

泰信鑫益定期开放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：中信银行股份有限公司
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。

本基金的托管人中信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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

§ 2 基金产品概况

5.1 报告期末基金资产组合情况		
序号	项目	金额(元)
1	权证投资	-
2	银行存款	-
3	应收利息	190,491,063.20
4	买入返售金融资产	190,491,063.20
5	应收账款	-
6	预付款项	-
7	其他应收款	-
8	存货	-
9	一年内到期的可赎回基金份额	6,456,429.27
10	其他资产	3,272,039.00
11	合计	199,779,524.47
	占基金资产的比例(%)	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

报告期末本基金未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通股票投资组合

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

5.4 报告期末按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	国债	190,360.00	0.10
2	地方政府债	-	-
3	企业债	109,372,000.00	59.30
4	公司债	109,372,000.00	59.30
5	金融债	24,302,760.00	12.22
6	企业票据	24,343,000.00	12.49
7	资产支持证券	20,311,372.00	11.07
8	回购协议	1,366,337.20	0.69
9	可转债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	199,491,063.20	100.00

§ 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

报告期(2016年10月1日 - 2016年12月31日)		基金净值变动幅度 (%)
1. 利润总额	100.382740	
2. 本期利润	-1,029,030.00	-105.77%
3. 本期已实现收益	-1029.03	-105.77%
4. 本期分配利润	134,160,262.29	64,703,707.45
5. 期末可供分配利润	1,045	

3.2 报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

泰信鑫益定期开放A

注：本基金业绩比较基准为：中国人民银行公告的一年定期存款基准利率(税后)+0.5%

2. 所述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

泰信鑫益定期开放A

注：本基金于2013年7月17日正式生效。

2. 本基金在每个交易日为一个开放周期，建仓期间本基金的投资操作将符合基金合同的相关规定；报告期内本基金的前3个月以及开放期的前10个工作日和后10个工作日，自由开放的前3个月以及3个月开放期以及非开放期投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或到期日为同一日内以政府债券占基金净资产的二级限制，但在开放期本基金持有现金或到期日在一年以内政府债券不低于基金净资产的9%。

3.2.1 本基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

泰信鑫益定期开放C

注：本基金业绩比较基准为：(1+定期存款基准利率(税后)+0.5%)×0.95%

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

泰信鑫益定期开放C

注：本基金业绩比较基准为：(1+定期存款基准利率(税后)+0.5%)×0.95%

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投资明细

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

报告期末本基金未持有权证。

5.9 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股指期货投资明细

报告期末本基金未投资股指期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金报告期内地购买股票的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

5.10.2

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购或增发新股。

5.10.3 其他资产构成

序号	类别	金额(元)
1	货币市场基金	1,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	3,272,039.00
5	应收申购款	-
6	买入返售金融资产	-
7	应收票据	-
8	应收账款	-
9	预付款项	-
10	其他应收款	-
11	合计	3,272,039.00

注1：本基金合同于2013年7月17日正式生效。

2. 本基金在每个交易日为一个开放周期，建仓期间本基金的投资操作将符合基金合同的相关规定；报告期内本基金的前3个月以及开放期的前10个工作日和后10个工作日，自由开放的前3个月以及3个月开放期以及非开放期投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或到期日为同一日内以政府债券占基金净资产的二级限制，但在开放期本基金持有现金或到期日在一年以内政府债券不低于基金净资产的9%。

3.2.1 本基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

泰信鑫益定期开放A

注：本基金业绩比较基准为：(1+定期存款基准利率(税后)+0.5%)×0.95%

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

泰信鑫益定期开放C

注：本基金业绩比较基准为：(1+定期存款基准利率(税后)+0.5%)×0.95%

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投资明细

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

报告期末本基金未持有权证。

5.9 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股指期货投资明细

报告期末本基金未投资股指期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金报告期内地购买股票的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

5.10.2

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购或增发新股。

5.10.3 其他资产构成

序号	类别	金额(元)
1	货币市场基金	1,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	3,272,039.00
5	应收申购款	-
6	买入返售金融资产	-
7	应收票据	-
8	应收账款	-
9	预付款项	-
10	其他应收款	-
11	合计	3,272,039.00

注1：以上日期即是指公司公告的日期。

2. 证券从业的含义从行业协会《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合规性情况的说明

报告期末本基金未持有权证。

5.10.4 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可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金未投资股票。

5.10.6 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

项目	泰信鑫益定期开放A	泰信鑫益定期开放C
报告期初基金资产总额	127,363,136.00	61,063,240.00
报告期初基金份额总额	30,000,000.00	20,400,000.00
报告期初基金资产净值	-	-
报告期末基金资产总额	127,363,137.00	61,063,241.00