泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金2017年半年度报告
摘要

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017年8月26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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰信基本面 400 指数分级		
场内简称	泰信 400		
基金主代码	162907		
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）		
基金合同生效日	2012 年 9 月 7 日		
基金管理人	泰信基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	71,691,923.91 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012 年 9 月 21 日		
下属分级基金的基金简称	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
下属分级基金场内简称:	泰信 400A	泰信 400B	泰信 400
下属分级基金的交易代码	150094	150095	162907
报告期末下属分级基金份额总额	4,700,830.00 份	4,700,830.00 份	62,290,263.91 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对中证锐联基本面 400 指数的有效跟踪。		
投资策略	本基金主要采用完全复制法，按照在中证锐联基本面 400 指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合和跟踪中证锐联基本面 400 指数的收益表现，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	95%×中证锐联基本面 400 指数收益率＋5%×商业银行人民币活期存款利率（税后）		
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。		
下属三级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。	高风险、高预期收益。	较高风险、较高预期收益。

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	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	胡囡	郭明
	联系电话	021-20899098	（010）66105799
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-5988	95588
传真		021-20899008	（010）66105798

2.4 信息披露方式

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

§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	-517,734.01
本期利润	49,016.05
加权平均基金份额本期利润	0.0008
本期基金份额净值增长率	-0.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.2768
期末基金资产净值	52,919,290.70
期末基金份额净值	0.738

注：1、本基金基金合同于2012年9月7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

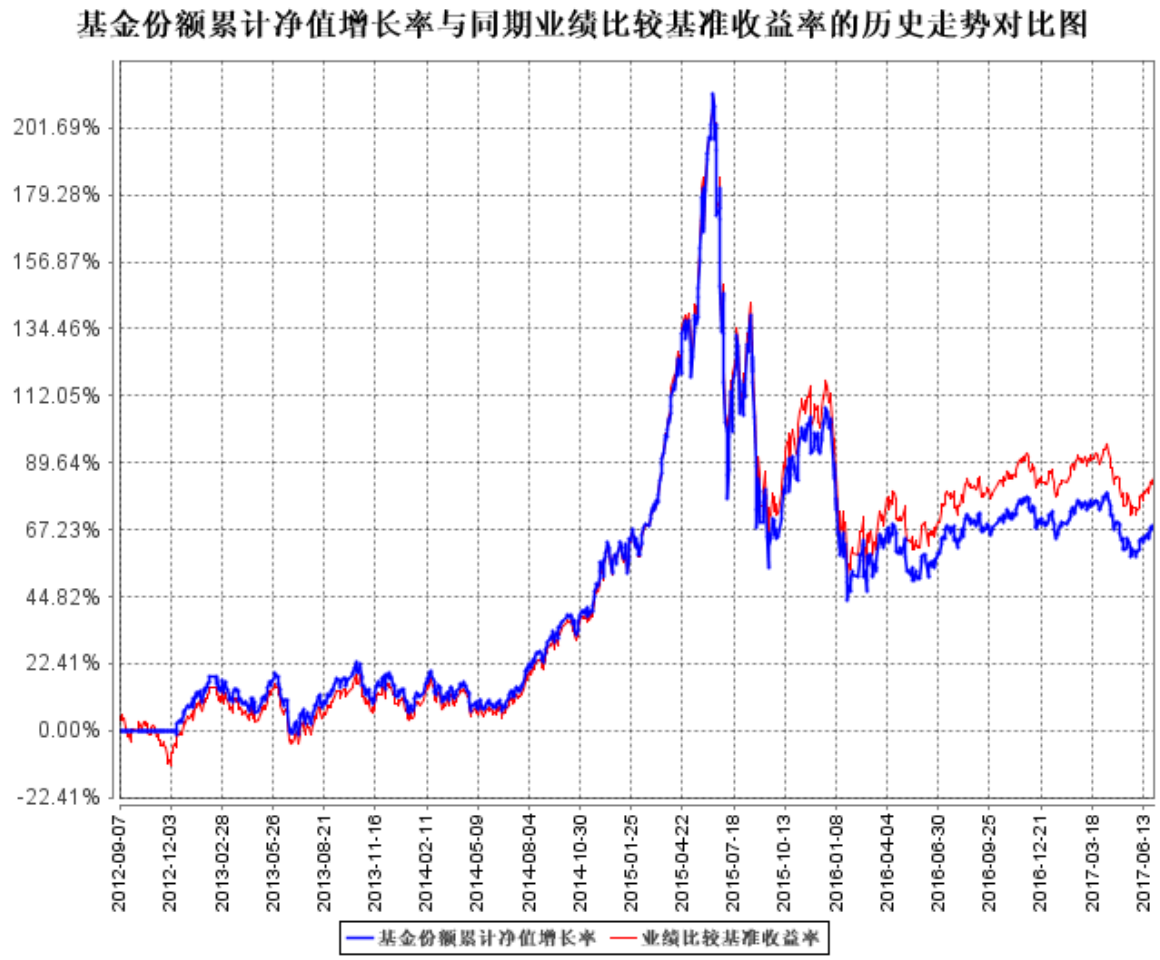
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.28%	0.75%	5.47%	0.81%	-0.19%	-0.06%
过去三个月	-3.15%	0.88%	-2.76%	0.92%	-0.39%	-0.04%
过去六个月	-0.14%	0.79%	0.83%	0.81%	-0.97%	-0.02%
过去一年	5.82%	0.82%	8.34%	0.84%	-2.52%	-0.02%
过去三年	52.29%	1.99%	69.35%	1.98%	-17.06%	0.01%
自基金合同生效起至今	68.87%	1.74%	84.29%	1.76%	-15.42%	-0.02%

