泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金 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	泰信基本面400指数分级
场内简称	泰信400
基金主代码	162907
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2012年9月7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	57,552,567.05份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012年9月21日

下属分级基金的基金简称	泰信基本面400A	泰信基本面400B	泰信基本面400
下属分级基金的场内简称	泰信400 A	泰信400B	泰信400
下属分级基金的交易代码	150094	150095	162907
报告期末下属分级基金份额总额	6,543,401.00份	6,543,401.00份	44,465,765.05份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,追求对中证锐联基本面400指数的有效跟踪。
投资策略	本基金主要采用完全复制法,按照在中证锐联基本面400指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合,以报合和跟踪中证锐联基本面400指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	95%×中证锐联基本面400指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。
下属分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。 / 高风险、高预期收益。 / 较高风险、较高预期收益。

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	胡园	郭明
	联系电话	021-20899098	(010)66105799
	电子邮箱	xxpl@ttfund.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	http://www.ttfund.com
基金年度报告备置地点	中国(上海)自由贸易实验区浦东南路256号华夏银行大厦37层

§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	-8,177,490.64	21,847,794.34	4,093,879.06
本期利润	-9,422,454.73	12,485,754.21	10,577,015.00
加权平均基金份额本期利润	-0.1490	0.2407	0.3708
本期基金份额净值增长率	-16.23%	24.93%	34.87%
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	0.2950	0.4262	0.3071
期末基金资产净值	43,949,667.13	57,171,748.61	37,542,830.91
期末基金份额净值	0.764	0.935	1.520

注:1、本基金合同于2012年9月7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

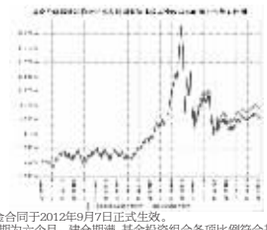
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.79%	0.79%	1.67%	0.79%	-0.88%	0.00%
过去六个月	5.96%	0.86%	7.44%	0.87%	-1.48%	-0.01%
过去一年	-16.23%	1.73%	-13.21%	1.73%	-3.02%	0.00%
过去三年	48.52%	2.02%	64.82%	2.01%	-16.30%	0.01%
自基金合同生效起至今	69.10%	1.81%	82.77%	1.84%	-13.67%	-0.03%

注:本基金业绩比较基准为:95%×中证锐联基本面400指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率(税后)

中证锐联基本面400指数以沪深A股为样本空间,挑选基本面价值排列第201至第600家的上市公司作为样本,基本面价值由四个财务指标来衡量:营业收入、现金流、净资产和分红;样本股的权重配置由基本面价值决定,在一定程度上打破了样本市值与其权重之间的关联,避免了传统市值指数中过多配置高估股票的现象。

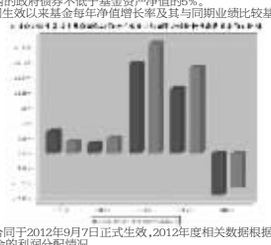
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的变动的比较



注:1、本基金基金合同于2012年9月7日正式生效。

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。本基金投资于中证锐联基本面400指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%;现金以及到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

3.2.3 自基金合同生效以来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



注:本基金基金合同于2012年9月7日正式生效,2012年度相关数据根据实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

在基金存续期内,本基金(包括泰信基本面400份额、泰信基本面400A份额、泰信基本面400B份额)不进行收益分配。

§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:徐喆
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、泰信尊信1号、泰信尊享稳健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		
张彦先生	本基金经理兼泰信中证200指数基金经理	2015年1月6日	-	10年	研究生硕士。具有基金从业资格。曾任职于国金证券研究所、上海从容投资管理有限公司、万家基金管理有限公司。2011年6月加入泰信基金管理有限公司,担任高级研究员。自2011年10月至2014年5月任泰信中小盘精选基金经理助理,2012年4月至2015年1月任泰信优势增长混合基金经理助理。自2015年1月6日起同时兼任泰信中证200指数基金经理。

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》、《泰信中证锐联基本面400指数分级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 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,降低购赎回、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。对非竞争竞价指令,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侯方式处理。

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

A股市场在2016年年初经历了熔断大跌后,走势整体震荡向上,板块轮动频繁,受供给侧改革、大宗商品价格上涨的推动,周期股下半年显著跑赢市场,而创业板受流动性边际收紧的影响,则出现了较位下跌。市场风格倾向于大盘蓝筹股和周期股。上证综指全年下跌12.31%,创业板下跌27.71%。

