泰信发展主题混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

基金管理人:泰信基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2017年3月30日

§1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。
普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。
本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。
本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰信发展主题混合
基金主代码	290008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月15日
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
报告期末基金份额总额	60,304,885.61份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	充分把握中国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，分享中国经济社会在科学发展、和谐发展和可持续发展过程中的投资机遇。在严格控制投资风险的条件下，力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。
投资策略	本基金的股票资产采用以“核心主题投资为主，卫星主题投资和非主题类投资为辅”的投资策略，并考虑组合品种的估值风险和大类资产的系统风险，通过品种和仓位的动态调整降低资产的波动风险。
业绩比较基准	75%×沪深300指数+25%×中证全债指数
风险收益特征	本基金作为混合型基金，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。本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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡图	郭明
	联系电话	021-20899098	(010)66106799
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-5988	95588
传真		021-20899008	(010)66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ftfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

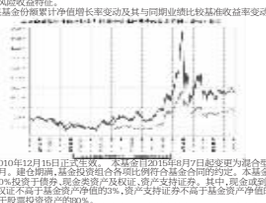
金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	-7,606,087.88	81,049,284.03	58,757,199.12
本期利润	-16,536,108.88	46,067,390.37	83,855,718.09
加权平均基金份额本期利润	-0.2542	0.5319	0.4624
本期基金份额净值增长率	-18.41%	24.85%	52.25%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.1211	0.3745	0.2779
期末基金资产净值	67,609,813.23	74,321,608.62	212,959,620.49
期末基金份额净值	1.121	1.374	1.489

注:1.本基金基金合同于2010年12月15日正式生效。
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.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。
4.期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
3.2 基金净值表现
3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	1.26%	0.90%	0.88%	0.55%	0.38%	0.35%
过去六个月	-1.32%	0.90%	3.85%	0.57%	-5.17%	0.33%
过去一年	-18.41%	1.74%	-7.71%	1.05%	-10.70%	0.69%
过去三年	56.09%	2.18%	40.11%	1.34%	14.98%	0.84%
过去五年	96.71%	1.86%	41.39%	1.22%	54.32%	0.64%
自基金合同生效起至今	51.67%	1.75%	12.38%	1.18%	39.29%	0.57%

