

泰信中证 200 指数证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

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

送出日期：2016 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

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。本半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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 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.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	41
7.8 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贵金属投资明细.....	41
7.9 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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息	43

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	43
§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	47
§11 备查文件目录.....	49
11.1 备查文件目录.....	49
11.2 存放地点.....	49
11.3 查阅方式.....	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信中证 200 指数证券投资基金
基金简称	泰信中证 200 指数
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	52,001,270.06 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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	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%。
风险收益特征	本基金为指数型基金，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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡囡	王永民
	联系电话	021-20899098	010-66594896
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-5988	95566
传真		021-20899008	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验	北京西城区复兴门内大街 1 号

	区浦东南路 256 号 华夏银行大厦 36-37 层	
邮政编码	200120	100818
法定代表人	王小林	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ftfund.com
基金半年度报告备置地点	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泰信基金管理有限公司	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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,938,840.15
本期利润	-13,875,812.64
加权平均基金份额本期利润	-0.2336
本期加权平均净值利润率	-23.97%
本期基金份额净值增长率	-18.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-637,016.55
期末可供分配基金份额利润	-0.0123
期末基金资产净值	51,364,253.51
期末基金份额净值	0.988
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.76%

注：1、本基金基金合同于 2011 年 6 月 9 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

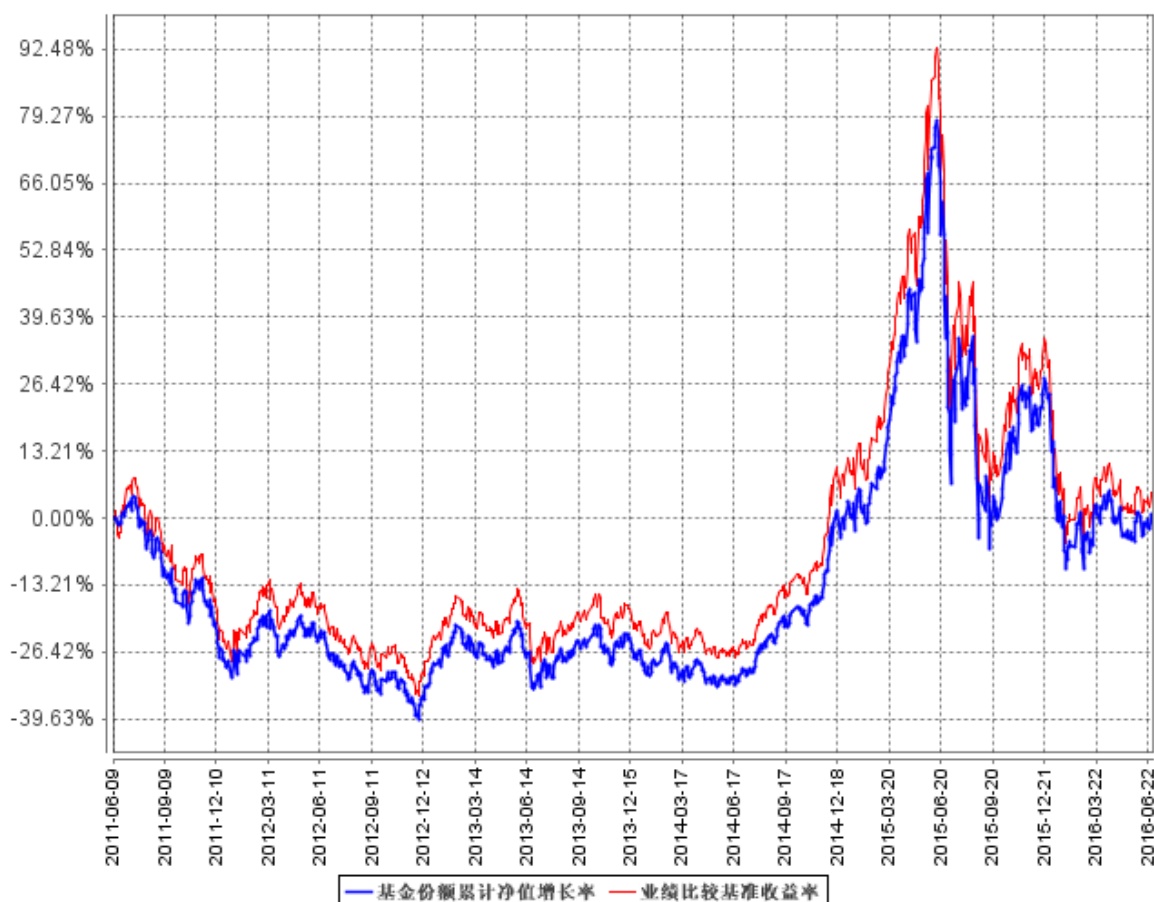
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.44%	1.23%	0.18%	1.23%	1.26%	0.00%
过去三个月	-1.40%	1.31%	-2.52%	1.30%	1.12%	0.01%
过去六个月	-18.08%	2.22%	-18.99%	2.19%	0.91%	0.03%
过去一年	-29.83%	2.74%	-32.27%	2.64%	2.44%	0.10%
过去三年	49.92%	2.00%	45.33%	1.96%	4.59%	0.04%
自基金合同生效起至今	0.76%	1.77%	4.96%	1.75%	-4.20%	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%。