注：本基金业绩比较基准为：95%×中证锐联基本面 400 指数收益率＋5%×商业银行人民币活期存款利率（税后）

中证锐联基本面 400 指数以沪深A股为样本空间，挑选基本面价值中间的第 201 家至第 600 家上市公司作为样本股，基本面价值由四个财务指标来衡量：营业收入、现金流、净资产和分红；样本股的权重配置由基本面价值决定，在一定程度上打破了样本市值与其权重之间的关联，避免了传统市值指数中过多配置高估股票的现象。

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 2012 年 9 月 7 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。本基金投资于中证锐联基本面 400 指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%；现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

§4 管理人报告

4.1 基金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		
张彦先生	本基金经理兼泰信中证 200 指数基金经理	2015 年 1 月 6 日	-	11 年	研究生硕士。具有基金从业资格。曾任职于国金证券研究所、上海从容投资管理有限公司、万家基金管理有限公司。2011 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，担任高级研究员。自 2011 年 10 月至 2014 年 5 月任泰信中小盘精选基金经理助理。

					2012 年 4 月至 2015 年 1 月任泰信优势增长混合基金经理助理 自 2015 年 1 月 6 日起同时兼任泰信中证 200 指数基金经理。

注：1、以上日期均是指公司公告的日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信中证锐利基本面 400 指数分级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 A 股市场呈现宽幅震荡的态势，上证综指上涨 3.11%。在经济增速降缓，货币政策中性偏紧，金融严监管去杠杆发力的背景下，以中证 100、上证 50 为代表的大盘蓝筹指数引领市场，涨幅高达 15%，而创业板受金融去杠杆冲击下跌 7.21%，市场分化显著。估值较为安全、业绩增长较为确定的价值蓝筹股投资机会相对突出

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 1.12%。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份额净值为 0.738 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.14%，业绩比较基准收益率为 0.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，预计继续呈现宽幅震荡的态势，市场以结构性机会为主。

