# 泰信鑫利混合型证券投资基金

## 2018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:2018年10月25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2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 泰信鑫利混合 | |
| 交易代码 | 004227 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017年5月25日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 37,962,711.55份 | |
| 投资目标 | 采用多种投资策略,在严格管理风险和保障必要流动性的前提下,力争实现长期稳健增值。 | |
| 投资策略 | 本基金的股票投资将行业精选和个股精选相结合,在宏观策略研究的基础上优选特定经济周期阶段下的优势行业,在优势行业中发掘具备投资价值的优势个股;在本基金的债券投资过程中,基金管理人将充分发挥在研究方面的专业化优势,采取积极主动的投资管理,以中长期利率趋势分析为基础,结合中长期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的债券组合投资收益。通过确定债券组合久期、确定债券组合期限结构配置和挑选个券等三个步骤构建债券组合,尽可能地控制风险、提高基金投资收益。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70% | |
| 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 | 中国银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 泰信鑫利混合A | 泰信鑫利混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 004227 | 004228 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 14,252,291.20份 | 23,710,420.35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(2018年7月1日 - 2018年9月30日) | |
|---|---|---|
| | 泰信鑫利混合A | 泰信鑫利混合C |
| 1. 本期已实现收益 | 5,140.55 | 5,883.99 |
| 2. 本期利润 | -113,936.15 | -192,552.83 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0075 | -0.0067 |
| 4. 期末基金资产净值 | 14,538,330.41 | 23,983,094.06 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0201 | 1.0115 |

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

泰信鑫利混合A

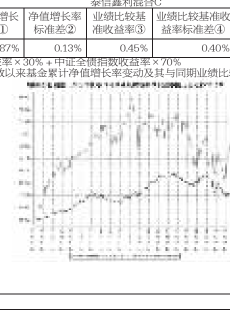
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -0.77% | 0.13% | 0.45% | 0.40% | -1.22% | -0.27% |

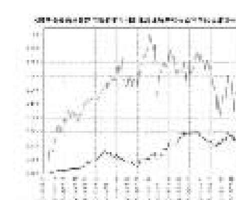
泰信鑫利混合C

| 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 | -0.87% | 0.13% | 0.45% | 0.40% | -1.32% | -0.27% |

注:沪深300指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%

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2017年5月25日正式生效。

2、本基金建仓期为六个月。建仓期满,基金的投资组合比例为:股票占基金资产的比例不超过30%;基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%;本基金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,应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,股指期货的投资比例遵循国家有关法律法规。

§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、泰信双息双利债券基金、泰信增强收益债券基金、泰信债券周期回报基金、泰信鑫益定期开放债券基金经理 | 2017年5月25日 | - | 22年 | 工商管理硕士,曾任职于上海鸿安投资咨询有限公司、齐鲁证券有限公司。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月起担任泰信双息双利债券基金基金经理;自2009年7月起担任泰信债券增强收益基金基金经理;自2012年10月起担任泰信债券周期回报基金基金经理。自2013年7月17日起担任泰信鑫益定期开放债券基金的基金经理。自2016年10月11日起担任泰信天天收益货币基金经理。现同时担任投资部固定收益投资总监。 |

注:1、以上任职日期是指基金合同生效的日期或公告日期;

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》、《泰信鑫利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

2018年3季度,宏观经济有所走弱,制造业指标下滑,9月中采PMI收于50.8,供需扩张双双放缓。基建投资下滑明显,地产销售走弱,开发商拿地热情降温。工业增加值及利润总额增速也呈放缓趋势。通胀3季度上升趋势延续,8月同比2.3%,而消费表现则较为平稳。3季度海外经济体表现整体良好,我国进出口数据相对平稳,但不排除中美贸易战冲突下,外贸企业提前出货,后续表现仍需持续关注。政策层面看,个人所得税改革出台,未来更多减税政策值得期待,宽财政政策也在逐步实施,财政部也加强对于地方政府债务风险管控。货币政策仍延续稳健的总基调,并未跟随美联储加息步伐,而是年内保持了接近季度一次的降准频率,并通过公开市场操作向市场注入了流动性。3季度社融规模仍较为平稳,信贷占比维持高位。

