>	<p>无。</p>
<p>其他信息</p>	<p>无。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>中信建投智信物联网基金的基金管理人中信建投基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估中信建投智信物联网基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算中信建</p>

	<p>投智信物联网基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督中信建投智信物联网基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对中信建投智信物联网基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致中信建投智信物联网基金不能持续经营。（五）</p>

	评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	许康玮、张勇
会计师事务所的地址	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
审计报告日期	2018-03-26

§ 7 年度财务报表

7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	17,392,127.58	2,993,024.10
结算备付金		195,027.58	131,627.16
存出保证金		44,778.75	22,263.25
交易性金融资产	7.4.7.2	40,877,167.68	19,292,920.00
其中：股票投资		40,807,470.00	9,229,920.00
基金投资		-	-
债券投资		69,697.68	10,063,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	54,800,404.70

应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,330.65	286,188.66
应收股利		-	-
应收申购款		10,970.24	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		58,521,402.48	77,526,427.87
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31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	7.4.7.3	-	-
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		72,206.95	11,671.47
应付管理人报酬		57,771.64	100,602.37
应付托管费		7,702.89	13,413.68
应付销售服务费		384.52	-
应付交易费用	7.4.7.7	46,240.95	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	7.4.7.8	150,099.83	250,029.32
负债合计		4,299,639.12	418,980.52
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	47,663,831.89	78,033,931.26
未分配利润	7.4.7.1 0	6,557,931.47	-926,483.91
所有者权益合计		54,221,763.36	77,107,447.35

负债和所有者权益总计		58,521,402.48	77,526,427.87
------------	--	---------------	---------------

注：报告截止日2017年12月31日，基金份额总额47,663,831.89份。其中A类基金份额净值1.1239元，基金份额总额39,099,708.97份；C类基金份额净值1.2001元，基金份额总额8,564,122.92份。

7.2 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01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年08月03日（基金合同生效日）至2016年12月31日
一、收入		7,494,747.17	408,496.70
1. 利息收入		325,281.05	1,365,132.65
其中：存款利息收入	7.4.7.1 1	56,010.33	402,658.57
债券利息收入		53,034.77	135,616.44
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		216,235.95	826,857.64
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,505,030.59	-1,280,197.61
其中：股票投资收益	7.4.7.1 2	5,430,865.28	-1,290,997.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.1 3	-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	7.4.7.1 4	-	-
股利收益	7.4.7.1 5	187,355.31	10,800.00
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.1 6	1,535,955.93	-246,946.71
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.1 7	128,479.60	570,508.37
减：二、费用		1,485,902.11	1,245,629.88
1. 管理人报酬	7.4.10. 2.1	796,466.77	783,576.91
2. 托管费	7.4.10. 2.2	106,195.56	104,476.95
3. 销售服务费	7.4.10. 2.3	9,852.84	-
4. 交易费用	7.4.7.1 8	368,951.76	98,048.92
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.1 9	204,435.18	259,527.10
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		6,008,845.06	-837,133.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		6,008,845.06	-837,133.18

7.3 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01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年01月01日至2017年12月31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)	-	6,008,845.06	6,008,845.06
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)	-30,370,099.37	1,475,570.32	-28,894,529.05
其中：1. 基金申购款	60,733,946.96	9,354,015.62	70,087,962.58
2. 基金赎回款	-91,104,046.33	-7,878,445.30	-98,982,491.63
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)	47,663,831.89	6,557,931.47	54,221,763.36
项 目	上年度可比期间 2016年08月03日(基金合同生效日)至2016年12月31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)	234,704,259.11	-	234,704,259.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-837,133.18	-837,133.18
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)	-156,670,327.85	-89,350.73	-156,759,678.58

其中：1. 基金申购款	500,202.00	-1,138.72	499,063.28
2. 基金赎回款	-157,170,529.85	-88,212.01	-157,258,741.86
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）	78,033,931.26	-926,483.91	77,107,447.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 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，本基金增加C类基金份额类别，本基金的原有基金份额全部自动划归为本基金A类基金份额。增加基金份额类别后，本基金分设A类、C类两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。本基金根据申购费、销售服务费等收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中：在投资者申购时收取申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基

金份额，称为A类基金份额。从本类别基金资产中计提销售服务费而在投资者申购时不收取申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为C类基金份额。

