泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告
摘要

2017 年 12 月 31 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：2018 年 3 月 29 日

§1 重要提示

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 2018 年 3 月 28 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。

普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰信互联网+主题混合
基金主代码	001978
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 6 月 8 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	51,266,534.92 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过深入研究并积极投资于互联网+主题相关的优质上市公司，分享其发展和成长的机会，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济、证券市场以及互联网+主题相关行业的发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%＋上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金是混合型基金，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。

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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ftfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2017 年	2016 年 6 月 8 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	373,231.02	-922,063.36
本期利润	2,545,976.55	-1,208,639.51
加权平均基金份额本期利润	0.0495	-0.0089
本期基金份额净值增长率	4.14%	-3.40%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0032	-0.0335
期末基金资产净值	51,571,971.95	56,476,977.35
期末基金份额净值	1.006	0.966

注：1、本基金合同生效日为 2016 年 6 月 8 日。

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。

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
过去三个月	1.82%	1.15%	2.60%	0.40%	-0.78%	0.75%
过去六个月	8.17%	1.12%	5.07%	0.35%	3.10%	0.77%

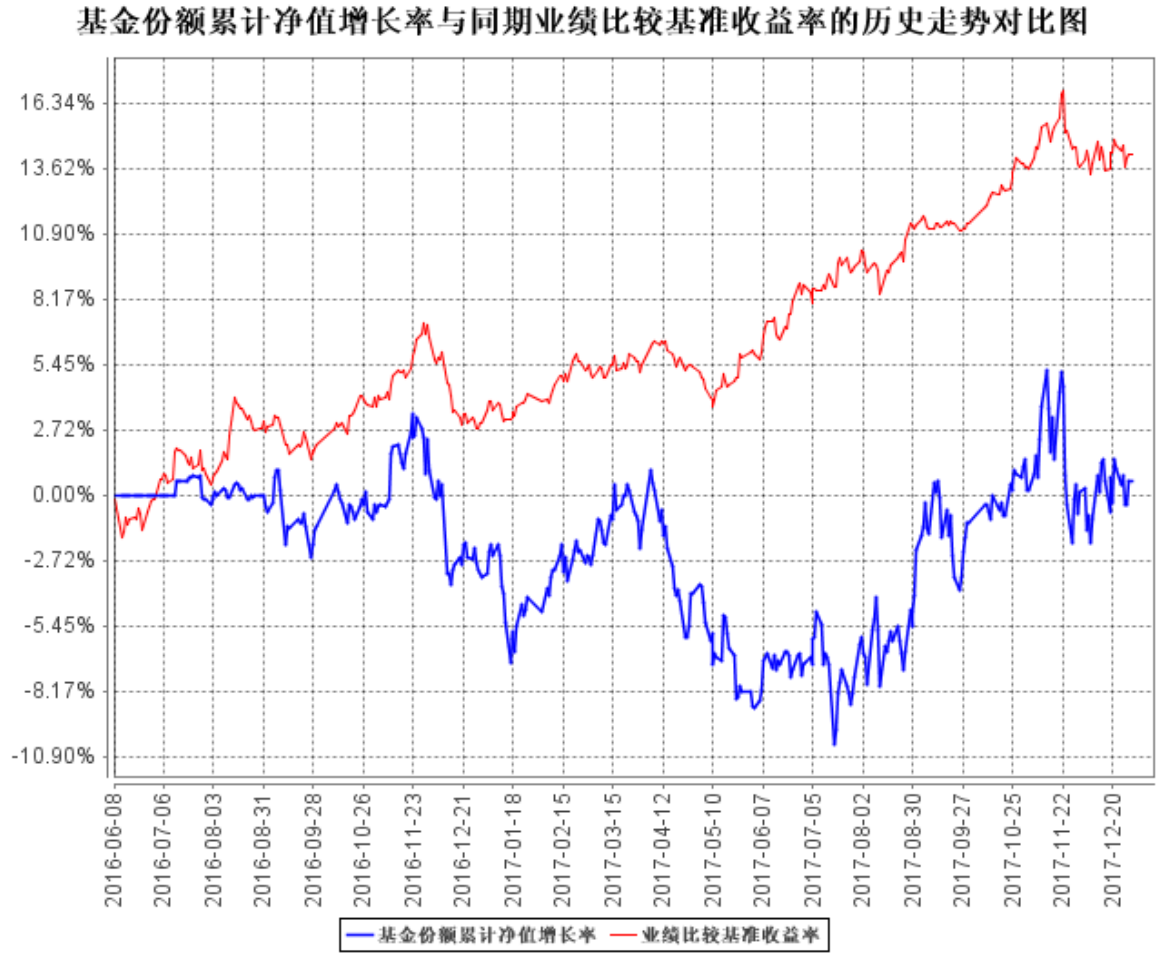
过去一年	4.14%	0.97%	10.86%	0.32%	-6.72%	0.65%
自基金合同生效起至今	0.60%	0.85%	14.19%	0.35%	-13.59%	0.50%

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

1、沪深 300 指数以沪深两市的 A 股股票中流通市值大、流动性好的蓝筹股为选股基础构建，大约覆盖市场 65％的流通市值，行业覆盖均衡，能够较全面地反映国内 A 股市场的总体趋势。指数通过沪深两个交易所发布，具有权威性和公正性，投资者能方便获得。

