

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

2020 年 1 月

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

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、基金产品资料概要等信息披露文件，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。基金产品资料概要编制、披露与更新要求将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

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。

本更新的招募说明书所载内容截止日为 2020 年 1 月 15 日，有关财务数据和净值截止日为 2019 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。本基金托管人中信银行股份有限公司复核了本次更新的招募说明书。

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17、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，男，1966年12月生，中国国籍，汉族，中共党员，成都电子科技大学硕士研究生学历，籍贯江苏。曾任中信证券股份有限公司交易部总经理、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。

邱黎强，男，1970年10月生，中国国籍，汉族，中共党员，北京大学硕士研究生学历，籍贯浙江。曾任中信建投证券股份有限公司资产管理部行政负责人等，现任中信建投基金管理有限公司副董事长、总经理，兼任元达信资本管理（北京）有限公司执行董事。

邹舫，男，1978年生，毕业于中国人民大学会计学专业，博士研究生学历，曾任中国三峡总公司资产财务部主任科员、中电投云南国际电力投资有限公司财务部预算处副处长（主持工作）、中电投集团财务部资金处主管（主持工作）、中国康富国际租赁股份有限公司证券与投资部总经理兼董事长办公室主任等职。2017年4月进入航天科技财务有限责任公司工作，任公司总经理助理、董事会秘书兼战略发展部（董事会办公室）部长（主任）。

周艳丽，女，1972年3月生，中国国籍，汉族，民建会员，南京大学硕士研究生学历，籍贯山东。曾任江苏省广播电视总台（集团）财务资产部副主任，现任江苏省广播电视总台（集团）财务资产部主任。

袁野，男，1976年12月生，中国国籍，汉族，中共党员，德国特里尔大学硕士研究生学历，籍贯黑龙江。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等，现任中信建投基金管理有限公司常务副总经理、职工董事。

胡家勇，男，1962年11月生，中国国籍，汉族，中共党员，中南财经大学博士研究生学历。曾任中南财经大学助教、讲师、副教授、教授等，现任中国社会科学院经济研究所研究员、中信建投基金管理有限公司独立董事，兼任国家社会科学基金评审组专家、中国博士后科学基金评审组专家、全国科技名词审定委员会委员、经济贸易名词审定委员会副主任。

王军，男，1980年1月生，中国国籍，汉族，中共党员，中国农业大学博士研究生学历。现任中国农业大学经济管理学院金融系讲师、中国农业大学中国期货与金融衍生品研究中心副主任兼秘书长、中国农业大学MBA教育中心主任及党支部书记、中信建投基金管理有限公司独立董事。

袁冬梅，女，1966年10月生，中国国籍，汉族，中共党员，北京大学分校法律法学专业本科，获法学学士学位。曾任北京市对外经济律师事务所律师、北京市共和律师事务所创始合伙人/律师、北京天达共和律师事务所合伙人/律师，北京市人大常委会立法咨询专家。

佟岩，女，1977年生，北京理工大学管理与经济学院教授，博士生导师，北京理工大学专业学位联合教育中心主任，中国会计学会财务管理分会理事，入选北京国资委外部董事人才库。佟岩女士是中国人民大学会计学博士，伦敦国

王学院（King's College London）访问学者，中国注册会计师，财政部全国会计领军人才（学术类），北京市优秀人才培养资助对象。在专业领域主持国家基金课题 3 项、教育部基金课题 1 项，发表 A 类 CSSCI 期刊、SCI 论文和 EI 论文多篇。佟岩女士现为金牛化工（600722）和中公教育（002607）独立董事。

2、监事会成员

陆亚，女，1966 年 2 月生，中国国籍，民主党派人士，中国人民大学硕士学历。曾就职于中国人民大学教务秘书、中国证券市场研究设计中心分析员、京都会计师事务所注册会计师、华夏证券业务主管等，现任中信建投证券股份有限公司首席风控师、风险管理部行政负责人、董事总经理、中信建投基金管理有限公司监事会主席。

