# 泰信中小盘精选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 | 泰信中小盘精选混合 |
| 基金主代码 | 290011 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011年10月26日 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 48,720,439.55份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金通过投资具有高成长潜力的中小盘股票,追求基金资产的长期稳定增值。在严控风险的前提下,力争获取超越业绩基准的稳健收益。 |
| 投资策略 | 本基金将结合“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”的个股精选策略,重点投资于萌芽期和成长期行业中具有持续成长潜力以及未来成长空间广阔的中小型上市公司,同时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 | 中证700指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,主要通过发掘具有高成长潜力的中小盘股票实现基金资产增值,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。 |

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 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 胡囡 | 王永民 |
| | 联系电话 | 021-20899098 | 010-66594896 |
| | 电子邮箱 | xxpl@ftfund.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-888-5988 | 95566 |
| 传真 | | 021-20899008 | 010-66594942 |

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 | http://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 | -18,390,647.90 | 190,543,311.14 | 119,334,824.13 |
| 本期利润 | -49,839,246.81 | 232,344,135.08 | 118,959,187.32 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.4089 | 0.8246 | 0.6268 |
| 本期基金份额净值增长率 | -17.30% | 42.06% | 47.91% |
| 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 | 0.7560 | 1.1487 | 0.6668 |
| 期末基金资产净值 | 85,552,706.87 | 356,733,059.52 | 575,762,668.85 |
| 期末基金份额净值 | 1.756 | 2.272 | 1.667 |

注:1、本基金合同于2011年10月26日正式生效。

2、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。

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

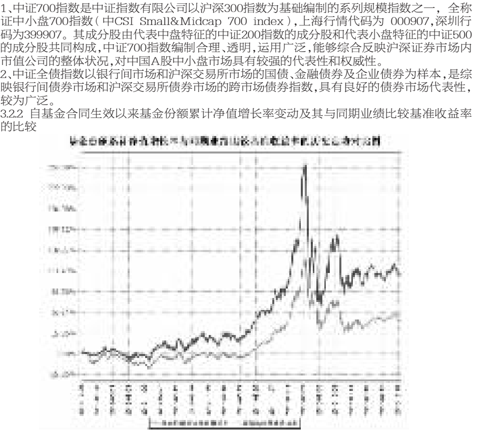
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 2.15% | 1.04% | -0.93% | 0.64% | 3.08% | 0.40% |
| 过去六个月 | -4.46% | 0.98% | 2.35% | 0.71% | -6.81% | 0.27% |
| 过去一年 | -17.30% | 1.71% | -13.43% | 1.45% | -3.87% | 0.26% |
| 过去三年 | 73.77% | 2.09% | 47.95% | 1.63% | 25.82% | 0.46% |
| 过去五年 | 107.90% | 1.80% | 63.01% | 1.46% | 44.89% | 0.34% |
| 自基金合同生效起至今 | 105.62% | 1.77% | 44.80% | 1.45% | 60.82% | 0.32% |

注:本基金业绩比较基准为:中证700指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%

1、中证700指数是中证指数有限公司以沪深300指数为基础编制的系列规模指数之一, 全称为中证中小盘700指数(中CSI Small&Midcap 700 index),上海行情代码为 000907,深圳行情代码为399907。其成分股由代表中盘特征的中证200指数的成分股和代表小盘特征的中证500指数的成分股共同构成,中证700指数编制合理、透明,运用广泛,能够综合反映沪深证券市场内中小市值公司的整体状况,对中国A股中小盘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。

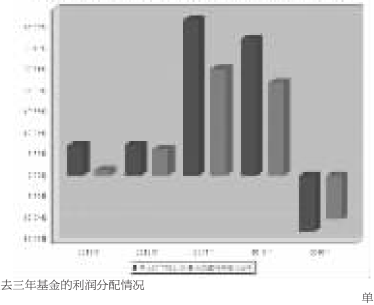
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金合同于2011年10月26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,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%,债券、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规和监管机构的规定执行。本基金投资于中小盘股票的比例不低于股票投资资产的80%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2016 | 1.350 | 15,029,307.21 | 3,339,791.47 | 18,369,098.68 | |
| 2015 | 0.700 | 20,777,119.50 | 3,274,373.96 | 24,051,493.46 | |
| 2014 | - | - | - | - | |
| 合计 | 2.050 | 35,806,426.71 | 6,614,165.43 | 42,420,592.14 | |

注:1、本基金的基金管理人于2015年1月6日宣告2014年度第一次分红,向截至2015年1月8日止在本基金注册登记人泰信基金管理有限公司 登记在册的本基金持有人,按每10份基金份额派发红利0.700元。

2、本基金的基金管理人于2015年12月31日宣告2015年度第一次分红,向截至2016年1月6日止在本基金注册登记人泰信基金管理有限公司 登记在册的本基金持有人,按每10份基金份额派发红利1.35元。

