

信息披露 Disclosure

泰信蓝筹精选混合型证券投资基金

原泰信蓝筹精选股票型证券投资基金

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：中国银行股份有限公司
报告期末：2015年12月31日

1.1 重要提示
1.2 基金概况

2.1 基金概况
2.2 基金业绩

2.3 基金管理人及主要人员
2.4 基金业绩

2.5 基金业绩

2.6 基金业绩

2.7 基金业绩

2.8 基金业绩

2.9 基金业绩

2.10 基金业绩

2.11 基金业绩

2.12 基金业绩

2.13 基金业绩

2.14 基金业绩

2.15 基金业绩

2.16 基金业绩

2.17 基金业绩

2.18 基金业绩

2.19 基金业绩

2.20 基金业绩

资产	期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
银行存款	107,066,880.23	94,720,788.60
结算备付金	5,236,163.84	8,256,317.79
存出保证金	1,226,213.97	960,794.12
交易性金融资产	700,605,513.70	1,063,188,065.29
其中：股票投资	700,605,513.70	1,063,188,065.29
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	280,000,000.00
应收证券清算款	24,858,387.99	719,889.39
应收利息	17,236.67	42,721.33
应收股利	-	-
应收申购款	610,534.47	320,231.17
递延所得税资产	-	-
其他资产	839,610,307.97	1,446,228,756.59
资产总计	1,446,228,756.59	2,766,228,756.59

负债	期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
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	27,685,260.33	-
应付赎回款	569,320.26	1,567,682.20
应付管理人报酬	1,065,476.44	1,888,572.34
应付托管费	175,912.22	301,428.70
应付销售服务费	-	-
应付交易费	2,083,954.21	5,141,943.48
应交税费	-	-
应付利息	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	406,227.13	302,670.20
负债合计	4,280,800.71	36,897,543.66
所有者权益	-	-
实收基金	516,285,503.94	1,150,608,491.60
未分配利润	319,044,603.22	260,722,716.44
所有者权益合计	835,330,107.16	1,411,331,208.04
负债和所有者权益总计	1,446,228,756.59	2,766,228,756.59

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	520,494,268.58	391,723,342.88
1.利息收入	1,580,602.03	3,836,590.27
其中：存款利息收入	1,152,810.56	603,415.94
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	427,792.37	3,233,174.81
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	368,067,829.35	368,262,853.19
其中：股票投资收益	364,543,697.86	368,262,853.19
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
公允价值变动收益（损失以“-”填列）	149,416,365.69	18,607,136.11
4.公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”填列）	1,438,969.61	986,763.31
减：二、费用	42,555,130.61	43,683,776.96
1.管理人报酬	20,341,622.52	14,473,164.60
2.托管费	3,390,249.73	2,412,194.06
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	18,278,419.88	14,778,463.31
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	444,070.00	429,596.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	477,939,256.05	360,009,564.12
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	477,939,256.05	360,009,564.12

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、期初所有者权益（基金净值）	1,150,608,491.60	260,722,716.44
二、本期损益变动产生的基金净值变动额（本期净利润）	-477,939,256.05	360,009,564.12
三、本期基金净值变动产生的基金净值变动额（本期净利润）	-477,939,256.05	360,009,564.12
四、本期基金净值变动产生的基金净值变动额（本期净利润）	-477,939,256.05	360,009,564.12
五、期末所有者权益（基金净值）	672,659,235.55	620,732,280.56

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、期初所有者权益（基金净值）	1,150,608,491.60	260,722,716.44
二、本期损益变动产生的基金净值变动额（本期净利润）	-477,939,256.05	360,009,564.12
三、本期基金净值变动产生的基金净值变动额（本期净利润）	-477,939,256.05	360,009,564.12
四、本期基金净值变动产生的基金净值变动额（本期净利润）	-477,939,256.05	360,009,564.12
五、期末所有者权益（基金净值）	672,659,235.55	620,732,280.56