本基金的投资标的为中证 200 指数，且本基金现金以及到期日在一年之内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，因此本基金将业绩比较基准定为中证 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变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 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：王斌

发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co., Ltd.）是山东省国际信托投资有限公司（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 日经中国证券监督管理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 6 月底，公司有正式员工 107 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 6 月底，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+混合共 18 只开放式基金及泰信乐利 5 号、泰信鲁信 1 号、泰信磐晟稳健 1 号、泰信磐晟定增 1 号、泰信价值 1 号、泰信添盈债券 1 号、泰信中行新时代 6 号、泰信财达添利 1 号、泰信合信 1 号、泰信融昇 1 号保本、泰信融昇 2 号保本、泰信财达添利 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债券、泰信洛肯 1 号、泰信洛肯 2 号、泰信合信 3 号共 20 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基本面 400 指数分级基金经理	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合规守信情况的说明

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律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。

4.3.2 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 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

上半年 A 股呈现“L”型走势。A 股市场在 1 月份人民币汇率意外贬值、股市熔断制度推出的影响下出现一轮快速下跌，其后随着熔断制度的退出，投资者信心逐渐恢复，市场在剩下的 5 个月时间里逐渐震荡回升。上半年沪深 300 指数下跌 15.47%，创业板指数下跌 17.92%。结构性机会相对明显。

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 1.2%。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 0.988 元，净值增长率为-18.08%，同期比较基准增长率为-18.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年经济同比增长 6.7%，相对平稳。从稳经济措施来看，政府依然是期望依靠房地产和基建这些传统行业来驱动带动经济回暖，但是目前信贷资金更多是流向房地产部门，而不是工业部门。同时上半年民间投资大幅放缓，也显示出经济增长动力不足。财政政策的力度应会根据经济实际情况有所调节，下滑风险加大时会适度发力托底，但不宜对其有过度的期待。

因此，展望下半年，经济下行的压力依然很大。货币政策环境尚难以收紧，但宽松的效果并不能有效的传导至实体经济中，对经济拉动效果不明显。在人民币汇率贬值压力下，央行的货币政策开始偏向稳健，一味的财政刺激和货币扩张只会累积风险，经济的长期走势还需看进一步改革的进展。

A 股市场目前呈现典型的存量博弈特征，我们认为下半年股指大概率仍将呈现宽幅震荡格局，投资需结构性机会和波段性机会并重。同时我们也注意到，在政策层面对金融部门的基础性改革与抑制资产泡沫是比较新的提法，值得关注。而 4 季度海外的政治事件风险和国内的政策选择方面都存在一定不确定性，或许给 A 股市场再次带来冲击，而预计下半年低估值蓝筹股相对收益较为显著。

本基金作为一只投资于中证 200 指数的被动指数基金产品，我们将坚持指数化投资理念，控制基金跟踪误差，通过模拟指数，跟踪市场趋势，使本产品成为投资者良好的资产配置工具。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。曾任职于山东省国际信托投资公司计财部、山东省国际信托投资公司上海证券部、鲁信香港投资有限公司。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，泰信优势增长基金基金经理。

梁剑先生，硕士。2004 年 7 月加入泰信基金管理有限公司，曾任泰信先行策略混合基金经理。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

一、基金合同关于利润分配的约定：

1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；

4、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

二、本报告期本基金未进行利润分配。

§ 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰信中证 200 指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰信中证 200 指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,811,035.64	5,377,995.41
结算备付金		-	-
存出保证金		12,867.23	4,146.60
交易性金融资产	6.4.7.2	47,690,869.79	69,799,101.48
其中：股票投资		47,690,869.79	69,799,101.48
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	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	680.97	1,474.97
应收股利		-	-
应收申购款		5,471.45	494.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		51,520,925.08	75,183,212.53
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,984.11	-
应付管理人报酬		29,105.09	33,932.36
应付托管费		6,236.79	7,271.21
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	34,004.28	32,584.41
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	82,341.30	227,214.90
负债合计		156,671.57	301,002.88
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	52,001,270.06	62,111,287.93
未分配利润	6.4.7.10	-637,016.55	12,770,921.72
所有者权益合计		51,364,253.51	74,882,209.65
负债和所有者权益总计		51,520,925.08	75,183,212.53

