泰信蓝筹精选混合型证券投资基金

2016 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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2017年1月20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。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据基金合同已于2017年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信蓝筹精选混合
交易代码	290006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年4月22日
报告期末基金份额总额	215,922,218.86份
投资目标	通过投资于在中国经济可持续发展过程中具有核心竞争优势,在其所属行业内占有领先地位,业绩持续增长,分红稳定的优质蓝筹公司,分享中国经济发展的成果。在严格控制投资风险的条件下,实现基金资产的稳健持续增长。
投资策略	本基金采取“自上而下”的大类资产配置和“自下而上”的精选证券相结合的投资策略,充分发挥投资管理人的研究优势,通过投资具有核心竞争优势,在其所属行业内占有领先地位,业绩持续增长,分红稳定的优质蓝筹公司,在严格控制投资风险的条件下实现基金资产的稳健持续增长。
业绩比较基准	75%*沪深300指数+25%*上证国债指数
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。适合于能够承担一定股市风险,追求资本长期增值的个人和机构投资者。
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

§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(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期已实现收益	-5,403,093.61
2.本期利润	986,743.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0042
4.期末基金资产净值	260,881,960.51
5.期末基金份额净值	1.2082

注:1、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、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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。

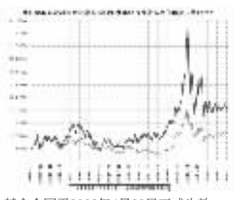
3.2 基金净值表现

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的比较

阶段	净值增长率①	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	0.19%	0.88%	1.34%	0.54%	-1.15%	0.34%

注:本基金业绩比较基准为:75%*沪深300指数+25%上证国债指数

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



注:1、泰信蓝筹精选股票基金基金合同于2009年4月22日正式生效。 本基金自2015年8月7日起变更为混合型基金。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满,本基金将基金资产的60%-95%投资于股票,基金资产的5%-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1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证不高于基金资产净值的3%,资产支持证券不高于基金资产净值的20%。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
车广路先生	本基金基金经理兼泰信国策驱动基金经理	2015年2月5日	-	9年	工商管理学硕士,具有基金从业资格。2007年6月进入泰信基金管理有限公司,历任研究部研究员、高级研究员、泰信蓝筹精选混合基金经理助理。自2012年3月1日至2014年6月21日担任本基金经理;自2014年6月21日至2016年1月27日担任泰信发展主题混合基金经理。自2015年10月27日开始担任泰信国策驱动混合基金经理。

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,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》、《泰信蓝筹精选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 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《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相关的各环节,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,基金经理严格遵守公平、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本基金与其他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。

4.3.2 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,亦无其他异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年四季度,A股市场走势先涨后跌。从10月初开始,A股市场出现长达两个月的反弹,上证综指再次跨过3300点。大盘蓝筹股成为本轮反弹的主线,主板走势明显强于中小板和创业板。在此期间,市场也曾几次尝试进行风格切换,但均未成功,表明市场对中小盘股票仍然存在较大的分歧。本基金从10月以来一直保持了较高的股票仓位,主要配置了大盘蓝筹股,并适当参与配置了部分举牌概念的股票,也取得了一定的效果。12月初保险资金投资股票的一系列新规定陆续出台,让A股市场上最活跃的增量资金放慢了进场的步伐,市场出现了较大的调整。由于事发突然未能及时调整,本基金在月初仓位依然较高,在市场调整的过程中出现了较大的回撤。之后,本基金降低了股票仓位,并对持仓结构进行了调整,减持了举牌概念的股票,增持了化工、钢铁等中游周期股,以及农业和改革相关的股票。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金单位净值为1.2082元,本季度净值增长率为0.19%,业绩比较基准增长率为1.34%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	226,290,036.19	89.62
	其中:股票	226,290,036.19	89.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	22,949,949.52	8.74
8	其他资产	4,291,846.40	1.63
9	合计	252,530,832.11	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,548,600.00	1.36
B	采矿业	3,339,000.00	1.28
C	制造业	182,212,483.12	69.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	26,911,028.00	10.32
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,441,025.07	4.39
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,837,900.00	3.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	235,290,036.19	90.19

