

泰信行业精选灵活配置混合型证券投资  
基金（原泰信保本混合型证券投资基金）  
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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 28 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。

本基金系原泰信保本混合型证券投资基金保本到期转型而来。根据《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，该基金的保本期为三年。自《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》生效之日（2012 年 2 月 22 日）起至三个公历年后对应日 2015 年 2 月 25 日（依据《基金合同》规定如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日）止，该保本周期到期。保本周期到期后，依据《基金合同》规定，本基金未能符合保本基金存续条件，该基金转型为非保本的混合型证券投资基金，基金名称变更为“泰信行业精选混合型证券投资基金”。基金托管人及基金注册机构保持不变，基金代码亦保持不变仍为“290012”。经基金管理人和基金托管人同意，本基金管理人对转型后的《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》进行了修改，并据此修改了《泰信行业精选混合型证券投资基金托管协议》、更新了《泰信行业精选混合型证券投资基金招募说明书》，并报中国证监会备案。自 2015 年 3 月 4 日起，《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》转型生效，《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》自该日起失效。

经泰信行业精选混合型证券投资基金 2015 年 8 月 28 日基金份额持有人大会（通讯方式）表决通过，并报中国证监会备案，泰信行业精选混合型证券投资基金变更为泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金。自 2015 年 9 月 1 日起，由《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》

修订而成的《泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效。本基金的投资组合比例调整为：“本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金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后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券”，业绩比较基准不变。

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。其中，原泰信保本混合型证券投资基金（基金转型前）报告期为 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 3 月 3 日止；泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金（基金转型后）报告期为 2015 年 3 月 4 日至 2015 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	泰信保本混合
基金主代码	290012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 2 月 22 日
基金管理人	泰信基金管理有限公司
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	283,272,972.80 份
基金合同存续期	不定期

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	泰信行业精选混合
基金主代码	290012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 3 月 4 日
基金管理人	泰信基金管理有限公司
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	920,517,365.81 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金通过运用优化的恒定比例组合保险方法（CPPI），在保证保本期到期本金安全的基础上，寻求资产的稳定增值。
投资策略	本基金以优化的恒定比例组合保险方法（CPPI）为基础来实现保本和增值，在保本周期中，通过严格的投资纪律约束和风险管理，对基金的资产配置进行优化动态调整，确保投资者的投资本金的安全性。同时，通过积极稳健的收益资产投资策略，谋取基金资产的增值。
业绩比较基准	三年期银行定期存款的税后收益率
风险收益特征	本基金为保本基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

## 2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	把握行业发展趋势和市场运行趋势，在经济发展以及市场运行的不同阶段所蕴含的行业投资机会，在控制风险的前提下，追求基金资产的稳定增值。
投资策略	紧密跟踪中国经济动向，把握中国经济的长期发展趋势和周期变动特征，挖掘不同发展阶段下的行业投资机会，综合运用主题投资、行业轮动等投资策略，追求基金资产的长期、持续增值。本基金将结合“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”的个券精选策略，同时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的波动风险。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品。

## 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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡囡	方韡
	联系电话	021-20899098	010-89936330
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	fangwei@citicib.com.cn
客户服务电话		400-888-5988	95558
传真		021-20899008	010-85230024

## 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	<a href="http://www.ftfund.com">http://www.ftfund.com</a>
基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易实验区浦东南路 256 号 华夏银行大厦 36-37 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 1 月 1 日-2015 年 12 月 31 日		2014 年	2013 年
	转型前	转型后		
本期已实现收益	7,446,950.43	113,946,889.13	39,826,428.49	651,146.92
本期利润	-9,258,905.05	109,471,794.85	57,029,405.57	-2,098,694.58
加权平均基金份额本期利润	-0.0310	0.0499	0.2738	-0.0407
本期基金份额净值增长率	-2.81%	10.15%	19.20%	-4.23%
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	0.1344	0.1597	0.1817	-0.0046
期末基金资产净值	321,355,941.96	1,131,467,808.53	366,299,750.31	45,950,025.39
期末基金份额净值	1.134	1.229	1.186	0.995

#### 3.2 基金净值表现（转型前）

##### 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	转型前				①—③	②—④
	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		
过去三个月 (20141204-20150303)	-0.80%	1.59%	1.00%	0.01%	-1.80%	1.58%
过去六个月 (20140904-20150303)	10.94%	1.18%	2.09%	0.01%	8.85%	1.17%
过去一年(20140304-20150303)	14.35%	0.82%	4.33%	0.01%	10.02%	0.81%
过去三年(20120304-20150303)	16.28%	0.54%	14.00%	0.01%	2.28%	0.53%
自基金合同生效日起至 至今(20120222-20150303)	16.39%	0.54%	14.15%	0.01%	2.24%	0.53%

注：泰信保本混合型证券投资基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款的税后收益率。

泰信保本混合型证券投资基金自 2015 年 3 月 4 日起转型为混合型证券投资基金，2015 年 3 月 3 日为本基金转型前一日。本表格列示的为基金转型前的基金净值表现。