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×60%+中债综合指数收益率×40%。

7.4.2 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7.4.4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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年度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2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。比较财务报表的实际编制期间为2016年8月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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认列。上述申购包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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

损益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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一基金份额类别内的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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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[2017]13号《中国证监会关于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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 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)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的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所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
活期存款	17,392,127.58	2,993,024.10
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计	17,392,127.58	2,993,024.10

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2017年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		39,516,958.46	40,807,470.00	1,290,511.54
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	71,200.00	69,697.68	-1,502.32
	银行间市场	-	-	-
	合计	71,200.00	69,697.68	-1,502.32
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		39,588,158.46	40,877,167.68	1,289,009.22
项目		上年度末2016年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		9,373,836.71	9,229,920.00	-143,916.71
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	10,166,030.00	10,063,000.00	-103,030.00
	合计	10,166,030.00	10,063,000.00	-103,030.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		19,539,866.71	19,292,920.00	-246,946.71

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	25,000,000.00	-
银行间市场	29,800,404.70	-
合计	54,800,404.70	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	1,190.78	519.23
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	96.58	65.12
应收债券利息	21.07	233,013.70
应收买入返售证券利息	-	52,579.61
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	22.22	11.00
合计	1,330.65	286,188.66

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	46,240.95	33,758.12
银行间市场应付交易费用	-	9,505.56
合计	46,240.95	43,263.68

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	99.83	29.32
预提费用	150,000.00	250,000.00
合计	150,099.83	250,029.32

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 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2017年01月01日至2017年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	78,033,931.26	78,033,931.26
本期申购	28,637,399.14	28,637,399.14
本期赎回(以“-”号填列)	-67,571,621.43	-67,571,621.43
本期末	39,099,708.97	39,099,708.97

7.4.7.9.2 中信建投智信物联网C

金额单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日至2017年12月31日

(中信建投智信物联网C)	基金份额(份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	32,096,547.82	32,096,547.82
本期赎回(以“-”号填列)	-23,532,424.90	-23,532,424.90
本期末	8,564,122.92	8,564,122.92

注：1. 申购含转换入份额。

2. 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15日起，本基金增加C类基金份额类别。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 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	-654,394.71	-272,089.20	-926,483.91
本期利润	3,407,556.48	1,811,768.34	5,219,324.82
本期基金份额交易产生的变动数	1,408,236.60	-856,954.45	551,282.15
其中：基金申购款	2,560,085.12	1,925,877.32	4,485,962.44
基金赎回款	-1,151,848.52	-2,782,831.77	-3,934,680.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,161,398.37	682,724.69	4,844,123.06

7.4.7.10.2 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	-	-	-
本期利润	1,065,332.65	-275,812.41	789,520.24

本期基金份额交易产生的变动数	574,371.58	349,916.59	924,288.17
其中：基金申购款	3,091,379.78	1,776,673.40	4,868,053.18
基金赎回款	-2,517,008.20	-1,426,756.81	-3,943,765.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,639,704.23	74,104.18	1,713,808.41

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间2016年08月03日（基金合同生效日）至2016年12月31日
活期存款利息收入	51,232.40	16,255.45
定期存款利息收入	-	380,000.00
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	4,123.54	6,345.29
其他	654.39	57.83
合计	56,010.33	402,658.57

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年08月03日（基金合同生效日）至2016年12月31日
卖出股票成交总额	154,208,303.45	40,741,619.17
减：卖出股票成本总额	148,777,438.17	42,032,616.78
买卖股票差价收入	5,430,865.28	-1,290,997.61

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2	上年度可比期间 2016年08月03日（基金合同生效
----	---------------------	-------------------------------

	017年12月31日	日)至2016年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	10,338,867.40	-
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	10,166,030.00	-
减:应收利息总额	286,027.40	-
买卖债券差价收入	-113,190.00	-

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2017年01月01日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年08月03日(基金合同生效 日)至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	187,355.31	10,800.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	187,355.31	10,800.00

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2017年01月01日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年08月03日(基金合同生效 日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	1,535,955.93	-246,946.71
——股票投资	1,434,428.25	-143,916.71
——债券投资	101,527.68	-103,030.00
——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	-	-
合计	1,535,955.93	-246,946.71

