泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资

2017年第三季度报告

基金管理人:泰信基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月26日

§1 重要提示

本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。

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同已于2017年10月23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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信国策驱动混合
交易代码	001569
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年10月27日
报告期末基金份额总额	225,692,190.53份
投资目标	本基金将积极投资于受益于国家政策驱动、符合经济发展方向且具有良好成长性的优质企业,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将深入挖掘国家政策驱动、符合经济发展方向且确定性较高的投资机会,同时结合"自上而下"的资产配置策略和"自下而上"的个股精选策略,注重股票资产在其各相关行业的配置,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波动的风险。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,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。
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

§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7月1日 - 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	9,294,701.49
2.本期利润	24,205,116.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.1033
4.期末基金资产净值	186,384,323.34
5.期末基金份额净值	0.826

注:1、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。

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	14.09%	1.44%	2.41%	0.30%	11.68%	1.14%

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%

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

注:1、本基金基金合同于2015年10月27日正式生效。

2、本基金建仓期为六个月。建仓期满本基金的投资组合比例为股票资产占基金资产的0%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
车广路先生	本基金经理兼泰信发展主题、泰信蓝筹精选基金经理	2015年10月27日	-	10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、泰信蓝筹精选基金经理助理。自2012年3月1日至2014年6月21日担任泰信蓝筹精选基金经理;自2014年6月21日至2016年1月27日担任泰信发展主题基金经理;自2015年2月5日开始担任泰信蓝筹精选基金经理。

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》、《泰信国策驱动灵活配置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规和基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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《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相关的各环节,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,基金经理严格遵守公平、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本基金与其他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,亦无其他异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年三季度,A股市场延续了之前的上涨趋势,但结构发生了较大的变化。在二季度较好的经济数据推动下,市场热点从"漂亮50"向二季度业绩好且估值较低的周期股板块扩散,随后扩散至全市场,上证指数在8月底站上3300点。在这个过程中,无论是大金融、成长还是周期都有较好的表现,市场呈现出了百花齐放的态势。究其原因,政策红利的释放、宏观经济数据的好转,企业盈利的恢复都发挥了重要的作用。进入九月后,市场呈现了横盘震荡的走势,且波动率越来越小。受8月经济数据低于预期的影响,前期涨幅较大的周期股出现了较大的调整,而新能源汽车、5G、苹果产业链等板块表现较好。分行业看,有色金属、钢铁和煤炭在三季度表现较好,而传媒、纺织服装和电力公用事业表现较差。本基金在三季度初,大幅增持了有色金属和钢铁等周期性行业,并在9月进行了波段操作。继续持有了新能源汽车产业链的相关股票。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.826元;本报告期基金份额净值增长率为14.09%,业绩比较基准收益率为2.41%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	176,366,365.85	94.03
	其中:股票	176,366,365.85	94.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,016,659.10	5.87
8	其他资产	175,765.90	0.09
9	合计	187,558,790.85	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	142,379,548.65	76.39
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	4,847,000.00	2.60
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	-	-
J	金融业	21,557,650.00	11.57
K	房地产业	7,582,167.20	4.07
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	176,366,365.85	94.63

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002460	赣锋锂业	180,000	15,714,000.00	8.43
2	002694	顾地科技	672,000	15,583,680.00	8.36
3	600614	鹏起科技	1,000,000	12,050,000.00	6.47
4	002466	天齐锂业	150,080	10,549,123.20	5.66
5	600581	八一钢铁	510,000	7,440,900.00	3.99
6	603799	华友钴业	70,000	6,402,900.00	3.44
7	300340	科恒股份	97,000	6,265,230.00	3.36
8	000807	云铝股份	420,000	5,825,400.00	3.13
9	300338	开元股份	220,000	5,489,000.00	2.94
10	601939	建设银行	770,000	5,366,900.00	2.88

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

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支持证券投资明细

本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

本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期末本基金未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期末本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

报告期末本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期末本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

报告期末本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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、处罚的情况说明。

