

# 泰信中小盘精选混合型证券投资基金 2017 年年度报告

2017 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 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 2018 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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 2017 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>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
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>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	16
4.10 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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>47</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58

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 .....	58
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 .....	58
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 .....	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	58
8.12 投资组合报告附注 .....	59
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
9.3 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 .....	60
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>61</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4 基金投资策略的改变 .....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
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 .....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8 其他重大事件 .....	66
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>71</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	71
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>72</b>
13.1 备查文件目录 .....	72
13.2 存放地点 .....	72
13.3 查阅方式 .....	72

## § 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	39,603,714.08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型上市公司，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	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	万众	陈四清

## 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	基金管理人及基金托管人住所

## 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	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、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	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	-1,308,893.71	-18,390,647.90	190,543,311.14
本期利润	-7,260,908.14	-49,839,246.81	232,344,135.08
加权平均基金份额本期利润	-0.1530	-0.4089	0.8246
本期加权平均净值利润率	-8.74%	-23.19%	39.14%
本期基金份额净值增长率	-8.49%	-17.30%	42.06%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	24,051,717.95	36,832,267.32	180,366,313.38
期末可供分配基金份额利润	0.6073	0.7560	1.1487
期末基金资产净值	63,655,432.03	85,552,706.87	356,733,059.52
期末基金份额净值	1.607	1.756	2.272
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	88.17%	105.62%	148.64%

注：1、本基金合同于 2011 年 10 月 26 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	-8.01%	0.95%	-2.75%	0.71%	-5.26%	0.24%
过去六个月	-7.43%	1.02%	2.30%	0.70%	-9.73%	0.32%
过去一年	-8.49%	1.03%	2.60%	0.67%	-11.09%	0.36%
过去三年	7.51%	2.04%	14.31%	1.58%	-6.80%	0.46%
过去五年	74.18%	1.81%	64.20%	1.39%	9.98%	0.42%
自基金合同生效起至今	88.17%	1.67%	48.57%	1.36%	39.60%	0.31%

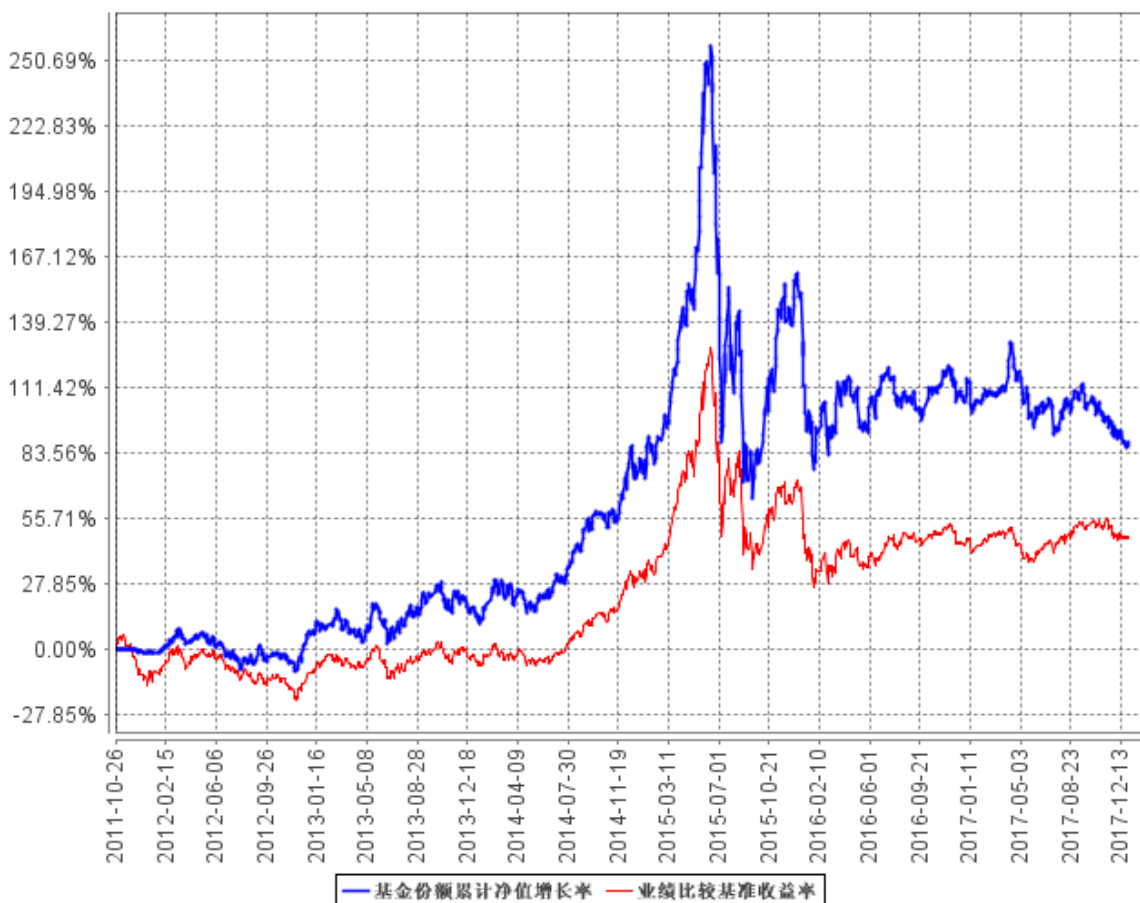
注：本基金业绩比较基准为：中证 700 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%

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， 全称为中证中小盘 700 指数（中 CSI Small&Midcap 700 index），上海行情代码为 000907，深圳行情代码为 399907。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。