2、上证国债指数涵盖了上海证券交易所交易的所有固定利率国债，能够较全面地反映国内债券市场的情况。

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



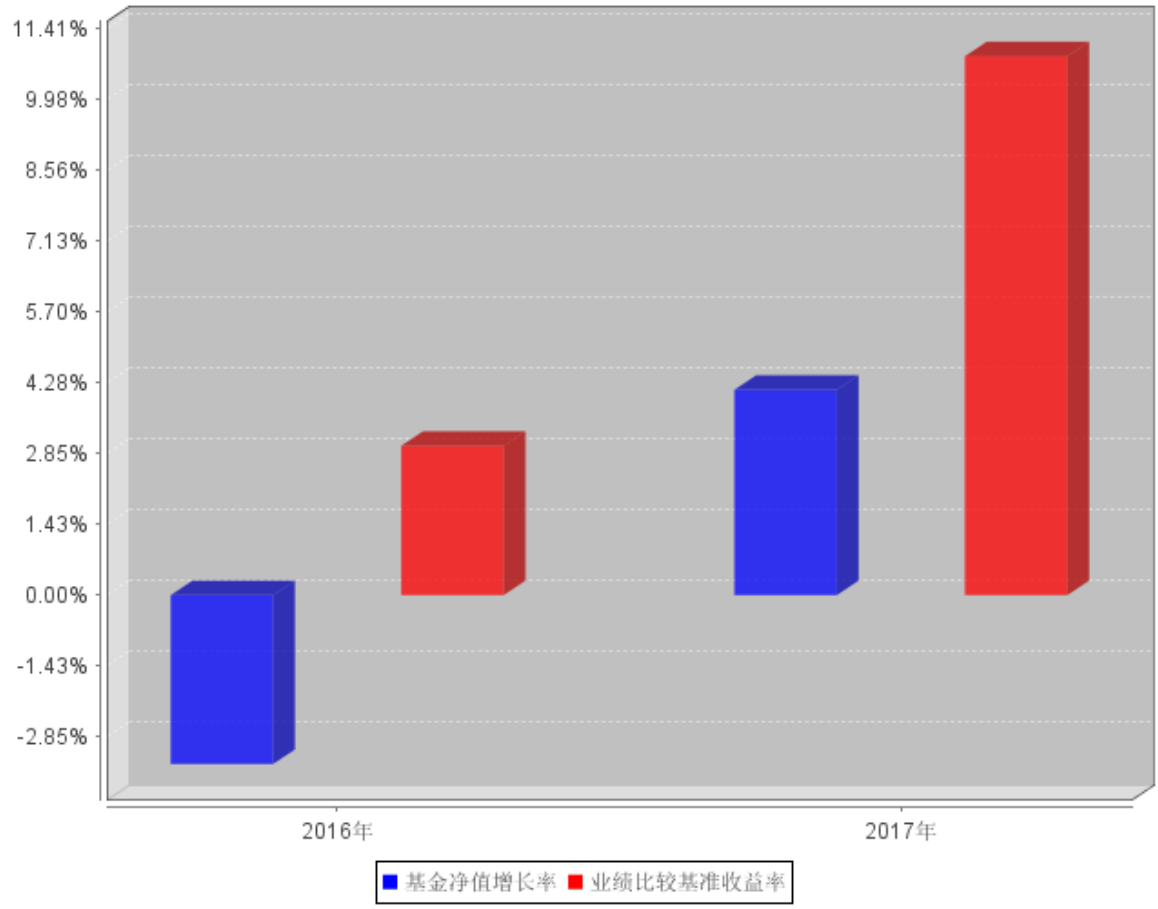
注：1、本基金基金合同于 2016 年 6 月 8 日正式生效。

2、本基金建仓期为六个月。建仓期满本基金的投资组合比例为股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%，投资于互联网+主题的相关证券不低于非现金基金资产的 80%。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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2016 年 6 月 8 日正式生效，2016 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

基金基金合同于 2016 年 6 月 8 日正式生效。2016 年、2017 年未进行利润分配。

§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 号华夏银行大厦 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：万众

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.）是原山东省国际信托投资有限公司（现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 12 月底，公司有正式员工 102 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 12 月 31 日，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、泰信鑫利混合共 20 只开放式基金及 19 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		
钱鑫先生	本基金经理兼泰信发展主题混合基金	2016年6月8日	-	8 年	硕士，具有基金从业资格。曾任华为海思半导体任产品市场经理、上海彤源投资发展有限公司 TMT 行业研究员。2012 年

	经理				3 月加入泰信基金管理有限公司，在研究部担任高级研究员岗位，自 2013 年 7 月起任先行策略基金经理助理。自 2014 年 5 月 20 日起至 2016 年 6 月 30 日担任泰信先行策略基金经理；自 2016 年 1 月 27 日起担任泰信发主题混合基金经理。

注：1、以上日期为基金合同生效的日期。

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》、《泰信互联网+主题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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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《泰信基金管理有限公司公平交易制度》，主要控制方法如下：

1、建立统一的研究平台，所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放。

2、建立全公司投资对象备选库和各投资组合的投资对象备选库。

3、投委会作为公司受托资产投资的最高决策机构，主要负责对公司所管理的受托资产进行投资决策。投资总监在其权限范围内审批超出投资组合经理权限的投资计划。投资组合经理在其权限范围内进行投资决策。

4、投资组合经理同时管理多个投资组合时，必须公平公正的对待管理的所有投资组合，除申购赎回、个股投资比例超标等客观因素之外，同一交易日投资同一交易品种时，应尽可能使他们获得相同或相近的交易价格。

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。

5、集中交易室负责所有投资指令的执行，必须确保所有同向指令的公平公正，平等对待所有

投资组合。发现异常指令或者涉嫌利益输送的指令，交易室应立即停止执行指令，并向投资总监和风险管理部报告。对非竞争竞价指令，不同投资组合也必须公平对待，主要采取成交结果按比例分配和轮侯方式处理。

6、风险管理部通过交易系统监控指标设置，实时监控交易指令，禁止同一投资组合内部的同日反向交易，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。

7、公司在交易系统中设置强制公平委托参数，强制交易系统对符合要求的同一交易品种的同向指令执行公平委托。

8、风险管理部定期与不定期对交易指令的公平性和交易委托的公平性进行分析，对强制公平委托的执行过程与结果进行检查；对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，并完成定期分析报告。

4.3.2 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。

4.3.3 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。

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，随着制造业 PMI、工业企业利润、进出口等经济数据持续向好，中、下游周期行业延续了去年下半年以来的周期复苏产业链传导，三四线城市消费带动了相关行业景气度提升。互

联网+领域由于大部分公司估值水平偏高，相对全市场不具备优势，在上半年表现较为一般，仅苹果产业链、人工智能、新能源汽车等方向有较好表现。在行业层面，人工智能包括无人驾驶技术、AlphaGo 为代表的深度学习应用均取得了新的突破，电信运营商为代表的物联网行业应用正在不断尝试推广，探索新的商业模式。本基金一方面布局参与了人工智能、云计算大数据、互联网消费金融等互联网+领域长期投资方向，另一方面重点参与了行业景气向上的苹果产业链、新能源汽车产业链等。此外根据基金合同契约规定，少部分仓位参与了符合产业逻辑的消费建材、周期行业投资机会。

