申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:申万菱信基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年十月二十六日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	申万菱信中证环保产业指数分级		
场内简称	申万环保		
基金主代码	163114		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年5月30日		
报告期末基金份额总额	911,959,088.05份		
投资目标	本基金采取指数化投资方式，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，实现对中证环保产业指数的有效跟踪。		
投资策略	本基金股票投资策略主要采用完全复制的方法进行投资，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。本基金股指期货投资策略为在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。		
业绩比较基准	95%×中证环保产业指数收益率+5%×银行同业存款利率		
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	申万环保	环保A	环保B
下属分级基金的场内简称	申万环保	环保A	环保B
下属分级基金的交易代码	163114	150184	150185
报告期末下属分级基金的份额总额	440,418,344.05份	235,770,372.00份	235,770,372.00份
下属分级基金的风险收益特征	申万环保份额为常规指数基金份额，具有预期风险较高、预期收益较高的特征，其预期风险和预期收益水平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。	申万环保A 份额，具有预期风险低，预期收益低的特征。	申万环保B 份额由于利用杠杆投资，具有预期风险高、预期收益高的特征。

§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	-10,859,068.47
2.本期利润	59,569,961.95
3.加权平均基金份额本期利润	0.0612
4.期末基金资产净值	895,142,699.39
5.期末基金份额净值	0.9816

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)上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

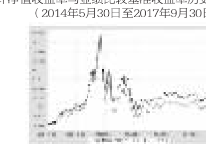
3.2 基金净值表现

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	6.96%	0.87%	6.72%	0.88%	0.24%	-0.01%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2014年5月30日至2017年9月30日)



§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		
袁英杰	本基金基金经理	2015-01-30	-	10年	袁英杰先生，硕士研究生。曾任职于兴业证券、申银万国证券研究所等，2013年5月加入申万菱信基金管理有限公司，曾任高级数量研究员，基金经理助理，申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、申万菱信深证成指分级证券投资基金基金经理，现任申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金、申万菱信中证500指数优选增强型证券投资基金、申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)、申万菱信臻选6个月定期开放混合型证券投资基金、申万菱信智选一年期定期开放混合型证券投资基金、申万菱信中证500指数增强型证券投资基金、申万菱信价值优利混合型证券投资基金基金经理。
俞诚	本基金基金经理	2015-12-03	-	8年	俞诚先生，经济学学士。2009年开始从事证券相关工作，2009年8月加入申万菱信基金管理有限公司，历任产品与金融工程总部金融工程师，数量研究员，申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、申万菱信沪深300价值指数证券投资基金基金经理，现任申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、申万菱信中证500指数增强型证券投资基金、申万菱信价值优享混合型证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

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守《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规的规定，严格遵守基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定，信息披露及时、准确、完整;本基金资产与本基金管理人与公司资产之间严格分开;没有发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。在基金资产的管理运作中，无任何损害基金持有人利益的行为，并通过稳健经营、规范运作、规避风险，保护了基金持有人的合法权益。

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》，本公司制定了《公平交易制度》，通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务(包括研究分析、投资决策、交易执行等)环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在投资和研究方面，本公司投资和研究部门不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境。

在交易执行方面，本公司的投资管理职能和交易执行职能相隔离，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在日常监控和事后分析评估方面，本公司风险管理总部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。风险管理总部通过对不同组合之间同向交易的价差率的假设检验、价格占优的次数百分比统计、价差交易模拟贡献与组合收益率差异的比较等方法对本报告期以及连续四个季度期间内、不同时间窗口下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析;对于场外交易，还特别对比了组合之间发生的同向交易的市场公允价格和交易对手，判断交易是否公平且是否涉及利益输送。

本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本公司制定了《异常交易监控报告制度》，明确定义了在投资交易过程中出现的各种可能导致不公平交易和利益输送的异常交易类型，并规定且落实了异常交易的日常监控、识别以及事后的分析流程。

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有一次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2017年三季度，沪深A股整体走势稳步向上，指数大小盘结构化剪刀差有所收敛。报告期内，在流动性中性的环境下，市场依然青睐业绩稳定、估值更具有优势的蓝筹股以及白马成长板块，而市场担忧的是以小盘为代表的创业板个股未来高增长能否持续。2017年三季度，上证综指上涨4.90%，深证成份指数上涨5.30%，沪深300指数上涨4.63%，中证500指数上涨7.58%，中小板指数上涨8.86%，创业板指数上涨2.69%，显示中小盘风格相对占优。