李慧，女，1982 年生，毕业于北京航空航天大学经济管理学院管理科学与工程专业，博士研究生学历，2009 年 6 月进入航天科技财务有限责任公司工作，曾入选财务公司行业专业人才库。现任航天科技财务有限责任公司风险管理与法律部副部长。

周琰，女，1983 年 7 月生，中共党员，南京大学硕士研究生学历。现任江苏省广播电视总台（集团）金融投资中心投资部业务一部主任、中信建投基金管理有限公司监事。

张全，男，1979 年 6 月生，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，曾任中信建投基金管理有限公司总经理助理、特定资产管理部负责人等，现任元达信资本管理（北京）有限公司总经理、中信建投基金管理有限公司职工监事。

谭淼，女，1978 年 12 月生，中共党员，中央财经大学本科学历。曾就职于华夏证券北京三里河路营业部客户服务部、华夏证券股份有限公司交易清算部、中信建投证券股份有限公司交易清算部、中信建投证券股份有限公司总裁办公室，现任中信建投基金管理有限公司总经理助理、中信建投基金管理有限公司职工监事。

谭保民，男，1984 年 2 月生，中共党员，中央民族大学本科学历。曾任中银国际证券有限责任公司北京营业部客服经理、国金证券股份有限公司基金筹备组注册登记会计、国金通用基金管理有限公司基金清算部高级注册登记会计，现

任中共中信建投基金管理有限公司纪律检查委员会纪委委员、中信建投基金管理有限公司运营管理部总监、中信建投基金管理有限公司职工监事。

3、高级管理人员

蒋月勤先生，现任公司董事长，简历同上。

邱黎强先生，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。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、中信建投基金管理有限公司督察长等，现任中信建投基金管理有限公司副总经理。

高翔先生，太原机械学院（现中北大学）本科学历。曾任广东深圳蛇口新欣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等，现任中信建投基金管理有限公司副总经理，兼任中信建投基金管理有限公司首席信息官、元达信资本管理（北京）有限公司执行监事。

张乐久先生，加拿大不列颠哥伦比亚大学硕士研究生学历。曾任中大期货有限公司研究员、太平洋证券股份有限公司研究员、中国证券监督管理委员会北京监管局主任科员、北京同瑞汇金管理有限公司合规专员等，现任中信建投基金管理有限公司督察长。

4、本基金基金经理

周紫光先生，大连理工大学工学硕士，曾任江海证券有限责任公司研究员、平安证券有限责任公司研究员、方正证券有限责任公司研究员、中信建投基金管理有限公司投资研究部研究员，现任中信建投基金管理有限公司投资部-股票投资部基金经理。

5、投资决策委员会成员

邱黎强先生，简历同上。

栾江伟先生，北京协和医学院药物分析学硕士。曾任新华基金管理股份有限公司基金经理，现任中信建投基金管理有限公司投资部负责人。

刘博先生，英国华威大学金融学硕士。曾任沈阳序和科技开发有限公司总经

理助理、中诚信国际信用评级有限责任公司分析师、招商证券股份有限公司研究员、中信建投证券股份有限公司固定收益部高级副总裁，现任中信建投基金管理有限公司投资部-固收投资部负责人。

周户先生，南开大学经济学硕士。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、国金证券股份有限公司及其下属基金公司研究员、中信建投基金管理有限公司投资研究部研究员，现任中信建投基金管理有限公司投资部-股票投资部基金经理。

许健先生，中央财经大学统计学硕士。曾任中国邮政集团公司投资主办、中信银行股份有限公司固定收益投资经理，现任中信建投基金管理有限公司投资部-固收投资部基金经理。

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（以下简称“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20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：保险兼业代理业务（有效期至 2020 年 09 月 09 日）；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。（企业依法自主选择经营项目，开展经营活动；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；不得从事本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）

