

## 泰信先行策略开放式证券投资基金

[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:中国光大银行股份有限公司

报告送出日期:2017年1月20日

## § 1 重要提示

本基金托管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、准确性完整性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人中国光大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。

本报告告期中未发生诉讼案件。

本报告告期为2016年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金产品概况	
交易代码	
基金简称	泰信先行策略
基金合同生效日	2016年9月1日
报告期末基金资产净值	1,106,360,772.76
报告期末基金份额净值	1.0000
投资目标	本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，追求长期的长期回报和资本增值，同时兼顾当期收入。
投资策略	本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，追求长期的长期回报和资本增值，同时兼顾当期收入。
业绩比较基准	沪深300指数×65%+中证债券指数×35%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于高风险、高收益的基金品种。
基金管理人	泰信基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期:2016年10月1日 - 2016年12月31日

主要财务指标

报告期初基金资产净值:1,097,862,110.00

报告期末基金资产净值:1,106,360,772.76

报告期基金净值增长率为:1.00%

报告期基金份额净值增长率为:1.00%

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示数字。

## 3. 基金净值表现

3.1 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

单位:人民币元

报告期初基金份额净值:1.0000

报告期末基金份额净值:1.0000

净值增长率为:0.00%

同期业绩比较基准收益率:0.00%

净值增长率为:0.00%

注:本基金业绩比较基准为:1.65%×沪深300指数+3.5%×中债国债指数

3.2 自基金合同生效以来基金累计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:1. 本基金合同于2016年9月1日正式生效。

2. 本基金在建仓期为六个月。建仓期间各项投资比例符合基金合同关于投资组合的相关规定。本基金组合投资的基本比例为:股票资产30%~95%，债券资产0%~65%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不高于基金净资产的5%。

## 4. 管理人报告

4.1 以上期间均为指公司公告的日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法》的相关规定。

在本报期内,本基金管理人严遵《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信先行策略开放式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,取信于社会的原则和保护基金资产。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取最大利益,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。

4.2 公平交易专项说明

4.2.1 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》(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、授权分析、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,发现可疑交易立即报告,并由风险管理部负责公平交易情况定期和不定期评估。

公司所有研究及公司管理的具有产品公平开放,基金管理严格遵守公平、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开,投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内,本基金投资的证券交易所公开竞价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。

4.2.2 异常交易行为的专项说明

本基金在建仓期中不存在日均反向交易,严格禁止可能导不公平交易和利益输送的同日反向交易,未出现成交较少的单边交易量超过该证券日成交量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

四季度走势平稳后启动,10月11月内地、制造业投资企稳向好,政策刺激剂增多,混合所有制改革试点试点出对提升了市场的风险偏好,推动了市场的上行。12月份流动性收紧以及金融市场风险暴露降低投资者风险偏好,市场呈现一定程度的回调。本基金四季度立足于基本面,配置集中于业绩企稳回升的整体行业配置较好。

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0.6186元,本季度净值增长率为-3.39%,同期业绩比较基准增长率为-0.008%。

## 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位:人民币元

报告期初基金资产总额:961,640,032.00

报告期末基金资产总额:961,640,032.00

占基金资产净值比例(%):97.71

货币资金:10,000.00

银行存款:10,000.00

应收申购款:0.00

应收赎回款:0.00

应收证券清算款:20,000,000.00

应收利息:1.00

应收股利:0.00

应收申购款:0.00

应收赎回款:0.00

应收证券清算款:0.00

应收利息:0.00

应收股利:0.00