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年08月03日（基金合同生效 日）至2016年12月31日
基金赎回费收入	128,479.60	570,508.37
合计	128,479.60	570,508.37

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年08月03日（基金合同生效 日）至2016年12月31日
交易所市场交易费用	368,776.76	97,873.92
银行间市场交易费用	175.00	175.00
合计	368,951.76	98,048.92

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年08月03日（基金合同生效 日）至2016年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	110,000.00	200,000.00
银行划款费	6,835.18	8,027.10
帐户维护费	37,600.00	1,500.00
其他费用	-	-

合计	204,435.18	259,527.10
----	------------	------------

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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（“中信银行”）	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

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017 年12月31日		上年度可比期间 2016年08月03日（基金合同 生效日）至2016年12月31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	136,64 2,683.8 5	41.02%	92,148,0 72.66	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017年12月31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	72,598.17	39.24%	4,683.41	10.13%
关联方名称	上年度可比期间 2016年08月03日至2016年12月31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	48,958.47	100.00%	33,758.12	100.00%

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。

7.4.10.1.4 债券交易

无。

7.4.10.1.5 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017 年12月31日		上年度可比期间 2016年08月03日（基金合同 生效日）至2016年12月31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	210,70	100.00%	1,307,90	100.00%

	0,000.00		0,000.00	
	0			

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日 至2017年12月31 日	上年度可比期间 2016年08月03日（基金合同 生效日）至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	796,466.77	783,576.91
其中：支付销售机构的客户维护费	459,786.74	383,743.03

注：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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日 至2017年12月31 日	上年度可比期间 2016年08月03日（基金合同生 效日）至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	106,195.56	104,476.95

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。

7.4.10.2.3 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 2017年01月01日至2017年12月31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	中信建投智信物联网	合计

	A	C	
中信建投基金管理有限公司	-	19.00	19.00
中信建投证券股份有限公司	-	9,509.78	9,509.78
合计	-	9,528.78	9,528.78

注：1. 根据《中信建投基金关于旗下部分开放式基金C类份额增加代销机构的公告》，自2017年5月15日起，本基金增加C类基金份额类别。

2. 支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给 中信建投基金管理有限公司，再由 中信建投基金管理有限公司 计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

C类基金日销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 2017年01月01日至20 17年12月31日		上年度可比期间 2016年08月03日（基金合同生效日） 至2016年12月31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	17,392,127.58	51,232.40	2,993,024.10	16,255.45

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

无。

7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 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
601600	中国铝业	2017-09-12	重大事项停牌	6.64	2018-02-26	7.28	60,000	404,400.00	398,400.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有按短期信用评级的债券投资 (2016 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.2.2 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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	69,697.68	-
未评级	-	-
合计	69,697.68	-

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.3 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上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2017年12月31日，除附注7.4.12中列示的卖出回购金融资产款余额将在1个月内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同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。

7.4.13.3.1 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公司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 7.4.12。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。于 2017 年 12 月 31 日，除附注 7.4.12 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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：

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末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
上年度末2016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	2,993,024.10	-	-	-	2,993,024.10
结算备付金	131,627.16	-	-	-	131,627.16
存出保证金	22,263.25	-	-	-	22,263.25
交易性金融资产	10,063,000.00	-	-	9,229,920.00	19,292,920.00
买入返售金融资产	54,800,404.70	-	-	-	54,800,404.70
应收利息	-	-	-	286,188.66	286,188.66
资产总计	68,010,319.21	-	-	9,516,108.66	77,526,427.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,671.47	11,671.47

应付管理人报酬	-	-	-	100,602.37	100,602.37
应付托管费	-	-	-	13,413.68	13,413.68
应付交易费用	-	-	-	43,263.68	43,263.68
其他负债	-	-	-	250,029.32	250,029.32
负债总计	-	-	-	418,980.52	418,980.52
利率敏感度缺口	68,010,319.21	-	-	9,097,128.14	77,107,447.35

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于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%（2016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13.05%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2016年12月31日：同）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016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	40,807,470.00	75.26	9,229,920.00	11.97
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	40,807,470.00	75.26	9,229,920.00	11.97

7.4.13.4.3.2 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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
	业绩比较基准上升5%	3,388,633.21	831,218.28
	业绩比较基准下降5%	-3,388,633.21	-831,218.28

