

# 泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券 投资基金 2016 年年度报告

2016 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：2017 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 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 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
<b>§5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
<b>§6 审计报告</b>	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
<b>§7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21
<b>§8 投资组合报告</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金资产组合情况	45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	60

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 .....	60
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 .....	60
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
8.12 投资组合报告附注 .....	61
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>62</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	62
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
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 .....	63
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>63</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>64</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	64
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 .....	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
11.4 基金投资策略的改变 .....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
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 .....	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
11.8 其他重大事件 .....	66
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>73</b>
12.1 备查文件目录 .....	73
12.2 存放地点 .....	74
12.3 查阅方式 .....	74

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金		
基金简称	泰信基本面 400 指数分级		
场内简称	泰信 400		
基金主代码	162907		
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)		
基金合同生效日	2012 年 9 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	57,552,567.05 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012 年 9 月 21 日		
下属分级基金的基金简称	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
下属分级基金的场内简称	泰信 400 A	泰信 400B	泰信 400
下属分级基金的交易代码	150094	150095	162907
报告期末下属分级基金份额总额	6,543,401.00 份	6,543,401.00 份	44,465,765.05 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,追求对中证锐联基本面 400 指数的有效跟踪。		
投资策略	本基金主要采用完全复制法,按照在中证锐联基本面 400 指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合和跟踪中证锐联基本面 400 指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。		
业绩比较基准	95%×中证锐联基本面 400 指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。	高风险、高预期收益。	较高风险、较高预期收益。

### 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	郭明
	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
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		王小林	易会满

## 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)自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 37 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-8,177,490.64	21,847,794.34	4,093,879.06
本期利润	-9,422,454.73	12,485,754.21	10,577,015.00
加权平均基金份额本期利润	-0.1490	0.2407	0.3708
本期加权平均净值利润率	-20.03%	22.03%	31.80%
本期基金份额净值增长率	-16.23%	24.93%	34.87%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	16,978,083.26	26,069,620.55	7,585,651.90
期末可供分配基金份额利润	0.2950	0.4262	0.3071

期末基金资产净值	43,949,667.13	57,171,748.61	37,542,830.91
期末基金份额净值	0.764	0.935	1.520
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2016 年末</b>	<b>2015 年末</b>	<b>2014 年末</b>
基金份额累计净值增长率	69.10%	89.90%	52.00%

注：1、本基金合同于 2012 年 9 月 7 日正式生效。

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

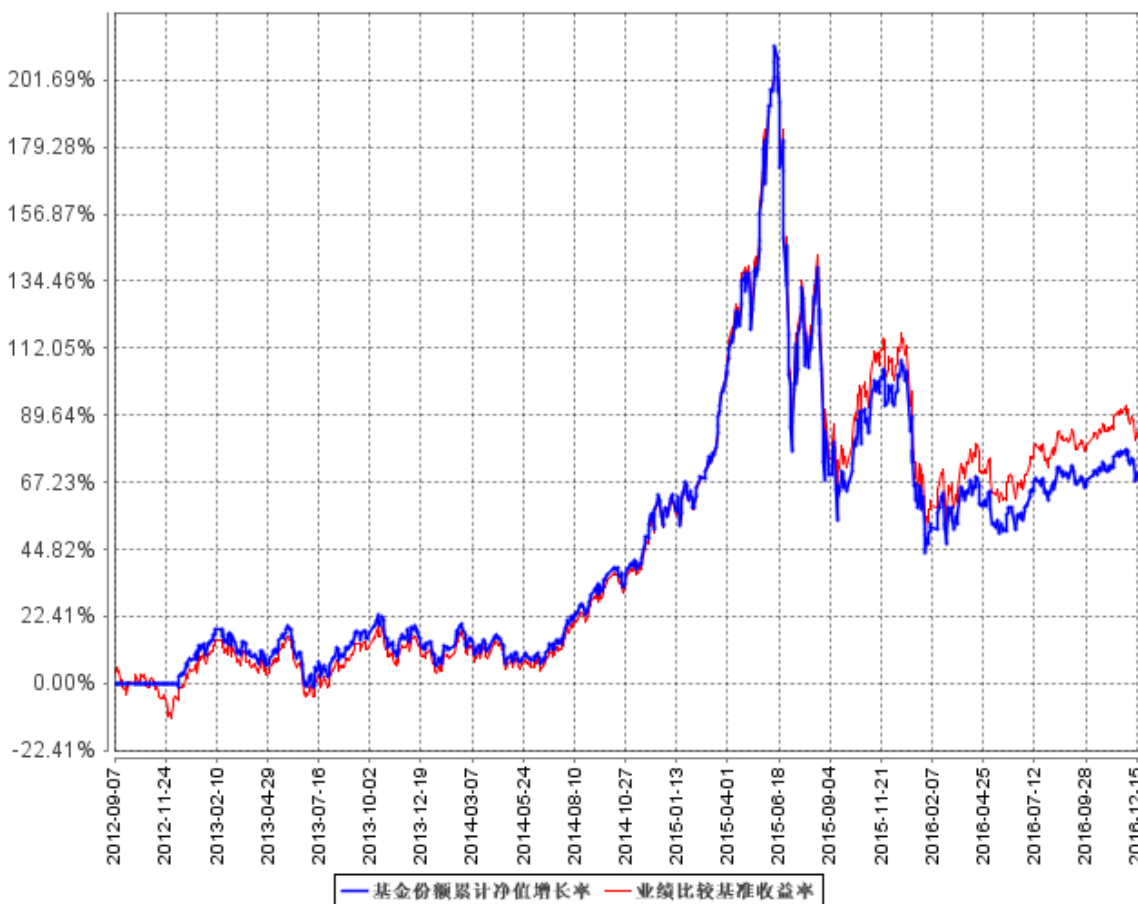
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.79%	0.79%	1.67%	0.79%	-0.88%	0.00%
过去六个月	5.96%	0.86%	7.44%	0.87%	-1.48%	-0.01%
过去一年	-16.23%	1.73%	-13.21%	1.73%	-3.02%	0.00%
过去三年	48.52%	2.02%	64.82%	2.01%	-16.30%	0.01%
自基金合同生效起至今	69.10%	1.81%	82.77%	1.84%	-13.67%	-0.03%

注：本基金业绩比较基准为： $95\% \times$  中证锐联基本面 400 指数收益率  $+ 5\% \times$  商业银行人民币活期存款利率（税后）

中证锐联基本面 400 指数以沪深 A 股为样本空间，挑选基本面价值排列第 201 至第 600 家的上市公司作为样本，基本面价值由四个财务指标来衡量：营业收入、现金流、净资产和分红；样本股的权重配置由基本面价值决定，在一定程度上打破了样本市值与其权重之间的关联，避免了传统市值指数中过多配置高估股票的现象。

