

泰信中证200指数证券投资基金

2018年第三季度报告

| 姓名 | 职务 | 在本基金的基金经理任期 | 从业年限 | 说明 |
|-----|------|-------------|------|--|
| 姜先生 | 基金经理 | 2016年1月6日 | 13年 | 硕士研究生，具有基金从业资格，曾任于国信证券研究所，上海宏源证券研究所研究员，平安资产管理公司，2013年加入泰信基金管理有限公司，历任研究员，自2011年10月至2014年6月在中信建投基金管理部，2012年4月至2015年11月在华夏基金基金管理部，自2015年11月8日起担任泰信中证200指数证券投资基金基金经理。自2017年11月15日起兼任泰信中证500指数证券投资基金基金经理。 |

注:1、以上日期均是公司公告的日期。
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。
3、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，本基金管理人恪守诚信，《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》及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约定。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
根据《证券投资基金法》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《公平交易管理办法》，适用于所有投资组合，以及所有投资管理活动。通过研究、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的全过程，从研究、投资、交易等环节落实，发现可疑交易预警，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期不定期审计。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
本公司严格执行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行为，公平交易制度严格执行并有效。报告期内，未发现异常交易行为。
4.3.3 投资交易流程控制
本公司严格执行《公平交易管理办法》,通过事前控制、事中控制和事后监控,未出现违反公平交易制度的行为,未发现异常交易行为。
4.3.4 投资交易流程控制
本公司严格执行《公平交易管理办法》,通过事前控制、事中控制和事后监控,未出现违反公平交易制度的行为,未发现异常交易行为。
4.3.5 投资交易流程控制
本公司严格执行《公平交易管理办法》,通过事前控制、事中控制和事后监控,未出现违反公平交易制度的行为,未发现异常交易行为。

5.1 报告期内基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 42,521,254.69 | 93.84 |
| 2 | 其中:股票 | 42,521,254.69 | 93.84 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| 4 | 其中:国债 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 2,763,387.00 | 6.14 |
| 8 | 其他资产 | 8,183.07 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 45,292,724.76 | 100.00 |

注:公允价值计量采用公允价值层次划分标准,其中第三层次公允价值计量使用了估值技术。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------------|---------------|--------------|
| A | 农林、牧、渔业 | 208,283.50 | 0.46 |
| B | 矿业 | 1,453,207.14 | 3.17 |
| C | 制造业 | 22,520,465.21 | 49.95 |
| D | 电力、热力、燃气及生产供应 | 889,022.07 | 1.98 |
| E | 建筑业 | 1,243,228.36 | 2.76 |
| F | 批发和零售业 | 1,411,952.72 | 3.12 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,563,507.61 | 3.46 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术业 | 3,474,358.80 | 7.69 |
| J | 金融业 | 4,278,670.01 | 9.46 |
| K | 房地产业 | 2,159,839.63 | 4.78 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,187,103.10 | 2.63 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 380,300.00 | 0.84 |
| O | 国防军工和综合服务业 | - | - |
| P | 医药 | - | - |
| Q | 互联网和IT | 410,671.50 | 0.91 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 636,782.72 | 1.41 |
| S | 合计 | 41,821,348.91 | 92.56 |

5.3 报告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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|------------|--------------|
| 1 | 601880 | 中国国航 | 13,038 | 889,844.76 | 1.98 |
| 2 | 601939 | 建设银行 | 102,253 | 740,166.02 | 1.64 |
| 3 | 602290 | 科兴医药 | 19,474 | 696,772.18 | 1.53 |
| 4 | 600328 | 桑德环境 | 64,782 | 683,282.18 | 1.52 |
| 5 | 600011 | 三一重工 | 61,758 | 548,036.20 | 1.23 |
| 6 | 600267 | 联华股份 | 33,027 | 509,430.24 | 1.13 |
| 7 | 600308 | 大澳元 | 11,482 | 483,102.74 | 1.07 |
| 8 | 600660 | 福耀玻璃 | 18,753 | 476,754.86 | 1.06 |
| 9 | 600741 | 华信国际 | 21,066 | 447,708.00 | 1.00 |
| 10 | 600000 | 浦发银行 | 14,284 | 433,038.82 | 0.96 |

5.4 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股指期货投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 000060 | 招商银行 | 28,072 | 477,604.72 | 1.06 |
| 2 | 601118 | 海康股份 | 17,883 | 116,461.16 | 0.26 |
| 3 | 000001 | 神州高铁 | 23,621 | 103,022.40 | 0.23 |

注:公允价值计量采用公允价值层次划分标准,其中第三层次公允价值计量使用了估值技术。

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 160000 | 16国债01 | 1,000,000.00 | 2.22 |
| 2 | 160000 | 16国债02 | 1,000,000.00 | 2.22 |
| 3 | 160000 | 16国债03 | 1,000,000.00 | 2.22 |
| 4 | 160000 | 16国债04 | 1,000,000.00 | 2.22 |
| 5 | 160000 | 16国债05 | 1,000,000.00 | 2.22 |