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.988 元，基金份额总额 52,001,270.06 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信中证 200 指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年6月30日
一、收入		-13,475,800.16	33,960,796.78
1.利息收入		14,866.30	18,596.34

其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,866.30	18,596.34
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）		-1,554,285.44	33,854,566.02
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,973,320.73	33,581,536.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	419,035.29	273,029.72
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-11,936,972.49	73,895.63
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	591.47	13,738.79
减：二、费用		400,012.48	627,048.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	201,805.51	281,086.83
2. 托管费	6.4.10.2.2	43,244.05	60,232.86
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	64,168.69	157,441.16
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	90,794.23	128,287.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,875,812.64	33,333,748.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,875,812.64	33,333,748.16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信中证 200 指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	62,111,287.93	12,770,921.72	74,882,209.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-13,875,812.64	-13,875,812.64
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）	-10,110,017.87	467,874.37	-9,642,143.50
其中：1.基金申购款	491,020.52	-17,510.23	473,510.29
2.基金赎回款	-10,601,038.39	485,384.60	-10,115,653.79
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）	52,001,270.06	-637,016.55	51,364,253.51
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	89,264,629.96	-2,025,343.20	87,239,286.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	33,333,748.16	33,333,748.16
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）	-49,527,394.41	-15,100,027.80	-64,627,422.21
其中：1.基金申购款	5,925,672.13	969,623.96	6,895,296.09
2.基金赎回款	-55,453,066.54	-16,069,651.76	-71,522,718.30
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）	39,737,235.55	16,208,377.16	55,945,612.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

葛航

基金管理人负责人

韩波

主管会计工作负责人

蔡海成

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰信中证 200 指数证券投资基金(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[2011]第 534 号《关于核准泰信中证 200 指数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 200 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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 316,771,140.56 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(2011)第 228 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 6 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 316,786,119.38 份基金份额,其中认购资金利息折合 14,978.82 份基金份额。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为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、权证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。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 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。本基金的业绩比较基准为:本基金的业绩比较基准为:95% X 中证 200 指数收益率 + 5% X 商业银行活期存款利率(税后)。

6.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》和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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年半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 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额,自 2015 年 9 月 8 日起,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	3,811,035.64
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	3,811,035.64

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	51,531,408.67	47,690,869.79	-3,840,538.88
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	51,531,408.67	47,690,869.79	-3,840,538.88

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末本基金未持有返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有买断式逆回购中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	675.75
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	5.22
合计	680.97

6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	34,004.28
银行间市场应付交易费用	-
合计	34,004.28

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	18.79
预提费用	79,561.30
应付指数使用费	2,761.21
合计	82,341.30

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	62,111,287.93	62,111,287.93
本期申购	491,020.52	491,020.52
本期赎回 (以“-”号填列)	-10,601,038.39	-10,601,038.39
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	52,001,270.06	52,001,270.06

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	30,513,348.69	-17,742,426.97	12,770,921.72
本期利润	-1,938,840.15	-11,936,972.49	-13,875,812.64
本期基金份额交易产生的变动数	-4,884,453.62	5,352,327.99	467,874.37
其中：基金申购款	238,062.66	-255,572.89	-17,510.23
基金赎回款	-5,122,516.28	5,607,900.88	485,384.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,690,054.92	-24,327,071.47	-637,016.55

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	14,357.94
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	327.33
其他	181.03
合计	14,866.30

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	24,040,867.70
减：卖出股票成本总额	26,014,188.43
买卖股票差价收入	-1,973,320.73

6.4.7.13 债券投资收益

本报告期本基金无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本期末本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

截至报告期末本基金未投资贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期末本基金无衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	419,035.29
基金投资产生的股利收益	-
合计	419,035.29

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-11,936,972.49
——股票投资	-11,936,972.49
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-11,936,972.49

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	331.27
转换费收入	260.20
其他	-
合计	591.47

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费用由转出基金的赎回费、转出和转入基金的申购费补差构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	64,168.69
银行间市场交易费用	-
合计	64,168.69

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	49,726.04
银行汇划费手续费	767.04
债券帐户维护费	4,500.00
指数使用费	5,765.89
其他	200.00
合计	90,794.23

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本报告期末本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本报告期无需要说明资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司
中国银行股份有限公司(中国银行)	基金托管人、基金代销机构
山东省国际信托股份有限公司(“山东国托”)	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信实业有限公司(“青岛国信”)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本期末及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间本基金无应支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	201,805.51	281,086.83
其中：支付销售机构的客户维护费	37,400.20	47,397.07

注：支付基金管理人泰信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值的 0.7% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.7% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	43,244.05	60,232.86

