

# 中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金

## 2020 年年度报告

2020 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:2021 年 03 月 31 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2021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2020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	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§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	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
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	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
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	67
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	67
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	68
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	68
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	68

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	68
8.12 投资组合报告附注.....	68
§9 基金份额持有人信息.....	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
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.....	70
§10 开放式基金份额变动.....	70
§11 重大事件揭示.....	70
11.1 基金份额持有人大会决议.....	70
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.....	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	71
11.4 基金投资策略的改变.....	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	71
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.....	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	71
11.8 其他重大事件.....	73
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	78
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.....	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	78
§13 备查文件目录.....	78
13.1 备查文件目录.....	78
13.2 存放地点.....	79
13.3 查阅方式.....	79

## § 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	319,852,944.53份	
基金合同存续期	不定期	
下属各类别基金的基金简称	中信建投智信物联网 A	中信建投智信物联网 C
下属各类别基金的交易代码	001809	004636
报告期末下属各类别基金的份额总额	222,888,686.04份	96,964,258.49份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于股票等权益类资产和债券等固定收益类金融工具，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，力争实现基金资产持续稳定增值。
投资策略	本基金采用自上而下的策略，通过对宏观经济基本面（包括经济运行周期、财政及货币政策、产业政策等）的分析判断，和对流动性水平（包括资金面供需情况、证券市场估值水平等）的深入研究，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，并据此对本基金资产在股票、债券、现金之间的投资比例进行动态调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高

	于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高预期风险、中高预期收益的品种。
--	--

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中信建投基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张乐久
	联系电话	010-57760122
	电子邮箱	zhanglj@csc.com.cn
客户服务电话	4009-108-108	95558
传真	010-59100298	010-85230024
注册地址	北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
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	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码	100010	100020
法定代表人	蒋月勤	李庆萍

注：基金管理人于2021年2月27日发布《中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，黄凌先生自2021年2月26日起担任基金管理人董事长，并于2021年3月1日完成黄凌先生担任基金管理人法定代表人的工商变更登记。

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	基金管理人及基金托管人住所

### 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	2020年		2019年		2018年	
	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	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	6,182,763.43	4,039,212.38	3,711,818.07	1,010,341.90	-6,446,988.07	105,355.98
本期利润	69,380,183.70	17,886,512.77	15,639,006.66	1,670,328.46	-10,824,098.67	737,349.28
加权平均基金份额本期利润	0.2436	0.1421	0.4818	0.3087	-0.3411	0.6782
本期加权平均净值利润率	14.17%	7.95%	46.49%	25.34%	-35.77%	59.30%
本期基金份额净值增长率	54.97%	54.35%	71.39%	70.76%	-30.34%	-32.02%
3.1.2 期末数据和指标	2020年末		2019年末		2018年末	
期末可供分配利润	11,536,003.32	9,141,030.12	-182,875.15	1,438,582.93	-6,703,559.75	-12,228.18
期末可供分配基金份额利润	0.0518	0.0943	-0.0023	0.0457	-0.2171	-0.1842
期末基金资产净值	463,466,134.84	208,494,240.91	105,950,031.98	43,883,578.05	24,167,686.65	54,165.35
期末基金份额净值	2.0794	2.1502	1.3418	1.3931	0.7829	0.8158
3.1.3 累计	2020年末		2019年末		2018年末	

期末指标						
基金份额累计净值增长率	107.94%	115.02%	34.18%	39.31%	-21.71%	-18.42%

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。

### 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	19.45%	1.77%	8.30%	0.59%	11.15%	1.18%
过去六个月	20.11%	2.23%	14.35%	0.80%	5.76%	1.43%
过去一年	54.97%	2.38%	16.24%	0.85%	38.73%	1.53%
过去三年	85.02%	1.93%	21.45%	0.80%	63.57%	1.13%
自基金合同生效起至今	107.94%	1.65%	36.98%	0.70%	70.96%	0.95%

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	19.32%	1.77%	8.30%	0.59%	11.02%	1.18%

过去六个月	19.87%	2.23%	14.35%	0.80%	5.52%	1.43%
过去一年	54.35%	2.38%	16.24%	0.85%	38.11%	1.53%
过去三年	79.17%	1.94%	21.45%	0.80%	57.72%	1.14%
自基金合同生效起至今	115.02%	1.83%	32.21%	0.75%	82.81%	1.08%

### 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



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

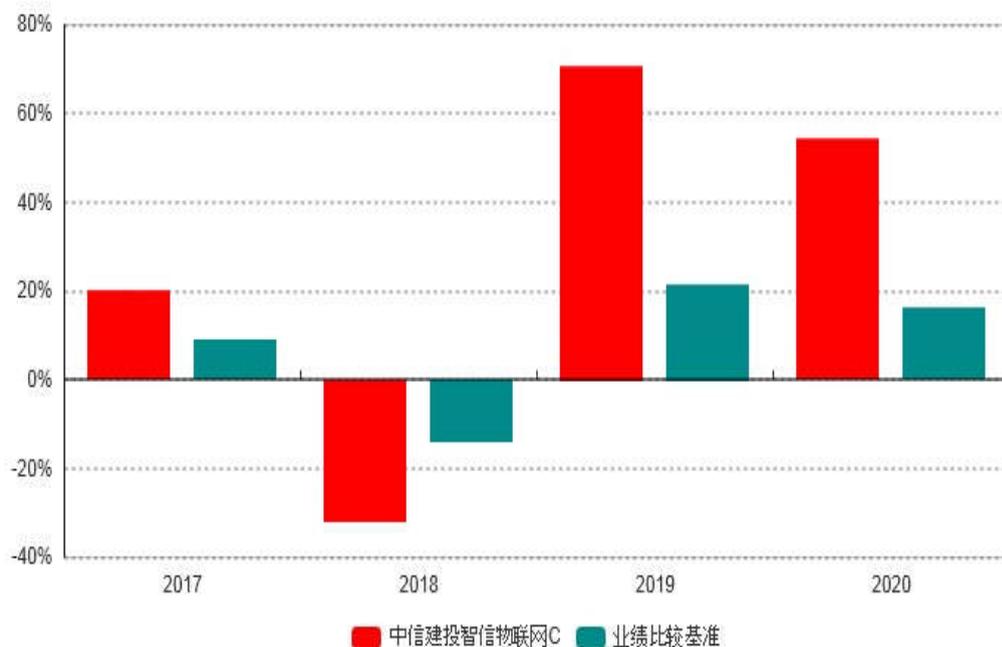
(2017年06月07日-2020年12月31日)