### 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

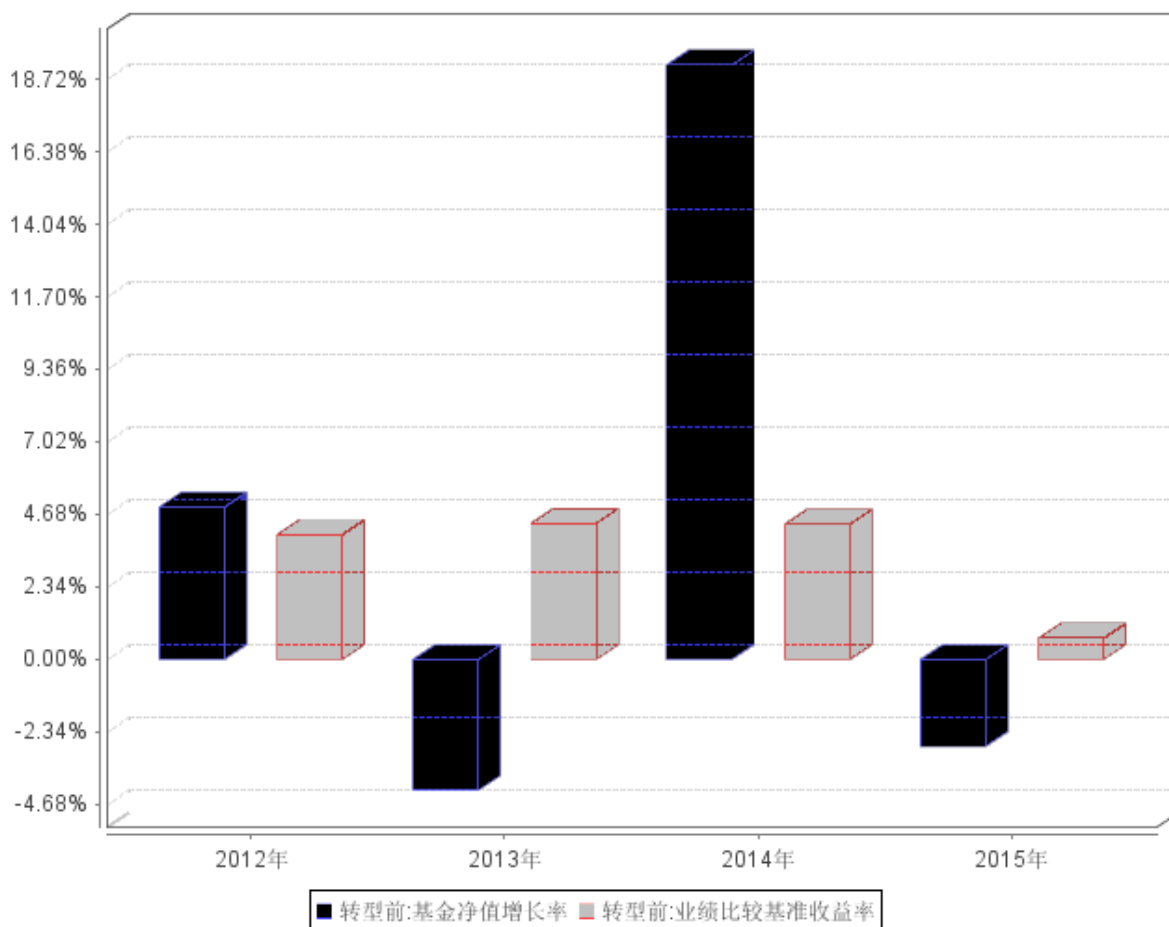


注：泰信保本混合型证券投资基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款的税后收益率。

泰信保本混合型证券投资基金自 2015 年 3 月 4 日起转型为混合型证券投资基金，2015 年 3 月 3 日为本基金转型前一日。本表格列示的为基金转型前的基金净值表现。

### 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

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：1、泰信保本混合基金合同于 2012 年 2 月 22 日正式生效，2012 年度相关数据根据实际存续期计算。

2、本基金于 2015 年 3 月 4 日转型为混合基金，因此 2015 年度实际存续期为 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 3 日。

## 3.2 基金净值表现（转型后）

### 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	转型后					
	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	1.72%	0.11%	9.92%	0.92%	-8.20%	-0.81%
过去六个月	-2.03%	0.35%	-7.13%	1.47%	5.10%	-1.12%
自基金合同生效起至今	10.15%	0.35%	7.39%	1.41%	2.76%	-1.06%

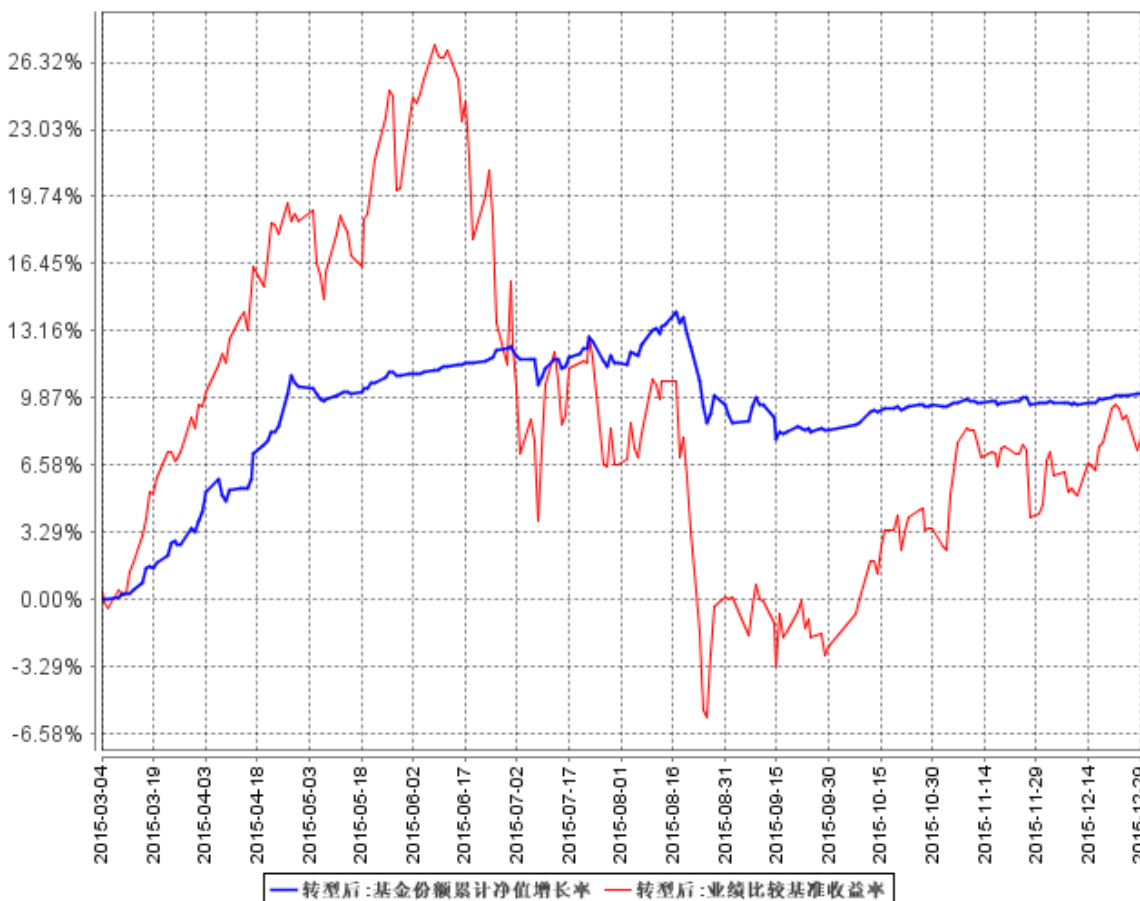
注：泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%