## §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:葛航
电话:021-20899188
传真:021-20899008
联系人:徐磊
发展沿革:

泰信基金管理有限公司(First-Trust Fund Management Co.,Ltd.)是原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、青岛国信实业有限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。

公司目前下设上海锐懿资产管理有限公司、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、专户投资部、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、泰信优质生活混合、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、泰信中证基本面400指数分级、泰信现代服务业混合、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5号、泰信鲁信1号、泰信磐晟稳健1号、泰信价值1号、泰信添盈债券分级1号、泰信添盈债券分级2号、泰信中行新时代6号、泰信财达添利1号、泰信财达添利2号、泰信-合信一号、泰信合信三号、泰信融昇保本1号、泰信融昇保本2号、泰信融昇3号保本、泰信融昇4号保本、泰信融嘉1号保本、泰信融嘉2号保本、泰信中融景诚旭诚一期、泰信洛肯1号、泰信洛肯2号、泰信易享一号、泰信融鑫2号、泰信中融景诚旭诚固收1号、泰信融昇5号、泰信财达添利3号共25个资产管理计划。

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 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 刘杰先生 | 本基金经理兼泰信优质生活混合基金经理 | 2015年3月17日 | - | 7年 | 研究生硕士。具有基金从业资格。2009年7月加入泰信基金管理有限公司,先后担任研究部助理研究员、研究员、高级研究员兼专户投资部投资顾问。自2016年12月1日起担任泰信优质生活混合基金经理。 |

注:1、基金经理的任职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。

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》、《泰信中小盘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》,主要控制方法如下:

1、建立统一的研究平台,所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放。

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、投委会作为公司受托资产投资的最高决策机构,主要负责对公司所管理的受托资产进行投资决策。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。

4、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,除申购赎回、个股投资比例超标等客观因素之外,同一交易日投资同一交易品种时,应尽可能使他们获得相同或相近的交易价格。

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。

5、集中交易室负责所有投资指令的执行,必须确保所有同向指令的公平公正,平等对待所有投资组合。发现异常指令或者涉嫌利益输送的指令,交易室应立即停止执行指令,并向投资总监和风险管理部报告。对非竞争类价指令,不同投资组合也必须公平对待,主要采取成交结果按比例分配和轮候方式处理。

6、风险管理部通过交易系统监控指标设置,实时监控交易指令,禁止同一投资组合内部的同日反向交易,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。

7、公司在交易系统中设置强制公平委托参数,强制交易系统对符合要求的同一交易品种的同向指令执行公平委托。

8、风险管理部定期与不定期对交易指令的公平性和交易委托的公平性进行分析,对强制公平委托的执行过程与结果进行检查;对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析,并完成定期分析报告。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司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,投资经理严格遵守公平、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。

4.3.3 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。

4.4 管理人对报告期内基金的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年上半年,市场整体表现为快速回落筑底企稳的走势。一月份指数单边下跌,上证指数创自去年5月份调整以来新低,恐慌情绪再度蔓延市场;二月开始,市场逐步企稳,春节后逐步浮出水面的宏观经济数据显示经济有企稳迹象,加之海外市场对国内影响较为正面,指数呈现出区间震荡并缓慢走高的趋势。经历了一季度末行业、板块的轮番表现后,大盘指数在二季度趋于稳定,但局部热点开始逐步凸显,结构性行情持续演绎。由于一季度刺激政策加码较重,二季度投资力度相对减弱,同时供给侧改革也没有新的进展,因此,传统行业基本被市场所忽视。六月份,由于海外几大风险事件的逐步兑现,特别是英国脱欧给全球市场带来了不小的冲击。一时间,股市、汇市、商品市场均出现了剧烈的波动,反观A股表现,相对较为平稳,但避险情绪进一步推升了贵金属板块的表现,以黄金为代表的贵金属板块股价持续向好。纵观上半年市场整体表现,消费、价值、防御几大投资方向表现显著优于其他版块,较之成长股的超额收益更加明显。下半年市场表现较上半年更加稳健,虽然市场仍出现了一系列风险事件,特别是年底债券市场的去杠杆,但市场仍然顶住了压力。

一季度由于一月份的净值大幅回撤,后面两个月的仓位策略都较为保守,但也在春节后对配置做了较大幅度调整,同时在二月底积极加仓。进入二季度,指数逐渐失真,我们也逐步淡化了对于大盘指数的判断,更多强调板块和个股的选择,积极参与市场热点。大部分时间内,基金都维持了较高仓位的运作。下半年市场相对平稳,本基金也积极参与了PPP、举牌等一系列热点主题,但因为行情持续性相对较短,对净值贡献有限。