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本报告期及上年度可比期间本基金未发生销售服务费用。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期末及上年度可比期间本基金与关联方未发生银行间同业市场债券（含回购）的交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2011 年 6 月 9 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	19,037,101.35	15,999,320.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	5,000,000.00
期末持有的基金份额	19,037,101.35	10,999,320.00

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	36.6100%	27.6800%
-----------------------	----------	----------

注：依据《泰信中证 200 指数证券投资基金招募说明书》相关约定，份额持有时间超过 2 年以上，赎回费率为 0。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
山东省国际信托股份 有限公司	26,439,218.54	50.8400%	36,439,218.54	58.6700%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	3,811,035.64	14,357.94	6,068,151.62	18,156.19

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期末及上年度可比期间本基金在承销期内未参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

报告期内本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600005	武钢股份	2016年6月27日	重大事项	2.76	-	-	132,300	540,913.37	365,148.00	-
000728	国元证券	2016年6月8日	重大事项	16.72	2016年7月8日	17.37	19,048	327,555.76	318,482.56	-
600649	城投控股	2016年6月20日	重大事项	14.36	-	-	20,323	156,385.14	291,838.28	-
002465	海格通信	2016年6月13日	重大事项	12.44	-	-	23,210	247,854.15	288,732.40	-
002065	东华软件	2015年12月22日	重大事项	25.10	2016年7月4日	22.59	10,644	194,636.87	267,164.40	-
000415	渤海金控	2016年2月1日	重大事项	6.82	2016年8月11日	7.50	34,600	306,428.58	235,972.00	-
002129	中环股份	2016年4月25日	重大事项	8.29	-	-	25,328	292,440.30	209,969.12	-
600166	福田汽车	2016年6月30日	临时停牌	5.52	2016年7月1日	5.62	30,600	187,444.90	168,912.00	-
000629	*ST钒钛	2016年5月26日	重大事项	2.39	-	-	67,542	205,057.28	161,425.38	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型证券投资基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立了以审计、合规与风险控制委员会、督察长为核心，对公司所有经营管理行为进行监督的四道监控防线。

监察稽核部对公司经营、基金投资等业务运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，如有必要则由督察长向公司董事长和中国证监会报告。目前，公司的事前、事中、事后三个控制层次的风险管理体系相对清晰。各业务部门负责事前风险防范；风险管理部负责对公司运营过程中产生或潜在的风险进行事中管理和监控，并负责运用定量分析模型，根据各基金的投资目标及投资策略，定期对基金的投资组合风险进行评估，向投资决策委员会提交业绩评估报告；监察稽核部负责对公司各项业务进行定期、不定期检查，负责事后监督。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有的信用类债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严

密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款和结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,811,035.64	-	-	-	3,811,035.64

存出保证金	12,867.23	-	-	-	12,867.23
交易性金融资产	-	-	-	47,690,869.79	47,690,869.79
应收利息	-	-	-	680.97	680.97
应收申购款	-	-	-	5,471.45	5,471.45
资产总计	3,823,902.87	-	-	47,697,022.21	51,520,925.08
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,984.11	4,984.11
应付管理人报酬	-	-	-	29,105.09	29,105.09
应付托管费	-	-	-	6,236.79	6,236.79
应付交易费用	-	-	-	34,004.28	34,004.28
其他负债	-	-	-	82,341.30	82,341.30
负债总计	-	-	-	156,671.57	156,671.57
利率敏感度缺口	3,823,902.87	-	-	47,540,350.64	51,364,253.51
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,377,995.41	-	-	-	5,377,995.41
存出保证金	4,146.60	-	-	-	4,146.60
交易性金融资产	-	-	-	69,799,101.48	69,799,101.48
应收利息	-	-	-	1,474.97	1,474.97
应收申购款	-	-	-	494.07	494.07
资产总计	5,382,142.01	-	-	69,801,070.52	75,183,212.53
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	33,932.36	33,932.36
应付托管费	-	-	-	7,271.21	7,271.21
应付交易费用	-	-	-	32,584.41	32,584.41
其他负债	-	-	-	227,214.90	227,214.90
负债总计	-	-	-	301,002.88	301,002.88
利率敏感度缺口	5,382,142.01	-	-	69,500,067.64	74,882,209.65

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券（2015 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2015 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中采取“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 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%。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	47,690,869.79	92.85	69,799,101.48	93.21
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	47,690,869.79	92.85	69,799,101.48	93.21

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除基金比较基准以外的其他市场变量保持不变
----	----------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	3,572,329.85	3,670,000.00
业绩比较基准下降 5%	-3,572,329.85	-3,670,000.00	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无其他需要说明有助于理解和分析会计报表事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	47,690,869.79	92.57
	其中：股票	47,690,869.79	92.57
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	3,811,035.64	7.40
7	其他各项资产	19,019.65	0.04
8	合计	51,520,925.08	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	448,139.12	0.87
B	采矿业	2,815,537.47	5.48
C	制造业	17,109,769.63	33.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,977,778.48	3.85