中信银行（601998.SH、0998.HK）成立于 1987 年，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。为中国经济建设做出了积极贡献。2007 年 4 月，中信银行实现在上海证券交易所和香港联合交易所 A+H 股同步上市。

中信银行以建设最佳综合金融服务企业为发展愿景，充分发挥中信集团金融与实业并举的独特竞争优势，坚持“以客为尊”，秉承“平安中信、合规经营、科技立行、服务实体、市场导向、创造价值”的经营理念，向企业客户和机构客户提供公司银行业务、国际业务、金融市场业务、机构业务、投资银行业务、保理业务、托管业务等综合金融解决方案，向个人客户提供零售银行、信用卡、消费金融、财富管理、私人银行、出国金融、电子银行等多元化金融产品及服务，全方位满足企业、机构及个人客户的综合金融服务需求。

截至 2018 年末，中信银行在国内 146 个大中城市设有 1,410 家营业网点，同时在境内外下设 6 家附属公司，包括中信国际金融控股有限公司、信银（香港）投资有限公司、中信金融租赁有限公司、浙江临安中信村镇银行股份有限公司、中信百信银行股份有限公司和阿尔金银行。其中，中信国际金融控股有限公司子公司中信银行（国际）有限公司，在香港、澳门、纽约、洛杉矶、新加坡和中国内地设有 38 家营业网点。信银（香港）投资有限公司在香港和中国内地设有 3 家子公司。中信百信银行股份有限公司为中信银行与百度公司发起设立的国内首

家具有独立法人资格的直销银行。阿尔金银行在哈萨克斯坦设有 6 家营业网点和 1 个私人银行中心。

30 多年来，中信银行坚持服务实体经济，稳健经营，与时俱进。经过 30 余年的发展，中信银行已成为一家总资产规模超 6 万亿元、员工人数近 6 万名，具有强大综合实力和品牌竞争力的金融集团。2018 年，中信银行在英国《银行家》杂志“全球银行品牌 500 强排行榜”中排名第 24 位；中信银行一级资本在英国《银行家》杂志“世界 1000 家银行排名”中排名第 27 位。

（二）主要人员情况

方合英先生，中信银行执行董事、行长兼财务总监。方先生于 2018 年 9 月加入中信银行董事会。方先生自 2014 年 8 月起任中信银行党委委员，2014 年 11 月起任中信银行副行长，2017 年 1 月起兼任中信银行财务总监，2019 年 2 月起任中信银行党委副书记。方先生现同时担任信银（香港）投资有限公司、中信银行（国际）有限公司及中信国际金融控股有限公司董事。此前，方先生于 2013 年 5 月至 2015 年 1 月任中信银行金融市场业务总监，2014 年 5 月至 2014 年 9 月兼任中信银行杭州分行党委书记、行长；2007 年 3 月至 2013 年 5 月任中信银行苏州分行党委书记、行长；2003 年 9 月至 2007 年 3 月历任中信银行杭州分行行长助理、党委委员、副行长；1996 年 12 月至 2003 年 9 月在中信银行杭州分行工作，历任信贷部科长、副总经理，富阳支行行长、党组书记，国际结算部副总经理，零售业务部副总经理，营业部总经理；1996 年 7 月至 1996 年 12 月任浦东发展银行杭州城东办事处副主任；1992 年 12 月至 1996 年 7 月在浙江银行学校实验城市信用社信贷部工作，历任信贷员、经理、总经理助理；1991 年 7 月至 1992 年 12 月在浙江银行学校任教师。方先生为高级经济师，毕业于北京大学，获高级管理人员工商管理硕士学位，拥有二十余年中国银行业从业经验。

