

泰信优质生活混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 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：2017 年 8 月 26 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 2017 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 2017 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20

§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	43
§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息	52
11.1 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.....	52
§12 备查文件目录	52

12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信优质生活混合型证券投资基金
基金简称	泰信优质生活混合
基金主代码	290004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 12 月 15 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	731, 795, 827. 34 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国经济可持续发展过程中那些最能够 满足人们优质生活需求的上市公司的长期稳定增长，在严格控制投资风险的基础上，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的大类资产配置、以核心-卫星策略为基础的优质生活行业配置和“自下而上”的证券精选相结合的投资 策略。
业绩比较基准	75%×富时中国 A600 指数+25%×富时中国国债指数
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。适合于能够承担一定股市风险，追求资本长期增值的个人和机构投资者。

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）自由贸易试验区浦东南路 256 号 华夏银行大厦 36-37 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	葛航	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》、《上海证券报》、《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(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-33,558,846.25
本期利润	-42,468,176.67
加权平均基金份额本期利润	-0.0519
本期加权平均净值利润率	-5.62%
本期基金份额净值增长率	-5.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-80,182,020.52
期末可供分配基金份额利润	-0.1096
期末基金资产净值	651,613,806.82
期末基金份额净值	0.8904

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	60.76%

注：1、本基金基金合同于 2006 年 12 月 15 日正式生效。本基金自 2015 年 8 月 7 日起变更为混合型基金。

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

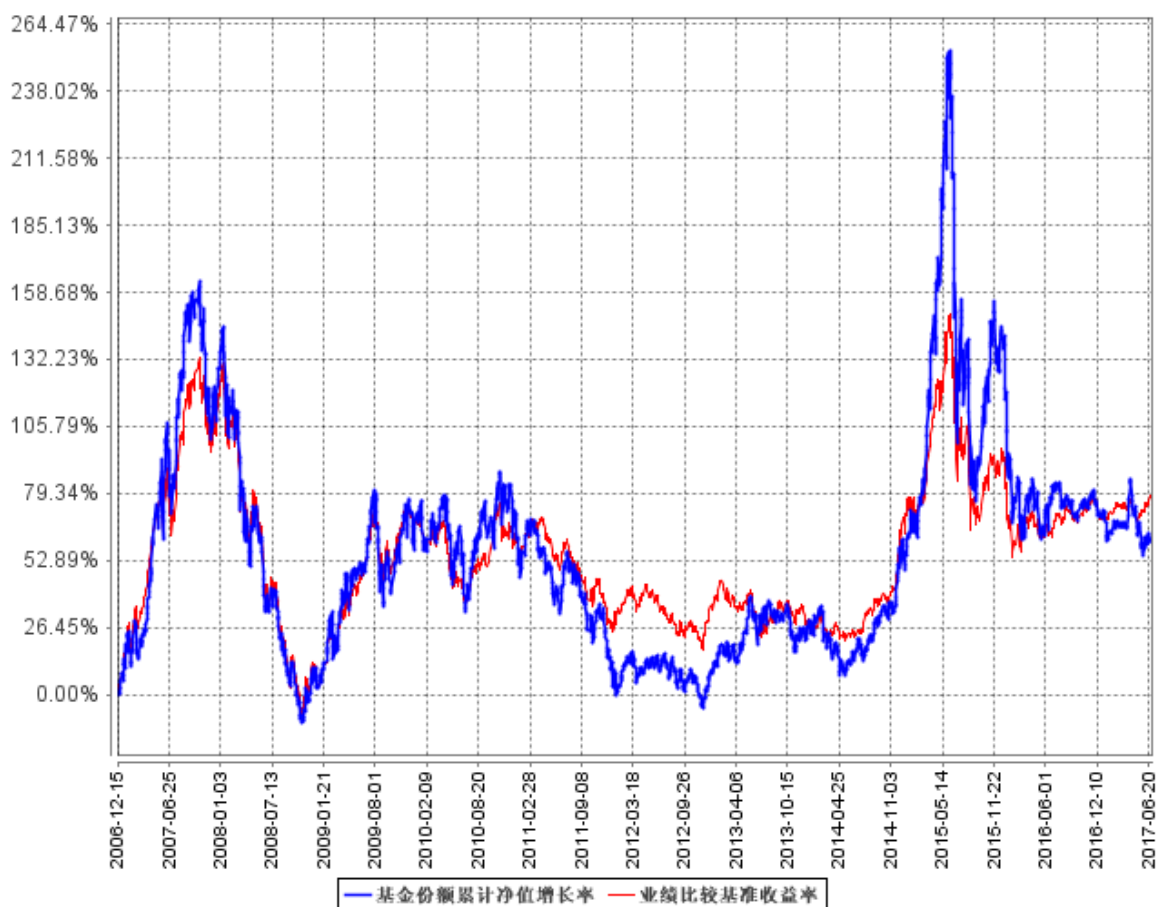
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.70%	1.11%	3.30%	0.46%	-2.60%	0.65%
过去三个月	-2.81%	1.31%	2.69%	0.48%	-5.50%	0.83%
过去六个月	-5.33%	1.05%	5.25%	0.44%	-10.58%	0.61%
过去一年	-11.08%	0.89%	7.83%	0.51%	-18.91%	0.38%
过去三年	35.15%	2.00%	43.18%	1.31%	-8.03%	0.69%
自基金合同生效起至今	60.76%	1.88%	78.55%	1.40%	-17.79%	0.48%