3季度市场走势分化,汇率持续贬值,原油上涨带来商品市场良好走势,股票市场震荡走平,债券市场表现良好,中债总财富指数上行1%,国债总财富指数上行0.19%。信用债总财富指数上行2.08%,转债上涨2.68%。充裕的市场流动性带来收益率曲线整体陡峭化下行。专项地方债发行也债市供需笼上了阴影,原油、房租、食品等价格因素上行提升了市场对通胀的担忧,长端收益率表现相对较弱。截止季末,1年期国债、国开债分别收于2.67%及3.08%。10年期国债、国开债分别收于3.61%及4.2%。信用市场方面,季度内民企违约不断,兵团六师的违约事件一度引发市场对于城投债的担忧。宽货币并未有效传导到宽信用。在利率债带动之下,信用债收益率曲线同样陡峭化下行,中高等级品种表现明显好于低等级品种。截止季末,3年期AAA及AA等级信用债收益率分别收于4.18%及5.01%较上季末下行37及49个基点。3季度转债指数在正股带动下有所上行,一级新债发行19只,受到股市行情影响,多只新债出现破发现象。二级存量标的走势分化,部分转债下修条款达成启动下修行为。

3季度,鑫利基金在加强产品流动性管理的基础上,根据市场情况,加强了权益类资产的波段操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰信鑫利混合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-0.77%;截至本报告期末泰信鑫利混合C基金份额净值为1.0115元,本报告期基金份额净值增长率为-0.87%;同期业绩比较基准收益率为0.45%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期本基金于2018年8月7日至2018年9月28日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 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 | 1,708,230.00 | 4.42 |
| | 其中:股票 | 1,708,230.00 | 4.42 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 20,951,496.12 | 54.21 |
| | 其中:债券 | 20,951,496.12 | 54.21 |
| | 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 | 15,460,204.07 | 40.00 |
| 8 | 其他资产 | 528,147.64 | 1.37 |
| 9 | 合计 | 38,648,077.83 | 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 | 1,552,430.00 | 4.03 |
| 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 | - | - |
| 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 | 155,800.00 | 0.40 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,708,230.00 | 4.43 |

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港股通股票。

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 | 002273 | 水晶光电 | 40,000 | 416,000.00 | 1.08 |
| 2 | 002241 | 歌尔股份 | 50,000 | 415,000.00 | 1.08 |
| 3 | 300545 | 联得装备 | 18,000 | 321,480.00 | 0.83 |
| 4 | 300750 | 宁德时代 | 3,000 | 219,000.00 | 0.57 |
| 5 | 300251 | 光线传媒 | 20,000 | 155,800.00 | 0.40 |
| 6 | 300236 | 上海新阳 | 4,000 | 91,200.00 | 0.24 |
| 7 | 300398 | 飞凯材料 | 5,000 | 89,750.00 | 0.23 |

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 | 6,089,580.00 | 15.81 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 12,999,159.60 | 33.75 |
| | 其中:政策性金融债 | 12,999,159.60 | 33.75 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债(可交换债) | 1,862,756.52 | 4.84 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 20,951,496.12 | 54.39 |

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 | 180205 | 18国开05 | 100,000 | 10,459,000.00 | 27.15 |
| 2 | 019534 | 16国债06 | 63,000 | 6,089,580.00 | 15.81 |
| 3 | 018002 | 国开1302 | 25,190 | 2,540,159.60 | 6.59 |
| 4 | 132009 | 17中油EB | 6,000 | 621,000.00 | 1.61 |
| 5 | 113017 | 吉视转债 | 5,750 | 520,605.00 | 1.35 |

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。

5.11.2

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 | 5,976.64 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 522,171.00 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 528,147.64 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 132009 | 17中油EB | 621,000.00 | 1.61 |
| 2 | 113017 | 吉视转债 | 520,605.00 | 1.35 |
| 3 | 128034 | 江银转债 | 348,622.50 | 0.91 |
| 4 | 127005 | 长证转债 | 145,438.02 | 0.38 |
| 5 | 128019 | 久立转2 | 142,755.00 | 0.37 |
| 6 | 128022 | 众信转债 | 84,336.00 | 0.22 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

| 项目 | 泰信鑫利混合A | 泰信鑫利混合C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 16,907,039.83 | 24,077,415.39 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 193.76 | 12,383,661.30 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 2,654,942.39 | 12,750,656.34 |
| 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 | 14,252,291.20 | 23,710,420.35 |

§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 | 4,866,154.00 |
| 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 | 4,866,154.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 12.82 |

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 | 20180701-20180930 | 22,562,291.54 | - | - | 22,562,291.54 | 59.43% |
| 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。 | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§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鑫利混合型证券投资基金设立的文件

2、《泰信鑫利混合型证券投资基金基金合同》

3、《泰信鑫利混合型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信鑫利混合型证券投资基金托管协议》

5、中国证监会批准设立泰信基金管理有限公司的文件

6、报告期内泰信鑫利混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

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

投资者可登录本基金管理人公司网站(http://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),和本公司客服联系。