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1.756元,净值增长率为-17.30%,同期业绩比较基准收益率为-13.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济基本面——四季度以来,工业利润增速继续走高,主要缘于工业生产、销售增长加快,价格涨幅明显扩大,去年同期低基数,以及电子、专用设备和石油加工等行业拉动明显。11月产成品存货同比增速0.5%,由负转正并连续5个月回升。库存销售比回落至0.36,低于过去两年同期。存货周转天数为14.1天,较10月持平。分行业库存有去有补,整体库存继续缓慢回补,但力度稍显不足。12月PMI小幅回落。12月全国制造业PMI小幅回落至51.4,连续第5个月高于荣枯线,但也是5个月来首次出现回落。分项来看,需求平、生产降、价格涨、库存去。分企业规模来看,大、中、小型企业均回落。12月经济整体平稳,PMI回落但仍在扩张区间,终端需求稳中有降,工业生产涨跌互现,完成6.5%-7%增长目标已无悬念。但16年稳增长的代价却是房价大涨、杠杆骤升、汇率承压。中央经济工作会议定调, 抑制地产泡沫和防范金融风险将是17年首要目标。截止目前12月商务部、统计局食品价格环比涨幅分别为1.8%、-0.4%,预计12月CPI食品价格环涨0.9%,受高基数影响,12月CPI或小降至2.2%。

资金面——12月最后一周R007均值上升10bp至3.3%,R001均值下降22BP至2.15%,但周五的R007降至3.01%,R001降至2.13%,节前货币利率整体保持稳定。12月最后一周央行操作逆回购6000亿,逆回购到期8450亿,逆回购回笼2450亿,但得益于前两周的大幅投放,12月央行净投放累计约4565亿。央行行长周小川发布新年致辞,称17年将保持货币政策稳健中性,调节好货币闸门,维护流动性基本稳定。而国家外汇管理局在12月31日表示,个人购汇政策没有变化,5万美元的个人购汇额度保持不变,但会加强对真实性和合规性的审核。1月份将开启新一轮换汇周期,但得益于12月财政万亿放款和央行持续投放,短期流动性仍有望维持稳定。

政策与事件——在习近平主席的新年贺词中,“撸起袖子加油干”代表了这个砥砺奋进的时代,新年伊始,央行对于资本管控的加强仍在继续,代表着2017年实体经济需要踏实肯干,而防范金融风险仍是重中之重。关注2017年资本市场参与者结构的变化,养老金、深港通等标志性事件为市场带来了新的机构投资者,而金融机构对于股票资产配置需求的上升。汇率的预期问题仍然不可小觑,在强烈的汇率贬值预期之下,资本外流的压力始终非常大,从企业到个人都争相配置海外资产,央行只能依靠较为严格的汇率管制,来抑制外汇储备的快速下降。外部而言,市场的焦点在特朗普1月20日就职带来的政策变化。

市场预判——展望2017年,我们认为外部和内部约束条件较多,很难见到系统性大行情,防风险为主。2017年贸易保护主义抬头,会对中国的出口贸易造成很大的冲击;资产价格处于高位,货币环境很难继续放松;社会的总体的杠杆率较高,对投资形成一定的掣肘;居民的杠杆率上升和人口老龄化的开始,对长期的消费潜力形成负面影响。投资者需要更加理性,应当适度降低对于收益率的预期。

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,较好地保障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交易进行监控,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。另外注意对监管机构处罚信息与市场负面信息搜集,提示投研部门注意潜在风险。

(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,新增了基金间同日同向交易、所有投资组合对单只股票成交量占其市场总成交异常等指标预警。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,在公平交易的各环节建立了责任追究制,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、反洗钱工作、信息披露、应用系统权限管理、基金投资备选库管理、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类汇报,并对目前市场上的疑似内幕交易、有争议的内幕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即时通讯做出进一步规范。加强投研人员的资讯管理,对基金经理集中区域进行录像监控,对于证券公司的网站、网页委托进行了屏蔽,对投研人员的办公电脑安装截屏软件进行留痕处理,并对安装软件的权限进行严格限制。

在本报告期内,本基金的投资运作等各环节基本符合规定的要求,未出现异常交易、操纵市场、内幕交易等违法违规现象。今后公司将继续夯实内部控制和风险管理工作,保证基金运作的合规性,充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、泰信基金管理有限公司估值程序等事项的说明

委员会主席

韩波先生,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:

唐国培先生,硕士。2002年加入泰信基金管理有限公司,现任公司风险管理部总监。

蔡海成先生,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。

梁剑先生,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任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、基金合同关于利润分配的约定:

1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式,基金份额持有人可自行选择收益分配方式;基金份额持有人事先未做出选择的,默认的分红方式为现金红利;选择红利再投资的,现金红利则按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同,基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准;

2、每一基金份额享有同等分配权;

3、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,基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日;