E	建筑业	1,320,987.59	2.57
F	批发和零售业	2,428,454.23	4.73
G	交通运输、仓储和邮政业	2,017,654.48	3.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,090,291.15	6.02
J	金融业	3,274,880.92	6.38
K	房地产业	2,273,703.14	4.43
L	租赁和商务服务业	1,121,308.59	2.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	580,008.59	1.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	182,065.52	0.35
R	文化、体育和娱乐业	2,369,401.50	4.61
S	综合	630,381.00	1.23
	合计	41,640,361.41	81.07

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,000,277.38	1.95
C	制造业	2,692,274.00	5.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	636,573.00	1.24
E	建筑业	187,580.00	0.37
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	712,488.00	1.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	68,640.00	0.13
J	金融业	411,174.00	0.80
K	房地产业	133,950.00	0.26
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	207,552.00	0.40
S	综合	-	-
	合计	6,050,508.38	11.78

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。

7.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

报告期末本基金未投资沪港通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002292	奥飞娱乐	22,700	679,865.00	1.32
2	601958	金铂股份	73,416	598,340.40	1.16
3	601098	中南传媒	29,233	529,409.63	1.03
4	000729	燕京啤酒	65,034	493,608.06	0.96
5	601555	东吴证券	35,140	470,876.00	0.92
6	002470	金正大	55,776	448,996.80	0.87
7	601118	海南橡胶	80,168	448,139.12	0.87
8	000999	华润三九	18,436	446,519.92	0.87
9	000425	徐工机械	140,807	430,869.42	0.84
10	600547	山东黄金	10,963	426,570.33	0.83
11	002475	立讯精密	21,184	416,265.60	0.81
12	300144	宋城演艺	16,700	415,997.00	0.81
13	600089	特变电工	48,194	410,612.88	0.80
14	002146	荣盛发展	60,350	405,552.00	0.79
15	600188	兖州煤业	36,857	403,215.58	0.79
16	600029	南方航空	56,986	402,321.16	0.78
17	600373	中文传媒	19,097	396,262.75	0.77
18	600256	广汇能源	93,700	384,170.00	0.75
19	000100	TCL 集团	112,287	369,424.23	0.72
20	600005	武钢股份	132,300	365,148.00	0.71
21	002081	金螳螂	36,266	363,385.32	0.71
22	600535	天士力	10,000	357,600.00	0.70
23	000712	锦龙股份	17,100	354,996.00	0.69
24	600648	外高桥	18,006	354,898.26	0.69
25	600100	同方股份	23,705	354,626.80	0.69

26	600109	国金证券	24,970	336,595.60	0.66
27	000009	中国宝安	24,370	333,869.00	0.65
28	600068	葛洲坝	56,925	331,303.50	0.65
29	600170	上海建工	86,219	330,218.77	0.64
30	601888	中国国旅	7,500	329,850.00	0.64
31	000917	电广传媒	19,593	323,872.29	0.63
32	601607	上海医药	17,667	318,889.35	0.62
33	000728	国元证券	19,048	318,482.56	0.62
34	002294	信立泰	11,641	316,635.20	0.62
35	300070	碧水源	21,033	312,971.04	0.61
36	600153	建发股份	25,996	311,952.00	0.61
37	600208	新湖中宝	72,134	305,126.82	0.59
38	600827	百联股份	24,837	300,030.96	0.58
39	601919	中国远洋	58,500	297,180.00	0.58
40	600489	中金黄金	26,430	297,073.20	0.58
41	600895	张江高科	16,400	296,512.00	0.58
42	600008	首创股份	75,900	295,251.00	0.57
43	600317	营口港	87,800	295,008.00	0.57
44	600804	鹏博士	16,077	293,083.71	0.57
45	000783	长江证券	25,255	292,958.00	0.57
46	002142	宁波银行	19,820	292,939.60	0.57
47	600649	城投控股	20,323	291,838.28	0.57
48	300027	华谊兄弟	21,402	289,783.08	0.56
49	000338	潍柴动力	37,100	289,751.00	0.56
50	600271	航天信息	12,144	289,027.20	0.56
51	002465	海格通信	23,210	288,732.40	0.56
52	000568	泸州老窖	9,696	287,971.20	0.56
53	600660	福耀玻璃	20,477	286,678.00	0.56
54	000540	中天城投	45,900	285,957.00	0.56
55	000559	万向钱潮	18,197	283,873.20	0.55
56	000793	华闻传媒	28,657	283,131.16	0.55
57	002385	大北农	34,985	281,979.10	0.55
58	600196	复星医药	14,800	281,496.00	0.55
59	600674	川投能源	33,784	279,055.84	0.54
60	002399	海普瑞	15,923	278,015.58	0.54
61	000157	中联重科	67,300	277,949.00	0.54
62	000503	海虹控股	6,872	276,323.12	0.54
63	600383	金地集团	26,500	274,540.00	0.53
64	300003	乐普医疗	15,000	273,600.00	0.53