注：本基金业绩比较基准为：75%×富时中国 A600 指数+25%×富时中国国债指数。

富时中国 A600 指数是富时中国指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流通市值最大的 600 只股票并以流通股本加权的股票指数，富时中国国债指数涵盖了在上海及深圳交易所交易的到期日至少在一年以上的纯定息债券，是目前中国证券市场中与本基金投资范围比较适配同时公信力较好的股票指数和债券指数。

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 2006 年 12 月 15 日正式生效。 本基金自 2015 年 8 月 7 日起变更为混合型基金。

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 60%–95%，债券资产 0%–35%，基金保留的现金以及投资于剩余期限在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

§ 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：葛航

总经理：葛航

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：姚慧

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 2017 年 6 月底，公司有正式员工 105 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 2017 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、泰信智选成长混合、泰信鑫利混合共 20 只开放式基金及 26 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		
刘杰先生	本基金基金经理兼泰信中小盘精选混合基金经理	2016年12月1日	-	8年	研究生硕士。具有基金从业资格。2009年7月加入泰信基金管理有限公司，先后担任研究部助理研究员、研究员、高级研究员兼专户投资部投资顾问。自2015年3月17日起担任泰信中小盘精选混合基金经理。
徐慕浩先生	基金经理助理	2015年11月9日	-	7年	南开大学金融学硕士，具有基金从业资格。2011年加入泰信基金管理有限公司，历任助理研究员，现任研究部研究员兼基金经理助理。

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》、《泰信优质生活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 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

上半年经济翘尾回升的动能主要来自存货投资、出口与政府支出，而这三项需求的高增都与价格因素密切相关。价格高增带动企业补库、进出口的价格差抬升净出口的实际值，企业营收和利润的名义高增也拉动财政收支的高增。二季度经济的超预期高增、黑色系的再度狂欢并未消除市场对后续经济走势的分歧。就年内而言，三季度经济将保持韧性，居民消费和地产投资有望对冲基建的回落和补库的结束，出口也高位震荡，经济回落压力集中在四季度。但回落并不意味着重回 2015 年，工业走出通缩、企业资产负债表修复、全球杠杆修复从分化走向收敛意味着经济最差的时候已经过去，货币金融环境的转向对经济内生动能侵蚀有限，经济缓慢寻底的同时企业盈利有望保持相对高增，能否抓住当前的窗口期走出债务周期的漩涡决定春天能否真的到来。行情方面，上半年市场基本围绕这低估值蓝筹、供给侧改革两大主线演绎；反观成长股为代表的创业板、中小板表现低迷，市场呈现出非牛非熊的状态，短期难以改变。

上半年，产品基本以低估值蓝筹股为主线，同时试图在创业板寻求超跌反弹的机会，但效果一般。我们也结合产品特点与契约要求积极在可投资范围内增加投资收益，一季度参与了京津冀主题与周期股反弹；二季度参与了供给侧改革相关板块与消费。下半年，我们仍将坚持热点板块与优质个股并重的策略，自上而下与自下而上相结合寻找投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.8904 元；本报告期基金份额净值增长率为-5.33%，业绩比较基准收益率为 5.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济基本面——上半年稳中缓升，下半年稳中趋缓。上半年经济基本面整体韧性好，延续去年四季度以来的整体稳中有升态势，主要动力在于全球经济复苏下的净出口贡献由负转正，消费贡献略微回升，抵消投资贡献趋势放缓。考虑到本轮全球经济企稳复苏主要靠低利率的货币量宽刺激为主，而缺乏重大技术创新引领经济增长的新引擎，基建投资周期也未见启动，同时人口老龄化、实体投资回报率下降、贸易保护主义势力抬头下全球贸易低增长，决定