注：1、以上第 1 张图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 2020 年 12 月 31 日；

2、以上第 2 张图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 2020 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 过去五年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：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（以下简称“中信建投基金”）于2013年9月9日在北京注册成立，注册资本3亿元，主要经营基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。中信建投基金全资子公司元达信资本管理（北京）有限公司于2015年6月8日成立，主要经营特定客户资产管理业务和中国证监会许可的其他业务。

中信建投基金积极回归公募基金业务本源，加强投研体系建设，注重核心投资人才的积累、培养，公司主动投资管理能力大幅提升，在2020年二季度银河证券评价报告中，中信建投基金近一年基金管理人股票投资主动管理能力排名5/118，近三年基金管理人股票投资主动管理能力排名第14/91。

同时中信建投基金加强客户体系建设、积极拓展渠道，加大了与国有大行、股份制银行及证券公司的合作力度。公司各项业务有序开展，为进一步发展奠定了良好的基础。

中信建投基金作为资产管理公司，秉承“忠于信，健于投”，追求以稳健的投资，回馈于客户的信任；致力于经过长期努力，打造具有影响力的品牌。

#### 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		
周紫光	本基金的基金经理、研究部负责人	2017-05-27	-	10年	中国籍，1983年7月生，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、方正证券股份有限公司研究员。2016年3月加入中信建投基金管理有限公司，曾任投资研究部研究员，现任研究部负责人，担任中信建投聚利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、中信建投智享生活混合型证券投资基金基金经理。
孙文	本基金的基金经理助理	2020-08-04	-	4年	中国籍，1990年10月生，对外经济贸易大学金融学硕士。2016年7月加入中信建投基金管理有限公司，曾任投资研究部研究员，现任中信建投医改灵活配置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、中信建投行业轮换混合型证券投资基金、中信建投策略精选混合型证券投资基金、中信建投价值甄选混合型证券投资基金基金经理助理。

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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《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

2020年是非常特殊的跌宕起伏的一年，新冠病毒席卷全球，美国特朗普政府高举反全球化大旗打击多边贸易，各国政府和人民都不适应这些巨大的变化，资本市场同样反应剧烈。回溯A股，年初疫情爆发后，全球股市先是暴跌然后快速上涨，反应了经济利空的影响后对全球流动性释放的预期。板块机构上看，先是延续了半导体信创的自主可控逻辑，但当华为受到美国打压后，整个科技板块开始回调。而受益于疫情的食品饮料和医药行业迎来了主升浪行情。进入下半年，由于国内疫情控制很好，海外很多国家疫情也有所缓和，科技股先反弹了一波但马上又被美国加强对华为的制裁打断，而后反应经济复苏预期的顺周期板块开始上涨，并在疫苗面市之后得到了加强。然而随着进入冬季，海外二次疫情爆发，国内也开始零星出现局部感染地区，受益于疫情逻辑的医药板块伴随着强劲的中期业绩表现再次强势。此外，下半年新能源和电动车板块快速崛起，主要是本身较强的行业基本面叠加了碳中和以及欧洲新能源汽车刺激政策导致，实现了估值业绩双升的戴维斯双击。还有军工板块在下半年周边局势升温 and 十四五规划背景下也有一波非常强劲的表现。物联网基金在2020年主要还是以科技方向的投资为主，但受到了美国两次打压华为影响，科技板块表现实属一般，下半年观察到了新能源和电动车的机会，调整了持仓，但对其配置比例不够，导致净值表现差强人意。

#### 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2.0794元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为54.97%，同期业绩比较基准收益率为16.24%；截至报告期末中信建投智信物联网C基金份额净值为2.1502元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为54.35%，同期业绩比较基准收益率为16.24%。

#### 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2021年，虽然宏观局势可能不会像2020年那么复杂，但在累计涨幅较高、估值较高、预期经济回暖和全球流动性不会继续放松甚至开始收紧的背景下，股市的赚钱难度可能是远大于2020年的，我们应当降低收益预期，并做好波动较大的准备。

过去一年多来，市场逐渐形成了优选行业赛道，拥抱行业龙头的逻辑，实际上与之前所说的自上而下寻找景气行业结合自下而上寻找优质公司的逻辑无异。但行情发展到了后期，报团愈演愈烈，估值分化越显极致，我们理解这与流动性宽松和公募大型产品暴增有关。进入2021年，我们认为报团的趋势难以快速结束，但报团的品种和方向一定不是一成不变的，大市值的估值溢价已经非常高，中小市值优质公司的性价比已经越来越有吸引力。经济转好背景下，股价位置和估值相对较低的顺周期板块可能在业绩带动下有良好的表现。而前期一直表现较差的科技成长板块，也可能有局部行情，这主要看有哪些细分行业会迎来景气上行阶段，我们目前判断智能驾驶、VR/AR、AI、工业互联网等科技赋能产业升级的领域可能有机会。我们今年会加大调研力度，挖掘机遇，努力争取给投资者带来满意的回报。

#### 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

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，由公司分管运营领导任估值委员会主任，委员包括投资部、研究部、特定资产管理部、稽控合规部、运营管理部的部门负责人。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净

值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策和执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 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二十个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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2020年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，中信建投基金管理有限公司在中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金2020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(2021)第21615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	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>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“中信建投智信物联网基金”)的财务报表,包括2020年12月31日的资产负债表,2020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。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>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2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<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。</p> <p>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>

强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<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”)管理层对其他信息负责。其他信息包括中信建投智信物联网基金2020年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已经执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>中信建投智信物联网基金的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。</p> <p>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投智信物联网基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>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>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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</p>

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) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，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	薛竞	郭蕙心
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	2021-03-29	