杨毓先生，中信银行副行长，分管托管业务。杨先生自 2015 年 7 月起任中信银行党委委员，2015 年 12 月起任中信银行副行长。此前，杨先生 2011 年 3 月至 2015 年 6 月任中国建设银行江苏省分行党委书记、行长；2006 年 7 月至 2011 年 2 月任中国建设银行河北省分行党委书记、行长；1982 年 8 月至 2006 年 6 月在中国建设银行河南省分行工作，历任计财处副处长，信阳分行副行长、党委委员，计财处处长，郑州市铁道分行党委书记、行长，郑州分行党委书记、行长，

河南省分行党委副书记、副行长（主持工作）。杨先生为高级经济师，研究生学历，管理学博士。

杨璋琪先生，中信银行资产托管部副总经理（主持工作），硕士研究生学历。杨先生 2018 年 1 月至 2019 年 3 月，任中信银行金融同业部副总经理；2015 年 5 月至 2018 年 1 月，任中信银行长春分行副行长；2013 年 4 月至 2015 年 5 月，任中信银行机构业务部总经理助理；1996 年 7 月至 2013 年 4 月，就职于中信银行北京分行（原总行营业部），历任支行行长、投资银行部总经理、贸易金融部总经理。

（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 2019 年三季度末，中信银行托管 138 只公开募集证券投资基金，以及基金公司、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 8.93 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

住所：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：李庆萍

传真：010-65550827

联系人：林大千

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

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话：400-888-8108

传真：010-65182261

联系人：权唐

网址：www.csc.com.cn

(3) 中信建投期货有限公司

办公地址：重庆市渝中区中山三路 107 号上站大楼 11-B, 名义层
11-A, 8-B4, 9-B、C

法定代表人：彭文德

客户服务电话：400-8877-780、023-63600049

网址：www.cfc108.com/

(4) 上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

传真：021-63602431

联系人：虞谷云、姜基彬

网址：www.spdb.com.cn

客户服务电话：95528

（5）中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

传真：010-60833739

联系人：马静懿

网址：www.cs.ecitic.com

客户服务电话：95548

（6）中信期货有限公司

住所：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305、14层

办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305、14层

法定代表人：张皓

传真：0755-83217421

联系人：洪诚

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

住所：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址：山东省青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