本基金于 2015 年 3 月 4 日转型生效。本表格列示的为基金转型后的基金净值表现。

### 3.2.2 自基金转型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



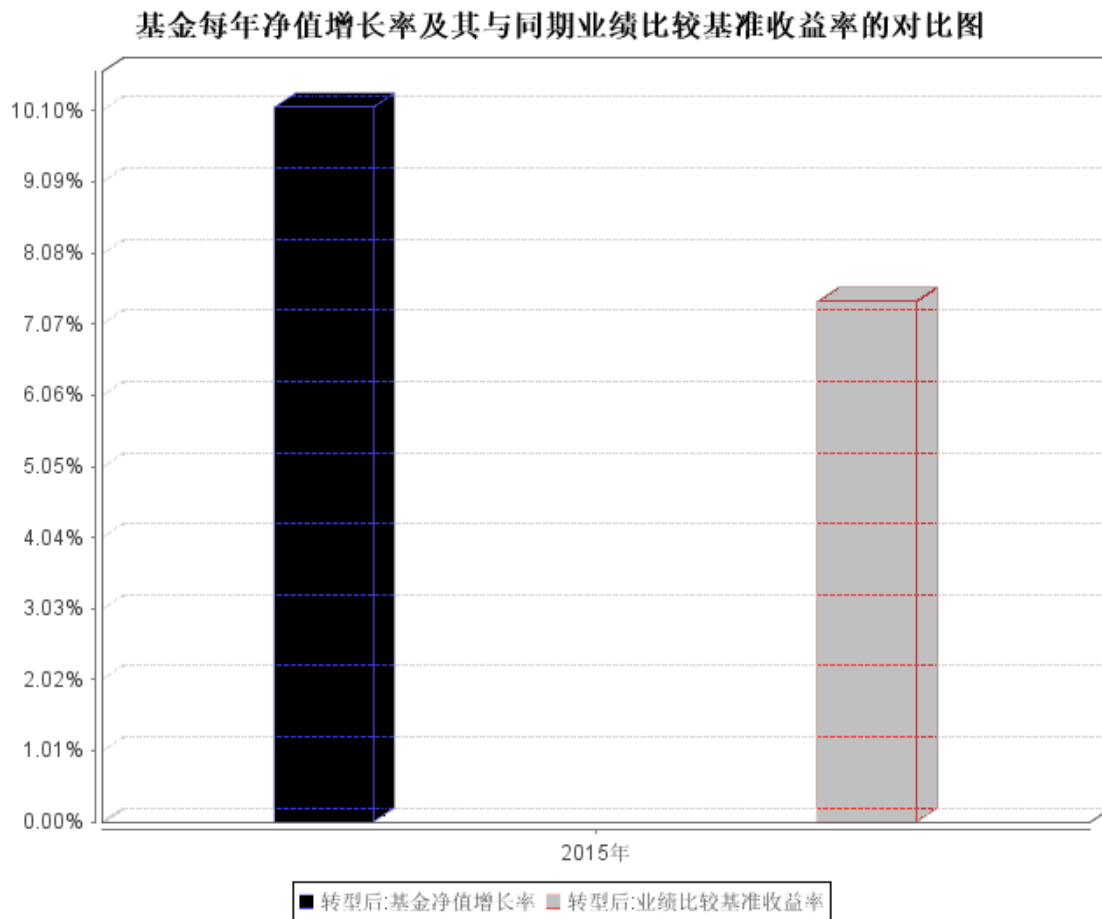
注：1、原泰信保本混合基金合同于 2012 年 2 月 22 日正式生效。自 2015 年 3 月 4 日起转型为泰信行业精选混合型证券投资基金。

2、经泰信行业精选混合型证券投资基金 2015 年 8 月 28 日基金份额持有人大会(通讯方式)表决通过，并报中国证监会备案，泰信行业精选混合型证券投资基金变更为泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金。自 2015 年 9 月 1 日起，由《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效。本基金的投资组合比例调整为：“本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金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后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券”，业绩比较基准不变。

3、本基金系原泰信保本混合型证券投资基金保本到期转型而来。根据《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，该基金的保本期为三年。保本周期到期后，依据《基金合同》规定，本基金未能符合保本基金存续条件，该基金转型为非保本的混合型证券投资基金，基金名

称变更为“泰信行业精选混合型证券投资基金”。自 2015 年 3 月 4 日起，《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》转型生效。

### 3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：泰信行业精选混合基金自 2015 年 3 月 4 日起转型生效。2015 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

转型前

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	0.2000	6,160,736.52	-	6,160,736.52	
2014	-	-	-	-	
2013	-	-	-	-	
合计	0.2000	6,160,736.52	-	6,160,736.52	

注：本基金的基金管理人于 2015 年 1 月 6 日宣告 2014 年度第一次分红，向截至 2015 年 1 月 8 日止在本基金注册登记人泰信基金管理有限公司 登记在册的本基金持有人，按每 10 份基金份

额派发红利 0.200 元。

### 转型后

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	0.2000	11,026,824.66	8,111,663.55	19,138,488.21	
合计	0.2000	11,026,824.66	8,111,663.55	19,138,488.21	

注：泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金自 2015 年 3 月 4 日起转型生效。

## § 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（转型前）

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		
董山青先生	基金投资部总监助理、本基金基金经理	2012 年 2 月 22 日	-	11 年	香港大学工商管理硕士，CFA。具有基金、期货从业资格。曾任职于中国银行上海分行。2004 年 8 月加入泰信基金管理有限公司，先后在清算会计部、研究部工作，曾任泰信优势增长基金经理助理。2010 年 9 月至 2012 年 10 月担任研究总监助理职务。现同时担任基金投资部总监助理职务。

注：1、以上日期均是指公司公告的日期；

2、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。

#### 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
董山青先生	基金投资部总监助理、本基金基金经理	2015 年 3 月 4 日	-	11	香港大学工商管理硕士，CFA。具有基金、期货从业资格。曾任职于中国银行上海分行。2004 年 8 月加入泰信基金管理有限公司，先后在清算会计部、研究部工作，曾任泰信优势增长基金经理助理。2010 年 9 月至 2012 年 10 月担任研究总监助理职务。现同时担任基金投资部总监助理职务。

注：1、以上日期均是指公司公告的日期；

2、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》、《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》、《泰信行业精选灵活配置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

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。

### 4.3.2 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

债券市场全年资金总体宽松，走出震荡向上的牛市行情。期间出现了部分信用债违约事件，造成低评级信用债震荡。股票市场大起大落，上半年大涨，下半年大跌酿成股灾。全年上证综指涨幅 11.79%，中小板综指涨幅 76.83%，创业板指涨幅 85.88%。

报告期内本基金在一季度完成了转型，转型后本基金确定保守的新股申购为核心策略；在下半年股灾开始后，市场不稳，随时可能出现大额赎回，对投资运作造成较大干扰。因此基于基金的风险收益定位、中长期的市场判断及持有人的利益，本基金以绝对收益为目标，采取类似保本基金的 CPPI 策略；基于对二级市场股票投资所持审慎态度，本基金将债券组合收益为安全垫，控制主动买入股票仓位在较低水平，并且债券组合也要保持高流动性，债券组合久期 1-2 年左右，选取 AA 及 AA 以上的流动性好，安全性高的债券品种，以 AAA 为主，适当配置 AA+，少量配置 AA 债券。年底 IPO 重启后，可转债和可交换债发行数量也开始增加，我们积极参与新股和新债申购，同时储备现金应对可能发生的赎回。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 3 日泰信保本混合基金净值增长率为-2.81%，同期业绩比较基准增长率为 0.69%。

