泰信中证200指数证券投资基金
2018年半年度报告

2018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：2018年8月25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 2018 年 8 月 23 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 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 8

3.1 主要会计数据和财务指标 8

3.2 基金净值表现 8

§4 管理人报告 10

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遵规守信情况的说明 11

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12

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 13

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13

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 14

§5 托管人报告 15

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 15

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 15

§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.....19
§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.....37
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.....39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....46
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.....46
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.....46
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.....46
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.....46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....47
7.12 投资组合报告附注.....47
§8 基金份额持有人信息.....49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....49
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.....49
§9 开放式基金份额变动.....50
§10 重大事件揭示.....51
10.1 基金份额持有人大会决议.....51
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.....51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....51
10.4 基金投资策略的改变.....51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....51
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.....51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....51
10.8 其他重大事件.....54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....56
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.....56

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....56
§12 备查文件目录.....57
12.1 备查文件目录.....57
12.2 存放地点.....57
12.3 查阅方式.....57

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信中证 200 指数证券投资基金
基金简称	泰信中证 200 指数
基金主代码	290010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 6 月 9 日
基金管理人	泰信基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	54,462,411.74 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资方法，通过严格的投资流程约束和数量化风险管理手段，以实现对标的指数的有效跟踪。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，按照在中证 200 指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合和跟踪中证 200 的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：中证 200 指数收益率×95%＋商业银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金为指数型基金，具有较高风险和较高预期收益的特征，其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰信基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡囡	王永民
	联系电话	021-20899098	010-66594896
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-5988	95566
传真		021-20899008	010-66594942

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 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	万众	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ftfund.com
基金半年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36-37 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泰信基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36、37 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-349,954.73
本期利润	-8,051,568.17
加权平均基金份额本期利润	-0.1497
本期加权平均净值利润率	-14.29%
本期基金份额净值增长率	-13.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-3,234,946.12
期末可供分配基金份额利润	-0.0594
期末基金资产净值	51,227,465.62
期末基金份额净值	0.941
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-4.03%

注：1、本基金基金合同于 2011 年 6 月 9 日正式生效。

2、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4、期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-8.37%	1.44%	-9.04%	1.45%	0.67%	-0.01%
过去三个月	-11.14%	1.14%	-11.87%	1.16%	0.73%	-0.02%
过去六个月	-13.51%	1.17%	-14.39%	1.19%	0.88%	-0.02%
过去一年	-10.72%	0.98%	-11.17%	1.00%	0.45%	-0.02%
过去三年	-33.17%	1.73%	-36.09%	1.68%	2.92%	0.05%
自基金合同	-4.03%	1.57%	-0.96%	1.56%	-3.07%	0.01%

生效起至今						

注：本基金业绩比较基准为：中证 200 指数收益率×95% + 商业银行活期存款利率(税后)×5%。本基金的投资标的为中证 200 指数，且本基金现金以及到期日在一年之内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，因此本基金将业绩比较基准定为中证 200 指数收益率×95% + 商业银行活期存款利率(税后)×5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金基金合同于 2011 年 6 月 9 日正式生效。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满，基金投资组合各项比例符合基金合同的约定：股票资产占基金资产 90%-95%，投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于股票资产的 90%。现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 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 2018 年 6 月底，公司有正式员工 100 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 2018 年 6 月 30 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、泰信

竞争优选共 21 只开放式基金及 9 个资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张彦先生	本基金经理兼泰信中证基本面 400 指数分级基金、泰信智选成长混合基金经理	2015 年 1 月 6 日	-	12 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 日起同时担任泰信中证锐联基本面 400 指数分级基金经理；自 2017 年 11 月 15 日起担任泰信智选成长混合基金经理。

注：1、以上日期均是指公司公告的日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金的投资运作符合有关法律法规和基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司公平交易制度适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，投资经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在集中交易室集中执行，投资交易过程公平公正，投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内，投资交易监控与价差分析未发现基金之间存在利益输送行为，公平交易制度整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况，亦无其他异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 上半年，中美贸易战愈演愈烈，在经济增速降缓，货币政策中性偏紧，金融严监管去杠杆的背景下， A 股市场呈现单边下跌的态势，上证综指下跌 13.9%，深证成指下跌 15.04%，中小板下跌 14.26%，创业板下跌 8.33%。从行业看，上半年仅有餐饮旅游、食品饮料和医药三个行业上涨，其他板块具有较大的跌幅。

