

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  
报告送出日期：2017年4月21日  
§ 1 重要提示  
本基金管理人的董事及监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。  
本基金的托管人中国银行股份有限公司根据基金合同于2017年4月19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，保证复核结果不存在虚假记载、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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况	
基金简称	泰信增强收益债券型证券投资基金
交易代码	200007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月20日
报告期末基金份额总额	13,618,743.00份
投资目标	在人民币计价的可投资的债券、货币市场工具以及权证类资产的比例不低于基金资产的80%，投资于权益类资产的比例不高不高于基金资产的20%；现金或到期日在一年以内（含一年）的政府债券不得低于基金资产净值的5%。
投资策略	本基金将定期对宏观经济、货币市场以及债券市场的变化进行分析，通过开放投资策略，结合各资产的配置比例例，不断调整资产配置比例，以达到预期的收益目标。
业绩比较基准	MoW上证综合债指数×20%+国债指数×80%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属中低风险收益的品种，风险收益水平低于股票型基金和股票型基金，高于货币市场基金。
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
下属分级基金的基金简称	泰信增强收益A
下属分级基金的交易代码	200007
报告期末下属分级基金的份额净值	9.045,107.47份
§ 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

主要财务指标		报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
泰信增强收益A	泰信增强收益C	
1.本期利润	20,603.42	36,296.32
2.本期利润	-10,660.61	-77,160.75
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0043	-0.0098
4.期末基金资产净值	3,706,367.67	9,080,672.97
5.期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注：上述基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或赎回基金的各项费用（例如：开放式基金的申购赎回费、红利再投费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平将低于上述列数字。

2.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，本期利润为期末可供分配利润减去期末持有的待摊费用。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰信增强收益A		
阶段	净值增长率为1.00%的净值增长标准差	
①	②	
过去二个月	-0.02%	0.09%
	0.04%	0.02%
	-0.08%	0.09%
	泰信增强收益C	
阶段	净值增长率为1.00%的净值增长标准差	
①	②	
过去二个月	-0.02%	0.08%
	0.04%	0.02%
	-0.08%	0.09%

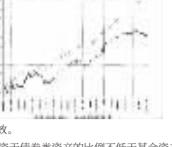
注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

3.2.2 本基金因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



## 泰信增强收益债券型证券投资基金

### 2017 第一季 度 报 告



开，多家上市企业发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

45 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，泰信增强收益A基金净值为1,008.00元，本季度净值增长率为-0.02%，同期业绩比较基准增长率为0.34%；泰信增强收益C基金净值增长率为-0.06%，本季度净值增长率为-0.62%，同期业绩比较基准增长率为0.34%。

46 报告期基金净值增长率偏离度情况

本报告期末基金净值增长率偏离度绝对值未超过0.5%，符合基金合同关于基金净值增长率偏离度的约定。

47 投资组合报告

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

48 管理人报告

截至报告期末，泰信增强收益A基金净值为1,008.00元，本季度净值增长率为-0.02%，同期业绩比较基准增长率为0.34%；泰信增强收益C基金净值增长率为-0.06%，本季度净值增长率为-0.62%，同期业绩比较基准增长率为0.34%。

49 报告期末基金资产组合情况

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

50 报告期末持有的可转换债券明细

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

51 报告期末持有的债券投资

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

52 报告期末持有的股票投资

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

53 报告期末持有的其他证券投资

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

54 报告期末持有贵金属投资

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

55 报告期末持有的权证投资

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

56 报告期末持有的股指期货投资

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

57 报告期末持有的国债期货投资

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

58 报告期末持有的资产支持证券

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

59 报告期末持有的其他金融工具投资

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

60 报告期末持有的股票期权

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

61 报告期末持有的其他金融工具投资

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

62 报告期末持有的权证投资

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

63 报告期末持有的资产支持票据

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

64 报告期末持有的其他投资

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

65 报告期末持有的其他金融工具投资

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

66 报告期末持有的其他投资

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

67 报告期末持有的其他投资

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

68 报告期末持有的其他投资

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

69 报告期末持有的其他投资

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

70 报告期末持有的其他投资

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

71 报告期末持有的其他投资

开，多家上市公司发布暂停交易公告，光大、深股转暂停交易，一级申购仍有份额收益。

一季度，双息双利基金调整并减持了持有的债券仓位，维持了债券持仓的整体稳定性，小幅减持了存续债升幅较高且参与了新发可转债的一级申购。

7