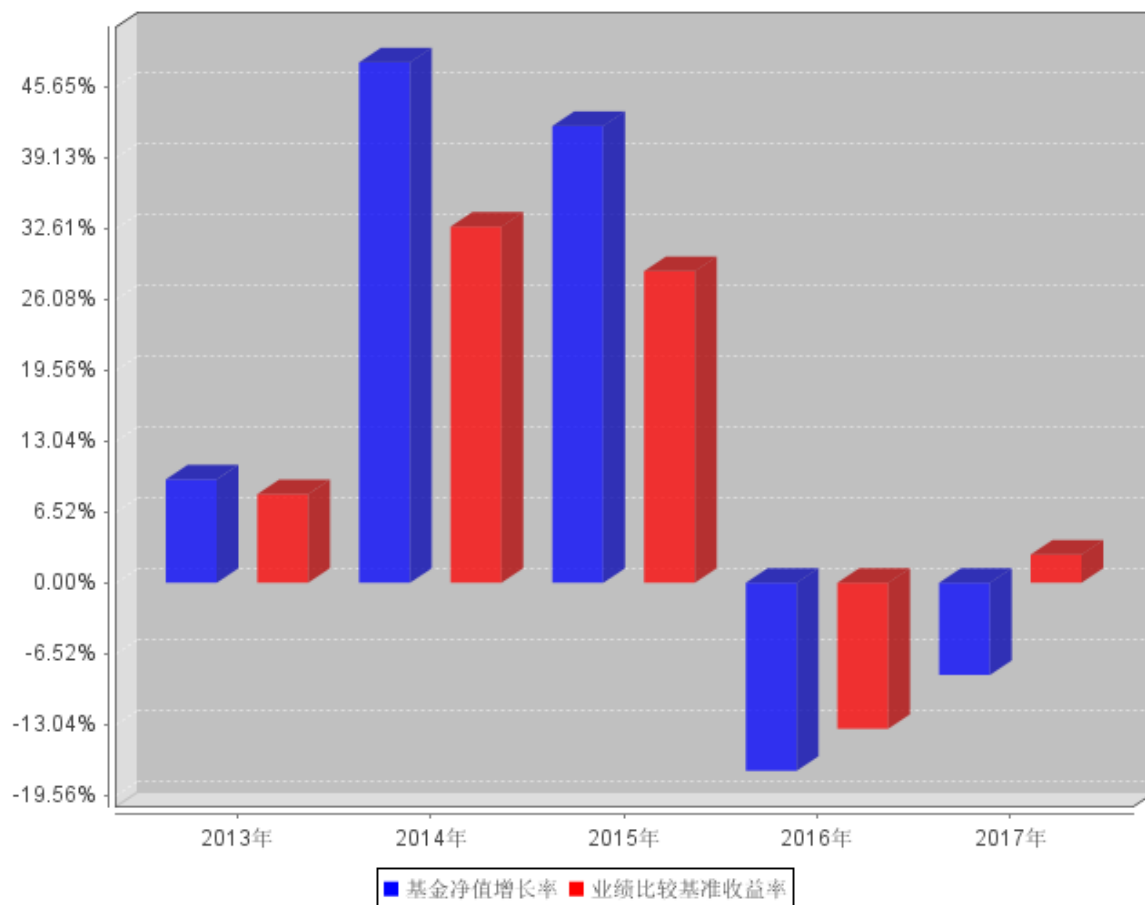
2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满，本基金将基金资产的 60%-95%投资于股票，现金或到期



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%。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年 度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2017	-	-	-	-	
2016	1.350	15,029,307.21	3,339,791.47	18,369,098.68	
2015	0.700	20,777,119.50	3,274,373.96	24,051,493.46	
合计	2.050	35,806,426.71	6,614,165.43	42,420,592.14	

## § 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：万众

总经理：葛航

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：姚慧

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 2017 年 12 月底，公司有正式员工 102 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 2017 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、泰信鑫利混合共 20 只开放式基金及 19 个资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘杰先生	本基金经理兼泰信优质生活混合基金经理	2015年3月17日	-	8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。自2016年12月1日起担任泰信优质生活混合基金经理。
董季周先生	本基金经理助理	2017年3月29日	-	5年	金融学硕士，具有基金从业资格证。曾任职于圆信永丰基金管理有限公司，2015年加入泰信基金管理有限公司，任研究员，现任研究部研究员兼本基金基金经理助理。

注：1、基金经理的任职日期以基金合同生效日为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

回顾已经过去的 2017 年，我们可以清晰地发现过去的一年市场的主线以及发生这种变化背后的逻辑，对此做分析和总结有助于我们对未来市场走势的判断。从 2014 年国家提出供给侧结构性改革的大政方针起，以及其间伴随施行的房地产行业去库存，是的到 2016 年底，代表着中国经济体量大部分比重的房地产、钢铁、煤炭、有色金属（电解铝等）等行业资产负债表得到了有效的修复，企业盈利、现金流状况大幅好转。因此带来的银行业、保险业资产负债表改善进一步化解了中国国家债务风险。我们通过市场全年的行业表现就能清楚的看到这一点，表现最好的行业基本集中在以上范围内。我们看到，国际资金对于中国资产的风险溢价水平开始提升，这一点率先在港股得到了体现，尤其是在港上市的房地产、资源型企业。伴随着沪港通、深港通的逐步推进，更多的海外资金开始流向 A 股市场，为 A 股市场带来了一种有别于以往的投资思路和选股策略，同时由于资金面的边际收紧、监管的力度加大也为高估值、业绩差、成长前景不明确的行业和个股带来了约束。同时，消费股凭借稳健的增长，以及消费升级大趋势带来的业绩提升吸引了最多的资金关注。

报告期内，本基金秉持了一贯的投资原则，兼顾成长性与估值选股；自上而下选行业，自下而上选个股。全年的配置基本围绕增长确定、估值合理的主线展开。由于我们年初对于全年行情预判较为谨慎，采取的操作策略基本以即使兑现收益为主，因此未能把握消费股的全年行情。随着二季度资源品价格的上涨，周期股预期逐渐乐观，下半年的配置以周期股为主。由于对消费、金融两大板块配置不够充分，全年净值表现并不理想。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.607 元；本报告期基金份额净值增长率为-8.49%，业绩比较基准收益率为 2.60%。

#### 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 2018 年，我们觉得宏观经济可能出现前高后低的总体走势，判断的主要依据来自于国内外两方面因素的叠加。首先，国内方面，2017 年全年房地产行业销售景气度维持在了较高位置，但投资开工数据在逐步恶化，特别是下半年较上半年明显回落；资源品价格经历的长周期的下跌

后，2017 年出现了大幅上涨，这些都对下游投资产生了明显的抑制；另外，2017 年全年人民币经历一轮较大幅度的升值，这对于 2018 年全年的出口势必构成不利影响。其次，国外方面，以美国为代表的发达经济体已经率先进入加息周期，资金在全球的流动方向也不利于中国经济的进一步扩张速度我们也看到特朗普政府一直在寻求中美贸易新的平衡点。