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 0.9%。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 0.941 元；本报告期基金份额净值增长率为-13.51%，业绩比较基准收益率为-14.39%。

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，二季度经济增速如期回落，下半年经济下行压力确认。影响下半年经济主要是两个因素，一个是贸易战，另一个是去年三季度以来的信用收缩。从贸易战的角度来看，从 500 亿美元商品扩大到 2500 亿美元影响 GDP 将更加明显。信用收缩从去年三四季度开始，已经持续了 3 个季度，社融增速从 13.2%下降到 9.8%，出现了快速下行，将对内需产生明显的收缩。当前政策已经开始转变，7 月 31 日政治局会议“稳就业、稳金融、稳外贸、稳外资、 稳投资、稳预期”基调，货币政策方面，已经出现一系列的边际宽松、稳定预期的措施，预计后续会更好的把握去杠杆政策执行的节奏和力度。保证了中国经济不至于出现硬着陆的危机。

大盘反弹缺乏基本面有力支撑。市场风险偏好的提升还要看积极的财政政策如何更积极以及各项改革的推进。在内部和外部两大因素消除之前，市场预计仍将保持震荡磨底的态势。

本基金作为一只投资于中证 200 指数的被动指数基金产品，我们将坚持指数化投资理念，控制基金跟踪误差，通过模拟指数，跟踪市场趋势，使本产品成为投资者良好的资产配置工具。本基金将继续规范运作，审慎投资，勤勉尽责地维护基金份额持有人利益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、泰信基金管理有限公司估值程序等事项的说明

委员会主席

韩波先生，本科学历。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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、基金合同关于利润分配的约定：

1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；

基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

2、每一基金份额享有同等分配权；

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

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

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

二、本报告期本基金未进行利润分配。

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

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰信中证 200 指数证券投资基金

报告截止日： 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	3,641,509.74	4,381,533.25
结算备付金		-	-
存出保证金		1,262.35	2,854.62
交易性金融资产	6.4.7.2	47,695,086.45	52,145,762.27
其中：股票投资		47,695,086.45	52,145,762.27
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	643.66	869.12
应收股利		-	-
应收申购款		6,524.34	13,151.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		51,345,026.54	56,544,170.54
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2018 年 6 月 30 日**	**上年度末 2017 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		3,678.63	-
应付管理人报酬		30,748.87	33,403.53
应付托管费		6,589.04	7,157.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	14,248.98	12,764.39

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	62,295.40	112,879.05
负债合计		117,560.92	166,204.89
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	54,462,411.74	51,801,747.09
未分配利润	6.4.7.10	-3,234,946.12	4,576,218.56
所有者权益合计		51,227,465.62	56,377,965.65
负债和所有者权益总计		51,345,026.54	56,544,170.54

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.941 元，基金份额总额 54,462,411.74 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信中证 200 指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-7,711,066.25	2,138,747.13
1.利息收入		15,362.32	11,686.44
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,362.32	11,686.44
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）		-28,506.72	61,590.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-384,206.62	-316,122.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	355,699.90	377,712.44
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-7,701,613.44	2,064,905.44
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	3,691.59	564.99

减：二、费用		340,501.92	328,698.30
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	195,312.31	184,034.71
2．托管费	6.4.10.2.2	41,852.61	39,435.99
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.19	28,533.69	25,370.41
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		-	-
7．其他费用	6.4.7.20	74,803.31	79,857.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,051,568.17	1,810,048.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,051,568.17	1,810,048.83

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信中证 200 指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	51,801,747.09	4,576,218.56	56,377,965.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,051,568.17	-8,051,568.17
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）	2,660,664.65	240,403.49	2,901,068.14
其中：1.基金申购款	6,307,698.45	464,006.60	6,771,705.05
2.基金赎回款	-3,647,033.80	-223,603.11	-3,870,636.91
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）	54,462,411.74	-3,234,946.12	51,227,465.62