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、期初所有者权益（基金净值）	1,150,608,491.60	260,722,716.44
二、本期损益变动产生的基金净值变动额（本期净利润）	-477,939,256.05	360,009,564.12
三、本期基金净值变动产生的基金净值变动额（本期净利润）	-477,939,256.05	360,009,564.12
四、本期基金净值变动产生的基金净值变动额（本期净利润）	-477,939,256.05	360,009,564.12
五、期末所有者权益（基金净值）	672,659,235.55	620,732,280.56

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,341,492.52	14,473,164.60
其中：支付给销售机构的客户维护费	1,000,640.32	1,488,450.04

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,341,492.52	14,473,164.60
其中：支付给销售机构的客户维护费	1,000,640.32	1,488,450.04

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,341,492.52	14,473,164.60
其中：支付给销售机构的客户维护费	1,000,640.32	1,488,450.04

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,341,492.52	14,473,164.60
其中：支付给销售机构的客户维护费	1,000,640.32	1,488,450.04

股票代码	股票名称	停牌日期	期末 停牌前 收盘价	复牌日期	复牌前 收盘价	数量（股）	期末 成本总额	期末市值总额	备注
002011	平安银行	2015年12月20日	16.72	2016年2月22日	16.05	499,369	7,647,260.22	8,369,314.46	-
002219	恒立液压	2015年7月8日	18.18	-	-	2,000,000	27,424,591.66	36,360,000.00	-
002228	金兴	2015年7月8日	19.52	2016年2月22日	15.21	1,600,000	27,219,434.33	31,232,000.00	-
600630	交大昂立	2015年8月14日	23.06	2016年1月21日	23.51	760,000	22,229,712.00	17,515,000.00	-
600682	南京高科	2015年7月11日	32.86	2016年1月27日	33.78	2,820,148	46,163,628.66	93,008,481.04	-
600749	西藏矿业	2015年11月30日	25.14	-	-	2,300,000	42,311,240.00	57,822,000.00	-
600900	四川双马	2015年11月19日	82.63	2016年3月26日	69.03	389,370	30,112,716.63	33,049,521.10	-
300238	鹏化	2015年12月24日	42.00	-	-	300,020	9,346,966.61	12,600,840.00	-

股票代码	股票名称	停牌日期	期末 停牌前 收盘价	复牌日期	复牌前 收盘价	数量（股）	期末 成本总额	期末市值总额	备注
002011	平安银行	2015年12月20日	16.72	2016年2月22日	16.05	499,369	7,647,260.22	8,369,314.46	-
002219	恒立液压	2015年7月8日	18.18	-	-	2,000,000	27,424,591.66	36,360,000.00	-
002228	金兴	2015年7月8日	19.52	2016年2月22日	15.21	1,600,000	27,219,434.33	31,232,000.00	-
600630	交大昂立	2015年8月14日	23.06	2016年1月21日	23.51	760,000	22,229,712.00	17,515,000.00	-
600682	南京高科	2015年7月11日	32.86	2016年1月27日	33.78	2,820,148	46,163,628.66	93,008,481.04	-
600749	西藏矿业	2015年11月30日	25.14	-	-	2,300,000	42,311,240.00	57,822,000.00	-
600900	四川双马	2015年11月19日	82.63	2016年3月26日	69.03	389,370	30,112,716.63	33,049,521.10	-
300238	鹏化	2015年12月24日	42.00	-	-	300,020	9,346,966.61	12,600,840.00	-