## § 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：2020年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	56,266,508.35	30,631,936.09
结算备付金		1,596,807.32	58,270.16
存出保证金		410,456.79	41,995.01
交易性金融资产	7.4.7.2	632,737,324.45	125,584,090.00
其中：股票投资		632,464,650.53	125,584,090.00
基金投资		-	-
债券投资		272,673.92	-
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	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	5,576.60	3,406.64

应收股利		-	-
应收申购款		2,222,661.78	1,691,567.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		693,239,335.29	158,011,265.17
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年12月31日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		-	3,152,954.62
应付赎回款		19,574,765.45	4,661,995.93
应付管理人报酬		873,757.13	119,166.19
应付托管费		116,500.94	15,888.82
应付销售服务费		73,732.91	8,744.91
应付交易费用	7.4.7.7	408,167.91	88,367.68
应交税费		0.65	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	232,034.55	130,536.99
负债合计		21,278,959.54	8,177,655.14
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	319,852,944.53	110,461,748.12
未分配利润	7.4.7.10	352,107,431.22	39,371,861.91
所有者权益合计		671,960,375.75	149,833,610.03
负债和所有者权益总计		693,239,335.29	158,011,265.17

注：报告截止日2020年12月31日，基金份额总额319,852,944.53份。其中A类基金份额净值2.0794元，基金份额222,888,686.04份；C类基金份额净值2.1502元，基金份额96,964,258.49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：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年12月31日
一、收入		104,731,763.18	18,619,121.86
1. 利息收入		209,871.53	24,411.61
其中：存款利息收入	7.4.7.11	209,844.39	24,411.61
债券利息收入		27.14	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		17,687,816.19	5,548,644.67
其中：股票投资收益	7.4.7.12	15,830,263.05	5,454,435.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,857,553.14	94,208.89
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	77,044,720.66	12,587,175.15

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	9,789,354.80	458,890.43
<b>减：二、费用</b>		17,465,066.71	1,309,786.74
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	10,538,964.60	605,344.30
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,405,195.31	80,712.54
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	884,588.19	26,701.88
4. 交易费用	7.4.7.18	4,408,305.98	424,191.26
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.06	-
7. 其他费用	7.4.7.19	228,012.57	172,836.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		87,266,696.47	17,309,335.12
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		87,266,696.47	17,309,335.12

### 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：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020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）	110,461,748.12	39,371,861.91	149,833,610.03

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	87,266,696.47	87,266,696.47
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)	209,391,196.41	225,468,872.84	434,860,069.25
其中：1. 基金申购款	1,545,525,335.95	1,245,144,966.67	2,790,670,302.62
2. 基金赎回款	-1,336,134,139.54	-1,019,676,093.83	-2,355,810,233.37
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)	319,852,944.53	352,107,431.22	671,960,375.75
项 目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019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)	30,937,639.93	-6,715,787.93	24,221,852.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,309,335.12	17,309,335.12
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	79,524,108.19	28,778,314.72	108,302,422.91

列)			
其中：1. 基金申购款	174, 146, 605. 15	46, 263, 768. 07	220, 410, 373. 22
2. 基金赎回款	-94, 622, 496. 96	-17, 485, 453. 35	-112, 107, 950. 31
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）	110, 461, 748. 12	39, 371, 861. 91	149, 833, 610. 03

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：

黄凌

谭淼

谭保民

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。

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、存托凭证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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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<年度和中期报告>》、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2020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2020年12月31日的财务状况以及2020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。

##### 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、资产支持证券投资和衍生工具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变动计入当期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款和其他各类应付款项等。

##### 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、资产支持证券投资和衍生工具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。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 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及由基金管理人缴纳的增值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，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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、债券投资和资产支持证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）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发〔2017〕6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

（3）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债金融估值中心有限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估计变更。

##### 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〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、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》、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》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	56,266,508.35	30,631,936.09
定期存款	-	-
其中:存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	56,266,508.35	30,631,936.09

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	545,347,136.72	632,464,650.53	87,117,513.81
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	214,400.00	272,673.92
	银行间市场	-	-
	合计	214,400.00	272,673.92

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	545,561,536.72	632,737,324.45	87,175,787.73
项目	上年度末2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	115,453,022.93	125,584,090.00	10,131,067.07
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	115,453,022.93	125,584,090.00	10,131,067.07

#### 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

无余额。

##### 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	4,540.39	3,355.90

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	790.46	28.82
应收债券利息	27.73	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	14.85	1.13
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	203.17	20.79
合计	5,576.60	3,406.64

#### 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	408,167.91	88,367.68
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	408,167.91	88,367.68

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	32,034.55	536.99
预提费用	200,000.00	130,000.00
合计	232,034.55	130,536.99

### 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2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	78,960,256.43	78,960,256.43
本期申购	966,947,789.56	966,947,789.56
本期赎回(以“-”号填列)	-823,019,359.95	-823,019,359.95
本期末	222,888,686.04	222,888,686.04

#### 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 (中信建投智信物联网C)	本期2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	31,501,491.69	31,501,491.69
本期申购	578,577,546.39	578,577,546.39
本期赎回(以“-”号填列)	-513,114,779.59	-513,114,779.59
本期末	96,964,258.49	96,964,258.49

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

### 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	-182,875.15	27,172,650.70	26,989,775.55
本期利润	6,182,763.43	63,197,420.27	69,380,183.70
本期基金份额交易产生的变动数	5,536,115.04	138,671,374.51	144,207,489.55
其中：基金申购款	-53,864,924.39	807,986,842.75	754,121,918.36
基金赎回款	59,401,039.43	-669,315,468.24	-609,914,428.81

本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,536,003.32	229,041,445.48	240,577,448.80

#### 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	1,438,582.93	10,943,503.43	12,382,086.36
本期利润	4,039,212.38	13,847,300.39	17,886,512.77
本期基金份额交易产生的变动数	3,663,234.81	77,598,148.48	81,261,383.29
其中：基金申购款	-11,942,469.82	502,965,518.13	491,023,048.31
基金赎回款	15,605,704.63	-425,367,369.65	-409,761,665.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,141,030.12	102,388,952.30	111,529,982.42