65	600406	国电南瑞	20,000	267,400.00	0.52
66	002065	东华软件	10,644	267,164.40	0.52
67	000826	启迪桑德	8,741	267,037.55	0.52
68	600038	中直股份	6,372	264,310.56	0.51
69	600739	辽宁成大	16,826	261,980.82	0.51
70	601933	永辉超市	62,260	257,133.80	0.50
71	002202	金风科技	16,636	251,702.68	0.49
72	000750	国海证券	33,993	251,208.27	0.49
73	600118	中国卫星	7,404	248,774.40	0.48
74	600873	梅花生物	39,933	247,983.93	0.48
75	000060	中金岭南	23,715	247,347.45	0.48
76	603993	洛阳钼业	59,520	247,008.00	0.48
77	000792	盐湖股份	11,679	246,426.90	0.48
78	002153	石基信息	9,289	245,043.82	0.48
79	000963	华东医药	3,617	243,785.80	0.47
80	002450	康得新	14,213	243,042.30	0.47
81	000046	泛海控股	23,900	241,629.00	0.47
82	000709	河钢股份	86,654	240,031.58	0.47
83	600415	小商品城	38,402	237,324.36	0.46
84	002500	山西证券	14,305	236,890.80	0.46
85	000415	渤海金控	34,600	235,972.00	0.46
86	600583	海油工程	33,900	234,249.00	0.46
87	600060	海信电器	13,202	233,411.36	0.45
88	600066	宇通客车	11,707	231,798.60	0.45
89	002007	华兰生物	7,262	228,026.80	0.44
90	600157	永泰能源	57,084	224,910.96	0.44
91	600588	用友网络	11,177	218,845.66	0.43
92	000402	金融街	22,486	218,563.92	0.43
93	601016	节能风电	22,000	218,460.00	0.43
94	000423	东阿阿胶	4,107	216,972.81	0.42
95	000898	鞍钢股份	56,622	216,862.26	0.42
96	000738	中航动控	8,200	216,480.00	0.42
97	002456	欧菲光	7,302	215,409.00	0.42
98	000413	东旭光电	24,955	214,363.45	0.42
99	300017	网宿科技	3,166	212,755.20	0.41
100	002129	中环股份	25,328	209,969.12	0.41
101	000686	东北证券	16,138	208,341.58	0.41
102	601333	广深铁路	52,001	203,323.91	0.40
103	601117	中国化学	36,700	202,951.00	0.40

104	600703	三安光电	10,100	201,697.00	0.39
105	300315	掌趣科技	19,200	201,408.00	0.39
106	600252	中恒集团	45,969	199,505.46	0.39
107	600863	内蒙华电	65,591	198,084.82	0.39
108	600663	陆家嘴	8,645	196,673.75	0.38
109	000876	新希望	23,614	196,468.48	0.38
110	002236	大华股份	14,950	195,845.00	0.38
111	601866	中海集运	48,563	192,309.48	0.37
112	601258	庞大集团	69,502	191,130.50	0.37
113	300124	汇川技术	9,783	189,790.20	0.37
114	600027	华电国际	38,339	189,778.05	0.37
115	600998	九州通	10,774	188,652.74	0.37
116	600369	西南证券	25,970	188,542.20	0.37
117	601106	中国一重	35,800	186,518.00	0.36
118	600221	海南航空	57,479	182,208.43	0.35
119	300015	爱尔眼科	4,984	182,065.52	0.35
120	601991	大唐发电	45,900	178,551.00	0.35
121	002422	科伦药业	11,582	178,478.62	0.35
122	600718	东软集团	9,665	177,062.80	0.34
123	601009	南京银行	18,749	176,053.11	0.34
124	600362	江西铜业	12,900	173,892.00	0.34
125	600741	华域汽车	12,400	173,724.00	0.34
126	600332	白云山	6,920	170,508.80	0.33
127	000630	铜陵有色	66,780	169,621.20	0.33
128	601216	君正集团	22,540	168,373.80	0.33
129	000039	中集集团	11,399	161,523.83	0.31
130	601179	中国西电	31,679	160,612.53	0.31
131	300058	蓝色光标	16,445	159,680.95	0.31
132	000061	农产品	13,033	158,481.28	0.31
133	000768	中航飞机	8,004	157,598.76	0.31
134	600009	上海机场	5,910	153,955.50	0.30
135	300024	机器人	6,057	153,787.23	0.30
136	601872	招商轮船	32,500	152,100.00	0.30
137	600867	通化东宝	7,249	149,981.81	0.29
138	601992	金隅股份	19,214	148,908.50	0.29
139	600352	浙江龙盛	17,084	147,264.08	0.29
140	300133	华策影视	9,320	145,112.40	0.28
141	000883	湖北能源	30,687	142,080.81	0.28
142	603000	人民网	8,484	140,919.24	0.27