综上所述，我们认为 2018 年一季度由于较好的财务报表、阶段性宽松的货币环境都有利于市场表现，特别是周期股的表现。进入二季度后，市场需要观察经济增长的持续性，同时需要关注是否会出现流动性拐点。我们从中央经济工作会议提出的今年三大任务——防范和化解金融风险、扶贫攻坚、蓝天保卫战几方面可以看出今年市场难以存在全面性机会，特别是在通胀预期升温、流动性可能出现拐点的大环境下。同时，我们也看到中国经济从高速增长向高质量增长过度的决心和态度非常坚决，而且已经取得前一半的胜利，我们也应对潜在的机会予以足够的重视，例如以 5G 为代表的新一代通信服务、以半导体为代表的先进制造、以新能源汽车为代表的新型消费增长点。

本基金将一如既往根据基金合同，选取适合产品风格的优质企业。

#### 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及合规管理有效性评估，确保风险控制及合规管理的有效性，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、政策法规规定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。根据证监会发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》，在 2017 年 10 月后加强了对旗下公募基金的流动性管控。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，对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进行预警监控。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、针对基金投资运作通过日常监察与专项稽核相结合，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，通过查漏补缺、及时整改强化了风险控制流程，提高了投资管理及运营相关人员的风险意识水平，从而较好地预防风险，维护基金持有人利益。

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，本年度公司购买了手机保管箱，在保管箱上方安装了探头，对基金经理、交易人员在交易时间的移动电话、掌上电脑等移动通讯工具实行集中管理，规范了手机上交异常记录表，不定期抽查；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：

张敬燕女士，硕士。2017 年加入泰信基金管理有限公司，现任公司风险管理部副总监。

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，泰信优势增长混合基金、泰信智选成长混合基金经理。

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

2、本基金基金经理不参与本基金估值。

3、参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、基金合同关于利润分配的约定：

1、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、本报告期本基金未进行利润分配。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 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

本报告期内本基金未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。



## § 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遵规守信、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 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(2018)第 21807 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	泰信中小盘精选混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了泰信中小盘精选混合型证券投资基金以下简称(“泰信中小盘精选混合基金”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 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。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附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券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了泰信中小盘精选混合基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于泰信中小盘精选混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>泰信中小盘精选混合基金的基金管理人泰信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估泰信中小盘精选混</p>

	<p>合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算泰信中小盘精选混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督泰信中小盘精选混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对泰信中小盘精选混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致泰信中小盘精选混合基金不能持续经营。</p>

	<p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露), 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
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)	
注册会计师的姓名	许康玮	周祎
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	2018 年 3 月 29 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	11,274,384.05	14,267,257.27
结算备付金		66,579.49	706,823.75
存出保证金		33,501.46	159,911.35
交易性金融资产	7.4.7.2	52,372,070.00	59,238,226.12
其中：股票投资		52,372,070.00	59,238,226.12
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	7,000,000.00	20,000,000.00
应收证券清算款		345,223.72	-
应收利息	7.4.7.5	2,573.25	2,633.68
应收股利		-	-
应收申购款		1,305.97	399.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		71,095,637.94	94,375,251.57
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 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		6,907,478.82	7,853,152.74
应付赎回款		9,214.42	4,233.69
应付管理人报酬		82,138.16	132,033.54
应付托管费		13,689.68	22,005.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	87,650.10	424,103.79
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	340,034.73	387,015.33
负债合计		7,440,205.91	8,822,544.70
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	39,603,714.08	48,720,439.55
未分配利润	7.4.7.10	24,051,717.95	36,832,267.32
所有者权益合计		63,655,432.03	85,552,706.87
负债和所有者权益总计		71,095,637.94	94,375,251.57

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.607 元，基金份额总额 39,603,714.08 份。

## 7.2 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-4,142,528.33	-40,668,646.71
1. 利息收入		226,472.18	407,324.52
其中：存款利息收入	7.4.7.11	134,762.47	372,400.32
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		91,709.71	34,924.20
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,565,971.55	-9,892,938.88
其中：股票投资收益	7.4.7.12	944,144.51	-10,491,184.82
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	7.4.7.13.1	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	621,827.04	598,245.94
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-5,952,014.43	-31,448,598.91
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	17,042.37	265,566.56
<b>减：二、费用</b>		3,118,379.81	9,170,600.10
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,248,622.23	3,248,165.06
2. 托管费	7.4.10.2.2	208,103.74	541,360.90
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	7.4.7.19	1,291,985.78	4,960,198.41
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	369,668.06	420,875.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,260,908.14	-49,839,246.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,260,908.14	-49,839,246.81

### 7.3 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	48,720,439.55	36,832,267.32	85,552,706.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,260,908.14	-7,260,908.14
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）	-9,116,725.47	-5,519,641.23	-14,636,366.70
其中：1. 基金申购款	7,839,583.03	6,758,824.07	14,598,407.10
2. 基金赎回款	-16,956,308.50	-12,278,465.30	-29,234,773.80
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）	39,603,714.08	24,051,717.95	63,655,432.03
项目	上年度可比期间 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）	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）	-	-49,839,246.81	-49,839,246.81
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）	-108,291,221.11	-94,680,786.05	-202,972,007.16
其中：1. 基金申购款	57,825,540.91	45,239,647.99	103,065,188.90
2. 基金赎回款	-166,116,762.02	-139,920,434.04	-306,037,196.06
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）	48,720,439.55	36,832,267.32	85,552,706.87

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

泰信中小盘精选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 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项股票(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： $80\% \times \text{中证 700 指数收益率} + 20\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

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 2018 年 3 月 29 日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 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、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下

由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 分部报告**

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，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[2017]13号《中国证监会关于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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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、债券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、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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，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	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
活期存款	11,274,384.05	14,267,257.27
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	11,274,384.05	14,267,257.27

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	54,055,464.27	52,372,070.00	-1,683,394.27

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	54,055,464.27	52,372,070.00	-1,683,394.27
项目	上年度末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	54,969,605.96	59,238,226.12	4,268,620.16
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	54,969,605.96	59,238,226.12	4,268,620.16

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末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

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	7,000,000.00	-
合计	7,000,000.00	-
项目	上年度末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	20,000,000.00	-
合计	20,000,000.00	-