最新公布的经济数据显示，中国上半年经济表现优异，二季度 GDP 达到 6.9%，与一季度持平。7 月制造业 PMI 为 51.4，较上月小幅回落 0.3，连续 12 个月位于扩张区间。非制造业 PMI 商务活动指数为 54.5，依旧维持高位。各项数据显示经济复苏仍在持续。

但是国内经济持续企稳，主要体现在“供给端收缩背景下的价格因素的上涨”。经济去杠杆继续的背景下，经济新周期开启的判断为时过早。我们预判本轮国内经济回升的持续性相对较为有限。

伴随着经济韧性，市场之前悲观预期开始扭转。但是欧美经济温和复苏使全球流动性收紧的总体趋势并未改变。在维持金融稳定上升为国家安全的导向下，货币政策在一段时间之内仍会紧平衡。经济启稳的背景更有助于国内金融监管坚定不移的推进。“金融监管，金融降杠杆，金融反腐”大环境仍是当前金融市场的主要特征。下半年，对金融去杠杆仍不能掉以轻心。因此，下半年市场仍然难摆脱震荡的特征，仍体现为结构性机会。

作为指数分级型基金产品，我们将坚持指数化投资策略，严格控制基金相对目标指数（基本面 400 指数）的偏离度，跟踪市场趋势，使得投资者可以清晰地把握分级子基金的交易情况，把

握住投资时机。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。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

在基金存续期内，本基金（包括泰信基本面400份额、泰信基本面400A份额、泰信基本面400B份额）不进行收益分配。

4.8 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2017年1月3日-2017年2月28日、2017年3月2日-2017年3月31日、2017年4月10日-2017年6月29日本基金资产净值低于五千万元。

§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，本基金托管人在对泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金的管理人——泰信基金管理有限公司在泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对泰信基金管理有限公司编制和披露的泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金
报告截止日： 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	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	2,867,495.77	2,791,914.43
结算备付金	-	77,523.19
存出保证金	2,761.85	5,239.16
交易性金融资产	41,316,371.46	41,414,118.99
其中：股票投资	41,316,371.46	41,414,118.99
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	-	-
应收利息	481.23	559.34
应收股利	-	-
应收申购款	8,987,047.81	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	53,174,158.12	44,289,355.11
负债和所有者权益	**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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	51,201.08	1,222.79
应付管理人报酬	34,936.57	38,790.64
应付托管费	7,686.05	8,533.92
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	20,264.46	15,084.36
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	140,779.26	276,056.27
负债合计	254,867.42	339,687.98
所有者权益：		
实收基金	31,423,103.33	26,069,783.67
未分配利润	21,496,187.37	17,879,883.46
所有者权益合计	52,919,290.70	43,949,667.13
负债和所有者权益总计	53,174,158.12	44,289,355.11

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之基础份额净值 0.738 元，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 A 份额净值 1.024 元，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 B 份额净值 0.452 元；基金份额总额 71,691,923.91 份，其中泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之基础份额 62,290,263.91 份，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 A 份额 4,700,830.00 份，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 B 份额 4,700,830.00 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金
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	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入	514,808.75	-11,477,971.13
1.利息收入	13,264.67	15,123.56
其中：存款利息收入	13,264.67	15,123.56
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）	-84,409.62	-6,724,971.37
其中：股票投资收益	-398,766.31	-7,073,228.69
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	314,356.69	348,257.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	566,750.06	-4,811,416.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	19,203.64	43,292.97
减：二、费用	465,792.70	636,861.94
1．管理人报酬	222,136.36	247,905.46
2．托管费	48,870.00	54,539.25
3．销售服务费	-	-
4．交易费用	38,137.38	136,323.24
5．利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6．其他费用	156,648.96	198,093.99
三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列）	49,016.05	-12,114,833.07
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	49,016.05	-12,114,833.07