下半年，市场流动性、金融监管、IPO 发行数量等均有所好转，带来市场风险偏好提升，适逢半年报业绩披露期，业绩良好的行业、个股表现突出，“一九行情”有所扩散。4 季度迎来党的十九大召开，习总书记提出新时代背景下社会主要矛盾转化为人民日益增长的美好生活需要和不平衡不充分的发展之间的矛盾。经济发展总基调由高速增 长转向高质量发展阶段，目前正处在转变方式、优化结构和转换动能的攻关期。这一最新理论为未来资本市场投资指明了方向。本基金积极应对市场变化，围绕行业景气度的持续性，重点参与了电子、新能源汽车、5G 等方向，保持了互联网领域人工智能、半导体等板块的长期配置，并根据基金合同规定部分仓位参与了消费、石油大炼化等确定性投资机会，取得了一定的投资效果。

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 1.006 元；本报告期基金份额净值增长率为 4.14%，业绩比较基准收益率为 10.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年，我们认为受全球经济复苏和国内结构性供给侧改革等因素影响，我国经济仍将保持一定增长，但 A 股盈利增速较 17 年存在放缓压力。受金融监管持续推进影响，流动性仍将保持紧平衡局面。预计市场依然以结构性行情为主。

经过 2016 年以来的震荡上行，A 股低估值蓝筹板块、龙头公司的估值水平得到了显著提升，未来主要关注其盈利增长情况。创新成长类公司经过两三年的估值消化，部分公司投资价值显现，但不论价值还是成长，选股的核心要素仍将来自行业景气度评估，或者是近期的盈利驱动、或者是政策影响下的远期盈利驱动。我们认为与 2017 年相比，市场对绝对低估值的严苛程度将有所放松，对成长性将更为关注。市场整体估值修复的完成使得 2017 年较为有效的动量策略面临挑战，反转策略则可能更为有效。我们将在行业景气评估的基础上，基于反转策略参与各阶段的投资机

会。

互联网+领域，以人工智能、工业互联网、5G 等为代表的创新技术日益成熟，对促进实体经济的效率提升，培育新经济增长点将发挥重要作用。国家和证券监管层面不断出台对创新经济的支持政策，我们认为互联网+领域将在 2018 年呈现更多投资机会。

市场风险方面，我们跟踪关注实体经济复苏的持续性，全球贸易摩擦对经济复苏进程的影响，金融监管对流动性的影响等风险。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，本基金管理人内部控制工作本着对基金份额持有人利益高度负责的精神，以独立于各业务部门的风险管理部、监察稽核部为主体，对基金销售、投资运作、后台保障等主要业务活动进行监督与控制，较好地保证了基金运作的合规性。

1、进一步完善制度建设，构建全面有效的内部控制体系

本基金管理人根据最新出台的相关法律法规，及时补充及完善了内部管理制度，同时对业务流程进一步梳理，严格按照监管要求进行风险控制评估及合规管理有效性评估，确保风险控制及合规管理的有效性，不断提升内部控制水平。

2、进一步规范基金投资管理工作流程，加强基金投资风险控制。

（1）加强基金的日常投资交易进行监控，及时提示相关风险。公司风险管理部负责基金日常投资行为的监控，并与相关基金经理沟通，提示相关风险。同时根据投委会的投资决议、政策法规规定对风险指标设置进行调整，不定期检查风险监控指标设置，并根据新的需求对风险监控指标进行测试和更新。根据证监会发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》，在 2017 年 10 月后加强了对旗下公募基金的流动性管控。另外注意对监管机构处罚信息与市场负面信息搜集，提示投研部门注意潜在风险。

（2）规范投资交易行为，防范交易环节的操作风险。公司禁止基金内的同日反向交易，严格控制旗下管理投资组合间的同日反向交易，对基金间同日同向交易、所有投资组合对单只股票成交量占其市场总成交异常等指标进行预警监控。对于日常的投资监控，公司实行的是事前控制、事中监督、事后检查的方法，在公平交易的各环节建立了责任追究制，实行各部门责任人、分管领导责任人负责制，以最大限度地监控并处置可能造成不公平交易或利益输送的行为。

3、针对基金投资运作通过日常监察与专项稽核相结合，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，通过查漏补缺、及时整改强化了风险控制流程，提高了投资管理及运营相关人员的风险意识

水平，从而较好地预防风险，维护基金持有人利益。

4、做好投研交易等人员的合规培训，提高合规意识。公司组织投研人员开展内幕交易案例合规培训，就近年来发生的典型内幕交易案例作了分类汇报，并对目前市场上的疑似内幕交易、有争议的内幕交易案例进行了说明，要求投研人员遵守投资纪律，规范决策流程，从源头避免内幕交易事件的发生，加强了投研人员的合规意识。

5、公司采用技术手段对网站、交易、行情等进行屏蔽，对其他非受控方式上网及即时通讯做出进一步规范。加强投研人员的资讯管理，本年度公司购买了手机保管箱，在保管箱上方安装了探头，对基金经理、交易人员在交易时间的移动电话、掌上电脑等移动通讯工具实行集中管理，规范了手机上交异常记录表，不定期抽查；对基金经理集中区域进行录像监控，对于证券公司的网站、网页委托进行了屏蔽，对投研人员的办公电脑安装截屏软件进行留痕处理，并对安装软件的权限进行严格限制。

在本报告期内，本基金的投资运作等各环节基本符合规定的要求，未出现异常交易、操纵市场、内幕交易等违法违规现象。今后公司将继续夯实内部控制和风险管理工作，保证基金运作的合规性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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：

张敬燕女士，硕士。2017 年加入泰信基金管理有限公司，现任公司风险管理部副总监。

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，泰信优势增长混合基金、泰信智选成长混合基金经理。

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。

4.8 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、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 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即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。

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

二、本报告期本基金未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金于 2017 年 4 月 6 日至 2017 年 6 月 29 日、2017 年 9 月 21 日至 2017 年 12 月 19 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 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”）在泰信互联网+主题灵活配置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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 21817 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金以下简称“泰信互联网+混合基金”)的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(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，公允反映了泰信互联网+混合基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

	按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于泰信互联网+混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	–
其他事项	–
其他信息	–
管理层和治理层对财务报表的责任	泰信互联网+混合基金的基金管理人泰信基金管理有限公司管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估泰信互联网+混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非管理层计划清算泰信互联网+混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。 泰信互联网+混合基金的基金管理人泰信基金管理有限公司治理层负责监督泰信互联网+混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计一定会发现存在的重大错报。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

