

泰信中小盘精选混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.6 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.....	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	38
7.8 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.....	38
7.9 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.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38
7.12 投资组合报告附注.....	39
§8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	40
§9 开放式基金份额变动.....	40
§10 重大事件揭示.....	41
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
10.2 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.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 其他重大事件.....	44
§11 备查文件目录.....	46
11.1 备查文件目录.....	46
11.2 存放地点.....	47
11.3 查阅方式.....	47

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信中小盘精选混合型证券投资基金
基金简称	泰信中小盘精选混合
基金主代码	290011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 10 月 26 日
基金管理人	泰信基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	137,411,224.55 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资具有高成长潜力的中小盘股票，追求基金资产的长期稳定增值。在严控风险的前提下，力争获取超越业绩基准的稳健收益。
投资策略	本基金将结合“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”的个股精选策略，重点投资于萌芽期和成长期行业中具有持续成长潜力以及未来成长空间广阔的中小上市公司，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	本基金业绩比较基准为：中证 700 指数收益率 × 80% + 中证全债指数收益率 × 20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，主要通过发掘具有高成长潜力的中小盘股票实现基金资产增值，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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡囡	王永民
	联系电话	021-20899098	010-66594896
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-5988	95566
传真		021-20899008	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层	北京西城区复兴门内大街 1 号

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	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	王小林	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ftfund.com
基金半年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36-37 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泰信基金管理有限公司	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

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-24,342,698.87
本期利润	-47,535,827.12
加权平均基金份额本期利润	-0.3420
本期加权平均净值利润率	-19.70%
本期基金份额净值增长率	-13.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	115,117,935.30
期末可供分配基金份额利润	0.8378
期末基金资产净值	252,529,159.85
期末基金份额净值	1.838
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	115.22%

注：1、本基金基金合同于 2011 年 10 月 26 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、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
过去一个月	6.06%	1.44%	1.50%	1.14%	4.56%	0.30%
过去三个月	2.11%	1.49%	-1.05%	1.21%	3.16%	0.28%
过去六个月	-13.44%	2.24%	-15.42%	1.95%	1.98%	0.29%
过去一年	-21.68%	2.88%	-24.80%	2.27%	3.12%	0.61%
过去三年	106.99%	2.13%	60.29%	1.67%	46.70%	0.46%
自基金合同生效起至今	115.22%	1.83%	41.47%	1.51%	73.75%	0.32%

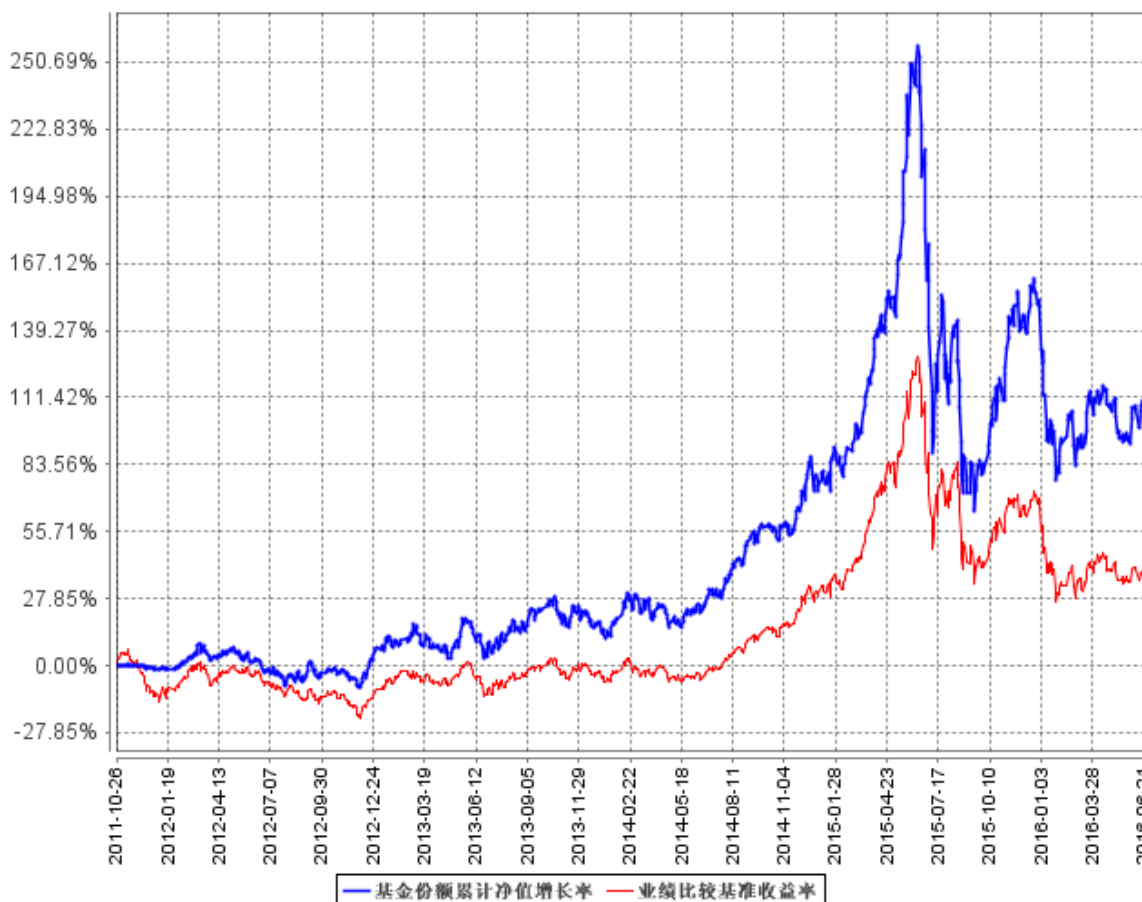
注：本基金业绩比较基准为：中证 700 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