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年12月31日
活期存款利息收入	174,748.09	21,497.39
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	27,052.11	2,296.24
其他	8,044.19	617.98
合计	209,844.39	24,411.61

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年
----	-------------------------	------------------------------

	12月31日	12月31日
卖出股票成交总额	1,822,450,951.33	159,005,275.40
减：卖出股票成本总额	1,806,620,688.28	153,550,839.62
买卖股票差价收入	15,830,263.05	5,454,435.78

#### 7.4.7.13 债券投资收益

无。

#### 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 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
股票投资产生的股利收益	1,857,553.14	94,208.89
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,857,553.14	94,208.89

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12 月31日
1. 交易性金融资产	77,044,720.66	12,587,175.15
——股票投资	76,986,446.74	12,587,175.15
——债券投资	58,273.92	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-

——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	77,044,720.66	12,587,175.15

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
基金赎回费收入	9,787,630.03	458,890.43
转换费收入	1,724.77	-
合计	9,789,354.80	458,890.43

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额中归入基金资产的比例按持有期间递减且不低于25%。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
交易所市场交易费用	4,408,305.98	424,191.26
银行间市场交易费用	-	-
合计	4,408,305.98	424,191.26

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
审计费用	80,000.00	50,000.00

信息披露费	120,000.00	80,000.00
汇划手续费	2,812.57	5,636.76
账户维护费	25,200.00	37,200.00
合计	228,012.57	172,836.76

#### 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
航天科技财务有限责任公司	基金管理人的股东
江苏广传广播传媒有限公司	基金管理人的股东
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中信建投期货有限公司	与基金管理人同一控股股东、基金销售机构

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 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019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	2,685,475,865.41	66.36%	212,927,899.49	51.42%

证券股份 有限公司				
--------------	--	--	--	--

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020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	1,426,791.74	65.38%	405,939.54	99.45%
关联方名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019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	113,128.74	49.52%	81,174.88	91.86%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、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。

#### 7.4.10.2 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 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至 2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,538,964.60	605,344.30
其中：支付销售机构的客户维护费	5,057,947.79	301,460.51

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 2020年01月01日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,405,195.31	80,712.54

注：支付基金托管人中信银行股份有限公司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 2020年01月01日至2020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A	中信建投智信物联网C	合计
中信建投 基金管理	0.00	3,489.32	3,489.32

有限公司			
中信建投 证券股份 有限公司	0.00	96,047.09	96,047.09
中信建投 期货有限 公司	0.00	88.07	88.07
合计	0.00	99,624.48	99,624.48
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019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A	中信建投智信物联网C	合计
中信建投 基金管理 有限公司	0.00	44.87	44.87
中信建投 证券股份 有限公司	0.00	251.03	251.03
合计	0.00	295.90	295.90

注：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0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，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：

日销售服务费=前一日C类的基金资产净值 × 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 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019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	56,266,508.35	174,748.09	30,631,936.09	21,497.39

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，按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

金额单位：人民币元

本期 2020年01月01日至2020年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中信建投证券股份有限公司	688063	派能科技	网下配售	5,370	300,720.00
中信建投证券股份有限公司	688608	恒玄科技	网下配售	2,089	338,564.23

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—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

无。

7.4.12 期末（2020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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688133	泰坦科技	2020-10-22	2021-04-30	科创板打新限售	44.47	116.54	2,527	112,375.69	294,496.58	-
688556	高测股份	2020-07-29	2021-02-08	科创板打新限售	14.41	26.93	6,896	99,371.36	185,709.28	-
300896	爱美客	2020-09-21	2021-03-29	创业板打新限售	118.27	603.36	294	34,771.38	177,387.84	-
688155	先惠技术	2020-08-03	2021-02-18	科创板打新限售	38.77	67.26	2,403	93,164.31	161,625.78	-
688378	奥来德	2020-08-26	2021-03-03	科创板打新限售	62.57	53.48	2,411	150,856.27	128,940.28	-
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-01-07	新股未上市	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
688557	兰剑智能	2020-11-25	2021-06-02	科创板打新限售	27.70	32.75	1,812	50,192.40	59,343.00	-

				售						
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	创业板打新限售	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300900	广联航空	2020-10-19	2021-04-29	创业板打新限售	17.87	33.16	879	15,707.73	29,147.64	-
300871	回盛生物	2020-08-13	2021-02-24	创业板打新限售	33.61	38.70	618	20,770.98	23,916.60	-
300910	瑞丰新材	2020-11-20	2021-05-27	创业板打新限售	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	-
300873	海晨股份	2020-08-14	2021-03-02	创业板打新限售	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300891	惠云钛业	2020-09-10	2021-03-17	创业板打新限售	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300898	熊猫乳品	2020-10-09	2021-04-16	创业板打新限售	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300909	汇创达	2020-11-	2021-05-	创业板打	29.57	40.67	386	11,414.0	15,698.6	-

		11	18	新限售				2	2	
300887	谱尼测试	2020-09-09	2021-03-16	创业板打新限售	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300864	南大环境	2020-08-13	2021-02-25	创业板打新限售	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
300889	爱克股份	2020-09-09	2021-03-16	创业板打新限售	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020-09-10	2021-03-18	创业板打新限售	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300902	国安达	2020-10-22	2021-04-29	创业板打新限售	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	-
300925	法本信息	2020-12-21	2021-06-30	创业板打新限售	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-
300895	铜牛信息	2020-09-17	2021-03-24	创业板打新限售	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300876	蒙泰高新	2020-08-14	2021-02-25	创业板打新限售	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-

300879	大叶股份	2020-08-25	2021-03-01	创业板打新限售	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300882	万胜智能	2020-08-27	2021-03-10	创业板打新限售	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300911	亿田智能	2020-11-24	2021-06-03	创业板打新限售	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300893	松原股份	2020-09-17	2021-03-24	创业板打新限售	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300918	南山智尚	2020-12-15	2021-06-22	创业板打新限售	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300881	盛德鑫泰	2020-08-25	2021-03-05	创业板打新限售	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300886	华业香料	2020-09-08	2021-03-16	创业板打新限售	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人，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

无余额。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	272,673.92	-
未评级	-	-
合计	272,673.92	-