泰信基金管理有限公司
2018年10月25日

# 泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金

## 2018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:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月25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。

本基金的托管人中信银行股份有限公司根据基金合同已于2018年10月22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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 泰信鑫益定期开放 | |
| 交易代码 | 000212 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2013年7月17日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 49,455,900.76份 | |
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下,本基金投资将追求资金的安全与长期稳定增长,并力求获得高于业绩比较基准的投资收益。 | |
| 投资策略 | 本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行整体资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例,在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上,根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。 | |
| 业绩比较基准 | 中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)+0.5%。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 泰信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 泰信鑫益定期开放A | 泰信鑫益定期开放C |
| 下属分级基金的交易代码 | 000212 | 000213 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 42,221,939.65份 | 7,233,961.11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(2018年7月1日 - 2018年9月30日) | |
|---|---|---|
| | 泰信鑫益定期开放A | 泰信鑫益定期开放C |
| 1. 本期已实现收益 | 658,424.63 | 106,612.66 |
| 2. 本期利润 | 614,021.31 | 98,138.88 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0119 | 0.0107 |
| 4. 期末基金资产净值 | 46,252,154.73 | 7,843,626.22 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.095 | 1.084 |

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

泰信鑫益定期开放A

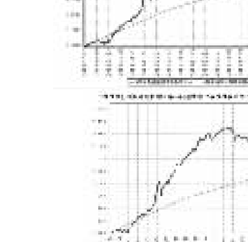
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.11% | 0.07% | 0.51% | 0.00% | 0.60% | 0.07% |

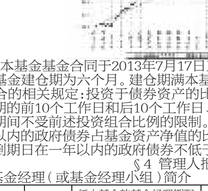
泰信鑫益定期开放C

| 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 | 1.03% | 0.08% | 0.51% | 0.00% | 0.52% | 0.08% |

注:本基金业绩比较基准为:中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)+0.5%

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2013年7月17日正式生效。

2、本基金建仓期为六个月。建仓期满本基金各项投资比例将符合基金合同关于投资组合的相关规定:投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,在每个受限开放期的前10个工作日和后10个工作日、自由开放期的前3个月和后3个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制,但在开放期本基金持有现金或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、泰信双息双利债券基金、泰信债券增强收益基金、泰信周期回报债券、泰信鑫利混合基金经理 | 2013年7月17日 | - | 22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日起担任泰信周期回报债券基金经理;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》、《泰信鑫益定期开放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》(中国证券监督管理委员会公告[2008]9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

2018年3季度,宏观经济有所走弱,制造业指标下滑,9月中采PMI收于50.8,供需扩张双双放缓。基建投资下滑明显,地产销售走弱,开发商拿地热情降温。工业增加值及利润总额增速也呈放缓趋势。通胀3季度上升趋势延续,8月同比2.3%,而消费表现则较为平稳。3季度海外经济体表现整体良好,我国进出口数据相对平稳,但不排除中美贸易战冲突下,外贸企业提前出货,后续表现仍需持续关注。政策层面看,个人所得税改革出台,未来更多减税政策值得期待,宽财政政策也在逐步实施,财政部也加强对于地方政府债务风险管控。货币政策仍延续稳健的总基调,并未跟随美联储加息步伐,而是年内保持了接近季度一次的降准频率,并通过公开市场操作向市场注入了流动性。3季度社融规模仍较为平稳,信贷占比维持高位。

3季度市场走势分化,汇率持续贬值,原油上涨带来商品市场良好走势,股票市场震荡走平,债券市场表现良好,中债总财富指数上行1%,国债总财富指数上行0.19%。信用债总财富指数上行2.08%,转债上涨2.68%。充裕的市场流动性带来收益率曲线整体陡峭化下行。专项地方债发行也债市供需笼上了阴影,原油、房租、食品等价格因素上行提升了市场对通胀的担忧,长端收益率表现相对较弱。截止季末,1年期国债、国开债分别收于2.67%及3.08%。10年期国债、国开债分别收于3.61%及4.2%。信用市场方面,季度内民企违约不断,兵团六师的违约事件一度引发市场对于城投债的担忧。宽货币并未有效传导到宽信用。在利率债带动之下,信用债收益率曲线同样陡峭化下行,中高等级品种表现明显好于低等级品种。截止季末,3年期AAA及AA等级信用债收益率分别收于4.18%及5.01%较上季末下行37及49个基点。3季度转债指数在正股带动下有所上行,一级新债发行19只,受到股市行情影响,多只新债出现破发现象。二级存量标的走势分化,部分转债下修条款达成启动下修行为。