1、中证 700 指数是中证指数有限公司以沪深 300 指数为基础编制的系列规模指数之一，其成分股由代表中盘特征的中证 200 指数的成分股和代表小盘特征的中证 500 指数的成分股共同构成，中证 700 指数编制合理、透明，运用广泛，能够综合反映沪深证券市场内中小市值公司的整体状况，对中国 A 股中小盘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、本基金基金合同于 2011 年 10 月 26 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，本基金将基金资产的 60%–95%投资于股票，现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，债券、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规和监管机构的规定执行。本基金投资于中小盘股票的比例不低于股票投资资产的 80%。

§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.）是山东省国际信托投资有限公司（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 2016 年 6 月底，公司有正式员工 107 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 2016 年 6 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、泰信鑫选混合、泰信互联网+混合共 18 只开放式基金及泰信乐利 5 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 1 号、泰信中行新时代 6 号、泰信财达添利 1 号、泰信合信 1 号、泰信融昇 1 号保本、泰信融昇 2 号保本、泰信财达添利 2 号、泰信融昇 3 号保本、泰信融昇 4 号保本、泰信融嘉 1 号保本、泰信融嘉 2 号保本、泰信中融景诚旭诚一期债券、泰信洛肯 1 号、泰信洛肯 2 号、泰信合信 3 号共 20 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	说明
----	----	-----------------	-----	----

		任职日期	离任日期	业年限	
刘杰先生	本基金经理	2015年3月17日	-	7年	研究生硕士。具有基金从业资格。2009年7月加入泰信基金管理有限公司，先后担任研究部助理研究员、研究员、高级研究员兼专户投资部投资顾问。

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遵规守信情况的说明

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》、《泰信中小盘精选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律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。

4.3.2 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，亦无其他异常交易行为。

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

2016 年上半年，市场整体表现为快速回落筑底企稳的走势。一月份指数单边下跌，上证指数创自去年 5 月份调整以来新低，恐慌情绪再度蔓延市场；二月开始，市场逐步企稳，春节后逐步浮出水面的宏观经济数据显示经济有企稳迹象，加之海外市场对国内影响较为正面，指数呈现出区间震荡并缓慢走高的趋势。经历了一季度末行业、板块的轮番表现后，大盘指数在二季度趋于稳定，但局部热点开始逐步凸显，结构性行情持续演绎。由于一季度刺激政策加码较重，二季度投资力度相对减弱，同时供给侧改革也没有新的进展，因此，传统行业基本被市场所忽视。六月份，由于海外几大风险事件的逐步兑现，特别是英国脱欧给全球市场带来了不小的冲击。一时间，股市、汇市、商品市场均出现了剧烈的波动，反观 A 股表现，相对较为平稳，但避险情绪进一步推升了贵金属板块的表现，以黄金为代表的贵金属板块股价持续向好。纵观上半年市场整体表现，消费、价值、防御几大投资方向表现显著优于其他版块，较之成长股的超额收益更加明显。