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。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

#### 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2020年12月31日，除附注7.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息（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，因此账面余额约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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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%。于2020年12月31日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未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。于2020年12月31日，本基金确认的净赎回申请未超过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。

#### 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主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	56,266,508.35	-	-	-	56,266,508.35
结算备付金	1,596,807.32	-	-	-	1,596,807.32
存出保证金	410,456.79	-	-	-	410,456.79
交易性金融资产	-	-	272,673.92	632,464,650.53	632,737,324.45
应收利息	-	-	-	5,576.60	5,576.60
应收申购款	-	-	-	2,222,661.78	2,222,661.78
资产总计	58,273,772.46	-	272,673.92	634,692,888.91	693,239,335.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	19,574,765.45	19,574,765.45
应付管理人报酬	-	-	-	873,757.13	873,757.13
应付托管费	-	-	-	116,500.94	116,500.94
应付销售服务费	-	-	-	73,732.91	73,732.91
应付交易费用	-	-	-	408,167.91	408,167.91
应交税费	-	-	-	0.65	0.65
其他负债	-	-	-	232,034.55	232,034.55
负债总计	-	-	-	21,278,959.54	21,278,959.54
利率敏感度缺口	58,273,772.46	-	272,673.92	613,413,929.37	671,960,375.75
上年度末2019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	30,631,936.09	-	-	-	30,631,936.09

结算备付金	58,270.16	-	-	-	58,270.16
存出保证金	41,995.01	-	-	-	41,995.01
交易性金融资产	-	-	-	125,584,090.00	125,584,090.00
应收利息	-	-	-	3,406.64	3,406.64
应收申购款	-	-	-	1,691,567.27	1,691,567.27
资产总计	30,732,201.26	-	-	127,279,063.91	158,011,265.17
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,152,954.62	3,152,954.62
应付赎回款	-	-	-	4,661,995.93	4,661,995.93
应付管理人报酬	-	-	-	119,166.19	119,166.19
应付托管费	-	-	-	15,888.82	15,888.82
应付销售服务费	-	-	-	8,744.91	8,744.91
应付交易费用	-	-	-	88,367.68	88,367.68
其他负债	-	-	-	130,536.99	130,536.99
负债总计	-	-	-	8,177,655.14	8,177,655.14
利率敏感度缺口	30,732,201.26	-	-	119,101,408.77	149,833,610.03

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2020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0.04%(2019年12月31日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019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 2020年12月31日		上年度末 2019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	632,464,650.53	94.12	125,584,090.00	83.82
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	632,464,650.53	94.12	125,584,090.00	83.82

#### 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准上升5%	41,661,543.30	11,428,698.06
	业绩比较基准下降5%	-41,661,543.30	-11,428,698.06

#### 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2020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631,239,293.48元，属于第二层次的余额为 1,498,030.97元，无属于第三层次的余额(2019年12月31日：第一层次125,584,090.00元，无第二或第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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2020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(2019年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，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	632,464,650.53	91.23
	其中：股票	632,464,650.53	91.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	272,673.92	0.04
	其中：债券	272,673.92	0.04
	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	57,863,315.67	8.35
8	其他各项资产	2,638,695.17	0.38
9	合计	693,239,335.29	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	386,766,174.74	57.56
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	19,998.88	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	245,353,250.03	36.51
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	310,145.78	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	15,081.10	0.00
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	632,464,650.53	94.12

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

## 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(元)	占基金资产
----	------	------	-------	---------	-------

					产净 值比 例(%)
1	300379	东方通	1,500,020	68,550,914.00	10.20
2	300014	亿纬锂能	800,000	65,200,000.00	9.70
3	000066	中国长城	3,200,000	60,768,000.00	9.04
4	300659	中孚信息	1,199,958	58,893,938.64	8.76
5	688111	金山办公	140,000	57,540,000.00	8.56
6	300750	宁德时代	100,000	35,111,000.00	5.23
7	002475	立讯精密	600,000	33,672,000.00	5.01
8	300073	当升科技	500,000	32,425,000.00	4.83
9	600536	中国软件	400,000	31,504,000.00	4.69
10	300433	蓝思科技	1,000,000	30,610,000.00	4.56
11	002460	赣锋锂业	300,000	30,360,000.00	4.52
12	300207	欣旺达	712,100	21,868,591.00	3.25
13	300598	诚迈科技	180,000	21,578,400.00	3.21
14	603501	韦尔股份	70,000	16,177,000.00	2.41
15	002241	歌尔股份	400,000	14,928,000.00	2.22
16	002138	顺络电子	600,000	14,712,000.00	2.19
17	002600	领益智造	1,000,000	11,990,000.00	1.78
18	603019	中科曙光	330,900	11,326,707.00	1.69
19	688095	福昕软件	30,000	7,260,000.00	1.08
20	688388	嘉元科技	40,000	3,525,600.00	0.52
21	688063	派能科技	5,370	1,388,789.40	0.21
22	688608	恒玄科技	2,089	691,459.00	0.10
23	688686	奥普特	2,330	505,144.00	0.08
24	688133	泰坦科技	2,527	294,496.58	0.04
25	688510	航亚科技	5,991	212,261.13	0.03
26	688556	高测股份	6,896	185,709.28	0.03
27	300896	爱美客	294	177,387.84	0.03
28	688155	先惠技术	2,403	161,625.78	0.02

29	688378	奥来德	2,411	128,940.28	0.02
30	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.02
31	688698	伟创电气	4,751	84,995.39	0.01
32	688571	杭华股份	8,200	82,820.00	0.01
33	688557	兰剑智能	1,812	59,343.00	0.01
34	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.01
35	300900	广联航空	879	29,147.64	0.00
36	300871	回盛生物	618	23,916.60	0.00
37	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00
38	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
39	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
40	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
41	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
42	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
43	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
44	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
45	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
46	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
47	300925	C法本	353	13,177.49	0.00
48	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
49	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
50	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
51	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
52	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
53	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
54	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
55	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
56	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00