### 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



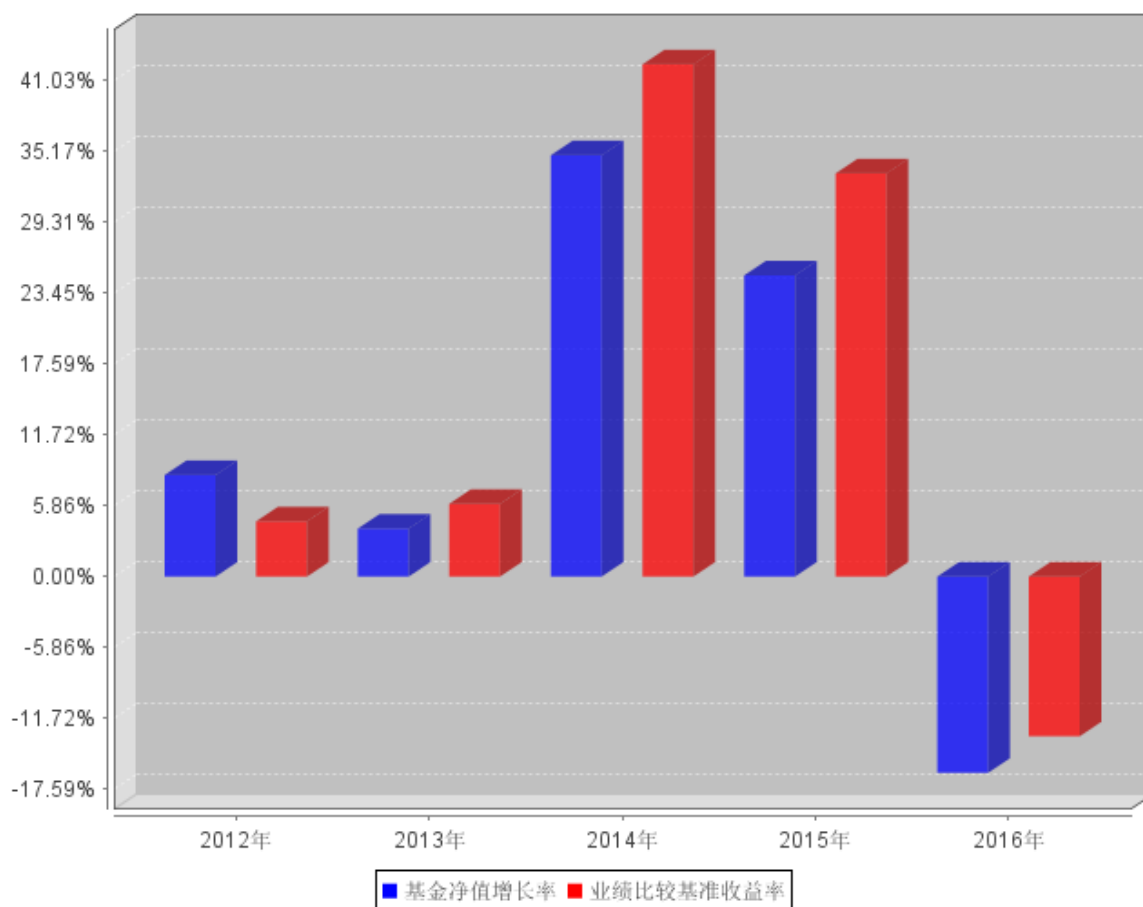
注：1、本基金基金合同于 2012 年 9 月 7 日正式生效。

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。本基金投资于中证锐联基本面 400 指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%；现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。



### 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：本基金基金合同于 2012 年 9 月 7 日正式生效，2012 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

在基金存续期内，本基金（包括泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额）不进行收益分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 号华夏银行大厦 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：徐磊

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 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 2016 年 12 月 31 日，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、泰信智选成长共 19 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、泰信价值 1 号、泰信添盈债券分级 1 号、泰信添盈债券分级 2 号、泰信中行新时代 6 号、泰信财达添利 1 号、泰信财达添利 2 号、泰信-合信一号、泰信合信三号、泰信融昇保本 1 号、泰信融昇保本 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、泰信洛肯 1 号、泰信洛肯 2 号、泰信易享一号、泰信融鑫 2 号、泰信中融景诚旭诚固收 1 号、泰信融昇 5 号、泰信财达添利 3 号共 25 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	说明
----	----	-----------------	----	----

		任职日期	离任日期	从业年限	
张彦先生	本基金经理兼泰信中证 200 指数基金经理	2015 年 1 月 6 日	-	10 年	研究生硕士。具有基金从业资格。曾任职于国金证券研究所、上海从容投资管理有限公司、万家基金管理有限公司。2011 年 6 月加入泰信基金管理有限公司,担任高级研究员。自 2011 年 10 月至 2014 年 5 月任泰信中小盘精选基金经理助理。2012 年 4 月至 2015 年 1 月任泰信优势增长混合基金经理助理。自 2015 年 1 月 6 日起同时兼任泰信中证 200 指数基金经理。

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》、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级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，应尽可能使他们

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

A 股市场在 2016 年年初经历了熔断大跌后, 走势整体震荡向上, 板块轮动频繁, 受供给侧改革、大宗商品价格上涨的推动, 周期股下半年显著跑赢市场, 而创业板受流动性边际收紧的影响, 则出现了破位下跌。市场风格倾向于大盘蓝筹股和周期股。上证综指全年下跌 12.31%, 创业板下跌 27.71%。

报告期内, 本基金作为被动操作的指数基金, 严格执行基金合同规定的投资策略, 按照规定的投资策略和方法进行投资操作, 努力拟合标的指数, 减小跟踪误差, 报告期内跟踪误差控制在 1.76。报告期跟踪误差主要是由于基金申购赎回和标的指数成分股定期调整等因素所造成。

### 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 0.764 元, 净值增长率为-16.23%, 业绩比较基准增长率为-13.21%。

## 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 2017 年, 机遇与风险同在, 我们预计全年呈现宽幅震荡的态势。

2017 年宏观经济经过多年的调整, 经济呈现复苏的势头。2016 年随着供给侧改革的深入, 在库存周期和上游商品价格的推动下, 宏观经济普遍出现好转, 进入 2017 年制造业经过多年的调整也开始逐步复苏。从中长期来看, 国内经济继续处于长周期的底部, 经济仍有下行压力, 但供给侧改革的深入推进有助于压缩下跌空间。在 PPP 落地比例上升、外汇管制趋严和海外投资受限的背景下, 民间投资增速有望回升。

虽然经济增速降低、货币政策更加保守, 但 2017 年通胀水平降会有所上升。去产能推动我国产出缺口进一步收窄, 从根本上提升了我国通胀压力。而原油价格将继续冲击通胀走势。而需求相对稳定有助于提升 PPI 对 CPI 的传导效率。因此, 2017 年 CPI 将成为影响市场主要变量之一。

金融危机后货币政策被过度使用的弊端正在显现。从国内看, 有效需求难见起色而资产价格泡沫持续膨胀; 从全球看, 美元已经进入加息周期, 全球货币政策开始转向, 各国政府在 2017 年更加依赖财政政策托底经济。而国内市场化利率上行, 央行有意抬升整体利率中枢, 切断加杠杆温床。货币政策稳健中性的取向得到确认。在通胀和汇率两个棘手难题面前, 市场利率上的扰动将引导加息预期不断强化。预计 2017 年流动性趋紧。

因此, 在经济弱复苏而流动性趋紧的背景下, 我们预计 2017 年全年将呈现宽幅震荡的态势, 结构性机会较为显著, 上半年预计周期股和蓝筹股机会较为显著, 若市场继续调整, 优质的成长

股也将在下半年有所展现。

作为指数分级型基金产品，我们将坚持指数化投资策略，严格控制基金相对目标指数（基本面 400 指数）的偏离度，跟踪市场趋势，使得投资者可以清晰地把握分级子基金的交易情况，把握住投资时机。本基金将继续规范运作，审慎投资，勤勉尽责地维护基金份额持有人利益。

#### 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

在基金存续期内，本基金（包括泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额）不进行收益分配。

#### 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资产净值低于五千万元的情况。

## § 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中证锐联基本面 400 指数分级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，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金的管理人——泰信基金管理有限公司在泰信中证锐联基本面 400 指数分级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。

### 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中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金 2016 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(2017)第 21003 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	泰信中证锐联基本面 400 指数分级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中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金(以下简称“泰信基本面 400 基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 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基本面 400 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, 上述泰信基本面 400 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, 公允反映了泰信基本面 400 基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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 傅琛慧
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	上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金

报告截止日: 2016 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	2, 791, 914. 43	3, 687, 002. 80

结算备付金		77,523.19	29,691.27
存出保证金		5,239.16	35,202.44
交易性金融资产	7.4.7.2	41,414,118.99	53,977,232.55
其中：股票投资		41,414,118.99	53,977,232.55
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	559.34	651.99
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		44,289,355.11	57,729,781.05
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	110.49
应付赎回款		1,222.79	128,097.47
应付管理人报酬		38,790.64	46,653.96
应付托管费		8,533.92	10,263.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	15,084.36	34,021.10
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	276,056.27	338,885.54
负债合计		339,687.98	558,032.44
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	26,069,783.67	28,455,925.47
未分配利润	7.4.7.10	17,879,883.46	28,715,823.14
所有者权益合计		43,949,667.13	57,171,748.61
负债和所有者权益总计		44,289,355.11	57,729,781.05

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之基础份额净值为 0.764 元，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 A 份额参考净值为 1.050 元，

泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 B 份额参考净值为 0.478 元；基金份额总额为 57,552,567.05 份，其中泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之基础份额为 44,465,765.05 份，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 A 份额为 6,543,401.00 份，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 B 份额为 6,543,401.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-8,289,654.83	14,035,255.74
1.利息收入		27,801.24	38,902.91
其中：存款利息收入	7.4.7.11	27,801.24	38,902.91
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-7,145,287.73	23,147,894.62
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-7,598,378.04	22,711,470.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
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	453,090.31	436,424.37
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,244,964.09	-9,362,040.13
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	72,795.75	210,498.34
<b>减：二、费用</b>		1,132,799.90	1,549,501.53
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	469,412.16	558,782.27
2.托管费	7.4.10.2.2	103,270.70	122,932.06
3.销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4.交易费用	7.4.7.19	174,717.80	414,715.89
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.20	385,399.24	453,071.31

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,422,454.73	12,485,754.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,422,454.73	12,485,754.21

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	28,455,925.47	28,715,823.14	57,171,748.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,422,454.73	-9,422,454.73
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）	-2,386,141.80	-1,413,484.95	-3,799,626.75
其中：1. 基金申购款	39,765,284.74	25,211,978.26	64,977,263.00
2. 基金赎回款	-42,151,426.54	-26,625,463.21	-68,776,889.75
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）	26,069,783.67	17,879,883.46	43,949,667.13
项目	上年度可比期间 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）	23,744,441.79	13,798,389.12	37,542,830.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,485,754.21	12,485,754.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	4,711,483.68	2,431,679.81	7,143,163.49