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金
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（基金净值）	26,069,783.67	17,879,883.46	43,949,667.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	49,016.05	49,016.05
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）	5,353,319.66	3,567,287.86	8,920,607.52
其中：1.基金申购款	14,248,772.89	10,225,957.79	24,474,730.68
2.基金赎回款	-8,895,453.23	-6,658,669.93	-15,554,123.16
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）	31,423,103.33	21,496,187.37	52,919,290.70
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）	28,455,925.47	28,715,823.14	57,171,748.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-12,114,833.07	-12,114,833.07
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）	-886,856.50	-289,729.06	-1,176,585.56
其中：1.基金申购款	27,120,282.44	16,735,446.00	43,855,728.44
2.基金赎回款	-28,007,138.94	-17,025,175.06	-45,032,314.00
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）	27,569,068.97	16,311,261.01	43,880,329.98

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

泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金(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□[2012]第 252 号《关于核准泰信中证锐联基本面 400 指数分级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《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约开放型，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 300,797,873.45 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(2012)第 346 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 9 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 300,843,720.90 份，其中认购资金利息折合 45,847.45 份。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的基金份额包括泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“泰信基本面 400 份额”)、泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“泰信基本面 400A 份额”)与泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“泰信基本面 400B 份额”)。其中，泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比率不变。

在泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400 份额存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日，本基金将根据基金合同的规定进行基金的定期份额折算。泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行参考净值计算，对泰信基本面 400A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份泰信基本面 400 份额将按 1 份泰信基本面 400A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于泰信基本面 400A 份额期末的约定应得收益，即泰信基本面 400A 份额每个会计年度 12 月 31 日份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内泰信基本面 400 份额分配给泰信基本面 400A 份额持有人。泰信基本面 400 份额持有人持有的每 2 份泰信基本面 400 份额将按 1 份泰信基本面 400A 份额获得新增泰信基本面 400 份额的分配。持有场外泰信基本面 400 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外泰信基

本面 400 份额的分配；持有场内泰信基本面 400 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内泰信基本面 400 份额的分配。经过上述份额折算，泰信基本面 400A 份额的基金份额参考净值和泰信基本面 400 份额的基金份额净值将相应调整。每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400 份额进行应得收益的定期份额折算。

除以上定期份额折算外，本基金根据基金合同规定，还将在以下两种情况进行份额折算，即：当泰信基本面 400 份额的基金份额净值达到 2.000 元；当泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元。当泰信基本面 400 份额的基金份额净值达到 2.000 元后，本基金将分别对泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额和泰信基本面 400 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的比例为 1:1，份额折算后泰信基本面 400 份额的基金份额净值、泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值均调整为 1 元。当泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元后，本基金将分别对泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额和泰信基本面 400 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的比例为 1：1，份额折算后泰信基本面 400 份额的基金份额净值、泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

泰信基本面 400 份额设置单独的基金代码，但不上市交易。泰信基本面 400A 份额与泰信基本面 400B 份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于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。其中，中证锐联基本面 400 指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的标的指数是中证锐联基本面 400 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》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

证锐联基本面 400 指数分级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 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.5 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。

(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，股票的股息、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。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

本报告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。

6.4.7.1.2 债券交易

本报告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。

6.4.7.1.3 债券回购交易

本报告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。

6.4.7.1.4 权证交易

本报告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。

6.4.7.1.5 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。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 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	222,136.36	247,905.46
其中：支付销售机构的客户维护费	18,613.01	23,966.35

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 1.0%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×1.00% / 当年天数。

6.4.7.2.2 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	48,870.00	54,539.25

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22%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×0.22% / 当年天数。

6.4.7.2.3 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。

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
基金合同生效日（2012 年 9 月 7 日）持有的基金份额	-	-	-

期初持有的基金份额	-	-	11,611,612.90
期间申购/买入总份额	-	-	12,010,284.02
期间因拆分变动份额	-	-	388,964.37
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	24,010,861.29
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	33.4900%

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
基金合同生效日（2012年9月7日）持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-
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	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-

注：基金管理人泰信基金管理有限公司在上半年度申购本基金的交易委托管理人直销中心办理。

根据《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金招募说明书》相关约定，持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