注:本基金的业绩比较基准为:75%×沪深300指数+25%×中证全债指数。
1.沪深300指数,编制合理科学性,运用广泛,对中国A股市场具有较强的代表性和权威性。
2.中证全债指数以银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券为样本,是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,具有良好的债券市场代表性,运用较为广泛。选择该业绩比较基准能够真实反映本基金长期动态的资产配置目标和风险收益特征。
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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.本基金基金合同于2010年12月15日正式生效。 本基金自2014年4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,基金投资组合各项比例符合基金合同的约定。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%。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%。
3.经泰信基金管理有限公司总办会审议决定,由钱鑫先生担任本基金基金经理,车广路先生不再担任本基金基金经理。具体详情请见2016年1月27日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信发展主题混合型证券投资基金经理变更的公告》。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
基金管理人:泰信基金管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区浦东南路256号华夏银行大厦37层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区浦东南路256号华夏银行大厦36-37层
成立日期:2003年5月23日
法定代表人:王小林
总经理:戴帆
电话:021-20899188
传真:021-20899008
联系人:徐丽
发展沿革:
泰信基金管理有限公司(First-Trust Fund Management Co.,Ltd.)是郑山东省国际信托投资有限公司(现更名为山东省国际信托股份有限公司)联合江苏省投资管理有限责任公司共同发起设立的基金管理公司。公司于2002年9月24日经中国证券监督委员会批准正式筹建,2003年5月8日获准开业,是以信托投资公司为主发起人而发起设立的基金管理公司。
公司目前下设上海投融资产管理有限公司、市场部、产品部、营销部(分华东、华北、华南三大营销中心)、理财顾问部、深圳分公司、北京分公司、电子商务部、客服中心、基金投资部、研究部、专户理财部、清算会计部、集中交易部、计划财务部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部。截至2016年12月底,公司有正式员工108人,多数具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。
截至2016年12月31日,泰信基金管理有限公司旗下共有泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信民丰连通混合、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选混合、泰信债券增强收益、泰信发展主题混合、泰信债券周期回报、泰信中证200指数、泰信中小盘精选混合、泰信行业精选混合、泰信行业轮动混合、泰信风尚灵活配置混合、泰信鑫益定期开放债券、泰信国策驱动混合、泰信鑫选混合、泰信互联网+混合、泰信智选成长共19只开放式基金及泰信乐利均一、泰信鑫悦1号、泰信鑫悦2号、泰信鑫稳健1号、泰信价值1号、泰信添鑫券分红1号、泰信添鑫券分红2号、泰信添鑫债券分红3号、泰信中证新目标专享、泰信财达添利1号、泰信财达添利2号、泰信一善一号、泰信合江一号、泰信鑫其保本1号、泰信鑫其保本2号、泰信鑫其3号保本、泰信鑫其4号保本、泰信鑫惠1号保本、泰信鑫惠2号保本、泰信中融联诚旭进一期、泰信洛肾1号、泰信洛肾2号、泰信慧享一号、泰信鑫鑫2号、泰信中融联诚旭进二期共22个开放式基金的管理人。
4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
钱鑫先生	本基金经理兼泰信互联网+基金经理	2016年1月27日	-	7年	硕士,具有基金从业资格。曾任华为海思半导体任产品市场经理,上海际源投资发展有限公司TMT行业研究员。2012年3月加入泰信基金管理有限公司,在研究部担任高级研究员岗位,自2013年7月起任先行策略基金经理助理。自2014年5月20日起至2016年6月30日担任泰信先行策略基金经理;自2016年6月18日起担任泰信互联网+主题基金经理。
车广路先生	本基金经理兼泰信蓝筹精选混合、泰信国策驱动混合基金经理	2014年6月21日	2016年1月27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3日至2014年6月21日任泰信蓝筹精选混合基金经理。自2015年2月5日起担任泰信蓝筹精选混合基金经理。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.基金经理的任期日期以基金合同生效日为准。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
3.经泰信基金管理有限公司总办会审议决定,由钱鑫先生担任本基金基金经理,车广路先生不再担任本基金基金经理。具体详情请见2016年1月27日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信发展主题混合型证券投资基金经理变更的公告》。
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》、《泰信发展主题混合型证券投资基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在投资决策、风险控制、基金会计核算、信息披露、基金份额登记等方面,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律法规和基金合同的规定。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度和控制方法
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《泰信基金管理有限公司公平交易制度》,主要内容如下:
1.建立统一的研究平台,所有研究成果对公司所有基金组合开放,并向投资决策委员会报告。
2.建立全公司投资对象备选库和各投资组合的投资对象备选库。
3.投委会作为公司投资决策委员会,为各基金组合提供投资决策意见。
4.投资组合经理应在其权限范围内进行投资决策。投资组合经理在其权限范围内进行投资决策,投资总监在其权限范围内审批超出投资组合经理权限的投资计划。投资组合经理在其权限范围内进行投资决策,并向投委会报告。
5.投资组合经理同时管理多个投资组合时,必须公平公正的对待管理的所有投资组合,除中期赎回、个股投资比例超标等客观因素之外,同一投资品种的买卖价格相同或相近的交易价格。
产品投资决策委员会对投资组合经理的日常投资决策进行有效监督,并在投资决策委员会例会上对投资决策的执行情况进行检查。
6.集中交易室负责所有投资组合的执行,必须确保所有同时段内的公平公正,审核对违所有投资组合。
7.公司应当在日常投资管理中,根据投资品种的特性,对投资组合的投资决策、交易执行、交易价格、交易时间等因素进行合理的安排,并在投资决策、交易执行、交易价格、交易时间等方面,制定公平交易的具体操作规程,并定期对公平交易的执行情况进行检查。
8.公司应当建立公平交易的风险控制机制,对公平交易的风险进行评估、对策制定、实施控制、内部监察等各项工作,并定期对公平交易的风险进行检查,并在投资决策委员会例会上对公平交易的风险控制机制进行评估。
9.公司应当建立公平交易的信息技术系统,以及所有投资管理活动、涵盖投资、研究分析、投资决策、交易执行、结算、风控、内部监察、绩效考核等投资管理活动各环节,从时间、投资、交易合规性监控,及投可疑交易记录报告,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有的基金组合开放,投委会根据投资决策委员会的决定,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,投资交易数据完整于整个投资过程。
本报告期内,投资交易数据与合规部分析未发现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,本基金参与的交易品种公司日报公开披露的单笔交易量达到该证券当日成交量5%的情况。
4.4 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2016年开年,在“熔断”的冲击下,市场情绪低迷,大盘长时间解禁等一系列因素作用影响下,市场出现了5178点以来的第三波大幅下跌,随后二、三月份期间,成长类个股相继迎来一波反弹潮,本基金在1月份保持了相对较低仓位,避免了深幅下跌,在市场逐渐企稳后重点布局参与了供给侧改革方向,随机参与了煤炭、化工、有色等品种,在均衡配置的基础上,三月份部分仓位切换到中小创个股,取得了一定的投资收益。
2季度权威人士关于中国经济判断对年初以来形成的市场预期产生了影响,经济强复苏与流动性持续宽松的预期被修正,在形成新的一致预期过程中,业绩确定高增长的银行业板块和高弹性受益、主题类投资机会受到市场青睐,6月份关于中国加入MSCI、美联储加息会议、英国脱欧等不确定事件使内大盘指数在震荡上行,而中小盘指数在不断创新低,本基金在2季度进行了积极调仓,配置了行业高景气、业绩高增长的白酒、消费板块,参与了电子半导体、物联网、区块链等符合产业大趋势的主题类投资机会,谋求消费与成长均衡配置。