4、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,全年分配比例不得低于年度可供分配收益的10%,若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;

5、基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过15个工作日;

6、投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位,小数点后第3位四舍五入,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产;

7、法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

二、本基金的基金管理人于2015年12月31日宣告2015年度第一次分红,向截至2016年1月6日止在本基金注册登记人泰信基金管理有限公司 登记在册的本基金持有人,按每10份基金份额派发红利1.35元。利润分配合计 18,369,098.68 元(其中,现金形式发放 15,029,307.21元,再投资形式发放 3,339,791.47元)。符合基金合同的约定。

## §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,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对泰信中小盘精选混合型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、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21012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 | 泰信中小盘精选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中小盘精选混合型证券投资基金 (原泰信中小盘精选股票型证券投资基金,以下简称“泰信中小盘基金”)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中小盘精选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:<br>(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;<br>(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。<br>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。<br>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,上述泰信中小盘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,公允反映了泰信中小盘基金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 | 单峰 | 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:泰信中小盘精选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 | 14,267,257.27 | 80,344,067.90 |
| 结算备付金 | 706,823.75 | 1,995,181.24 |
| 存出保证金 | 159,911.35 | 545,057.29 |
| 交易性金融资产 | 59,238,226.12 | 283,281,203.01 |
| 其中:股票投资 | 59,238,226.12 | 283,281,203.01 |
| 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 | 20,000,000.00 | - |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 2,633.68 | 12,081.36 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 399.40 | 494.07 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 94,375,251.57 | 366,178,084.87 |
| 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 | 7,853,152.74 | 7,648,373.46 |
| 应付赎回款 | 4,233.69 | 64,658.03 |
| 应付管理人报酬 | 132,033.54 | 454,256.95 |
| 应付托管费 | 22,005.61 | 75,709.46 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 424,103.79 | 810,320.76 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 387,015.33 | 391,706.69 |
| 负债合计 | 8,822,544.70 | 9,445,025.35 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 48,720,439.55 | 157,011,660.66 |
| 未分配利润 | 36,832,267.32 | 199,721,398.86 |
| 所有者权益合计 | 85,552,706.87 | 356,733,059.52 |
| 负债和所有者权益总计 | 94,375,251.57 | 366,178,084.87 |

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.756元,基金份额总额48,720,439.55份。

7.2 利润表

会计主体:泰信中小盘精选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

| 审计报告标题 | 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 | -40,668,646.71 | 252,193,565.43 |
| 1.利息收入 | 407,324.52 | 986,812.37 |
| 其中:存款利息收入 | 372,400.32 | 503,274.33 |
| 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 | 34,924.20 | 483,538.04 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | -9,892,938.88 | 208,616,951.62 |
| 其中:股票投资收益 | -10,491,184.82 | 206,737,314.70 |
| 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 | 598,245.94 | 1,879,636.92 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | -31,448,598.91 | 41,800,823.94 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | 265,566.56 | 788,977.50 |
| 减:二、费用 | 9,170,600.10 | 19,849,430.35 |
| 1. 管理人报酬 | 3,248,165.06 | 8,892,193.81 |
| 2. 托管费 | 541,360.90 | 1,482,032.28 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 4,960,198.41 | 9,035,426.99 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 420,875.73 | 439,777.27 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | -49,839,246.81 | 232,344,135.08 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | -49,839,246.81 | 232,344,135.08 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰信中小盘精选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) | 157,011,660.66 | 199,721,398.86 | 356,733,059.52 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | -49,839,246.81 | -49,839,246.81 |
| 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) | -108,291,221.11 | -94,680,786.05 | -202,972,007.16 |
| 其中:1.基金申购款 | 57,825,540.91 | 45,239,647.99 | 103,065,188.90 |
| 2.基金赎回款 | -166,116,762.02 | -139,920,434.04 | -306,037,196.06 |
| 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) | - | -18,369,098.68 | -18,369,098.68 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 48,720,439.55 | 36,832,267.32 | 85,552,706.87 |
| 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) | 345,435,141.97 | 230,327,526.88 | 575,762,668.85 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 232,344,135.08 | 232,344,135.08 |
| 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) | -188,423,481.31 | -238,898,769.64 | -427,322,250.95 |
| 其中:1.基金申购款 | 176,564,550.49 | 184,846,974.51 | 361,411,525.00 |
| 2.基金赎回款 | -364,988,031.80 | -423,745,744.15 | -788,733,775.95 |
| 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) | - | -24,051,493.46 | -24,051,493.46 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 157,011,660.66 | 199,721,398.86 | 356,733,059.52 |

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:

| | | |
|---|---|---|
| 葛航 | 韩波 | 蔡海成 |
| 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