6.4.7.4.2 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

泰信基本面 400				
关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 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	29,104,230.83	40.6000%	24,237,971.33	42.1100%

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方中山东省国际信托股份有限公司于本期末持有本基金

份额，其持有的份额为泰信基本面 400 份额。对于分级基金，比例的分母采用基金的总份额。除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

6.4.7.5 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 6 月 30 日		上年度可比期间 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
中国工商银行	2,867,495.77	12,917.44	2,910,239.64	14,079.00

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.7.6 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。

6.4.7.7 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。

6.4.8 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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/增发而持有的流通受限证券。

6.4.8.2 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
000656	金科股份	2017 年 5 月 31 日	重大事项	6.54	2017 年 7 月 5 日	5.92	75,655	348,068.25	494,783.70	-
600655	豫园商城	2017 年 5 月 17 日	重大事项	11.32	-	-	21,174	280,694.36	239,689.68	-
601717	郑煤机	2017 年 4 月 24 日	重大事项	7.79	-	-	24,935	182,762.91	194,243.65	-
002128	露天煤业	2017 年 6 月 16 日	重大事项	8.70	2017 年 7 月 14 日	9.57	17,800	135,692.28	154,860.00	-
600277	亿利	2017 年	重大	7.83	-	-	13,672	104,299.99	107,051.76	-

	洁能	3 月 6 日	事项							
600657	信达地产	2017 年 6 月 19 日	重大事项	5.76	2017 年 8 月 10 日	6.19	16,654	105,703.85	95,927.04	-
600673	东阳光科	2016 年 11 月 15 日	重大事项	7.29	-	-	12,253	103,781.37	89,324.37	-
600959	江苏有线	2017 年 6 月 19 日	重大事项	10.57	-	-	7,560	82,165.46	79,909.20	-
601001	大同煤业	2017 年 6 月 22 日	重大事项	5.25	2017 年 7 月 21 日	5.78	15,214	83,298.16	79,873.50	-
601872	招商轮船	2017 年 5 月 2 日	重大事项	5.16	-	-	14,800	95,980.70	76,368.00	-
600577	精达股份	2017 年 6 月 26 日	重大事项	4.80	2017 年 7 月 10 日	4.50	13,748	72,091.30	65,990.40	-
002013	中航机电	2017 年 5 月 16 日	重大事项	10.33	2017 年 8 月 2 日	11.36	5,983	62,587.14	61,804.39	-
600485	信威集团	2017 年 6 月 27 日	重大事项	14.59	-	-	4,100	88,204.18	59,819.00	-
000887	中鼎股份	2017 年 6 月 20 日	重大事项	22.09	2017 年 7 月 14 日	19.88	2,634	58,258.69	58,185.06	-
601608	中信重工	2017 年 4 月 19 日	重大事项	5.54	2017 年 7 月 26 日	5.26	10,050	61,485.20	55,677.00	-
002129	中环股份	2016 年 7 月 6 日	重大事项	8.27	-	-	5,500	76,574.22	45,485.00	-
002399	海普瑞	2017 年 6 月 29 日	重大事项	20.23	-	-	2,177	43,002.88	44,040.71	-
002075	沙钢股份	2016 年 9 月 19 日	重大事项	16.12	-	-	2,420	44,596.14	39,010.40	-
002252	上海莱士	2017 年 6 月 21 日	重大事项	20.24	-	-	1,536	30,958.11	31,088.64	-

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 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。