	（三）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （四）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对泰信互联网+混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致泰信互联网+混合基金不能持续经营。 （五）评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与泰信互联网+混合基金的基金管理人泰信基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	许康玮	周祎
会计师事务所的地址	上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2018 年 3 月 29 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日： 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	10,093,009.55	2,950,122.67
结算备付金	490,146.64	1,838,157.31
存出保证金	47,861.54	61,045.23

交易性金融资产	40,124,919.40	35,431,860.80
其中：股票投资	40,124,919.40	35,431,860.80
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	1,293,536.68	19,838,234.02
应收利息	2,617.84	1,377.62
应收股利	-	-
应收申购款	309.54	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	52,052,401.19	60,120,797.65
负债和所有者权益	**本期末 2017 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	2,979,605.30
应付赎回款	981.77	-
应付管理人报酬	60,433.74	75,450.95
应付托管费	10,072.35	12,575.16
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	248,939.54	236,188.89
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	160,001.84	340,000.00
负债合计	480,429.24	3,643,820.30
所有者权益：		
实收基金	51,266,534.92	58,435,182.29
未分配利润	305,437.03	-1,958,204.94
所有者权益合计	51,571,971.95	56,476,977.35
负债和所有者权益总计	52,052,401.19	60,120,797.65

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.006 元，基金份额总额 51,266,534.92 份。

7.2 利润表

会计主体：泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期： 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	5,209,606.62	1,200,498.16
1.利息收入	198,332.86	1,204,847.81
其中：存款利息收入	78,690.07	171,856.34
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	119,642.79	1,032,991.47
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	2,804,861.89	-830,658.37
其中：股票投资收益	2,620,744.17	-846,993.37
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	184,117.72	16,335.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	2,172,745.53	-286,576.15
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	33,666.34	1,112,884.87
减：二、费用	2,663,630.07	2,409,137.67
1．管理人报酬	746,813.40	1,144,723.71
2．托管费	124,468.86	190,787.36
3．销售服务费	-	-
4．交易费用	1,628,320.63	731,410.83
5．利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6．其他费用	164,027.18	342,215.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	2,545,976.55	-1,208,639.51
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	2,545,976.55	-1,208,639.51

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	58,435,182.29	-1,958,204.94	56,476,977.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期 净利润）	-	2,545,976.55	2,545,976.55
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）	-7,168,647.37	-282,334.58	-7,450,981.95
其中：1.基金申购款	20,748,016.10	-720,942.00	20,027,074.10
2.基金赎回款	-27,916,663.47	438,607.42	-27,478,056.05
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）	51,266,534.92	305,437.03	51,571,971.95
项目	上年度可比期间 2016 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 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）	367,344,997.25	-	367,344,997.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期 净利润）	-	-1,208,639.51	-1,208,639.51
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）	-308,909,814.96	-749,565.43	-309,659,380.39
其中：1.基金申购款	552,854.96	512.56	553,367.52
2.基金赎回款	-309,462,669.92	-750,077.99	-310,212,747.91
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）	58,435,182.29	-1,958,204.94	56,476,977.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金(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”)证监许可[2015]第 2365 号《关于准予泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《泰信互联网+主题灵活配置混合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 367,151,997.29 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 761 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 6 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 367,344,997.25 份基金份额，其中认购资金利息折合 192,999.96 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(以下简称“中国银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(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 (含可转债、中小企业私募债券)、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%，投资于互联网+主题的相关证券不低于非现金基金资产的 80%。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。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%＋上证国债指数收益率×50%。

本财务报表由本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司于 2017 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 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 日及以后期间颁布的《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》、《泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券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、债券的差价收入，股票的股息、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，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。

7.4.7 关联方关系

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、登记机构、基金销售机构
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
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司
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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

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股票交易。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 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。

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本期及上年度可比期间本基金无应支付关联方佣金余额。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	746,813.40	1,144,723.71
其中：支付销售机构的客户维护费	329,355.98	397,638.46

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%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 1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	124,468.86	190,787.36

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：

日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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	上年度可比期间

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	4,964,250.25	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	4,964,250.25	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.6800%	-

注：基金管理人泰信基金管理有限公司在本年度申购本基金的交易委托管理人直销中心办理，申购费用为人民币 1,000.00 元。

7.4.8.4.2 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 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 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	8,613,742.28	16.8000%	-	-

7.4.8.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 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	10,093,009.55	62,432.04	2,950,122.67	103,173.56

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（ 2017 年 12 月 31 日 ）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 40,124,919.40 元，无属于第二层次以及第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 35,431,860.80 元，无属于第二层次以及第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)增值税

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，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。

根据财政部、国家税务总局于 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	40,124,919.40	77.09
	其中：股票	40,124,919.40	77.09
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	10,583,156.19	20.33
8	其他各项资产	1,344,325.60	2.58
9	合计	52,052,401.19	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	28,012,839.40	54.32
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	957,000.00	1.86
G	交通运输、仓储和邮政业	1,311,200.00	2.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,863,700.00	7.49
J	金融业	931,000.00	1.81
K	房地产业	2,122,500.00	4.12
L	租赁和商务服务业	1,562,880.00	3.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,363,800.00	2.64
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	40,124,919.40	77.80

8.2.2 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。

8.3 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

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	600048	保利地产	150,000	2,122,500.00	4.12
2	002027	分众传媒	111,000	1,562,880.00	3.03
3	300232	洲明科技	106,000	1,515,800.00	2.94
4	002202	金风科技	80,000	1,508,000.00	2.92
5	000786	北新建材	67,000	1,507,500.00	2.92
6	600521	华海药业	50,000	1,506,000.00	2.92
7	600487	亨通光电	37,000	1,495,540.00	2.90
8	300316	晶盛机电	70,000	1,463,700.00	2.84
9	600835	上海机电	59,300	1,452,850.00	2.82
10	600183	生益科技	80,000	1,380,800.00	2.68

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002466	天齐锂业	7,152,925.00	12.67
2	300197	铁汉生态	6,618,180.00	11.72
3	601336	新华保险	5,917,252.00	10.48
4	000786	北新建材	5,315,496.00	9.41
5	600782	新钢股份	5,276,389.00	9.34
6	600366	宁波韵升	4,536,558.00	8.03
7	000933	神火股份	4,527,709.00	8.02
8	002573	清新环境	4,460,178.40	7.90