泰信中小盘精选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[2011]第1138号《关于核准泰信中小盘精选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《泰信中小盘精选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262,307,424.58元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第408号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信中小盘精选股票型证券投资基金基金合同》于2011年10月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为262,332,100.87份基金份额,其中认购资金利息折合24,676.29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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,泰信中小盘精选股票型证券投资基金于2015年8月7日公告后更名为泰信中小盘精选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《泰信中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》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各类股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或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,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%,债券、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规和监管机构的规定执行。本基金投资于中小盘股票的比例不低于股票投资资产的80%。本基金的业绩比较基准为:80% ×中证700指数收益率 + 20% ×中证全债指数收益率。

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日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“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》、《泰信中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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2016年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 泰信基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 上海锐懿资产管理有限公司 | 基金管理人的子公司 |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 山东省国际信托股份有限公司(“山东国托”) | 基金管理人的股东 |
| 江苏省投资管理有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 青岛国信实业有限公司(“青岛国信”) | 基金管理人的股东 |

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本期末及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本期及上年度可比期间本基金无应支付关联方佣金余额。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

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 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 3,248,165.06 | 8,892,193.81 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 105,480.88 | 187,880.95 |

注:支付基金管理人泰信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为: 日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

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 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 541,360.90 | 1,482,032.28 |

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

本报告期及上年度本基金未发生销售服务费用。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期末及上年度可比期间本基金未发生与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)的交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

| 关联方名称 | 本期末 2016年12月31日 | | 上年度末 2015年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 山东国托 | 27,512,090.56 | 56.4700% | 33,512,090.56 | 21.3400% |

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

| 关联方名称 | 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 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行 | 14,267,257.27 | 340,510.45 | 80,344,067.90 | 397,602.38 |

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期末及上年度可比期间本基金未在承销期内持有关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末( 2016年12月31日 )本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 000547 | 航天发展 | 2016年4月19日 | 重大资产重组 | 15.28 | 2017年1月3日 | 16.90 | 479,924 | 7,132,052.26 | 7,333,238.72 | - |
| 000748 | 长城信息 | 2016年11月1日 | 重大资产重组 | 18.92 | - | - | 220,000 | 4,666,745.00 | 4,162,400.00 | - |

注:1. 本基金截至2016年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。2. 根据长城信息产业股份有限公司(以下简称“长城信息”)于2016年10月25日公布的《关于中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并公司事宜的提示性公告》和中国长城计算机深圳股份有限公司(以下简称“长城电脑”)于2017年1月20日公布的《中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并长城信息产业股份有限公司及重大资产置换和发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易实施情况暨新增股份上市公告书》,长城电脑向长城信息全体股东发行A股股票,以换股比例1:0.5424取得长城信息股东持有的长城信息全部股票,吸收合并长城信息;长城信息自2016年11月1日起连续停牌。换股合并后新增的长城电脑股票于2017年1月18日上市流通,当日开盘单价为10.63元。长城信息人民币普通股股票自2017年1月18日起终止上市并摘牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2015年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为228,678,339.08元,属于第二层次的余额为 54,602,863.93元,无属于第三层次的余额(2014年12月31日,第一层次408,202,921.98,第二层次27,125,174.22元,无属于第三层次的余额) 。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 59,238,226.12 | 62.77 |
| | 其中:股票 | 59,238,226.12 | 62.77 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 20,000,000.00 | 21.19 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 14,974,081.02 | 15.87 |
| 7 | 其他各项资产 | 162,944.43 | 0.17 |
| 8 | 合计 | 94,375,251.57 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 10,551,800.00 | 12.33 |
| C | 制造业 | 45,809,426.12 | 53.55 |
| 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 | 2,877,000.00 | 3.36 |
| 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 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 59,238,226.12 | 69.24 |