操作上，基金运作主要着眼于控制每日跟踪误差、净值表现和业绩基准的偏差幅度。从实际运作结果观察，基金跟踪误差的主要来源有长期停牌股票估值调整以及指数成分股定期调整。

本基金产品在申万菱信中证环保指数分级基金之基础份额的基础上，设计了环保A份额和环保B份额。环保A和环保B份额之比为1:1。

从整体折溢价水平来看，本基金在报告期内折溢价率溢价幅度最大接近2.49%，折价幅度最大接近-0.92%。

作为被动投资的基金产品，申万菱信中证环保指数分级基金将继续坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，使得投资者可以清晰地计算出分级端两个产品的折溢价状况。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2017年三季度中证环保指数期间表现为7.06%，基金业绩基准表现为6.72%，申万菱信中证环保指数分级基金净值期间表现为6.96%，领先业绩基准0.24%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	821,513,033.54	91.43
	其中:股票	821,513,033.54	91.43
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	-	-
	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	75,255,737.70	8.38
7	其他各项资产	1,727,921.24	0.19
8	合计	898,496,692.48	100.00

注:本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

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	39,793.60	0.00
C	制造业	536,824,990.87	59.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	110,385,790.09	12.33
E	建筑业	55,103,337.33	6.16
F	批发和零售业	26,380.90	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,687,092.95	3.54
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,771,502.22	0.76
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	72,360,050.00	8.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.01
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.00
S	综合	8,129,223.18	0.91
	合计	821,513,033.54	91.77

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

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	601012	隆基股份	468,882.00	13,817,952.54	1.54
2	002129	中环股份	1,191,128.00	12,697,424.48	1.42
3	600884	杉杉股份	523,606.00	12,629,376.72	1.41
4	002340	格林美	1,438,964.00	12,461,428.24	1.39
5	300274	阳光电源	718,381.00	12,090,352.23	1.35
6	002056	横店东磁	1,066,338.00	11,601,757.44	1.30
7	300355	蒙草生态	845,323.00	10,913,119.93	1.22
8	300317	珈伟股份	545,536.00	10,463,380.48	1.17
9	002366	台海核电	363,432.00	10,299,662.88	1.15
10	300323	华灿光电	550,105.00	10,138,435.15	1.13

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未投资股指期货交易。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货交易。

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

本基金本报告期末未投资国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货交易。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货交易。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	96,150.36
2	应收证券清算款	188,575.68
3	应收股利	-
4	应收利息	15,245.32
5	应收申购款	1,427,949.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,727,921.24

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末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	002129	中环股份	12,697,424.48	1.42	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	申万环保	环保A	环保B
本报告期期初基金份额总额	529,397,485.10	251,723,322.00	251,723,322.00
报告期基金总申购份额	77,210,598.00	-	-
减:报告期基金总赎回份额	198,095,639.05	-	-
报告期基金拆分变动份额	31,905,900.00	-15,952,950.00	-15,952,950.00
本报告期期末基金份额总额	440,418,344.05	235,770,372.00	235,770,372.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

§8备查文件目录

8.1 备查文件目录

基金合同;

招募说明书及其定期更新;

发售公告;

成立公告;

开放日常交易业务公告;

定期报告;

其他临时公告。

8.2 存放地点

上述备查文件中基金合同、招募说明书及其定期更新、基金发售公告和基金成立公告均放置于本基金管理人及基金托管人的住所;开放日常交易业务公告、定期报告和其他临时公告放置于本基金管理人的住所。本基金管理人住所地址为:中国上海市中山南路100号11层。