一季度由于一月份的净值大幅回撤，后面两个月的仓位策略都较为保守，但也在春节后对配置做了较大幅度调整，同时在二月底积极加仓。进入二季度，指数逐渐失真，我们也逐步淡化了对于大盘指数的判断，更多强调板块和个股的选择，积极参与市场热点。大部分时间内，基金都维持了较高仓位的运作。展望下半年，我们认为存量博弈的区间震荡格局短期难以打破，在这样的背景下板块的超额收益的持续性会变得很不确定。回顾上半年，消费、价值已经获得明显的超额收益，下半年继续强势的可能性变得越来越小；我们倾向于认为，下半年超额收益可能来自于预期低、配置低的成长板块，但我们也要注意版块内的分化，“真成长”才能兑现真收益。我们仍将坚持，自上而下做配置、自下而上挑个股的策略寻找投资机会。

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 1.838 元，净值增长率为-13.44%，同期比较基准增长率为-15.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济基本面——物价数据好于预期。5 月 CPI 同比略低于预期，预计二季度物价保持温和增长。CPI 来看，食品价格是前期推升 CPI 的重要因素，近期猪肉价格依然因供给因素保持强势，随着天气回暖，影响春季的气候因素逐渐消除，但油价的上涨可能成为未来助推动力，油井供给的增加值得关注；PPI 来看，工业品价格持续下降，PPI 虽有改善，但疲软之势较难改变。

资金面——英国脱欧事件对全球市场的冲击目前来看并不显著，却测试出全球主要央行们的“底牌”。本次英国脱欧公投后全球主要央行展现出积极沟通的姿态，并且也及时投放流动性以防市场风险，其背后反映出的是货币政策留给央行们犯错的空间已经不大，必须尽可能把潜在的危机控制在萌芽阶段。英国脱欧事件后的央行反应显示出对于经济复苏和潜在风险的谨慎心态，这意味着市场对货币政策转向或者退出的担忧过于悲观，因此，我们判断，下半年资金面发生转向的可能性越来越小，宽松的格局料将维持。

政策与事件——二季度市场重点关注的几件大事（1）MSCI 指数是否将 A 股指数纳入其中；（2）美联储六月份的议息会议是否会调整现行的利率水平；（3）英国就是否退出欧盟的全民公投。这三件大事也成为了左右近期中国以及全球金融市场表现得主要力量。我们看到，在这几件大事逐一落定之后，全球各国央行均采取了不同种类的应对措施。这些事件短期的影响基本已经消除，但长远影响仍有待观察。

市场预判——存量博弈的精髓在于集中力量在有限的领域集中突破，从而获取结构性超额收益。但过去一段时间，我们发现，这一博弈行为有进入消耗战的趋势。第一，板块轮动明显加速，但却无主线接力。上周一军工、计算机起势，周二医药、传媒表现突出，周三则又切换到一带一路的建筑板块，但均无持续性拉升，同时，之前一直抱团的新能源汽车产业链则出现资金流出迹象，存量资金在多个板块左冲右突后并未带来明显效果，资金的消耗反而使得个别板块趋势性赚钱效应大打折扣。第二，净减持规模扩大进一步吞噬存量资金。2016 年以来，大小非净减持规模逐月增加，2-4 月月均净减持规模仅在 80 亿左右，但 5 月已增加至 145 亿，6 月更是扩大至 280 亿。这些都是我们需要去警惕的不利因素，今年行情的显著特点就是预期高度一致后的转向。

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。曾任职于山东省国际信托投资公司计财部、山东省国际信托投资公司上海证券部、鲁信香港投资有限公司。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，曾任泰信先行策略混合基金经理。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、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；选择红利再投资的，现金红利则按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；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；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、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，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

4、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 12 次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

5、基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；

6、投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均保留到小数点后第 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产；

7、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

二、本基金的基金管理人于 2015 年 12 月 31 日宣告 2015 年度第一次分红，向截至 2016 年 1 月 6 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 1.35 元。利润分配合计 18,369,098.68 元(其中, 现金形式发放 15,029,307.21 元, 再投资形式发放 3,339,791.47 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰信中小盘精选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰信中小盘精选混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	65,390,849.81	80,344,067.90
结算备付金		2,009,767.77	1,995,181.24
存出保证金		264,903.20	545,057.29
交易性金融资产	6.4.7.2	185,870,098.04	283,281,203.01
其中：股票投资		185,870,098.04	283,281,203.01
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	6,684.44	12,081.36
应收股利		-	-