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	2,528.25	1,937.42
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	30.00	318.00
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	306.25
应收申购款利息	-	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	15.00	72.00
合计	2,573.25	2,633.68

**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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	87,650.10	424,103.79
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	87,650.10	424,103.79

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	34.73	15.33
预提费用	340,000.00	387,000.00
合计	340,034.73	387,015.33



**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,720,439.55	48,720,439.55
本期申购	7,839,583.03	7,839,583.03
本期赎回（以“-”号填列）	-16,956,308.50	-16,956,308.50
- 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	39,603,714.08	39,603,714.08

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

**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	41,761,603.47	-4,929,336.15	36,832,267.32
本期利润	-1,308,893.71	-5,952,014.43	-7,260,908.14
本期基金份额交易产生的变动数	-7,845,233.05	2,325,591.82	-5,519,641.23
其中：基金申购款	7,340,280.10	-581,456.03	6,758,824.07
基金赎回款	-15,185,513.15	2,907,047.85	-12,278,465.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,607,476.71	-8,555,758.76	24,051,717.95

**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
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
活期存款利息收入	121,886.61	340,510.45
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	11,781.36	25,551.68
其他	1,094.50	6,338.19

合计	134,762.47	372,400.32
----	------------	------------

#### 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 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年12月31日
卖出股票成交总额	438,461,604.94	1,706,799,561.17
减：卖出股票成本总额	437,517,460.43	1,717,290,745.99
买卖股票差价收入	944,144.51	-10,491,184.82

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本报告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 衍生工具收益

本报告期及上年度可比期间本基金无衍生工具投资收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
股票投资产生的股利收益	621,827.04	598,245.94
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	621,827.04	598,245.94

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
1. 交易性金融资产	-5,952,014.43	-31,448,598.91
——股票投资	-5,952,014.43	-31,448,598.91

——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	-5,952,014.43	-31,448,598.91

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
基金赎回费收入	16,818.69	176,291.83
转出基金补偿费	223.68	89,274.73
合计	17,042.37	265,566.56

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

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	1,291,985.78	4,960,198.41
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,291,985.78	4,960,198.41

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
审计费用	60,000.00	67,000.00
信息披露费	280,000.00	320,000.00
帐户维护费	18,200.00	13,500.00
银行划款手续费	11,468.06	20,175.73

其他	-	200.00
-	-	-
合计	369,668.06	420,875.73

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
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
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
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,248,622.23	3,248,165.06
其中：支付销售机构的客户维护费	123,412.51	105,480.88

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 1.50% 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： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}$ 。

#### 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
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	208,103.74	541,360.90

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： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$ 。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期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的债券(含回购)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

本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末	上年度末
	2017年12月31日	2016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	69.4700%	27,512,090.56	56.4700%

#### 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 2017年1月1日至2017年12月31 日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
中国银行	11,274,384.05	121,886.61	14,267,257.27	340,510.45

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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2017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
000401	冀东 水泥	2017 年11 月21 日	重大 事项	13.79	2018年 1月15 日	15.17	150,000	2,069,697.00	2,068,500.00	-

注：本基金截至2017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

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 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。

#### 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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 2017 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2016 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。

于 2017 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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%。本基金与由本



基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 3.25%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2017 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 68,577,954.05，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### **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、买入返售金融资产等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	11,274,384.05	-	-	-	11,274,384.05
结算备付金	66,579.49	-	-	-	66,579.49
存出保证金	33,501.46	-	-	-	33,501.46
交易性金融资产	-	-	-	52,372,070.00	52,372,070.00
买入返售金融资产	7,000,000.00	-	-	-	7,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	345,223.72	345,223.72
应收利息	-	-	-	2,573.25	2,573.25
应收申购款	-	-	-	1,305.97	1,305.97
资产总计	18,374,465.00	-	-	52,721,172.94	71,095,637.94
负债					
应付证券清算款	-	-	-	6,907,478.82	6,907,478.82
应付赎回款	-	-	-	9,214.42	9,214.42
应付管理人报酬	-	-	-	82,138.16	82,138.16
应付托管费	-	-	-	13,689.68	13,689.68
应付交易费用	-	-	-	87,650.10	87,650.10
其他负债	-	-	-	340,034.73	340,034.73
负债总计	-	-	-	7,440,205.91	7,440,205.91
利率敏感度缺口	18,374,465.00	-	-	-45,280,967.03	63,655,432.03
上年度末 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	14,267,257.27	-	-	-	14,267,257.27
结算备付金	706,823.75	-	-	-	706,823.75
存出保证金	159,911.35	-	-	-	159,911.35
交易性金融资产	-	-	-	59,238,226.12	59,238,226.12

买入返售金融资产	20,000,000.00	-	-	-	20,000,000.00
应收利息	-	-	-	2,633.68	2,633.68
应收申购款	-	-	-	399.40	399.40
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	35,133,992.37	-	-	59,241,259.20	94,375,251.57
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	7,853,152.74	7,853,152.74
应付赎回款	-	-	-	4,233.69	4,233.69
应付管理人报酬	-	-	-	132,033.54	132,033.54
应付托管费	-	-	-	22,005.61	22,005.61
应付交易费用	-	-	-	424,103.79	424,103.79
其他负债	-	-	-	387,015.33	387,015.33
负债总计	-	-	-	8,822,544.70	8,822,544.70
利率敏感度缺口	35,133,992.37	-	-	-50,418,714.50	85,552,706.87

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 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2016 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(2016 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。本基金主要投资于交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，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%，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%，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 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 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	52,372,070.00	82.27	59,238,226.12	69.24
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	52,372,070.00	82.27	59,238,226.12	69.24

#### 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(附注 7.4.1)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(2017年12月31日)	上年度末(2016年12月31日)
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	4,026,732.55	4,769,207.22
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-4,026,732.55	-4,769,207.22	

#### 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

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。

(a) 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 2017 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 50,303,570.00 元，属于第二层次的余额为 2,068,500.00 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 47,742,587.40 元，第二层次 11,495,638.72 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 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(2016 年 12 月 31 日：同)。

(c) 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适

用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况和 2017 年度经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，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	52,372,070.00	73.66
	其中：股票	52,372,070.00	73.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	7,000,000.00	9.85
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,340,963.54	15.95
8	其他各项资产	382,604.40	0.54
9	合计	71,095,637.94	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,673,000.00	2.63
B	采矿业	-	-
C	制造业	29,081,270.00	45.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,799,000.00	2.83
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,898,300.00	9.27
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	2,333,500.00	3.67
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,741,200.00	7.45
L	租赁和商务服务业	425,400.00	0.67