鑫益定期在3季度初增加了10年期利率债的配置,适度拉长了组合久期,9月加强了流动性管理,适度减持了利率债品种。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰信鑫益定期开放A基金份额净值为1.095元,本报告期基金份额净值增长率为1.11%;截至本报告期末泰信鑫益定期开放C基金份额净值为1.084元,本报告期基金份额净值增长率为1.03%;同期业绩比较基准收益率为0.51%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§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 | 47,869,002.00 | 86.67 |
| | 其中:债券 | 47,869,002.00 | 86.67 |
| | 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 | 6,359,272.69 | 11.51 |
| 8 | 其他资产 | 1,004,421.98 | 1.82 |
| 9 | 合计 | 55,232,696.67 | 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

报告期末本基金未投资股票。

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港股通股票。

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

报告期末本基金未投资股票。

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 | 14,553,590.00 | 26.90 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 22,612,800.00 | 41.80 |
| | 其中:政策性金融债 | 22,612,800.00 | 41.80 |
| 4 | 企业债券 | 10,702,612.00 | 19.78 |
| 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 | 47,869,002.00 | 88.49 |

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 | 180205 | 18国开05 | 100,000 | 10,459,000.00 | 19.33 |
| 2 | 150412 | 15农发12 | 100,000 | 10,124,000.00 | 18.71 |
| 3 | 019534 | 16国债06 | 94,000 | 9,086,040.00 | 16.80 |
| 4 | 010303 | 03国债(3) | 55,000 | 5,467,550.00 | 10.11 |
| 5 | 122591 | 12常交债 | 48,000 | 4,875,840.00 | 9.01 |

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

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

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

本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,也不参与一级市场的新股申购或增发新股。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,931.81 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,002,490.17 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,004,421.98 |

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 | 泰信鑫益定期开放A | 泰信鑫益定期开放C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 51,874,944.33 | 9,289,362.20 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 8,185.11 | - |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 9,661,189.79 | 2,055,401.09 |
| 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 | 42,221,939.65 | 7,233,961.11 |

§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 | 20180701-20180930 | 29,430,801.27 | - | - | 29,430,801.27 | 59.51% |
| 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。 | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§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鑫益定期开放债券型证券投资基金设立的文件

2、《泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金基金合同》

3、《泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信鑫益定期开放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)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
2018年10月25日

# 泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金

## 2018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:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月25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。

本基金的托管人中信银行股份有限公司根据基金合同已于2018年10月22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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 泰信行业精选混合 | |
| 交易代码 | 290012 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2015年3月4日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 68,138,449.31份 | |
| 投资目标 | 把握行业发展趋势和市场运行趋势,在经济发展以及市场运行的不同阶段所蕴含的行业投资机会,在控制风险的前提下,追求基金资产的稳定增值。 | |
| 投资策略 | 紧密跟踪中国经济动向,把握中国经济的长期发展趋势和周期变动特征,挖掘不同发展阶段下的行业投资机会,综合运用主题投资、行业轮动等投资策略,追求基金资产的长期、持续增值。本基金将结合"自上而下"的资产配置策略和"自下而上"的个券精选策略,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 | 沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45% | |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型证券投资基金,其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金产品,低于股票型基金产品。 | |
| 基金管理人 | 泰信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 泰信行业精选混合A | 泰信行业精选混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 290012 | 002583 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 68,138,449.31份 | -份 |

注:截至报告期末本基金C份额为0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(2018年7月1日 - 2018年9月30日) | |
|---|---|---|
| | 泰信行业精选混合A | 泰信行业精选混合C |
| 1. 本期已实现收益 | 2,313,384.69 | - |
| 2. 本期利润 | -4,873,273.07 | - |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0702 | - |
| 4. 期末基金资产净值 | 67,954,441.72 | - |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.997 | 0.997 |

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、截至报告期末本基金C份额为0份。

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

泰信行业精选混合A

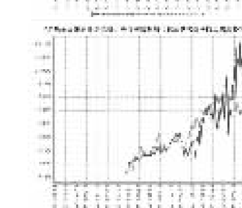
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -6.65% | 1.67% | -0.59% | 0.75% | -6.06% | 0.92% |

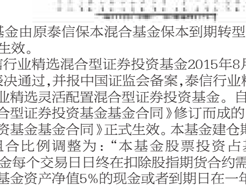
泰信行业精选混合C

| 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 | -6.65% | 1.67% | -0.59% | 0.75% | -6.06% | 0.92% |

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%

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、本基金由原泰信保本混合基金保本到期转型而来,本基金合同于2015年3月4日正式生效。