报告期内,本基金作为被动操作的指数基金,严格执行基金合同规定的投资策略,按照规定的投资策略和方法进行投资操作,努力拟合标的指数,减小跟踪误差,报告期内跟踪误差控制在1.76。报告期跟踪误差主要是由于基金申购赎回和标的指数成分股定期调整等因素所造成。

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0.764元,净值增长率为-16.23%,业绩比较基准增长率为-13.21%。

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,机遇与风险同在,我们预计全年呈现宽幅震荡的态势。

2017年宏观经济经过多年的调整,经济呈现复苏的势头。2016年随着供给侧改革的深入,在库存周期和上游商品价格的推动下,宏观经济普遍出现好转,进入2017年制造业经过多年的调整也开始逐步复苏。从中长期来看,国内经济继续处于长周期的底部,经济仍有下行压力,但供给侧改革的深入推进有助于压缩下跌空间。在PPI落地比例上升、外汇管制趋严和海外投资受限的背景下,民间投资增速有望回升。

虽然经济增速降低、货币政策更加保守,但2017年通胀水平降会有所上升。去产能推动我国产出缺口进一步收窄,从根本上提升了我国通胀压力。而原油价格将继续冲击通胀走势。而需求相对稳定有助于提升PPI对CPI的传导效率。因此,2017年CPI将成为影响市场主要变量之一。

金融危机后货币政策被过度使用的弊端正在显现。从国内看,有效需求难见起色而资产价格泡沫持续膨胀;从全球看,美元已经进入加息周期,全球货币政策开始转向,各国政府在2017年更加依赖财政政策托底经济。而国内市场化利率上行,央行有意拍升整体利率中枢,切断加杠杆温床。货币政策稳健中性的取向得到确认。在通胀和汇率两个棘手难题面前,市场利率上的扰动将引导加息预期不断强化。预计2017年流动性趋紧。

因此,在经济弱复苏而流动性趋紧的背景下,我们预计2017年全年将呈现宽幅震荡的态势,结构性机会较为显著,上半年预计周期股和蓝筹股机会较为显著,若市场继续调整,优质的成长股也将在下半年有所展现。

作为指数分级型基金产品,我们将坚持指数化投资策略,严格控制基金相对目标指数(基本面400指数)的偏离度,跟踪市场趋势,使得投资者可以清晰地把握分级子基金的交易情况,把握住投资时机。本基金将继续规范运作,审慎投资,勤勉尽责地维护基金份额持有人利益。

4.6 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,泰信优势增长混合基金经理。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在基金存续期内,本基金(包括泰信基本面400份额、泰信基本面400A份额、泰信基本面400B份额)不进行收益分配。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 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中证锐联基本面400指数分级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,完全尽职尽责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,泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金的管理人——泰信基金管理有限公司在泰信中证锐联基本面400指数分级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。

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中证锐联基本面400指数分级证券投资基金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,以上内容真实、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21003号

6.2 审计报告的基本内容

财务报表是否经过审计	审计报告
审计报告收件人	泰信中证锐联基本面400指数分级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证锐联基本面400指数分级证券投资基金(以下简称"泰信基本面400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基本面400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,上述泰信基本面400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,公允反映了泰信基本面400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	上海市产湾区湖滨路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:泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金
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	2,791,914.43	3,687,002.80
结算备付金	77,523.19	29,691.27
存出保证金	5,239.16	35,202.44
交易性金融资产	41,414,118.99	53,977,232.55
其中:股票投资	41,414,118.99	53,977,232.55
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	-	-
应收利息	559.34	651.99
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	44,289,355.11	57,729,781.05
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	-	110.49
应付赎回款	1,222.79	128,097.47
应付管理人报酬	38,790.64	46,653.96
应付托管费	8,533.92	10,263.88
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	15,084.36	34,021.10
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	276,056.27	338,885.54
负债合计	339,687.98	558,032.44
所有者权益:		
实收基金	26,069,783.67	28,455,925.47
未分配利润	17,879,883.46	28,715,823.14
所有者权益合计	43,949,667.13	57,171,748.61
负债和所有者权益总计	44,289,355.11	57,729,781.05

注:报告截止日2016年12月31日,泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金之基础份额净值为0.764元,泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金之A份额参考净值为1.050元,泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金之B份额参考净值为0.478元;基金份额总额为57,552,567.05份,其中泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金之基础份额为44,465,765.05份,泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金之A份额为6,543,401.00份,泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金之B份额为6,543,401.00份。

7.2 利润表
会计主体:泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金
本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