股票代码	股票名称	停牌日期	期末 停牌前 收盘价	复牌日期	复牌前 收盘价	数量（股）	期末 成本总额	期末市值总额	备注
002011	平安银行	2015年12月20日	16.72	2016年2月22日	16.05	499,369	7,647,260.22	8,369,314.46	-
002219	恒立液压	2015年7月8日	18.18	-	-	2,000,000	27,424,591.66	36,360,000.00	-
002228	金兴	2015年7月8日	19.52	2016年2月22日	15.21	1,600,000	27,219,434.33	31,232,000.00	-
600630	交大昂立	2015年8月14日	23.06	2016年1月21日	23.51	760,000	22,229,712.00	17,515,000.00	-
600682	南京高科	2015年7月11日	32.86	2016年1月27日	33.78	2,820,148	46,163,628.66	93,008,481.04	-
600749	西藏矿业	2015年11月30日	25.14	-	-	2,300,000	42,311,240.00	57,822,000.00	-
600900	四川双马	2015年11月19日	82.63	2016年3月26日	69.03	389,370	30,112,716.63	33,049,521.10	-
300238	鹏化	2015年12月24日	42.00	-	-	300,020	9,346,966.61	12,600,840.00	-

股票代码	股票名称	停牌日期	期末 停牌前 收盘价	复牌日期	复牌前 收盘价	数量（股）	期末 成本总额	期末市值总额	备注
002011	平安银行	2015年12月20日	16.72	2016年2月22日	16.05	499,369	7,647,260.22	8,369,314.46	-
002219	恒立液压	2015年7月8日	18.18	-	-	2,000,000	27,424,591.66	36,360,000.00	-
002228	金兴	2015年7月8日	19.52	2016年2月22日	15.21	1,600,000	27,219,434.33	31,232,000.00	-
600630	交大昂立	2015年8月14日	23.06	2016年1月21日	23.51	760,000	22,229,712.00	17,515,000.00	-
600682	南京高科	2015年7月11日	32.86	2016年1月27日	33.78	2,820,148	46,163,628.66	93,008,481.04	-
600749	西藏矿业	2015年11月30日	25.14	-	-	2,300,000	42,311,240.00	57,822,000.00	-
600900	四川双马	2015年11月19日	82.63	2016年3月26日	69.03	389,370	30,112,716.63	33,049,521.10	-
300238	鹏化	2015年12月24日	42.00	-	-	300,020	9,346,966.61	12,600,840.00	-

股票代码	股票名称	停牌日期	期末 停牌前 收盘价	复牌日期	复牌前 收盘价	数量（股）	期末 成本总额	期末市值总额	备注
002011	平安银行	2015年12月20日	16.72	2016年2月22日	16.05	499,369	7,647,260.22	8,369,314.46	-
002219	恒立液压	2015年7月8日	18.18	-	-	2,000,000	27,424,591.66	36,360,000.00	-
002228	金兴	2015年7月8日	19.52	2016年2月22日	15.21	1,600,000	27,219,434.33	31,232,000.00	-
600630	交大昂立	2015年8月14日	23.06	2016年1月21日	23.51	760,000	22,229,712.00	17,515,000.00	-
600682	南京高科	2015年7月11日	32.86	2016年1月27日	33.78	2,820,148	46,163,628.66	93,008,481.04	-
600749	西藏矿业	2015年11月30日	25.14	-	-	2,300,000	42,311,240.00	57,822,000.00	-
600900	四川双马	2015年11月19日	82.63	2016年3月26日	69.03	389,370	30,112,716.63	33,049,521.10	-
300238	鹏化	2015年12月24日	42.00	-	-	300,020	9,346,966.61	12,600,840.00	-

序号	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	004902	南京高科	2,320,148	93,008,481.04	11.13
2	000658	冀东能源	2,200,010	40,940,277.00	6.92
3	600749	西藏矿业	2,300,000	17,622,000.00	6.30
4	002219	恒立液压	2,000,000	36,360,000.00	4.35
5	300009	通达股份	300,000	34,624,000.00	4.16
6	600650	交大昂立	390,970	33,610,521.10	3.99
7	000070	特变电工	1,000,000	32,000,000.00	3.84
8	002228	合兴包装	1,600,000	31,232,000.00	3.74