7.4.14 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2017年12月31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（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12月31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。上述税收政策对本基金截至2017年12月31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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	40,807,470.00	69.73
	其中：股票	40,807,470.00	69.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	69,697.68	0.12
	其中：债券	69,697.68	0.12
	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	17,587,155.16	30.05
8	其他各项资产	57,079.64	0.10
9	合计	58,521,402.48	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	40,807,470.00	75.26

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	-	-
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	40,807,470.00	75.26

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资港股通股票。

8.3 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	占基金资产净值比例(%)
1	603328	依顿电子	180,000	2,583,000.00	4.76
2	002456	欧菲光	121,000	2,491,390.00	4.59
3	002273	水晶光电	103,000	2,429,770.00	4.48

4	603799	华友钴业	30,000	2,406,900.0 0	4.44
5	600031	三一重工	250,000	2,267,500.0 0	4.18
6	002048	宁波华翔	70,000	1,666,000.0 0	3.07
7	002384	东山精密	54,000	1,536,840.0 0	2.83
8	000823	超声电子	100,000	1,355,000.0 0	2.50
9	603111	康尼机电	100,000	1,350,000.0 0	2.49
10	002202	金风科技	70,000	1,319,500.0 0	2.43
11	601799	星宇股份	26,000	1,287,000.0 0	2.37
12	600584	长电科技	60,000	1,279,800.0 0	2.36
13	300037	新宙邦	60,000	1,251,600.0 0	2.31
14	002709	天赐材料	27,000	1,241,730.0 0	2.29
15	600563	法拉电子	24,000	1,219,440.0 0	2.25
16	002493	荣盛石化	80,000	1,148,000.0 0	2.12
17	600703	三安光电	45,000	1,142,550.0 0	2.11
18	000039	中集集团	50,000	1,142,500.0 0	2.11
19	000333	美的集团	20,000	1,108,600.0 0	2.04
20	000063	中兴通讯	30,000	1,090,800.0	2.01

				0	
21	002180	艾派克	39,000	1,065,090.00	1.96
22	601636	旗滨集团	170,000	1,060,800.00	1.96
23	600581	八一钢铁	76,000	1,038,160.00	1.91
24	300136	信维通信	20,000	1,014,000.00	1.87
25	600388	龙净环保	50,000	865,000.00	1.60
26	600782	新钢股份	130,000	855,400.00	1.58
27	000100	TCL 集团	200,000	780,000.00	1.44
28	600019	宝钢股份	90,000	777,600.00	1.43
29	600362	江西铜业	30,000	605,100.00	1.12
30	300308	中际装备	10,000	585,000.00	1.08
31	002019	亿帆医药	20,000	445,000.00	0.82
32	601600	中国铝业	60,000	398,400.00	0.73

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	5,252,615.00	6.81
2	002456	欧菲光	4,548,146.93	5.90
3	603328	依顿电子	4,530,720.91	5.88
4	002273	水晶光电	4,180,460.57	5.42
5	600019	宝钢股份	3,360,383.24	4.36
6	603799	华友钴业	3,205,598.00	4.16
7	000063	中兴通讯	3,174,514.00	4.12
8	300296	利亚德	2,945,055.80	3.82

9	002475	立讯精密	2,836,451.00	3.68
10	601600	中国铝业	2,835,700.00	3.68
11	000039	中集集团	2,657,688.00	3.45
12	000651	格力电器	2,651,840.00	3.44
13	600584	长电科技	2,534,583.00	3.29
14	600498	烽火通信	2,518,620.58	3.27
15	600884	杉杉股份	2,501,845.00	3.24
16	603111	康尼机电	2,437,932.00	3.16
17	300426	唐德影视	2,432,193.00	3.15
18	300027	华谊兄弟	2,342,796.24	3.04
19	300166	东方国信	2,327,944.54	3.02
20	300007	汉威电子	2,204,926.00	2.86
21	600038	中直股份	2,166,938.00	2.81
22	600031	三一重工	2,157,815.00	2.80
23	000066	中国长城	2,152,446.00	2.79
24	600416	湘电股份	1,931,042.80	2.50
25	000333	美的集团	1,893,687.00	2.46
26	000050	深天马 A	1,770,358.74	2.30
27	601225	陕西煤业	1,765,000.00	2.29
28	002241	歌尔股份	1,719,140.00	2.23
29	300136	信维通信	1,692,780.00	2.20
30	300133	华策影视	1,692,404.16	2.19
31	002048	宁波华翔	1,670,260.20	2.17
32	002074	国轩高科	1,644,431.40	2.13
33	002008	大族激光	1,632,643.14	2.12
34	600110	诺德股份	1,553,300.00	2.01
35	600050	中国联通	1,546,477.00	2.01
36	300068	南都电源	1,545,292.00	2.00