9	603799	华友钴业	4,415,230.00	7.82
10	002859	洁美科技	4,334,689.00	7.68
11	002460	赣锋锂业	4,149,745.00	7.35
12	600048	保利地产	4,051,200.00	7.17
13	600487	亨通光电	4,045,371.00	7.16
14	002236	大华股份	4,006,380.63	7.09
15	002008	大族激光	3,926,313.00	6.95
16	600549	厦门钨业	3,867,295.00	6.85
17	002368	太极股份	3,767,771.14	6.67
18	600110	诺德股份	3,721,631.00	6.59
19	002456	欧菲光	3,683,409.00	6.52
20	000002	万科 A	3,663,584.00	6.49
21	300232	洲明科技	3,646,747.00	6.46
22	002049	紫光国芯	3,591,071.00	6.36
23	600491	龙元建设	3,469,546.00	6.14
24	601233	桐昆股份	3,435,415.00	6.08
25	002709	天赐材料	3,402,995.00	6.03
26	600536	中国软件	3,328,394.00	5.89
27	600029	南方航空	3,200,840.57	5.67
28	603019	中科曙光	3,167,257.00	5.61
29	300367	东方网力	3,007,952.00	5.33
30	600019	宝钢股份	2,875,764.10	5.09
31	300355	蒙草生态	2,855,362.40	5.06
32	300316	晶盛机电	2,846,862.00	5.04
33	000807	云铝股份	2,843,258.00	5.03
34	300433	蓝思科技	2,797,500.00	4.95
35	300450	先导智能	2,793,935.00	4.95
36	600874	创业环保	2,790,767.94	4.94
37	600884	杉杉股份	2,789,984.47	4.94
38	000768	中航飞机	2,788,801.16	4.94
39	601668	中国建筑	2,756,723.00	4.88
40	002717	岭南园林	2,721,252.00	4.82
41	600419	天润乳业	2,688,547.00	4.76
42	000970	中科三环	2,677,658.79	4.74
43	601166	兴业银行	2,645,762.00	4.68
44	600803	新奥股份	2,632,628.00	4.66

45	300481	濮阳惠成	2,616,818.20	4.63
46	000709	河钢股份	2,593,112.00	4.59
47	601952	苏垦农发	2,589,900.00	4.59
48	600990	四创电子	2,579,157.00	4.57
49	600388	龙净环保	2,562,577.36	4.54
50	600183	生益科技	2,557,219.20	4.53
51	002837	英维克	2,539,622.00	4.50
52	300336	新文化	2,521,645.00	4.46
53	000001	平安银行	2,499,783.49	4.43
54	300166	东方国信	2,462,489.40	4.36
55	600703	三安光电	2,447,500.00	4.33
56	002635	安洁科技	2,441,353.00	4.32
57	300098	高新兴	2,438,660.00	4.32
58	600585	海螺水泥	2,434,462.28	4.31
59	300170	汉得信息	2,414,532.74	4.28
60	000049	德赛电池	2,405,039.40	4.26
61	002217	合力泰	2,398,459.00	4.25
62	002019	亿帆医药	2,377,679.98	4.21
63	000050	深天马 A	2,355,237.00	4.17
64	600028	中国石化	2,348,054.95	4.16
65	300429	强力新材	2,298,010.00	4.07
66	300038	梅泰诺	2,290,900.00	4.06
67	002273	水晶光电	2,252,762.00	3.99
68	002517	恺英网络	2,232,713.42	3.95
69	002457	青龙管业	2,219,837.00	3.93
70	300425	环能科技	2,205,438.00	3.91
71	300604	长川科技	2,174,800.00	3.85
72	000977	浪潮信息	2,141,073.40	3.79
73	002371	北方华创	2,140,900.00	3.79
74	300502	新易盛	2,137,893.00	3.79
75	603993	洛阳钼业	2,127,800.00	3.77
76	600050	中国联通	2,126,600.00	3.77
77	000066	中国长城	2,117,597.00	3.75
78	002036	联创电子	2,084,436.00	3.69
79	002531	天顺风能	2,082,236.00	3.69
80	600588	用友网络	2,013,290.00	3.56

81	600346	恒力股份	1,952,930.70	3.46
82	600438	通威股份	1,913,284.00	3.39
83	300409	道氏技术	1,910,877.00	3.38
84	300224	正海磁材	1,902,457.50	3.37
85	002304	洋河股份	1,878,557.30	3.33
86	300083	劲胜智能	1,823,916.00	3.23
87	300570	太辰光	1,807,200.00	3.20
88	601888	中国国旅	1,772,000.00	3.14
89	601111	中国国航	1,737,321.00	3.08
90	600718	东软集团	1,735,496.00	3.07
91	002343	慈文传媒	1,724,215.00	3.05
92	300034	钢研高纳	1,666,416.11	2.95
93	601628	中国人寿	1,663,736.00	2.95
94	600409	三友化工	1,657,200.00	2.93
95	300061	康旗股份	1,653,119.00	2.93
96	600383	金地集团	1,652,400.00	2.93
97	600176	中国巨石	1,646,700.00	2.92
98	000728	国元证券	1,626,730.00	2.88
99	002310	东方园林	1,611,148.00	2.85
100	600966	博汇纸业	1,610,280.00	2.85
101	603589	口子窖	1,597,000.00	2.83
102	300302	同有科技	1,580,664.02	2.80
103	600584	长电科技	1,576,139.00	2.79
104	300284	苏交科	1,562,035.50	2.77
105	300628	亿联网络	1,553,887.68	2.75
106	002125	湘潭电化	1,553,727.00	2.75
107	000603	盛达矿业	1,551,010.00	2.75
108	000825	太钢不锈	1,550,000.00	2.74
109	601881	中国银河	1,549,096.00	2.74
110	600076	康欣新材	1,539,562.00	2.73
111	603358	华达科技	1,536,364.00	2.72
112	600809	山西汾酒	1,533,600.00	2.72
113	601012	隆基股份	1,529,513.00	2.71
114	000708	大冶特钢	1,526,991.00	2.70
115	300059	东方财富	1,519,200.00	2.69
116	002405	四维图新	1,505,919.50	2.67

