泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金

【2015】年度报告摘要

基金管理人:泰信基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2016年3月30日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2015年10月27日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰信国策驱动混合
基金主代码	001569
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年10月27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	433,601,759.10份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将积极投资于受益于国家政策驱动、符合经济发展方向且具有良好成长性的优质企业,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	我国经济转型的推进与国家政策导向紧密相关,国家政策将有力推动相关经济领域的发展,受益于国家政策的行业和公司将成为先导性力量,在整体经济中占主导地位,其中蕴含的投资机会将主导未来资本市场的走向。 本基金将深入挖掘国家政策驱动、符合经济发展方向且确定性较高的投资机会,同时结合"自上而下"的资产配置策略和"自下而上"的个股精选策略,注重股票资产在其各相关行业的配置,并考虑组合品种的估值风险和大类资产的系统风险,通过品种和仓位的动态调整降低资产波动的风险。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡囡	洪渊
	联系电话	021-20899098	(010)66105799
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-5988	95588
传真		021-20899008	(010)66105798

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ftfund.com
基金年度报告备置地点	中国(上海)自由贸易实验区浦东南路256号华夏银行大厦37层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年10月27日(基金合同生效日)-2015年12月31日
本期已实现收益	-1,396,794.97
本期利润	7,528,066.10
加权平均基金份额本期利润	0.0136
本期基金份额净值增长率	1.50%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0030
期末基金资产净值	440,145,201.17
期末基金份额净值	1.015

注:1、本基金基金合同于2015年10月27日正式生效。

2、所述基金业绩指标不包括持有人申购或交易基金的各项费用,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

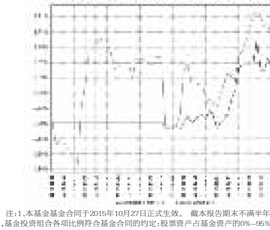
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	1.50%	0.39%	2.75%	0.83%	-1.25%	-0.44%

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%

1、沪深300指数是由中证指数有限公司编制,从上海和深圳证券市场中选取300 只A 股作为样本的综合性指数;样本选择标准为规模大、流动性好的股票,目前沪深300 指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性。

2、上证国债指数样本涵盖了上海证券交易所所有的国债品种,交易所的国债交易市场具有参与主体丰富、竞价交易连续的特性,能反映出市场利率的瞬息变化,也使得上证国债指数能真实地标示出利率市场整体的收益风险度。因此本基金选取的基准具有较好的代表性。

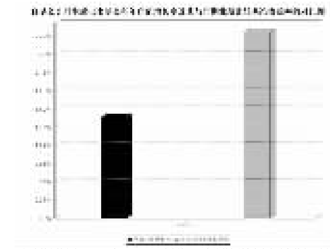
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金基金合同于2015年10月27日正式生效。截止本报告期末不满半年,且仍处于建仓期。

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:股票资产占基金资产的0%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或到期日在一年期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



注:本基金基金合同于2015年10月27日正式生效,2015年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同于2015年10月27日生效。本报告期未进行利润分配。

§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)自由贸易实验区浦东南路256号37层
办公地址:中国(上海)自由贸易实验区浦东南路256号华夏银行大厦36-37层
成立日期:2003 年 5 月23 日
法定代表人:王小林
总经理:葛航
电话:021-20899188
传真:021-20899008
联系人:王斌
发展沿革:

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

公司目前下设上海锐懿资产管理有限公司、市场部、产品部、营销部(分华东、华北、华南三大营销中心)、理财顾问部、深圳分公司、北京分公司、电子商务部、客服中心、基金投资部、研究部、专户投资部、清算会计部、集中交易部、计划财务部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部。截至2015年12月底,公司有正式员工108人,多数具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