项目	上年度可比期间 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）	51,415,704.53	975,122.94	52,390,827.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,810,048.83	1,810,048.83
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）	-165,389.52	-16,976.13	-182,365.65
其中：1.基金申购款	391,952.36	13,726.23	405,678.59
2.基金赎回款	-557,341.88	-30,702.36	-588,044.24
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）	51,250,315.01	2,768,195.64	54,018,510.65

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 200 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 534 号《关于核准泰信中证 200 指数证券投资基金募集的批复》核准,由泰信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 316,771,140.56 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 228 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 6 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 316,786,119.38 份基金份额，其中认购资金利息折合 14,978.82 份基金份额。本基金的基金管

理人为泰信基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于股票资产的 90%。现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为：中证 200 指数收益率× 95%+商业银行活期存款利率(税后) ×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则－基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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[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》、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》、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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	3,641,509.74
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	3,641,509.74

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		51,553,812.09	47,695,086.45	-3,858,725.64
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		51,553,812.09	47,695,086.45	-3,858,725.64

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末本基金未持有返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有买断式逆回购中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	643.21
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.45
合计	643.66

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 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	14,248.98
银行间市场应付交易费用	-
合计	14,248.98

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	13.86
预提费用	59,505.56

应付指数使用费	2,775.98
-	-
合计	62,295.40

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	51,801,747.09	51,801,747.09
本期申购	6,307,698.45	6,307,698.45
本期赎回 (以"-"号填列)	-3,647,033.80	-3,647,033.80
- 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	54,462,411.74	54,462,411.74

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	21,155,639.52	-16,579,420.96	4,576,218.56
本期利润	-349,954.73	-7,701,613.44	-8,051,568.17
本期基金份额交易产生的变动数	1,080,554.09	-840,150.60	240,403.49
其中：基金申购款	2,548,356.67	-2,084,350.07	464,006.60
基金赎回款	-1,467,802.58	1,244,199.47	-223,603.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,886,238.88	-25,121,185.00	-3,234,946.12

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	15,198.50
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	155.15
其他	8.67
合计	15,362.32

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	8,214,463.24
减：卖出股票成本总额	8,598,669.86
买卖股票差价收入	-384,206.62

6.4.7.13 债券投资收益

本报告期本基金无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本报告期本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

截至报告期末本基金未投资贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期本基金无衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	355,699.90
基金投资产生的股利收益	-
合计	355,699.90

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-7,701,613.44
——股票投资	-7,701,613.44
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-7,701,613.44

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,622.44
转换费收入	69.15
合计	3,691.59

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

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

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	28,533.69
银行间市场交易费用	-
合计	28,533.69

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	29,752.78
银行汇划费手续费用	717.36
债券帐户维护费	9,000.00
指数使用费	5,580.39
其他	-
-	-
合计	74,803.31

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
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。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	195,312.31	184,034.71
其中：支付销售机构的客户维护费	42,417.97	38,781.27

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付	41,852.61	39,435.99

的托管费		

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

6.4.10.2.3 销售服务费

本报告期及上年度可比期间本基金未发生销售服务费用。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	19,037,101.35	19,037,101.35
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	19,037,101.35	19,037,101.35
期末持有的基金份额占基金总份额比例	34.9500%	37.1500%

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
山东省国际信托股份有限公司	26,439,218.54	48.5500%	26,439,218.54	51.0400%

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	3,641,509.74	15,198.50	3,157,614.05	11,582.62

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

本报告期及上年度可比期间本基金在承销期内未参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

报告期内本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600221	海航控股	2018 年 1 月 10 日	重大事项	3.23	2018 年 7 月 20 日	2.91	152,165	492,652.48	491,492.95	-
002450	康得新	2018 年 6 月 4 日	重大事项	17.08	-	-	28,072	444,936.30	479,469.76	-
000540	中天金融	2017 年 8 月 21 日	重大事项	4.87	-	-	58,846	341,533.48	286,580.02	-
002310	东方园林	2018 年 5 月 25 日	重大事项	15.03	-	-	18,718	274,552.68	281,331.54	-
300072	三聚环保	2018 年 6 月 19 日	重大事项	23.28	2018 年 7 月 10 日	24.00	12,084	360,156.06	281,315.52	-
002602	世纪华通	2018 年 6 月 12 日	重大事项	32.50	-	-	6,091	212,393.79	197,957.50	-
000415	渤海金控	2018 年 1 月 17 日	重大事项	5.84	2018 年 7 月 17 日	5.26	24,561	217,520.02	143,436.24	-