## 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	600438	通威股份	81,120,879.68	54.14
2	300598	诚迈科技	74,330,525.20	49.61
3	688111	金山办公	72,603,537.84	48.46
4	300379	东方通	69,992,235.08	46.71
5	600536	中国软件	64,460,725.67	43.02
6	300014	亿纬锂能	64,453,967.26	43.02
7	300659	中孚信息	61,204,834.00	40.85
8	000063	中兴通讯	57,447,834.91	38.34
9	300465	高伟达	56,229,198.00	37.53
10	000066	中国长城	54,866,821.16	36.62
11	002475	立讯精密	48,011,487.62	32.04
12	002138	顺络电子	46,951,289.59	31.34
13	002180	纳思达	45,861,209.80	30.61
14	300750	宁德时代	44,839,553.00	29.93
15	300352	北信源	40,563,923.12	27.07
16	688058	宝兰德	39,982,650.26	26.68
17	002456	欧菲光	39,380,919.20	26.28
18	000100	TCL科技	38,151,206.98	25.46
19	000725	京东方A	36,286,662.00	24.22
20	002460	赣锋锂业	35,040,445.91	23.39
21	300073	当升科技	34,214,067.08	22.83
22	300433	蓝思科技	32,873,477.86	21.94
23	603738	泰晶科技	32,236,875.33	21.52
24	603659	璞泰来	30,434,307.96	20.31
25	603019	中科曙光	29,460,272.04	19.66
26	600406	国电南瑞	29,179,463.00	19.47

27	000636	风华高科	28,844,058.60	19.25
28	002065	东华软件	27,175,823.00	18.14
29	300674	宇信科技	26,436,826.00	17.64
30	002028	思源电气	26,391,012.00	17.61
31	688258	卓易信息	26,192,761.98	17.48
32	300059	东方财富	25,675,146.24	17.14
33	600584	长电科技	25,300,470.51	16.89
34	000555	神州信息	24,945,052.99	16.65
35	002241	歌尔股份	24,203,863.41	16.15
36	300207	欣旺达	23,973,333.00	16.00
37	300460	惠伦晶体	23,896,031.00	15.95
38	300663	科蓝软件	23,219,200.00	15.50
39	000034	神州数码	22,954,491.35	15.32
40	300033	同花顺	22,580,552.60	15.07
41	300348	长亮科技	21,590,361.50	14.41
42	002371	北方华创	21,279,898.00	14.20
43	603232	格尔软件	18,222,656.64	12.16
44	600984	建设机械	17,911,328.44	11.95
45	300677	英科医疗	17,841,944.60	11.91
46	300037	新宙邦	16,590,687.00	11.07
47	002850	科达利	16,208,256.00	10.82
48	002368	太极股份	16,085,844.64	10.74
49	300136	信维通信	15,147,680.57	10.11
50	300365	恒华科技	13,878,998.00	9.26
51	603501	韦尔股份	13,171,284.33	8.79
52	002600	领益智造	13,006,475.00	8.68
53	601012	隆基股份	12,558,727.00	8.38
54	300579	数字认证	11,792,334.00	7.87
55	300455	康拓红外	11,602,841.88	7.74
56	688158	优刻得	11,489,205.68	7.67
57	002129	中环股份	10,950,000.00	7.31

58	000830	鲁西化工	10,682,281.48	7.13
59	000977	浪潮信息	10,397,339.36	6.94
60	603195	公牛集团	10,396,159.30	6.94
61	300408	三环集团	10,375,903.00	6.92
62	600563	法拉电子	9,935,157.00	6.63
63	002156	通富微电	9,787,972.00	6.53
64	600640	号百控股	9,680,119.00	6.46
65	002273	水晶光电	9,463,140.72	6.32
66	600183	生益科技	9,446,660.94	6.30
67	300782	卓胜微	9,389,512.00	6.27
68	002268	卫士通	9,273,287.45	6.19
69	688095	福昕软件	8,521,498.38	5.69
70	002466	天齐锂业	8,512,277.00	5.68
71	688012	中微公司	8,483,637.02	5.66
72	300541	先进数通	8,313,485.10	5.55
73	000009	中国宝安	8,303,523.77	5.54
74	300088	长信科技	8,068,200.00	5.38
75	002938	鹏鼎控股	7,896,639.92	5.27
76	600884	杉杉股份	7,891,542.00	5.27
77	600570	恒生电子	7,869,224.57	5.25
78	002518	科士达	7,305,809.00	4.88
79	688006	杭可科技	7,124,435.77	4.75
80	002128	露天煤业	6,900,704.00	4.61
81	002508	老板电器	6,595,804.44	4.40
82	688388	嘉元科技	6,417,752.26	4.28
83	300545	联得装备	6,197,835.00	4.14
84	300388	国祯环保	5,921,853.65	3.95
85	600728	佳都科技	5,698,700.00	3.80
86	688981	中芯国际	5,100,000.00	3.40
87	000570	苏常柴A	4,995,205.00	3.33
88	300159	新研股份	4,982,183.00	3.33

89	300568	星源材质	4,716,971.24	3.15
90	603283	赛腾股份	4,599,653.00	3.07
91	688039	当虹科技	4,539,282.96	3.03
92	002438	江苏神通	4,478,029.00	2.99
93	300562	乐心医疗	4,332,669.00	2.89
94	688018	乐鑫科技	4,250,752.14	2.84
95	600741	华域汽车	4,239,054.00	2.83
96	600305	恒顺醋业	4,098,757.00	2.74
97	002185	华天科技	4,034,074.04	2.69
98	600009	上海机场	3,856,032.00	2.57
99	300712	永福股份	3,763,881.00	2.51
100	601615	明阳智能	3,753,004.00	2.50
101	600216	浙江医药	3,657,310.00	2.44
102	300772	运达股份	3,586,684.00	2.39
103	002531	天顺风能	3,502,552.00	2.34
104	603218	日月股份	3,489,765.00	2.33
105	000021	深科技	3,464,527.00	2.31
106	605358	立昂微	3,333,669.20	2.22
107	688390	固德威	3,248,049.05	2.17
108	300316	晶盛机电	3,161,467.00	2.11