3季度开始出现了一波震荡强反弹(上证指数为例涨20%左右),但仅处在价值业绩弹跳的节奏中。相比仓位管理,报告期内本基金更为着眼于结构的优化调整,配置上突出对业绩确定性的重视,以基本面有持续性改善的行业和个股为重点布局方向,积极寻找各种结构性机会,参与了受益财政刺激政策的PPP概念(航交、园林、环保PPP等),国家重点扶持的半导体国产化受益个股,行业高景气业绩兑现较好的苹果产业链,并对前期涨幅较大的品种减仓,并对前期涨幅较大的煤炭个股进行了处理。
4季度在十一期间多地出台房地产调控政策的背景下,市场对楼市资金分流的预期提升了风险偏好,保险机构的接连举牌动作带动了市场人气并形成一定的投资主线,美国大选尘埃落定,特朗普加大基建投资等施政预期确定了周期、基建、一带一路等概念投资,十八届六中全会和年底中央经济工作会议的召开为下一年的经济工作定调及相关投资思路预期了方向,本基金积极应对市场变化带来的投资机会,以基本面有持续性改善为配置原则,除长期的医药配置品种以外,基于大宗商品价格持续上涨的较佳重点配置了煤炭板块,基于特朗普胜选的施政思路参与了一带一路、有色等板块投资,11月份参与了依新股行情,12月份加重品种参与了券商、煤炭、供给侧改革等方向,取得了不错的投资效果。
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末,本基金单位净值为1.121元,净值增长率为-18.41%,同期业绩比较基准收益率为-7.71%。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望2017年,我们认为随着库存周期的逐步展开,实体经济将迎来一轮盈利复苏的改善,特别对于过去几年行业产能去化明显,竞争格局优化的行业龙头公司,盈利修复/ROE回升的持续性可期,产业链传导比将出现传递到中下游。同时,在利率上行的市场情景下,过去所谓的“高估值”,基于PE、PEG的视角而变低估值中枢下移的压力,在实体经济的复苏转换具备优质资产、行业格局好定价能力强的行业龙头公司的估值修复。我们上半年看好以化工、钢铁、造纸为代表的中游行业机会,白酒、家电为代表的稳定消费类投资机会,同时关注充分调整的优质成长类个股机会。
展望2017年下半年的十九大会议将回顾未来几年经济发展改革方向,我们看好相关的供给侧改革、国资国企改革带来的投资机会。5月14日将在北京召开“一带一路”国际会议,这一历史发展机遇也将带来相关投资机会。
市场风险方面,我们测算无注定实体经济复苏可持续性,特别是执政后全球贸易以及地缘冲突可能的风险。
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况
在本报告期内,本基金管理人内部控制工作本着对基金份额持有人利益高度负责的精神,以独立于各业务部门的风险管理部、监察稽核部为主体,对基金销售、投资运作、后台保障等主要业务活动进行监督与控制,较好地保证了基金运作的合规性。
1.进一步完善制度建设,构建全面有效的内部控制体系
本基金管理人根据最新出台的相关法律法规,及时补充及完善了内部管理制度,同时对业务流程进一步梳理,严格按照监管要求进行风险控制评估,确保风险控制的有效性,不断提升内部控制水平。
2.进一步规范基金投资管理工作流程,加强基金投资风险控制
(1)加强基金的日常投资关键进行监控,及时提示相关风险。公司风险管理部负责基金日常投资行为的监控,并与相关基金经理沟通,提示相关风险。同时根据投委会的投资决议对风险指标设置进行调整,不定期检查风险监控指标设置,并根据新的需求对风险监控指标进行测试和更新。特别是在2015年7、8月间加强了对旗下公募基金所持停牌股票的流动性指标监测。为公募基金管理机构投资决策提供及时准确的风险信息与提醒,提示投资经理“注意频率风险”。
(2)规范投资交易行为,防范交易环节的操作风险。公司禁止基金内部的同日反向交易,严格控制旗下管理投资组合间的同日反向交易,前期了基金间同日同向交易,并在投资组合对单笔交易量或交易占其市场总成交量等指标预警。对于日常的投资监控,公司实行的是事前控制、事中监督、事后检查的方法,在公平交易的环节上建立了责任追究制,实行各部门责任人、分管领导责任人负责制,以最大限度地监控并处置可能造成不公平交易或利益输送的行为。
3.日常监察与专项稽核相结合,深入开展各项监察稽核工作。包括对基金销售、宣传材料、客户服务、投资执行、信息披露、应用系统管理、基金投资组合风险管理、异常交易监控等方面进行专项稽核。通过日常监察与专项稽核的方式,保证了内部监察稽核的全面性、实时性,强化了风险控制流程,提高了业务部门及人员的风险意识水平,从而较好地预防风险。
4.做好投研交易等人员的合规培训,提高合规意识。公司组织投研人员开展内幕交易案例合规培训,就近年来发生的典型内幕交易案例作了分析、报告,并对目前市场上的疑似内幕交易、操纵市场交易案例进行了说明,要求投研人员遵守投资纪律,规范决策流程,从源头避免内幕交易事件的发生,加强了投研人员的合规意识。
5.公司采用技术手段对网站、交易、行情等进行屏蔽,对其他非受控方式上网及随时通讯软件进一步规范,加强投研人员的投资管理,对公司证券投资决策委员会、投资组合经理、研究员、交易员、基金经理、证券投资部、风控部、监察稽核部等人员的投资行为进行了监督,要求投研人员遵守投资纪律,规范决策流程,从源头避免内幕交易事件的发生,加强了投研人员的合规意识。
6.公司建立了公司内部信息传递、流转、使用等流程,对公司内部信息的传递、流转、使用等进行了监督,要求投研人员遵守投资纪律,规范决策流程,从源头避免内幕交易事件的发生,加强了投研人员的合规意识。
7.公司建立了投研人员的投资管理、证券投资、证券研究、证券交易、基金经理、证券投资部、风控部、监察稽核部等人员的投资行为的监督,要求投研人员遵守投资纪律,规范决策流程,从源头避免内幕交易事件的发生,加强了投研人员的合规意识。
在本报告期内,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律法规和基金合同的规定。
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
4.7.1 基金管理有限公司估值程序等事项的说明
委员会主席:
韩政先生,本科学历。2002年加入泰信基金管理公司,现任公司副总经理。
委员会成员:
周国防先生,硕士。2002年加入泰信基金管理有限公司,现任公司风控管理部总监。
蔡甬成先生,硕士。2013年加入泰信基金管理有限公司,现任公司清算会计部总监。
朱志权先生,学士。2008年6月加入泰信基金管理有限公司,现任基金投资部总监兼投资总监,泰信优势增长基金基金经理。
梁炯先生,硕士。2004年7月加入泰信基金管理有限公司,现任研究部副总监兼研究副总监。
2.本基金基金经理不参与本基金估值。
3.参与估值流程各方之间不存在利益大相冲突。
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
1.基金合同关于利润分配的约定
(1)基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资两种,投资人可选择获取现金红利,或将分红资金按权益登记日该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金红利。
(2)每一基金份额享有同等分配权。
(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。
(4)在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年最多为12次。
(5)每次基金收益分配比例不低于该次收益分配基准日可供分配利润的50%。基金合同生效不满三个月,收益可不分配。
(6)基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过15个工作日。
(7)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。
2.本报告期,本基金未进行利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
本报告期内,本基金托管人在对泰信发展主题混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全忠诚地履行了基金托管人应尽的义务。
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内,泰信发展主题混合型证券投资基金的管理人——泰信基金管理有限公司在泰信发展主题混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,泰信发展主题混合型证券投资基金未进行利润分配。
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人依法对泰信基金管理有限公司编制和披露的泰信发展主题混合型证券投资基金2016年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,认为内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第20997号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰信发展主题混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的泰信发展主题混合型证券投资基金(原泰信发展主题股票型证券投资基金,以下简称“泰信发展主题混合基金”)的财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表,2016年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是泰信发展主题混合基金的基金管理人泰信基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映; (2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,上述泰信发展主题混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了泰信发展主题混合基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况。