117	002027	分众传媒	1,495,040.00	2.65
118	000898	鞍钢股份	1,485,000.00	2.63
119	600216	浙江医药	1,483,318.00	2.63
120	000783	长江证券	1,469,953.00	2.60
121	300377	赢时胜	1,467,900.00	2.60
122	600521	华海药业	1,465,000.00	2.59
123	600038	中直股份	1,462,950.00	2.59
124	600326	西藏天路	1,458,400.00	2.58
125	002463	沪电股份	1,450,800.00	2.57
126	000732	泰禾集团	1,447,960.00	2.56
127	601939	建设银行	1,443,950.00	2.56
128	600835	上海机电	1,437,478.00	2.55
129	002024	苏宁云商	1,430,359.00	2.53
130	300496	中科创达	1,424,800.00	2.52
131	300357	我武生物	1,423,944.00	2.52
132	002823	凯中精密	1,422,556.00	2.52
133	601717	郑煤机	1,421,237.00	2.52
134	600352	浙江龙盛	1,421,132.00	2.52
135	601901	方正证券	1,420,200.00	2.51
136	002496	辉丰股份	1,414,800.00	2.51
137	000651	格力电器	1,409,500.00	2.50
138	600406	国电南瑞	1,408,110.00	2.49
139	600963	岳阳林纸	1,400,676.00	2.48
140	300244	迪安诊断	1,390,308.00	2.46
141	601128	常熟银行	1,390,000.00	2.46
142	002202	金风科技	1,389,341.00	2.46
143	600271	航天信息	1,388,000.00	2.46
144	600104	上汽集团	1,387,082.00	2.46
145	603636	南威软件	1,379,390.00	2.44
146	300078	思创医惠	1,378,895.00	2.44
147	600362	江西铜业	1,374,584.00	2.43
148	002350	北京科锐	1,370,255.00	2.43
149	002493	荣盛石化	1,367,431.00	2.42
150	601908	京运通	1,363,620.00	2.41
151	600525	长园集团	1,351,363.60	2.39
152	600068	葛洲坝	1,351,200.00	2.39

153	600233	圆通速递	1,346,243.00	2.38
154	000671	阳光城	1,335,600.00	2.36
155	600528	中铁工业	1,328,821.00	2.35
156	600114	东睦股份	1,324,121.68	2.34
157	600661	新南洋	1,320,000.00	2.34
158	600801	华新水泥	1,316,520.00	2.33
159	000100	TCL 集团	1,315,825.88	2.33
160	002696	百洋股份	1,313,367.00	2.33
161	300373	扬杰科技	1,310,933.00	2.32
162	603308	应流股份	1,307,386.00	2.31
163	600500	中化国际	1,303,200.00	2.31
164	002384	东山精密	1,302,000.00	2.31
165	600219	南山铝业	1,291,875.00	2.29
166	000661	长春高新	1,288,543.40	2.28
167	601989	中国重工	1,286,200.00	2.28
168	600153	建发股份	1,283,600.00	2.27
169	600291	西水股份	1,283,486.00	2.27
170	600827	百联股份	1,283,481.00	2.27
171	000426	兴业矿业	1,282,930.00	2.27
172	002829	星网宇达	1,280,066.46	2.27
173	000703	恒逸石化	1,278,785.00	2.26
174	600270	外运发展	1,276,700.00	2.26
175	002396	星网锐捷	1,271,245.46	2.25
176	002258	利尔化学	1,270,616.00	2.25
177	000983	西山煤电	1,258,321.00	2.23
178	002157	正邦科技	1,255,200.00	2.22
179	002001	新和成	1,249,837.00	2.21
180	300369	绿盟科技	1,245,783.02	2.21
181	300545	联得装备	1,245,750.00	2.21
182	600446	金证股份	1,244,885.00	2.20
183	002222	福晶科技	1,226,976.00	2.17
184	300027	华谊兄弟	1,224,300.00	2.17
185	002690	美亚光电	1,218,000.00	2.16
186	600486	扬农化工	1,215,153.80	2.15
187	601222	林洋能源	1,214,500.00	2.15
188	300236	上海新阳	1,212,478.80	2.15

189	300226	上海钢联	1,207,440.00	2.14
190	600008	首创股份	1,206,400.00	2.14
191	000921	海信科龙	1,204,175.44	2.13
192	002431	棕榈股份	1,203,179.00	2.13
193	600054	黄山旅游	1,196,736.00	2.12
194	601398	工商银行	1,182,000.00	2.09
195	002510	天汽模	1,178,800.00	2.09
196	603040	新坐标	1,174,500.00	2.08
197	600096	云天化	1,165,749.00	2.06
198	000596	古井贡酒	1,158,000.00	2.05
199	600820	隧道股份	1,152,300.00	2.04
200	300424	航新科技	1,151,363.00	2.04
201	002798	帝王洁具	1,133,000.00	2.01

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。

8.4.2 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	002466	天齐锂业	7,343,520.85	13.00
2	300197	铁汉生态	6,571,927.00	11.64
3	601336	新华保险	5,907,857.09	10.46
4	002456	欧菲光	5,473,359.14	9.69
5	300316	晶盛机电	5,453,083.99	9.66
6	600782	新钢股份	5,159,833.41	9.14
7	603799	华友钴业	4,946,856.00	8.76
8	002460	赣锋锂业	4,814,067.00	8.52
9	000933	神火股份	4,750,313.00	8.41
10	600366	宁波韵升	4,574,561.00	8.10
11	002859	洁美科技	4,399,789.00	7.79
12	000786	北新建材	4,279,240.00	7.58
13	002236	大华股份	4,114,985.00	7.29
14	600549	厦门钨业	4,110,804.60	7.28
15	600803	新奥股份	4,037,774.00	7.15
16	002008	大族激光	4,004,042.00	7.09
17	002049	紫光国芯	3,852,332.00	6.82