2015 年 3 月 4 日（基金合同转型生效日）至 2015 年 12 月 31 日，泰信行业精选混合基金净值为 1.229 元，净值增长率为 10.15%，同期业绩比较基准收益率为 7.39%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一段时间，宏观经济压力仍存，经济增长依然乏力，发电量、工业企业库存显示出需求仍疲弱，固定资产投资下滑势头没有止住，工业企业利润低位徘徊，企业盈利能力恶化，产成品存货同比增速加快。总体来看，经济仍处下行之中，经济活跃度有所升温，但内需依然偏弱，出口能否受益人民币贬值尚待观察，资金面的阶段性宽松或仍将延续。

管理层继续推行宽松的货币政策和积极的财政政策，并准备在 2016 年开始推行注册制，我

们预计注册制的推行是一个长期过程，预计在退市制度和投资者保护制度尚未完善的情况下，上市公司的数量不会大跃进。注册制属于管理层稳增长的政策着力点之一，新兴产业和新兴业态将得到更多支持。12 月的中央经济会议，通过五大政策支柱和五大任务对“供给侧结构性改革”做出明确布局。

经历了股灾的巨幅波动，市场风险偏好有所改变，低风险资产重新回到投资者资产配置之中，风格偏好切换将继续利好债市。在稳增长及金融风险压力下，宽松政策持续，债市延续牛尾行情，但是泡沫也正在浮现，随着美联储加息进程的启动，我们债券市场的收益率继续下行的空间可能比较有限了。股市并不缺钱，而是缺少信心，行政化的救市政策稳住了市场，政策底已经出现，但是市场底仍需时间。由于近期股市大幅波动，注册制改革、新股发行制度和证券法修改可能出现波折，我们耐心等待制度变革。我们期待在国企、土地、财税、金融、反腐等方面出现重大力度改革，挽回市场信心，重启牛市之路。

#### 4.6 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。

#### 4.7 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收益分配基准日可供分配利润的 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:

(1) 保本周期内: 仅采用现金分红一种收益分配方式, 不进行红利再投资;

(2) 转型后: 基金收益分配方式分为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按除权日的基金份额净值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; 如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同, 基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准;

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、基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过 15 个工作日;

6、法律法规或监管机关另有规定的, 从其规定。

二、泰信保本混合基金于 2015 年 1 月 6 日宣告 2014 年度第一次分红, 向截至 2015 年 1 月 8 日止在本基金注册登记人泰信基金管理有限公司 登记在册的本基金持有人, 按每 10 份基金份额派发红利 0.200 元。利润分配合计 6,160,736.52 元, 全部以现金形式发放。符合基金合同的约定。

三、泰信行业精选灵活配置混合基金自 2015 年 3 月 4 日转型生效, 本报告期本基金每 10 份分配 0.200 元, 利润分配合计 19,138,488.21 元(其中, 现金形式发放 11,026,824.66 元, 再投资形式发放 8,111,663.55 元)。符合基金合同的约定。

## § 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

自本基金成立以来, 作为本基金的托管人, 中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定, 尽职尽责地履行了托管人应尽的义务, 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

报告期内，本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求，对基金管理人——泰信基金管理有限公司在本基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。本报告期，本基金进行了利润分配，经本托管人复核，符合合同相关要求，不存在损害持有人利益的情况。

## 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

本报告由泰信基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告(转型前)

### 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 22713 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	泰信保本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保本混合型证券投资基金(以下简称“泰信保本混合基金”)的财务报表，包括 2015 年 3 月 3 日(基金合同失效前日)的资产负债表、2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 3 日(基金合同失效前日)止期间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保本混合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”)、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, 上述泰信保本混合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, 公允反映了泰信保本混合基金 2015 年 3 月 3 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 3 日(基金合同失效前日)止期间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

## § 6 审计报告(转型后)

### 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 20849 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	泰信行业精选灵活配置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行业精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“泰信行业精选灵活配置混合基金”)的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 3 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间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	<p>编制和公允列报财务报表是泰信行业精选灵活配置混合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：</p> <p>(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”)、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财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(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。</p>	
注册会计师的责任段	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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>	
审计意见段	我们认为，上述泰信行业精选灵活配置混合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，公允反映了泰信行业精选灵活配置混合基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 3 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间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(转型前)

### 7.1 资产负债表(转型前)

会计主体：泰信保本混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 3 月 3 日

单位：人民币元

资 产	报告期初至转型前	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	233,785,615.85	2,023,092.94
结算备付金	5,692,761.39	25,221,397.34
存出保证金	515,763.98	314,129.15
交易性金融资产	-	598,264,315.12
其中：股票投资	-	244,788,116.12
基金投资	-	-
债券投资	-	353,476,199.00
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	85,963,326.72	719,299.55
应收利息	76,676.92	8,964,881.89
应收股利	-	-
应收申购款	-	119,882.66
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	326,034,144.86	635,626,998.65
<b>负债和所有者权益</b>	<b>报告期初至转型前</b>	<b>上年度末 2014 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	266,800,000.00
应付证券清算款	-	725,547.59
应付赎回款	4,054,916.39	45,233.85

应付管理人报酬	-	371,712.55
应付托管费	-	61,952.09
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	305,488.23	757,680.55
应交税费	27,134.40	27,134.40
应付利息	-	148,917.15
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	290,663.88	389,070.16
负债合计	4,678,202.90	269,327,248.34
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	283,272,972.80	308,860,643.82
未分配利润	38,082,969.16	57,439,106.49
所有者权益合计	321,355,941.96	366,299,750.31
负债和所有者权益总计	326,034,144.86	635,626,998.65

注：报告截止日 2015 年 3 月 3 日基金份额净值 1.134 元，基金份额总额 283,272,972.80 份。

## 7.2 利润表

会计主体：泰信保本混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 3 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 3 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-7,134,753.05	72,562,525.12
1. 利息收入	1,585,272.38	20,557,432.27
其中：存款利息收入	64,920.61	470,589.44
债券利息收入	1,466,762.95	19,922,256.07
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	53,588.82	164,586.76
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	7,852,960.21	34,442,005.09
其中：股票投资收益	13,892,212.04	29,993,064.40
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-6,039,251.83	4,358,689.75
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	-	90,250.94
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-16,705,855.48	17,202,977.08