#### 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	600438	通威股份	99,499,882.36	66.41
2	300014	亿纬锂能	70,792,996.27	47.25
3	000063	中兴通讯	66,974,025.00	44.70
4	300465	高伟达	56,401,413.60	37.64
5	300750	宁德时代	50,668,902.96	33.82
6	600406	国电南瑞	41,815,853.89	27.91

7	002456	欧菲光	40,190,608.94	26.82
8	300352	北信源	38,864,449.00	25.94
9	688111	金山办公	38,249,892.66	25.53
10	002180	纳思达	37,633,921.08	25.12
11	603659	璞泰来	37,164,131.21	24.80
12	300674	宇信科技	35,108,585.18	23.43
13	688058	宝兰德	34,194,719.90	22.82
14	000725	京东方 A	30,446,510.00	20.32
15	002475	立讯精密	30,003,475.31	20.02
16	000100	TCL科技	29,348,624.87	19.59
17	603738	泰晶科技	28,375,698.00	18.94
18	300059	东方财富	27,423,127.24	18.30
19	002065	东华软件	27,134,100.00	18.11
20	002460	赣锋锂业	27,028,757.00	18.04
21	600584	长电科技	26,147,844.35	17.45
22	002028	思源电气	25,421,337.00	16.97
23	000555	神州信息	25,337,117.90	16.91
24	601012	隆基股份	24,284,043.86	16.21
25	002138	顺络电子	23,798,123.76	15.88
26	688258	卓易信息	23,060,120.25	15.39
27	300663	科蓝软件	23,045,926.60	15.38
28	300348	长亮科技	22,738,244.38	15.18
29	300598	诚迈科技	22,362,895.51	14.93
30	000636	风华高科	20,975,461.00	14.00
31	002156	通富微电	20,948,459.00	13.98
32	300677	英科医疗	20,842,717.96	13.91
33	300033	同花顺	20,815,833.00	13.89
34	002371	北方华创	20,315,363.00	13.56
35	600536	中国软件	19,634,794.00	13.10
36	300037	新宙邦	19,417,753.00	12.96
37	000034	神州数码	18,320,377.92	12.23

38	600984	建设机械	18,209,792.68	12.15
39	002368	太极股份	17,910,170.31	11.95
40	603019	中科曙光	17,799,179.36	11.88
41	603232	格尔软件	17,724,149.52	11.83
42	002185	华天科技	17,448,963.44	11.65
43	002850	科达利	17,302,719.30	11.55
44	300460	惠伦晶体	16,768,811.06	11.19
45	300073	当升科技	15,311,561.00	10.22
46	600570	恒生电子	12,375,112.38	8.26
47	300365	恒华科技	11,610,053.00	7.75
48	000977	浪潮信息	11,554,973.57	7.71
49	000830	鲁西化工	11,543,422.00	7.70
50	002129	中环股份	10,840,360.00	7.23
51	300136	信维通信	10,803,796.00	7.21
52	688158	优刻得	10,782,617.73	7.20
53	300782	卓胜微	10,366,736.00	6.92
54	600884	杉杉股份	10,257,748.06	6.85
55	300579	数字认证	10,164,527.00	6.78
56	002241	歌尔股份	10,163,955.00	6.78
57	603195	公牛集团	9,983,600.00	6.66
58	002268	卫士通	9,837,271.82	6.57
59	300455	康拓红外	8,908,287.00	5.95
60	688006	杭可科技	8,728,990.87	5.83
61	603986	兆易创新	8,623,595.00	5.76
62	688012	中微公司	8,552,497.80	5.71
63	600183	生益科技	8,253,080.00	5.51
64	002273	水晶光电	8,003,942.16	5.34
65	002466	天齐锂业	7,960,585.00	5.31
66	600563	法拉电子	7,845,355.00	5.24
67	600640	号百控股	7,738,489.00	5.16
68	002508	老板电器	7,590,552.00	5.07

69	300408	三环集团	7,377,585.00	4.92
70	002518	科士达	7,322,505.00	4.89
71	002128	露天煤业	7,023,920.00	4.69
72	002938	鹏鼎控股	6,712,213.96	4.48
73	300388	国祯环保	6,567,119.00	4.38
74	300541	先进数通	6,536,875.86	4.36
75	000009	中国宝安	6,264,128.30	4.18
76	600728	佳都科技	5,801,250.00	3.87
77	300088	长信科技	5,613,000.00	3.75
78	300545	联得装备	5,346,153.00	3.57
79	688388	嘉元科技	5,231,100.14	3.49
80	300568	星源材质	5,120,908.00	3.42
81	002438	江苏神通	5,053,680.00	3.37
82	603005	晶方科技	4,980,000.00	3.32
83	000570	苏常柴 A	4,737,658.52	3.16
84	605358	立昂微	4,690,600.00	3.13
85	600305	恒顺醋业	4,486,100.60	2.99
86	688390	固德威	4,484,549.48	2.99
87	600741	华域汽车	4,121,495.00	2.75
88	603283	赛腾股份	4,050,421.00	2.70
89	688981	中芯国际	4,012,800.00	2.68
90	300159	新研股份	3,910,057.00	2.61
91	600009	上海机场	3,785,825.00	2.53
92	688039	当虹科技	3,747,207.10	2.50
93	300712	永福股份	3,596,870.00	2.40
94	600216	浙江医药	3,579,945.00	2.39
95	300316	晶盛机电	3,517,952.00	2.35
96	300562	乐心医疗	3,430,638.00	2.29
97	601615	明阳智能	3,230,516.00	2.16
98	000021	深科技	3,094,265.00	2.07

### 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	2,238,997,931.67
卖出股票收入（成交）总额	1,822,450,951.33

### 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)	272,673.92	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	272,673.92	0.04

### 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	128136	立讯转债	2,144	272,673.92	0.04

### 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

无余额。

### 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

无余额。

### 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

无余额。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

### 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	410,456.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,576.60
5	应收申购款	2,222,661.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,638,695.17

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

### 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	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中信建投智信物联网A	37,245	5,984.39	257,935.79	0.1157%	222,630,750.25	99.8843%
中信建投智信物联网C	21,647	4,479.34	183,489.75	0.1892%	96,780,768.74	99.8108%
合计	57,238	5,588.12	441,425.54	0.138%	319,411,518.99	99.862%

