

泰信现代服务业混合型证券投资基金

(原泰信现代服务业股票型证券投资基金)

2015 年年度报告 摘要

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 24 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。

普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰信现代服务业混合
基金主代码	290014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 7 日
基金管理人	泰信基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	33,191,925.06 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	充分把握中国经济可持续发展过程中现代服务业呈现出的投资机会，通过行业配置和精选个股，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中现代服务业的崛起所孕育的投资机遇。在严格控制投资风险的前提下，力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。
投资策略	本基金看好在我国加快转变经济发展方式的过程中现代服务业的发展前景，将结合“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”的个股精选策略，注重股票资产在其各相关行业的配置，并考虑组合品种的估值风险和大类资产的系统风险，通过品种和仓位的动态调整降低资产波动的风险。
业绩比较基准	75%×沪深 300 指数+25%×中证全债指数
风险收益特征	本基金作为混合型基金，主要通过发掘在我国加快转变经济发展方式的过程中，推动现代服务业大发展带来的投资机会，实现基金资产增值，属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金。

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		泰信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡囡	洪渊
	联系电话	021-20899098	(010) 66105799
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	400-888-5988	95588
传真	021-20899008	(010) 66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ftfund.com
基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 37 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	2015 年	2014 年	2013 年 2 月 7 日 (基金合同生效日)– 2013 年 12 月 31 日
本期已实现收益	7,322,555.16	9,494,889.47	18,485,437.79
本期利润	3,865,067.02	13,451,115.36	19,618,570.62
加权平均基金份额本期利润	0.1220	0.3637	0.1557
本期基金份额净值增长率	29.52%	34.48%	3.10%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.7110	0.3209	0.0212
期末基金资产净值	56,791,572.45	43,810,532.14	51,730,546.23
期末基金份额净值	1.711	1.321	1.021

注：1、上述指标的计算时间的起始日为 2013 年 2 月 7 日（基金合同生效日）。

2、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、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。

4、期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

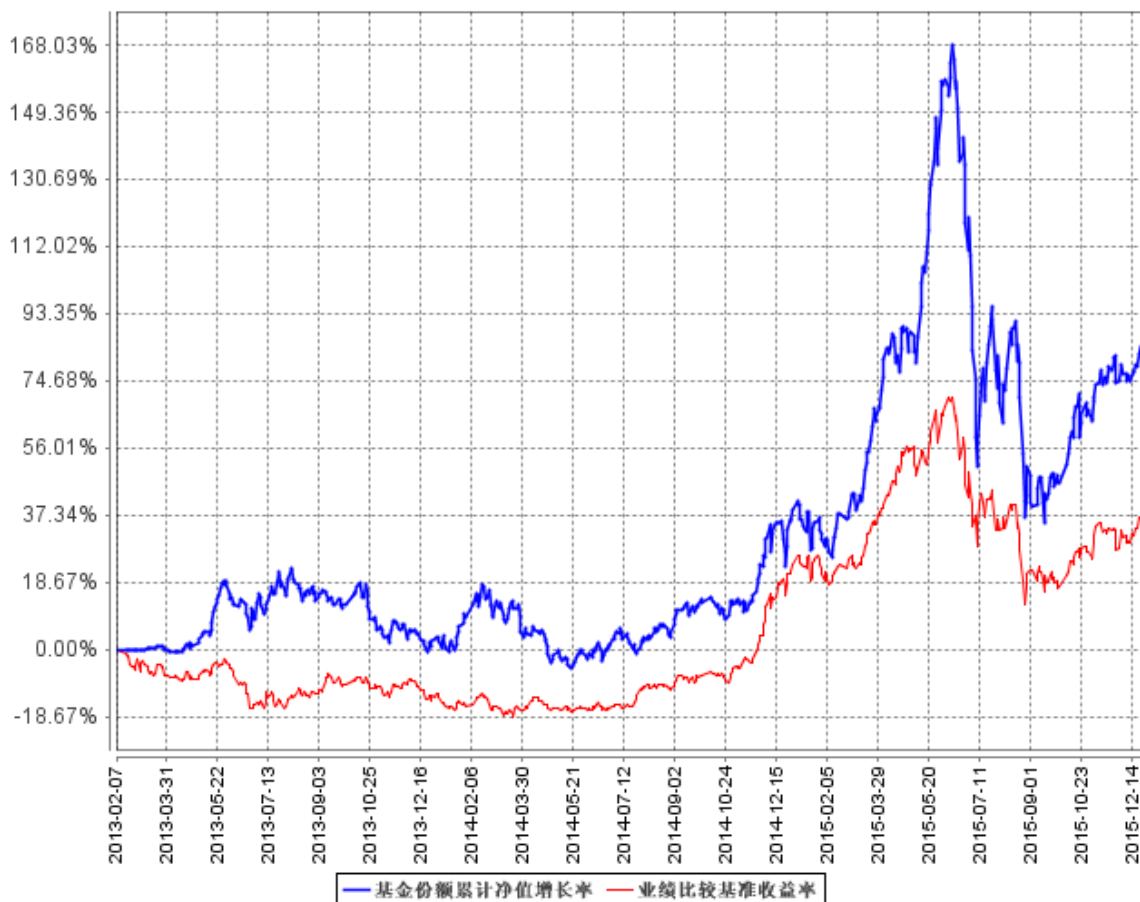
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	22.65%	1.72%	13.07%	1.25%	9.58%	0.47%
过去六个月	-18.41%	3.17%	-10.80%	2.01%	-7.61%	1.16%
过去一年	29.52%	2.80%	7.91%	1.86%	21.61%	0.94%
自基金合同 生效起至今	79.59%	1.99%	33.10%	1.35%	46.49%	0.64%

注：本基金业绩比较基准为：75%×沪深 300 指数+25%×中证全债指数

- 1、沪深 300 指数，编制合理和透明，运用广泛，对中国 A 股市场具有较强的代表性和权威性。
- 2、中证全债指数以银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券为样本，是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，具有良好的债券市场代表性，运用较为广泛。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同于 2013 年 2 月 7 日正式生效。本基金自 2015 年 8 月 7 日起变更为混合型基

