

(上接 D28 版)

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
电话:010-59013825
联系人:邵玉磊
网址:www.vanjiawealth.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

8815 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:贾海霞
联系电话:0755-86722853
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
电话:0755-83516089
传真:0755-83515567
联系人:李春芳
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
传真:010-59287825
联系人:郭宝亮
网址:www.gomefund.com
客户服务电话:400-111-0889
(37)上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路 555 号裕景国际 B 座 16 层
法定代表人:张跃伟
电话:021-20691832
传真:021-20691861
联系人:黄辉
网址:www.eichfund.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 17 号
法定代表人:张东宁
电话:010-66225518
传真:010-66226045
联系人:韩裕
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
电话:010-63130889-8369
传真:010-58325282
联系人:刘宝文
网址:8jj.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
电话:0755-83198888
传真:0755-83195109
联系人:邓桐鹏
网址:www.cmbchina.com
客户服务电话:95555
(41)宜信普泽投资顾问(北京)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
电话:010-52855713
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
电话:15298383910
传真:025-66008800-887226
联系人:张慧
网址:www.snjjm.com
客户服务电话:95177
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: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
办公地址:上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
法定代表人:杨绍信
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:张勇
经办注册会计师:许康玮、张勇

四、基金的名称
中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金
五、基金的类型
混合型证券投资基金
六、基金的运作方式
契约型开放式
七、基金的投资目标
本基金主要投资于股票等权益类资产和债券等固定收益类金融工具,通过灵活的资产配置与严谨的风险管理,力争实现基金资产持续稳定增值。

八、基金的投资范围
本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具,债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)及法律法规和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,基金管理人可在履

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所需缴纳的交易保证金后,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及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的都已具备的条件下,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上市公司;第二类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价值,选择财务和经营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,形成对标的股票的前初步判断。接下来,基金管理人将通过对产业链头研究和实地调研等基本研究方法,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、盈利能力、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。
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、收益率较高、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,以该资产所产生的现金流支付其收益的证券。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作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。中债综合指数的选择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真实反映本基金的风险收益特征。
如果今后市场中出现更具有代表性的业绩比较基准,或者更科学的业绩比较基准,或者中国人民银行调整或停止该基准利率的发布,基金管理人认为有必要作相应调整时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,经与基金托管人协商一致后,变更本基金的业绩比较基准,报中国证监会备案并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。
十一、基金的风险收益特征
本基金属于混合型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中中高预期风险、中高预期收益的品种。
十二、基金的投资组合报告
基金管理人、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基金合同规定,于 2018 年 8 月复核了本报告投资组合报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本报告投资组合报告所载数据截至 2018 年 6 月 30 日(摘自本基金 2018 年第 2 季度报告),本报告中所列财务数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况
Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

2.报告期末按行业分类的股票投资组合
(1)报告期末按行业分类的境内股票投资组合
Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

(2)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
Table with 4 columns: 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(%)

4.报告期末按债券品种和分类的债券投资组合
Table with 4 columns: 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(%)

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
Table with 4 columns: 序号, 名称, 金额(元)

6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
Table with 4 columns: 序号, 名称, 金额(元)

7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
Table with 4 columns: 序号, 名称, 金额(元)

8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
Table with 4 columns: 序号, 名称, 金额(元)

9.报告期末本基金持有的股指期货交易情况说明
(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
Table with 4 columns: 序号, 名称, 金额(元)

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
(1)本期国债期货投资政策
Table with 4 columns: 序号, 名称, 金额(元)

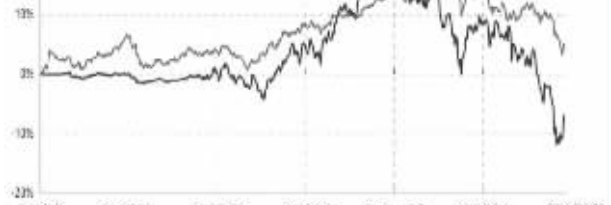
11.投资组合报告附注
(1)报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体因涉嫌违法违规行为立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
(2)本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。
(3)其他资产构成
Table with 4 columns: 序号, 名称, 金额(元)

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
Table with 4 columns: 序号, 名称, 金额(元)

十二、基金的业绩
基金业绩截止日为 2018 年 6 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
Table with 5 columns: 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, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④

中信建投智信物联网 C
Table with 5 columns: 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, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④



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 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(首份份额登记日)至 2018 年 6 月 30 日。

十四、基金的费用和税收
(一)基金费用的种类
1.基金管理人的管理费;
2.基金托管人的托管费;
3.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事务所、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×1.50%÷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×0.20%÷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 类基金份额的基金资产净值的 0.40%年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.40%÷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 类基金份额的基金资产净值
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“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项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。
十五、对招募说明书更新部分的说明
本更新的招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,对《中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》进行了更新,本更新招募说明书主要更新的内容如下:

- 1.针对“重要提示”部分,更新了重要提示相关信息。
2.针对“第一部分 绪言”部分,更新了第一部分 绪言相关信息。
3.针对“第二部分 释义”部分,更新了第二部分 释义相关信息。
4.针对“第三部分 基金管理人”部分,更新了第三部分 基金管理人相关信息。
5.针对“第四部分 基金托管人”部分,更新了第四部分 基金托管人相关信息。
6.针对“第五部分 相关服务机构”部分,更新了第五部分 相关服务机构相关信息。
7.针对“第八部分 基金份额的申购与赎回”部分,更新了第八部分 基金份额的申购与赎回相关信息。
8.针对“第九部分 基金的投资”部分,更新了第九部分 基金的投资相关信息。
9.针对“第十部分 基金的业绩”部分,更新了第十部分 基金的业绩相关信息。
10.针对“第十二部分 基金资产估值”部分,更新了第十二部分 基金资产估值相关信息。
11.针对“第十七部分 风险揭示”部分,更新了第十七部分 风险揭示相关信息。
12.针对“第二十部分 基金托管协议的内容摘要”部分,更新了第二十部分 基金托管协议的内容摘要相关信息。
13.针对“第二十二部分 其他应披露事项”部分,更新了第二十二部分其他应披露事项相关信息。

中信建投基金管理有限公司
2018 年 8 月