本轮库存周期推动的经济复苏或已步入中后场；因而下半年出口需求增速或下滑，净出口贡献或回落。同时，随着 16 年底以来的货币政策回归稳健中性、大范围升级从严调控楼市、金融去杠杆及严格规范地方举债行为等效果显现，下半年地产投资将缓慢回落、基建投资高位难支、制造业投资低位反弹乏力，国内经济底部缓升甚至企稳动力将衰减，叠加全球经济复苏步入中后场，净出口贡献或回落，以及去年经济前低后高的基数效应，预计今年上下半场经济前高后低态势难改，下半年经济将稳中趋缓。

资金面——稳健中性基调难调整，流动性有望维持稳定，资金利率或步入平稳期。内部环境方面，上半年经济超预期企稳，短期经济韧性好，下半年回落幅度有限，通胀整体保持温和低位运行；外部因素方面，下半年美元加息节奏放缓（近期随着特朗普新医保法案的否决，美联储鸽派，下半年美元三次加息概率显著下修），美联储缩表预期充分进度缓慢，人民币汇率贬值与资本流出压力有限。综合内外部因素判断，预计下半年货币政策稳健中性基调维持不变，基本面好于预期，使得放松必要性不大，外部压力缓解，进一步收紧的必要性也下降。货币政策稳健中性基调难有调整，仍以 OMO、MLF、PSL 等灵活对冲、“削峰填谷”的对冲性操作策略为主，维持流动性基本稳定，以助力下半年经济温和去杠杆与直接融资提速。

货币政策稳健中性、流动性维持稳定下，资金利率也将步入平稳期。近两月央行加大净投放“填谷”资金季节性需求后，7 月货币市场资金日均利率已回落至合理中枢位置 3.3%附近；近期已自中枢下方有所反弹，R007 已自 7 月上中旬的 3.0%均值，已回升下旬的 3.6%均值附近；下半年货币政策稳健中性、流动性维持稳定下，资金利率整体或步入平稳期，上下波动区间有限，对市场影响或弱化。

政策与事件——下半年金融风险排雷主战场转移，对市场直接冲击缓解。金融防风险去杠杆为 17 年重点工作任务，那当前中国灰犀牛风险主要包括哪些？近日中央财经领导小组办公室有关领导具体指出，主要有影子银行、房地产泡沫、国有企业高杠杆、地方债务、违法违规集资等几大问题。对于前两大金融风险，已率先发力且初见成效。去年国庆前后全国大范围楼市从严调

控，房地产泡沫已得到遏制，近期正在加快建立楼市调控长效机制（如多个城市近日推出购租同权）；而上半年金融去杠杆发力，表外融资明显萎缩，影子银行活动正逐步收缩，中小银行以同业负债增速及银行资产负债增速双双回落，金融去杠杆也初见成效。

在确保不发生金融系统性风险的安全底线，国务院金稳会下，加强监管协调有望得到落实，金融去杠杆或以温和节奏、保持定力推进为主。结合此前全国金融工作会议也提出国企与地方政府为经济去杠杆两大重点领域，提出要紧紧抓住处置“僵尸企业”这个牛鼻子，更多运用市场机制实现优胜劣汰，预计下半年金融风险排雷主战场将转移至国有企业与地方债务的遏制化解，去杠杆重心由上半年的金融领域转移至下半年的国企与地方政府，对市场直接冲击大为缓解，甚至受经济实体去杠杆，优化资金资源配置，提高股市活跃度。预计下半年国企混改、央企重组、市场化并购重组等国改进程或加快；同时要积极稳妥化解累积的地方政府债务风险，有效规范地方政府举债融资，坚决遏制隐性债务增量。

市场预判——近期周期股表现强势，源于市场对于二季度经济和盈利的悲观预期的修复，其中盈利的悲观修复与周期品价格关系密切。另外，政策的持续超预期也是推动周期股行情进一步演绎的重要力量，供给侧改革深入推进，同时叠加环保核查，进一步促进了相关产品供给的紧张。目前，周期板块的关注点依然在业绩上。对中报预告数据进行整理，周期性行业的中报净利润增速都比较靠前，钢铁位居净利润增速榜首，采掘、有色、化工处于行业净利润增速的前 40%。现在的市场依然是存量博弈，投资者高度重视业绩支撑。当前时点，我们看好：（一）供给短期受政策影响，带来价格提升的板块，如钢铁、铝、稀土等；（二）环保趋严，行业落后产能逐步退出带来的竞争格局改善，如化工；（三）间接受益于下游客户盈利情况改善而带来的资产负债表改善的银行、保险板块。主题方面继续关注雄安新区的进一步政策催化。