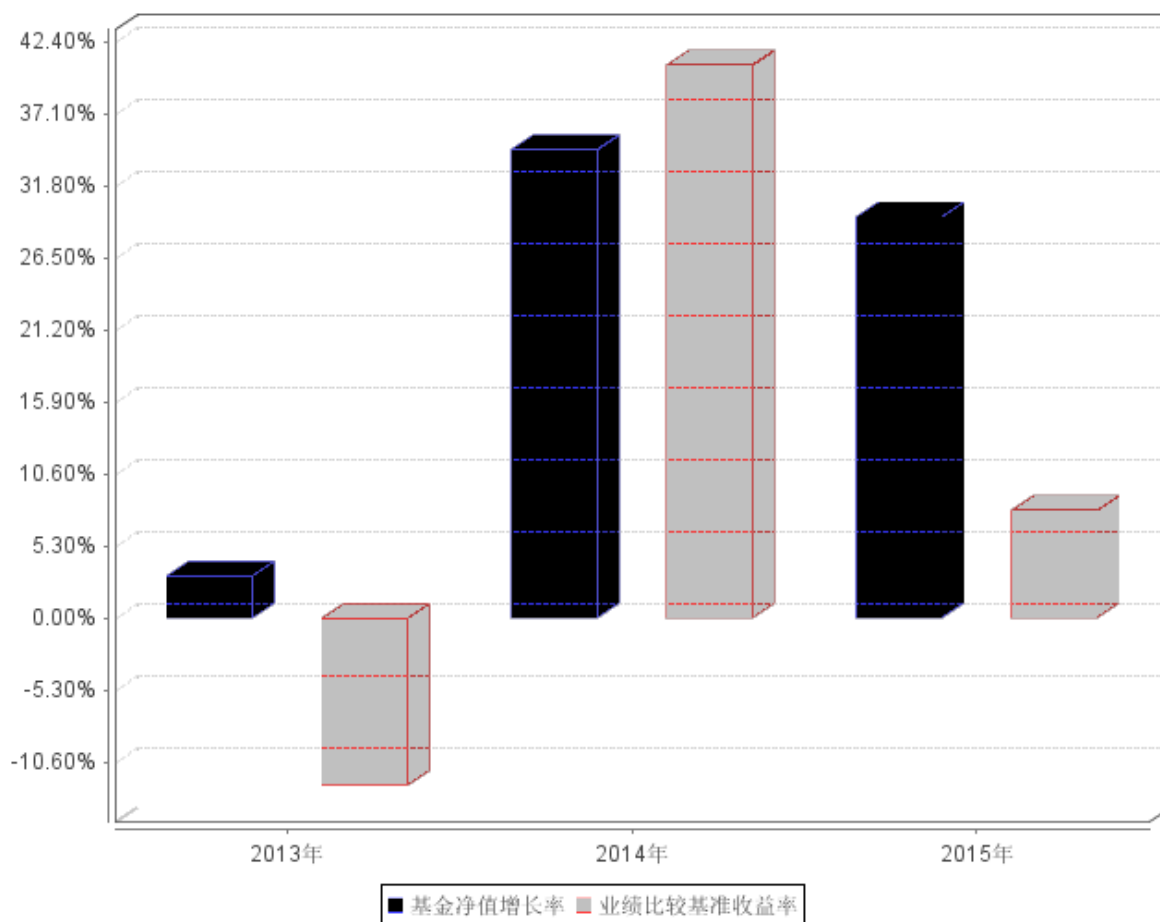
金。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满，基金投资组合各项比例符合基金合同的约定。本基金将基金资产的 60%-95%投资于股票，固定收益类证券投资比例为基金资产的 0%-35%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%。本基金投资于现代服务业相关上市公司的比例不低于股票投资资产的 80%。

3、经泰信基金管理有限公司总办会审议通过，聘任王博强先生担任本基金经理，戴宇虹女士不再担任本基金经理。具体详情请见 2015 年 3 月 17 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信现代服务业股票型证券投资基金经理变更的公告》。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2013 年 2 月 7 日正式生效，2013 年度相关数据根据实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2015	-	-	-	-	
2014	0.500	1,368,511.18	286,880.17	1,655,391.35	
2013	0.100	370,117.25	129,285.90	499,403.15	
合计	0.600	1,738,628.43	416,166.07	2,154,794.50	

§ 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

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36-37 层

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：王小林

总经理：葛航

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：王斌

发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co., Ltd.）是原山东省国际信托投资有限公司（现更名为山东省国际信托股份有限公司）联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司共同发起设立的基金管理公司。公司于 2002 年 9 月 24 日经中国证券监督管理委员会批准正式筹建，2003 年 5 月 8 日获准开业，是国内第一家以信托投资公司为主发起人而发起设立的基金管理公司。

公司目前下设上海锐懿资产管理有限公司、市场部、产品部、营销部（分华东、华北、华南三大营销中心）、理财顾问部、深圳分公司、北京分公司、电子商务部、客服中心、基金投资部、研究部、专户投资部、清算会计部、集中交易部、计划财务部、信息技术部、风险管理部、监察

稽核部、综合管理部。截至 2015 年 12 月底，公司有正式员工 108 人，多数具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

截至 2015 年 12 月底，泰信基金管理有限公司旗下共有泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活混合、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选混合、泰信债券增强收益、泰信发展主题混合、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选混合、泰信行业精选混合、泰信中证基本面 400 指数分级、泰信现代服务业混合、泰信鑫益定期开放债券、泰信国策驱动混合共 16 只开放式基金及泰信乐利 5 号、泰信至尊阿尔法 6 号、泰信吉渊分级 1 号、泰信鲁信 1 号、泰信磐晟稳健 1 号、泰信磐晟定增 1 号、泰信价值 1 号、泰信添盈债券分级 1 号、泰信中行新时代 6 号共 9 个资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王博强先生	本基金经理	2015 年 3 月 17 日	-	6 年	研究生硕士。具有基金从业资格。2008 年 12 月加入泰信基金管理有限公司，历任基金投资部行政助理、集中交易部交易员、研究部助理研究员、研究员、高级研究员兼泰信发展主题混合基金经理助理。
戴宇虹女士	本基金经理兼泰信先行策略混合基金、泰优质生活股票基金经理	2013 年 2 月 7 日	2015 年 3 月 17 日	8 年	金融学硕士。具有基金从业资格。曾先后任职于国药控股有限公司、群益证券股份有限公司。2008 年 10 月加入泰信基金管理有限公司，先后担任研究部高级研究、泰信发展主题股票基金经理助理。自 2012 年 3 月 1 日起担任泰信优质生活股票基金经理。自 2015 年 2 月 5 日起担任泰信先行策略混合基金经理。

注：1、经泰信基金管理有限公司总办会审议通过，聘任王博强先生担任本基金经理，戴宇虹女士不再担任本基金经理。具体详情请见 2015 年 3 月 17 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信现代服务业股票型证券投资基金经理变更的公告》。

- 2、基金经理的任职日期以基金合同生效日为准。
- 3、证券从业的含义遵从行业协会《证券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循《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信现代服务业混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金的投资运作符合有关法规和基金合同的规定。

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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（中国证监会公告[2011]18号），公司制定了《泰信基金管理有限公司公平交易制度》，主要控制方法如下：

- 1、建立统一的研究平台，所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放。
- 2、建立全公司投资对象备选库和各投资组合的投资对象备选库。
- 3、投委会作为公司受托资产投资的最高决策机构，主要负责对公司所管理的受托资产进行投资决策。投资总监在其权限范围内审批超出投资组合经理权限的投资计划。投资组合经理在其权限范围内进行投资决策。
- 4、投资组合经理同时管理多个投资组合时，必须公平公正的对待管理的所有投资组合，除申购赎回、个股投资比例超标等客观因素之外，同一交易日投资同一交易品种时，应尽可能使她们获得相同或相近的交易价格。