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	87,381,722.37	99,510,217.56	186,891,939.93
2. 基金赎回款	-82,670,238.69	-97,078,537.75	-179,748,776.44
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）	28,455,925.47	28,715,823.14	57,171,748.61

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

泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金(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 252 号《关于核准泰信中证锐联基本面 400 指数分级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《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约开放型，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 300,797,873.45 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 346 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 9 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 300,843,720.90 份，其中认购资金利息折合 45,847.45 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。

本基金的基金份额包括泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“泰信基本面 400 份额”)、泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“泰信基本面 400A 份额”)与泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“泰信基本面 400B 份额”)。其中，泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比率不变。

根据《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》的规定，每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)的第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对泰信基本面

400A 份额和泰信基本面 400 份额进行应得收益的定期份额折算。泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行参考净值计算，对泰信基本面 400A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份泰信基本面 400 份额将按 1 份泰信基本面 400A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于泰信基本面 400A 份额期末的约定应得收益，即泰信基本面 400A 份额每个会计年度 12 月 31 日份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内泰信基本面 400 份额分配给泰信基本面 400A 份额持有人。泰信基本面 400 份额持有人持有的每 2 份泰信基本面 400 份额将按 1 份泰信基本面 400A 份额获得新增泰信基本面 400 份额的分配。持有场外泰信基本面 400 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外泰信基本面 400 份额的分配；持有场内泰信基本面 400 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内泰信基本面 400 份额的分配。经过上述份额折算，泰信基本面 400A 份额的基金份额参考净值和泰信基本面 400 份额的基金份额净值将相应调整。

除以上定期份额折算外，本基金根据基金合同规定，还将在以下两种情况进行份额折算，即：当泰信基本面 400 份额的基金份额净值达到 2.000 元；当泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元。当泰信基本面 400 份额的基金份额净值达到 2.000 元后，本基金将分别对泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额和泰信基本面 400 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的比例为 1:1，份额折算后泰信基本面 400 份额的基金份额净值、泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值均调整为 1 元。当泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元后，本基金将分别对泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额和泰信基本面 400 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的比例为 1:1，份额折算后泰信基本面 400 份额的基金份额净值、泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

泰信基本面 400 份额设置单独的基金代码，但不上市交易。泰信基本面 400A 份额与泰信基本面 400B 份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。投资者可在场内申购和赎回泰信基本面 400 份额，投资者可选择将其场内申购的泰信基本面 400 份额按 1:1 的比例分拆成泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额，投资者可按 1:1 的配比将其持有的泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额申请合并为泰信基本面 400 份额后赎回。投资者可在场外申购和赎回泰信基本面 400 份额。场外申购的泰信基本面 400 份额不进行分拆。投资者可将其持有的场外泰信基本面 400 份额跨系统转登记至场内并申请将其分拆成泰信基本面 400A

份额和泰信基本面 400B 份额后上市交易。投资者可按 1:1 的配比将其持有的泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额合并为泰信基本面 400 份额后赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括股票(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。其中，中证锐联基本面 400 指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。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。本基金的标的指数是中证锐联基本面 400 指数。本基金的业绩比较基准是  $95\% \times \text{中证锐联基本面 400 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率(税后)}$ 。

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 2017 年 3 月 24 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、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(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》、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级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 2016 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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资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。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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购、赎回以及配对转换引起的实收基金变动分别于基金申购确认日、基金赎回确认日及基金配对转换确认日认列。

#### **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。

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**

在存续期内，本基金(包括泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额)将不进行收益分配。

#### **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的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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。

## 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

### 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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

## 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	2,791,914.43	3,687,002.80
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	2,791,914.43	3,687,002.80

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	42,982,716.87	41,414,118.99	-1,568,597.88
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	42,982,716.87	41,414,118.99	-1,568,597.88
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	54,300,866.34	53,977,232.55	-323,633.79
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	54,300,866.34	53,977,232.55	-323,633.79

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末及上年度末本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 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

本报告期末及上年度末本基金未持有返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末本基金未持有买断式逆回购中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	522.04	622.69
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	34.90	13.40
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	2.40	15.90
合计	559.34	651.99

### 7.4.7.6 其他资产

本报告期末及上年度末本基金无其他资产余额。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	15,084.36	34,021.10
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	15,084.36	34,021.10

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3.19	482.76
预提费用	264,500.00	324,500.00
应付指数使用费	11,553.08	13,902.78
合计	276,056.27	338,885.54

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	61,160,847.53	28,455,925.47
本期申购	3,204.71	1,491.39
本期赎回（以“-”号填列）	-34,634.19	-16,117.88
2017 年 1 月 4 日 基金拆分/份额折算前	61,129,418.05	28,441,298.98
基金拆分/份额折算变动份额	1,658,988.87	-
本期申购	87,785,197.03	39,763,793.35
本期赎回（以“-”号填列）	-93,021,036.90	-42,135,308.66
本期末	57,552,567.05	26,069,783.67

注：1. 截至 2016 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 13,086,802.00 份（其中泰信基本面 400A 份额 6,543,401.00 份，泰信基本面 400B 份额 6,543,401.00 份），托管在场内未上市交易的基金份额为 424,752.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 44,041,013.05 份，均为泰信基本面 400 份额。场内的泰信基本面份额登记在证券登记结算系统，场外的泰信基本面份额登记在注册登记系统，可按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

2. 根据《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金合同》的相关规定和《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告》，本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司确定 2016 年 1 月 4 日为份额折算基准日，对泰信基本面 400 份额的场内、场外份额和泰信基本面 400A 份额实施定期份额折算。折算前，泰信基本面 400 场外和场内份额分别为 46,384,031.05 份和 261,375.00 份，根据基金份额折算公式，新增份额折算比例为 0.021642388，折算后泰信基本面 400 场外份额总额和场内份额总额分别为 47,642,845.92 份和 661,549.00 份，泰信基本面 400 份额净值为 0.839 元；折算前，泰信基本面 400A 份额总额为 7,242,006.00 份，

根据基金份额折算公式，新增份额折算比例为 0.054277943，折算后泰信基本面 400A 份额总额为 7,242,006.00 份，份额净值为 1.001 元，经份额折算后产生新增的泰信基本面 400 场内份额。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述折算比例，对全体基金份额持有人持有的泰信基本面 400 份额和泰信基本面 400A 份额进行了折算，并于 2016 年 1 月 5 日进行了变更登记。

#### 7.4.7.10 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	26,069,620.55	2,646,202.59	28,715,823.14
本期利润	-8,177,490.64	-1,244,964.09	-9,422,454.73
本期基金份额交易产生的变动数	-914,046.65	-499,438.30	-1,413,484.95
其中：基金申购款	32,018,883.79	-6,806,905.53	25,211,978.26
基金赎回款	-32,932,930.44	6,307,467.23	-26,625,463.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,978,083.26	901,800.20	17,879,883.46

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	26,377.16	36,722.76
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	892.29	1,653.50
其他	531.79	526.65
合计	27,801.24	38,902.91

#### 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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	59,089,298.98	136,112,618.90
减：卖出股票成本总额	66,687,677.02	113,401,148.65

买卖股票差价收入	-7,598,378.04	22,711,470.25
----------	---------------	---------------

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本期及上年度可比期间本基金无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本报告期末及上年度可比期间本基金无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未投资贵金属。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本报告期末及上年度可比期间本基金无衍生工具投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	453,090.31	436,424.37
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	453,090.31	436,424.37

#### 7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,244,964.09	-9,362,040.13
——股票投资	-1,244,964.09	-9,362,040.13
——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	-1,244,964.09	-9,362,040.13



**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	72,795.75	210,498.34
其他	-	-
合计	72,795.75	210,498.34

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，本基金收取的赎回费中不低于 25% 的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	174,717.80	414,715.89
银行间市场交易费用	-	-
合计	174,717.80	414,715.89

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	200,000.00	260,000.00
债券帐户维护费—— 中债登	18,000.00	18,000.00
指数使用费	46,941.24	54,550.31
上市年费	60,000.00	60,000.00
银行划款手续费	458.00	521.00
其他	-	-
合计	385,399.24	453,071.31

注：根据泰信基金管理有限公司 2016 年 8 月 5 日公布的《关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金调整指数许可使用费并修改基金合同的公告》，经与本基金的托管人中国工商银行股份有限公司以及中证指数有限公司协商一致后，并报中国证监会备案，泰信基金管理有限公司决定调整本基金的指数许可使用费和每季度指数许可使用费的收取下限，并相应对《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》内容进行修订。修订后的相关合同条款规定：如