### 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	210,694.27	0.0945%
	中信建投智信物联网C	367,708.41	0.3792%
	合计	578,402.68	0.1808%

### 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	0
	中信建投智信物联网C	10~50
	合计	10~50
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	78,960,256.43	31,501,491.69
本报告期基金总申购份额	966,947,789.56	578,577,546.39
减：本报告期基金总赎回份额	823,019,359.95	513,114,779.59
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	222,888,686.04	96,964,258.49

### § 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

2020年5月22日，邱黎强先生不再担任基金管理人总经理，董事长蒋月勤先生代行总经理职务。

2020年5月31日，周建萍女士不再担任基金管理人副总经理。

2020年6月19日，金强先生担任基金管理人总经理，董事长蒋月勤先生不再代行总经理职务。

2020年12月30日，袁野先生不再担任基金管理人常务副总经理。

本报告期内，基金托管人于2020年10月9日任命杨璋琪先生担任基金托管人资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，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80,000.00元整，该审计机构自2016年8月3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

本报告期内，基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	
广发证券	1	495,902,386.03	12.25%	263,473.44	12.07%	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	540,704,661.22	13.36%	287,278.41	13.16%	-
招商证券	1	324,535,771.41	8.02%	204,878.02	9.39%	-

中信建投证券	2	2,685,475,865.41	66.36%	1,426,791.74	65.38%	-
--------	---	------------------	--------	--------------	--------	---

### 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

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
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字〔2007〕48号）的规定及本基金管理人的《中信建投基金管理有限公司公募基金交易单元管理办法》，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公司投资部负责人根据证券经纪商投资研究服务综合评价，作出交易单元开设或撤销的相关决定。经公司分管领导通过后，方可办理相关的交易单元开设或撤销事宜。

（2）投资部每季度组织相关部门完成对各往来证券经纪商的研究服务评估。投资部根据评估结果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)=基础研究服务(70%)+特别研究服务(15%)+综合研究服务(15%)。

基础研究服务占70%权重，由投资部负责人、研究部负责人、基金经理和研究员负责打分；特别研究服务占15%权重，由系统跟踪股票涨跌幅后生成得分；综合研究服务

占15%权重，由投资部负责人、研究部负责人和投资部行政秘书负责打分。

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。

### 11.8 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	关于中信建投基金管理有限 公司旗下部分证券投资基金 修改基金合同和托管协议的 公告	中国证监会规定报刊及规定 网站	2020-01-15
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、托管协议（2020年1 月）	中国证监会规定网站	2020-01-15
3	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）及摘要（20 20年1月）	中国证监会规定网站	2020-01-17
4	中信建投基金管理有限公司 旗下部分基金2019年第4季 度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2020-01-18
5	中信建投智信物联网灵活配 置混合型证券投资基金2019 年第4季度报告	中国证监会规定网站	2020-01-18
6	关于中信建投智信物联网灵 活配置混合型证券投资基金 在珠海盈米基金销售有限 公司开通定投业务及开展费率 优惠的公告	中国证监会规定报刊及规定 网站	2020-01-21
7	中信建投基金管理有限公司 关于旗下部分基金开通定投 业务及开展费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及规定 网站	2020-02-12
8	中信建投基金管理有限公司 关于增加中信建投期货有限	中国证监会规定报刊及规定 网站	2020-02-26

	公司为旗下部分基金代销机构并开通定投业务及开展费率优惠的公告		
9	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大连网金基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务及开展费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-02-27
10	中信建投基金管理有限公司关于增加信达证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投业务及开展费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-03-09
11	中信建投基金管理有限公司关于延期披露旗下公募基金2019年年度报告的公告	中国证监会规定报刊及规定网站、上交所网站	2020-03-24
12	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	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-03-27
13	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信建投期货有限公司开通定投业务及开展费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-04-15
14	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2019年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2020-04-17
15	中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金2019年年度报告	中国证监会规定网站	2020-04-17
16	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金2020年第1季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2020-04-22
17	中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金2020	中国证监会规定网站	2020-04-22

	年第1季度报告		
18	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金在北京汇成基金销售有限公司开通定投业务及开展费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-04-30
19	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金增加代销机构并开通定投业务及开展费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-05-06
20	中信建投基金管理有限公司关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-05-14
21	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站、上交所网站	2020-05-23
22	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站、上交所网站	2020-06-02
23	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站、上交所网站	2020-06-20
24	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	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-06-23
25	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加江海证券有限公司为代销机构并开通定投业务及开展费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-07-20
26	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2020年第2季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2020-07-21
27	中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金2020	中国证监会规定网站	2020-07-21

	年第2季度报告		
28	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加恒泰证券股份有限公司为代销机构并开通定投业务及开展费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-07-30
29	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为代销机构并开通定投业务及开展费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-08-07
30	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金在直销中心及网上直销平台开展费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-08-12
31	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-08-14
32	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金在植信基金开通定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-08-14
33	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2020年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2020-08-31
34	中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金2020年中期报告	中国证监会规定网站	2020-08-31
35	中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定网站	2020-09-01
36	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东吴证券股份有限公司为代销机	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-10-27

	构并调整申购起点金额及开通定投业务、开展费率优惠的公告		
37	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2020年第3季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2020-10-28
38	中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金2020年第3季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-10-28
39	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-11-03
40	中信建投基金管理有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-11-03
41	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-12-08
42	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金修订基金合同、托管协议的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-12-11
43	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（2020年12月）	中国证监会规定网站	2020-12-11
44	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（2020年12月）	中国证监会规定网站	2020-12-11
45	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金调整通过中信银行申购及定期定额投资起点金额的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-12-11

46	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（2020年12月）	中国证监会规定网站	2020-12-16
47	中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新（2020年12月）	中国证监会规定网站	2020-12-16
48	中信建投基金管理有限公司关于暂停深圳前海汇联基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-12-23
49	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-12-23
50	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加江苏汇林保大基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-12-30
51	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2020-12-31

## § 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

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 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

基金管理人及基金托管人住所。

### 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  
二〇二一年三月三十一日