8.2.2 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。

8.3 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

金额单位:人民币元

| 代码 | 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 | 002383 | 合众思壮 | 166,935 | 8,263,282.50 | 9.66 |
| 2 | 000547 | 航天发展 | 479,924 | 7,333,238.72 | 8.57 |
| 3 | 600596 | 新安股份 | 600,000 | 6,144,000.00 | 7.18 |
| 4 | 300097 | 智云股份 | 90,000 | 4,932,900.00 | 5.77 |
| 5 | 000748 | 长城信息 | 220,000 | 4,162,400.00 | 4.87 |
| 6 | 600759 | 洲际油气 | 420,000 | 4,124,400.00 | 4.82 |
| 7 | 300164 | 通源石油 | 360,000 | 3,722,400.00 | 4.35 |
| 8 | 600803 | 新奥股份 | 250,000 | 3,565,000.00 | 4.17 |
| 9 | 002353 | 杰瑞股份 | 160,000 | 3,248,000.00 | 3.80 |
| 10 | 000066 | 长城电脑 | 250,000 | 3,110,000.00 | 3.64 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 002673 | 西部证券 | 38,193,765.54 | 10.71 |
| 2 | 601198 | 东兴证券 | 33,256,554.00 | 9.32 |
| 3 | 000728 | 国元证券 | 27,990,345.91 | 7.85 |
| 4 | 002383 | 合众思壮 | 20,097,851.54 | 5.63 |
| 5 | 601555 | 东吴证券 | 20,043,751.00 | 5.62 |
| 6 | 601318 | 中国平安 | 19,241,641.00 | 5.39 |
| 7 | 300352 | 北信源 | 17,400,574.40 | 4.88 |
| 8 | 300287 | 飞利信 | 15,510,859.82 | 4.35 |
| 9 | 300209 | 天泽信息 | 15,145,304.11 | 4.25 |
| 10 | 300067 | 安诺其 | 15,084,036.28 | 4.23 |
| 11 | 002440 | 闰土股份 | 14,510,389.54 | 4.07 |
| 12 | 000937 | 冀中能源 | 14,480,434.14 | 4.06 |
| 13 | 002353 | 杰瑞股份 | 14,237,277.99 | 3.99 |
| 14 | 600038 | 中直股份 | 13,944,812.01 | 3.91 |
| 15 | 600109 | 国金证券 | 13,803,148.37 | 3.87 |
| 16 | 300168 | 万达信息 | 13,791,677.36 | 3.87 |
| 17 | 002467 | 二六三 | 13,267,180.54 | 3.72 |
| 18 | 300252 | 金信诺 | 12,742,829.70 | 3.57 |
| 19 | 600958 | 东方证券 | 12,058,255.00 | 3.38 |
| 20 | 002340 | 格林美 | 12,049,463.72 | 3.38 |
| 21 | 002092 | 中泰化学 | 11,709,008.55 | 3.28 |
| 22 | 002655 | 共达电声 | 11,537,921.42 | 3.23 |
| 23 | 300010 | 立思辰 | 11,409,109.82 | 3.20 |
| 24 | 000563 | 陕国投A | 11,247,690.96 | 3.15 |
| 25 | 002626 | 金达威 | 10,686,866.27 | 3.00 |
| 26 | 600184 | 光电股份 | 10,532,361.44 | 2.95 |
| 27 | 300367 | 东方网力 | 10,448,075.10 | 2.93 |
| 28 | 600495 | 晋西车轴 | 10,204,634.63 | 2.86 |
| 29 | 000697 | 炼石有色 | 10,142,494.21 | 2.84 |
| 30 | 601009 | 南京银行 | 9,858,511.00 | 2.76 |
| 31 | 300398 | 飞凯材料 | 9,844,746.06 | 2.76 |
| 32 | 600987 | 航民股份 | 9,627,702.61 | 2.70 |
| 33 | 000768 | 中航飞机 | 9,399,879.93 | 2.63 |
| 34 | 300245 | 天玑科技 | 9,370,267.77 | 2.63 |
| 35 | 000848 | 承德露露 | 9,141,904.61 | 2.56 |
| 36 | 300377 | 赢时胜 | 8,393,206.00 | 2.35 |
| 37 | 002142 | 宁波银行 | 8,283,472.96 | 2.32 |
| 38 | 601169 | 北京银行 | 8,279,657.01 | 2.32 |
| 39 | 000652 | 泰达股份 | 7,434,596.55 | 2.08 |
| 40 | 002253 | 川大智胜 | 7,423,123.00 | 2.08 |
| 41 | 601989 | 中国重工 | 7,393,635.20 | 2.07 |
| 42 | 002590 | 万安科技 | 7,379,668.00 | 2.07 |
| 43 | 002450 | 康得新 | 7,286,863.46 | 2.04 |
| 44 | 600546 | *ST山煤 | 7,283,295.58 | 2.04 |
| 45 | 300456 | 耐威科技 | 7,208,822.00 | 2.02 |
| 46 | 601699 | 潞安环能 | 7,181,561.78 | 2.01 |
| 47 | 600597 | 光明乳业 | 7,144,659.20 | 2.00 |