果本基金前一年度日均资产规模净值超过或等于 40 亿元，则本年度的指数许可使用基点费按照万分九的年费率计提；如果不足 40 亿元，则本年度的指数许可使用费按照万分之十的年费率计提。基金管理人与指数许可方约定了每季指数许可使用费人民币 5 万元的收取下限，则该下限超出当季累计指数使用费的部分（即：每季指数许可使用费收取下限减当季累计指数许可使用费）由基金管理人自行承担，不作为基金费用从基金财产中列支。标的指数许可使用费每日计算，逐日累计。计算方法如下：

日指数许可使用费 = 前一日基金资产净值 × 适用的指数许可使用费年费率 / 当年天数。

## 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

1. 根据《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金合同》及深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金以 2017 年 1 月 3 日为份额折算基准日，对泰信基本面 400 的场内份额、场外份额和泰信基本面 400A 份额实施定期份额折算。

2. 财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税[2016]140 号），要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2 号），2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。截至本财务报表批准报出日止，上述税收政策对本基金截止 2016 年 12 月 31 日止年度的财务状况和经营成果无影响。

## 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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商	基金托管人、基金销售机构

银行”)	
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司
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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

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。

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 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。

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 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。

### 7.4.10.2 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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	469,412.16	558,782.27
其中：支付销售机构的客户维护费	44,633.45	44,912.88

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 1.0% 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 × 1.00% / 当年天数。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	103,270.70	122,932.06

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 0.22% 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 × 0.22% / 当年天数。

**7.4.10.2.3 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。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：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。

**7.4.10.4 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		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	11,611,612.90
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	-	-	11,611,612.90
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	20.1800%

项目	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-
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	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-

注：基金管理人泰信基金管理有限公司在本年度申购本基金的交易委托管理人直销中心办理，申购费用为人民币 1,000.00 元。

#### 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

泰信基本面 400				
关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 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	24,237,971.33	42.1100%	38,201,229.28	62.4600%

#### 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	2,791,914.43	26,377.16	3,687,002.80	36,722.76

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。

#### 7.4.10.6 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在承销期内持有关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

在基金存续期内，本基金（包括泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额）不进行收益分配。

## 7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

## 7.4.12.2 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
600655	豫园商城	2016年12月20日	重大事项	11.42	-	-	21,174	280,694.36	241,807.08	-
600406	国电南瑞	2016年12月28日	重大事项	16.63	-	-	10,987	172,352.42	182,713.81	-
600859	王府井	2016年9月27日	重大事项	16.28	-	-	7,854	147,754.72	127,863.12	-
002440	闰土股份	2016年10月24日	重大事项	16.34	2017年1月12日	15.22	7,241	137,672.70	118,317.94	-
000829	天音控股	2016年9月29日	重大事项	11.28	-	-	9,543	125,283.24	107,645.04	-
000750	国海证券	2016年12月15日	重大事项	6.97	2017年1月20日	6.27	14,017	117,862.00	97,698.49	-
600626	申达股份	2016年12月15日	重大事项	13.69	2017年1月12日	13.70	6,984	88,906.91	95,610.96	-
600673	东阳光科	2016年11月15日	重大事项	7.29	-	-	12,253	103,781.37	89,324.37	-
600480	凌云股份	2016年8月1日	重大事项	15.01	2017年1月13日	16.51	5,100	65,994.00	76,551.00	-
000887	中鼎股份	2016年11月18日	重大事项	25.94	2017年2月15日	23.99	2,934	64,894.08	76,107.96	-
600577	精达股份	2016年5月13日	重大事项	4.18	2017年3	4.60	15,902	83,386.37	66,470.36	-

					月 2 日						
600973	宝胜股份	2016 年 11 月 28 日	重大事项	8.05	2017 年 2 月 22 日	8.86	8,162	64,937.15	65,704.10	-	
000050	深天马 A	2016 年 9 月 12 日	重大事项	18.82	-	-	3,400	71,297.02	63,988.00	-	
000042	中洲控股	2016 年 10 月 27 日	重大事项	20.24	-	-	3,000	57,423.50	60,720.00	-	
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大事项	14.60	-	-	4,100	88,204.18	59,860.00	-	
601005	重庆钢铁	2016 年 6 月 2 日	重大事项	2.52	-	-	20,200	74,631.72	50,904.00	-	
600551	时代出版	2016 年 11 月 28 日	重大事项	20.32	-	-	2,497	51,083.70	50,739.04	-	
002129	中环股份	2016 年 7 月 6 日	重大事项	8.27	-	-	5,500	76,574.22	45,485.00	-	
002075	沙钢股份	2016 年 9 月 19 日	重大事项	16.12	-	-	2,420	44,596.14	39,010.40	-	
000987	越秀金控	2016 年 8 月 29 日	重大事项	14.49	2017 年 1 月 9 日	15.94	1,066	18,122.34	15,446.34	-	

注：本基金截至 2016 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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份

额来看，泰信基本面 400A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；泰信基本面 400B 份额具有高风险、高预期收益的特征。本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括股票（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。本基金采用指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对中证锐联基本面 400 指数的有效跟踪。力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，实现基金资产的长期增值。

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。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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 12 月 31 日，本基金无债券投资(2015 年 12 月 31 日：同)。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

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股票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发行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，因此除附注 7.4.12 中列示的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。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担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。

### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	2,791,914.43	-	-	-	2,791,914.43
结算备付金	77,523.19	-	-	-	77,523.19
存出保证金	5,239.16	-	-	-	5,239.16
交易性金融资产	-	-	-	41,414,118.99	41,414,118.99
应收利息	-	-	-	559.34	559.34
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,874,676.78	-	-	41,414,678.33	44,289,355.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,222.79	1,222.79
应付管理人报酬	-	-	-	38,790.64	38,790.64
应付托管费	-	-	-	8,533.92	8,533.92
应付交易费用	-	-	-	15,084.36	15,084.36
其他负债	-	-	-	276,056.27	276,056.27
负债总计	-	-	-	339,687.98	339,687.98
利率敏感度缺口	2,874,676.78	-	-	41,074,990.35	43,949,667.13
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	3,687,002.80	-	-	-	3,687,002.80
结算备付金	29,691.27	-	-	-	29,691.27
存出保证金	35,202.44	-	-	-	35,202.44
交易性金融资产	-	-	-	53,977,232.55	53,977,232.55
应收利息	-	-	-	651.99	651.99
资产总计	3,751,896.51	-	-	53,977,884.54	57,729,781.05
负债					
应付证券清算款	-	-	-	110.49	110.49
应付赎回款	-	-	-	128,097.47	128,097.47
应付管理人报酬	-	-	-	46,653.96	46,653.96
应付托管费	-	-	-	10,263.88	10,263.88
应付交易费用	-	-	-	34,021.10	34,021.10
其他负债	-	-	-	338,885.54	338,885.54

负债总计	-	-	-	558,032.44	558,032.44
利率敏感度缺口	3,751,896.51	-	-	53,419,852.10	57,171,748.61

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（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）。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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，主要采用完全复制法，按照在中证锐联基本面 400 指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合和跟踪中证锐联基本面 400 指数的收益表现，并根据标的指数成份股及

其权重的变动而进行相应调整，使跟踪误差控制在限定的范围之内。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。本基金投资组合中投资于中证锐联基本面 400 指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	41,414,118.99	94.23	53,977,232.55	94.41
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	41,414,118.99	94.23	53,977,232.55	94.41

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	2,190,000.00	2,710,000.00
	2. 业绩比较基准下降 5%	-2,190,000.00	-2,710,000.00

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 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 39,682,151.98 元，属于第二层次的余额为 1,731,967.01 元，无属于第三层

次的余额。(2015 年 12 月 31 日：第一层次 49,548,660.71 元，第二层次 4,428,571.84 元，无第三层次的余额)。

(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，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 2016 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(2015 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	41,414,118.99	93.51
	其中：股票	41,414,118.99	93.51
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	2,869,437.62	6.48

7	其他各项资产	5,798.50	0.01
8	合计	44,289,355.11	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 期末指数投资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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	114,695.56	0.26
B	采矿业	1,778,076.55	4.05
C	制造业	22,079,204.47	50.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,746,283.16	3.97
E	建筑业	1,430,947.53	3.26
F	批发和零售业	3,454,840.42	7.86
G	交通运输、仓储和邮政业	2,560,991.41	5.83
H	住宿和餐饮业	32,258.70	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,460,568.55	3.32
J	金融业	1,769,056.63	4.03
K	房地产业	2,724,828.51	6.20
L	租赁和商务服务业	835,052.46	1.90
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	269,061.06	0.61
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	790,979.95	1.80
S	综合	316,370.03	0.72
	合计	41,363,214.99	94.11

### 8.2.2 期末积极投资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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	50,904.00	0.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	50,904.00	0.12

注：基金被动持有非成分股。

### 8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有沪港通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 8.3.1 期末指数投资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	000656	金科股份	75,455	395,384.20	0.90
2	000422	湖北宜化	47,700	379,215.00	0.86