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。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、泰信智选成长基金经理。

梁剑先生，硕士。2004 年 7 月加入泰信基金管理有限公司，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

1、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，投资者可选择将获取的现金红利自动转为基金份额进行再投资；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) 基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；

(4) 基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；

(5) 如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；

(6) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少 1 次；

(7) 全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 50%。基金合同生效不满三个月，收益可不分配；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

2、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”）在对泰信优质生活混合型证券投资基金（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合规守信、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：泰信优质生活混合型证券投资基金

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	54,120,838.07	120,510,386.04
结算备付金		6,947,403.11	1,237,078.99
存出保证金		289,198.34	341,719.85
交易性金融资产	6.4.7.2	493,667,929.97	572,162,067.91
其中：股票投资		493,667,929.97	572,162,067.91
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	99,000,169.50	200,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	31,674.87	21,113.20
应收股利		-	-
应收申购款		5,486.61	14,634.92

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		654,062,700.47	894,287,000.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016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		-	24,218,976.45
应付赎回款		238,591.23	142,998.66
应付管理人报酬		806,551.64	1,125,201.38
应付托管费		134,425.29	187,533.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	820,617.77	1,350,605.50
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	448,707.72	650,164.97
负债合计		2,448,893.65	27,675,480.53
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	731,795,827.34	921,469,868.55
未分配利润	6.4.7.10	-80,182,020.52	-54,858,348.17
所有者权益合计		651,613,806.82	866,611,520.38
负债和所有者权益总计		654,062,700.47	894,287,000.91

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8904 元，基金份额总额 731,795,827.34 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信优质生活混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年6月30日
一、收入		-31,763,527.72	-254,765,830.06
1.利息收入		1,301,881.41	764,976.34
其中：存款利息收入	6.4.7.11	604,888.34	758,206.13
债券利息收入		876.54	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		696,116.53	6,770.21
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-24,313,932.87	-199,061,929.30
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-26,652,440.80	-201,387,586.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	195,084.26	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	2,143,423.67	2,325,656.76
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-8,909,330.42	-56,553,237.30
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	157,854.16	84,360.20
减：二、费用		10,704,648.95	18,428,155.46
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,626,713.53	7,312,424.77
2. 托管费	6.4.10.2.2	937,785.59	1,218,737.50
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	3,916,620.34	9,674,767.95
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	223,529.49	222,225.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-42,468,176.67	-273,193,985.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-42,468,176.67	-273,193,985.52

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信优质生活混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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	921,469,868.55	-54,858,348.17	866,611,520.38

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-42,468,176.67	-42,468,176.67
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)	-189,674,041.21	17,144,504.32	-172,529,536.89
其中:1.基金申购款	57,600,621.26	-357,890.24	57,242,731.02
2.基金赎回款	-247,274,662.47	17,502,394.56	-229,772,267.91
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)	731,795,827.34	-80,182,020.52	651,613,806.82
项目	上年度可比期间 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)	809,270,017.15	446,467,825.22	1,255,737,842.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-273,193,985.52	-273,193,985.52
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)	193,827,639.38	1,290,988.41	195,118,627.79
其中:1.基金申购款	317,636,517.26	2,657,711.75	320,294,229.01
2.基金赎回款	-123,808,877.88	-1,366,723.34	-125,175,601.22
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)	-	-173,118,243.00	-173,118,243.00
五、期末所有者权益(基金净值)	1,003,097,656.53	1,446,585.11	1,004,544,241.64

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

韩波

蔡海成

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰信优质生活混合型证券投资基金(原名为泰信优质生活股票型证券投资基金,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”)证监基金字[2006]第 229 号《关于同意泰信优质生活股票型证券投资基金设立的批复》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《泰信优质生活股票型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 1,591,255,543.43 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(2006)第 191 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》于 2006 年 12 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,591,662,103.09 份基金份额,其中认购资金利息折合 406,559.66 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 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,泰信优质生活股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为泰信优质生活混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信优质生活混合型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,包括国内依法公开发行上市的各类股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金组合投资的范围为:股票资产 60%-95%,债券资产 0-35%,基金保留的现金以及投资于剩余期限在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:75%×富时中国 A600 指数(原新华富时 A600 指数)+25%×富时中国国债指数(原新华富时国债指数)。