严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

- 5、集中交易室负责所有投资指令的执行，必须确保所有同向指令的公平公正，平等对待所有投资组合。发现异常指令或者涉嫌利益输送的指令，交易室应立即停止执行指令，并向投资总监和风险管理部报告。对非竞争竞价指令，不同投资组合也必须公平对待，主要采取成交结果按比例分配和轮候方式处理。

- 6、风险管理部通过交易系统监控指标设置，实时监控交易指令，禁止同一投资组合内部的同时反向交易，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利

益输送的同日反向交易。

7、公司在交易系统中设置强制公平委托参数，强制交易系统对符合要求的同一交易品种的同向指令执行公平委托。

8、风险管理部定期与不定期对交易指令的公平性和交易委托的公平性进行分析，对强制公平委托的执行过程与结果进行检查；对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，并完成定期分析报告。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司公平交易制度适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，投资经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在集中交易室集中执行，投资交易过程公平公正，投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内，投资交易监控与价差分析未发现基金之间存在利益输送行为，公平交易制度整体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易，未出现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

回顾 2015 年，A 股市场走出了一轮跌宕起伏的行情，从主要市场指数上来看，上证综指、沪深 300 指数和深成指分别上涨 9.4%、5.6%和 63.2%，而中小板和创业板指数分别上涨 75.3%和 106.6%，市场呈现明显的结构性特征。上半年市场风格偏向中小市值的成长股，各种主题投资机会十分活跃。三月、四月份随着杠杆资金跑步入市，市场加速赶顶。2015 年六月末，随着管理层清理配资政策出台，市场出现一轮惨烈的下跌。七月末期以证金公司为代表的国家队正式亮相市场，市场迎来了一丝喘息，并于四季度展开了一轮反弹行情。

我们在一季度配置了较多蓝筹股，在一季度表现不是十分理想。二季度我们积极调整结构，

契合市场热点，并且在六月份积极切换为蓝筹股防御，在清理配资风暴中守住了大部分成果。可惜在七月中旬基金面临大规模赎回，在流动性危机的环境下，给净值带来了一定损失。我们把握了 9 月份市场的反弹行情，并于 12 月中旬开始积极降低仓位，在 2016 年初市场快速调整中避免了较大损失。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金单位净值为 1.711 元，净值增长率为 29.52%，业绩比较基准增长率为 7.91%。

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 2016 年，我们认为市场呈现前低后高行情。周期品在 2016 年可能面临较大的机会。随着刺激性政策的不断出台，我们已经隐隐感觉到了周期复苏的迹象，在刚刚结束的 G20 会议中，各国政府一致认为宽货币政策效用有限，全球货币政策已经很难同步，未来对于经济增长将更多会用财政政策，印度也很快推出了数额庞大的旨在刺激经济的公路铁路投资计划。全球大宗商品价格反弹强烈，疲软多年的钢铁，煤炭行业也出现了恢复的迹象，一线城市房地产销售也重归火爆。我们认为周期性行业是 2016 年最充满机遇的板块。

我们认为中小创估值风险将在头两个季度中得到有效的释放。具体来说，自 2013 年来的中小创个股行情在转型升级中主要扮演“融资通道”作用。即资本市场以转型类中小创个股为通道，以不断推动中小创类上市公司实行转型和外延并购的模式，实现向实体输出资金的目地，并通过并购做大做强。其具体推动力为二级市场与一级市场的价差，而这种价差存是以审批制为基础的。在现有审批制的制度环境下，上市存在很高的门槛，许多创业公司选择被现有上市企业并购，现有上市企业市值也不断攀升。随着一轮牛市，中小创类公司百亿市值企业大幅增加，外延并购推动股价所需的标的也越来越大。随着注册制预期的加强，被收购企业选择独立上市的通道不断打开，现有模式恐怕走到了尽头。市场给出的估值溢价亦面临较大的修正。

我们认为注册制从短期看利空但是长期看将对资本市场发展有极大的益处，A 股常年供给不足所导致的“炒估值”将因注册制推出，改善上市公司供给两条因素下逐步回归“炒业绩”的本源。当供给侧的限制被打开后，“壳资源”，“赌重组”等扭曲市场的行为将失去存在的基础，投资者回报将成为驱动股价的根本，整体市场估值水平也将下移。我们一直认为，合理估值与业绩成长才是投资者回报的长期基础，中国经济转型确实需要股市的支持，但是没有投资者回报的支持是难以长久的，支持转型是让资金方与需求方在资本市场中自主寻找平衡点，而不是限制供应导致长期估值虚高，股东价值损毁。我们认为，在注册制大背景下，市场达到均衡后股市将

有长期的投资机会，股市牛短熊长的现象将发生根本性的改观。

综上所述，我们将在配置中保持机动灵活。上半年我们主要以周期复苏带来的投资机会为主，做好行业轮动，并随时评估事态的变化。以估值为准绳，在估值合理后寻找成长型个股的投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，本基金管理人内部控制工作本着对基金份额持有人利益高度负责的精神，以独立于各业务部门的风险管理部、监察稽核部为主体，对基金销售、投资运作、后台保障等主要业务活动进行监督与控制，较好地保证了基金运作的合规性。

1、进一步完善制度建设，构建全面有效的内部控制体系

本基金管理人根据最新出台的相关法律法规，及时补充及完善了内部管理制度，同时对业务流程进一步梳理，严格按照监管要求进行风险控制评估，确保风险控制的有效性，不断提升内部控制水平。

2、进一步规范基金投资管理 workflow，加强基金投资风险控制。

(1) 加强基金的日常投资交易进行监控，及时提示相关风险。公司风险管理部负责基金日常投资行为的监控，并与相关基金经理沟通，提示相关风险。同时根据投委会的投资决议对风险指标设置进行调整，不定期检查风险监控指标设置，并根据新的需求对风险监控指标进行测试和更新。特别是在 2015 年 7、8 月间加强了对旗下公募基金所持停牌股票的流动性指标监测。另外注意对监管机构处罚信息与市场负面信息搜集，提示投研部门注意潜在风险。

(2) 规范投资交易行为，防范交易环节的操作风险。公司禁止基金内的同日反向交易，严格控制旗下管理投资组合间的同日反向交易，新增了基金间同日同向交易、所有投资组合对单只股票成交量占其市场总成交异常等指标预警。对于日常的投资监控，公司实行的是事前控制、事中监督、事后检查的方法，在公平交易的各环节建立了责任追究制，实行各部门责任人、分管领导责任人负责制，以最大限度地监控并处置可能造成不公平交易或利益输送的行为。

3、日常监察与专项稽核相结合，深入开展各项监察稽核工作。包括对基金销售、宣传材料、客户服务、反洗钱工作、信息披露、应用系统权限管理、基金投资备选库管理、异常交易监控等方面进行专项稽核。通过日常监察与专项稽核的方式，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，强化了风险控制流程，提高了业务部门及人员的风险意识水平，从而较好地预防风险。

4、做好投研交易等人员的合规培训，提高合规意识。公司组织投研人员开展内幕交易案例合规培训，就近年来发生的典型内幕交易案例作了分类汇报，并对目前市场上的疑似内幕交易、