18	600110	诺德股份	3,612,343.33	6.40
19	000807	云铝股份	3,573,231.00	6.33
20	600028	中国石化	3,566,931.80	6.32
21	601233	桐昆股份	3,533,587.00	6.26
22	002368	太极股份	3,528,320.00	6.25
23	000002	万科 A	3,496,208.00	6.19
24	600491	龙元建设	3,454,389.14	6.12
25	002573	清新环境	3,444,485.00	6.10
26	603019	中科曙光	3,405,148.32	6.03
27	600884	杉杉股份	3,176,716.00	5.62
28	300367	东方网力	3,079,719.00	5.45
29	300450	先导智能	3,052,665.00	5.41
30	600536	中国软件	3,007,906.38	5.33
31	300377	赢时胜	2,989,362.00	5.29
32	300355	蒙草生态	2,976,979.60	5.27
33	002383	合众思壮	2,936,400.00	5.20
34	600019	宝钢股份	2,928,600.00	5.19
35	300433	蓝思科技	2,885,020.00	5.11
36	300232	洲明科技	2,847,918.00	5.04
37	000709	河钢股份	2,766,000.00	4.90
38	600487	亨通光电	2,748,815.00	4.87
39	000768	中航飞机	2,737,221.00	4.85
40	601166	兴业银行	2,726,381.00	4.83
41	002837	英维克	2,703,563.00	4.79
42	600596	新安股份	2,681,361.00	4.75
43	002829	星网宇达	2,661,069.60	4.71
44	002717	岭南园林	2,655,943.00	4.70
45	601668	中国建筑	2,641,400.00	4.68
46	000970	中科三环	2,608,538.00	4.62
47	600419	天润乳业	2,592,674.00	4.59
48	600874	创业环保	2,579,773.00	4.57
49	300336	新文化	2,545,869.00	4.51
50	002019	亿帆医药	2,543,427.17	4.50
51	601952	苏垦农发	2,540,794.00	4.50
52	300340	科恒股份	2,525,756.00	4.47
53	002078	太阳纸业	2,475,763.00	4.38
54	600990	四创电子	2,472,231.00	4.38
55	300061	康旗股份	2,470,934.64	4.38

56	300170	汉得信息	2,452,390.60	4.34
57	300038	梅泰诺	2,420,649.00	4.29
58	300481	濮阳惠成	2,410,786.00	4.27
59	600820	隧道股份	2,396,365.00	4.24
60	600585	海螺水泥	2,392,477.00	4.24
61	000049	德赛电池	2,381,665.00	4.22
62	002635	安洁科技	2,376,018.00	4.21
63	600588	用友网络	2,375,000.00	4.21
64	002517	恺英网络	2,359,720.00	4.18
65	600703	三安光电	2,341,600.00	4.15
66	002217	合力泰	2,339,225.36	4.14
67	000050	深天马 A	2,328,000.00	4.12
68	002709	天赐材料	2,313,150.00	4.10
69	300078	思创医惠	2,299,344.55	4.07
70	002457	青龙管业	2,267,637.00	4.02
71	002273	水晶光电	2,254,579.00	3.99
72	300429	强力新材	2,197,195.00	3.89
73	300502	新易盛	2,195,041.00	3.89
74	300425	环能科技	2,170,083.46	3.84
75	002036	联创电子	2,167,178.00	3.84
76	000977	浪潮信息	2,140,000.00	3.79
77	002304	洋河股份	2,123,471.00	3.76
78	603993	洛阳钼业	2,110,800.00	3.74
79	000066	中国长城	2,064,046.85	3.65
80	600048	保利地产	2,025,100.00	3.59
81	300098	高新兴	2,005,493.13	3.55
82	300409	道氏技术	1,961,726.00	3.47
83	600809	山西汾酒	1,947,700.00	3.45
84	600050	中国联通	1,944,900.00	3.44
85	600438	通威股份	1,943,041.00	3.44
86	600029	南方航空	1,942,754.00	3.44
87	600346	恒力股份	1,913,363.78	3.39
88	300604	长川科技	1,912,536.00	3.39
89	300083	劲胜智能	1,895,327.00	3.36
90	601111	中国国航	1,866,900.00	3.31
91	600966	博汇纸业	1,771,678.43	3.14
92	601888	中国国旅	1,767,000.00	3.13
93	601628	中国人寿	1,760,110.18	3.12

94	600718	东软集团	1,729,100.00	3.06
95	000001	平安银行	1,725,217.89	3.05
96	000822	山东海化	1,721,084.20	3.05
97	002343	慈文传媒	1,718,601.00	3.04
98	601717	郑煤机	1,714,700.00	3.04
99	300224	正海磁材	1,713,600.00	3.03
100	600176	中国巨石	1,699,343.64	3.01
101	000728	国元证券	1,698,716.00	3.01
102	600383	金地集团	1,670,011.00	2.96
103	600076	康欣新材	1,657,467.93	2.93
104	600409	三友化工	1,648,800.00	2.92
105	600584	长电科技	1,645,673.00	2.91
106	603678	火炬电子	1,642,080.00	2.91
107	300166	东方国信	1,615,809.00	2.86
108	002493	荣盛石化	1,613,889.00	2.86
109	002463	沪电股份	1,597,872.64	2.83
110	000018	神州长城	1,595,400.00	2.82
111	300284	苏交科	1,584,691.80	2.81
112	000825	太钢不锈	1,584,550.00	2.81
113	300302	同有科技	1,570,316.00	2.78
114	002310	东方园林	1,568,405.00	2.78
115	600406	国电南瑞	1,562,831.53	2.77
116	300011	鼎汉技术	1,561,900.00	2.77
117	600525	长园集团	1,555,500.00	2.75
118	603589	口子窖	1,538,498.00	2.72
119	000059	华锦股份	1,535,124.00	2.72
120	601881	中国银河	1,534,459.00	2.72
121	300628	亿联网络	1,533,600.00	2.72
122	300570	太辰光	1,533,120.00	2.71
123	000708	大冶特钢	1,530,900.00	2.71
124	600104	上汽集团	1,526,100.00	2.70
125	000783	长江证券	1,512,000.00	2.68
126	600183	生益科技	1,510,575.20	2.67
127	600963	岳阳林纸	1,510,011.50	2.67
128	002405	四维图新	1,508,400.00	2.67
129	000603	盛达矿业	1,506,290.00	2.67
130	000898	鞍钢股份	1,500,286.00	2.66
131	601939	建设银行	1,486,250.00	2.63