143	600021	上海电力	13,500	138,645.00	0.27
144	600875	东方电气	14,036	137,833.52	0.27
145	000800	一汽轿车	12,560	136,652.80	0.27
146	300002	神州泰岳	12,800	136,192.00	0.27
147	300146	汤臣倍健	9,924	134,370.96	0.26
148	002195	二三四五	10,800	132,732.00	0.26
149	000623	吉林敖东	5,186	129,390.70	0.25
150	002008	大族激光	5,467	124,866.28	0.24
151	600600	青岛啤酒	4,286	124,594.02	0.24
152	601928	凤凰传媒	11,720	123,528.80	0.24
153	000156	华数传媒	6,604	122,504.20	0.24
154	000027	深圳能源	18,282	116,639.16	0.23
155	600578	京能电力	26,737	114,434.36	0.22
156	601718	际华集团	14,900	113,836.00	0.22
157	601198	东兴证券	4,600	112,424.00	0.22
158	600085	同仁堂	3,706	110,401.74	0.21
159	002241	歌尔股份	3,800	108,984.00	0.21
160	601608	中信重工	20,000	107,400.00	0.21
161	000778	新兴铸管	23,090	107,137.60	0.21
162	600642	申能股份	18,606	106,798.44	0.21
163	000825	太钢不锈	33,587	106,134.92	0.21
164	600309	万华化学	6,100	105,530.00	0.21
165	002230	科大讯飞	3,089	101,473.65	0.20
166	600688	上海石化	15,800	96,380.00	0.19
167	600570	恒生电子	1,438	96,015.26	0.19
168	600820	隧道股份	11,100	93,129.00	0.18
169	601021	春秋航空	1,700	81,498.00	0.16
170	300251	光线传媒	5,508	63,672.48	0.12
171	603885	吉祥航空	2,200	57,750.00	0.11
172	600177	雅戈尔	3,903	53,822.37	0.10
173	601099	太平洋	5,640	34,573.20	0.07

7.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600549	厦门钨业	17,500	519,925.00	1.01
2	002673	西部证券	15,900	411,174.00	0.80

3	600717	天津港	43,200	375,408.00	0.73
4	601231	环旭电子	34,700	371,290.00	0.72
5	600350	山东高速	63,600	337,080.00	0.66
6	000937	冀中能源	60,800	323,456.00	0.63
7	002353	杰瑞股份	14,300	275,704.00	0.54
8	000581	威孚高科	13,300	268,128.00	0.52
9	002038	双鹭药业	8,700	262,566.00	0.51
10	000539	粤电力A	50,200	252,004.00	0.49
11	000831	*ST 五稀	18,000	237,240.00	0.46
12	000400	许继电气	15,200	234,688.00	0.46
13	600315	上海家化	7,300	210,532.00	0.41
14	601158	重庆水务	32,300	207,689.00	0.40
15	600633	浙报传媒	13,800	207,552.00	0.40
16	000983	西山煤电	24,400	198,860.00	0.39
17	601699	潞安环能	29,700	194,238.00	0.38
18	002375	亚厦股份	16,600	187,580.00	0.37
19	000598	兴蓉环境	33,500	176,880.00	0.34
20	600166	福田汽车	30,600	168,912.00	0.33
21	000629	*ST 钒钛	67,542	161,425.38	0.31
22	601238	广汽集团	6,100	143,289.00	0.28
23	001979	招商蛇口	9,400	133,950.00	0.26
24	601969	海南矿业	10,900	122,298.00	0.24
25	002410	广联达	4,800	68,640.00	0.13

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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	001979	招商蛇口	829,837.00	1.11
2	002292	奥飞娱乐	521,920.00	0.70
3	600549	厦门钨业	499,364.00	0.67
4	601958	金铂股份	472,936.00	0.63
5	002673	西部证券	383,315.00	0.51
6	600717	天津港	380,541.00	0.51
7	601231	环旭电子	367,601.00	0.49

8	000729	燕京啤酒	337,971.08	0.45
9	600350	山东高速	333,471.00	0.45
10	601118	海南橡胶	329,213.73	0.44
11	601098	中南传媒	323,629.00	0.43
12	000937	冀中能源	306,440.00	0.41
13	002353	杰瑞股份	302,038.00	0.40
14	000999	华润三九	292,921.00	0.39
15	002470	金正大	278,122.00	0.37
16	600188	兖州煤业	276,798.00	0.37
17	000581	威孚高科	271,305.32	0.36
18	002146	荣盛发展	266,262.00	0.36
19	000539	粤电力 A	261,220.00	0.35
20	002038	双鹭药业	255,752.00	0.34