应收申购款		300,598.06	494.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		253,842,901.32	366,178,084.87
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	7,648,373.46
应付赎回款		5,455.80	64,658.03
应付管理人报酬		305,849.85	454,256.95
应付托管费		50,974.97	75,709.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	759,000.67	810,320.76
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	192,460.18	391,706.69
负债合计		1,313,741.47	9,445,025.35
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	137,411,224.55	157,011,660.66
未分配利润	6.4.7.10	115,117,935.30	199,721,398.86
所有者权益合计		252,529,159.85	356,733,059.52
负债和所有者权益总计		253,842,901.32	366,178,084.87

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.838 元，基金份额总额 137,411,224.55 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信中小盘精选混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
一、收入		-42,239,148.55	349,169,062.66
1.利息收入		232,136.18	624,882.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	220,767.89	252,454.03
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		11,368.29	372,428.32
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-19,372,613.85	287,469,639.71
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-19,923,195.30	285,814,808.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	550,581.45	1,654,831.65
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-23,193,128.25	60,675,099.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	94,457.37	399,440.98
减：二、费用		5,296,678.57	12,920,930.20
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,808,893.09	5,679,650.75
2. 托管费	6.4.10.2.2	301,482.17	946,608.48
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,977,052.13	6,076,324.94
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	209,251.18	218,346.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-47,535,827.12	336,248,132.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-47,535,827.12	336,248,132.46

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信中小盘精选混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30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)	157,011,660.66	199,721,398.86	356,733,059.52

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-47,535,827.12	-47,535,827.12
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-19,600,436.11	-18,698,537.76	-38,298,973.87
其中：1.基金申购款	48,682,438.66	37,960,497.80	86,642,936.46
2.基金赎回款	-68,282,874.77	-56,659,035.56	-124,941,910.33
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）	-	-18,369,098.68	-18,369,098.68
五、期末所有者权益（基金净值）	137,411,224.55	115,117,935.30	252,529,159.85
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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）	345,435,141.97	230,327,526.88	575,762,668.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	336,248,132.46	336,248,132.46
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）	-35,247,909.89	-73,906,138.83	-109,154,048.72
其中：1.基金申购款	152,714,659.65	162,381,202.04	315,095,861.69
2.基金赎回款	-187,962,569.54	-236,287,340.87	-424,249,910.41
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）	-	-24,051,493.46	-24,051,493.46
五、期末所有者权益（基金净值）	310,187,232.08	468,618,027.05	778,805,259.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

葛航

基金管理人负责人

韩波

主管会计工作负责人

蔡海成

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰信中小盘精选混合型证券投资基金(原名为泰信中小盘精选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[2011]第 1138 号《关于核准泰信中小盘精选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《泰信中小盘精选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 262,307,424.58 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(2011)第 408 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信中小盘精选股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 10 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 262,332,100.87 份基金份额,其中认购资金利息折合 24,676.29 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

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》,泰信中小盘精选股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为泰信中小盘精选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《泰信中小盘精选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,包括国内依法公开发行上市的各类股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、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。本基金将基金资产的 60%-95%投资于股票,现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,债券、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规和监管机构的规定执行。本基金投资于中小盘股票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: $80\% \times \text{中证 700 指数收益率} + 20\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

6.4.2 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》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》和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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年半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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	65,390,849.81
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	65,390,849.81

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	173,346,007.22	185,870,098.04	12,524,090.82
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	173,346,007.22	185,870,098.04	12,524,090.82

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本报告期末本基金未持有返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有买断式逆回购中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	5,762.64
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	814.52
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	107.28
合计	6,684.44

6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	759,000.67
银行间市场应付交易费用	-
合计	759,000.67

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	17.02

预提费用	192,443.16
合计	192,460.18

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	157,011,660.66	157,011,660.66
本期申购	48,682,438.66	48,682,438.66
本期赎回(以“-”号填列)	-68,282,874.77	-68,282,874.77
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	137,411,224.55	137,411,224.55

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

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
上年度末	180,366,313.38	19,355,085.48	199,721,398.86
本期利润	-24,342,698.87	-23,193,128.25	-47,535,827.12
本期基金份额交易产生的变动数	-21,075,625.23	2,377,087.47	-18,698,537.76
其中：基金申购款	45,759,740.72	-7,799,242.92	37,960,497.80
基金赎回款	-66,835,365.95	10,176,330.39	-56,659,035.56
本期已分配利润	-18,369,098.68	-	-18,369,098.68
本期末	116,578,890.60	-1,460,955.30	115,117,935.30