注:本项的“买入金额”均按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 002673 | 西部证券 | 38,871,462.83 | 10.90 |
| 2 | 601198 | 东兴证券 | 34,238,220.49 | 9.60 |
| 3 | 000728 | 国元证券 | 28,828,146.95 | 8.08 |
| 4 | 300142 | 沃森生物 | 26,516,498.47 | 7.43 |
| 5 | 601555 | 东吴证券 | 21,518,683.35 | 6.03 |
| 6 | 300352 | 北信源 | 19,316,831.23 | 5.41 |
| 7 | 002626 | 金达威 | 18,754,759.67 | 5.26 |
| 8 | 601318 | 中国平安 | 18,688,360.00 | 5.24 |
| 9 | 600990 | 四创电子 | 17,673,848.42 | 4.95 |
| 10 | 300209 | 天泽信息 | 17,577,941.16 | 4.93 |
| 11 | 300287 | 飞利信 | 16,545,875.24 | 4.64 |
| 12 | 002208 | 合肥城建 | 16,279,093.18 | 4.56 |
| 13 | 300168 | 万达信息 | 15,622,952.35 | 4.38 |
| 14 | 002383 | 合众思壮 | 14,560,160.91 | 4.08 |
| 15 | 300252 | 金信诺 | 14,458,147.06 | 4.05 |
| 16 | 000937 | 冀中能源 | 14,378,802.72 | 4.03 |
| 17 | 600038 | 中直股份 | 14,191,557.22 | 3.98 |
| 18 | 002467 | 二六三 | 13,972,273.91 | 3.92 |
| 19 | 600109 | 国金证券 | 13,757,077.95 | 3.86 |
| 20 | 300067 | 安诺其 | 13,240,294.76 | 3.71 |
| 21 | 002228 | 合兴包装 | 13,222,068.21 | 3.71 |
| 22 | 002440 | 闰土股份 | 12,704,357.40 | 3.56 |
| 23 | 002390 | 信邦制药 | 12,379,771.00 | 3.47 |
| 24 | 002092 | 中泰化学 | 12,150,034.28 | 3.41 |
| 25 | 600958 | 东方证券 | 11,777,592.53 | 3.30 |
| 26 | 002340 | 格林美 | 11,634,113.03 | 3.26 |
| 27 | 000697 | 炼石有色 | 11,595,621.92 | 3.25 |
| 28 | 600775 | 南京熊猫 | 11,491,197.60 | 3.22 |
| 29 | 300085 | 银之杰 | 11,319,965.95 | 3.17 |
| 30 | 002686 | 亿利达 | 11,217,655.76 | 3.14 |
| 31 | 002655 | 共达电声 | 11,063,630.62 | 3.10 |
| 32 | 000563 | 陕国投A | 10,874,215.17 | 3.05 |
| 33 | 300398 | 飞凯材料 | 10,789,440.00 | 3.02 |
| 34 | 002353 | 杰瑞股份 | 10,657,333.00 | 2.99 |
| 35 | 600184 | 光电股份 | 10,633,900.26 | 2.98 |
| 36 | 300010 | 立思辰 | 10,419,684.00 | 2.92 |
| 37 | 600495 | 晋西车轴 | 10,404,200.75 | 2.92 |
| 38 | 002565 | 顺灏股份 | 10,299,808.00 | 2.89 |
| 39 | 300367 | 东方网力 | 10,218,008.33 | 2.86 |
| 40 | 000768 | 中航飞机 | 9,734,073.98 | 2.73 |
| 41 | 002590 | 万安科技 | 9,674,656.87 | 2.71 |
| 42 | 600987 | 航民股份 | 9,555,786.40 | 2.68 |
| 43 | 300378 | 鼎捷软件 | 9,499,073.89 | 2.66 |
| 44 | 300245 | 天玑科技 | 9,287,459.98 | 2.60 |
| 45 | 601009 | 南京银行 | 9,189,303.86 | 2.58 |
| 46 | 300377 | 赢时胜 | 9,041,833.85 | 2.53 |
| 47 | 000848 | 承德露露 | 9,012,299.65 | 2.53 |
| 48 | 300503 | 昊志机电 | 8,639,358.00 | 2.42 |
| 49 | 600590 | 泰豪科技 | 8,561,968.34 | 2.40 |
| 50 | 600682 | 南京新百 | 8,311,162.60 | 2.33 |
| 51 | 600576 | 万家文化 | 7,964,558.41 | 2.23 |
| 52 | 002657 | 中科金财 | 7,943,163.50 | 2.23 |
| 53 | 002253 | 川大智胜 | 7,841,120.75 | 2.20 |
| 54 | 300456 | 耐威科技 | 7,587,246.00 | 2.13 |
| 55 | 002025 | 航天电器 | 7,580,509.02 | 2.12 |
| 56 | 601169 | 北京银行 | 7,538,759.91 | 2.11 |
| 57 | 000633 | *ST合金 | 7,443,211.00 | 2.09 |
| 58 | 601989 | 中国重工 | 7,404,232.18 | 2.08 |
| 59 | 002450 | 康得新 | 7,380,302.26 | 2.07 |
| 60 | 002142 | 宁波银行 | 7,359,245.32 | 2.06 |
| 61 | 002639 | 雪人股份 | 7,325,652.80 | 2.05 |
| 62 | 600685 | 中船防务 | 7,254,720.96 | 2.03 |
| 63 | 002631 | 德尔未来 | 7,201,657.00 | 2.02 |
| 64 | 300462 | 华铭智能 | 7,200,254.64 | 2.02 |
| 65 | 002537 | 海立美达 | 7,184,829.60 | 2.01 |
| 66 | 002456 | 欧菲光 | 7,141,348.49 | 2.00 |
| 67 | 600546 | *ST山煤 | 7,138,198.00 | 2.00 |

