

# 信息披露 Disclosure

## 泰信发展主题混合型证券投资基金

### 2015] 第四季度报告

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:2016年1月22日

#### § 1 重要提示

本基金管理人的董事会及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，并对其中的事实准确性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司保证基金合同已于2016年1月18日复核了本报告中的财务数据,净值表现和投资组合报告等,并复核了本基金在虚假记载、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。

本报告所载的财务资料未经审计。

本报告期为 2015年10月1日起至2015年12月31日止。

#### § 2 基本产品概况

基金简称 泰信发展主题混合

交易代码 290008

基金运作方式 约期开放式

基金合同生效日 2010年12月16日

报告期末基金份额总额 54,071,9215.08份

充分披露中国宏观经济可持续发展过程中的主题投资机会,通过主题配置和精选个股,分享中国经济在行业发展的过程中所蕴含的机遇,力争在控制风险的前提下,力争基金资产取得超越业绩比较基准的稳健回报。

本基金的投资策略采用“核心-卫星”的投资策略,并考虑各种风格的基金风格,通过行业配置和个股精选,力争在控制风险的前提下,力争基金资产取得超越业绩比较基准的稳健回报。

业绩比较基准 75%×沪深300指数+25%×中证全债指数

本基金的投资策略采用“核心-卫星”的投资策略,并考虑各种风格的基金风格,通过行业配置和个股精选,力争在控制风险的前提下,力争基金资产取得超越业绩比较基准的稳健回报。

风险收益特征 本基金为混合型基金,中高收益的基金品种,其预期风险和预期收益均高于股票型基金,低于债券型基金。

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

#### § 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期: 2015年10月1日 ~ 2015年12月31日

1.本期已实现收益 3,396,097.61

2.本期利润 23,970,461.60

3.加权平均基金份额本期利润 0.4193

4.期末基金资产净值 74,321,008.62

5.期末基金份额净值 1.374

注:1. 所述基金的业比较基准不包括基金份额持有人申购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购费、赎回费、申购或赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平将低于原始数据。

2. 本期利润是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 基金的业绩表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 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 30.73% 2.26% 13.07% 1.25% 17.66% 1.01%

注:本基金的业比较基准为:75%×沪深300指数+25%×中证全债指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金的业比较基准为:60%×95%投资于股票,基金资产的3%~40%投资于债券、现金类资产及权证,资产支持证券,其中,现金或到期日在一年以内的政府债券低于基金资产净值的5%,权证不低于基金资产净值的3%,资产支持证券不低于基金资产净值的20%。其中投资于发展主题相关上市公司的比例不低于股票投资资产的80%。

#### § 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业 任期日期 离任日期 说明

车广路先生 本基金经理兼泰信蓝筹优势基金经理兼泰信混合基金经理 2014年6月21日 - 8年

注:1.以上日期均是指公司公告的日期。

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。

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,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》、《泰信发展主题混合型证券投资基金》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 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》、《公开募集证券投资基金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《公平交易制度》,适用于所有投资品种,以及所有投资管理活动,涵盖研究、分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节,从研究、投资、交易合规性监控,发现利益输送、利益冲突、公平交易、公平定价、公平交易制度的执行情况,以及对所有投资管理活动、涵盖研究、分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节,从研究、投资、交易合规性监控,发现利益输送、利益冲突、公平交易、公平定价、公平交易制度的执行情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金严格执行不同时段组合之间的日内反向交易,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。本报告期未发现本基金与其他基金之间存在利益输送行为,公平交易制度严格执行情况良好。

4.3.3 公平交易专项说明

4.3.4 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金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《公平交易制度》,适用于所有投资品种,以及所有投资管理活动,涵盖研究、分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节,从研究、投资、交易合规性监控,发现利益输送、利益冲突、公平交易、公平定价、公平交易制度的执行情况,以及对所有投资管理活动、涵盖研究、分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节,从研究、投资、交易合规性监控,发现利益输送、利益冲突、公平交易、公平定价、公平交易制度的执行情况。

4.4 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.1 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.2 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.3 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.4 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.5 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.6 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.7 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.8 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.9 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.10 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.11 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.12 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.13 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.14 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.15 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.16 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.17 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.18 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.19 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.20 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.21 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.22 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.23 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.24 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.25 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.26 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.27 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.28 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.29 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.30 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.31 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.32 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.33 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.34 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.35 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.36 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.37 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.38 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.39 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.40 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.41 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.42 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.43 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.44 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.45 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.46 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.47 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.48 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.49 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.50 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.51 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.52 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.53 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.54 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.55 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.56 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.57 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.58 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.59 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.60 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.61 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.62 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.63 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.64 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.65 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.66 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.67 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.68 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.69 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.70 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.71 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.72 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.73 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.74 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.75 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.76 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.77 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.78 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.79 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.80 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.81 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.82 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.83 报告期内本基金的费用情况说明

4.4.84 报告