6.4.8.3.2 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。

6.4.9 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	41,316,371.46	77.70
	其中：股票	41,316,371.46	77.70
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	2,867,495.77	5.39
7	其他各项资产	8,990,290.89	16.91
8	合计	53,174,158.12	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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	105,325.12	0.20
B	采矿业	1,720,858.79	3.25
C	制造业	22,369,662.78	42.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,164,605.89	2.20
E	建筑业	1,375,086.74	2.60
F	批发和零售业	3,291,043.64	6.22
G	交通运输、仓储和邮政业	1,874,730.20	3.54
H	住宿和餐饮业	40,514.50	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,599,975.17	3.02
J	金融业	2,581,955.35	4.88
K	房地产业	2,205,441.77	4.17
L	租赁和商务服务业	703,916.52	1.33
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	235,509.90	0.45
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	1,133,053.29	2.14
S	综合	198,032.02	0.37
	合计	40,599,711.68	76.72

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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	221,876.08	0.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	494,783.70	0.93
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	716,659.78	1.35

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。

7.3 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

7.3.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601168	西部矿业	39,400	302,986.00	0.57
2	600739	辽宁成大	15,538	280,150.14	0.53
3	601555	东吴证券	24,295	272,832.85	0.52
4	000423	东阿阿胶	3,644	261,967.16	0.50
5	000422	湖北宜化	42,929	255,427.55	0.48
6	000488	晨鸣纸业	19,214	247,860.60	0.47

7	600655	豫园商城	21,174	239,689.68	0.45
8	600004	白云机场	12,800	236,288.00	0.45
9	600705	中航资本	41,418	234,011.70	0.44
10	000623	吉林敖东	9,805	224,436.45	0.42

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。

7.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000656	金科股份	75,655	494,783.70	0.93
2	600673	东阳光科	12,253	89,324.37	0.17
3	002129	中环股份	5,500	45,485.00	0.09
4	002399	海普瑞	2,177	44,040.71	0.08
5	601005	*ST 重钢	20,200	43,026.00	0.08

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	601168	西部矿业	295,894.00	0.67
2	600782	新钢股份	167,970.00	0.38
3	601666	平煤股份	165,158.00	0.38
4	000729	燕京啤酒	162,059.00	0.37
5	600111	北方稀土	154,840.00	0.35
6	600150	中国船舶	150,073.46	0.34
7	000800	一汽轿车	140,217.00	0.32
8	600096	云天化	139,740.00	0.32
9	600282	南钢股份	134,400.00	0.31
10	002419	天虹股份	125,489.00	0.29
11	000501	鄂武商 A	123,087.00	0.28
12	601555	东吴证券	121,502.00	0.28
13	002183	怡亚通	115,118.00	0.26

14	600502	安徽水利	112,476.00	0.26
15	600395	盘江股份	107,406.00	0.24
16	600291	西水股份	102,480.00	0.23
17	601997	贵阳银行	97,920.00	0.22
18	000750	国海证券	93,002.00	0.21
19	601012	隆基股份	91,273.00	0.21
20	601000	唐山港	89,243.00	0.20

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	000600	建投能源	198,203.10	0.45
2	600674	川投能源	193,127.50	0.44
3	000959	首钢股份	180,250.00	0.41
4	600269	赣粤高速	179,648.00	0.41
5	000877	天山股份	159,245.55	0.36
6	601179	中国西电	152,435.00	0.35
7	600308	华泰股份	152,381.00	0.35
8	600033	福建高速	152,172.00	0.35
9	000900	现代投资	151,256.61	0.34
10	600008	首创股份	145,466.00	0.33
11	600637	东方明珠	143,891.76	0.33
12	601000	唐山港	143,226.56	0.33
13	002028	思源电气	135,001.20	0.31
14	600057	象屿股份	133,168.92	0.30
15	600970	中材国际	131,421.16	0.30
16	600426	华鲁恒升	129,314.12	0.29
17	000550	江铃汽车	128,291.00	0.29
18	000786	北新建材	126,094.70	0.29
19	600157	永泰能源	121,713.06	0.28
20	000415	渤海金控	119,120.80	0.27

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	12,441,971.83
卖出股票收入（成交）总额	12,707,703.11

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。

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

报告期末本基金未持有权证。

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	2,761.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	481.23
5	应收申购款	8,987,047.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,990,290.89