法定代表人：姜晓林

传真：0532-68722193

联系人：孙秋月

网址：<http://sd.citics.com/>

客户服务电话：95548

（8）交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

传真：021-58408483

联系人：孙昊

网址：www.bankcomm.com

客户服务电话：95559

（9）北京农村商业银行股份有限公司

住所：北京市西城区阜成门内大街 410 号

办公地址：北京市西城区金融大街 9 号金融街中心 B 座

法定代表人：乔瑞

传真：010-63229478

联系人：董张丽

网址：www.bjrcb.com

客户服务电话：96198

（10）上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼

法定代表人：其实

传真：021-64385308

联系人：夏雯

网址：www.1234567.com.cn

客户服务电话：400-181-8188

（11）一路财富（北京）基金销售股份有限公司

住所：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702 室

法定代表人：吴雪秀

传真：010-88312099

联系人：徐越

网址：www.yilucaifu.com

客户服务电话：400-001-1566

（12）上海陆金所基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：王之光

传真：021-22066653

联系人：程晨

网址：www.lufunds.com

客户服务电话：400-821-9031

（13）中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

传真：0531-68889185

联系人：吴阳

网址：www.zts.com.cn

客户服务电话：95538

（14）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 1 号环球金融中心西塔 14 层

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

网址：www.antfortune.com

客户服务电话：95188

（15）浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

传真：0571-88910240

联系人：李珍珍

网址：www.5ifund.com

客户服务电话：400-877-3772

（16）大泰金石基金销售有限公司

住所：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

传真：021-20324199

联系人：赵明

网址：www.dtfunds.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

住所：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

传真：021-63332523

联系人：李晓明

客服电话：4000 178 000

网址：www.lingxianfund.com

（18）珠海盈米基金销售有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔

B1201-1203

法定代表人：肖雯

传真：020-89629011

联系人：吴煜浩

网址：www.yingmi.cn

客户服务电话：020-89629066

（19）北京钱景基金销售有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人：赵荣春

传真：010-57569671

联系人：魏争

客户服务电话：400-678-5095

网址：www.niuji.net

（20）武汉市伯嘉基金销售有限公司

地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第7栋23层1号、4号

法定代表人：陶捷

联系人：孔繁

客户服务电话：027-87006003

网址：www.buyfunds.cn

（21）北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人：王伟刚

电话：010-56282140

联系人：于伟伟

网址：www.hcjijin.com

客户服务电话：400-619-9059

（22）北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层

法定代表人：梁越

传真：010-56810630

联系人：张敏

网址：www.chtfund.com

客户服务电话：400-898-0618

（23）北京肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部

法定代表人：江卉

传真：010-89180000

联系人：黄立影

网址：<http://fund.jd.com/>

客户服务电话：95118、400-098-8511

（24）上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

传真：021-50583633

联系人：陈洁

网址：<http://a.leadfund.com.cn/>

客户服务电话：400-067-6266

（25）北京格上富信基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：李悦章

联系人：张林

传真：010-65983333

客户服务电话：400-066-8586

网址：www.igesafe.com

（26）北京微动利基金销售有限公司

注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号 3 层 342

办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

法定代表人：季长军

联系人：王伟丽

传真：010-68854009

客户服务电话：400-188-5687

网址：www.buyforyou.com.cn

（27）上海云湾基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

法定代表人：戴新装

联系人：江辉

传真：021-20538999

客服电话：400-820-1515

网址：www.zhengtongfunds.com

（28）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906

室

法定代表人：杨文斌

传真：021-68596916

联系人：徐超逸

网址：www.ehowbuy.com

客户服务电话：400-700-9665

（29）北京中期时代基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号

办公地址：北京市朝阳区光华路 16 号中期大厦 2 层

法定代表人：姜新

联系人：侯英建

传真：010-65807865

客服电话：010-65807609

网址：<http://www.cifcofund.com>

(30) 上海攀赢基金销售有限公司

注册地址：上海市闸北区广中西路 1207 号 306 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 488 号太平金融大厦 603 室

法定代表人：田为奇

联系人：吴卫东

网址：www.pytz.cn

客户服务电话：021-68889082

(31) 乾道盈泰基金销售（北京）有限公司

住所：北京市海淀区东北旺村南 1 号楼 7 层 7117 室

办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室

法定代表人：王兴吉

传真：010-82057741

联系人：高雪超

网址：www.qiandaojr.com

客户服务电话：4000888080

(32) 喜鹊财富基金销售有限公司

注册地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

办公地址：北京市朝阳区北苑路安苑里 1 号奇迹大厦 6 层

法定代表人：陈皓

传真：010-50877697

联系人：张萌

网址：www.xiquefund.com

客户服务电话：0891-6177483

(33) 万家财富基金销售（天津）有限公司

住所：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人：李修辞

联系人：李明然

网址：www.wanjiawealth.com

客户服务电话：010-59013895

（34）深圳前海汇联基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区粤兴二道6号武汉大学深圳产学研大楼B815