5.6 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

5.7 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权证投资明细

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

5.11 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|----------|
| 1 | 存出保证金 | 1,169.69 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 495.00 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他资产 | - |
| 8 | 合计 | 8,183.07 |

5.12 报告期末本基金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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.7 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.9 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.10 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.11 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.12 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.13 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.14 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.16 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.17 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.18 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.19 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.20 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.21 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.22 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.23 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.24 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.25 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.26 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.27 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.28 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.29 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.30 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.31 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.32 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.33 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.34 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.35 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.36 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.37 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.38 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.39 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.40 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.41 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.42 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.43 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.44 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.45 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.46 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.47 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.48 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.49 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.50 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.51 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.52 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.53 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.54 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.55 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.56 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.57 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.58 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.59 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.60 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.61 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.62 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.63 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.64 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.65 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.66 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.67 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.68 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.69 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.70 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.71 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.72 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.73 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.74 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.75 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.76 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.77 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.78 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.79 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.80 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.81 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.82 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.83 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.84 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.85 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.86 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.87 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.88 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.89 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.90 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.91 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.92 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.93 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.94 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.95 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.96 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.97 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.98 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理任期 | 从业年限 | 说明 |
|-----|------|-------------|------|--|
| 姜先生 | 基金经理 | 2016年1月6日 | 13年 | 硕士研究生，具有基金从业资格，曾任于国信证券研究所，上海宏源证券研究所研究员，平安资产管理公司，2013年加入泰信基金管理有限公司，历任研究员，自2011年10月至2014年6月在中信建投基金管理部，2012年4月至2015年11月在华夏基金基金管理部，自2015年11月8日起担任泰信中证200指数证券投资基金基金经理。自2017年11月15日起兼任泰信中证500指数证券投资基金基金经理。 |

注:1、以上日期均是公司公告的日期。
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。
3、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守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》及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约定。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
根据《证券投资基金法》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《公平交易管理办法》，适用于所有投资组合，以及所有投资管理活动。通过研究、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的全过程，从研究、投资、交易等环节落实，发现可疑交易预警，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期不定期审计。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
本公司严格执行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行为，公平交易制度严格执行并有效。报告期内，未发现异常交易行为。
4.3.3 投资交易流程控制
本公司严格执行《公平交易管理办法》,通过事前控制、事中控制和事后监控,未出现违反公平交易制度的行为,未发现异常交易行为。
4.3.4 投资交易流程控制
本公司严格执行《公平交易管理办法》,通过事前控制、事中控制和事后监控,未出现违反公平交易制度的行为,未发现异常交易行为。
4.3.5 投资交易流程控制
本公司严格执行《公平交易管理办法》,通过事前控制、事中控制和事后监控,未出现违反公平交易制度的行为,未发现异常交易行为。

5.1 报告期内基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 44,230,816.66 | 91.36 |
| 2 | 其中:股票 | 44,230,816.66 | 91.36 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| 4 | 其中:国债 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 3,899,672.14 | 8.03 |
| 8 | 其他资产 | 16,261.61 | 0.03 |
| 9 | 合计 | 48,146,649.41 | 100.00 |

注:公允价值计量采用公允价值层次划分标准,其中第三层次公允价值计量使用了估值技术。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------------|---------------|--------------|
| A | 农林、牧、渔业 | 712.00 | 0.00 |
| B | 矿业 | 17,700,369.60 | 36.36 |
| C | 制造业 | 2,628,000.00 | 5.44 |
| D | 电力、热力、燃气及生产供应 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 2,628,000.00 | 5.44 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术业 | 18,496,516.66 | 38.59 |
| 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 | 1,800.00 | 0.00 |
| O | 国防军工和综合服务业 | - | - |
| P | 医药 | - | - |
| Q | 互联网和IT | 1,810,200.00 | 3.76 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 6,019,468.00 | 12.51 |
| S | 合计 | 44,230,816.66 | 91.36 |

5.3 报告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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 000033 | 荣信股份 | 112,000 | 2,084,720.00 | 4.32 |
| 2 | 300115 | 东方智造 | 270,000 | 2,508,000.00 | 5.20 |
| 3 | 300069 | 东方智造 | 221,200 | 2,405,000.00 | 5.00 |
| 4 | 000429 | 明润科技 | 138,000 | 2,400,000.00 | 5.00 |
| 5 | 600891 | 光明乳业 | 318,000 | 2,361,600.00 | 4.91 |
| 6 | 300078 | 盛通股份 | 184,000 | 1,784,800.00 | 3.72 |
| 7 | 000228 | 锐奇股份 | 284,000 | 1,616,400.00 | 3.3 |