601118	海南橡胶	2018 年 5 月 24 日	重大事项	6.62	-	-	17,893	99,314.32	118,451.66	-
000008	神州高铁	2018 年 6 月 6 日	重大事项	4.96	2018 年 8 月 7 日	4.46	23,621	199,268.25	117,160.16	-
002411	必康股份	2018 年 6 月 19 日	重大事项	28.34	-	-	4,091	113,567.81	115,938.94	-
000723	美锦能源	2018 年 3 月 27 日	重大事项	5.43	2018 年 7 月 31 日	4.89	17,200	123,528.00	93,396.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本报告期末本基金无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型证券投资基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资。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流动性风险、市场风险及跟踪误差风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是采用被动投资策略，在投资管理上将最大限度地分散掉非系统性风险。对于跟踪误差的风险，本基金将通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的跟踪误差在限定范围内。

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，因而与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。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2018 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行

持续的监测和分析。

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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 5.09%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2018 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 48,730,065.90 元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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。

本基金持有及承担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、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,641,509.74	-	-	-	3,641,509.74
存出保证金	1,262.35	-	-	-	1,262.35
交易性金融资产	-	-	-	47,695,086.45	47,695,086.45
应收利息	-	-	-	643.66	643.66
应收申购款	-	-	-	6,524.34	6,524.34
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,642,772.09	-	-	47,702,254.45	51,345,026.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,678.63	3,678.63
应付管理人报酬	-	-	-	30,748.87	30,748.87
应付托管费	-	-	-	6,589.04	6,589.04
应付交易费用	-	-	-	14,248.98	14,248.98
其他负债	-	-	-	62,295.40	62,295.40
负债总计	-	-	-	117,560.92	117,560.92
利率敏感度缺口	3,642,772.09	-	-	47,584,693.53	51,227,465.62
上年度末 2017 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	4,381,533.25	-	-	-	4,381,533.25
存出保证金	2,854.62	-	-	-	2,854.62
交易性金融资产	-	-	-	52,145,762.27	52,145,762.27

应收利息	-	-	-	869.12	869.12
应收申购款	-	-	-	13,151.28	13,151.28
资产总计	4,384,387.87	-	-	52,159,782.67	56,544,170.54
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	33,403.53	33,403.53
应付托管费	-	-	-	7,157.92	7,157.92
应付交易费用	-	-	-	12,764.39	12,764.39
其他负债	-	-	-	112,879.05	112,879.05
负债总计	-	-	-	166,204.89	166,204.89
利率敏感度缺口	4,384,387.87	-	-	51,993,577.78	56,377,965.65

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券（2017 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（2017 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。本基金主要投资于交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中采取完全复制法以及自上而下的资产配置策略，按照在中证 200 指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合和跟踪中证 200 的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 90%-95%，投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于股票资产的 90%，现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)

指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	47,695,086.45	93.10	52,145,762.27	92.49
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	47,695,086.45	93.10	52,145,762.27	92.49

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（ 2018 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2017 年 12 月 31 日 ）
	1.业绩比较基准上升 5%	2,475,126.36	2,767,526.84
	2.业绩比较基准下降 5%	-2,475,126.36	-2,767,526.84

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	47,695,086.45	92.89
	其中：股票	47,695,086.45	92.89
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	3,641,509.74	7.09
8	其他各项资产	8,430.35	0.02
9	合计	51,345,026.54	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	206,605.62	0.40
B	采矿业	1,384,656.97	2.70
C	制造业	25,210,997.87	49.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	888,080.83	1.73
E	建筑业	1,507,791.39	2.94
F	批发和零售业	1,689,841.00	3.30
G	交通运输、仓储和邮政业	1,900,027.58	3.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,720,538.53	7.26
J	金融业	5,041,524.82	9.84