有争议的内幕交易案例进行了说明，要求投研人员遵守投资纪律，规范决策流程，从源头避免内幕交易事件的发生，加强了投研人员的合规意识。

5、公司采用技术手段对网站、交易、行情等进行屏蔽，对其他非受控方式上网及即时通讯做出进一步规范。加强投研人员的资讯管理，对基金经理集中区域进行录像监控，对于证券公司的网站、网页委托进行了屏蔽，对投研人员的办公电脑安装截屏软件进行留痕处理，并对安装软件的权限进行严格限制。

在本报告期内，本基金的投资运作各环节基本符合规定的要求，未出现异常交易、操纵市场、内幕交易等违法违规现象。今后公司将继续夯实内部控制和风险管理工作，保证基金运作的合规性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、泰信基金管理有限公司估值程序等事项的说明

委员会主席

韩波先生，本科学历。2002 年加入泰信基金管理公司，现任公司副总经理。

委员会成员：

唐国培先生，硕士。2002 年加入泰信基金管理有限公司，现任公司风险管理部总监。

蔡海成先生，硕士。2013 年加入泰信基金管理有限公司，现任公司清算会计部总监。

朱志权先生，学士。2008 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，现任基金投资部总监兼投资总监，泰信优势增长基金基金经理。

梁剑先生，硕士。2004 年 7 月加入泰信基金管理有限公司，现任研究部副总监兼研究副总监。

2、本基金基金经理不参与本基金估值。

3、参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、基金合同关于利润分配的约定：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人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；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

二、本报告期,本基金未进行利润分配。

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

本报告期本基金有连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人和基金资产净值低于五千万的情况。

§ 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

本报告期内，本基金托管人在对泰信现代服务业混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，泰信现代服务业混合型证券投资基金的管理人——泰信基金管理有限公司在泰信现代服务业混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，泰信现代服务业混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对泰信基金管理有限公司编制和披露的泰信现代服务业混合型证券投资基金 2015 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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(2016)第 20851 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	泰信现代服务业混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的泰信现代服务业混合型证券投资基金(原泰信现代服务业股票型证券投资基金，以下简称“泰信现代服务业基金”)的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 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。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是泰信现代服务业基金的基金管理人泰信基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)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，并使其实现公允反映； (2) 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。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 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。
审计意见段	我们认为，上述泰信现代服务业基金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，公允反映了泰信现代服务业基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	单峰	周祎
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)	
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼	
审计报告日期	2016 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泰信现代服务业混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	8,230,767.17	7,723,239.70
结算备付金	800,704.67	581,709.95
存出保证金	120,118.91	66,028.11
交易性金融资产	38,424,163.01	38,353,194.50
其中：股票投资	38,424,163.01	38,353,194.50
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	10,001,918.05	-
应收利息	3,553.27	1,012.12
应收股利	-	-
应收申购款	-	577,503.37
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	57,581,225.08	47,302,687.75
负债和所有者权益	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-

衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	2,287,859.45
应付赎回款	-	383,116.99
应付管理人报酬	79,579.44	62,732.55
应付托管费	13,263.23	10,455.43
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	332,309.96	284,271.05
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	364,500.00	463,720.14
负债合计	789,652.63	3,492,155.61
所有者权益：		
实收基金	33,191,925.06	33,166,854.79
未分配利润	23,599,647.39	10,643,677.35
所有者权益合计	56,791,572.45	43,810,532.14
负债和所有者权益总计	57,581,225.08	47,302,687.75

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.711 元，基金份额总额 33,191,925.06 份。

7.2 利润表

会计主体：泰信现代服务业混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	6,675,780.98	15,755,661.21
1. 利息收入	77,813.00	60,506.07
其中：存款利息收入	75,894.95	55,634.40
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,918.05	4,871.67
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	9,961,191.25	11,688,189.54
其中：股票投资收益	9,803,963.25	11,488,507.69
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-

资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	157,228.00	199,681.85
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-3,457,488.14	3,956,225.89
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	94,264.87	50,739.71
减：二、费用	2,810,713.96	2,304,545.85
1. 管理人报酬	765,468.64	594,622.49
2. 托管费	127,578.04	99,103.78
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,537,570.28	1,131,914.58
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	380,097.00	478,905.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	3,865,067.02	13,451,115.36
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	3,865,067.02	13,451,115.36

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信现代服务业混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	33,166,854.79	10,643,677.35	43,810,532.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	3,865,067.02	3,865,067.02
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）	25,070.27	9,090,903.02	9,115,973.29
其中：1. 基金申购款	47,342,333.26	46,190,638.13	93,532,971.39

2. 基金赎回款	-47,317,262.99	-37,099,735.11	-84,416,998.10
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）	33,191,925.06	23,599,647.39	56,791,572.45
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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）	50,655,945.00	1,074,601.23	51,730,546.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	13,451,115.36	13,451,115.36
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）	-17,489,090.21	-2,226,647.89	-19,715,738.10
其中：1. 基金申购款	31,112,071.56	4,683,570.83	35,795,642.39
2. 基金赎回款	-48,601,161.77	-6,910,218.72	-55,511,380.49
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）	-	-1,655,391.35	-1,655,391.35
五、期末所有者权益（基金净值）	33,166,854.79	10,643,677.35	43,810,532.14

注：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：

<u>葛航</u>	<u>韩波</u>	<u>蔡海成</u>
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

泰信现代服务业混合型证券投资基金(原名为泰信现代服务业股票型证券投资基金,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[2012]第938号《关于核准泰信现代服务业股票型证券投资基金募集的批复》核准,由泰信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《泰信现代服务业股票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。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 358,345,806.61 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 070 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰信现代服务业股票型证券投资基金基金合同》于 2013 年 2 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 358,406,733.77 份，其中认购资金利息折合 60,927.16 份。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，泰信现代服务业股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为泰信现代服务业混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信现代服务业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各类股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的 60%-95%，固定收益类证券投资占基金资产的 0-35%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，权证投资比例为基金资产净值的 0-3%。投资于现代服务业相关上市公司的比例不低于股票投资资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：75%×沪深 300 指数+25%×中证全债指数。

本财务报表由本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司于 2016 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信现代服务业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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
山东省国际信托股份有限公司(“山东国托”)	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信实业有限公司(“青岛国信”)	基金管理人的股东

注：1. 本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司的股东山东省国际信托有限公司于 2015 年 7 月 30 日变更注册为山东省国际信托股份有限公司。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本期末本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本报告期末本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本报告期本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本报告期本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本期本基金无应支付关联方佣金余额。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	765,468.64	594,622.49
其中：支付销售机构的客户维护费	125,887.98	333,965.93

注：支付基金管理人泰信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%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

×1.5% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	127,578.04	99,103.78

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 × 0.25% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

本报告期末及上年度末本基金未发生销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期末及上年度可比期间本基金未发生与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2015 年 12 月 31 日		2014 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
山东省国际信托股份有限公司	18,130,215.59	54.6200%	20,044,616.70	60.4400%

7.4.8.5 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	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 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
中国工商银行	8,230,767.17	67,203.70	7,723,239.70	50,547.25