顾地科技股份有限公司(以下简称公司、顾地科技)于2015年12月8日收到中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)《调查通知书》,因公司相关行为涉嫌违法违规,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,中国证监会决定对公司进行立案调查。2016年6月3日,公司收到了中国证监会湖北监管局《行政处罚事先告知书》,2016年9月9日,公司收到了中国证监会湖北监管局《行政处罚决定书》,中国证监会湖北监管局对公司信息披露违法事项已调查、审理终结,并对公司及相关当事人进行了处罚。

涉及信息披露的问题是广东顾地(顾地科技原大股东)。在2015年3月13日,广东顾地同重庆涌瑞股权投资有限公司、杭州德力西集团有限公司、邢某亚等三方签订《股份转让协议》(以下简称《转让协议》)和《股份转让补充协议》(以下简称《补充协议》)。《补充协议》在《转让协议》的基础上,在履约保证金、股东权益、现金分红、违约责任等方面增加了实质性内容,并明确约定"本补充协议与《股份转让协议》具有同等法律效力,本补充协议与《股份转让协议》不一致的,以本补充协议为准"。上述协议签署时,广东顾地时任董事长邱丽娟(同时担任顾地科技董事)、董事林超群(同时担任顾地科技董事长)、董事林昌华(同时担任顾地科技董事,副总经理)和董事林昌盛均在《转让协议》和《补充协议》文件上签字。广东顾地副董事长麦浩文承认其在广东顾地董事会决议此次股份转让的事项上签字,并参与过上述协议的协商。2015年3月17日,广东顾地在披露的简式权益报告书中未将《补充协议》列入备查文件,也未就是否存在补充协议进行说明。顾地科技在披露的《关于控股股东转让公司股份的提示性公告》中只披露了本次股份变动计划情况、《转让协议》、《简式权益报告书》等,没有提及《补充协议》。

我们认为,此次处罚并不影响本基金对该只股票投资,原因如下:

1.造成此次事件的原因是原大股东,及原高管的不当操作造成。公司已于2016年4月26日(本基金投资该股票前)完成股权变更,实际控制人已发生变更,涉事高管也已离职。

2.处罚对公司投资价值不构成损害。

3.公司承诺将以此为戒,严格按照《公司法》、《证券法》、《上市公司信息披露管理办法》、《深圳证券交易所股票上市规则》、《中小企业板上市公司规范运作指引》等法律法规的要求,进一步提高规范运作意识、强化公司内部治理及信息披露管理,真实、准确、完整、及时地履行信息披露义务。

5.11.2

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股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	165,144.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,655.99
5	应收申购款	7,964.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	175,765.90

5.11.4 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处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002694	顾地科技	15,583,680.00	8.36	临时停牌
2	600581	八一钢铁	7,440,900.00	3.99	临时停牌
3	300340	科恒股份	6,265,230.00	3.36	临时停牌

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	244,709,969.22
报告期期间基金总申购份额	2,780,580.06
减:报告期期间基金总赎回份额	21,798,358.75
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	225,692,190.53

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,001,250.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,001,250.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	4.43

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金申购、赎回本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

2、《泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

9.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所,供投资者免费查阅。在支付必要的工本费后,投资者可在有效的工作时间内取得本报告及上述备查文件的复制件。

9.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站(www.ftfund.com)查阅上述相关文件,或拨打客户服务中心电话(400-888-5988,021-38784566),和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司

2017年10月26日

泰信天天收益货币市场基金

2017年第三季度报告

基金管理人:泰信基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月26日

§1 重要提示

本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。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据基金合同已于2017年10月25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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信天天收益货币		
交易代码	290001		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2004年2月10日		
报告期末基金份额总额	1,000,023,515.67份		
投资目标	确保本金安全和资产的充分流动性,追求超过业绩比较基准的现金收益。		
投资策略	运用久期控制、类别配置和无风险套利等投资策略追求低风险稳定收益并保持基金资产的最佳流动性。		
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为货币市场基金,为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。		
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	泰信天天收益A	泰信天天收益B	泰信天天收益E
下属分级基金的交易代码	290001	002234	002235
报告期末下属分级基金的份额总额	176,694,288.40份	823,325,367.85份	3,859.42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7月1日 - 2017年9月30日)		
	泰信天天收益A	泰信天天收益B	泰信天天收益E
1. 本期已实现收益	1,682,328.68	8,351,986.42	36.11
2. 本期利润	1,682,328.68	8,351,986.42	36.11
3. 期末基金资产净值	176,694,288.40	823,325,367.85	3,859.42