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》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信优质生活混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会(以下简称“中国基金业协会”)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 2017 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

(3)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，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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	54,120,838.07
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	54,120,838.07

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	495,826,786.74	493,667,929.97	-2,158,856.77
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	495,826,786.74	493,667,929.97	-2,158,856.77

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

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	99,000,169.50	-
合计	99,000,169.50	-

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 2017年6月30日
应收活期存款利息	21,230.92
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	2,815.96
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	7,510.90
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	117.09
合计	31,674.87

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 2017年6月30日
----	-------------------

交易所市场应付交易费用	820,135.94
银行间市场应付交易费用	481.83
合计	820,617.77

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	353.44
预提费用	198,354.28
-	-
合计	448,707.72

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	921,469,868.55	921,469,868.55
本期申购	57,600,621.26	57,600,621.26
本期赎回（以“-”号填列）	-247,274,662.47	-247,274,662.47
- 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	731,795,827.34	731,795,827.34

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	-35,430,127.69	-19,428,220.48	-54,858,348.17
本期利润	-33,558,846.25	-8,909,330.42	-42,468,176.67
本期基金份额交易产生的变动数	12,929,330.34	4,215,173.98	17,144,504.32
其中：基金申购款	-3,992,352.94	3,634,462.70	-357,890.24
基金赎回款	16,921,683.28	580,711.28	17,502,394.56

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-56,059,643.60	-24,122,376.92	-80,182,020.52

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	524,649.16
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	77,929.91
其他	2,309.27
合计	604,888.34

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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	1,312,015,920.24
减：卖出股票成本总额	1,338,668,361.04
买卖股票差价收入	-26,652,440.80

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	195,084.26
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	195,084.26

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,193,960.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,998,000.00
减：应收利息总额	876.54
买卖债券差价收入	195,084.26

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期末本基金未投资资产支持证券。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本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。

6.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2017年1月1日至2017年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	-

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,143,423.67
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,143,423.67

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	-8,909,330.42
——股票投资	-8,909,330.42
——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	-8,909,330.42

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	151,299.01
转出基金补偿费	6,555.15
其他	-
-	-
合计	157,854.16

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，其中赎回费部分的 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 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	3,916,620.34
银行间市场交易费用	-
合计	3,916,620.34

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
中债登账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,200.00
银行划款手续费	6,975.21
其他	-
账户维护费	-
合计	223,529.49

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、注册登记机构、基金销售机构
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、基金销售机构
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 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,626,713.53	7,312,424.77
其中：支付销售机构的客户维护费	621,847.28	699,017.82

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 1.5% 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 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
----	----------------------------	---------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	937,785.59	1,218,737.50
----------------	------------	--------------

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 0.25% 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： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$ 。

6.4.10.2.3 销售服务费

本报告期及上年度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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016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	54,120,838.07	524,649.16	112,102,159.93	699,383.08

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未参与在承销期内关联方承销的证券。

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

本报告期本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

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
002694	颐地科技	2017 年 5 月 25 日	重大事项停牌	23.32	-	-	1,826,576	40,563,166.77	42,595,752.32	-

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。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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。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。

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、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	54,120,838.07	-	-	-	54,120,838.07
结算备付金	6,947,403.11	-	-	-	6,947,403.11
存出保证金	289,198.34	-	-	-	289,198.34
交易性金融资产	-	-	-	493,667,929.97	493,667,929.97
买入返售金融资产	99,000,169.50	-	-	-	99,000,169.50
应收利息	-	-	-	31,674.87	31,674.87
应收申购款	-	-	-	5,486.61	5,486.61
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	160,357,609.02	-	-	493,705,091.45	654,062,700.47
负债					
应付赎回款	-	-	-	238,591.23	238,591.23
应付管理人报酬	-	-	-	806,551.64	806,551.64
应付托管费	-	-	-	134,425.29	134,425.29
应付交易费用	-	-	-	820,617.77	820,617.77
其他负债	-	-	-	448,707.72	448,707.72
负债总计	-	-	-	2,448,893.65	2,448,893.65
利率敏感度缺口	160,357,609.02	-	-	-491,256,197.80	651,613,806.82
上年度末 2016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	120,510,386.04	-	-	-	120,510,386.04
结算备付金	1,237,078.99	-	-	-	1,237,078.99