办公地址：深圳市南山区软件产业基地4栋D座三楼

法定代表人：万勇

联系人：蒋晋文

传真：0755-86725180

客服电话：0755-86722851

网址：<http://www.flyingfund.com.cn>

（35）长城证券股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

传真：0755-83515567

联系人：徐锦山

网址：www.cgws.com

客户服务电话：400-666-6888、0755-33680000

（36）天津国美基金销售有限公司

住所：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼D座二层
202-124室

办公地址：北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座9层

法定代表人：丁东华

电话：010-59287984

联系人：郭宝亮

网址：www.gomefund.com

客户服务电话：400-111-0889

（37）上海长量基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层

法定代表人：张跃伟

传真：021-20691861

联系人：党敏

网址：www.erichfund.com

客户服务电话：400-820-2899

（38）北京银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：张东宁

传真：010-66226045

联系人：周黎

网址：www.bankofbeijing.com.cn

客户服务电话：95526

（39）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 9 层

法定代表人：陈操

传真：010-58325282

联系人：刘宝文

网址：8.jrj.com.cn

客户服务电话：400-850-7771

（40）招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号

办公地址：深圳市深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

传真：0755-83195109

联系人：季平伟

网址：www.cmbchina.com

客户服务电话：95555

（41）宜信普泽（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 18 层 1809

法定代表人：沈伟桦

传真：010-85894285

联系人：程刚

网址：www.yixinfund.com

客户服务电话：400-609-9200

（42）南京苏宁基金销售有限公司

住所：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

传真：025-66008800-887226

联系人：张慧

网址：www.snjjin.com

客户服务电话：95177

（43）北京植信基金销售有限公司

住所：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106-67

办公地址：北京市朝阳区盛世龙源国食苑 10 号楼

法定代表人：杨纪峰

传真：010-67767615

联系人：吴鹏

网址：www.zhixin-inv.com

客户服务电话：400-680-2123

（44）上海联泰基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

传真：021-52975270

联系人：兰敏

网址：www.66zichan.com

客户服务电话：400-166-6788

（45）泰诚财富基金销售（大连）有限公司

住所：辽宁省大连市沙河口区星海公园 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海公园 3 号

法定代表人：林卓

传真：0411-84396536

联系人：张晓辉

网址：www.haojiyoujijin.com

客户服务电话：400-6411-999

（46）上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济
发展区）

办公地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和
经济发展区）

法定代表人：王翔

传真：021-55085991

联系人：李关洲

网址：www.jiyufund.com.cn

客户服务电话：400-820-5369

（47）北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

传真：010-61840699

联系人：侯芳芳

网址：<https://danjuanapp.com>

客户服务电话：400-159-9288

（48）深圳前海财厚基金销售有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区深圳湾科技生态园三千11栋A座3608室

法定代表人：杨艳平

传真：0755-26640652

联系人：莫婉

网址：www.caiho.cn

客户服务电话：400-1286-800

（49）东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：陈耀庭

传真：021-50498825

联系人：王一彦

网址：www.longone.com.cn

客户服务电话：95531、400-888-8588

（50）和耕传承基金销售有限公司

住所：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北6号楼5楼

503

办公地址：郑州市郑东新区东风南路康宁街新发展大厦503

法定代表人：王旋

联系人：董亚芳

网址：www.hgcpcb.com

客户服务电话：4000-555-671

（51）济安财富（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

网址：www.jianfortune.com

客户服务电话：400-673-7010

（52）国金证券股份有限公司

住所：成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：杜晶、黎建平

网址：www.gjzq.com.cn

客户服务电话：95310

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：上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼

法定代表人：李丹

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：张勇

经办注册会计师：张勇、郭蕙心

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（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%。

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、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，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合同规定，于 2020 年 1 月复核了本报告中的财务指标、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 2019 年 9 月 30 日（摘自本基金 2019 年第 3 季度报告），本报告中所列财务数据未经审计。

（一）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	48,366,178.06	68.87
	其中：股票	48,366,178.06	68.87
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	21,222,239.97	30.22
8	其他资产	640,638.65	0.91
9	合计	70,229,056.68	100.00

(二) 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	141,000.00	0.21
B	采矿业	-	-
C	制造业	38,122,598.06	58.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	555,600.00	0.85
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、软件和技术服务业	9,008,580.00	13.73
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	538,400.00	0.82
S	综合	-	-
	合计	48,366,178.06	73.70