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,555,400.00	5.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,865,000.00	4.50
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	52,372,070.00	82.27

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有港股通股票。

### 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

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	000417	合肥百货	470,000	3,792,900.00	5.96
2	600340	华夏幸福	80,000	2,511,200.00	3.94
3	002285	世联行	200,000	2,230,000.00	3.50
4	002640	跨境通	110,000	2,105,400.00	3.31
5	000401	冀东水泥	150,000	2,068,500.00	3.25
6	600216	浙江医药	150,000	2,016,000.00	3.17
7	600031	三一重工	220,000	1,995,400.00	3.13
8	601766	中国中车	163,000	1,973,930.00	3.10
9	600835	上海机电	76,000	1,862,000.00	2.93
10	000425	徐工机械	400,000	1,852,000.00	2.91
11	002709	天赐材料	40,000	1,839,600.00	2.89
12	000800	一汽轿车	170,000	1,829,200.00	2.87
13	002573	清新环境	80,000	1,818,400.00	2.86
14	600008	首创股份	350,000	1,799,000.00	2.83
15	300244	迪安诊断	75,000	1,771,500.00	2.78
16	600038	中直股份	38,000	1,768,140.00	2.78
17	600760	中航黑豹	50,000	1,744,500.00	2.74
18	600990	四创电子	30,000	1,742,700.00	2.74
19	300070	碧水源	100,000	1,737,000.00	2.73
20	300498	温氏股份	70,000	1,673,000.00	2.63
21	002371	北方华创	40,000	1,657,600.00	2.60



22	002511	中顺洁柔	100,000	1,628,000.00	2.56
23	300075	数字政通	100,000	1,618,000.00	2.54
24	300061	康旗股份	100,000	1,588,000.00	2.49
25	000100	TCL 集团	400,000	1,560,000.00	2.45
26	002044	美年健康	50,000	1,093,500.00	1.72
27	600584	长电科技	50,000	1,066,500.00	1.68
28	300229	拓尔思	50,000	715,500.00	1.12
29	002156	通富微电	50,000	661,000.00	1.04
30	002769	普路通	30,000	425,400.00	0.67
31	300054	鼎龙股份	20,000	228,200.00	0.36

## 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	000066	中国长城	7,357,309.15	8.60
2	600038	中直股份	6,494,067.10	7.59
3	600048	保利地产	6,423,484.00	7.51
4	002573	清新环境	6,349,570.65	7.42
5	601766	中国中车	5,981,616.76	6.99
6	600029	南方航空	5,456,967.00	6.38
7	002108	沧州明珠	5,196,224.00	6.07
8	603019	中科曙光	5,063,391.00	5.92
9	600893	航发动力	4,999,111.00	5.84
10	601336	新华保险	4,947,599.00	5.78
11	600782	新钢股份	4,672,640.00	5.46
12	601992	金隅股份	4,619,127.00	5.40
13	000401	冀东水泥	4,569,747.00	5.34
14	300471	厚普股份	4,520,908.90	5.28
15	600266	北京城建	4,480,531.00	5.24
16	600507	方大特钢	4,463,535.00	5.22
17	600990	四创电子	4,409,882.79	5.15
18	002418	康盛股份	4,377,397.00	5.12
19	002146	荣盛发展	4,306,461.00	5.03

20	601318	中国平安	4,268,500.70	4.99
21	601211	国泰君安	4,193,788.80	4.90
22	000417	合肥百货	4,111,561.94	4.81
23	000100	TCL 集团	3,989,900.00	4.66
24	600718	东软集团	3,940,211.00	4.61
25	600028	中国石化	3,898,019.30	4.56
26	600760	中航黑豹	3,316,990.00	3.88
27	600536	中国软件	2,784,684.00	3.25
28	000768	中航飞机	2,749,975.60	3.21
29	600115	东方航空	2,735,795.00	3.20
30	002368	太极股份	2,731,947.88	3.19
31	300352	北信源	2,725,845.30	3.19
32	002268	卫士通	2,678,143.51	3.13
33	300248	新开普	2,668,174.00	3.12
34	300244	迪安诊断	2,660,826.00	3.11
35	002519	银河电子	2,659,727.18	3.11
36	300369	绿盟科技	2,634,238.20	3.08
37	600584	长电科技	2,607,995.00	3.05
38	600640	号百控股	2,596,324.00	3.03
39	000826	启迪桑德	2,587,475.00	3.02
40	601618	中国中冶	2,581,000.00	3.02
41	000669	金鸿控股	2,580,810.00	3.02
42	601390	中国中铁	2,556,800.00	2.99
43	300444	双杰电气	2,550,295.00	2.98
44	601186	中国铁建	2,540,000.00	2.97
45	601628	中国人寿	2,505,900.00	2.93
46	600756	浪潮软件	2,499,094.00	2.92
47	000656	金科股份	2,497,803.00	2.92
48	600489	中金黄金	2,492,921.28	2.91
49	002074	国轩高科	2,487,501.00	2.91
50	601600	中国铝业	2,484,019.00	2.90
51	600466	蓝光发展	2,479,757.00	2.90
52	000547	航天发展	2,474,652.20	2.89
53	000002	万科 A	2,471,732.00	2.89
54	600528	中铁工业	2,468,715.00	2.89
55	002285	世联行	2,465,743.00	2.88