存出保证金	341,719.85	-	-	-	341,719.85
交易性金融资产	-	-	-	-572,162,067.91	572,162,067.91
买入返售金融资产	200,000,000.00	-	-	-	200,000,000.00
应收利息	-	-	-	21,113.20	21,113.20
应收申购款	-	-	-	14,634.92	14,634.92
资产总计	322,089,184.88	-	-	-572,197,816.03	894,287,000.91
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	24,218,976.45	24,218,976.45
应付赎回款	-	-	-	142,998.66	142,998.66
应付管理人报酬	-	-	-	1,125,201.38	1,125,201.38
应付托管费	-	-	-	187,533.57	187,533.57
应付交易费用	-	-	-	1,350,605.50	1,350,605.50
其他负债	-	-	-	650,164.97	650,164.97
负债总计	-	-	-	27,675,480.53	27,675,480.53
利率敏感度缺口	322,089,184.88	-	-	-544,522,335.50	866,611,520.38

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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资 (2016 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 (2016 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或银行间同业市场交易的股票和债券，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，采用“自上而下”的策略，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。本基金组合投资的范围为：股票资产 60%-95%，债券资产 0%-35%。此外，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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	493,667,929.97	75.76	572,162,067.91	66.02
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	493,667,929.97	75.76	572,162,067.91	66.02

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	4,796,603.44	60,330,000.00
业绩比较基准下降 5%	-4,796,603.44	-60,330,000.00	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运

营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§ 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	493,667,929.97	75.48
	其中：股票	493,667,929.97	75.48
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	99,000,169.50	15.14
	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	61,068,241.18	9.34
7	其他各项资产	326,359.82	0.05
8	合计	654,062,700.47	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	采矿业	-	-
C	制造业	268,485,436.96	41.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,121,000.00	2.47
E	建筑业	14,612,000.00	2.24
F	批发和零售业	14,223,000.00	2.18
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	133,553,549.52	20.50
J	金融业	187,943.49	0.03
K	房地产业	27,871,400.00	4.28
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	18,613,600.00	2.86
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	493,667,929.97	75.76

7.2.2 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

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	002694	顾地科技	1,826,576	42,595,752.32	6.54
2	600340	华夏幸福	830,000	27,871,400.00	4.28

3	000923	河北宣工	930,000	27,714,000.00	4.25
4	000826	启迪桑德	530,000	18,613,600.00	2.86
5	000066	中国长城	1,999,975	18,019,774.75	2.77
6	300275	梅安森	930,000	17,837,400.00	2.74
7	600536	中国软件	930,000	17,818,800.00	2.73
8	000401	冀东水泥	1,150,000	17,698,500.00	2.72
9	002368	太极股份	630,000	17,444,700.00	2.68
10	300352	北信源	2,974,500	17,162,865.00	2.63
11	002439	启明星辰	900,000	16,740,000.00	2.57
12	603019	中科曙光	590,000	16,602,600.00	2.55
13	300471	厚普股份	1,090,552	16,587,295.92	2.55
14	600008	首创股份	2,450,000	16,121,000.00	2.47
15	600756	浪潮软件	799,878	15,829,585.62	2.43
16	300083	劲胜精密	1,700,000	15,708,000.00	2.41
17	000733	振华科技	980,000	15,582,000.00	2.39
18	300369	绿盟科技	1,408,188	15,574,559.28	2.39
19	000581	威孚高科	600,000	15,540,000.00	2.38
20	002108	沧州明珠	1,139,000	15,205,650.00	2.33
21	002268	卫士通	900,000	15,138,000.00	2.32
22	600068	葛洲坝	1,300,000	14,612,000.00	2.24
23	000597	东北制药	1,300,000	14,534,000.00	2.23
24	600153	建发股份	1,100,000	14,223,000.00	2.18
25	002223	鱼跃医疗	580,000	13,734,400.00	2.11
26	000951	中国重汽	890,200	13,611,158.00	2.09
27	601992	金隅股份	1,999,929	12,939,540.63	1.99
28	300424	航新科技	255,057	12,031,038.69	1.85
29	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.03
30	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
31	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
32	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
33	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.01
34	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
35	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
36	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
37	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
38	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
39	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
40	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
41	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00

42	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
43	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
44	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
45	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
46	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