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

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
车广路先生	本基金经理兼泰信蓝筹精选、发展主题混合基金经理	2015年10月27日	-	8年	工商管理学硕士。具有基金从业资格。2007年6月进入泰信基金管理有限公司,历任研究部研究员、高级研究员、泰信蓝筹精选基金经理助理。自2012年3月1日至2014年6月21日担任泰信蓝筹精选基金经理;自2014年6月21日开始担任泰信发展主题基金经理;自2015年2月5日开始担任泰信蓝筹精选基金经理。

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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为,本基金的投资运作符合有关法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侯方式处理。

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日反向交易,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开开放,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,公司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

本基金在10月27日成立之后的一个月内,主要进行了融券回购交易。从12月初开始正式建仓,主要增持了2016年业绩增长确定性强的板块和个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金单位净值为1.015元,净值增长率为1.50%,同期业绩比较基准收益率为2.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为,2016年的A股市场将呈现出大分化、大波动的走势。一方面宏观经济基本面很难在短期内得到改善,流动性对市场的边际改善下降,人民币汇率波动的影响,以及注册制带来的供给增加等不利因素的压制,A股市场很难出现像过去一年多那样的整体性机会。但改革的快速推进以及红利的释放,转型带来的劳动生产力的提高,人口结构变化带来的消费行为的变化,以及新技术新业态的出现都会为市场创造一些结构性的机会。我们将去寻找能享受改革和转型红利,受益于新消费习惯,或者受益于新技术新业态出现的公司。另一方面由于新消费、新业态、新技术,受益于转型的公司虽然增长较快,但对应阶段的估值都相对较高。加上我们预计今年主题投资业会是市场的重点,而主题投资重点考虑的是弹性而非估值。因此当市场一段出现下跌,波动将非常剧烈。

2016年,我们看好以下几个投资方向:一,新技术,新业态的出现带来的机会。这种机会可能更多的出现在电子、计算机、医药、商贸等领域;二,由于社会发展、人口结构与变化,以及自身发展所处阶段,在总体经济下滑的大环境下仍然能保持高速增长的行业,比如教育、旅游、传媒、养老、体育等行业。三,改革未来最可能为经济增长提供新的动力,与改革相关的行业和个股值得关注,包括国企改革带来的机会,以及军队改革带来的军工行业和民参军行业的机会。四,受益于产业转型升级的行业,我们看好,智能制造、节能环保等行业。

在个股的选择方面,我们将综合利用公司的股票价值评估系统和尽职调研评估系统,结合定量分析和定性分析,精选出技术、管理、资源和政策四个方面具有优势,成长具有持续性的公司进行投资。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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工作流程,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,防范交易环节中的风险。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,对其他非投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,本基金的投资运作等各环节基本符合规定的要求,未出现异常交易、操纵市场、内幕交易等违法违规现象。今后公司将继续夯实内部控制和风险管理工作,保证基金运作的合规性,充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、泰信基金管理有限公司估值程序等事项的说明

委员会主席

韩波先生,本科学历。2002年加入泰信基金管理公司,现任公司副总经理。

委员会成员:

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

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

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

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

2、本基金基金经理不参与本基金估值。

3、参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、基金合同关于利润分配的约定

1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为6次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

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

4、每一基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

二、本报告期本基金未进行利润分配。

§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国策驱动灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对泰信基金管理有限公司编制和披露的泰信国策驱动混合型证券投资基金2015年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第20853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	泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人:	
引言段	我们审计了后附的泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"泰信国策驱动灵活配置混合基金")的财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表、2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是泰信国策驱动灵活配置混合基金的基金管理人泰信基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映; (2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为,上述泰信国策驱动灵活配置混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了泰信国策驱动灵活配置混合基金2015年12月31日的财务状况以及2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	单峰	周祎
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6楼	
审计报告日期	2016年3月25日	