8.3 查阅方式

上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址:www.swsmu.com。

申万菱信基金管理有限公司
二〇一七年十月二十六日

申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:申万菱信基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年十月二十六日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	申万菱信中证申万医药生物指数分级		
场内简称	医药生物		
基金主代码	163118		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年6月19日		
报告期末基金份额总额	959,261,871.31份		
投资目标	本基金采取指数化投资方式，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，实现对中证申万医药生物指数的有效跟踪。		
投资策略	本基金股票投资策略主要采用完全复制的方法进行投资，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。本基金股指期货投资策略为在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。		
业绩比较基准	95%×中证申万医药生物指数收益率+5%×银行同业存款利率		
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	医药生物	SW医药A	SW医药B
下属分级基金的场内简称	医药生物	SW医药A	SW医药B
下属分级基金的交易代码	163118	150283	150284
报告期末下属分级基金的份额总额	840,406,358.31份	59,427,756.00份	59,427,757.00份
下属分级基金的风险收益特征	申万医药份额为常规指数基金份额，具有预期风险较高、预期收益较高的特征，其预期风险和预期收益水平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。	申万医药A份额，具有预期风险低，预期收益低的特征。	申万医药B份额由于利用杠杆投资，具有预期风险高、预期收益高的特征。

§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	-2,166,195.30
2.本期利润	-7,130,125.63
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0071
4.期末基金资产净值	853,530,042.60
5.期末基金份额净值	0.8898

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)上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金各项费用后，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	-0.63%	0.59%	-0.79%	0.61%	0.16%	-0.02%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年6月19日至2017年9月30日)

§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		
张少华	副总经理兼固定收益投资总部总监，本基金基金经理	2015-06-19	-	18年	张少华先生，硕士研究生。曾任职于申银万国证券，2003年1月加入申万巴黎基金筹备组，后正式加入申万菱信基金管理有限公司，曾任风险管理总部总监，基金投资管理总部副总监、总监，申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)、申万菱信沪深300价值指数证券投资基金、申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金基金经理，现任公司副总经理兼固定收益投资总部总监，申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金基金经理。
荆一帆	本基金基金经理	2017-06-01	-	5年	荆一帆先生，硕士研究生。2012年起从事金融相关工作，曾任职于华夏基金管理有限公司、国投瑞银基金管理有限公司，2017年加入申万菱信基金管理有限公司，现任申万菱信沪深300价值指数证券投资基金、申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)、申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

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守《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规的规定，严格遵守基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定，信息披露及时、准确、完整;本基金资产与本基金管理人与公司资产之间严格分开;没有发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。在基金资产的管理运作中，无任何损害基金持有人利益的行为，并通过稳健经营、规范运作、规避风险，保护了基金持有人的合法权益。

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》，本公司制定了《公平交易制度》，通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务(包括研究分析、投资决策、交易执行等)环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在投资和研究方面，本公司投资和研究部门不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境。

在交易执行方面，本公司的投资管理职能和交易执行职能相隔离，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在日常监控和事后分析评估方面，本公司风险管理总部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。风险管理总部通过对不同组合之间同向交易的价差率的假设检验、价格占优的次数百分比统计、价差交易模拟贡献与组合收益率差异的比较等方法对本报告期以及连续四个季度期间内、不同时间窗口下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析;对于场外交易，还特别对比了组合之间发生的同向交易的市场公允价格和交易对手，判断交易是否公平且是否涉及利益输送。

本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本公司制定了《异常交易监控报告制度》，明确定义了在投资交易过程中出现的各种可能导致不公平交易和利益输送的异常交易类型，并规定且落实了异常交易的日常监控、识别以及事后的分析流程。

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有一次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2017年三季度，上海与深圳A股整体均有所上涨。中小盘股票表现更佳。2017年三季度，上证综指上涨4.90%，深证成份指数上涨5.30%，沪深300指数上涨4.63%，中证500指数上涨7.58%;中小板指数上涨8.86%，创业板指数上涨2.69%。

操作上，基金运作主要着眼于控制每日跟踪误差、净值表现和业绩基准的偏差幅度。从实际运作结果观察，基金跟踪误差的主要来源是长期停牌股票估值调整。

本基金产品在申万菱信中证申万医药行业投资指数分级基金之基础份额的基础上，设计了申万医药A份额和申万医药B份额。申万医药A和申万医药B份额之比为1:1。

从整体折溢价水平来看，本基金折溢价率基本在-1%至1%之间，波动幅度较小。

作为被动投资的基金产品，申万菱信中证申万医药行业指数分级基金将继续坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，使得投资者可以清晰地计算出分级端两个产品的折溢价状况。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2017年三季度中证申万医药行业成份指数期间表现为-0.85%，基金业绩基准表现为-0.79%，申万菱信中证申万医药行业指数分级基金净值期间表现为-0.63%，领先业绩基准0.16%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	790,748,775.93	92.16
	其中:股票	790,748,775.93	92.16
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	-	-
	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	67,027,161.94	7.81
7	其他各项资产	253,182.63	0.03
8	合计	858,029,120.50	100.00