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

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	000656	金科股份	494,783.70	0.93	重大事项
2	600673	东阳光科	89,324.37	0.17	重大事项
3	002129	中环股份	45,485.00	0.09	重大事项
4	002399	海普瑞	44,040.71	0.08	重大事项

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

份额级别	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
泰信基本面 400A	91	51,657.47	3,631,063.00	77.24%	1,069,767.00	22.76%
泰信基本面 400B	510	9,217.31	500.00	0.01%	4,700,330.00	99.99%
泰信基本面 400	584	106,661.41	53,125,136.12	85.29%	9,165,127.79	14.71%
合计	1,185	60,499.51	56,756,699.12	79.17%	14,935,224.79	20.83%

8.2 期末上市基金前十名持有人

泰信基本面 400A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额

			比例
1	华夏未来资本管理有限公司－华夏未来添时 1 号基金	1,065,238.00	22.66%
2	恒天中岩投资管理有限公司－恒天华夏未来一期证券投资基金	647,824.00	13.78%
3	华夏未来资本管理有限公司－华夏未来添时 2 号基金	418,000.00	8.89%
4	建信基金－中信银行－建行群星璀璨 1 期华夏未来 1 号特定多个客户资	400,000.00	8.51%
5	建信基金－兴业银行－建信星光熠熠 1 期尚盈 1 号特定多个客户资产管	385,000.00	8.19%
6	鹏华资产－中信银行－鹏华资产华夏未来泽时进取 7 号 1 期资产管理计	200,000.00	4.25%
7	郑志坤	177,925.00	3.78%
8	高明桂	138,038.00	2.94%
9	北京天演资本管理有限公司－星辰之天演 2 号私募证券投资基金	135,300.00	2.88%
10	王庆丰	115,900.00	2.47%

泰信基本面 400B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	韩莉颖	488,323.00	10.39%
2	蓝晓	435,536.00	9.27%
3	冯广媛	274,238.00	5.83%
4	崔文涛	104,000.00	2.21%
5	周玉明	98,100.00	2.09%
6	王方	90,600.00	1.93%
7	沈中庆	80,000.00	1.70%
8	孙丽君	77,500.00	1.65%
9	包素芹	72,800.00	1.55%
10	张敏红	71,800.00	1.53%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	泰信基本面 400A	-	-
	泰信基本面 400B	-	-
	泰信基本面 400	13,547.57	0.0217%
	合计	13,547.57	0.0189%

8.4 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	份额级别	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	泰信基本面 400A	0
	泰信基本面 400B	0
	泰信基本面 400	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰信基本面 400A	0
	泰信基本面 400B	0
	泰信基本面 400	0
	合计	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

项目	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
基金合同生效日（2012 年 9 月 7 日）基金份额总额	-	-	300,843,720.90
本报告期期初基金份额总额	6,543,401.00	6,543,401.00	44,465,765.05
本报告期基金总申购份额	-	-	32,505,871.79
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	20,294,359.77
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-1,842,571.00	-1,842,571.00	5,612,986.84
本报告期期末基金份额总额	4,700,830.00	4,700,830.00	62,290,263.91

§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

本报告期内，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	
中国银河证券	1	11,218,006.24	44.60%	10,222.91	44.07%	-
川财证券	1	11,112,824.92	44.19%	10,349.40	44.61%	-
中泰证券	1	2,818,843.78	11.21%	2,625.31	11.32%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

瑞银证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
宏源证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	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、本报告期新增交易单元：渤海证券深圳 390860、中银国际深圳 003346，退租交易单元：高华证券上海 24008。

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
中国银河证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

瑞银证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170630	11,611,612.90	12,399,248.39	-	24,010,861.29	33.49%
	2	20170101-20170630	24,237,971.33	4,866,259.50	-	29,104,230.83	40.60%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风							

险以及净值波动风险等特有风险。

泰信基金管理有限公司
2017 年 8 月 26 日