泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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:2019年3月28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2019年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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2018年1月1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	泰信鑫选混合	
基金主代码	001970	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年2月4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	63,076,740.41份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	泰信鑫选混合A	泰信鑫选混合C
下属分级基金的交易代码:	001970	002580
报告期末下属分级基金的份额总额	33,028,077.79份	30,048,662.62份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产的长期稳定增值。
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，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×55%＋上证国债指数收益率×45%
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	胡图	郭明
	联系电话	021-20899098	(010)66105799
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-5988	95588
传真		021-20899008	(010)66105798

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	http://www.ftfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§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	2018年		2017年		2016年2月4日(基金合同生效日)-2016年12月31日	
	泰信鑫选混合A	泰信鑫选混合C	泰信鑫选混合A	泰信鑫选混合C	泰信鑫选混合A	泰信鑫选混合C
本期已实现收益	-2,695,534.60	-2,156,833.75	-206,849.71	-299,809.73	2,138,340.80	-
本期利润	-6,077,679.13	-5,940,612.65	-2,042,973.92	75,341.56	913,777.41	-
加权平均基金份额本期利润	-0.1960	-0.2147	-0.0623	0.0041	0.0070	-
本期基金份额净值增长率	-22.93%	-22.98%	-4.60%	-4.80%	0.10%	-0.30%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.2644	-0.2664	-0.0454	-0.0609	0.0011	-
期末基金资产净值	24,295,924.75	22,042,478.20	35,008,759.05	25,029,290.01	47,684,555.87	-
期末基金份额净值	0.736	0.734	0.955	0.953	1.001	1.001

注:1.本基金基金合同于2016年2月4日生效。本基金自2016年5月5日起增加C类份额。

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、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。

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

泰信鑫选混合A

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	-4.66%	1.95%	-6.12%	0.90%	1.46%	1.05%
过去六个月	-14.91%	1.76%	-6.68%	0.82%	-8.23%	0.94%
过去一年	-22.93%	1.80%	-12.22%	0.74%	-10.71%	1.06%
自基金合同生效起至今	-26.40%	1.13%	6.37%	0.58%	-32.77%	0.55%

泰信鑫选混合C

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	-4.80%	1.95%	-6.12%	0.90%	1.32%	1.05%
过去六个月	-14.95%	1.76%	-6.68%	0.82%	-8.27%	0.94%
过去一年	-22.98%	1.81%	-12.22%	0.74%	-10.76%	1.07%
自基金合同生效起至今	-26.89%	1.18%	0.92%	0.55%	-27.81%	0.63%

注:本基金业绩比较基准为:沪深300 指数收益率×55%＋上证国债指数收益率×45%;本基金自2016年5月5日起增加C类份额。

1.沪深300指数由中国A股各行业上市公司中最具流动性的300家公司编制而成，能够全面反映股票市场的波动,是股票市场中风险收益特征较好的指数之一。

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。

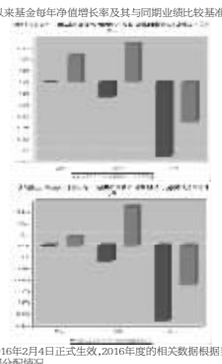
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金基金合同于2016年2月4日正式生效。

2.经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致并报中国证监会备案,自2016年5月5日起泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金增加C类基金份额,并对本基金的基金合同及托管协议作相应修改。

3.本基金建仓期为六个月,建仓期满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%。

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2016年2月4日正式生效,2016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

本基金过去三年未进行利润分配。

§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2018年12月底,公司有正式员工100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2018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、泰信竞争优选混合共21只开放式基金及8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		
董山青 先生	基金投资部总监助理、本基金经理兼泰信行业精选混合基金经理	2016年2月4日	-	13年	工商管理硕士，具有基金从业资格。曾就职于中国银行;2004年8月加入泰信基金管理有限公司,历任交易员、研究员、研究总监助理、基金经理助理、基金经理等职;2009年5月至2011年4月担任泰信优势增长基金经理助理;2012年2月22日至2015年3月3日担任泰信保本混合型证券投资基金基金经理,2015年3月4日起至今担任由泰信保本基金转型后的泰信行业精选混合型证券投资基金的基金经理;2016年2月4日起至今担任泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;现同时担任基金投资部总监助理。