注:本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

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	659,789,252.23	77.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	82,260,922.07	9.64
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.00
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	5,849,491.20	0.69
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	42,730,976.55	5.01
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.01
S	综合	-	-
	合计	790,748,775.93	92.64

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

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	600276	恒瑞医药	1,126,632.00	67,519,055.76	7.91
2	600518	康美药业	1,978,398.00	39,726,231.84	4.65
3	000538	云南白药	347,074.00	31,479,611.80	3.69
4	600196	复星医药	670,267.00	22,916,428.73	2.68
5	000423	东阿阿胶	348,777.00	22,646,090.61	2.65
6	002252	上海莱士	993,750.00	20,679,937.50	2.42
7	601607	上海医药	769,099.00	18,258,410.26	2.14
8	000963	华东医药	324,004.00	15,898,876.28	1.86
9	600867	通化东宝	796,220.00	15,367,046.00	1.80
10	300003	乐普医疗	712,547.00	15,312,635.03	1.79

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	42,081.43
2	应收证券清算款	184,034.57
3	应收股利	-
4	应收利息	12,516.93
5	应收申购款	14,549.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	253,182.63

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	医药生物	SW医药A	SW医药B
本报告期期初基金份额总额	903,703,260.71	65,776,518.00	65,776,519.00
报告期基金总申购份额	6,796,516.51	-	-
减:报告期基金总赎回份额	82,790,942.91	-	-
报告期基金拆分变动份额	12,697,524.00	-6,348,762.00	-6,348,762.00
本报告期期末基金份额总额	840,406,358.31	59,427,756.00	59,427,757.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

§8备查文件目录

8.1 备查文件目录

基金合同;

招募说明书及其定期更新;

发售公告;

成立公告;

开放日常交易业务公告;

定期报告;

其他临时公告。

8.2 存放地点

上述备查文件中基金合同、招募说明书及其定期更新、基金发售公告和基金成立公告均放置于本基金管理人及基金托管人的住所;开放日常交易业务公告、定期报告和其他临时公告放置于本基金管理人的住所。本基金管理人住所地址为:中国上海市中山南路100号11层。

8.3 查阅方式

上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址:www.swsmu.com。

申万菱信基金管理有限公司
二〇一七年十月二十六日

泰信中证200指数证券投资基金

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。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信中证200指数
交易代码	290010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月9日
报告期末基金份额总额	51,594,029.65份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资方法，通过严格的投资流程约束和数量化风险管理手段，以实现对标的指数的有效跟踪。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，按照在中证200指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合和跟踪中证200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	中证200指数收益率×95% + 商业银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险和较高预期收益的特征，其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。其风险因素主要来自于市场风险和跟踪误差的风险。
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

§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	87,292.92
2.本期利润	2,503,046.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0483
4.期末基金资产净值	56,866,861.01
5.期末基金份额净值	1.102

注:1、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。

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。

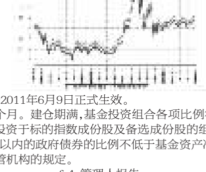
3.2 基金净值表现

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

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	4.55%	0.72%	4.71%	0.74%	-0.16%	-0.02%

注:本基金业绩比较基准为:中证200指数收益率×95% + 商业银行活期存款利率(税后)×5%。

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2011年6月9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:股票资产占基金资产90%-95%，投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于股票资产的90%。现金以及到期日在1年以内的政府债券的比例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。

§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		
张彦先生	本基金经理兼泰信中证基本面400指数分级基金经理	2015年1月6日	-	11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锐联基本面400指数分级基金经理。

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200指数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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，随着供给侧改革初见成效，企业盈利显著增加，上证指数三季度上证综指上涨4.9%，中小板上涨8.86%，创业板则上涨2.69%，前进周期股和大盘蓝筹股表现突出，后期中小板表现强劲，市场热点不断扩散。

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0.8%。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。

4.5 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1.102元;本报告期基金份额净值增长率为4.55%，业绩比较基准收益率为4.71%。