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
	活期存款利息收入
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	15,788.28
其他	4,215.66
合计	220,767.89

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	1,005,587,091.07
减：卖出股票成本总额	1,025,510,286.37
买卖股票差价收入	-19,923,195.30

6.4.7.13 债券投资收益

本报告期本基金无债券投资收益余额。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本报告期末本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期末本基金未投资贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期末本基金无衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	550,581.45
基金投资产生的股利收益	-
合计	550,581.45

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-23,193,128.25
——股票投资	-23,193,128.25
——债券投资	-
——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	-23,193,128.25

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	94,450.22
转出基金补偿费	7.15
其他	-
合计	94,457.37

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

2. 本基金的转换费用由转出基金的赎回费、转出和转入基金的申购费补差构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	2,977,052.13
银行间市场交易费用	-
合计	2,977,052.13

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	33,316.92
信息披露费	159,126.24
帐户维护费	4,500.00
银行划款手续费	12,108.02
其他	200.00
合计	209,251.18

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本报告期末本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本报告期无需要说明资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金销售机构、注册登记机构
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间本基金无应支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,808,893.09	5,679,650.75
其中：支付销售机构的客户维护费	51,013.50	116,599.55

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 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}$ 。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	301,482.17	946,608.48

注：支付基金托管人中国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： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$ 。

6.4.10.2.3 销售服务费

本报告期及上年度可比期间本基金未发生销售服务费用。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

6.4.10.4.2 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 2016年6月30日	上年度末 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	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	27,512,090.56	20.0200%	33,512,090.56	21.3400%

6.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年6月 30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	65,390,849.81	200,763.95	37,011,273.00	181,725.59

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期末及上年度可比期间本基金未参与在承销期内关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	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	本期利润分 配 合计	备注
1	2016年1月 6日	2016年1月 6日	1.350	15,029,307.21	3,339,791.47	18,369,098.68	
合计	-	-	1.350	15,029,307.21	3,339,791.47	18,369,098.68	

注：本基金的基金管理人于2015年12月31日宣告2015年度第一次分红，向截至2016年1月6日止在本基金注册登记人泰信基金管理有限公司 登记在册的本基金全体持有人，按每10份基金份额派发红利1.350元。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

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。

6.4.12.2 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
300142	沃森生物	2016 年 3 月 22 日	重大事项 未公告	8.14	-	-	1,548,100	16,288,338.77	12,601,534.00	-
300503	昊志机电	2016 年 6 月 30 日	临时 停牌	84.72	2016 年 7 月 5 日	82.99	100,000	5,064,524.58	8,472,000.00	-
000547	航天发展	2016 年 4 月 19 日	重大事项 未公告	16.30	-	-	479,924	7,132,052.26	7,822,761.20	-
000633	*ST 合金	2016 年 2 月 18 日	重大事项 未公告	11.81	2016 年 8 月 18 日	10.84	650,300	10,140,804.58	7,680,043.00	-
300166	东方国信	2016 年 6 月 8 日	重大事项 未公告	27.47	-	-	249,975	6,053,423.00	6,866,813.25	-
002631	德尔未来	2016 年 6 月 29 日	重大事项 未公告	26.60	-	-	250,000	5,009,437.20	6,650,000.00	-
000728	国元 证券	2016 年 6 月 8 日	重大事项 未公告	16.72	2016 年 7 月 8 日	17.37	350,000	5,534,546.42	5,852,000.00	-
600576	万家文化	2016 年 4 月 12 日	重大事项 未公告	21.77	-	-	150,000	3,262,680.00	3,265,500.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立了以审计、合规与风险控制委员会、督察长为核心，对公司所有经营管理行为进行监督的四道监控防线。