注:1、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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本基金收益分配是按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰信天天收益A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9509%	0.0032%	0.3450%	0.0000%	0.6059%	0.0032%

注:本基金业绩比较基准为:七天通知存款利率(税后)

泰信天天收益B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0116%	0.0032%	0.3450%	0.0000%	0.6666%	0.0032%

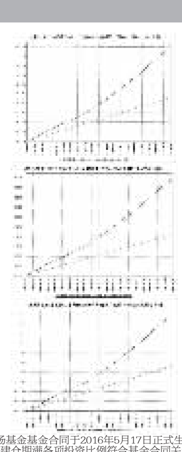
注:本基金业绩比较基准为:七天通知存款利率(税后)

泰信天天收益E

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9414%	0.0032%	0.3450%	0.0000%	0.5964%	0.0032%

注:本基金业绩比较基准为:七天通知存款利率(税后)

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、泰信天天收益货币市场基金基金合同于2016年5月17日正式生效。

2、本基金建仓期为六个月。建仓期满各项投资比例符合基金合同关于投资组合的相关规定。 本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金、通知存款、短期融资券(包含超级短期融资券)、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据,以及法律法规或中国证监会、中国人民银行允许基金投资的其他具有良好流动性的货币市场工具(但须符合中国证监会的有关规定)。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何俊春女士	基金投资部固定收益投资总监、本基金基金经理兼泰信双息双利债券、泰信债券增强收益、泰信债券周期回报、泰信鑫益定期开放债券、泰信鑫利混合基金经理	2016年10月11日	-	21年	工商管理硕士。具有基金从业资格。曾任职于上海鸿安投资咨询有限公司、齐鲁证券上海斜土路营业部。2002年12月加入泰信基金管理有限公司,先后担任泰信天天收益基金交易员、交易主管,泰信天天收益基金经理。自2008年10月10日起担任泰信双息双利债券基金经理;自2009年7月29日起担任泰信债券增强收益基金经理;自2012年10月25日起担任泰信债券周期回报基金经理;自2013年7月17日起担任泰信鑫益定期开放债券基金经理;自2017年5月25日起任泰信鑫利混合基金经理。现同时担任基金投资部固定收益投资总监。

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

在本报告期内,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》、《泰信天天收益货币市场基金基金合同》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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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《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相关的各环节,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,基金经理严格遵守公平、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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金无异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年第三季度,市场进入主动去杠杆阶段,债券收益率未出现趋势性下行,多以震荡为主。7月监管政策逐渐明朗化。全国金融工作会议也未超出市场预期,对债市的影响较小;月末央行维护流动性稳定意图明显;虽然短期内经济数据回暖,显示经济基本面有一定韧性,但对长端债券造成的扰动幅度并不大,当月收益率呈现震荡走势。8月整体资金面前松后紧,短期流动性总体偏紧,央行"削峰"操作对市场宽松预期打击较大;虽然当月经济数据有所回落,但债市预期仍然出现分化,叠加8月央行特别国债发行,市场出现一定的紧张情绪,使得收益率出现震荡上行。9月央行继续维持资金面紧平衡,资金面宽松程度不及3月和6月,短端债券收益率下行幅度不及长端;同时当月经济数据全面回落,受此影响,长端债券收益率小幅下行。三季度末较二季度末一年期国开债、AAA短融和AA+短融分别上行9bp、12bp和14bp。