3	600739	辽宁成大	15,938	286,246.48	0.65
4	000488	晨鸣纸业	25,953	268,873.08	0.61
5	000623	吉林敖东	8,587	266,111.13	0.61
6	002092	中泰化学	21,404	258,988.40	0.59
7	000423	东阿阿胶	4,678	252,003.86	0.57
8	600143	金发科技	31,900	248,182.00	0.56
9	600655	豫园商城	21,174	241,807.08	0.55
10	600039	四川路桥	47,643	225,827.82	0.51
11	600729	重庆百货	9,568	224,178.24	0.51
12	600970	中材国际	30,900	219,081.00	0.50
13	000728	国元证券	11,000	218,900.00	0.50
14	600426	华鲁恒升	16,467	218,187.75	0.50
15	600881	亚泰集团	39,750	217,432.50	0.49
16	000528	柳工	29,000	211,990.00	0.48
17	600535	天士力	5,047	209,400.03	0.48
18	000581	威孚高科	9,321	209,163.24	0.48
19	000060	中金岭南	18,717	208,694.55	0.47
20	600705	中航资本	33,518	205,130.16	0.47
21	000830	鲁西化工	36,560	204,370.40	0.47
22	600123	兰花科创	25,400	204,216.00	0.46
23	000543	皖能电力	25,513	194,153.93	0.44
24	601555	东吴证券	14,595	193,675.65	0.44
25	601717	郑煤机	27,135	190,759.05	0.43
26	000768	中航飞机	8,889	188,980.14	0.43
27	600369	西南证券	25,908	184,724.04	0.42
28	600406	国电南瑞	10,987	182,713.81	0.42
29	000786	北新建材	17,580	180,898.20	0.41
30	000793	华闻传媒	15,926	179,804.54	0.41
31	000690	宝新能源	19,336	179,244.72	0.41
32	600276	恒瑞医药	3,846	174,993.00	0.40
33	002081	金螳螂	17,801	174,271.79	0.40
34	600703	三安光电	12,732	170,481.48	0.39
35	000959	首钢股份	25,700	170,134.00	0.39
36	600252	中恒集团	36,971	169,327.18	0.39
37	600315	上海家化	6,219	168,597.09	0.38
38	600507	方大特钢	24,800	167,896.00	0.38
39	600674	川投能源	19,150	166,605.00	0.38
40	600269	赣粤高速	32,800	164,984.00	0.38
41	000012	南玻 A	14,473	164,123.82	0.37



42	600787	中储股份	18,042	163,640.94	0.37
43	600141	兴发集团	10,708	162,868.68	0.37
44	600522	中天科技	15,340	161,530.20	0.37
45	600067	冠城大通	22,556	161,500.96	0.37
46	601058	赛轮金宇	39,678	161,489.46	0.37
47	601099	太平洋	31,300	161,195.00	0.37
48	600210	紫江企业	29,598	160,125.18	0.36
49	600415	小商品城	18,422	159,350.30	0.36
50	600804	鹏博士	7,240	158,773.20	0.36
51	601718	际华集团	17,200	158,412.00	0.36
52	600409	三友化工	16,804	157,789.56	0.36
53	600109	国金证券	12,085	157,467.55	0.36
54	600487	亨通光电	8,402	156,781.32	0.36
55	000550	江铃汽车	5,800	156,600.00	0.36
56	600497	驰宏锌锗	22,194	156,023.82	0.36
57	600026	中远海能	22,800	155,268.00	0.35
58	002078	太阳纸业	23,037	153,887.16	0.35
59	600325	华发股份	12,005	153,664.00	0.35
60	600873	梅花生物	23,549	153,539.48	0.35
61	000401	冀东水泥	12,900	153,510.00	0.35
62	601678	滨化股份	21,056	153,498.24	0.35
63	002422	科伦药业	9,514	153,365.68	0.35
64	000877	天山股份	21,603	152,301.15	0.35
65	600004	白云机场	10,800	152,172.00	0.35
66	002241	歌尔股份	5,736	152,118.72	0.35
67	600120	浙江东方	5,258	152,061.36	0.35
68	002128	露天煤业	17,600	151,360.00	0.34
69	600637	东方明珠	6,452	150,331.60	0.34
70	600308	华泰股份	27,200	147,968.00	0.34
71	600256	广汇能源	31,656	147,833.52	0.34
72	600057	象屿股份	12,842	147,683.00	0.34
73	600320	振华重工	28,669	146,211.90	0.33
74	600742	一汽富维	9,034	145,718.42	0.33
75	601179	中国西电	25,800	143,964.00	0.33
76	601001	大同煤业	23,500	143,585.00	0.33
77	002269	美邦服饰	28,500	142,785.00	0.32
78	002450	康得新	7,393	141,280.23	0.32
79	002456	欧菲光	4,100	140,548.00	0.32
80	600138	中青旅	6,700	140,499.00	0.32

81	000612	焦作万方	12,160	140,448.00	0.32
82	600079	人福医药	7,036	140,368.20	0.32
83	000726	鲁泰 A	10,916	139,833.96	0.32
84	600597	光明乳业	10,689	139,598.34	0.32
85	600582	天地科技	27,920	138,762.40	0.32
86	300070	碧水源	7,853	137,584.56	0.31
87	000961	中南建设	13,202	137,300.80	0.31
88	601233	桐昆股份	9,553	137,181.08	0.31
89	600720	祁连山	16,697	136,414.49	0.31
90	600596	新安股份	13,307	136,263.68	0.31
91	000963	华东医药	1,881	135,563.67	0.31
92	600491	龙元建设	11,700	135,018.00	0.31
93	600761	安徽合力	10,604	134,882.88	0.31
94	000926	福星股份	10,568	134,636.32	0.31
95	600056	中国医药	7,008	133,362.24	0.30
96	002008	大族激光	5,897	133,272.20	0.30
97	600397	安源煤业	25,785	133,050.60	0.30
98	000960	锡业股份	10,127	132,866.24	0.30
99	002001	新和成	6,735	132,006.00	0.30
100	600801	华新水泥	16,837	130,486.75	0.30
101	600157	永泰能源	32,406	129,948.06	0.30
102	000900	现代投资	16,101	129,935.07	0.30
103	601000	唐山港	32,316	129,587.16	0.29
104	600859	王府井	7,854	127,863.12	0.29
105	600033	福建高速	36,900	127,674.00	0.29
106	600805	悦达投资	14,955	126,967.95	0.29
107	600008	首创股份	30,820	126,670.20	0.29
108	600686	金龙汽车	8,861	125,914.81	0.29
109	000626	远大控股	5,100	125,715.00	0.29
110	600600	青岛啤酒	4,260	125,414.40	0.29
111	600183	生益科技	11,276	124,036.00	0.28
112	600064	南京高科	7,405	124,033.75	0.28
113	000572	海马汽车	23,104	123,837.44	0.28
114	000415	渤海金控	17,284	123,580.60	0.28
115	600718	东软集团	6,285	123,563.10	0.28
116	000917	电广传媒	8,580	123,466.20	0.28
117	000600	建投能源	13,790	122,455.20	0.28
118	600085	同仁堂	3,888	122,005.44	0.28
119	002004	华邦健康	13,412	121,646.84	0.28

120	000413	东旭光电	10,800	121,608.00	0.28
121	002470	金正大	15,308	120,933.20	0.28
122	600835	上海机电	6,186	120,750.72	0.27
123	000417	合肥百货	13,967	120,535.21	0.27
124	600816	安信信托	5,100	120,462.00	0.27
125	000839	中信国安	13,040	119,707.20	0.27
126	600160	巨化股份	11,293	119,479.94	0.27
127	600017	日照港	29,480	119,394.00	0.27
128	600893	中航动力	3,638	119,108.12	0.27
129	600267	海正药业	9,026	118,691.90	0.27
130	601010	文峰股份	22,563	118,681.38	0.27
131	600284	浦东建设	8,994	118,630.86	0.27
132	000686	东北证券	9,580	118,408.80	0.27
133	002440	闰土股份	7,241	118,317.94	0.27
134	000999	华润三九	4,755	117,591.15	0.27
135	002311	海大集团	7,813	117,585.65	0.27
136	002048	宁波华翔	5,307	117,496.98	0.27
137	600312	平高电气	7,500	117,150.00	0.27
138	000009	中国宝安	11,218	116,218.48	0.26
139	000400	许继电气	6,401	116,178.15	0.26
140	000559	万向钱潮	8,758	116,131.08	0.26
141	601098	中南传媒	6,939	115,603.74	0.26
142	000006	深振业 A	12,197	115,261.65	0.26
143	000701	厦门信达	7,407	113,845.59	0.26
144	000906	物产中拓	7,746	113,556.36	0.26
145	600332	白云山	4,715	113,065.70	0.26
146	601369	陕鼓动力	16,500	113,025.00	0.26
147	600216	浙江医药	8,814	111,761.52	0.25
148	600125	铁龙物流	13,787	111,398.96	0.25
149	600062	华润双鹤	5,007	111,305.61	0.25
150	000666	经纬纺机	5,205	111,230.85	0.25
151	600575	皖江物流	19,337	111,187.75	0.25
152	600978	宜华生活	10,431	111,090.15	0.25
153	000758	中色股份	13,896	111,029.04	0.25
154	600584	长电科技	6,269	110,647.85	0.25
155	000021	深科技	11,676	110,104.68	0.25
156	002385	大北农	15,500	110,050.00	0.25
157	600525	长园集团	7,860	109,647.00	0.25
158	000789	万年青	13,621	109,376.63	0.25