8.4.2 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	000063	中兴通讯	5,189,223.67	6.73
2	002635	安洁科技	5,116,125.23	6.64
3	002475	立讯精密	3,730,713.49	4.84
4	600884	杉杉股份	3,707,412.20	4.81
5	000059	华锦股份	3,227,804.00	4.19
6	000066	中国长城	3,107,564.00	4.03
7	600498	烽火通信	3,084,827.73	4.00
8	000651	格力电器	2,966,358.00	3.85
9	300296	利亚德	2,897,732.68	3.76
10	002456	欧菲光	2,530,565.17	3.28
11	600019	宝钢股份	2,489,875.00	3.23
12	601600	中国铝业	2,410,800.00	3.13
13	000050	深天马 A	2,384,143.00	3.09
14	600340	华夏幸福	2,299,020.00	2.98
15	300166	东方国信	2,258,565.76	2.93
16	300426	唐德影视	2,242,704.50	2.91
17	300027	华谊兄弟	2,197,664.00	2.85
18	300007	汉威电子	2,113,990.00	2.74
19	601225	陕西煤业	2,111,390.00	2.74
20	002008	大族激光	2,093,992.35	2.72
21	600416	湘电股份	2,013,398.08	2.61
22	002185	华天科技	1,880,422.00	2.44
23	603328	依顿电子	1,825,193.36	2.37
24	600038	中直股份	1,743,501.00	2.26
25	600050	中国联通	1,727,503.00	2.24
26	600309	万华化学	1,725,298.00	2.24
27	002138	顺络电子	1,700,573.00	2.21

28	600452	涪陵电力	1,700,102.00	2.20
29	002396	星网锐捷	1,652,170.24	2.14
30	600110	诺德股份	1,649,789.00	2.14
31	000777	中核科技	1,642,448.00	2.13
32	300133	华策影视	1,628,355.56	2.11
33	000039	中集集团	1,623,972.00	2.11
34	002241	歌尔股份	1,621,194.00	2.10
35	002074	国轩高科	1,602,087.49	2.08

8.4.3 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	178,920,559.92
卖出股票收入（成交）总额	154,208,303.45

8.5 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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)	69,697.68	0.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	69,697.68	0.13

8.6 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	128020	水晶转债	712	69,697.68	0.13

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期内本基金未运用股指期货进行投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内本基金未运用股指期货进行投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	44,778.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,330.65
5	应收申购款	10,970.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	57,079.64

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	户均持有的基 金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	数 (户)		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	927	42,178.76	-	-	39,099,708.97	100.0 0%
中信 建投 智信 物联 网C	11	778,556.63	8,433,836.55	98.4 8%	130,286.37	1.52%
合计	938	50,814.32	8,433,836.55	17.6 9%	39,229,995.34	82.3 1%

9.2 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	1,206,729.40	2.532%
	中信建投智信物 联网C	1,000.00	0.0021%
	合计	1,207,729.40	2.53%

9.3 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	50~100
	中信建投智信物联 网C	0
	合计	50~100

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

§ 10 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	
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	28,637,399.14	32,096,547.82
减：本报告期基金总赎回份额	67,571,621.43	23,532,424.90
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	39,099,708.97	8,564,122.92

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

2017年5月27日，增聘周紫光为本基金的基金经理；

2017年7月12日，基金管理人聘任张乐久为基金管理人督察长，周建萍离任基金管理人督察长；

2017年7月14日，基金管理人聘任周建萍为基金管理人副总经理；

2017年9月13日，王琦离任本基金的基金经理。

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用50,000.00元，该审计机构自2016年8月3日（基金合同生效日）起为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