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	132,869.84	360,110.68
<b>减：二、费用</b>	<b>2,124,152.00</b>	<b>15,533,119.55</b>
1. 管理人报酬	622,982.23	2,614,643.18
2. 托管费	103,830.37	435,773.86
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	655,289.55	1,574,184.49
5. 利息支出	668,549.76	10,475,397.99
其中：卖出回购金融资产支出	668,549.76	10,475,397.99
6. 其他费用	73,500.09	433,120.03
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-9,258,905.05</b>	<b>57,029,405.57</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-9,258,905.05</b>	<b>57,029,405.57</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信保本混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 3 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 3 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）	308,860,643.82	57,439,106.49	366,299,750.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-9,258,905.05	-9,258,905.05
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）	-25,587,671.02	-3,936,495.76	-29,524,166.78
其中：1. 基金申购款	4,549,448.34	850,938.20	5,400,386.54
2. 基金赎回款	-30,137,119.36	-4,787,433.96	-34,924,553.32
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）	-	-6,160,736.52	-6,160,736.52

五、期末所有者权益（基金净值）	283,272,972.80	38,082,969.16	321,355,941.96
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）	46,161,266.21	-211,240.82	45,950,025.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	57,029,405.57	57,029,405.57
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）	262,699,377.61	620,941.74	263,320,319.35
其中：1. 基金申购款	333,173,252.96	5,431,253.74	338,604,506.70
2. 基金赎回款	-70,473,875.35	-4,810,312.00	-75,284,187.35
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）	308,860,643.82	57,439,106.49	366,299,750.31

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

泰信保本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[2011]第1598号《关于核准泰信保本混合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《泰信保本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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币221,949,752.06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(2012)第031号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》于2012年2月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为

221,971,641.04 份基金份额，其中认购资金利息折合 21,888.98 份基金份额。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。本基金的担保人为山东省鲁信投资控股集团有限公司，为本基金的保本提供不可撤销的连带责任保证担保。

根据《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的第一个保本周期为三年。在第一个保本周期内，本基金为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额提供的保本额为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资金额，即基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的净认购金额及募集期间的利息收入之和。在保本周期到期日，如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其认购并持有到期的基金份额的累计分红款项之和低于其认购并持有到期的基金份额的投资金额，基金管理人应补足该差额并及时偿付，保证人对此提供不可撤销的连带责任保证。

根据《关于泰信保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及泰信行业精选混合型证券投资基金转型运作后相关业务规则的公告》的有关规定，本基金保本期于 2015 年 2 月 25 日到期。保本期到期后进入过渡期。保本周期到期操作期间为 2015 年 2 月 25 日至 2015 年 3 月 3 日。在本基金到期操作期间截止日次日，即 2015 年 3 月 4 日起“泰信保本混合型证券投资基金”转型为“泰信行业精选混合型证券投资基金”。泰信行业精选混合型证券投资基金合同及托管协议即日起生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，投资于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(包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证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(但需符合中国证监会的相关规定)。在保本周期内，本基金的投资组合比例为：股票、权证等收益资产占基金资产的 0-40%，其中，持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的 60%-100%，其中，基金持有现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款的税后收益率。

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》、《泰信保本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 1 月 1 日至 2015 年 3 月 3 日止期间的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 3 月 3 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 3 日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
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	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
山东省鲁信投资控股集团有限公司	基金管理人股东的母公司、基金担保人

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

本期末及上年度可比期间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

本期及上年度可比期间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

本期及上年度可比期间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

本期及上年度可比期间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

本期及上年度可比期间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 3 月 3 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	622,982.23	2,614,643.18
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	81,316.11	364,929.49

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 1.2% 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 × 1.2% / 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 3 月 3 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	103,830.37	435,773.86

注：支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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 × 0.2% / 当年天数。

**7.4.8.2.3 销售服务费**

本报告期及上年度本基金未发生销售服务费用。

**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**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 3 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	39,524,703.56	-
期间申购/买入总份额	-	39,524,703.56
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-

期末持有的基金份额	39,524,703.56	39,524,703.56
期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.95%	12.80%

#### 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 2015年3月3日		上年度末 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	96,968,496.20	34.23%	96,968,496.20	31.40%

#### 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 2015年1月1日至2015年3月3日		上年度可比期间 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
中信银行	233,785,615.85	64,920.61	2,023,092.94	41,931.10

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期末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

本基金由山东省鲁信投资控股集团有限公司作为担保人，为本基金的保本提供不可撤销的连带责任保证担保。保证担保的范围为：在保本周期到期日，基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积加上认购并持有到期的基金份额累计分红金额之和计算的总金额低于认购保本金额的差额部分。本基金的担保费由本基金的基金管理人按基金资产净值 0.2% 的年费率从基金管理费收入中列支。

#### 7.4.9 期末（2015年3月3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股票

报告期末本基金未持有因认购新发/增发而流通受限股票。

### 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 3 月 3 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无属于第一层次、第二层次或第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 568,817,733.52，属于第二层次的余额为 29,446,581.60 元，无属于第三层次的余额)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 3 月 3 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。

## § 7 年度财务报表(转型后)

### 7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：泰信行业精选灵活配置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	附注号	转型后至报告期末
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	1,837,824.39
结算备付金		20,384,499.84
存出保证金		774,232.91
交易性金融资产	7.4.7.2	444,036,615.13
其中：股票投资		32,725,690.43
基金投资		-
债券投资		411,310,924.70
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	133,400,000.00
应收证券清算款		906,429,762.58
应收利息	7.4.7.5	8,082,351.62
应收股利		-
应收申购款		3,055.07
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	642,417.94
资产总计		1,515,590,759.48
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>转型后至报告期末</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		380,000,000.00
应付证券清算款		-
应付赎回款		2,139,007.28
应付管理人报酬		1,193,229.76
应付托管费		248,589.55
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	84,334.76
应交税费		27,134.40
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	430,655.20
负债合计		384,122,950.95
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	920,517,365.81
未分配利润	7.4.7.10	210,950,442.72
所有者权益合计		1,131,467,808.53
负债和所有者权益总计		1,515,590,759.48

注：1、报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.229 元，基金份额总额 920,517,365.81 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2015 年 3 月 4 日(基金合同转型生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 3 月 4 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2015 年 3 月 4 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		156,331,926.29
1. 利息收入		66,350,293.75
其中：存款利息收入	7.4.7.11	13,255,511.56
债券利息收入		41,294,971.94
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		11,799,810.25
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		56,104,463.14
其中：股票投资收益	7.4.7.12	60,044,708.85

基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-5,529,454.72
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	1,589,209.01
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-4,475,094.28
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	38,352,263.68
<b>减：二、费用</b>		46,860,131.44
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	32,928,921.65
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,695,575.08
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	3,685,962.18
5. 利息支出		4,074,968.38
其中：卖出回购金融资产支出		4,074,968.38
6. 其他费用	7.4.7.20	474,704.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		109,471,794.85
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		109,471,794.85