天天收益基金在三季度继续维持适中偏短的久期策略。所持存单和短融信用评级较高、流动性好。同时择时调整逆回购资产配置比例和期限,使得基金在面临市场波动时仍具有较好的流动性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期泰信天天收益A的基金份额净值收益率为0.9509%,本报告期泰信天天收益B的基金份额净值收益率为1.0116%,本报告期泰信天天收益E的基金份额净值收益率为0.9414%,同期业绩比较基准收益率为0.3450%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	872,561,795.08	86.97
	其中:债券	872,561,795.08	86.97
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	109,956,004.93	10.96
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	19,505,844.56	1.94
4	其他资产	1,255,047.86	0.13
5	合计	1,003,278,692.43	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	2.49
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:1、上表中报告期内债券回购融资余额为报告期内每个交易日的融资余额的合计数,报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

2、本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	71
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	94
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	56

注:本报告期内无投资组合平均剩余期限超过 120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	34.92	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	22.91	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	12.88	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	12.93	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	16.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		100.20	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

报告期内投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,950,002.38	4.99
	其中:政策性金融债	49,950,002.38	4.99
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,000,826.18	3.00
6	中期票据	-	-
7	同业存单	792,610,966.52	79.26
8	其他	-	-
9	合计	872,561,795.08	87.25
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170203	17国开03	500,000	49,950,002.38	4.99
2	111780924	17宁波银行CD123	500,000	49,941,481.86	4.99
3	111710185	17兴业银行CD185	500,000	49,941,105.43	4.99
4	111709316	17浦发银行CD316	500,000	49,826,670.73	4.98
5	111705046	17建设银行CD046	500,000	49,820,903.45	4.98
6	111708254	17中信银行CD254	500,000	49,812,982.95	4.98
7	111717179	17光大银行CD179	500,000	49,731,133.46	4.97
8	111715312	17民生银行CD312	500,000	49,583,988.79	4.96
9	111708327	17中信银行CD327	500,000	49,513,398.95	4.95
10	111714214	17江苏银行CD214	500,000	49,388,312.21	4.94

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0802%
报告期内偏离度的最低值	-0.0415%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0308%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期本基金未发生负偏离度的绝对值达到0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期本基金未发生正偏离度绝对值达到0.5%的情况。

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

(1)本基金所持有的债券(包括票据)采用摊余成本法进行估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。

(2)本基金持有的回购以成本列示,按实际利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息;合同利率与实际利率差异较小的,也可采用合同利率计算确定利息收入。

(3)本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示,按相应利率逐日计提利息。

5.9.2

本基金本期末持有的前十名证券中没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,255,047.86
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,255,047.86

5.9.4 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	泰信天天收益A	泰信天天收益B	泰信天天收益E
报告期期初基金份额总额	94,633,605.75	1,124,005,310.08	3,836.69
报告期期间基金总申购份额	492,982,500.54	788,652,724.99	36.73
报告期期间基金总赎回份额	410,921,817.89	1,089,332,667.22	14.00
报告期期末基金份额总额	176,694,288.40	823,325,367.85	3,859.42

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2017年7月10日	141,939.26	141,939.26	0.00%
2	红利再投	2017年8月10日	152,297.61	152,297.61	0.00%
3	赎回	2017年8月29日	23,230,492.89	23,282,853.86	0.00%
4	红利再投	2017年9月11日	71,358.01	71,358.01	0.00%
5	申购	2017年9月18日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
合计			33,596,087.77	33,648,448.74	

注:依据《泰信天天收益货币市场基金招募说明书》的相关约定,本基金不收取申购赎回费用。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
	1	20170701-20170930	439,951,060.06	3,619,229.30	150,000,000.00	293,570,289.36	29.36%
	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形,本基金管理人已经采取措施,审慎确认大额申购与大额赎回,防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金的基金管理人于2017年8月29日申请赎回泰信天天收益货币B类23,230,492.89份。

本基金的基金管理人于2017年9月18日申请申购泰信天天收益货币B类10,000,000.00份。

本基金基金管理人的股东于2017年7月3日申请赎回泰信天天收益货币B类30,000,000.00份。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰信天天收益开放式证券投资基金设立的文件