因基金管理人未有效执行风险管控机制，报告期内收到中国证券监督管理委员会北京监管局下发的（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；北京证监局下发的《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；北京证监局下发的《关于对中信建投基金管理有限公司采取责令改正并暂停办理相关业务措施的决定》（[2017]79号），对基金管理人采取责令改正并限期暂停特定客户资产管理计划备案的行政监管措施。

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	116,231,464.24	34.89%	61,753.99	33.38%	-
招商证券	1	80,254,715.28	24.09%	50,664.66	27.38%	-
中信建投证券	2	136,642,683.85	41.02%	72,598.17	39.24%	-

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，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委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

11.7.2 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	-	-	210,700,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 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	中国证监会指定报刊及管理	2017-01-03

	关于旗下开放式证券投资基金2016年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	人网站	
2	中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金2016年第4季度报告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-01-20
3	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司基金申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-02-27
4	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）摘要（2017年第1号）	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-03-20
5	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）（2017年第1号）	管理人网站	2017-03-20
6	中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-03-31
7	中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告	管理人网站	2017-03-31
8	《中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告》更正公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-04-15
9	中信建投基金增加中期资产管理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	2017-04-21
10	中信建投基金增加上海好买	中国证监会指定报刊及管理	2017-04-21

	基金销售有限公司为多只基金的销售机构的公告	人网站	
11	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	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-04-21
12	中信建投基金增加上海云湾投资管理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	2017-04-24
13	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	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-05-10
14	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（2017年5月修订）	管理人网站	2017-05-10
15	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（2017年5月修订）	管理人网站	2017-05-10
16	中信建投基金关于旗下部分开放式基金C类份额增加代销机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-05-15
17	中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金关于增聘基金经理的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-06-01
18	关于公司副董事长兼任子公司执行董事的公告	管理人网站	2017-06-29
19	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	2017-07-01

20	中信建投基金增加上海长量基金销售投资顾问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	2017-07-14
21	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-07-14
22	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-07-15
23	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2季度报告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-07-21
24	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金参加一路财富（北京）信息科技股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-08-10
25	关于调整通过盈米财富销售平台申购中信建投基金管理有限公司旗下基金金额下限及最低持有金额下限的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-08-25
26	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	管理人网站	2017-08-29
27	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	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-08-29
28	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）（2017年第2号）	管理人网站	2017-09-15
29	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）摘要（2017	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-09-15

	年第2号)		
30	中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金关于变更基金经理的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-09-15
31	关于中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金变更基金份额净值小数点保留位数并修改基金合同和托管协议中相关条款的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-09-27
32	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	管理人网站	2017-09-27
33	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	2017-09-27
34	中信建投基金增加喜鹊财富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	2017-10-20
35	中信建投基金增加天津万家财富资产管理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	2017-10-20
36	中信建投基金增加乾道金融信息服务（北京）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	2017-10-20
37	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3季度报告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-10-26
38	中信建投基金增加北京银行股份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	2017-10-30
39	中信建投基金管理有限公司关于旗下基金通过北京银行	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-11-06

	股份有限公司参与定投业务及费率优惠的公告		
40	中信建投基金管理有限公司关于旗下基金通过上海浦东发展银行股份有限公司参与定投业务及费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-11-06
41	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金开通基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-11-11
42	中信建投基金增加长城证券股份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	2017-11-13
43	中信建投基金管理有限公司关于在中信建投证券开通旗下部分基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-11-16
44	中信建投基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中国铝业”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-11-16
45	中信建投基金管理有限公司关于暂停旗下部分基金在北京银行代销渠道参与定投的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-11-22
46	中信建投基金增加深圳前海汇联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	2017-11-24
47	中信建投基金增加深圳市新兰德证券投资咨询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	2017-11-24
48	中信建投基金管理有限公司关于旗下基金持有的“金通灵”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-12-06
49	中信建投基金管理有限公司	中国证监会指定报刊及管理	2017-12-29

	关于旗下基金持有的“光环新网”股票估值方法调整的公告	人网站	
--	----------------------------	-----	--

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2017年5月10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》、《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（2017年5月修订）》、《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（2017年5月修订）》；

基金管理人于2017年9月27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变更基金份额净值小数点保留位数并修改基金合同和托管协议中相关条款的公告》、《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》。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所。

13.3 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
二〇一八年三月三十日