56	002673	西部证券	2,464,650.00	2.88
57	600998	九州通	2,463,590.00	2.88
58	600153	建发股份	2,463,145.85	2.88
59	000783	长江证券	2,445,640.00	2.86
60	600827	百联股份	2,444,203.00	2.86
61	600116	三峡水利	2,432,997.00	2.84
62	600383	金地集团	2,430,000.00	2.84
63	000800	一汽轿车	2,428,076.00	2.84
64	000671	阳光城	2,425,523.14	2.84
65	000792	盐湖股份	2,421,883.00	2.83
66	002310	东方园林	2,420,704.00	2.83
67	600219	南山铝业	2,413,339.00	2.82
68	600008	首创股份	2,410,799.56	2.82
69	002648	卫星石化	2,406,900.00	2.81
70	002223	鱼跃医疗	2,398,878.00	2.80
71	600547	山东黄金	2,392,030.00	2.80
72	300336	新文化	2,383,970.00	2.79
73	002159	三特索道	2,381,377.00	2.78
74	600808	马钢股份	2,381,158.00	2.78
75	600348	阳泉煤业	2,377,763.49	2.78
76	600958	东方证券	2,373,000.00	2.77
77	600495	晋西车轴	2,366,403.20	2.77
78	000786	北新建材	2,365,364.00	2.76
79	600326	西藏天路	2,364,473.50	2.76
80	000732	泰禾集团	2,358,525.42	2.76
81	300340	科恒股份	2,357,270.00	2.76
82	000581	威孚高科	2,356,792.00	2.75
83	000776	广发证券	2,338,250.00	2.73
84	300061	康旗股份	2,336,173.20	2.73
85	002332	仙琚制药	2,319,971.11	2.71
86	002640	跨境通	2,318,506.00	2.71
87	000597	东北制药	2,315,163.00	2.71
88	600681	百川能源	2,313,845.00	2.70
89	001979	招商蛇口	2,311,523.00	2.70
90	002041	登海种业	2,307,338.00	2.70
91	601166	兴业银行	2,307,237.77	2.70

92	000822	山东海化	2,303,379.64	2.69
93	600482	中国动力	2,301,104.73	2.69
94	601058	赛轮金宇	2,287,578.72	2.67
95	300570	太辰光	2,278,681.36	2.66
96	601111	中国国航	2,263,893.00	2.65
97	600837	海通证券	2,238,449.00	2.62
98	300228	富瑞特装	2,236,247.00	2.61
99	603993	洛阳钼业	2,235,000.00	2.61
100	601952	苏垦农发	2,224,806.00	2.60
101	300070	碧水源	2,219,333.00	2.59
102	300055	万邦达	2,216,859.74	2.59
103	603589	口子窖	2,215,098.00	2.59
104	600802	福建水泥	2,207,590.00	2.58
105	600141	兴发集团	2,206,629.00	2.58
106	601669	中国电建	2,201,396.00	2.57
107	000001	平安银行	2,197,037.65	2.57
108	000951	中国重汽	2,194,008.00	2.56
109	000933	神火股份	2,188,074.00	2.56
110	601155	新城控股	2,186,676.00	2.56
111	600340	华夏幸福	2,178,580.00	2.55
112	600068	葛洲坝	2,178,128.18	2.55
113	600259	广晟有色	2,171,801.00	2.54
114	600316	洪都航空	2,166,182.12	2.53
115	002247	帝龙文化	2,164,217.00	2.53
116	600491	龙元建设	2,161,489.50	2.53
117	002244	滨江集团	2,158,200.00	2.52
118	000923	河北宣工	2,136,187.00	2.50
119	600549	厦门钨业	2,133,654.00	2.49
120	600155	宝硕股份	2,120,765.03	2.48
121	300059	东方财富	2,115,037.36	2.47
122	600809	山西汾酒	2,113,555.76	2.47
123	601998	中信银行	2,111,737.00	2.47
124	601601	中国太保	2,106,502.94	2.46
125	300374	恒通科技	2,105,945.00	2.46
126	601225	陕西煤业	2,100,000.00	2.45
127	000166	申万宏源	2,099,188.00	2.45

128	603616	韩建河山	2,089,832.00	2.44
129	002850	科达利	2,081,595.00	2.43
130	002174	游族网络	2,074,047.36	2.42
131	000733	振华科技	2,071,480.00	2.42
132	600392	盛和资源	2,067,161.00	2.42
133	002064	华峰氨纶	2,059,393.51	2.41
134	300275	梅安森	2,057,027.00	2.40
135	600015	华夏银行	2,056,792.00	2.40
136	002439	启明星辰	2,048,280.00	2.39
137	600030	中信证券	2,047,736.00	2.39
138	601009	南京银行	2,044,000.00	2.39
139	601555	东吴证券	2,005,514.00	2.34
140	002457	青龙管业	1,999,500.00	2.34
141	600835	上海机电	1,982,531.00	2.32
142	600855	航天长峰	1,965,887.06	2.30
143	601881	中国银河	1,965,837.20	2.30
144	601198	东兴证券	1,962,584.00	2.29
145	300075	数字政通	1,950,627.00	2.28
146	600216	浙江医药	1,921,306.00	2.25
147	600031	三一重工	1,908,400.00	2.23
148	601229	上海银行	1,897,000.00	2.22
149	600977	中国电影	1,870,676.00	2.19
150	600197	伊力特	1,854,352.00	2.17
151	002709	天赐材料	1,848,452.00	2.16
152	002823	凯中精密	1,844,232.50	2.16
153	601699	潞安环能	1,843,950.00	2.16
154	000425	徐工机械	1,804,000.00	2.11
155	300083	劲胜智能	1,783,026.00	2.08
156	600596	新安股份	1,779,039.00	2.08
157	600874	创业环保	1,778,424.00	2.08

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000547	航天发展	11,550,014.26	13.50
2	000066	中国长城	10,209,440.14	11.93
3	002383	合众思壮	9,107,973.60	10.65
4	600596	新安股份	7,877,270.00	9.21
5	600048	保利地产	6,953,139.51	8.13
6	600028	中国石化	6,767,800.00	7.91
7	600782	新钢股份	5,686,873.00	6.65
8	600029	南方航空	5,396,997.52	6.31
9	002108	沧州明珠	5,174,273.60	6.05
10	002146	荣盛发展	4,984,560.19	5.83
11	300097	智云股份	4,946,997.76	5.78
12	601336	新华保险	4,905,425.52	5.73
13	002573	清新环境	4,897,754.04	5.72
14	600990	四创电子	4,844,526.69	5.66
15	600507	方大特钢	4,839,667.02	5.66
16	603019	中科曙光	4,792,030.00	5.60
17	600893	航发动力	4,699,800.30	5.49
18	600038	中直股份	4,565,662.05	5.34
19	600266	北京城建	4,514,237.59	5.28
20	601318	中国平安	4,437,341.40	5.19
21	601211	国泰君安	4,170,937.65	4.88
22	300471	厚普股份	4,048,300.00	4.73
23	601766	中国中车	4,016,197.02	4.69
24	002418	康盛股份	3,946,898.00	4.61
25	600718	东软集团	3,825,913.00	4.47
26	600759	洲际油气	3,748,957.00	4.38
27	300164	通源石油	3,670,719.00	4.29
28	601992	金隅股份	3,651,453.00	4.27
29	000792	盐湖股份	3,408,092.58	3.98
30	600803	新奥股份	3,357,408.00	3.92
31	002353	杰瑞股份	3,155,325.00	3.69
32	600571	信雅达	3,035,313.00	3.55
33	000933	神火股份	2,930,581.07	3.43
34	600392	盛和资源	2,926,266.00	3.42
35	000002	万科 A	2,890,587.00	3.38
36	600115	东方航空	2,813,666.69	3.29