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年12月31日
资 产:	
银行存款	182,992,091.35
结算备付金	46,358,510.12
存出保证金	3,311.86
交易性金融资产	193,945,813.77
其中:股票投资	193,945,813.77
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	19,100,942.56
应收利息	58,927.29
应收股利	-
应收申购款	1,125.29
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	442,460,722.24
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日
负 债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	1,138,905.00
应付管理人报酬	611,806.24
应付托管费	101,967.69
应付销售服务费	-
应付交易费用	331,028.74
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	131,813.40
负债合计	2,315,521.07
所有者权益:	
实收基金	433,601,759.10
未分配利润	6,543,442.07
所有者权益合计	440,145,201.17
负债和所有者权益总计	442,460,722.24

注:1、报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.015元,基金份额总额433,601,759.10份。

2、本财务报表的实际编制期间为2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期 2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入	9,840,010.29
1.利息收入	1,218,114.57
其中:存款利息收入	292,581.64
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	925,532.93
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-1,057,766.30
其中:股票投资收益	-1,057,766.30
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	8,924,861.07
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	754,800.95
减:二、费用	2,311,944.19
1. 管理人报酬	1,483,723.39
2. 托管费	247,287.23
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	450,042.57
5. 利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	130,891.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	7,528,066.10
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	7,528,066.10

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年10月27日(基金合同生效日)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)	632,964,112.52	-	632,964,112.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	7,528,066.10	7,528,066.10
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)	-199,362,353.42	-984,624.03	-200,346,977.45
其中:1.基金申购款	873,619.75	13,113.92	886,733.67
2.基金赎回款	-200,235,973.17	-997,737.95	-201,233,711.12
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)	433,601,759.10	6,543,442.07	440,145,201.17

注:报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

____葛航____ ____韩波____ ____蔡海成____
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"泰信国策驱动灵活配置混合基金")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[2015]第1290号《关于准予泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由上投摩根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《泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集期间为2015年8月24日至2015年10月23日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集261,016,960.41元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第1195号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年10月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为632,964,112.52份基金份额,其中认购资金利息折合411,556.43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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含可转债、中小企业私募债券)、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的0%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

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

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间。

7.4.4.1记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.2金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

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

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

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

(2)金融负债的分类

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

7.4.4.3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。

7.4.4.4金融资产和金融负债的估值原则

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

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

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

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

7.4.4.5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。

7.4.4.6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。

7.4.4.7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)。

7.4.4.8收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.9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。

7.4.4.10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。

7.4.4.11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。

7.4.4.12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:

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额,自2015年9月8日起,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

7.4.7重要财务报表项目的说明

7.4.7.1银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
活期存款	182,992,091.35
定期存款	-
其中:存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计:	182,992,091.35

7.4.7.2交易性金融资产

单位:人民币元

项目		本期末 2015年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		185,020,952.70	193,945,813.77	8,924,861.07
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		185,020,952.70	193,945,813.77	8,924,861.07

7.4.7.3衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

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

本报告期末本基金未买入返售金融资产。

7.4.7.4.2期末买断式逆回购交易中取得的债券

报告期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 2015年12月31日
应收活期存款利息	38,064.59
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	20,861.30
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	1.40
合计	58,927.29

7.4.7.6其他资产

报告期末本基金未持有其他资产。

7.4.7.7应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	331,028.74
银行间市场应付交易费用	-
合计	331,028.74

7.4.7.8其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,413.40
预提费用	130,400.00
合计	131,813.40

7.4.7.9实收基金

金额单位:人民币元

项目	本期 2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	632,964,112.52	632,964,112.52
本期申购	873,619.75	873,619.75
本期赎回(以"-"号填列)	-200,235,973.17	-200,235,973.17
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	433,601,759.10	433,601,759.10

注:1. 申购含转换入份额;赎回含转换出份额。

2. 本基金自2015年8月24日至2015年10月23日止期间公开发售,共募集有效净认购资金632,552,556.09元。根据《样本证券投资基金基金合同/招募说明书/基金份泰信行业精选混合型证券投资基金》的规定,本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入411,556.43元在本基金成立后,折算为411,556.43份基金份额,划入基金份额持有人账户。

3. 根据《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金于2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年11月25日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务和转换业务自2015年11月26日起开始办理。