资 产	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	-8,289,654.83	14,035,255.74
1.利息收入	27,801.24	38,902.91
其中:存款利息收入	27,801.24	38,902.91
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	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-7,145,287.73	23,147,894.62
其中:股票投资收益	-7,598,378.04	22,711,470.25
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	453,090.31	436,424.37
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-1,244,964.09	-9,362,040.13
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	72,795.75	210,498.34
减:二、费用	1,132,799.90	1,549,501.53
1. 管理人报酬	469,412.16	558,782.27
2. 托管费	103,270.70	122,932.06
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	174,717.80	414,715.89
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	385,399.24	453,071.31
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-9,422,454.73	12,485,754.21
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-9,422,454.73	12,485,754.21

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金
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)	28,455,925.47	28,715,823.14	57,171,748.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-9,422,454.73	-9,422,454.73
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)	-2,386,141.80	-1,413,484.95	-3,799,626.75
其中:1.基金申购款	39,765,284.74	25,211,978.26	64,977,263.00
2.基金赎回款	-42,151,426.54	-26,625,463.21	-68,776,889.75
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)	26,069,783.67	17,879,883.46	43,949,667.13

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)	23,744,441.79	13,798,389.12	37,542,830.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	12,485,754.21	12,485,754.21
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)	4,711,483.68	2,431,679.81	7,143,163.49
其中:1.基金申购款	87,381,722.37	99,510,217.56	186,891,939.93
2.基金赎回款	-82,670,238.69	-97,078,537.75	-179,748,776.44
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)	28,455,925.47	28,715,823.14	57,171,748.61

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

泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金(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?2012?1252号《关于核准泰信中证锐联基本面400指数分级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《泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约开放型,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300,797,873.45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(2012)第346号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金基金合同》于2012年9月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为300,843,720.90份,其中认购资金利息折合45,847.45份。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。

本基金的基金份额包括泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称"泰信基本面400份额")、泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称"泰信基本面400A份额")与泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称"泰信基本面400B份额")。其中,泰信基本面400A份额、泰信基本面400B份额的基金份额配比始终保持1:1的比率不变。

根据《泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金基金合同》的规定,每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)的第一个工作日为基金份额折算基准日,本基金将对泰信基本面400A份额和泰信基本面400份额进行定期份额折算,泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行参考净值计算,对泰信基本面400A份额的应得收益进行定期份额折算,每2份泰信基本面400份额将按1份泰信基本面400A份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后,泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额的份额配比保持1:1的比例。对于泰信基本面400A份额期末的约定应得收益,即泰信基本面400A份额每个会计年度12月31日份额参考净值超出1.000元部分,将折算为场内泰信基本面400份额分配给泰信基本面400A份额持有人。泰信基本面400份额持有人持有的每2份泰信基本面400份额将按1份泰信基本面400A份额获得新增泰信基本面400份额的分配。持有场外泰信基本面400份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外泰信基本面400份额的分配;持有场内泰信基本面400份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内泰信基本面400份额的分配。经过上述份额折算,泰信基本面400A份额的基金份额参考净值和泰信基本面400份额的基金份额净值将相应调整。

除以上定期份额折算外,本基金根据基金合同规定,还将在以下两种情况进行份额折算,即:当泰信基本面400份额的基金份额净值达到2.000元;当泰信基本面400B份额的基金份额参考净值达到0.250元。当泰信基本面400份额的基金份额净值达到2.000元后,本基金将分别对泰信基本面400A份额、泰信基本面400B份额和泰信基本面400份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额的比例为1:1,份额折算后泰信基本面400份额的基金份额净值、泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额的基金份额参考净值均调整为1元。当泰信基本面400B份额的基金份额参考净值达到0.250元后,本基金将分别对泰信基本面400A份额、泰信基本面400B份额和泰信基本面400份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额的比例为1:1,份额折算后泰信基本面400份额的基金份额净值、泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额的基金份额参考净值均调整为1.000元。

泰信基本面400份额设置单独的基金代码,但不上市交易。泰信基本面400A份额与泰信基本面400B份额交易代码不同,只可在深圳证券交易所上市交易,不可单独进行申购或赎回。投资者可在场内申购和赎回泰信基本面400份额,投资者可选择将其场内申购的泰信基本面400份额按1:1的比例分拆成泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额,投资者可按1:1的配比将其持有的泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额申请合并为泰信基本面400份额后赎回。投资者可在场外申购和赎回泰信基本面400份额,场外申购的泰信基本面400份额不进行分拆。投资者可将其持有的场外泰信基本面400份额跨系统转登记至场内并申请将其分拆成泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额后上市交易。投资者可按1:1的配比将其持有的泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额申请合并为泰信基本面400份额后赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债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。其中,中证锐联基本面400指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的标的指数是中证锐联基本面400指数。本基金的业绩比较基准是95%×中证锐联基本面400指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率(税后)。

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、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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》、《泰信中证锐联基本面400指数分级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[2003]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》