159	600713	南京医药	13,630	108,358.50	0.25
160	000598	兴蓉环境	18,806	108,322.56	0.25
161	000829	天音控股	9,543	107,645.04	0.24
162	601588	北辰实业	25,800	107,586.00	0.24
163	600481	双良节能	14,252	107,175.04	0.24
164	000031	中粮地产	12,011	107,138.12	0.24
165	002183	怡亚通	9,846	106,927.56	0.24
166	601777	力帆股份	11,177	106,852.12	0.24
167	600635	大众公用	17,771	106,803.71	0.24
168	002465	海格通信	9,078	105,758.70	0.24
169	002051	中工国际	4,604	105,523.68	0.24
170	600508	上海能源	9,700	105,342.00	0.24
171	002701	奥瑞金	12,186	105,287.04	0.24
172	000860	顺鑫农业	4,774	105,028.00	0.24
173	002375	亚厦股份	9,917	104,921.86	0.24
174	600498	烽火通信	4,139	104,344.19	0.24
175	000939	凯迪生态	8,100	104,247.00	0.24
176	600657	信达地产	16,954	103,419.40	0.24
177	002028	思源电气	7,836	103,278.48	0.23
178	002277	友阿股份	7,184	103,162.24	0.23
179	600037	歌华有线	6,683	102,383.56	0.23
180	600122	宏图高科	8,357	102,122.54	0.23
181	002065	东华软件	4,375	101,937.50	0.23
182	600509	天富能源	13,596	101,562.12	0.23
183	600006	东风汽车	14,528	99,952.64	0.23
184	300124	汇川技术	4,899	99,596.67	0.23
185	600588	用友网络	4,778	99,477.96	0.23
186	600277	亿利洁能	13,972	99,340.92	0.23
187	601866	中远海发	24,300	99,144.00	0.23
188	600569	安阳钢铁	33,100	98,969.00	0.23
189	000685	中山公用	8,818	98,144.34	0.22
190	601880	大连港	34,993	97,980.40	0.22
191	000750	国海证券	14,017	97,698.49	0.22
192	600388	龙净环保	7,897	97,685.89	0.22
193	000683	远兴能源	30,463	96,872.34	0.22
194	601789	宁波建工	14,474	96,686.32	0.22
195	600020	中原高速	21,500	96,535.00	0.22
196	600963	岳阳林纸	11,796	96,373.32	0.22
197	002242	九阳股份	5,344	96,352.32	0.22

198	000046	泛海控股	10,344	96,095.76	0.22
199	000680	山推股份	17,298	95,657.94	0.22
200	600626	申达股份	6,984	95,610.96	0.22
201	000671	阳光城	17,112	95,313.84	0.22
202	600567	山鹰纸业	26,326	95,300.12	0.22
203	002085	万丰奥威	4,794	94,729.44	0.22
204	600373	中文传媒	4,662	94,172.40	0.21
205	002250	联化科技	5,800	93,844.00	0.21
206	600511	国药股份	3,110	93,611.00	0.21
207	600811	东方集团	13,081	93,529.15	0.21
208	603766	隆鑫通用	4,483	93,156.74	0.21
209	000043	中航地产	7,543	92,477.18	0.21
210	002191	劲嘉股份	8,860	92,232.60	0.21
211	002236	大华股份	6,717	91,888.56	0.21
212	002251	步步高	5,576	91,725.20	0.21
213	600971	恒源煤电	14,626	91,705.02	0.21
214	601101	昊华能源	13,666	91,288.88	0.21
215	002271	东方雨虹	4,200	91,098.00	0.21
216	601928	凤凰传媒	8,671	90,785.37	0.21
217	002237	恒邦股份	7,844	90,206.00	0.21
218	600176	中国巨石	9,139	89,927.76	0.20
219	002673	西部证券	4,324	89,809.48	0.20
220	600673	东阳光科	12,253	89,324.37	0.20
221	000028	国药一致	1,325	88,642.50	0.20
222	601958	金铂股份	11,500	87,975.00	0.20
223	000910	大亚圣象	4,600	87,860.00	0.20
224	000652	泰达股份	15,825	87,354.00	0.20
225	600697	欧亚集团	2,700	86,481.00	0.20
226	600499	科达洁能	11,418	86,320.08	0.20
227	600169	太原重工	21,267	85,706.01	0.20
228	600297	广汇汽车	10,000	85,600.00	0.19
229	000807	云铝股份	12,675	84,922.50	0.19
230	002310	东方园林	5,960	84,334.00	0.19
231	600959	江苏有线	7,460	84,298.00	0.19
232	002353	杰瑞股份	4,147	84,184.10	0.19
233	600449	宁夏建材	6,905	84,033.85	0.19
234	000970	中科三环	6,277	83,797.95	0.19
235	002344	海宁皮城	7,390	83,654.80	0.19
236	000698	沈阳化工	10,500	82,845.00	0.19

237	600611	大众交通	12,578	82,637.46	0.19
238	000089	深圳机场	10,300	82,400.00	0.19
239	000826	启迪桑德	2,490	82,120.20	0.19
240	600676	交运股份	9,140	81,985.80	0.19
241	002083	孚日股份	11,544	81,616.08	0.19
242	600380	健康元	8,205	81,475.65	0.19
243	300002	神州泰岳	8,800	81,312.00	0.19
244	600061	国投安信	5,200	81,172.00	0.18
245	603993	洛阳钼业	21,763	80,958.36	0.18
246	000418	小天鹅 A	2,483	80,250.56	0.18
247	000732	泰禾集团	4,500	79,605.00	0.18
248	600809	山西汾酒	3,166	79,213.32	0.18
249	600469	风神股份	6,602	78,563.80	0.18
250	000767	漳泽电力	20,400	78,540.00	0.18
251	601929	吉视传媒	18,718	78,428.42	0.18
252	601198	东兴证券	3,900	78,234.00	0.18
253	002221	东华能源	6,300	78,057.00	0.18
254	002570	贝因美	5,943	77,972.16	0.18
255	600648	外高桥	3,947	77,913.78	0.18
256	002244	滨江集团	11,152	77,840.96	0.18
257	601118	海南橡胶	11,034	76,796.64	0.17
258	600516	方大炭素	8,282	76,691.32	0.17
259	600480	凌云股份	5,100	76,551.00	0.17
260	000887	中鼎股份	2,934	76,107.96	0.17
261	000828	东莞控股	6,000	75,480.00	0.17
262	002233	塔牌集团	8,043	75,202.05	0.17
263	600240	华业资本	7,000	75,180.00	0.17
264	600743	华远地产	16,876	75,098.20	0.17
265	600565	迪马股份	10,100	74,942.00	0.17
266	600327	大东方	7,979	74,204.70	0.17
267	600549	厦门钨业	3,362	74,031.24	0.17
268	600317	营口港	21,300	73,911.00	0.17
269	600595	中孚实业	13,100	73,622.00	0.17
270	002429	兆驰股份	7,389	73,594.44	0.17
271	601216	君正集团	15,806	73,497.90	0.17
272	002210	飞马国际	3,976	73,357.20	0.17
273	601106	中国一重	13,546	73,283.86	0.17
274	600895	张江高科	4,130	73,183.60	0.17
275	601872	招商轮船	14,800	73,112.00	0.17