2、《泰信天天收益货币市场基金基金合同》

3、《泰信天天收益货币市场基金招募说明书》

4、《泰信天天收益货币市场托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

9.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所,供投资者免费查阅。在支付必要的工本费后,投资者可在有效的工作时间内取得本报告及上述备查文件的复制件。

9.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站(www.ftfund.com)查阅上述相关文件,或拨打客户服务中心电话(400-888-5988,021-38784566),和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司

2017年10月26日

泰信增强收益债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:泰信基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月26日

§1 重要提示

本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。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据基金合同已于2017年10月25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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为 2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信债券增强收益	
交易代码	290007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年7月29日	
报告期末基金份额总额	20,171,040.06份	
投资目标	在获取债券稳定收益的基础上,通过股票一级市场申购等手段谋求高于比较基准的收益。	
投资策略	本基金根据对宏观经济形势、货币和财政政策变化、经济周期及利益走势、企业盈利和信用状况、基金流动性情况等的动态分析,通过召开投资决策委员会,确定基金中各类资产的配置比例范围,并跟踪影响资产策略配置的各种因素的变化,定期对资产策略配置比例进行调整。	
业绩比较基准	80%*上证企业债指数+20%*上证国债指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的低风险、低收益品种,其长期平均风险和预期收益率低于混合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	泰信债券增强收益A	泰信债券增强收益C
下属分级基金的交易代码	290007	291007
报告期末下属分级基金的份额总额	14,753,178.64份	5,417,861.42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7月1日 - 2017年9月30日)	
	泰信债券增强收益A	泰信债券增强收益C
1. 本期已实现收益	172,763.03	75,921.35
2. 本期利润	108,992.69	46,052.54
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0073	0.0066
4. 期末基金资产净值	15,050,379.73	5,489,255.87
5. 期末基金份额净值	1.0201	1.0132

注:1、上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。

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰信债券增强收益A

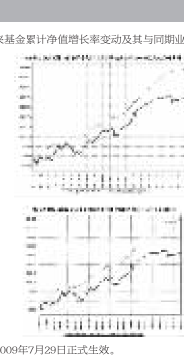
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.72%	0.05%	0.75%	0.02%	-0.03%	0.03%

泰信债券增强收益C

阶段	净值增长率①	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	0.64%	0.05%	0.75%	0.02%	-0.11%	0.03%

注:本基金的业绩比较基准为:80%上证企业债指数+20%上证国债指数。

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



注:1、本基金基金合同于2009年7月29日正式生效。

2、本基金建仓期为六个月。建仓期满,本基金投资于债券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于基金资产的20%,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%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何俊春女士	基金投资部固定收益投资总监、本基金基金经理兼泰信天天收益货币基金、泰信双息双利基金、泰信债券周期回报基金、泰信鑫益定期开放债券、泰信鑫利混合基金经理	2009年7月29日	-	21年	工商管理硕士。具有基金从业资格。曾任职于上海鸿安投资咨询有限公司、齐鲁证券上海斜土路营业部。2002年12月加入泰信基金管理有限公司,先后担任泰信天天收益基金交易员、交易主管,泰信天天收益基金经理。自2008年10月10日起担任泰信双息双利债券基金经理;自2012年10月25日起担任泰信债券周期回报基金经理;自2013年7月17日起担任泰信鑫益定期开放债券基金经理;自2016年10月11日起担任泰信天天收益货币基金经理;自2017年5月25日任泰信鑫利混合基金经理。现同时担任基金投资部固定收益投资总监。

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》、《泰信增强收益债券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规和基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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《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相关的各环节,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,基金经理严格遵守公平、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本基金与其他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,亦无其他异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年3季度,国内宏观经济有所走弱,固定资产投资增速小幅下行,地产投资受到销售走弱影响,稳增长的助力之一基建投资同比增速也有所下行,中采制造业PMI继续改善,规模以上工业增加值低于预期。3季度社会消费品零售总额月度同比下滑,出口走弱。3季度宏观政治仍维持中性偏紧,央行公开市场操作稳健,季度末为支持金融机构发展普惠金融业务,下调了达标机构的存款准备金率,并自2018年起实施。3季度基础货币供应量M1、M2下行,但社会融资规模整体维持高位,信贷占比进一步抬升。8月通胀小幅超预期,但食品价格回升力度不足,压制9月价格表现。3季度,海外经济体弱复苏,美联储缩表临近。