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有沪港通股票。

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	002383	合众思壮	370,066	18,318,267.00	7.02
2	002194	顺灏科技	420,000	17,703,000.00	6.79
3	600614	鼎立股份	1,120,000	13,104,000.00	5.02
4	600146	商赢环球	370,000	12,524,500.00	4.80
5	600019	宝钢股份	1,400,000	8,890,000.00	3.41
6	603678	火炬电子	100,000	7,565,000.00	2.90
7	000018	神州长城	670,040	7,169,428.00	2.75
8	600879	航天电子	460,000	7,010,400.00	2.69
9	600032	云赛智联	700,097	6,671,924.41	2.56
10	600855	航天长峰	220,000	6,365,800.00	2.44

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有债券。

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十名资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末本基金未投资贵金属。

5.8 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

本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.11.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	138,752.09
2	应收证券清算款	4,142,152.16
3	应收股利	-
4	应收利息	4,911.88
5	应收申购款	6,030.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,291,846.40

5.11.4 报告期末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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600855	航天长峰	6,365,800.00	2.44	重大事项

5.11.6 本报告涉及合计数相关比例的,均以合计数除以相关数据计算,而不是对不同比例进行合计。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	239,527,394.17
报告期期间基金总申购份额	1,927,849.51
减:报告期期间基金总赎回份额	25,533,024.82
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	215,922,218.86

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	15,485,160.18
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	15,485,160.18
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	转换出	2016年12月27日	15,485,160.18	18,805,178.52	-
合计			15,485,160.18	18,805,178.52	

注:根据《泰信蓝筹精选混合型证券投资基金招募说明书》相关约定,本次交易不收取手续费。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰信蓝筹精选股票型证券投资基金设立的文件

2、《泰信蓝筹精选混合型证券投资基金基金合同》

3、《泰信蓝筹精选混合型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信蓝筹精选混合型证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

8.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所,供投资者免费查阅。在支付必要的工本费后,投资者可在有效的工作时间内取得本报告及上述备查文件的复制件或复印件。

8.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站(www.ftfund.com)查阅上述相关文件,或拨打客户服务中心电话(400-888-5988,021-38784566),和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司
2017年1月20日

泰信双息双利债券型证券投资基金

2016 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:2017年1月20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。

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同已于2017年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信双息双利债券
交易代码	290003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年10月31日
报告期末基金份额总额	25,001,291.91份
投资目标	本基金的投资目标是在获取债券稳定收益的基础上,通过股票一级市场中购及适当的二级市场投资等手段实现高于投资基准的收益。
投资策略	在本基金投资管理计划中,投资策略由自上而下的资产配置计划和自下而上的选股(或债券)计划组成,本基金根据对宏观经济形势、货币和财政政策变化、经济周期及利率走势、企业盈利和信用状况等等的动态分析,在限定投资范围内,决定债券类资产、股票类等工具的配置比例。并跟踪影响资产策略配置的各种因素的变化,定期对资产策略配置比例进行调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为上证国债指数。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的低风险品种,预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期已实现收益	-1,311.57
2.本期利润	-287,574.36
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0082
4.期末基金资产净值	25,525,974.05
5.期末基金份额净值	1.0210

注:1.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。

2.所述基金业绩指标不包括持有人申购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

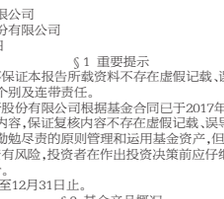
3.2 基金净值表现

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的比较

阶段	净值增长率①	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	-0.83%	0.07%	0.04%	0.06%	-0.87%	0.01%