2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

(三)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(元)	占基金资产净值比 例(%)
1	601012	隆基股份	160,000	4,196,800.00	6.39
2	000063	中兴通讯	105,000	3,361,050.00	5.12
3	300014	亿纬锂能	110,000	3,342,900.00	5.09
4	600438	通威股份	230,000	2,930,200.00	4.46
5	300659	中孚信息	36,000	2,016,000.00	3.07
6	300274	阳光电源	170,000	1,921,000.00	2.93
7	600584	长电科技	100,000	1,721,000.00	2.62
8	002185	华天科技	300,000	1,635,000.00	2.49
9	300450	先导智能	45,000	1,516,500.00	2.31
10	600745	闻泰科技	20,000	1,413,800.00	2.15

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无余额。

(五)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

无余额。

(六)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

无余额。

（七）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

无余额。

（八）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

无余额。

（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

（十一）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	33,430.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,857.26
5	应收申购款	605,351.37
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	640,638.65

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

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 2019 年 9 月 30 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

中信建投智信物联网 A

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
2019 年 7 月 1 日-2019 年 9 月 30 日	21.11%	1.64%	0.08%	0.57%	21.03%	1.07%
2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日	17.63%	1.90%	15.98%	0.92%	1.65%	0.98%
2018 年 1 月 1 日-2018 年 12 月 31 日	-30.34%	1.60%	-14.01%	0.80%	-16.33%	0.80%
2017 年 1 月 1 日-2017 年 12 月 31 日	13.76%	0.86%	11.14%	0.39%	2.62%	0.47%
2016 年 8 月 3 日（基金合同生效日）-2016 年 12 月 31 日	-1.20%	0.15%	1.48%	0.46%	-2.68%	-0.31%

中信建投智信物联网 C

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
2019 年 7 月 1 日-2019 年 9 月 30 日	20.99%	1.64%	0.08%	0.57%	20.91%	1.07%
2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日	17.42%	1.90%	15.98%	0.92%	1.44%	0.98%

2018年1月1日-2018年12月31日	-32.02%	1.62%	-14.01%	0.80%	-18.01%	0.82%
2017年6月7日（首笔份额登记日）-2017年12月31日	20.01%	1.12%	8.86%	0.42%	11.15%	0.70%

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-2019年09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-2019年09月30日)



注：1、图 1 为中信建投智信物联网 A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图，绘图日期为 2016 年 8 月 3 日（基金合同生效日）至 2019 年 9 月 30 日；
 2、图 2 为中信建投智信物联网 C 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图，绘图日期为 2017 年 6 月 7 日（首笔份额登记日）至 2019 年 9 月 30 日。

十四、基金费用和税收

（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、销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用、账户维护费用；
- 9、基金的账户开户费用；

10、因投资港股通标的股票而产生的各项费用；

11、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。

3、销售服务费

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%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.40% 年费率计提。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资金划拨指令，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登记机构，经登记机构代付给各个基金销售机构。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 4—11 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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、其他有关法律法规及基金合同的要求，对《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，本更新的招募说明书主要更新内容如下：

- 1、更新了“第一部分 前言”的相关内容；
- 2、更新了“第二部分 释义”的相关内容；
- 3、更新了“第三部分 基金管理人”的相关内容；

- 4、更新了“第四部分 基金托管人”的相关内容；
- 5、更新了“第五部分 相关服务机构”的相关内容；
- 6、更新了“第八部分 基金份额的申购与赎回”的相关内容；
- 7、更新了“第九部分 基金的投资”的相关内容，基金投资组合报告经托管人复核；
- 8、更新了“第十部分 基金的业绩”的相关内容，并经托管人复核；
- 9、更新了“第十三部分 基金的收益与分配”的相关内容；
- 10、更新了“第十五部分 基金的会计与审计”的相关内容；
- 11、更新了“第十六部分 基金的信息披露”的相关内容；
- 12、更新了“第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的相关内容；
- 13、更新了“第十九部分 基金合同内容摘要”的相关内容；
- 14、更新了“第二十部分 基金托管协议的内容摘要”的相关内容；
- 15、更新了“第二十二部分 其他应披露事项”，列示了本次更新期间与本基金相关的公告事项。

中信建投基金管理有限公司

2020年1月