K	房地产业	2,181,541.81	4.26
L	租赁和商务服务业	1,203,967.81	2.35
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	517,086.66	1.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	787,968.06	1.54
R	文化、体育和娱乐业	739,375.92	1.44
S	综合	-	-
	合计	46,980,004.87	91.71

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	118,451.66	0.23
B	采掘业	-	-
C	制造业	596,629.92	1.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	715,081.58	1.40

注：积极投资股票为被动持有非当前成分股，将逐步进行调整成分股。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未投资港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601888	中国国旅	13,038	839,777.58	1.64
2	601939	建设银行	102,233	669,626.15	1.31
3	002230	科大讯飞	19,474	624,531.18	1.22
4	002008	大族激光	11,402	606,472.38	1.18
5	002475	立讯精密	25,413	572,809.02	1.12
6	000338	潍柴动力	64,702	566,142.50	1.11
7	600196	复星医药	13,431	555,909.09	1.09
8	600031	三一重工	61,790	554,256.30	1.08
9	002236	大华股份	23,243	524,129.65	1.02
10	300003	乐普医疗	14,284	523,937.12	1.02
11	600741	华域汽车	21,056	499,448.32	0.97
12	600221	海航控股	152,165	491,492.95	0.96
13	600660	福耀玻璃	18,733	481,625.43	0.94
14	002466	天齐锂业	9,594	475,766.46	0.93
15	000963	华东医药	9,736	469,762.00	0.92
16	600867	通化东宝	19,200	460,224.00	0.90
17	603799	华友钴业	4,700	458,109.00	0.89
18	600436	片仔癀	4,031	451,189.83	0.88
19	300124	汇川技术	13,334	437,621.88	0.85
20	601012	隆基股份	26,099	435,592.31	0.85
21	000100	TCL 集团	144,587	419,302.30	0.82
22	600352	浙江龙盛	34,774	415,549.30	0.81
23	300015	爱尔眼科	12,734	411,180.86	0.80
24	002456	欧菲科技	25,390	409,540.70	0.80
25	002460	赣锋锂业	10,428	402,312.24	0.79
26	600029	南方航空	46,922	396,490.90	0.77
27	600886	国投电力	54,401	395,495.27	0.77
28	600487	亨通光电	17,780	392,049.00	0.77
29	600406	国电南瑞	24,414	385,741.20	0.75
30	600271	航天信息	14,930	377,281.10	0.74

31	002044	美年健康	16,672	376,787.20	0.74
32	601155	新城控股	12,060	373,498.20	0.73
33	601607	上海医药	15,413	368,370.70	0.72
34	601901	方正证券	54,900	367,281.00	0.72
35	300070	碧水源	25,114	349,838.02	0.68
36	600570	恒生电子	6,599	349,417.05	0.68
37	600516	方大炭素	14,300	348,634.00	0.68
38	600089	特变电工	49,654	344,102.22	0.67
39	002202	金风科技	27,167	343,390.88	0.67
40	600066	宇通客车	17,754	340,699.26	0.67
41	601600	中国铝业	87,794	337,128.96	0.66
42	600111	北方稀土	29,120	331,385.60	0.65
43	000423	东阿阿胶	6,119	329,263.39	0.64
44	601377	兴业证券	62,012	326,803.24	0.64
45	300408	三环集团	13,900	326,650.00	0.64
46	300136	信维通信	10,506	322,849.38	0.63
47	600535	天士力	12,133	313,274.06	0.61
48	600588	用友网络	12,696	311,178.96	0.61
49	000413	东旭光电	51,212	310,344.72	0.61
50	600383	金地集团	30,132	307,045.08	0.60
51	000503	海虹控股	9,599	305,056.22	0.60
52	600398	海澜之家	23,900	304,486.00	0.59
53	300122	智飞生物	6,406	293,010.44	0.57
54	000768	中航飞机	18,502	289,371.28	0.56
55	600522	中天科技	32,660	287,734.60	0.56
56	000540	中天金融	58,846	286,580.02	0.56
57	600176	中国巨石	28,000	286,440.00	0.56
58	600332	白云山	7,509	285,717.45	0.56
59	601788	光大证券	26,000	285,480.00	0.56
60	002310	东方园林	18,718	281,331.54	0.55
61	300072	三聚环保	12,084	281,315.52	0.55
62	000783	长江证券	51,667	280,551.81	0.55
63	600705	中航资本	59,959	280,008.53	0.55
64	002572	索菲亚	8,600	276,748.00	0.54
65	600068	葛洲坝	36,931	266,272.51	0.52
66	600637	东方明珠	17,600	265,056.00	0.52
67	002241	歌尔股份	26,005	264,990.95	0.52
68	600085	同仁堂	7,330	258,602.40	0.50
69	600177	雅戈尔	33,521	258,111.70	0.50