注:本基金业绩比较基准为:上证国债指数。

3.2.2 自基金合同转型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



注:1、本基金建仓期为六个月。建仓期满,各项投资比例符合基金合同关于投资组合的相关规定。本基金主要投资于债券类金融工具。债券类金融工具包括国债、央行票据、金融债、信用等级为投资级的企业债(包括可转债),可分离性债券、短期融资券、资产支持证券等法律法规或中国证监会允许投资的固定收益品种。上述资产投资比例不低于基金资产的80%。其中,本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

2、经泰信中短期债券投资基金2007 年9 月27 日基金份额持有人大会(通讯方式)表决通过, 并经中国证监会2007 年10 月26 日证监基金字[2007]293 号文核准,泰信中短期债券投资基金 变更为泰信双息双利债券型证券投资基金,自2007 年10 月31 日起,由《泰信中短期债券投资基金基金合同》修订而成的《泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同》正式生效。业绩比较基准由“2 年期银行定期存款利率(税后)”变更为“上证国债指数”。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何俊春女士	基金投资部固定收益投资总监、本基金基金经理兼泰信双息双利债券、泰信债券增强收益、泰信债券周期回报、泰信鑫益定期开放债券基金经理	2008年10月10日	-	20年	工商管理硕士,具有基金从业资格。曾任职于上海鸿安投资咨询有限公司,齐鲁证券上海斜土路营业部。2002年12月加入泰信基金管理有限公司,先后担任泰信天天收益基金交易员、交易主管,泰信天天收益基金经理。自2008年10月10日起担任泰信双息双利债券基金经理;自2009年7月29日起担任泰信债券增强收益基金经理;自2012年10月26日起担任泰信债券周期回报基金经理;自2013年7月17日起担任泰信鑫益定期开放债券基金经理;自2016年10月11日起担任泰信天天收益货币基金经理。现同时担任基金投资部固定收益投资总监。

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

在本报告期内,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》、《泰信天天收益货币市场基金基金合同》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 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《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相关的各环节,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,基金经理严格遵守公平、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本基金与其他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。

4.3.2 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,亦无其他异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

4季度宏观经济表现较好,12月中采及财新PMI分别收于51.4及51.9较3季度末继续改善,生产、价格及库存等指标均有所加强。固定资产投资增速小幅上行,其中,制造业补库存及地产投资惯性带动两者增速上升,基建投资增速小幅下滑。但进入四季度,受地产严控因素影响,房屋销量出现明显的下滑,对未来投资将形成制约。4季度社消品维持稳定,汽车、家电等相关消费整体较好,边际有一定弱化。工业企业利润有所改善。M2继续走弱,人民币信贷中居民贷款占比较高,企业贷款偏低,显示实体经济融资需求依旧疲弱。通胀及工业品价格继续上行。海外经济体持续改善,美日欧PMI持续改善,12月美联储正式加息并上调2017年加息预期,但日本和欧洲仍维持量化宽松的货币政策。12月末中央经济工作会议召开,强调稳是主基调、供给侧改革延续,未来财政政策将更加积极,货币政策则稳健中性,调节好货币阀门,将防控金融风险放到更加重要的位置。

4季度,央行重启28天逆回购,虽然通过公开市场净投放资金超2万亿,但是多为MLP等高成本资金,市场流动性趋紧,7天回购季度均值为2.81%较3季度2.49%上行32个基点。债市受到较大冲击。10月份下旬开始多重利空不断冲击债券市场。市场先后受到10月末央行收紧资金推动金融去杠杆预期,到11月的川普上台全球再通胀、美债持续上涨预期,再到12月机构赎回货基、国海代持事件引发债券市场信任危机,最后到12月下旬市场超跌反弹。截至季末,10年期国债及国开债收益率分别收于3.01%及3.68%较9月末分别上行29和63个基点。短端中由更大,1年期国债及国开债收益率分别上行49和190个基点至2.65%及3.18%。受流动性冲击及大连机床等违约事件发酵等影响,信用债调整更加剧烈,信用利差全面走阔,低等级短久期品种受挫严重。12月以来,多家发行主体取消新债发行。转债市场四季度受股市债市下跌的双重冲击影响,除录得小幅正收益的三一转债和停牌的电气转债外,其他标的整体下跌。