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	002418	康盛股份	43,161,287.57	4.98
2	002694	顾地科技	40,563,166.77	4.68
3	300471	厚普股份	31,159,995.42	3.60
4	300248	新开普	30,716,474.00	3.54
5	000401	冀东水泥	28,636,962.49	3.30
6	002331	皖通科技	24,815,971.93	2.86
7	600782	新钢股份	24,497,134.00	2.83
8	601669	中国电建	24,437,900.78	2.82
9	300275	梅安森	24,215,812.00	2.79
10	601766	中国中车	23,402,076.34	2.70
11	600029	南方航空	22,459,328.00	2.59
12	600340	华夏幸福	22,426,864.07	2.59
13	601186	中国铁建	22,055,035.00	2.54
14	600536	中国软件	21,580,866.00	2.49
15	000923	河北宣工	21,338,630.00	2.46
16	000732	泰禾集团	20,683,512.07	2.39
17	600547	山东黄金	20,643,176.92	2.38
18	601390	中国中铁	20,424,683.51	2.36
19	600116	三峡水利	20,199,574.00	2.33
20	000826	启迪桑德	19,197,314.00	2.22
21	600489	中金黄金	19,093,664.26	2.20
22	600482	中国动力	18,789,430.17	2.17
23	600507	方大特钢	18,528,018.93	2.14

24	601555	东吴证券	18,125,428.36	2.09
25	000066	中国长城	18,114,939.57	2.09
26	300369	绿盟科技	18,044,129.72	2.08
27	600008	首创股份	18,017,272.00	2.08
28	601618	中国中冶	17,898,420.00	2.07
29	300352	北信源	17,778,505.34	2.05
30	601198	东兴证券	17,694,579.44	2.04

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	002383	合众思壮	46,791,847.36	5.40
2	002418	康盛股份	37,903,797.00	4.37
3	002686	亿利达	34,346,813.72	3.96
4	300347	泰格医药	31,516,549.56	3.64
5	600028	中国石化	29,232,871.96	3.37
6	601669	中国电建	26,816,685.34	3.09
7	300097	智云股份	26,377,444.70	3.04
8	600782	新钢股份	25,126,681.29	2.90
9	600759	洲际油气	25,047,241.16	2.89
10	600803	新奥股份	24,435,126.64	2.82
11	300248	新开普	24,198,576.19	2.79
12	601166	兴业银行	23,869,297.21	2.75
13	603000	人民网	23,677,912.93	2.73
14	000822	山东海化	23,648,000.00	2.73
15	600096	云天化	23,069,658.00	2.66
16	600116	三峡水利	22,954,680.76	2.65
17	002331	皖通科技	22,622,371.36	2.61
18	601766	中国中车	22,531,370.60	2.60
19	600029	南方航空	21,935,672.38	2.53
20	601186	中国铁建	21,858,176.84	2.52
21	000921	海信科龙	21,734,867.99	2.51
22	002146	荣盛发展	20,968,611.80	2.42

23	600596	新安股份	20,328,718.09	2.35
24	600886	国投电力	20,053,728.43	2.31
25	000732	泰禾集团	19,548,774.23	2.26
26	601390	中国中铁	19,356,850.57	2.23
27	000703	恒逸石化	19,255,335.96	2.22
28	600266	北京城建	18,584,529.92	2.14
29	300061	康耐特	18,362,481.30	2.12
30	603609	禾丰牧业	18,235,471.87	2.10
31	601555	东吴证券	18,235,040.25	2.10
32	601198	东兴证券	18,018,762.00	2.08
33	600507	方大特钢	18,007,234.00	2.08
34	600482	中国动力	17,417,305.80	2.01
35	002829	星网宇达	17,384,693.73	2.01

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	1,269,083,553.52
卖出股票收入（成交）总额	1,312,015,920.24

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况说明。

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

涉及信息披露的问题是广东顾地（顾地科技原大股东）。在 2015 年 3 月 13 日，广东顾地同重庆涌瑞股权投资有限公司、杭州德力西集团有限公司、邢某亚等三方签订《股份转让协议》（以下简称《转让协议》）和《股份转让补充协议》（以下简称《补充协议》）。《补充协议》在《转让协议》的基础上，在履约保证金、股东权益、现金分红、违约责任等方面增加了实质性内容，并明确约定“本补充协议与《股份转让协议》具有同等法律效力，本补充协议与《股份转让协议》

不一致的，以本补充协议为准”。上述协议签署时，广东顾地时任董事长邱丽娟（同时担任顾地科技董事）、董事林超群（同时担任顾地科技董事长）、董事林昌华（同时担任顾地科技董事，副总经理）和董事林昌盛均在《转让协议》和《补充协议》文件上签字。广东顾地副董事长麦浩文承认其在广东顾地董事会决议此次股份转让的事项上签字，并参与过上述协议的协商。2015 年 3 月 17 日，广东顾地在披露的简式权益报告书中未将《补充协议》列入备查文件，也未就是否存在补充协议进行说明。顾地科技在披露的《关于控股股东转让公司股份的提示性公告》中只披露了本次股份变动计划情况、《转让协议》、《简式权益报告书》等，没有提及《补充协议》。