监察稽核部对公司经营、基金投资等业务运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，如有必要则由督察长向公司董事长和中国证监会报告。目前，公司的事前、事中、事后三个控制层次的风险管理体系相对清晰。各业务部门负责事前风险防范；风险管理部负责对公司运营过程中产生或潜在的风险进行事中管理和监控，并负责运用定量分析模型，根据各基金的投资目标及投资策略，定期对基金的投资组合风险进行评估，向投资决策委员会提交业绩评估报告；监察稽核部负责对公司各项业务进行定期、不定期检查，负责事后监督。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有的信用类债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款和结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	65,390,849.81	-	-	-	65,390,849.81
结算备付金	2,009,767.77	-	-	-	2,009,767.77
存出保证金	264,903.20	-	-	-	264,903.20
交易性金融资产	-	-	-	185,870,098.04	185,870,098.04
应收利息	-	-	-	6,684.44	6,684.44
应收申购款	-	-	-	300,598.06	300,598.06
资产总计	67,665,520.78	-	-	186,177,380.54	253,842,901.32
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,455.80	5,455.80
应付管理人报酬	-	-	-	305,849.85	305,849.85
应付托管费	-	-	-	50,974.97	50,974.97
应付交易费用	-	-	-	759,000.67	759,000.67
其他负债	-	-	-	192,460.18	192,460.18
负债总计	-	-	-	1,313,741.47	1,313,741.47
利率敏感度缺口	67,665,520.78	-	-	184,863,639.07	252,529,159.85
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	80,344,067.90	-	-	-	80,344,067.90
结算备付金	1,995,181.24	-	-	-	1,995,181.24
存出保证金	545,057.29	-	-	-	545,057.29

交易性金融资产	-	-	-	283,281,203.01	283,281,203.01
应收利息	-	-	-	12,081.36	12,081.36
应收申购款	-	-	-	494.07	494.07
资产总计	82,884,306.43	-	-	283,293,778.44	366,178,084.87
负债					
应付证券清算款	-	-	-	7,648,373.46	7,648,373.46
应付赎回款	-	-	-	64,658.03	64,658.03
应付管理人报酬	-	-	-	454,256.95	454,256.95
应付托管费	-	-	-	75,709.46	75,709.46
应付交易费用	-	-	-	810,320.76	810,320.76
其他负债	-	-	-	391,706.69	391,706.69
负债总计	-	-	-	9,445,025.35	9,445,025.35
利率敏感度缺口	82,884,306.43	-	-	273,848,753.09	356,733,059.52

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券（2015 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2015 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中采取“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 60%-95%，债券、现金类资产及权证、资产支持证券占基金资产的 5%-40%。本基金的基金管理人

每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	185,870,098.04	73.60	283,281,203.01	79.41
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	185,870,098.04	73.60	283,281,203.01	79.41

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保证不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	21,430,331.83	17,280,000.00
业绩比较基准下降 5%	-21,430,331.83	-17,280,000.00	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无其他需要说明有助于理解和分析会计报表事项。

§7 投资组合报告

7.1 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	185,870,098.04	73.22
	其中：股票	185,870,098.04	73.22
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	67,400,617.58	26.55
7	其他各项资产	572,185.70	0.23
8	合计	253,842,901.32	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	131,643,464.79	52.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,920.00	0.01
F	批发和零售业	3,265,500.00	1.29
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	12,674,313.25	5.02
J	金融业	33,262,000.00	13.17
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,003,900.00	1.98

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	185,870,098.04	73.60

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

报告期末本基金未投资沪港通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600990	四创电子	169,987	14,736,173.03	5.84
2	300142	沃森生物	1,548,100	12,601,534.00	4.99
3	300398	飞凯材料	160,000	11,968,000.00	4.74
4	300503	昊志机电	100,000	8,472,000.00	3.35
5	600184	光电股份	349,973	7,923,388.72	3.14
6	000547	航天发展	479,924	7,822,761.20	3.10
7	002590	万安科技	250,000	7,782,500.00	3.08
8	002673	西部证券	300,000	7,758,000.00	3.07
9	000633	*ST 合金	650,300	7,680,043.00	3.04
10	002025	航天电器	300,000	7,407,000.00	2.93
11	601198	东兴证券	300,000	7,332,000.00	2.90
12	000783	长江证券	600,000	6,960,000.00	2.76
13	300166	东方国信	249,975	6,866,813.25	2.72
14	002631	德尔未来	250,000	6,650,000.00	2.63
15	000728	国元证券	350,000	5,852,000.00	2.32
16	300209	天泽信息	230,000	5,807,500.00	2.30
17	000063	中兴通讯	397,426	5,699,088.84	2.26
18	601555	东吴证券	400,000	5,360,000.00	2.12
19	002121	科陆电子	450,000	5,287,500.00	2.09
20	600495	晋西车轴	700,000	5,131,000.00	2.03
21	603377	东方时尚	110,000	5,003,900.00	1.98
22	002529	海源机械	204,100	4,182,009.00	1.66
23	300456	耐威科技	60,000	4,065,000.00	1.61
24	002182	云海金属	200,000	3,980,000.00	1.58
25	300114	中航电测	129,915	3,871,467.00	1.53