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 3 月 4 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 3 月 4 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）	283,272,972.80	38,082,969.16	321,355,941.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	109,471,794.85	109,471,794.85
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）	637,244,393.01	82,534,166.92	719,778,559.93



其中：1. 基金申购款	8,954,026,763.27	2,280,279,865.59	11,234,306,628.86
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-8,316,782,370.26	-2,197,745,698.67	-10,514,528,068.93
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）	-	-19,138,488.21	-19,138,488.21
五、期末所有者权益（基金净值）	920,517,365.81	210,950,442.72	1,131,467,808.53

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：

_____ 葛航	_____ 韩波	_____ 蔡海成
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

泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由原泰信保本混合型证券投资基金变更而来。根据《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》的约定以及本基金的基金管理人发布的《关于泰信保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及泰信行业精选混合型证券投资基金转型运作后相关业务规则的公告》的规定，泰信保本混合型证券投资基金保本期于 2015 年 2 月 25 日到期。保本期到期后进入过渡期。保本周期到期操作期间为 2015 年 2 月 25 日至 2015 年 3 月 3 日。到期操作期间截止日次日，即 2015 年 3 月 4 日起“泰信保本混合型证券投资基金”转型为“泰信行业精选混合型证券投资基金”，修订后的《泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》自同一起失效。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信行业精选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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、资产支持证券、中小企业私募债券、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金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后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：55%×沪深 300 指数收

益率+45%×上证国债指数收益率。

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》、《泰信行业精选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。

## 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 3 月 4 日(基金合同转型生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间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 3 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 3 月 4 日(基金合同转型生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以

衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产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起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，

参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购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和托管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

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，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[2008]38号《关于进一步规范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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募

债券除外)，按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券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

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 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 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 2015 年 12 月 31 日
活期存款	1,837,824.39
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,837,824.39

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	估值增值	
股票	33,180,946.89	32,725,690.43	-455,256.46	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	415,330,762.52	411,310,924.70	-4,019,837.82
	银行间市场	-	-	-
	合计	415,330,762.52	411,310,924.70	-4,019,837.82
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	448,511,709.41	444,036,615.13	-4,475,094.28	

##### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金无衍生金融资产余额。

##### 7.4.7.4 买入返售金融资产

###### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

买入返售证券	133,400,000.00	-
合计	133,400,000.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未进行买断式逆回购。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应收活期存款利息	121,986.74
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	9,173.00
应收债券利息	7,930,577.82
应收买入返售证券利息	20,265.66
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	348.40
合计	8,082,351.62

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
其他应收款	642,417.94
待摊费用	-
合计	642,417.94

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	84,334.76
银行间市场应付交易费用	-
合计	84,334.76

#### 7.4.7.8 其他负债



单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,655.20
预提费用	429,000.00
合计	430,655.20

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 3 月 4 日至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	283,272,972.80	283,272,972.80
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	8,954,026,763.27	8,954,026,763.27
本期赎回（以“-”号填列）	-8,316,782,370.26	-8,316,782,370.26
本期末	920,517,365.81	920,517,365.81

#### 7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	52,699,529.99	-14,616,560.83	38,082,969.16
本期利润	113,946,889.13	-4,475,094.28	109,471,794.85
本期基金份额交易产生的变动数	-540,082.10	83,074,249.02	82,534,166.92
其中：基金申购款	2,262,907,761.78	17,372,103.81	2,280,279,865.59
基金赎回款	-2,263,447,843.88	65,702,145.21	-2,197,745,698.67
本期已分配利润	-19,138,488.21	-	-19,138,488.21
本期末	146,967,848.81	63,982,593.91	210,950,442.72

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 3 月 4 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	12,177,192.11
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	826,438.77
其他	251,880.68
合计	13,255,511.56

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年3月4日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	1,575,172,108.82
卖出股票成本总额	1,206,243,217.89
买卖股票差价收入	60,044,708.85

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2015年3月4日至2015年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-5,529,454.72
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-5,529,454.72

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年3月4日至2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,454,038,069.57
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,397,544,412.34
减：应收利息总额	62,023,111.95
债券投资收益	-5,529,454.72

##### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

报告期末本基金未投资资产支持证券。

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

报告期末本基金未投资贵金属。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

报告期末本基金无衍生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月4日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,589,209.01
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,589,209.01

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年3月4日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-4,475,094.28
——股票投资	-455,256.46
——债券投资	-4,019,837.82
——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	-
合计	-4,475,094.28

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月4日至2015年12月31日
基金赎回费收入	37,332,595.85
转出基金补偿费	994,877.45
其他	24,790.38
合计	38,352,263.68

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和转入基金申购补差费构成，其中赎回费部分的 25% 归入基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 3 月 4 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	3,685,962.18
银行间市场交易费用	-
合计	3,685,962.18

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 3 月 4 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	89,808.44
信息披露费	265,643.36
账户服务费	29,884.32
持有人大会费用	50,000.00
银行划款手续费	39,368.03
合计	474,704.15

### 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

截至财务报表报出日，本基金并无须做披露的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
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
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	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。

#### 7.4.10 本报告期间的关联方交易

##### 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

报告期末本基金未通过关联方进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

报告期末本基金未通过关联方进行债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

报告期末本基金未通过关联方进行债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

报告期末本基金未通过关联方进行权证交易。

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

报告期末本基金无应支付关联方的佣金。

#### 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 2015 年 3 月 4 日至 2015 年 12 月 31 日
当期应支付的管理费	32,928,921.65
其中：支付销售机构的客户维护费	3,067,932.33

注：支付基金管理人泰信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 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：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% ÷ 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 3 月 4 日至 2015 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	5,695,575.08

注：支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

报告期末本基金无销售服务费用。

#### 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

本期末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。

#### 7.4.10.4 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

份额单位：份

项目	本期
	2015年3月4日至2015年12月31日
期初持有的基金份额	39,524,703.56
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分增加的份额	-
期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	39,524,703.56
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	4.29%

##### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末	
	2015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
山东省国际信托股 份有限公司	53,198,338.38	5.78%

##### 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	
	2015年3月4日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中信银行	1,837,824.39	12,177,192.11

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

##### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期末本基金未参与关联方主承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期末本基金无其他关联交易事项说明。

#### 7.4.11 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

##### 7.4.11.2 期末持有的暂时停牌股票

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
000657	中钨 高新	2015 年 8 月 6 日	重大事 项公告	16.01	2016 年 2 月 25 日	16.30	500,000	10,298,586.00	8,005,000.00

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。

##### 7.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

报告期末本基金未持有银行间市场正回购债券。

###### 7.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金持有交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 380,000,000.00 元，于 2016 年 1 月 7 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按照证券交易所规定的比例折算成标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12 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 24,720,690.43 元，属于第二层次的余额为 419,315,924.70 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。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 26 日起改为采用中央国债登记结算有限责任公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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 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。