我们认为，此次处罚并不影响本基金对该只股票投资，原因如下：

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

2、处罚对公司投资价值不构成损害。

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

7.12.2

本报告期内基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的股票备选库。

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	289,198.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	31,674.87
5	应收申购款	5,486.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	326,359.82

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002694	顾地科技	42,595,752.32	6.54	重大事项停牌

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
25,336	28,883.64	116,378,335.41	15.90%	615,417,491.93	84.10%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,287.88	0.0004%

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（2006 年 12 月 15 日）基金份额总额	1,591,662,103.09
本报告期期初基金份额总额	921,469,868.55
本报告期基金总申购份额	57,600,621.26
减：本报告期基金总赎回份额	247,274,662.47
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	731,795,827.34

注：总申购份额含红利再投、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

2017 年 1 月 23 日起，公司董事总经理葛航先生代理公司董事长职务，王小林先生不再担任公司董事长职务，上述高管变动按照相关规定报监管机构备案并公告。

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

万科企业股份有限公司工会委员会诉泰信基金管理有限公司等被告损害股东利益责任纠纷一案，公司已聘请专业律师应诉，截至报告期末诉讼处于审理阶段，法院未作出判决。
本报告期无涉及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	
中银国际	3	467,850,947.71	18.13%	431,289.88	18.15%	-
光大证券	1	359,389,865.37	13.93%	334,698.41	14.09%	-
广发证券	2	282,380,069.45	10.94%	262,976.51	11.07%	-
长江证券	1	278,219,531.81	10.78%	253,541.77	10.67%	-
安信证券	3	227,265,143.38	8.81%	207,107.12	8.72%	-
招商证券	1	214,385,822.07	8.31%	195,369.30	8.22%	-
申银万国	1	212,910,910.90	8.25%	198,284.99	8.35%	-
国泰君安	1	199,534,700.45	7.73%	181,836.24	7.65%	-
东方证券	1	159,892,556.80	6.20%	145,710.96	6.13%	-
广州证券	1	116,903,061.87	4.53%	108,870.81	4.58%	-
中金公司	1	54,780,785.13	2.12%	51,017.96	2.15%	-

天风证券	1	6,981,714.44	0.27%	4,966.10	0.21%	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合证 券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中国建银投 资证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	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，对席位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、本报告期新增交易单元：华金证券（深圳 000481）、中银国际（深圳 037925）、川财证券（深圳 003701）；无退租交易单元。

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
中银国际	-	-	730,000,000.00	12.64%	-	-
光大证券	-	-	1,570,000,000.00	27.18%	-	-
广发证券	-	-	380,000,000.00	6.58%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	10,193,960.80	100.00%	105,400,000.00	1.82%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	680,000,000.00	11.77%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	2,230,000,000.00	38.61%	-	-
中金公司	-	-	80,000,000.00	1.39%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中国建银投资证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

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（合众思壮）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2017年1月14日
2	16年4季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2017年1月20日
3	行业高级管理人变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2017年1月23日
4	提醒投资者更新过期身份证信息	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2017年2月22日
5	交通银行手机银行费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2017年2月23日
6	新增南京苏宁基金销售有限公司为销售机构并开通转换费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2017年3月3日
7	新增北京懒猫金融为销售机构并开通定投转换及费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2017年3月15日
8	参加工商银行申购费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2017年3月30日

		(www.ftfund.com)	
9	新增上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2017年3月30日
10	16年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2017年3月30日
11	在广发证券开通转换、费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2017年4月8日
12	在中银国际证券开通定投转换业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2017年4月13日
13	17年1季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2017年4月21日
14	交通银行手机银行费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2017年4月22日
15	在上海好买基金开通申购定投费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2017年4月27日
16	调整在伯嘉基金定投最低申购金额并参加费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2017年5月12日
17	在中泰证券申购定投费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2017年5月23日
18	在平安银行开通定投转换费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2017年5月26日
19	参加中银国际证券有限公司定投费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2017年6月8日

		(www.ftfund.com)	
20	参加上海长量基金申购、定投费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2017 年 6 月 21 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰信优质生活股票型证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信优质生活混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信优质生活混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信优质生活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、报告期内泰信优质生活混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

12.2 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。

12.3 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

2017年8月26日