26	600576	万家文化	150,000	3,265,500.00	1.29
27	300198	纳川股份	200,000	3,218,000.00	1.27
28	603609	禾丰牧业	200,000	3,166,000.00	1.25
29	601611	中国核建	1,000	20,920.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	002673	西部证券	28,684,018.54	8.04
2	601198	东兴证券	28,540,158.00	8.00
3	000728	国元证券	22,580,413.91	6.33
4	601318	中国平安	19,241,641.00	5.39
5	300287	飞利信	15,510,859.82	4.35
6	300209	天泽信息	15,145,304.11	4.25
7	601555	东吴证券	14,138,266.00	3.96
8	300168	万达信息	13,791,677.36	3.87
9	002467	二六三	13,267,180.54	3.72
10	300252	金信诺	12,742,829.70	3.57
11	300352	北信源	12,373,722.50	3.47
12	600958	东方证券	12,058,255.00	3.38
13	002340	格林美	12,049,463.72	3.38
14	002655	共达电声	11,537,921.42	3.23
15	002383	合众思壮	11,220,718.86	3.15
16	002353	杰瑞股份	10,314,755.00	2.89
17	000697	炼石有色	10,142,494.21	2.84
18	601009	南京银行	9,858,511.00	2.76
19	300398	飞凯材料	9,844,746.06	2.76
20	600987	航民股份	9,627,702.61	2.70
21	000848	承德露露	9,141,904.61	2.56
22	300377	赢时胜	8,393,206.00	2.35
23	002142	宁波银行	8,283,472.96	2.32
24	601169	北京银行	8,279,657.01	2.32
25	600184	光电股份	8,055,914.10	2.26

26	000652	泰达股份	7,434,596.55	2.08
27	002253	川大智胜	7,423,123.00	2.08
28	601989	中国重工	7,393,635.20	2.07
29	002590	万安科技	7,379,668.00	2.07
30	002092	中泰化学	7,288,808.55	2.04
31	600546	*ST 山煤	7,283,295.58	2.04
32	300456	耐威科技	7,208,822.00	2.02
33	601699	潞安环能	7,181,561.78	2.01
34	600597	光明乳业	7,144,659.20	2.00
35	000547	航天发展	7,132,052.26	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。

7.4.2 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	002673	西部证券	22,502,761.83	6.31
2	601198	东兴证券	22,400,455.49	6.28
3	601318	中国平安	18,688,360.00	5.24
4	000728	国元证券	16,887,517.05	4.73
5	300287	飞利信	16,545,875.24	4.64
6	002208	合肥城建	16,279,093.18	4.56
7	300168	万达信息	15,622,952.35	4.38
8	300252	金信诺	14,458,147.06	4.05
9	300352	北信源	14,421,273.23	4.04
10	002467	二六三	13,972,273.91	3.92
11	002228	合兴包装	13,222,068.21	3.71
12	300209	天泽信息	11,925,686.36	3.34
13	600958	东方证券	11,777,592.53	3.30
14	002340	格林美	11,634,113.03	3.26
15	000697	炼石有色	11,595,621.92	3.25
16	600775	南京熊猫	11,491,197.60	3.22
17	300085	银之杰	11,319,965.95	3.17
18	002686	亿利达	11,217,655.76	3.14
19	002655	共达电声	11,063,630.62	3.10
20	002383	合众思壮	10,881,087.91	3.05

21	002565	上海绿新	10,299,808.00	2.89
22	002353	杰瑞股份	9,845,992.00	2.76
23	601555	东吴证券	9,758,553.00	2.74
24	600987	航民股份	9,555,786.40	2.68
25	601009	南京银行	9,189,303.86	2.58
26	300377	赢时胜	9,041,833.85	2.53
27	000848	承德露露	9,012,299.65	2.53
28	300142	沃森生物	8,791,057.32	2.46
29	600590	泰豪科技	8,561,968.34	2.40
30	002626	金达威	8,418,007.20	2.36
31	600682	南京新百	8,311,162.60	2.33
32	002657	中科金财	7,943,163.50	2.23
33	002253	川大智胜	7,841,120.75	2.20
34	002092	中泰化学	7,781,234.28	2.18
35	601169	北京银行	7,538,759.91	2.11
36	601989	中国重工	7,404,232.18	2.08
37	002142	宁波银行	7,359,245.32	2.06
38	600685	中船防务	7,254,720.96	2.03
39	002390	信邦制药	7,217,673.00	2.02
40	002537	海立美达	7,184,829.60	2.01
41	600546	*ST 山煤	7,138,198.00	2.00