3季度在货币供应下行背景下,央行整体维持流动性紧平衡,公开市场仅进行了不足1300亿元的净投放,R007季度回购均值显著上行,债券市场呈现弱势调整。短端利率在先松后紧的资金面牵动下震荡走高,长端收益率则在基本面逐步走弱及通胀改善的预期影响下先升后降。季末看,10年期国债及国开债分别收于3.61%及4.19%,较上季末上行5和下行1个基点,而1年期品种则分别收于3.47%及3.96%,上行了近1和9个基点。信用债方面,受到流动性及基本面的分化影响,长久期品种表现优于短久期品种,信用等级分化也较为严重,中低等级品种在机构配置的保护下表现好于高等级信用债。季末,3年期AA及AA+企业债受于4.99%及4.83%,上行近4和14个基点。受供给侧改革拉动,周期性行业标的整体表现良好,信用利差有所收缩。季内五洋建设、厉华婕妤两家企业实质违约。3季度,转债标的受正股带动收益表现良好,保险标的表现最佳。一级市场新发国君、雨虹两只转债及中油等4只EB,一级申购表现良好,但伴随转债信用申购新方案出台,新增的参与者或摊薄一级申购收益。

3季度增强收益维持当前债券的配置,整体久期保持3年左右。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰信债券增强收益A基金份额净值为1.0201元,本报告期基金份额净值增长率为0.72%;截至本报告期末泰信债券增强收益C基金份额净值为1.0132元,本报告期基金份额净值增长率为0.64%;同期业绩比较基准收益率为0.75%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期本基金资产净值连续低于五千万元。依据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,我公司已向中国证监会报送泰信增强收益债券型证券投资基金拟申请转型的解决方案。具体实施方案待与托管行沟通确认及完成公司内容审核流程后再呈报证监会。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,428,168.30	85.24
	其中:债券	18,428,168.30	85.24
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,892,106.08	13.38
8	其他资产	298,471.81	1.38
9	合计	21,618,746.19	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港股通投资股票投资组合

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

报告期末本基金未持有股票。

5.4 报告期末按债券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	国家债券	5,962,100.00	29.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	12,465,450.00	60.69
	其中:政策性金融债	12,465,450.00	60.69
4	企业债券	618.30	0.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,428,168.30	89.72

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150412	15农发12	100,000	9,954,000.00	48.46
2	019512	15国债12	50,000	4,977,000.00	24.23
3	018005	国开1701	15,000	1,490,250.00	7.26
4	018002	国开1302	10,000	1,021,200.00	4.97
5	019537	16国债09	10,000	985,100.00	4.80

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支持证券投资明细

本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

本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

报告期内本基金投资的前十名证券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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,860.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	296,113.03
5	应收申购款	498.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	298,471.81

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处于转股期的可转换债券。

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 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	泰信债券增强收益A	泰信债券增强收益C
报告期期初基金份额总额	14,970,397.48	8,218,151.53
报告期期间基金总申购份额	34,369.28	116,338.59
减:报告期期间基金总赎回份额	251,588.12	2,916,628.70
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	14,753,178.64	5,417,861.42

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金申购、赎回本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170701-20170930	11,901,408.45	-	-	11,901,408.45	59.00%
	-	-	-	-	-	-	-
个人							
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形,本基金管理人已经采取措施,审慎确认大额申购与大额赎回,防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰信增强收益债券型证券投资基金设立的文件

2、《泰信增强收益债券型证券投资基金基金合同》

3、《泰信增强收益债券型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信增强收益债券型证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

9.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所,供投资者免费查阅。在支付必要的工本费后,投资者可在有效的工作时间内取得本报告及上述备查文件的复制件。

9.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站(www.ftfund.com)免费查阅上述相关文件,或拨打客户服务中心电话(400-888-5988,021-38784566),和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司

2017年10月26日