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未在承销期内持有关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002612	朗姿股份	2015年12月23日	重大事项	75.46	-	-	6,000	328,428.88	452,760.00	-
300336	新文化	2015年12月24日	重大事项	42.00	-	-	10,000	383,931.00	420,000.00	-
601058	赛轮金宇	2015年12月28日	重大事项	9.00	2016年1月12日	8.10	45,000	349,952.98	405,000.00	-
000901	航天科技	2015年8月19日	重大事项	42.13	2016年2月18日	47.59	25,000	1,450,889.29	1,053,250.00	-
300028	金亚科技	2015年6月10日	重大事项	24.48	-	-	29,900	1,197,117.20	731,952.00	-
300238	冠昊生物	2015年11月12日	重大事项	55.14	-	-	40,095	1,812,817.32	2,210,838.30	-

注：本基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购作为抵押的债券。

7.4.10 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 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 33,150,362.71 元，属于第二层次余额为 4,541,848.30 元，属于第三层次余额为 731,952.00 元。(2014 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 34,740,850.00 元，属于第二层次余额为 3,612,344.50 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

	交易性金融资产 ——股票投资
2015 年 1 月 1 日	-
购买	-
出售	-
转入第三层次	555,542.00
转出第三层次	-
当期利得或损失总额	

——计入损益的利得或损失	176,410.00
2015 年 12 月 31 日	731,952.00

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动收益、投资收益等项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值按照可比公司法确定。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 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(2014 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	38,424,163.01	66.73
	其中：股票	38,424,163.01	66.73
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	9,031,471.84	15.68
7	其他各项资产	10,125,590.23	17.58
8	合计	57,581,225.08	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,187,460.00	2.09
B	采矿业	1,691,540.00	2.98
C	制造业	29,463,293.01	51.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	613,090.00	1.08
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	220,800.00	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	1,788,800.00	3.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	876,000.00	1.54
J	金融业	-	-
K	房地产业	994,380.00	1.75
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	1,588,800.00	2.80
S	综合	-	-
	合计	38,424,163.01	67.66

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	--------	------	---------------

1	000895	双汇发展	140,000	2,857,400.00	5.03
2	300238	冠昊生物	40,095	2,210,838.30	3.89
3	002008	大族激光	79,983	2,070,759.87	3.65
4	000651	格力电器	87,000	1,944,450.00	3.42
5	000625	长安汽车	114,000	1,934,580.00	3.41
6	002241	歌尔声学	50,000	1,730,000.00	3.05
7	600766	园城黄金	83,000	1,691,540.00	2.98
8	600315	上海家化	40,000	1,579,600.00	2.78
9	600519	贵州茅台	7,236	1,578,822.84	2.78
10	601006	大秦铁路	170,000	1,465,400.00	2.58

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	600048	保利地产	13,440,186.25	30.68
2	600855	航天长峰	9,361,287.18	21.37
3	300238	冠昊生物	8,634,953.44	19.71
4	000002	万科A	8,587,982.93	19.60
5	600837	海通证券	7,240,338.00	16.53
6	600596	新安股份	7,154,708.00	16.33
7	300086	康芝药业	6,770,779.28	15.45
8	600519	贵州茅台	6,241,677.91	14.25
9	002312	三泰控股	5,943,862.00	13.57
10	000895	双汇发展	5,679,108.11	12.96
11	300101	振芯科技	5,525,680.00	12.61
12	601006	大秦铁路	4,948,462.53	11.30
13	002539	新都化工	4,799,432.20	10.95
14	601111	中国国航	4,661,442.00	10.64
15	002146	荣盛发展	4,609,732.00	10.52
16	600029	南方航空	4,497,814.00	10.27
17	600600	青岛啤酒	4,475,510.48	10.22
18	000838	财信发展	4,367,965.88	9.97
19	600958	东方证券	4,268,850.00	9.74

20	600115	东方航空	4,260,229.10	9.72
21	600054	黄山旅游	4,227,255.81	9.65
22	000056	皇庭国际	4,066,880.58	9.28
23	600573	惠泉啤酒	4,032,058.94	9.20
24	300028	金亚科技	3,988,659.54	9.10
25	002711	欧浦智网	3,764,910.10	8.59
26	601939	建设银行	3,703,098.18	8.45
27	000625	长安汽车	3,674,083.33	8.39
28	000592	平潭发展	3,541,617.00	8.08
29	600176	中国巨石	3,525,206.00	8.05
30	300017	网宿科技	3,503,956.50	8.00
31	600518	康美药业	3,490,946.95	7.97
32	600562	国睿科技	3,482,443.56	7.95
33	300284	苏文科	3,453,653.00	7.88
34	000793	华闻传媒	3,438,201.36	7.85
35	600662	强生控股	3,429,682.25	7.83
36	300198	纳川股份	3,427,222.80	7.82
37	300253	卫宁健康	3,339,867.00	7.62
38	600315	上海家化	3,236,917.00	7.39
39	600585	海螺水泥	3,220,207.40	7.35
40	002169	智光电气	3,196,531.58	7.30
41	300072	三聚环保	3,195,257.76	7.29
42	000651	格力电器	3,187,034.03	7.27
43	600208	新湖中宝	3,169,749.00	7.24
44	002172	澳洋科技	3,162,478.00	7.22
45	002612	朗姿股份	3,105,823.77	7.09
46	601311	骆驼股份	2,998,206.00	6.84
47	002196	方正电机	2,972,725.84	6.79
48	300100	双林股份	2,970,917.26	6.78
49	300032	金龙机电	2,875,969.00	6.56
50	300251	光线传媒	2,871,166.30	6.55
51	600836	界龙实业	2,866,550.00	6.54
52	601668	中国建筑	2,793,247.00	6.38
53	601555	东吴证券	2,769,825.00	6.32
54	002299	圣农发展	2,756,027.10	6.29
55	601069	西部黄金	2,747,455.94	6.27

56	000877	天山股份	2,733,388.00	6.24
57	000488	晨鸣纸业	2,706,842.00	6.18
58	002179	中航光电	2,657,563.00	6.07
59	600446	金证股份	2,651,401.00	6.05
60	600581	八一钢铁	2,623,360.00	5.99
61	000402	金融街	2,569,672.00	5.87
62	600418	江淮汽车	2,514,637.00	5.74
63	600766	园城黄金	2,507,531.58	5.72
64	600886	国投电力	2,496,900.00	5.70
65	600104	上汽集团	2,491,829.00	5.69
66	002216	三全食品	2,491,098.00	5.69
67	600422	昆药集团	2,475,825.00	5.65
68	600547	山东黄金	2,454,423.99	5.60
69	000789	万年青	2,433,109.51	5.55
70	601857	中国石油	2,399,280.00	5.48
71	600674	川投能源	2,374,088.25	5.42
72	300166	东方国信	2,346,034.00	5.35
73	002551	尚荣医疗	2,345,849.00	5.35
74	000915	山大华特	2,262,495.00	5.16
75	600521	华海药业	2,254,787.28	5.15
76	600369	西南证券	2,253,598.00	5.14
77	300196	长海股份	2,230,976.17	5.09
78	300205	天喻信息	2,217,628.00	5.06
79	300178	腾邦国际	2,216,258.00	5.06
80	600340	华夏幸福	2,192,465.74	5.00
81	600502	安徽水利	2,167,104.22	4.95
82	002433	太安堂	2,159,350.99	4.93
83	600428	中远航运	2,156,784.00	4.92
84	600153	建发股份	2,101,814.37	4.80
85	000400	许继电气	2,087,454.00	4.76
86	000042	中洲控股	2,052,687.00	4.69
87	300068	南都电源	2,034,202.64	4.64
88	000901	航天科技	2,031,245.00	4.64
89	002019	亿帆鑫富	2,031,080.12	4.64
90	000768	中航飞机	2,029,429.00	4.63
91	600067	冠城大通	2,017,940.00	4.61