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	001979	招商蛇口	1,302,586.14	1.74
2	300104	乐视网	784,972.00	1.05
3	002450	康得新	574,727.00	0.77
4	002673	西部证券	519,452.64	0.69
5	601099	太平洋	516,837.00	0.69
6	600570	恒生电子	502,704.00	0.67
7	601009	南京银行	476,970.00	0.64
8	002230	科大讯飞	470,866.00	0.63
9	300017	网宿科技	418,417.02	0.56
10	000783	长江证券	399,234.00	0.53
11	002241	歌尔股份	394,161.00	0.53
12	300024	机器人	376,818.80	0.50
13	600177	雅戈尔	365,981.00	0.49
14	600009	上海机场	342,527.00	0.46
15	000423	东阿阿胶	290,204.25	0.39
16	600315	上海家化	281,866.72	0.38
17	600066	宇通客车	279,953.96	0.37

18	600703	三安光电	275,632.00	0.37
19	002142	宁波银行	255,652.00	0.34
20	600085	同仁堂	255,573.40	0.34

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	15,842,929.23
卖出股票收入（成交）总额	24,128,381.30

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

报告期末本基金未投资贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.12.2

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	12,867.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	680.97
5	应收申购款	5,471.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,019.65

7.12.4 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的处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**7.12.5.1 期末指数投资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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末基金积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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。**§ 8 基金份额持有人信息****8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
299	173, 917. 29	45, 476, 319. 89	87. 45%	6, 524, 950. 17	12. 55%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：基金份额总量的数量区间为 0、0 至 10 万份（含）、10 万份至 50 万份（含）、50 万份至 100 万份（含）、100 万份以上。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 6 月 9 日）基金份额总额	316, 786, 119. 38
本报告期期初基金份额总额	62, 111, 287. 93

本报告期基金总申购份额	491,020.52
减:本报告期基金总赎回份额	10,601,038.39
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	52,001,270.06

注:总申购份额含红利再投资、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内,本基金未改聘会计师事务所,仍为普华永道中天会计师事务所有限公司。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,本基金管理人、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

华泰证券	1	21,102,991.74	53.08%	19,231.15	52.54%	-
申银万国	1	18,651,160.39	46.92%	17,369.93	47.46%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合证 券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
中国建银投 资证券	2	-	-	-	-	-

第一创业	1	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位有关问题的通知》（证监基金字【2007】48 号）中关于“一家基金公司通过一家证券经营机构买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金 30%”的要求，本基金管理人在选择租用交易单元时，注重所选证券公司的综合实力、市场声誉。对证券公司的研究能力，由公司研究人员对其提供的研究报告、研究成果的质量进行定期评估。公司将根据内部评估报告，对交易单元租用情况进行总体评价，决定是否对交易单元租用情况进行调整。

2、本报告期内本基金退租交易单元：国金证券 28266，无新租交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-

财富证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中国建银投 资证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	停牌股票估值调整（乐视网）	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2016年1月12日
2	新增兴业证券为销售机构并开通定投转换及费率优惠业务	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2016年1月12日
3	新增北京增财销售为销售机构并开通定投转换费率优惠	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2016年1月20日
4	2015年4季度报告	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2016年1月22日
5	在财富证券开通转换业务	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2016年3月1日
6	广州证券、德邦证券开定投转换费率优惠	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2016年3月1日
7	在东海证券开通转换业务	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2016年3月10日

8	提醒投资者更新身份信息公告	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 3 月 24 日
9	工商银行申购费率优惠	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 3 月 28 日
10	2015 年年度报告	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 3 月 30 日
11	新增北京钱景财富管理有限公司 为销售机构并开通定投转换费率 优惠业务	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 4 月 12 日
12	参加陆金所费率优惠	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 4 月 15 日
13	2016 年 1 季度报告	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 4 月 21 日
14	中信建投费率优惠	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 5 月 4 日
15	参见民生银行费率优惠业务	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 5 月 13 日
16	新增鑫鼎盛为销售机构并开通定 投转换业务	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 5 月 24 日
17	新增深圳新兰德为销售机构并开 通定投转换费率优惠	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 6 月 7 日
18	陆金所开通定投及费率优惠	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 6 月 8 日
19	新增泰诚财富为销售机构并开通 定投转换费率优惠	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 6 月 17 日
20	在陆金所开通申购定投费率优惠 业务	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 6 月 24 日
21	在交通银行开通网上银行、手机银 行申购费率优惠业务	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 6 月 27 日

§ 11 备查文件目录

11.1 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

11.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人住所（或办公场所）、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或复印件。

11.3 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
2016 年 8 月 29 日