132	002024	苏宁云商	1,472,300.00	2.61
133	600326	西藏天路	1,467,000.00	2.60
134	601901	方正证券	1,454,770.00	2.58
135	000732	泰禾集团	1,454,711.00	2.58
136	600528	中铁工业	1,451,954.65	2.57
137	000661	长春高新	1,441,943.80	2.55
138	000651	格力电器	1,440,221.36	2.55
139	002125	湘潭电化	1,439,648.00	2.55
140	300496	中科创达	1,427,124.00	2.53
141	002823	凯中精密	1,421,495.00	2.52
142	300034	钢研高纳	1,417,333.22	2.51
143	002496	辉丰股份	1,410,000.00	2.50
144	600352	浙江龙盛	1,404,000.00	2.49
145	600801	华新水泥	1,390,300.00	2.46
146	300244	迪安诊断	1,384,843.00	2.45
147	601128	常熟银行	1,382,470.00	2.45
148	300357	我武生物	1,379,408.00	2.44
149	600153	建发股份	1,375,508.00	2.44
150	600114	东睦股份	1,371,080.00	2.43
151	300424	航新科技	1,367,370.00	2.42
152	600362	江西铜业	1,366,700.00	2.42
153	603358	华达科技	1,362,459.00	2.41
154	603308	应流股份	1,351,089.00	2.39
155	600233	圆通速递	1,347,203.00	2.39
156	002350	北京科锐	1,336,800.00	2.37
157	002696	百洋股份	1,335,870.00	2.37
158	600388	龙净环保	1,334,508.00	2.36
159	600500	中化国际	1,320,751.00	2.34
160	600661	新南洋	1,315,299.00	2.33
161	002396	星网锐捷	1,313,597.40	2.33
162	600038	中直股份	1,311,000.00	2.32
163	002510	天汽模	1,310,400.00	2.32
164	603636	南威软件	1,295,247.00	2.29
165	002384	东山精密	1,292,044.00	2.29
166	600068	葛洲坝	1,288,998.00	2.28
167	002371	北方华创	1,281,654.00	2.27
168	000596	古井贡酒	1,280,000.00	2.27
169	600270	外运发展	1,279,702.82	2.27

170	000100	TCL 集团	1,279,000.00	2.26
171	002258	利尔化学	1,267,402.00	2.24
172	601908	京运通	1,259,297.00	2.23
173	000830	鲁西化工	1,254,042.00	2.22
174	000997	新大陆	1,248,625.00	2.21
175	600219	南山铝业	1,245,000.00	2.20
176	002157	正邦科技	1,242,800.00	2.20
177	000930	中粮生化	1,242,338.00	2.20
178	600054	黄山旅游	1,239,800.00	2.20
179	002001	新和成	1,238,758.00	2.19
180	000983	西山煤电	1,226,000.00	2.17
181	300373	扬杰科技	1,220,892.00	2.16
182	300027	华谊兄弟	1,212,700.00	2.15
183	002222	福晶科技	1,207,284.00	2.14
184	601398	工商银行	1,203,000.00	2.13
185	600486	扬农化工	1,199,220.00	2.12
186	300298	三诺生物	1,197,573.00	2.12
187	600291	西水股份	1,197,168.00	2.12
188	000426	兴业矿业	1,186,000.00	2.10
189	603040	新坐标	1,185,000.00	2.10
190	300226	上海钢联	1,184,921.10	2.10
191	002690	美亚光电	1,174,598.00	2.08
192	000921	海信科龙	1,172,457.00	2.08
193	300545	联得装备	1,167,631.00	2.07
194	600827	百联股份	1,163,473.00	2.06
195	000671	阳光城	1,162,060.00	2.06
196	600008	首创股份	1,161,800.00	2.06
197	600446	金证股份	1,159,351.00	2.05
198	600332	白云山	1,158,425.00	2.05
199	601198	东兴证券	1,155,397.69	2.05
200	300369	绿盟科技	1,153,365.00	2.04
201	601222	林洋能源	1,152,900.00	2.04
202	603337	杰克股份	1,137,600.00	2.01
203	000776	广发证券	1,132,065.00	2.00

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。

8.4.3 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	539,778,856.43
卖出股票收入（成交）总额	539,879,287.53

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未投资债券。

8.6 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

报告期末本基金未投资债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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

本报告期末本基金未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	47,861.54
2	应收证券清算款	1,293,536.68
3	应收股利	-
4	应收利息	2,617.84
5	应收申购款	309.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,344,325.60

8.12.4 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处于转股期的可转换债券。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
563	91,059.56	13,577,992.53	26.49%	37,688,542.39	73.51%

9.3 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	62,508.56	0.1219%

9.4 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。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2016 年 6 月 8 日 ）基金份额总额	367,344,997.25
本报告期期初基金份额总额	58,435,182.29
本报告期基金总申购份额	20,748,016.10
减:本报告期基金总赎回份额	27,916,663.47
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	51,266,534.92

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

1、2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2、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；自 2017 年 7 月 17 日起，万众先生担任泰信基金管理有限公司董事长职务；公司于 2017 年 9 月 22 日发布公告，公司法定代表人变更为万众先生。上述管理人重大人事变动在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站上披露，并报监管机构备案。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

公司与万科企业股份有限公司工会委员会就泰信价值 1 号诉讼一案，深圳市罗湖区人民法院于 2017 年 7 月 10 日作出民事裁定书，准许原告万科企业股份有限公司工委会撤回起诉并结案。

本报告期无涉及基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费为人民币 6 万元。该审计机构从基金合同生效日（2016 年 6 月 8 日）开始为本基金提供审计服务。

11.6 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、托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
国联证券	1	279,765,349.98	25.91%	260,546.65	26.25%	-
华泰证券	1	200,342,700.18	18.56%	182,572.32	18.39%	-
华金证券	1	156,197,957.10	14.47%	142,343.15	14.34%	-
东方证券	1	121,973,947.76	11.30%	111,154.74	11.20%	-
中国建银投资证券	2	52,648,343.87	4.88%	47,978.46	4.83%	-
招商证券	1	49,404,291.41	4.58%	45,022.21	4.54%	-
中银国际	3	40,553,083.18	3.76%	37,766.88	3.80%	-
西南证券	1	39,622,937.68	3.67%	36,901.09	3.72%	-
安信证券	3	37,463,473.69	3.47%	34,889.69	3.51%	-
长江证券	1	31,596,874.95	2.93%	28,794.38	2.90%	-
国泰君安	1	28,652,729.78	2.65%	26,111.06	2.63%	-
中信建投	2	25,482,453.93	2.36%	23,731.94	2.39%	-
广发证券	2	15,954,000.45	1.48%	14,857.90	1.50%	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	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	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

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、本报告期内本基金新增交易单元：华金证券深圳 000481、中银国际上海 37925、川财证券深圳 003701；退租交易单元：中投证券上海 392094。

11.7.2 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
国联证券	-	-	514,000,000.00	55.45%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中国建银投资	-	-	-	-	-	-

证券						
招商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	275,000,000.00	29.67%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	138,000,000.00	14.89%	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

泰信基金管理有限公司
2018 年 3 月 29 日