92	600546	山煤国际	1,997,613.00	4.56
93	600172	黄河旋风	1,992,010.41	4.55
94	600016	民生银行	1,987,382.00	4.54
95	300098	高新兴	1,973,291.00	4.50
96	600343	航天动力	1,931,884.00	4.41
97	600664	哈药股份	1,910,626.00	4.36
98	601377	兴业证券	1,903,403.00	4.34
99	601058	赛轮金宇	1,880,385.24	4.29
100	601336	新华保险	1,879,450.00	4.29
101	601211	国泰君安	1,853,999.03	4.23
102	601800	中国交建	1,849,681.00	4.22
103	002116	中国海诚	1,848,463.00	4.22
104	601515	东风股份	1,847,001.00	4.22
105	600240	华业资本	1,841,238.58	4.20
106	002466	天齐锂业	1,823,629.00	4.16
107	600028	中国石化	1,796,400.00	4.10
108	002686	亿利达	1,794,777.02	4.10
109	000729	燕京啤酒	1,791,543.24	4.09
110	002241	歌尔声学	1,790,728.00	4.09
111	300009	安科生物	1,787,521.98	4.08
112	601088	中国神华	1,787,016.00	4.08
113	600896	中海海盛	1,752,247.01	4.00
114	002568	百润股份	1,751,610.00	4.00
115	002714	牧原股份	1,742,581.00	3.98
116	002657	中金金财	1,669,139.80	3.81
117	601919	中国远洋	1,651,078.00	3.77
118	600583	海油工程	1,650,973.22	3.77
119	300104	乐视网	1,644,000.00	3.75
120	002171	楚江新材	1,642,193.00	3.75
121	601866	中海集运	1,638,124.00	3.74
122	002008	大族激光	1,620,989.20	3.70
123	600570	恒生电子	1,614,876.00	3.69
124	300261	雅本化学	1,608,928.26	3.67
125	600648	外高桥	1,605,478.39	3.66
126	002013	中航机电	1,596,655.87	3.64
127	300142	沃森生物	1,595,368.00	3.64

128	300199	翰宇药业	1,537,654.00	3.51
129	300059	东方财富	1,532,380.00	3.50
130	002398	建研集团	1,523,332.00	3.48
131	601872	招商轮船	1,508,986.00	3.44
132	300339	润和软件	1,479,900.00	3.38
133	600372	中航电子	1,468,920.00	3.35
134	000728	国元证券	1,464,388.00	3.34
135	000868	安凯客车	1,455,246.00	3.32
136	000856	冀东装备	1,445,790.00	3.30
137	300342	天银机电	1,401,944.00	3.20
138	002407	多氟多	1,397,742.00	3.19
139	603899	晨光文具	1,380,508.00	3.15
140	002183	怡亚通	1,373,245.62	3.13
141	600162	香江控股	1,354,944.84	3.09
142	000401	冀东水泥	1,350,540.00	3.08
143	002421	达实智能	1,325,489.00	3.03
144	000024	招商地产	1,322,477.00	3.02
145	600629	华建集团	1,311,402.00	2.99
146	300075	数字政通	1,309,220.00	2.99
147	000050	深天马A	1,279,147.00	2.92
148	002341	新纶科技	1,262,780.00	2.88
149	002208	合肥城建	1,261,134.00	2.88
150	300108	双龙股份	1,252,945.00	2.86
151	600999	招商证券	1,247,301.00	2.85
152	002372	伟星新材	1,223,400.00	2.79
153	300004	南风股份	1,186,262.00	2.71
154	002294	信立泰	1,165,673.41	2.66
155	600290	华仪电气	1,159,850.90	2.65
156	002701	奥瑞金	1,155,573.00	2.64
157	002268	卫士通	1,141,087.72	2.60
158	601718	际华集团	1,134,386.83	2.59
159	300005	探路者	1,122,149.07	2.56
160	002540	亚太科技	1,113,042.32	2.54
161	600873	梅花生物	1,109,735.00	2.53
162	002441	众业达	1,096,346.00	2.50
163	000006	深振业A	1,090,531.00	2.49

164	000503	海虹控股	1,087,500.00	2.48
165	600775	南京熊猫	1,080,340.02	2.47
166	002022	科华生物	1,076,007.00	2.46
167	300192	科斯伍德	1,068,007.99	2.44
168	300183	东软载波	1,063,921.00	2.43
169	600270	外运发展	1,057,964.00	2.41
170	603898	好莱客	1,053,491.00	2.40
171	600008	首创股份	1,036,350.98	2.37
172	002055	得润电子	1,031,400.00	2.35
173	600026	中海发展	1,016,078.00	2.32
174	002170	芭田股份	1,013,634.37	2.31
175	002712	思美传媒	1,006,050.00	2.30
176	000523	广州浪奇	1,004,014.22	2.29
177	002080	中材科技	1,000,420.00	2.28
178	000911	南宁糖业	997,719.00	2.28
179	002513	蓝丰生化	996,600.00	2.27
180	000063	中兴通讯	955,540.16	2.18
181	603019	中科曙光	948,117.00	2.16
182	600687	刚泰控股	945,498.00	2.16
183	300155	安居宝	943,541.00	2.15
184	300471	厚普股份	943,201.00	2.15
185	002142	宁波银行	941,788.00	2.15
186	002229	鸿博股份	938,308.00	2.14
187	300250	初灵信息	925,539.46	2.11
188	601318	中国平安	914,836.00	2.09
189	300112	万讯自控	913,648.14	2.09
190	002456	欧菲光	907,954.92	2.07
191	002154	报喜鸟	903,310.00	2.06
192	300388	国祯环保	899,511.00	2.05
193	000701	厦门信达	895,399.00	2.04
194	600105	永鼎股份	892,000.00	2.04
195	300049	福瑞股份	882,328.00	2.01
196	603025	大豪科技	878,240.00	2.00