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-1,396,794.97	8,924,861.07	7,528,066.10
本期基金份额交易产生的变动数	90,764.89	-1,075,388.92	-984,624.03
其中:基金申购款	-888.42	14,002.34	13,113.92
基金赎回款	91,653.31	-1,089,391.26	-997,737.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,306,030.08	7,849,472.15	6,543,442.07

7.4.7.11存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	218,261.94
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	74,315.47
其他	4.23
合计	292,581.64

7.4.7.12股票投资收益

单位:人民币元

项目	本期 2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出股票成交总额	87,063,749.95
减:卖出股票成本总额	88,121,516.25
买卖股票差价收入	-1,057,766.30

7.4.7.13债券投资收益

报告期末本基金未持有债券。

7.4.7.13.1资产支持证券投资收益

报告期末本基金未持有资产证券投资证券。

7.4.7.14贵金属投资收益

报告期末本基金未投资贵金属。

7.4.7.15衍生工具收益

报告期末本基金无衍生工具收益。

7.4.7.16股利收益

报告期末本基金无股利收益。

7.4.7.17公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日
1.交易性金融资产	8,924,861.07
——股票投资	8,924,861.07
——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	8,924,861.07

7.4.7.18其他收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日
基金赎回费收入	754,689.10
转出基金补偿费	111.85
合计	754,800.95

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

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

7.4.7.19交易费用

单位:人民币元

项目	本期 2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	450,042.57
银行间市场交易费用	-
合计	450,042.57

7.4.7.20其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日
审计费用	50,400.00
信息披露费	80,000.00
其它	400.00
银行划款手续费	91.00
合计	130,891.00

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

截至财务报表批出日,本基金并无须做披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金销售机构
山东省国际信托股份有限公司("山东国托")	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信实业有限公司("青岛国信")	基金管理人的股东

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

2.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 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

报告期末本基金未通过关联方进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

报告期末本基金未通过关联方进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

报告期末本基金未通过关联方进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

报告期末本基金未通过关联方进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

报告期末本基金无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,483,723.39
其中:支付销售机构的客户维护费	462,285.29

注:支付基金管理人泰信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	247,287.23

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

报告期末本基金未发生销售服务费。

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

报告期末本基金未发生与关联方进行银行间同业市场债券交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日
基金合同生效日(2015年10月27日)持有的基金份额	10,001,250.00
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	10,001,250.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.3100%

注:基金管理人泰信基金管理有限公司在本年度认购本基金的交易委托中国银行办理,认购费1000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

关联方名称	本期末 2015年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
山东省国际信托股份有限公司	40,062,000.00	9.2400%

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年10月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	182,992,091.35	218,261.94

注:本基金的活期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

报告期末本基金未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

报告期末无其他关联方交易事项说明。

7.4.11 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

报告期末本基金未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

7.4.11.2 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
300336	新文化	2015年12月23日	重大事项	42.00	-	-	199,992	6,170,237.46	8,399,664.00	-
002011	盾安环境	2015年12月25日	重大事项	16.72	2016年2月22日	15.05	399,923	6,118,323.29	6,686,712.56	-

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

7.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购。

7.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购。

7.4.12 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2015年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为178,859,437.21元,属于第二层次的余额为15,086,376.56元,无属于第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

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	193,945,813.77	43.83
	其中:股票	193,945,813.77	43.83
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	229,350,601.47	51.84
7	其他各项资产	19,164,307.00	4.33
8	合计	442,460,722.24	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	116,731,910.77	26.52
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	12,148,939.00	2.76
J	金融业	-	-
K	房地产业	31,511,200.00	7.16
L	租赁和商务服务业	6,524,100.00	1.48
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,280,000.00	1.20
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	21,749,664.00	4.94
S	综合	-	-
	合计	193,945,813.77	44.06