注册会计师的姓名	毕峰	傅琛慧
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼	
审计报告日期	2017年3月24日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表
会计主体:泰信发展主题混合型证券投资基金
报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资 产:		
银行存款	12,647,641.72	10,063,641.01
结算备付金	616,630.09	447,446.26
存出保证金	89,599.23	112,785.21
交易性金融资产	51,980,428.42	59,528,469.60
其中:股票投资	51,980,428.42	59,528,469.60
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	4,439,229.68	4,788,887.29
应收利息	2,989.91	1,689.59
应收股利	-	-
应收申购款	198.80	108,403.59
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	69,776,717.85	75,061,322.56
负债和所有者权益	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负 债:		
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	1,468,403.18	-
应付赎回款	-	27,916.90
应付管理人报酬	87,648.15	98,347.14
应付托管费	14,608.03	16,391.20
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	315,745.26	216,505.65
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	280,500.00	370,553.04
负债合计	2,166,904.62	729,713.93
所有者权益:		
实收基金	60,304,885.61	54,071,921.53
未分配利润	7,304,927.62	20,249,687.09
所有者权益合计	67,609,813.23	74,321,608.62
负债和所有者权益总计	69,776,717.85	75,061,322.56

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.121元,基金份额总额60,304,885.61份。
7.2 利润表
会计主体:泰信发展主题混合型证券投资基金
本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入	-12,435,979.47	51,842,838.82
1.利息收入	117,054.96	118,827.51
其中:存款利息收入	113,888.29	107,088.06
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	3,166.67	11,739.45
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-3,632,081.28	86,620,657.33
其中:股票投资收益	-3,771,023.88	86,343,782.96
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	138,942.60	276,874.37
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-8,930,021.00	-34,981,893.66
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	9,067.85	85,247.64
减:二、费用	4,100,129.41	5,775,448.45
1. 管理人报酬	1,088,065.04	2,028,347.94
2. 托管费	181,344.19	338,058.01
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,536,170.18	3,024,238.50
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	294,550.00	384,804.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-16,536,108.88	46,067,390.37
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-16,536,108.88	46,067,390.37