注:1.基金经理任职日期为基金合同生效日;

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信鑫选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

债券市场大幅上涨,股票市场涨跌互现,报告期内各指数涨跌幅分别为:上证综指-24.59%,中小板综指-35.31%,创业板指-28.65%。

报告期内股票市场的较大波动导致组合波动也比较较大,对净值造成一定影响。由于我们对股市一直长期看好,特别是看好新兴产业,如科技、传媒、军工等成长类板块,因此长期维持对成长股的高仓位配置。虽然股票市场全年震荡下跌,但是个股估值优势更加凸显,很多股票出现了难得的买点,自2015年中以来的熊市可能已经步入尾声。我们无法判断市场见底的具体时点,因此只能坚定持股,持有能够穿越周期的公司,以公司的成长性抵御熊市的下跌。我们对未来的二级市场股票投资较为乐观,同时一级市场方面仍然参与部分新股的申购。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰信鑫选混合A基金份额净值为0.736元,本报告期基金份额净值增长率为-22.93%;截至本报告期末泰信鑫选混合C基金份额净值为0.734元,本报告期基金份额净值增长率为-22.98%;同期业绩比较基准收益率为-12.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一段时间,供给侧改革已经见到成效,宏观经济景气有所回落,通胀平缓,行业内部整合进行中,资金面由偏紧转为有所宽松,去杠杆转为稳杠杆。美元指数维持高位,美联储货币政策表态开始倾向鸽派,市场开始预期加息次数减少甚至加息进程结束。美国政府关门创造历史记录,特朗普呼吁两党团结,美国国内矛盾可能成为未来一段时间特朗普政府关注焦点。近期即将进行的中美贸易谈判可能会有所进展。

管理层的货币政策从稳健转为有所宽松,强调稳增长和稳就业,中央经济工作会议工作的落实重点在推动制造业高质量发展和促进形成强大国内市场,相关改革正在扎实推进。近期个税专项扣除落实,传统基建与新基建方向确定,也有利于稳增长。而管理层对房地产政策重申“房住不炒,因城施策”,说明房地产政策全面放松的可能性不大。资本市场方面开始强调引入长期资金,对外开放。最近的商誉减值暴雷事件,说明市场对创业板商誉减值的担忧终于靴子落地。

未来市场信心的支撑就是改革政策的执行,市场对于改革的期盼也将更加急切,政策的力度和落地时间都很重要,目前可以关注科创板的推进过程。相对于当前的市场利率,股市估值水平合理,市场信心有待恢复,我们期待在国企、土地、财税、金融、反腐等方面继续推出重大力度改革,重启牛市之路。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1.泰信基金管理有限公司估值程序等事项的说明

委员会主席

韩波先生,本科学历。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,曾任公司风险管理部副总监。

蔡雍成先生,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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、基金合同关于利润分配的约定:

1.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相应类别的基金份额进行再投资,且基金份额持有人可对A类、C类基金份额分别选择不同的分红方式;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.基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4.由于本基金A类基金份额不收取销售服务费,而C类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同,在收益分配数额方面可能有所不同,本基金同一类别的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。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金于2018年5月30日至2018年8月20日、2018年9月5日至2018年11月16日、2018年11月20日至2018年12月28日有连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对泰信鑫选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

本报告期内泰信鑫选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鑫选灵活配置混合型证券投资基金基金合同、基金资产净值计算、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。本报告期内泰信鑫选灵活配置混合型证券投资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鑫选灵活配置混合型证券投资基金2018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(2019)第21235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	泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人:
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“泰信鑫选混合基金”)的财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018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。 (二)我们的意见 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,公允反映了泰信鑫选混合基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于泰信鑫选混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
管理层和治理层对财务报表的责任	泰信鑫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。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估泰信鑫选混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鑫选混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督泰信鑫选混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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: (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。 (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。 (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。 (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,就可能导致对泰信鑫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。我们的结论是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鑫选混合基金不能持续经营。 (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。 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。
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	2019年3月26日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	3,456,760.24	3,352,412.69
结算备付金	4,085.25	113,658.40
存出保证金	8,609.64	17,599.61
交易性金融资产	43,127,023.06	56,818,341.96
其中:股票投资	43,127,023.06	55,362,257.96
基金投资	-	-
债券投资	-	1,456,084.00
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	-	-
应收利息	696.66	5,730.53
应收股利	-	-
应收申购款	339.51	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	46,597,514.36	60,307,743.19
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017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	2,804.74	196.98
应付管理人报酬	60,699.22	77,368.02
应付托管费	10,116.51	12,894.65
应付销售服务费	1,920.64	2,142.13
应付交易费用	3,560.25	17,092.12
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	180,010.05	160,000.23
负债合计	259,111.41	269,694.13
所有者权益:		
实收基金	63,076,740.41	62,934,989.33
未分配利润	-16,738,337.46	-2,896,940.27
所有者权益合计	46,338,402.95	60,038,049.06
负债和所有者权益总计	46,597,514.36	60,307,743.19