§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	53,409,158.76	93.70
	其中:股票	53,409,158.76	93.70
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	3,580,631.01	6.28
8	其他资产	11,504.40	0.02
9	合计	57,001,294.17	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	414,367.63	0.73
B	采矿业	2,117,803.12	3.72
C	制造业	25,052,981.40	44.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,049,680.54	1.85
E	建筑业	1,814,379.32	3.19
F	批发和零售业	2,537,883.32	4.46
G	交通运输、仓储和邮政业	2,374,195.87	4.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,354,466.73	9.42
J	金融业	5,626,428.64	9.89
K	房地产业	2,460,540.14	4.33
L	租赁和商务服务业	1,087,483.63	1.91
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	728,418.72	1.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	285,768.00	0.50
R	文化、体育和娱乐业	1,342,807.51	2.36
S	综合	644,464.21	1.13
	合计	52,891,668.78	93.01

5.2.2 报告期末积极投资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	采掘业	-	-
C	制造业	398,014.72	0.70
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	97,511.26	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	21,964.00	0.04
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	-	-
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	517,489.98	0.91

注:积极投资股票为被动持有非当前成分股，将逐步进行调整成分股。

5.2.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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	600309	万华化学	19,049	802,915.35	1.41
2	600703	三安光电	33,880	783,983.20	1.38
3	002450	康得新	34,416	729,963.36	1.28
4	002230	科大讯飞	13,489	723,684.85	1.27
5	601600	中国铝业	91,200	690,384.00	1.21
6	601939	建设银行	93,542	651,987.74	1.15
7	002466	天齐锂业	8,309	584,039.61	1.03
8	601377	兴业证券	67,700	573,419.00	1.01
9	002456	欧菲光	26,467	560,835.73	0.99
10	000568	泸州老窖	9,762	547,648.20	0.96

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002129	中环股份	25,328	208,702.72	0.37
2	600666	奥瑞德	10,880	189,312.00	0.33
3	600648	外高桥	5,506	97,511.26	0.17
4	603885	吉祥航空	1,520	21,964.00	0.04

注:积极投资股票为被动持有非当前成分股，将逐步进行调整成分股。

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

截至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

截至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

截至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

截至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

截至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。

2016年6月份兴业证券被调查与欣泰电气财务造假一事有关。2017年6月1日欣泰电气涉嫌欺诈发行及信息披露违法违规案已由证监会调查完毕。证监会依法对欣泰电气及相关责任人作出行政处罚和市场禁入措施。随后2016年7月，中国证监会就作出了处罚决定:对兴业证券给予警告，没收保荐业务收入1,200万元，并处以2,400万元罚款;没收承销股票违法所得2078万元，并处以60万元罚款。对欣泰电气的保荐代表人兰翔、伍文祥给予警告，并分别处以30万元罚款，撤销证券从业资格，分别采取10年证券市场禁入措施。兴业证券将作为先行赔付专项基金的出资人，出资人民币5.5亿元设立先行赔付专项基金。2017年7月份兴业证券全部投行项目已经恢复受理。

故此，该事项已经了结，整体上上述处罚影响兴业证券2016年业绩，不影响公司当前业务经营和投资价值。2017年6月兴业证券入选中证200指数成分股，本基金作为完全复制基金，根据公司基金的合同，故此将兴业证券也纳入股票投资池。

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	2,591.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	649.74
5	应收申购款	8,262.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,504.40

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

5.11.6 报告期末指数投资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	601600	中国铝业	690,384.00	1.21	重大事项

5.11.7 报告期末积极投资前五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	002129	中环股份	208,702.72	0.37	重大事项
2	600666	奥瑞德	189,312.00	0.33	重大事项

5.11.8 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	51,250,315.01
报告期期间基金总申购份额	2,242,109.71
减:报告期期间基金总赎回份额	1,898,395.07
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	51,594,029.65

§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	19,037,101.35
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	19,037,101.35
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	36.90

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	26,439,218.54	-	-	26,439,218.54	51.24%
	2	20170701-20170930	19,037,101.35	-	-	19,037,101.35	36.90%
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中证200指数证券投资基金设立的文件

2、《泰信中证200指数证券投资基金基金合同》

3、《泰信中证200指数证券投资基金招募说明书》

4、《泰信中证200指数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