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	600048	保利地产	14,695,820.08	33.54
2	000002	万科A	11,261,871.94	25.71
3	600855	航天长峰	9,388,695.94	21.43
4	600837	海通证券	8,898,012.12	20.31
5	300086	康芝药业	8,246,201.03	18.82
6	300238	冠昊生物	5,957,337.96	13.60
7	601006	大秦铁路	5,814,701.00	13.27
8	300101	振芯科技	5,522,610.54	12.61
9	600596	新安股份	5,243,511.50	11.97
10	601668	中国建筑	5,015,110.57	11.45
11	600029	南方航空	4,870,949.00	11.12
12	000838	财信发展	4,861,922.00	11.10
13	600115	东方航空	4,796,402.00	10.95
14	002312	三泰控股	4,634,200.00	10.58
15	600600	青岛啤酒	4,599,540.08	10.50
16	600519	贵州茅台	4,542,408.00	10.37
17	601111	中国国航	4,360,524.27	9.95
18	600958	东方证券	4,160,189.84	9.50
19	002146	荣盛发展	4,150,177.56	9.47
20	601939	建设银行	3,954,498.00	9.03
21	600573	惠泉啤酒	3,946,785.50	9.01
22	002172	澳洋科技	3,918,941.41	8.95
23	601800	中国交建	3,917,630.00	8.94
24	601336	新华保险	3,767,756.00	8.60
25	300100	双林股份	3,759,492.00	8.58
26	300198	纳川股份	3,749,417.00	8.56
27	300284	苏交科	3,722,460.36	8.50
28	002539	新都化工	3,710,105.99	8.47
29	600562	国睿科技	3,655,279.50	8.34
30	002711	欧浦智网	3,652,983.04	8.34
31	000592	平潭发展	3,640,074.00	8.31
32	300017	网宿科技	3,486,546.51	7.96
33	000895	双汇发展	3,483,817.46	7.95
34	000056	皇庭国际	3,428,118.21	7.82

35	300253	卫宁健康	3,398,740.28	7.76
36	601311	骆驼股份	3,340,281.00	7.62
37	002169	智光电气	3,323,037.85	7.59
38	600054	黄山旅游	3,276,455.51	7.48
39	300028	金亚科技	3,262,023.00	7.45
40	600446	金证股份	3,232,481.20	7.38
41	300339	润和软件	3,183,946.00	7.27
42	600208	新湖中宝	3,155,591.00	7.20
43	600176	中国巨石	3,154,110.16	7.20
44	600518	康美药业	3,079,417.28	7.03
45	600172	黄河旋风	3,070,638.00	7.01
46	002184	海得控制	2,975,898.87	6.79
47	300072	三聚环保	2,963,200.84	6.76
48	600104	上汽集团	2,932,750.00	6.69
49	600585	海螺水泥	2,918,595.24	6.66
50	002196	方正电机	2,916,389.96	6.66
51	002612	朗姿股份	2,838,492.33	6.48
52	300178	腾邦国际	2,827,985.32	6.46
53	600662	强生控股	2,718,295.00	6.20
54	000793	华闻传媒	2,704,920.81	6.17
55	600369	西南证券	2,656,600.00	6.06
56	000402	金融街	2,650,871.75	6.05
57	601857	中国石油	2,601,750.00	5.94
58	601069	西部黄金	2,589,316.60	5.91
59	002179	中航光电	2,588,750.00	5.91
60	601318	中国平安	2,584,928.00	5.90
61	601555	东吴证券	2,567,765.00	5.86
62	600581	八一钢铁	2,562,364.30	5.85
63	300068	南都电源	2,548,928.25	5.82
64	600067	冠城大通	2,542,665.00	5.80
65	002466	天齐锂业	2,534,250.00	5.78
66	002568	百润股份	2,509,409.10	5.73
67	600418	江淮汽车	2,507,370.50	5.72
68	600153	建发股份	2,475,406.75	5.65
69	600836	界龙实业	2,444,387.34	5.58
70	002216	三全食品	2,432,292.50	5.55
71	300251	光线传媒	2,421,047.64	5.53
72	000042	中洲控股	2,387,465.00	5.45

73	600886	国投电力	2,366,700.00	5.40
74	600388	龙净环保	2,351,436.98	5.37
75	600340	华夏幸福	2,322,438.17	5.30
76	002009	天奇股份	2,308,799.39	5.27
77	600502	安徽水利	2,283,511.96	5.21
78	300032	金龙机电	2,234,055.86	5.10
79	600547	山东黄金	2,189,936.24	5.00
80	601628	中国人寿	2,177,000.00	4.97
81	000024	招商地产	2,141,400.00	4.89
82	300199	翰宇药业	2,092,175.00	4.78
83	600016	民生银行	2,070,034.00	4.72
84	300196	长海股份	2,068,295.24	4.72
85	300098	高新兴	2,036,755.04	4.65
86	002268	卫士通	2,026,063.60	4.62
87	601377	兴业证券	2,022,227.00	4.62
88	000789	万年青	2,019,855.00	4.61
89	002116	中国海诚	2,014,739.27	4.60
90	600674	川投能源	1,992,777.72	4.55
91	300009	安科生物	1,954,790.00	4.46
92	002183	怡亚通	1,954,107.00	4.46
93	000069	华侨城A	1,946,999.17	4.44
94	600240	华业资本	1,943,106.00	4.44
95	601211	国泰君安	1,909,623.00	4.36
96	600343	航天动力	1,908,016.98	4.36
97	000625	长安汽车	1,907,418.40	4.35
98	600028	中国石化	1,885,024.30	4.30
99	002551	尚荣医疗	1,875,427.74	4.28
100	600521	华海药业	1,870,895.52	4.27
101	002540	亚太科技	1,868,309.27	4.26
102	600766	园城黄金	1,852,603.00	4.23
103	600428	中远航运	1,830,561.00	4.18
104	600422	昆药集团	1,800,899.00	4.11
105	600648	外高桥	1,780,094.00	4.06
106	002686	亿利达	1,767,250.00	4.03
107	002441	众业达	1,760,303.10	4.02
108	601088	中国神华	1,757,063.00	4.01
109	002013	中航机电	1,748,493.00	3.99
110	300166	东方国信	1,744,972.01	3.98

111	002573	清新环境	1,723,691.31	3.93
112	002714	牧原股份	1,718,879.00	3.92
113	000488	晨鸣纸业	1,716,903.00	3.92
114	300205	天喻信息	1,716,187.36	3.92
115	002657	中科金财	1,706,053.00	3.89
116	002299	圣农发展	1,697,901.20	3.88
117	600664	哈药股份	1,688,231.97	3.85
118	002019	亿帆鑫富	1,684,128.92	3.84
119	300104	乐视网	1,666,225.00	3.80
120	600570	恒生电子	1,652,893.00	3.77
121	600315	上海家化	1,644,374.00	3.75
122	000877	天山股份	1,643,084.00	3.75
123	600629	华建集团	1,637,496.00	3.74
124	601872	招商轮船	1,624,581.50	3.71
125	601058	赛轮金宇	1,615,619.00	3.69
126	603899	晨光文具	1,593,115.00	3.64
127	300142	沃森生物	1,590,635.24	3.63
128	000400	许继电气	1,586,700.00	3.62
129	002171	楚江新材	1,561,543.00	3.56
130	601166	兴业银行	1,552,100.00	3.54
131	300059	东方财富	1,526,871.22	3.49
132	002407	多氟多	1,515,393.90	3.46
133	000503	海虹控股	1,475,209.30	3.37
134	600372	中航电子	1,463,553.00	3.34
135	000868	安凯客车	1,456,113.00	3.32
136	002398	建研集团	1,454,335.00	3.32
137	000768	中航飞机	1,443,240.00	3.29
138	002701	奥瑞金	1,428,990.00	3.26
139	603019	中科曙光	1,416,781.45	3.23
140	000728	国元证券	1,401,138.74	3.20
141	000050	深天马A	1,389,774.00	3.17
142	600896	中海海盛	1,382,907.00	3.16
143	000911	南宁糖业	1,359,337.97	3.10
144	000856	冀东装备	1,354,981.00	3.09
145	601117	中国化学	1,347,000.00	3.07
146	601866	中海集运	1,346,201.00	3.07
147	002080	中材科技	1,342,243.00	3.06
148	300075	数字政通	1,327,087.00	3.03