(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(转型前)

### 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		
	其中：股票		
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	239,478,377.24	73.45
7	其他资产	86,555,767.62	26.55
8	合计	326,034,144.86	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

截至报告期末（2015年3月3日）本基金未持有股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

截至报告期末（2015年3月3日）本基金未持有股票。

## 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	600028	中国石化	23,039,259.51	6.29
2	600026	中海发展	9,871,792.70	2.70
3	601318	中国平安	9,620,502.76	2.63
4	601100	恒立油缸	8,319,958.58	2.27
5	601818	光大银行	5,594,000.00	1.53
6	600305	恒顺醋业	3,475,891.50	0.95
7	600809	山西汾酒	1,977,401.76	0.54
8	000401	冀东水泥	352,268.00	0.10
9	002739	万达院线	10,675.00	0.00

10	300413	快乐购	4,530.00	0.00
----	--------	-----	----------	------

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	601318	中国平安	29,948,609.54	8.18
2	600028	中国石化	25,112,170.00	6.86
3	000060	中金岭南	20,016,282.19	5.46
4	600332	白云山	19,081,502.48	5.21
5	600315	上海家化	19,006,799.60	5.19
6	600362	江西铜业	17,493,429.95	4.78
7	600500	中化国际	17,239,385.91	4.71
8	000758	中色股份	16,947,868.70	4.63
9	000630	铜陵有色	16,744,908.98	4.57
10	600809	山西汾酒	15,139,986.39	4.13
11	002646	青青稞酒	12,292,626.68	3.36
12	601872	招商轮船	11,341,029.50	3.10
13	600026	中海发展	10,006,549.79	2.73
14	601818	光大银行	9,798,971.57	2.68
15	601369	陕鼓动力	9,771,620.13	2.67
16	601100	恒立油缸	7,951,329.00	2.17
17	000401	冀东水泥	6,950,741.74	1.90
18	600428	中远航运	6,811,469.45	1.86
19	300315	掌趣科技	6,021,501.60	1.64
20	000423	东阿阿胶	5,954,557.30	1.63

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	62,266,279.81
卖出股票收入（成交）总额	308,884,182.08

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

截至报告期末（2015 年 3 月 3 日）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

截至报告期末（2015 年 3 月 3 日）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

截至报告期末（2015 年 3 月 3 日）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

截至报告期末（2015 年 3 月 3 日）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

截至报告期末（2015 年 3 月 3 日）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（2015 年 3 月 3 日）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（2015 年 3 月 3 日）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（2015 年 3 月 3 日）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（2015 年 3 月 3 日）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（2015 年 3 月 3 日）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 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	515,763.98
2	应收证券清算款	85,963,326.72
3	应收股利	-
4	应收利息	76,676.92
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	86,555,767.62

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至报告期末（2015 年 3 月 3 日）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**

截至报告期末（2015 年 3 月 3 日）本基金未持有股票。

**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。

**§ 8 投资组合报告(转型后)****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	32,725,690.43	2.16
	其中：股票	32,725,690.43	2.16
2	固定收益投资	411,310,924.70	27.14
	其中：债券	411,310,924.70	27.14
	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	133,400,000.00	8.80
	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	22,222,324.23	1.47
7	其他资产	915,931,820.12	60.43
8	合计	1,515,590,759.48	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,895,980.78	1.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,802,000.00	0.78
E	建筑业	569,223.75	0.05

F	批发和零售业	1,737,304.44	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	233,257.06	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,572,800.00	0.23
L	租赁和商务服务业	932,400.00	0.08
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	982,724.40	0.09
S	综合	-	-
	合计	32,725,690.43	2.89

### 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 (转型后)

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	000690	宝新能源	900,000	8,802,000.00	0.78
2	000657	中钨高新	500,000	8,005,000.00	0.71
3	601588	北辰实业	480,000	2,572,800.00	0.23
4	600521	华海药业	100,000	2,539,000.00	0.22
5	600887	伊利股份	110,000	1,807,300.00	0.16
6	601933	永辉超市	150,000	1,515,000.00	0.13
7	603100	川仪股份	60,000	1,088,400.00	0.10
8	600513	联环药业	40,000	1,042,400.00	0.09
9	603999	读者传媒	16,713	982,724.40	0.09
10	600138	中青旅	40,000	932,400.00	0.08

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601211	国泰君安	92,855,426.22	8.21
2	600332	白云山	90,221,471.81	7.97
3	600109	国金证券	81,965,373.96	7.24
4	601919	中国远洋	80,179,196.98	7.09
5	600999	招商证券	72,893,767.01	6.44
6	600395	盘江股份	68,655,399.36	6.07
7	600026	中海发展	61,078,797.23	5.40
8	601866	中海集运	60,676,845.14	5.36
9	002353	杰瑞股份	42,207,582.71	3.73
10	600428	中远航运	33,239,967.31	2.94
11	601985	中国核电	32,649,100.17	2.89
12	601872	招商轮船	31,028,846.70	2.74
13	603567	珍宝岛	25,255,339.30	2.23
14	600028	中国石化	23,039,259.51	2.04
15	000783	长江证券	22,346,054.00	1.97
16	300286	安科瑞	21,997,367.45	1.94
17	000100	TCL 集团	17,597,956.46	1.56
18	600688	上海石化	14,349,189.80	1.27
19	600169	太原重工	14,127,787.00	1.25
20	002709	天赐材料	12,550,055.10	1.11

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601211	国泰君安	147,079,980.04	13.00
2	601985	中国核电	133,313,052.28	11.78
3	600332	白云山	70,198,538.71	6.20

4	601919	中国远洋	66,769,455.45	5.90
5	601866	中海集运	58,867,064.10	5.20
6	600999	招商证券	57,404,235.61	5.07
7	600026	中海发展	54,296,646.40	4.80
8	600395	盘江股份	46,645,424.94	4.12
9	600428	中远航运	38,056,521.05	3.36
10	601872	招商轮船	36,526,606.99	3.23
11	600109	国金证券	34,192,930.45	3.02
12	002353	杰瑞股份	31,722,884.49	2.80
13	000783	长江证券	23,597,904.00	2.09
14	300286	安科瑞	22,617,113.55	2.00
15	603567	珍宝岛	19,536,348.92	1.73
16	000100	TCL 集团	18,184,000.00	1.61
17	600688	上海石化	14,914,936.40	1.32
18	600169	太原重工	14,243,706.90	1.26
19	002709	天赐材料	12,807,636.40	1.13
20	002293	罗莱生活	12,687,238.93	1.12

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	1,301,690,444.59
卖出股票收入（成交）总额	1,575,172,108.82