注:报告截止日2018年12月31日,泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金的基金份额总额63,076,740.41份,其中A类基金份额净值0.736元,基金份额总额33,028,077.79份;C类基金份额净值0.734元,基金份额总额30,048,662.62份。

7.2 利润表

会计主体:泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	-10,691,575.14	-850,762.07
1.利息收入	33,554.87	793,837.52
其中:存款利息收入	31,795.05	23,872.60
债券利息收入	1,694.20	651,448.48
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	65.62	118,516.44
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-3,588,605.09	-294,012.70
其中:股票投资收益	-3,538,546.84	276,508.06
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-198,601.16	-647,725.98
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	148,542.91	77,205.22
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-7,165,923.43	-1,460,972.92
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	29,398.51	110,386.03
减:二、费用	1,326,716.64	1,116,870.29
1. 管理人报酬	758,394.65	690,225.87
2. 托管费	126,399.11	115,037.54
3. 销售服务费	23,746.90	13,726.31
4. 交易费用	219,754.90	106,592.13
5. 利息支出	-	12,147.12
其中:卖出回购金融资产支出	-	12,147.12
6. 税金及附加	6.08	-
7. 其他费用	198,415.00	179,141.32
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-12,018,291.78	-1,967,632.36
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-12,018,291.78	-1,967,632.36

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	62,934,989.33	-2,896,940.27	60,038,049.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-12,018,291.78	-12,018,291.78
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)	141,751.08	-1,823,105.41	-1,681,354.33
其中:1.基金申购款	16,055,214.90	-2,907,830.63	13,147,384.27
2.基金赎回款	-15,913,463.82	1,084,725.22	-14,828,738.60
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)	63,076,740.41	-16,738,337.46	46,338,402.95

项目	上年度可比期间 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)	47,630,127.43	54,428.44	47,684,555.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,967,632.36	-1,967,632.36
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)	15,304,861.90	-983,736.35	14,321,125.55
其中:1.基金申购款	61,401,593.69	-934,667.70	60,466,925.99
2.基金赎回款	-46,096,731.79	-49,068.65	-46,145,800.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	62,934,989.33	-2,896,940.27	60,038,049.06

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

泰信鑫选灵活配置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[2015]第 1597号《关于准予泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金设立的批复》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《泰信鑫选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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 337,550,009.50 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(2016)第139号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年2月4日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为337,594,314.60份基金份额,其中认购资金利息折合44,305.10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(以下简称“中国工商银行”)。

根据本基金管理人 2016 年 4 月 28 日发布的《关于泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》,经与基金托管人中国工商银行股协商一致,自 2016 年 5 月 5 日起,本基金增加收取销售服务费的 C 类基金份额,并对基金合同作相应修改。本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。无需从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;需从本类别基金资产中计提销售服务费且赎回费率最高不超过 0.5%的基金份额,称为 C 类基金份额。于 2016 年 5 月 5 日起基金份额持有人原有的本基金份额全部自动转换为 A 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,合并运作,A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金合同》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、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会相关规定)。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,持现或到日一年以内 终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,持现或到期日在一年以内 的政府债券不低于基金资产净值5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为沪深300 指数收益率×55%＋上证国债指数收益率×45%。

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2019年3月26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《证券投资基金计核算业务指引》、《泰信鑫选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。

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2018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2018年12月31日的财务状况以及2018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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

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[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