

泰信发展主题混合型证券投资基金

[2015] 第三季度报告

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

报告送出日期:2015年10月24日

§1 重要提示

本基金的基金管理人和基金托管人根据本基金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责任。

本基金的基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同已于2015年10月12日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金的基金管理人和基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，基金的过往业绩并不代表未来表现。投资人投资于本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告的中期报告期为2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称:泰信发展主题混合

交易代码:200008

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年12月15日

报告期末基金份额总额(63,618,947,660.00)

基金类别:混合型基金

基金投资目标:充分运用基金管理人的研究优势和市场时机，通过主动管理，精选行业，精选个股，把握行业发展中的投资机会，在严格控制风险的前提下，力争基金净值的持续增长。

基金投资策略:本基金将主要投资于具有良好成长性的行业，通过精选个股，把握行业和个股的投资机会，从而实现基金净值的持续增长。

基金业绩比较基准:75%×沪深300指数+25%×中证金融指数

风险收益特征:本基金的预期风险和预期收益均高于货币基金，低于股票基金，风险报酬率居中。

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

报告期末基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -17,429,546.48

2.本期利润 -40,940,026.38

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0546

4.期末基金份额净值 81,096,604.54

5.期末可供分配基金份额净值 1,289

注:1.所列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、基金转换费等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.40% 4.32% -21.11% 25.1% -10.29% 18.1%

注:本基金的业绩比较基准为:75%×沪深300指数+25%×中证金融指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

3.1 主要财务指标

报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -17,429,546.48

2.本期利润 -40,940,026.38

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0546

4.期末基金份额净值 81,096,604.54

5.期末可供分配基金份额净值 1,289

注:1.所列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、基金转换费等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.40% 4.32% -21.11% 25.1% -10.29% 18.1%

注:本基金的业绩比较基准为:75%×沪深300指数+25%×中证金融指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

3.1 主要财务指标

报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -17,429,546.48

2.本期利润 -40,940,026.38

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0546

4.期末基金份额净值 81,096,604.54

5.期末可供分配基金份额净值 1,289

注:1.所列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、基金转换费等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.40% 4.32% -21.11% 25.1% -10.29% 18.1%

注:本基金的业绩比较基准为:75%×沪深300指数+25%×中证金融指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

3.1 主要财务指标

报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -17,429,546.48

2.本期利润 -40,940,026.38

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0546

4.期末基金份额净值 81,096,604.54

5.期末可供分配基金份额净值 1,289

注:1.所列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、基金转换费等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.40% 4.32% -21.11% 25.1% -10.29% 18.1%

注:本基金的业绩比较基准为:75%×沪深300指数+25%×中证金融指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

3.1 主要财务指标

报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -15,172,930

2.本期利润 520,472,311

3.加权平均基金份额本期利润 0.0062

4.期末基金份额净值 76,169,314.30

5.期末可供分配基金份额净值 1,116.01

注:1.所列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、基金转换费等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.67% 0.07% 1.23% 0.05% -0.66% 0.02%

注:本基金的业绩比较基准为:75%×沪深300指数+25%×中证金融指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

3.1 主要财务指标

报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -15,172,930

2.本期利润 520,472,311

3.加权平均基金份额本期利润 0.0062

4.期末基金份额净值 76,169,314.30

5.期末可供分配基金份额净值 1,116.01

注:1.所列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、基金转换费等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.67% 0.07% 1.23% 0.05% -0.66% 0.02%

注:本基金的业绩比较基准为:75%×沪深300指数+25%×中证金融指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

3.1 主要财务指标

报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -15,172,930

2.本期利润 520,472,311

3.加权平均基金份额本期利润 0.0062

4.期末基金份额净值 76,169,314.30

5.期末可供分配基金份额净值 1,116.01

注:1.所列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、基金转换费等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.67% 0.07% 1.23% 0.05% -0.66% 0.02%

注:本基金的业绩比较基准为:75%×沪深300指数+25%×中证金融指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

3.1 主要财务指标

报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -15,172,930

2.本期利润 520,472,311

3.加权平均基金份额本期利润 0.0062

4.期末基金份额净值 76,169,314.30

5.期末可供分配基金份额净值 1,116.01

注:1.所列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、基金转换费等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.67% 0.07% 1.23% 0.05% -0.66% 0.02%

注:本基金的业绩比较基准为:75%×沪深300指数+25%×中证金融指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

3.1 主要财务指标

报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -15,172,930

2.本期利润 520,472,311