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

代码	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	300009	安科生物	400,000	17,312,000.00	3.93
2	300364	中文在线	75,000	13,350,000.00	3.03
3	600775	南京熊猫	600,000	11,490,000.00	2.61
4	002466	天齐锂业	80,000	11,260,000.00	2.56
5	002026	山东威达	549,946	9,690,048.52	2.20
6	002345	潮宏基	500,000	8,440,000.00	1.92
7	300336	新文化	199,992	8,399,664.00	1.91
8	000558	莱茵体育	280,000	7,756,000.00	1.76
9	002425	凯撒股份	259,903	7,534,587.97	1.71
10	600266	北京城建	500,000	7,320,000.00	1.66

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300009	安科生物	15,345,298.07	3.49
2	300364	中文在线	14,131,586.00	3.21
3	002466	天齐锂业	12,001,911.50	2.73
4	600775	南京熊猫	10,837,578.67	2.46
5	002279	久其软件	9,555,017.00	2.17
6	002026	山东威达	8,988,013.32	2.04
7	002345	潮宏基	8,138,578.69	1.85
8	600266	北京城建	7,885,650.00	1.79
9	600969	郴电国际	6,804,727.75	1.55
10	600559	老白干酒	6,595,414.00	1.50
11	000558	莱茵体育	6,514,725.18	1.48
12	300083	劲胜精密	6,438,082.51	1.46
13	600158	中体产业	6,419,606.47	1.46
14	002425	凯撒股份	6,310,589.27	1.43
15	300336	新文化	6,170,237.46	1.40
16	002011	盾安环境	6,118,323.29	1.39
17	000831	五矿稀土	5,901,484.00	1.34
18	601888	中国国旅	5,752,075.06	1.31
19	002030	达安基因	5,718,470.56	1.30
20	600590	泰豪科技	5,709,965.00	1.30

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600969	郴电国际	6,151,184.32	1.40
2	600109	国金证券	5,842,978.86	1.33
3	002642	荣之联	5,657,678.00	1.29
4	600900	长江电力	5,499,773.37	1.25
5	601099	太平洋	5,427,465.00	1.23
6	601336	新华保险	5,204,293.88	1.18
7	600038	中直股份	5,170,790.40	1.17
8	000547	航天发展	5,079,985.00	1.15
9	002686	亿利达	5,078,618.00	1.15
10	002030	达安基因	5,036,620.26	1.14
11	002474	榕基软件	4,928,532.00	1.12
12	600701	工大高新	4,710,181.45	1.07
13	300245	天玑科技	4,665,119.30	1.06
14	000060	中金岭南	4,622,032.53	1.05
15	002467	二六三	4,427,687.85	1.01
16	601169	北京银行	4,157,881.73	0.94
17	002279	久其软件	2,729,926.00	0.62
18	002433	太安堂	1,759,394.00	0.40
19	300232	洲明科技	810,401.00	0.18
20	000166	申万宏源	36,360.00	0.01

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	273,142,468.95
卖出股票收入(成交)总额	87,063,749.95

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前十名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

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

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

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

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

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

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	3,311.86
2	应收证券清算款	19,100,942.56
3	应收股利	-
4	应收利息	58,927.29
5	应收申购款	1,125.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,164,307.00

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	300336	新文化	8,399,664.00	1.91	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
4,374	99,131.63	66,082,040.00	15.24%	367,519,719.10	84.76%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	60,491.63	0.0140%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2015年10月27日)基金份额总额	632,964,112.52
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	873,619.75
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	200,235,973.17
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	433,601,759.10

§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

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

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 5.04 万元。该审计机构从基金合同生效日(2015年10月27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	
中国银河证券	1	221,569,732.77	61.51%	201,916.43	61.00%	-
民生证券	1	138,636,486.13	38.49%	129,112.31	39.00%	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	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	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	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、本基金与公司旗下在中国工商银行托管的泰信优势增长基金、泰信发展主题基金、泰信中证400指数分级基金、泰信现代服务业股票基金共用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中国银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	13,050,000,000.00	95.60%	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	600,000,000.00	4.40%	-	-

泰信基金管理有限公司
2016年3月30日