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。

7.4.3 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	951,288,839.65
卖出股票收入（成交）总额	1,005,587,091.07

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

7.6 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

报告期末本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 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。

7.9 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

报告期末本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

7.12.2

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。

7.12.3 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	264,903.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,684.44
5	应收申购款	300,598.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	572,185.70

7.12.4 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的处于转股期的可转换债券。

7.12.5 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	300142	沃森生物	12,601,534.00	4.99	重大事项未公告
2	300503	昊志机电	8,472,000.00	3.35	临时停牌
3	000547	航天发展	7,822,761.20	3.10	重大事项未公告
4	000633	*ST 合金	7,680,043.00	3.04	重大事项未公告

7.12.6 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 基金份额持有人信息

8.1 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
604	227,502.03	129,200,356.36	94.02%	8,210,868.19	5.98%

8.2 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	21,009.72	0.0153%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

注：基金份额总量的数量区间为 0、0 至 10 万份（含）、10 万份至 50 万份（含）、50 万份至 100 万份（含）、100 万份以上。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 10 月 26 日）基金份额总额	262,332,100.87
本报告期期初基金份额总额	157,011,660.66
本报告期基金总申购份额	48,682,438.66
减：本报告期基金总赎回份额	68,282,874.77
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	137,411,224.55

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示**10.1 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。

10.2 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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘会计师事务所，仍为普华永道中天会计师事务所有限公司。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
中信建投	2	656,543,925.17	33.55%	601,648.88	33.46%	-
华泰证券	1	513,231,729.06	26.23%	467,709.18	26.01%	-
万联证券	1	257,673,158.63	13.17%	239,969.92	13.35%	-
广州证券	1	195,110,674.64	9.97%	181,706.88	10.11%	-
中国建银投资证券	2	141,624,925.99	7.24%	129,062.92	7.18%	-
西南证券	1	78,647,104.76	4.02%	73,243.90	4.07%	-
国泰君安	1	49,879,267.22	2.55%	45,454.84	2.53%	-
东吴证券	2	34,346,242.50	1.76%	31,299.70	1.74%	-
安信证券	3	29,818,902.75	1.52%	27,769.44	1.54%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-

中银国际	2	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-
华泰联合证 券	1	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-

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、本报告期本基金无新增交易单元；退租交易单元：国金证券 上海 28266。

10.7.2 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

中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	50,000,000.00	25.00%	-	-
中国建银投资证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	150,000,000.00	75.00%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	停牌股票估值调整（朗姿股份）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016年1月8日
2	新增兴业证券为销售机构并开通定投转换及费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016年1月12日
3	新增北京增财销售为销售机构并开通定投转换费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016年1月20日
4	2015年4季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016年1月22日
5	停牌股票估值调整（沃森生物）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016年2月26日
6	在财富证券开通转换业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016年3月1日
7	广州证券开定投转换费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016年3月1日
8	在东海证券开通转换业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016年3月10日
9	提醒投资者更新身份信息公告	《中国证券报》、《上	2016年3月24日

		海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	
10	工商银行申购费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 3 月 28 日
11	2015 年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 3 月 30 日
12	新增北京钱景财富管理有限公司为销售机构并开通定投转换费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 4 月 12 日
13	参加陆金所费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 4 月 15 日
14	2016 年 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 4 月 21 日
15	中信建投费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 5 月 4 日
16	停牌股票估值调整（航天发展）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 5 月 12 日
17	停牌股票估值调整（万家文化）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 5 月 19 日

18	新增鑫鼎盛为销售机构并开通定投转换业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 5 月 24 日
19	新增深圳新兰德为销售机构并开通定投转换费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 6 月 7 日
20	陆金所开通定投及费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 6 月 8 日
21	新增泰诚财富为销售机构并开通定投转换费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 6 月 17 日
22	在陆金所开通申购定投费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 6 月 24 日
23	在交通银行开通网上银行、手机银行申购费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 6 月 27 日

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰信中小盘精选股票型证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信中小盘精选混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信中小盘精选混合型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

11.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人住所（或办公场所）、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。在支付必要的工本费后，投资者可在有效的工作时间内取得本报告及上述备查文件的复制件或复印件。

11.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站(www.ftfund.com)查阅上述相关文件，或拨打客户服务中心电话(400-888-5988, 021-38784566)，和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司
2016年8月29日