4季度,双息双利基金应对赎回适度降低了股票及债券投资仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金单位净值为1.0210元,本季度净值增长率为-0.83%, 同期业绩比较基准增长率0.04%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期本基金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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	581,934.00	2.23
	其中:股票	581,934.00	2.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,461,545.00	78.53
	其中:债券	20,461,545.00	78.53
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,642,618.51	17.82
8	其他资产	369,410.50	1.42
9	合计	26,055,508.01	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	436,080.00	1.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	145,854.00	0.57
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	581,934.00	2.28

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有沪港通股票。

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	300424	航新科技	6,000	296,380.00	1.16
2	300347	泰格医药	5,400	145,854.00	0.57
3	002284	亚太股份	10,000	140,700.00	0.55

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	4,992,600.00	19.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,006,000.00	39.20
	其中:政策性金融债	10,006,000.00	39.20
4	企业债券	4,857,025.00	19.03
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	605,920.00	2.37
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,461,545.00	80.16

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	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150212	15国开12	100,000	10,006,000.00	39.20
2	010213	02国债(3)	30,000	2,999,400.00	11.75
3	019546	16国债18	20,000	1,993,200.00	7.81
4	122837	11武经发	10,720	1,094,833.60	4.29
5	122800	10杨浦02	10,000	995,300.00	3.90

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十名资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

报告期末本基金未投资贵金属。

5.8 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

本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.10.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,486.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	361,724.89
5	应收申购款	1,200.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	369,410.50

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	110035	白云转债	373,680.00	1.46
2	113009	广汽转债	232,240.00	0.91

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金持有的前十名股票中不存在流通受限的股票。

5.10.6 本报告涉及合计数相关比例的,均以合计数除以相关数据计算,而不是对不同比例进行合计。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	45,285,240.54
报告期期间基金总申购份额	29,067,727.49
减:报告期期间基金总赎回份额	49,351,676.12
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	25,001,291.91

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金申购、赎回本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、原泰信中短期债券投资基金基金份额持有人大会经中国证监会证监基金字[2007]293号文核准的文件

2、《泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同》

3、《泰信双息双利债券型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信双息双利债券型证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

8.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的办公场所,供投资者免费查阅。在支付必要的工本费后,投资者可在有效的工作时间内取得本报告及上述备查文件的复制件或复印件。

8.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站(www.ftfund.com)查阅上述相关文件,或拨打客户服务中心电话(400-888-5988,021-38784566),和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司
2017年1月20日

泰信天天收益货币市场基金

2016 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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2017年1月20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。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据基金合同已于2017年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

经泰信天天收益开放式证券投资基金基金份额持有人大会表决通过,并报中国证监会备案。自2016年5月17日起修订后的《泰信天天收益货币市场基金基金合同》生效,原《泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同》失效。本次持有人大会对《基金合同》的相关内容进行修改,包括变更基金名称、根据最新法律法规、证监会规范性文件要求修改原合同中部分条款及措辞、调整组合的投资范围和投资比例、对基金份额进行分类等。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信天天收益货币
交易代码	290001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年5月17日
报告期末基金份额总额	2,068,835,008.40份
投资目标	确保本金安全和资产的充分流动性,追求超过业绩比较基准的现金收益。
投资策略	运用久期控制、类别配置和无风险套利等投资策略追求低风险稳定收益并保持基金资产的最佳流动性。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、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	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	泰信天天收益A	泰信天天收益B	泰信天天收益E
下属分级基金的交易代码	290001	002234	002235
报告期末下属分级基金的份额总额	125,746,750.82份	1,933,085,386.07份	2,871.51份

§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(2016年10月1日 - 2016年12月31日)		
	泰信天天收益A	泰信天天收益B	泰信天天收益E
1. 本期已实现收益	630,249.62	9,145,303.77	6.68
2. 本期利润	630,249.62	9,145,303.77	6.68
3. 期末基金资产净值	125,746,750.82	1,933,085,386.07	2,871.51

注:1、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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润