2、经泰信行业精选混合型证券投资基金2015年8月28日基金份额持有人大会(通讯方式)表决通过,并报中国证监会备案,泰信行业精选混合型证券投资基金变更为泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金。自2015年9月1日起,由《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效。本基金建仓期为六个月。建仓期满,本基金的投资组合比例调整为:"本基金股票投资占基金资产的比例范围为0-95%。本基金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,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券",业绩比较基准不变。

§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 | | |
| 董山青先生 | 基金投资部总监助理、本基金基金经理兼泰信鑫选混合基金经理 | 2012年2月22日 | - | 13年 | 香港大学工商管理硕士,CFA。具有基金、期货从业资格。曾任职于中国银行上海分行。2004年8月加入泰信基金管理有限公司,先后在清算会计部、研究部工作,曾任泰信优势增长基金经理助理。2010年9月至2012年10月担任研究总监助理职务。现同时担任基金投资部总监助理职务。自2016年2月4日起担任泰信鑫选混合基金经理。 |

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》、《泰信行业精选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

债券市场略有下跌,股票市场震荡,报告期内各指数涨跌幅分别为:上证综指-0.92%,中小板综指-10.41%,创业板指-12.16%。

报告期内股票市场分化较大,中美贸易战和去杠杆进程成为市场关注焦点,大盘蓝筹类个股较为强势,其他板块表现平淡。一级市场方面,新股发行数量逐步降低,网下新股申购中签率较低,新股涨幅一般,且近期新股申购底仓波动很大,导致网下新股申购策略的吸引力持续降低,一级市场方面仅参与部分网下新股和网上新股的申购。报告期内美国经济表现良好,美联储持续加息,全球货币紧缩预期也随之进一步强化,中国经济也在升级转型过程中。近期市场波动较大,我们期待管理层针对市场关注问题出台改革举措,市场信心将逐步恢复,我们对未来股票投资保持乐观心态。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金A份额单位净值为0.997元,本季度净值增长率为-6.65%;本基金C份额单位净值为0.997元,本季度净值增长率为-6.65%;同期业绩比较基准增长率为-0.59%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§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 | 63,829,576.24 | 93.33 |
| | 其中:股票 | 63,829,576.24 | 93.33 |
| 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 | 4,500,889.63 | 6.58 |
| 8 | 其他资产 | 64,100.91 | 0.09 |
| 9 | 合计 | 68,394,566.78 | 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 | 28,481,336.60 | 41.91 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 899.00 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,063.20 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | 2,640.00 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 21,564,987.64 | 31.73 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,074.00 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 2,540,984.00 | 3.74 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 5,336.00 | 0.01 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 2,389.00 | 0.00 |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 11,227,866.80 | 16.52 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 63,829,576.24 | 93.93 |

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港股通股票。

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 | 300458 | 全志科技 | 213,890 | 5,336,555.50 | 7.85 |
| 2 | 300133 | 华策影视 | 486,000 | 4,655,880.00 | 6.85 |
| 3 | 002439 | 启明星辰 | 243,100 | 4,584,866.00 | 6.75 |
| 4 | 600893 | 航发动力 | 181,500 | 4,366,890.00 | 6.43 |
| 5 | 300059 | 东方财富 | 357,600 | 4,023,000.00 | 5.92 |
| 6 | 300251 | 光线传媒 | 475,080 | 3,700,873.20 | 5.45 |
| 7 | 002292 | 奥飞娱乐 | 490,100 | 3,117,036.00 | 4.59 |
| 8 | 300253 | 卫宁健康 | 210,000 | 3,028,200.00 | 4.46 |
| 9 | 300078 | 思创医惠 | 287,000 | 2,783,900.00 | 4.10 |
| 10 | 300024 | 机器人 | 164,100 | 2,679,753.00 | 3.94 |

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

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

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

报告期末本基金未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期末本基金未持有股指期货。

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

报告期末本基金未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期末本基金未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

报告期末本基金未持有国债期货。

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。

5.11.2

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 | 31,176.43 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,922.51 |
| 5 | 应收申购款 | 31,001.97 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 64,100.91 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本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

报告期末本基金投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

| 项目 | 泰信行业精选混合A | 泰信行业精选混合C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 70,448,744.87 | - |
| 报告期期间基金总申购份额 | 4,021,753.78 | - |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 6,332,049.34 | - |
| 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 | 68,138,449.31 | - |

注:截至报告期末本基金C份额为0份。

§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

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、原中国证监会批准原泰信保本混合型证券投资基金设立的文件

2、《泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信行业精选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
2018年10月25日