注:本项 “卖出金额”均按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

| | |
|---|---|
| 序号 | 1,524,696,368.01 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 1,706,799,561.17 |

注:本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

8.6 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报告期末本基金未持有债券。

8.7 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

报告期末本基金未持有资产支持证券。

8.8 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贵金属投资明细

报告期末本基金未投资贵金属。

8.9 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。

8.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1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。

8.10.2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。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1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。

8.11.2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。

8.11.3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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 159,911.35 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,633.68 |
| 5 | 应收申购款 | 399.40 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 162,944.43 |

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000547 | 航天发展 | 7,333,238.72 | 8.57 | 重大资产重组 |
| 2 | 000748 | 长城信息 | 4,162,400.00 | 4.87 | 重大资产重组 |

8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 599 | 81,336.29 | 39,497,240.29 | 81.07% | 9,223,199.26 | 18.93% |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 21,009.72 | 0.0431% |

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|---|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

注:基金份额总量的数量区间为0、0至10万份(含)、10万份至50万份(含)、50万份至100万份(含)、100万份以上。

## §10 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日( 2011年10月26日 )基金份额总额 | 262,332,100.87 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 157,011,660.66 |
| 本报告期基金总申购份额 | 57,825,540.91 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 166,116,762.02 |
| 本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 48,720,439.55 |

注:总申购份额含红利再投资、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

## §11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2016年12月,郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2、基金管理人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

2016年7月万科企业股份有限公司工会委员会诉泰信基金管理有限公司等被告损害股东利益责任纠纷一案,公司已聘请专业律师应诉,目前案件正在审理阶段,法院未作出判决。

本报告期无涉及基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费为人民币6.7万元。该审计机构从基金合同生效日(2011年10月26日)开始为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中信建投 | 2 | 656,543,925.17 | 20.32% | 601,648.88 | 20.28% | - |
| 华泰证券 | 1 | 588,024,999.17 | 18.20% | 535,868.45 | 18.06% | - |
| 广州证券 | 1 | 370,000,794.24 | 11.45% | 344,582.23 | 11.61% | - |
| 长江证券 | 1 | 363,499,971.29 | 11.25% | 331,258.06 | 11.17% | - |
| 万联证券 | 1 | 257,673,158.63 | 7.97% | 239,969.92 | 8.09% | - |
| 中银国际 | 3 | 252,855,698.08 | 7.82% | 230,427.84 | 7.77% | - |
| 东方证券 | 1 | 215,342,463.25 | 6.66% | 196,241.29 | 6.61% | - |
| 中国建银投资证券 | 2 | 141,624,925.99 | 4.38% | 129,062.92 | 4.35% | - |
| 安信证券 | 3 | 109,067,960.44 | 3.38% | 101,574.35 | 3.42% | - |
| 国信证券 | 1 | 101,238,713.10 | 3.13% | 94,282.91 | 3.18% | - |
| 西南证券 | 1 | 78,647,104.76 | 2.43% | 73,243.90 | 2.47% | - |
| 国泰君安 | 1 | 49,879,267.22 | 1.54% | 45,454.84 | 1.53% | - |
| 东吴证券 | 2 | 34,346,242.50 | 1.06% | 31,299.70 | 1.06% | - |
| 申银万国 | 1 | 12,691,515.34 | 0.39% | 11,819.58 | 0.40% | - |
| 华宝证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 第一创业 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰联合证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 财富证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 南京证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注:1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位有关问题的通知》(证监基金字【2007】48号)中关于“一家基金公司通过一家证券经营机构买卖证券的年交易佣金,不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金30%”的要求,本基金管理人在选择租用交易单元时,注重所选证券公司的综合实力、市场声誉。对证券公司的研究能力,由公司研究人员对其提供的研究报告、研究成果的质量进行定期评估。公司将根据内部评估报告,对交易单元租用情况进行总体评价,决定是否对交易单元租用情况进行调整。

2、本报告期新增交易单元:天风证券深圳001625;退租交易单元:国金证券上海28266、广发证券深圳391580。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广州证券 | - | - | 50,000,000.00 | 15.43% | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中国建银投资证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | 30,000,000.00 | 9.26% | - | - |
| 西南证券 | - | - | 150,000,000.00 | 46.30% | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | - | - | 94,000,000.00 | 29.01% | - | - |
| 华宝证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰联合证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | - | - | - | - | - | - |
| 财富证券 | - | - | - | - | - | - |
| 南京证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |

泰信基金管理有限公司
2017年3月30日