37	002829	星网宇达	2,763,784.56	3.23
38	600116	三峡水利	2,708,312.00	3.17
39	000951	中国重汽	2,695,561.00	3.15
40	000768	中航飞机	2,658,613.96	3.11
41	600640	号百控股	2,607,814.00	3.05
42	002368	太极股份	2,600,982.10	3.04
43	601186	中国铁建	2,592,670.00	3.03
44	002519	银河电子	2,590,031.96	3.03
45	600549	厦门钨业	2,579,501.00	3.02
46	600808	马钢股份	2,565,003.00	3.00
47	000783	长江证券	2,515,000.00	2.94
48	000776	广发证券	2,513,410.00	2.94
49	601600	中国铝业	2,512,000.00	2.94
50	600153	建发股份	2,500,207.55	2.92
51	600326	西藏天路	2,495,855.00	2.92
52	601618	中国中冶	2,494,412.00	2.92
53	601628	中国人寿	2,491,194.00	2.91
54	000581	威孚高科	2,490,010.00	2.91
55	000923	河北宣工	2,487,396.53	2.91
56	601390	中国中铁	2,462,492.00	2.88
57	601669	中国电建	2,445,417.62	2.86
58	000401	冀东水泥	2,431,575.00	2.84
59	600528	中铁工业	2,427,786.00	2.84
60	000822	山东海化	2,425,514.00	2.84
61	600219	南山铝业	2,422,000.00	2.83
62	002310	东方园林	2,419,678.00	2.83
63	600827	百联股份	2,418,567.00	2.83
64	600998	九州通	2,417,940.00	2.83
65	300444	双杰电气	2,411,690.40	2.82
66	000786	北新建材	2,405,695.00	2.81
67	600348	阳泉煤业	2,403,412.00	2.81
68	002673	西部证券	2,387,086.48	2.79
69	000671	阳光城	2,383,343.32	2.79
70	600495	晋西车轴	2,369,139.00	2.77
71	300352	北信源	2,365,536.00	2.77
72	601881	中国银河	2,347,994.00	2.74
73	000656	金科股份	2,345,638.00	2.74
74	000669	金鸿控股	2,337,995.00	2.73

75	600958	东方证券	2,329,219.24	2.72
76	601601	中国太保	2,328,983.07	2.72
77	000826	启迪桑德	2,313,829.00	2.70
78	300275	梅安森	2,311,763.00	2.70
79	002439	启明星辰	2,309,317.00	2.70
80	601166	兴业银行	2,287,896.00	2.67
81	002159	三特索道	2,283,919.15	2.67
82	601111	中国国航	2,283,315.60	2.67
83	600383	金地集团	2,279,773.00	2.66
84	002648	卫星石化	2,279,385.72	2.66
85	000001	平安银行	2,278,000.00	2.66
86	600756	浪潮软件	2,275,648.00	2.66
87	002174	游族网络	2,272,675.36	2.66
88	001979	招商蛇口	2,268,963.20	2.65
89	300059	东方财富	2,266,500.00	2.65
90	300336	新文化	2,266,232.00	2.65
91	601155	新城控股	2,261,222.00	2.64
92	002332	仙琚制药	2,259,489.50	2.64
93	002041	登海种业	2,252,118.90	2.63
94	601058	赛轮金宇	2,251,249.00	2.63
95	600068	葛洲坝	2,250,916.00	2.63
96	600141	兴发集团	2,246,276.10	2.63
97	000732	泰禾集团	2,245,147.04	2.62
98	300055	万邦达	2,226,575.00	2.60
99	600482	中国动力	2,224,624.40	2.60
100	000100	TCL 集团	2,220,000.00	2.59
101	600837	海通证券	2,207,311.51	2.58
102	600802	福建水泥	2,201,616.00	2.57
103	600155	宝硕股份	2,198,636.50	2.57
104	002244	滨江集团	2,189,467.00	2.56
105	600489	中金黄金	2,174,481.00	2.54
106	600809	山西汾酒	2,145,975.00	2.51
107	000597	东北制药	2,143,206.00	2.51
108	002074	国轩高科	2,120,056.45	2.48
109	000166	申万宏源	2,117,500.00	2.48
110	600681	百川能源	2,110,834.01	2.47
111	601952	苏垦农发	2,101,307.00	2.46
112	600197	伊力特	2,087,321.00	2.44



113	603589	口子窖	2,085,007.00	2.44
114	300248	新开普	2,069,827.76	2.42
115	600536	中国软件	2,049,515.00	2.40
116	600466	蓝光发展	2,045,000.00	2.39
117	000733	振华科技	2,042,187.00	2.39
118	600584	长电科技	2,041,569.00	2.39
119	601555	东吴证券	2,036,713.00	2.38
120	601225	陕西煤业	2,030,000.00	2.37
121	002223	鱼跃医疗	2,020,492.00	2.36
122	601198	东兴证券	2,016,844.00	2.36
123	601009	南京银行	2,011,000.00	2.35
124	600259	广晟有色	2,008,000.00	2.35
125	600030	中信证券	2,007,455.91	2.35
126	600491	龙元建设	2,006,109.67	2.34
127	600316	洪都航空	1,990,166.00	2.33
128	300570	太辰光	1,984,784.60	2.32
129	002064	华峰氨纶	1,962,000.00	2.29
130	600015	华夏银行	1,948,000.00	2.28
131	002268	卫士通	1,944,617.30	2.27
132	300369	绿盟科技	1,939,252.46	2.27
133	300340	科恒股份	1,904,910.00	2.23
134	002823	凯中精密	1,895,093.00	2.22
135	601998	中信银行	1,893,073.47	2.21
136	603993	洛阳钼业	1,890,805.00	2.21
137	601699	潞安环能	1,884,200.00	2.20
138	600547	山东黄金	1,873,683.23	2.19
139	002850	科达利	1,848,073.00	2.16
140	002247	帝龙文化	1,840,619.00	2.15
141	600977	中国电影	1,809,978.00	2.12
142	300228	富瑞特装	1,803,536.00	2.11
143	600760	中航黑豹	1,770,000.00	2.07
144	601229	上海银行	1,747,156.20	2.04
145	600855	航天长峰	1,730,722.00	2.02
146	002457	青龙管业	1,730,265.33	2.02