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

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	75,183,073.80	6.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	336,127,850.90	29.71
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-



7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	411,310,924.70	36.35

## 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	019317	13 国债 17	634,820	64,021,597.00	5.66
2	112079	12 长安债	540,905	55,713,215.00	4.92
3	122733	11 京资 01	471,280	48,084,698.40	4.25
4	122065	11 上港 01	456,670	45,913,601.80	4.06
5	122097	11 浦路桥	357,400	36,858,662.00	3.26

## 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

截至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

截至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

截至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 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	774,232.91
2	应收证券清算款	906,429,762.58
3	应收股利	-
4	应收利息	8,082,351.62
5	应收申购款	3,055.07

6	其他应收款	642,417.94
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	915,931,820.12

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	000657	中钨高新	8,005,000.00	0.71	重大事项公告

**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(转型前)

### 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
447	633,720.30	230,048,319.21	81.21%	53,224,653.59	18.79%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	119,809.20	0.0423%

#### 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

### § 9 基金份额持有人信息(转型后)

#### 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
2,852	322,762.05	635,931,113.69	69.08%	284,586,252.12	30.92%

#### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	92,210.75	0.0100%

#### 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	0~10
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 ( 2015 年 3 月 4 日 ) 基金份额总额	283, 272, 972. 80
报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	8, 954, 026, 763. 27
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	8, 316, 782, 370. 26
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 ( 份额减少以 "-" 填列 )	-
报告期期末基金份额总额	920, 517, 365. 81

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，泰信行业精选混合型证券投资基金（以下简称“泰信行业精选基金”或“本基金”）的基金管理人泰信基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）于 2015 年 7 月 22 日 15:00 起至 2015 年 8 月 26 日 15:00 通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，并与 2015 年 8 月 28 日表决通过《关于修改泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

本次《基金合同》主要修改内容集中在如下几方面：

1、调整本基金投资范围，增加资产支持证券、中小企业私募债券、股指期货等投资品种，以及如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

2、调整本基金投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%，业绩比较基准不变，并按照证监会要求相应地将基金名称调整为“泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金”。

3、调低基金管理人的管理费率，由原合同中的 1.5% 调整为 1.2%。

4、整体调低《招募说明书》中的基金赎回费率，将原赎回费率结构：T<7 天，1.5%；7 天 ≤ T<30 天，0.75%；30 天 ≤ T<365 天，0.5%；365 天 ≤ T<730 天，0.25%；T ≥ 730 天，0% 调整为：

T<7 天, 1.5%; 7 天≤T<30 天, 0.75%; 30 天≤T<180 天, 0.5%; 180 天≤T<365 天, 0.1%; 365 天≤T<730 天, 0.05%; T≥730 天, 0%。归入基金资产比例不变。

5、近年来《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》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》等法律法规、证监会规范性文件陆续修订并颁布实施,原《基金合同》中部分条款及措辞已不符合新规要求或不符合监管机构最新监管要求,本基金管理人泰信基金管理有限公司经与基金托管人中信银行股份有限公司协商一致,对《基金合同》中以上相关内容进行修改并完善。

6、原《基金合同》中相关内容表述不够完善,本基金管理人泰信基金管理有限公司经与基金托管人中信银行股份有限公司协商一致,对《基金合同》中以上相关内容进行修改并完善。

关于本次基金份额持有人大会具体详情请参见本基金管理人于 2015 年 7 月 18 日在指定媒介及泰信基金网站上对外披露的《泰信行业精选混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会公告》、2015 年 8 月 31 日对外披露的《泰信行业精选混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》。

## 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

本报告期基金管理人、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

1、本基金系原泰信保本混合型证券投资基金保本到期转型而来。根据《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,该基金的保本期为三年。自《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》生效之日(2012 年 2 月 22 日)起至三个公历年后对应日 2015 年 2 月 25 日(依据《基金合同》规定如该对应日为非工作日,则顺延至下一个工作日)止,该保本周期到期。保本周期到期后,依据《基金合同》规定,本基金未能符合保本基金存续条件,该基金自 2015 年 3 月 4 日起转型为非保本的混合型证券投资基金,基金名称变更为“泰信行业精选混合型证券投资基金”,基金业绩比较基准变更为“沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%”,各项投资比例变更为“股票投资比例为基金资产的 30%-80%;债券投资比例为基金资产的

15%-65%；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；并保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。”基金托管人及基金注册机构保持不变，基金代码亦保持不变仍为“290012”。经基金管理人和基金托管人同意，本基金管理人于转型后的《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》进行了修改，并据此修改了《泰信行业精选混合型证券投资基金托管协议》、更新了《泰信行业精选混合型证券投资基金招募说明书》，并报中国证监会备案。

2、经泰信行业精选混合型证券投资基金 2015 年 8 月 28 日基金份额持有人大会(通讯方式)表决通过，并报中国证监会备案，泰信行业精选混合型证券投资基金变更为泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金。自 2015 年 9 月 1 日起，由《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效。本基金的投资组合比例调整为：“本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金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后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券”，业绩比较基准不变。

## 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 10 万元。该审计机构从基金合同生效日（2012 年 2 月 22 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、托管人托管业务部门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 (转型后)

### 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	
海通证券		22,259,163,026.87	95.21%	2,046,653.34	95.25%	-
中山证券	1	113,621,021.68	4.79%	101,951.43	4.75%	-

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信银行托管的泰信周期回报债券基金、泰信鑫益定期开放债券基金共用交易单元。

### 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
海通证券	3,907,210,693.50	99.58%	124,646,810,000.00	99.22%	-	-
中山证券	16,284,823.56	0.42%	975,138,000.00	0.78%	-	-

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)

### 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	
海通证券	2	338,224,204.68	100.00%	305,488.23	100.00%	-
中山证券	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信银行托管的泰信周期回报债券基金、泰信鑫益定期开放债券基金共用交易单元。

### 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
海通证券	595,792,080.70	100.00%	4,010,800,000.00	100.00%	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金系原泰信保本混合型证券投资基金保本到期转型而来。根据《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，该基金的保本期为三年。保本周期到期后，依据《基金合同》规定，本基金未能符合保本基金存续条件，该基金转型为非保本的混合型证券投资基金，基金名称变更为“泰信行业精选混合型证券投资基金”。自 2015 年 3 月 4 日起，《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》转型生效。

经泰信行业精选混合型证券投资基金 2015 年 8 月 28 日基金份额持有人大会(通讯方式)表决通过，并报中国证监会备案，泰信行业精选混合型证券投资基金变更为泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金。自 2015 年 9 月 1 日起，由《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效。本基金的投资组合比例调整为：“本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金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后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券”，业绩比较基准不变。

泰信基金管理有限公司  
2016 年 3 月 30 日