149	002208	合肥城建	1,323,773.00	3.02
150	300112	万讯自控	1,319,133.78	3.01
151	300005	探路者	1,316,766.00	3.01
152	002294	信立泰	1,316,220.00	3.00
153	601919	中国远洋	1,315,679.00	3.00
154	300108	双龙股份	1,315,560.00	3.00
155	600162	香江控股	1,307,812.00	2.99
156	601601	中国太保	1,300,455.16	2.97
157	300342	天银机电	1,293,645.00	2.95
158	002372	伟星新材	1,286,647.50	2.94
159	000651	格力电器	1,268,400.00	2.90
160	601718	际华集团	1,254,976.00	2.86
161	600270	外运发展	1,233,728.23	2.82
162	002022	科华生物	1,215,811.84	2.78
163	002341	新纶科技	1,200,752.00	2.74
164	000006	深振业A	1,195,110.00	2.73
165	002154	报喜鸟	1,157,537.00	2.64
166	300004	南风股份	1,154,131.00	2.63
167	300183	东软载波	1,136,793.10	2.59
168	000915	山大华特	1,135,706.00	2.59
169	603898	好莱客	1,123,918.00	2.57
170	000063	中兴通讯	1,119,689.00	2.56
171	600290	华仪电气	1,117,662.00	2.55
172	600546	山煤国际	1,112,709.00	2.54
173	600873	梅花生物	1,101,487.00	2.51
174	000783	长江证券	1,088,000.00	2.48
175	300250	初灵信息	1,042,071.00	2.38
176	600000	浦发银行	1,032,355.21	2.36
177	600583	海油工程	1,030,200.00	2.35
178	300155	安居宝	1,021,104.00	2.33
179	300192	科斯伍德	1,010,592.53	2.31
180	600026	中海发展	1,000,280.00	2.28
181	600008	首创股份	999,242.00	2.28
182	002433	太安堂	994,870.00	2.27
183	000523	广州浪奇	984,552.00	2.25
184	300388	国祯环保	982,873.50	2.24
185	300471	厚普股份	979,411.00	2.24
186	002170	芭田股份	975,428.57	2.23

187	002189	利达光电	970,599.98	2.22
188	000701	厦门信达	962,800.00	2.20
189	600999	招商证券	941,527.20	2.15
190	002513	蓝丰生化	922,553.82	2.11
191	600375	华菱星马	919,300.00	2.10
192	002142	宁波银行	912,545.00	2.08
193	002229	鸿博股份	890,977.31	2.03

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	505,235,921.07
卖出股票收入（成交）总额	511,511,427.67

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末本基金未投资贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

8.12.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

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	120,118.91
2	应收证券清算款	10,001,918.05
3	应收股利	-
4	应收利息	3,553.27
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,125,590.23

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300238	冠昊生物	2,210,838.30	3.89	重大事项

8.12.6 本报告涉及合计数相关比例的，均以合计数除以相关数据计算，而不是对不同比例进行合计。

§ 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

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
220	150,872.39	25,340,631.10	76.35%	7,851,293.96	23.65%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 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的情况

项目	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	0

本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年2月7日）基金份额总额	358,406,733.77
本报告期期初基金份额总额	33,166,854.79
本报告期基金总申购份额	47,342,333.26
减：本报告期基金总赎回份额	47,317,262.99
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	33,191,925.06

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

1、经泰信基金管理有限公司总办会审议通过，聘任王博强先生担任本基金经理，戴宇虹女士不再担任本基金经理。具体详情请见2015年3月17日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信现代服务业股票型证券投资基金基金经理变更的公告》。本公司上述人事变动已按相关规定向监管机构进行备案。

2、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内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

本报告期本基金支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费为人民币 6 万元。该审计机构从基金合同生效日（2013 年 2 月 7 日）开始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，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	1	293,953,374.85	28.92%	272,897.50	29.50%	-
中山证券	1	186,163,660.52	18.31%	165,690.32	17.91%	-
新时代证券	1	115,893,557.94	11.40%	103,737.97	11.21%	-
广州证券	1	97,935,386.86	9.63%	88,591.27	9.58%	-
华创证券	2	96,857,914.92	9.53%	88,198.84	9.53%	-
华泰证券	1	78,352,760.18	7.71%	71,706.50	7.75%	-
民生证券	1	62,089,293.25	6.11%	56,525.78	6.11%	-
广发证券	2	47,790,289.41	4.70%	43,508.27	4.70%	-
中国银河证券	1	37,517,525.81	3.69%	34,189.70	3.70%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

瑞银证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券	1	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）中关于“一家基金公司通过一家证券经营机构买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金 30%”的要求，本基金管理人在选择租用交易单元时，注重所选证券公司的综合实力、市场声誉。对证券公司的研究能力，由公司研究人员对其提供的研究报告、研究成果的质量进行定期评估。公司将根据内部评估报告，对交易单元租用情况进行总体评价，决定是否对交易单元租用情况进行调整。

2、本基金与公司旗下在中国工商银行托管的泰信优势增长混合基金、泰信发展主题基金、泰信中证锐联基本面 400 指数分级基金、泰信国策驱动基金共用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
申万宏源	-	-	10,000,000.00	100.00%	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-

高华证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

根据 2014 年 8 月 8 日施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》（证监会令第 104 号）第三十条第一项的规定“股票基金的股票资产投资比例下限由 60%上调至 80%”。我公司经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2015 年 8 月 7 日起将旗下泰信现代服务业股票型证券投资基金变更为混合型证券投资基金，本次调整仅对基金合同中涉及基金名称、基金类别及风险收益特征等条款进行了修订。具体详情请参见 2015 年 8 月 7 日刊登在指定媒介及本公司网站（www.ftfund.com）上的《泰信基金管理有限公司关于旗下五只股票型证券投资基金变更基金类型并相应修订基金合同部分条款的公告》以及修订后的《泰信现代服务业混合型证券投资基金基金合同》、《泰信现代服务业混合型证券投资基金托管协议》等文件。

泰信基金管理有限公司
2016 年 3 月 30 日