276	600038	中直股份	1,509	73,065.78	0.17
277	600270	外运发展	4,401	72,792.54	0.17
278	000979	中弘股份	27,565	72,771.60	0.17
279	000966	长源电力	11,998	72,467.92	0.16
280	600073	上海梅林	6,300	72,135.00	0.16
281	600737	中粮屯河	5,712	71,171.52	0.16
282	002013	中航机电	3,889	71,129.81	0.16
283	000869	张裕 A	1,964	70,704.00	0.16
284	600663	陆家嘴	3,189	70,572.57	0.16
285	002204	大连重工	15,868	70,453.92	0.16
286	300027	华谊兄弟	6,396	70,356.00	0.16
287	002556	辉隆股份	6,757	70,205.23	0.16
288	002475	立讯精密	3,325	68,993.75	0.16
289	002489	浙江永强	9,100	68,887.00	0.16
290	600662	强生控股	6,199	68,746.91	0.16
291	601231	环旭电子	6,416	68,715.36	0.16
292	300146	汤臣倍健	5,700	68,058.00	0.15
293	600533	栖霞建设	12,100	67,881.00	0.15
294	600572	康恩贝	9,250	67,617.50	0.15
295	601886	江河集团	6,344	67,563.60	0.15
296	002294	信立泰	2,288	66,901.12	0.15
297	600577	精达股份	15,902	66,470.36	0.15
298	000541	佛山照明	6,742	66,341.28	0.15
299	600973	宝胜股份	8,162	65,704.10	0.15
300	002050	三花股份	5,950	65,688.00	0.15
301	601636	旗滨集团	16,900	65,572.00	0.15
302	601566	九牧王	3,700	65,453.00	0.15
303	002029	七匹狼	6,406	65,405.26	0.15
304	600517	置信电气	6,701	65,200.73	0.15
305	300408	三环集团	4,100	65,108.00	0.15
306	002482	广田集团	7,032	65,046.00	0.15
307	600280	中央商场	7,548	64,988.28	0.15
308	002416	爱施德	4,363	64,266.99	0.15
309	002155	湖南黄金	5,605	64,177.25	0.15
310	000050	深天马 A	3,400	63,988.00	0.15
311	601107	四川成渝	12,600	63,756.00	0.15
312	000552	靖远煤电	16,800	63,672.00	0.14
313	000090	天健集团	6,580	63,562.80	0.14
314	000718	苏宁环球	7,318	63,154.34	0.14

315	002500	山西证券	5,173	62,179.46	0.14
316	600812	华北制药	9,911	62,042.86	0.14
317	600633	浙报传媒	3,500	61,810.00	0.14
318	002309	中利科技	4,349	61,799.29	0.14
319	002152	广电运通	4,640	61,619.20	0.14
320	600396	金山股份	11,800	61,478.00	0.14
321	002011	盾安环境	6,434	61,251.68	0.14
322	600012	皖通高速	3,700	61,013.00	0.14
323	000620	新华联	7,168	60,784.64	0.14
324	000042	中洲控股	3,000	60,720.00	0.14
325	002267	陕天然气	6,294	60,359.46	0.14
326	600485	信威集团	4,100	59,860.00	0.14
327	600195	中牧股份	2,787	59,223.75	0.13
328	002508	老板电器	1,600	58,880.00	0.13
329	600726	华电能源	11,800	58,410.00	0.13
330	002463	沪电股份	12,156	58,105.68	0.13
331	601311	骆驼股份	3,540	57,808.20	0.13
332	001696	宗申动力	6,091	57,255.40	0.13
333	002408	齐翔腾达	5,163	56,793.00	0.13
334	600458	时代新材	4,000	56,600.00	0.13
335	601608	中信重工	10,050	56,380.50	0.13
336	600428	中远海特	9,191	56,248.92	0.13
337	000088	盐田港	7,850	55,970.50	0.13
338	300003	乐普医疗	3,100	55,583.00	0.13
339	600366	宁波韵升	2,820	55,525.80	0.13
340	600118	中国卫星	1,768	55,232.32	0.13
341	600894	广日股份	4,000	54,680.00	0.12
342	300059	东方财富	3,200	54,176.00	0.12
343	600466	蓝光发展	5,600	54,152.00	0.12
344	002007	华兰生物	1,466	52,409.50	0.12
345	002062	宏润建设	7,800	52,260.00	0.12
346	000587	金洲慈航	3,500	52,080.00	0.12
347	002498	汉缆股份	12,100	52,030.00	0.12
348	600278	东方创业	3,164	51,636.48	0.12
349	600987	航民股份	4,175	51,519.50	0.12
350	601801	皖新传媒	2,898	50,917.86	0.12
351	600551	时代出版	2,497	50,739.04	0.12
352	600685	中船防务	1,700	50,490.00	0.11
353	601515	东风股份	4,213	50,429.61	0.11



354	603001	奥康国际	2,200	50,380.00	0.11
355	300257	开山股份	2,900	49,764.00	0.11
356	600292	远达环保	3,990	49,356.30	0.11
357	600869	智慧能源	6,234	48,251.16	0.11
358	002293	罗莱生活	3,587	48,245.15	0.11
359	600744	华银电力	8,900	46,814.00	0.11
360	000536	华映科技	3,008	45,932.16	0.10
361	600231	凌钢股份	16,900	45,799.00	0.10
362	600580	卧龙电气	5,000	45,500.00	0.10
363	002129	中环股份	5,500	45,485.00	0.10
364	601339	百隆东方	7,222	45,065.28	0.10
365	603077	和邦生物	8,705	44,569.60	0.10
366	600510	黑牡丹	5,103	44,038.89	0.10
367	600708	光明地产	4,900	43,757.00	0.10
368	002588	史丹利	3,800	43,130.00	0.10
369	002662	京威股份	2,600	42,770.00	0.10
370	600372	中航电子	2,274	42,205.44	0.10
371	000631	顺发恒业	8,429	41,302.10	0.09
372	600748	上实发展	5,037	41,253.03	0.09
373	000156	华数传媒	2,300	41,193.00	0.09
374	002157	正邦科技	6,109	40,685.94	0.09
375	002399	海普瑞	2,177	39,664.94	0.09
376	000596	古井贡酒	858	39,039.00	0.09
377	002075	沙钢股份	2,420	39,010.40	0.09
378	002444	巨星科技	2,431	37,923.60	0.09
379	002299	圣农发展	1,786	37,898.92	0.09
380	300144	宋城演艺	1,700	35,598.00	0.08
381	002252	上海莱士	1,536	35,466.24	0.08
382	600639	浦东金桥	1,900	35,264.00	0.08
383	600180	瑞茂通	2,500	33,850.00	0.08
384	601021	春秋航空	900	33,066.00	0.08
385	600236	桂冠电力	5,300	32,330.00	0.07
386	600754	锦江股份	1,095	32,258.70	0.07
387	300433	蓝思科技	1,100	30,371.00	0.07
388	002651	利君股份	2,500	29,325.00	0.07
389	603198	迎驾贡酒	1,300	28,015.00	0.06
390	600126	杭钢股份	3,333	27,997.20	0.06
391	603806	福斯特	600	27,762.00	0.06
392	600483	福能股份	2,500	27,675.00	0.06

393	002539	云图控股	1,900	21,014.00	0.05
394	603885	吉祥航空	900	20,970.00	0.05
395	600981	汇鸿集团	2,400	20,376.00	0.05
396	601969	海南矿业	1,300	15,912.00	0.04
397	000987	越秀金控	1,066	15,446.34	0.04
398	002010	传化股份	800	15,040.00	0.03
399	002249	大洋电机	1,662	14,343.06	0.03
400	600623	华谊集团	700	9,408.00	0.02

### 8.3.2 期末积极投资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	601005	重庆钢铁	20,200	50,904.00	0.12

注：基金被动持有非成分股。

### 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	600017	日照港	680,033.00	1.19
2	601377	兴业证券	406,153.76	0.71
3	000422	湖北宜化	404,545.00	0.71
4	000488	晨鸣纸业	357,740.00	0.63
5	000656	金科股份	351,763.00	0.62
6	000423	东阿阿胶	348,097.00	0.61
7	600739	辽宁成大	342,326.00	0.60
8	600655	豫园商城	312,900.00	0.55
9	600729	重庆百货	296,553.00	0.52
10	600143	金发科技	289,031.00	0.51
11	600216	浙江医药	288,012.00	0.50
12	600276	恒瑞医药	282,860.79	0.49
13	000728	国元证券	281,373.00	0.49
14	600970	中材国际	276,197.00	0.48

15	000012	南玻 A	273,493.00	0.48
16	000626	远大控股	271,157.00	0.47
17	000623	吉林敖东	271,118.00	0.47
18	600369	西南证券	259,888.00	0.45
19	000839	中信国安	259,288.00	0.45
20	600705	中航资本	258,594.00	0.45

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	600017	日照港	645,720.00	1.13
2	601377	兴业证券	516,999.55	0.90
3	600216	浙江医药	482,473.00	0.84
4	000488	晨鸣纸业	470,560.00	0.82
5	000423	东阿阿胶	460,934.00	0.81
6	000422	湖北宜化	454,465.00	0.79
7	600276	恒瑞医药	410,058.00	0.72
8	000012	南玻 A	398,856.80	0.70
9	601933	永辉超市	367,066.68	0.64
10	601888	中国国旅	344,082.85	0.60
11	600160	巨化股份	332,599.00	0.58
12	000926	福星股份	317,198.00	0.55
13	002001	新和成	315,840.00	0.55
14	600096	云天化	310,745.00	0.54
15	000701	厦门信达	308,708.00	0.54
16	600997	开滦股份	307,601.00	0.54
17	000839	中信国安	302,247.00	0.53
18	600522	中天科技	301,527.00	0.53
19	000963	华东医药	299,796.00	0.52
20	002242	九阳股份	297,922.00	0.52