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	436,603,318.74
卖出股票收入（成交）总额	438,461,604.94

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

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

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	33,501.46
2	应收证券清算款	345,223.72
3	应收股利	-
4	应收利息	2,573.25
5	应收申购款	1,305.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	382,604.40

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000401	冀东水泥	2,068,500.00	3.25	重大事项

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

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
614	64,501.16	31,044,803.71	78.39%	8,558,910.37	21.61%

### 9.2 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	0.0530%

### 9.3 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。

## § 10 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	48,720,439.55
本报告期基金总申购份额	7,839,583.03
减:本报告期基金总赎回份额	16,956,308.50
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	39,603,714.08

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2、2017 年 1 月 23 日起，公司董事总经理葛航先生代理公司董事长职务，王小林先生不再担任公司董事长职务；自 2017 年 7 月 17 日起，万众先生担任泰信基金管理有限公司董事长职务；公司于 2017 年 9 月 22 日发布公告，公司法定代表人变更为万众先生。上述管理人重大人事变动在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站上披露，并报监管机构备案。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

公司与万科企业股份有限公司工会委员会就泰信价值 1 号诉讼一案，深圳市罗湖区人民法院于 2017 年 7 月 10 日作出民事裁定书，准许原告万科企业股份有限公司工会委员会撤回起诉并结案。

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（2011 年 10 月 26 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、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	
西南证券	1	158,153,635.41	18.27%	147,288.34	18.85%	-
东吴证券	2	138,340,221.29	15.98%	126,069.40	16.13%	-
万联证券	1	96,599,691.71	11.16%	89,963.31	11.51%	-
光大证券	1	94,340,836.56	10.90%	87,860.07	11.24%	-
申万宏源	1	92,326,836.49	10.66%	85,983.45	11.00%	-
天风证券	1	84,809,798.01	9.80%	60,325.05	7.72%	-
东方证券	1	68,100,068.53	7.87%	62,059.93	7.94%	-
华金证券	1	60,528,946.20	6.99%	55,160.55	7.06%	-
中信建投	2	24,633,941.59	2.85%	22,808.39	2.92%	-
招商证券	1	18,310,481.54	2.11%	16,686.35	2.14%	-
国金证券	2	15,277,478.75	1.76%	13,922.16	1.78%	-
中银国际	3	9,369,942.11	1.08%	8,726.03	1.12%	-
国泰君安	1	4,962,161.47	0.57%	4,521.98	0.58%	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合证 券	1	-	-	-	-	-
川财证券	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	-	-	-	-	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中国建银投 资证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

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

2、本基金新增交易单元：华金证券（深圳 000481）、中银国际（深圳 037925）、川财证券（深圳 003701）； 退租交易单元：中投证券（上海 392094）。

### 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
西南证券	-	-	90,000,000.00	11.61%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	260,000,000.00	33.55%	-	-
光大证券	-	-	20,000,000.00	2.58%	-	-
申万宏源	-	-	398,000,000.00	51.35%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	7,000,000.00	0.90%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证 券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中国建银投 资证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

### 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	停牌股票估值调整（合众思壮）	《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）	2017年1月14日
2	16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）	2017年1月20日
3	行业高级管理人变更的公告	《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）	2017年1月23日
4	提醒投资者更新过期身份证信息	《中国证券报》、《上	2017年2月22日

		海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	
5	交通银行手机银行费率优惠	《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)	2017年2月23日
6	新增南京苏宁基金销售有限公司为销售机构并开通转换费率优惠业务	《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)	2017年3月3日
7	新增北京懒猫金融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)	2017年3月15日
8	参加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)	2017年3月30日
9	新增上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构	《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)	2017年3月30日
10	16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)	2017年3月30日
11	在广发证券开通转换、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)	2017年4月8日
12	17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)	2017年4月21日

13	交通银行手机银行费率优惠	《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)	2017年4月22日
14	在上海好买基金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)	2017年4月27日
15	调整在伯嘉基金定投最低申购金额并参加费率优惠	《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)	2017年5月12日
16	在中泰证券申购定投费率优惠	《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)	2017年5月23日
17	新增平安银行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)	2017年5月26日
18	参加上海长量基金申购、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)	2017年6月21日
19	参加交通银行手机银行申购、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)	2017年7月1日
20	在蚂蚁基金开通转换费率优惠并调整交易限额	《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)	2017年7月18日
21	17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	2017年7月21日

		(www.ftfund.com)	
22	新增北京肯特瑞财富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)	2017年7月22日
23	在大泰金石开通定投及定投费率优惠	《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)	2017年7月26日
24	华泰证券开通申购及定投费率优惠	《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)	2017年7月28日
25	在上海华夏财富开通申购费率优惠业务	《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)	2017年8月16日
26	17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)	2017年8月26日
27	在中泰证券调整定投下限	《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)	2017年9月4日
28	新增天津万家财富为销售机构并开通转换及费率优惠	《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)	2017年10月13日
29	17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)	2017年10月26日
30	新增中银国际证券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	2017年11月24日

		公 司 网 站 (www.ftfund.com)	
31	上海华信证券开通转换业务并转换费用折扣	《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)	2017 年 12 月 26 日
32	调整在工商银行定投下限并参加费率优惠业务	《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)	2017 年 12 月 27 日
33	对持有流通受限股票估值方法调整的公告	《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)	2017 年 12 月 29 日
34	交通银行手机银行费率优惠	《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)	2017 年 12 月 30 日
35	实施增值税政策的公告	《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)	2017 年 12 月 30 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20171231	27,512,090.56	-	-	27,512,090.56	69.47%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p>							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 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。

### 13.3 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

2018年3月29日