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:泰信发展主题混合型证券投资基金
本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	54,071,921.53	20,249,687.09	74,321,608.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-16,536,108.88	-16,536,108.88
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	6,232,964.08	3,591,349.41	9,824,313.49
其中:1.基金申购款	25,249,491.50	4,874,606.64	30,124,098.14
2.基金赎回款	-19,016,527.42	-1,283,257.23	-20,299,784.65
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	60,304,885.61	7,304,927.62	67,609,813.23

项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	143,050,560.73	69,909,059.76	212,959,620.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	46,067,390.37	46,067,390.37
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-89,978,639.20	-58,033,694.48	-147,012,333.68
其中:1.基金申购款	49,783,827.40	25,296,379.91	75,079,207.31
2.基金赎回款	-139,762,466.60	-83,329,074.39	-222,091,540.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-37,693,068.56	-37,693,068.56
五、期末所有者权益(基金净值)	54,071,921.53	20,249,687.09	74,321,608.62

注:报表附注为财务报表的组成部分。
本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:
葛帅 韩政 蔡甬成
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人
7.4 报表附注
7.4.1 基金基本情况
泰信发展主题混合型证券投资基金以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]1280号《关于核准泰信发展主题股票型证券投资基金募集的批复》核准,由泰信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信发展主题股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,754,077,000元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司验资并出具了普华永道中天验字(2010)第405号验资报告予以验证。经中国证监会备案,《泰信发展主题股票型证券投资基金基金合同》于2010年12月15日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为707,192,791.05份基金份额,其中认购资金利息折合3,781,714.05份基金份额。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。
根据《2014年中国证监会令第74号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,泰信发展主题股票型证券投资基金于2015年8月7日公告后更名为泰信发展主题混合型证券投资基金。
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信发展主题混合型证券投资基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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%。本基金的业绩比较基准为:75%×沪深300指数+25%×中证全债指数。
本财务报表由本基金的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于2017年3月24日批准报出。
7.4.2 会计报表的编制基础
本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定以上合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号-年度报告和半年度报告》、中国证券投资基金业协会以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信发展主题股票型证券投资基金合同》和在财务报表附注7.4.6所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。
7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
本基金2016年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2