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	55,369,527.55
卖出股票收入（成交）总额	59,089,298.98

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

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

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所有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	5,239.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	559.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,798.50

### 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

#### 8.12.5.1 期末指数投资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	600655	豫园商城	241,807.08	0.55	临时停牌

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五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	601005	重庆钢铁	50,904.00	0.12	临时停牌

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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
泰信基本面 400A	92	71,123.92	961,800.00	14.70%	5,581,601.00	85.30%
泰信基本面 400B	660	9,914.24	68,700.00	1.05%	6,474,701.00	98.95%
泰信基本面 400	604	73,618.82	35,849,586.23	80.62%	8,616,178.82	19.38%
合计	1,356	42,442.90	36,880,086.23	64.08%	20,672,480.82	35.92%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

泰信基本面 400A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	郑月娟	1,438,682.00	21.99%
2	顾立岳	1,248,405.00	19.08%
3	董长珠	841,300.00	12.86%
4	北京恒天财富投资管理有限公司—恒天华夏未来一期证券投资基金	647,824.00	9.90%
5	郑宏澍	532,395.00	8.14%
6	郑月琴	420,560.00	6.43%
7	刘景芝	376,800.00	5.76%
8	郑文颖	205,883.00	3.15%
9	郑志坤	177,925.00	2.72%
10	方春娣	100,000.00	1.53%

泰信基本面 400B

	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额
--	-------	---------	--------

序号			比例
1	韩莉颖	786,335.00	12.02%
2	王军	210,800.00	3.22%
3	姜学军	193,000.00	2.95%
4	蒋安平	142,311.00	2.17%
5	官孟良	116,800.00	1.79%
6	陈志伟	114,729.00	1.75%
7	崔文涛	104,000.00	1.59%
8	赵晓辉	101,200.00	1.55%
9	周玉明	98,100.00	1.50%
10	王方	94,600.00	1.45%

### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泰信基本面 400A	0
	泰信基本面 400B	0
	泰信基本面 400	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰信基本面 400A	0
	泰信基本面 400B	0
	泰信基本面 400	0
	合计	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。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
基金合同生效日(2012 年 9 月 7 日)	-	-	300,843,720.90
基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	7,242,006.00	7,242,006.00	46,676,835.53
本报告期基金总申购份额	-	-	87,788,401.74
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	93,055,671.09
本报告期基金拆分变动份额（份额	-698,605.00	-698,605.00	3,056,198.87

减少以“-”填列)			
本报告期期末基金份额总额	6,543,401.00	6,543,401.00	44,465,765.05

## § 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

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

2016年7月万科企业股份有限公司工会委员会诉泰信基金管理有限公司等被告损害股东利益责任纠纷一案，公司已聘请专业律师应诉，目前案件正在审理阶段，法院未作出判决。

本报告期无涉及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（2012年9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	
川财证券	1	53,681,166.13	46.94%	49,994.81	47.40%	-



中国银河证券	1	51,559,327.90	45.08%	46,985.84	44.55%	-
齐鲁证券	1	9,124,687.22	7.98%	8,498.65	8.06%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	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、本报告期新增交易单元：国信证券上海 34699、国信证券深圳 397448、天风证券上海 36378、东北证券深圳 001675；退租交易单元：无

### 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
川财证券	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	定期折算泰信 400A 份额停复牌公告、第五个运作周年约定收益率公告	《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 6 日
2	定期折算结果及恢复交易公告、泰信 400A 前收盘价调整公告	《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 6 日
3	指数熔断期间场内基金暂停申购赎回业务公告	《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 6 日
4	新增大泰金石为销售机构并开通费率优惠业务	《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 7 日
5	停牌股票估值调整 (盾安环境、长电科技)	《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
6	在兴业证券开通定投费率优惠业务	《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 1 月 12 日
7	新增北京增财销售为销售机构并	《中国证券报》、《上海证	2016 年 1 月 20 日

	开通定换费率优惠	券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	
8	15 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
9	价格波动提示、可能发生不定期折算第一次提示	《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 27 日
10	价格波动提示、可能发生不定期折算第二次提示	《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 28 日
11	价格波动提示、可能发生不定期折算第三次提示、价格波动提示	《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 29 日
12	停牌股票估值调整 (宏图高科)	《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 29 日
13	可能发生不定期折算第四次提示	《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 1 日
14	可能发生不定期折算第五次提示	《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 2 日
15	可能发生不定期折算第六次提示	《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 3 日
16	可能发生不定期折算第七次提示	《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 4 日
17	可能发生不定期折算第八次提示	《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 5 日
18	可能发生不定期折算第九次提示	《中国证券报》、《上海证	2016 年 2 月 15 日

		券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	
19	可能发生不定期折算第十次提示	《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 16 日
20	可能发生不定期折算第十一次提示	《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
21	可能发生不定期折算第十二次提示	《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 29 日
22	可能发生不定期折算第十三次提示、B 份额价格波动风险提示	《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
23	可能发生不定期折算第十四次提示	《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 2 日
24	可能发生不定期折算第十五次提示	《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
25	可能发生不定期折算第十六次提示	《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 11 日
26	可能发生不定期折算第十七次提示	《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 14 日
27	可能发生不定期折算第十八次提示	《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 18 日
28	提醒投资者更新身份信息公告	《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 24 日
29	工商银行申购费率优惠	《中国证券报》、《上海证	2016 年 3 月 28 日

		券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	
30	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
31	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
32	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
33	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
34	在中信建投开通定投转换业务费率优惠业务	《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 5 月 4 日
35	可能发生不定期折算第十九次提示	《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 10 日
36	可能发生不定期折算第二十次提示	《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 11 日
37	可能发生不定期折算第二十一次提示	《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
38	可能发生不定期折算第二十二次提示	《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 13 日
39	可能发生不定期折算第二十三次提示	《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 16 日
40	可能发生不定期折算第二十四次	《中国证券报》、《上海证	2016 年 5 月 17 日

	提示	券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	
41	可能发生不定期折算第二十五次提示	《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 18 日
42	可能发生不定期折算第二十六次提示	《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
43	可能发生不定期折算第二十七次提示	《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 20 日
44	可能发生不定期折算第二十八次提示	《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 21 日
45	可能发生不定期折算第二十九次提示	《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
46	可能发生不定期折算第三十次提示	《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 25 日
47	可能发生不定期折算第三十一次提示	《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 26 日
48	可能发生不定期折算第三十二次提示	《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 27 日
49	可能发生不定期折算第三十三次提示	《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 28 日
50	可能发生不定期折算第三十四次提示	《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 31 日
51	新增厦门鑫鼎盛为销售机构并开	《中国证券报》、《上海证	2016 年 6 月 3 日

	通定投业务	券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	
52	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
53	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
54	可能发生不定期折算第三十五次提示	《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 14 日
55	可能发生不定期折算第三十六次提示	《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 15 日
56	可能发生不定期折算第三十七次提示	《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 16 日
57	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
58	可能发生不定期折算第三十八次提示	《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
59	可能发生不定期折算第三十九次提示	《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 18 日
60	可能发生不定期折算第四十次提示	《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 21 日
61	可能发生不定期折算第四十一次提示	《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 22 日
62	在陆金所开通申购定投费率优惠	《中国证券报》、《上海证	2016 年 6 月 24 日

	业务	券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	
63	可能发生不定期折算第四十二次提示	《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
64	可能发生不定期折算第四十三次提示	《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
65	可能发生不定期折算第四十四次提示	《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 28 日
66	参加鑫鼎盛申购定定投费率优惠业务	《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 7 月 6 日
67	新增武汉市伯嘉销售有限公司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 7 月 16 日
68	16 年 2 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 7 月 19 日
69	新增北京晟视天下为销售机构并开通定投业务	《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 7 月 22 日
70	参加泰诚财富基金销售(大连)有限公司申购、定投费率优惠活动	《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 8 月 12 日
71	参加上海联泰资产管理有限公司申购、定投费率优惠	《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 8 月 20 日
72	16 年半年度报告	《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 8 月 29 日
73	新增华泰证券为销售机构开通定	《中国证券报》、《上海证	2016 年 9 月 19 日



	投转换业务	券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	
74	参加北京恒天明泽基金销售有限公司申购、定投费率优惠活动的公告	《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 10 月 25 日
75	参加嘉实财富费率优惠活动的公告	《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 10 月 25 日
76	16 年 3 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 10 月 26 日
77	新增华福证券为销售机构并开通定投、转换及费率优惠	《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 11 月 30 日
78	新增宁波银行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 11 月 30 日
79	参加农业银行网上银行掌上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 12 月 28 日
80	办理 2017 定期份额折算业务公告	《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 12 月 28 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级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

## 12.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人住所、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。

## 12.3 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](http://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  
2017年3月30日