70	601877	正泰电器	11,501	256,702.32	0.50
71	600674	川投能源	29,420	256,542.40	0.50
72	300024	机器人	14,591	253,883.40	0.50
73	601919	中远海控	50,979	250,816.68	0.49
74	600739	辽宁成大	16,352	248,223.36	0.48
75	000157	中联重科	59,891	246,152.01	0.48
76	601198	东兴证券	18,400	239,936.00	0.47
77	002007	华兰生物	7,457	239,817.12	0.47
78	000425	徐工机械	56,163	238,131.12	0.46
79	600547	山东黄金	9,929	237,501.68	0.46
80	002493	荣盛石化	22,900	236,328.00	0.46
81	000625	长安汽车	26,000	234,000.00	0.46
82	600804	鹏博士	19,137	229,644.00	0.45
83	300144	宋城演艺	9,713	228,255.50	0.45
84	601997	贵阳银行	18,428	227,770.08	0.44
85	000623	吉林敖东	12,414	223,203.72	0.44
86	000786	北新建材	11,900	220,507.00	0.43
87	600809	山西汾酒	3,500	220,115.00	0.43
88	600362	江西铜业	13,852	219,554.20	0.43
89	600208	新湖中宝	57,452	219,466.64	0.43
90	601555	东吴证券	32,094	219,202.02	0.43
91	600926	杭州银行	19,540	216,698.60	0.42
92	002065	东华软件	25,184	216,582.40	0.42
93	603833	欧派家居	1,686	215,015.58	0.42
94	002081	金螳螂	21,166	213,776.60	0.42
95	601099	太平洋	91,111	213,199.74	0.42
96	002050	三花智控	11,300	213,005.00	0.42
97	600816	安信信托	29,256	211,813.44	0.41
98	300017	网宿科技	19,478	208,609.38	0.41
99	600100	同方股份	23,743	208,463.54	0.41
100	002294	信立泰	5,591	207,817.47	0.41
101	002714	牧原股份	4,647	206,605.62	0.40
102	002146	荣盛发展	23,256	203,024.88	0.40
103	600482	中国动力	11,578	202,036.10	0.39
104	000792	盐湖股份	18,624	201,511.68	0.39
105	600109	国金证券	28,284	201,099.24	0.39
106	600219	南山铝业	74,076	200,745.96	0.39
107	000728	国元证券	26,973	199,600.20	0.39
108	002602	世纪华通	6,091	197,957.50	0.39

109	002508	老板电器	6,340	194,130.80	0.38
110	601333	广深铁路	45,343	192,707.75	0.38
111	603858	步长制药	4,500	192,555.00	0.38
112	600297	广汇汽车	32,658	191,375.88	0.37
113	002797	第一创业	28,000	189,560.00	0.37
114	000630	铜陵有色	84,365	186,446.65	0.36
115	600498	烽火通信	7,433	184,710.05	0.36
116	600170	上海建工	59,480	180,819.20	0.35
117	000876	新希望	28,191	178,730.94	0.35
118	600438	通威股份	25,900	178,710.00	0.35
119	601117	中国化学	26,360	177,402.80	0.35
120	002673	西部证券	23,357	176,345.35	0.34
121	000839	中信国安	36,685	173,520.05	0.34
122	600549	厦门钨业	11,269	171,063.42	0.33
123	002624	完美世界	5,500	170,555.00	0.33
124	600153	建发股份	18,942	170,288.58	0.33
125	000826	启迪桑德	9,568	167,248.64	0.33
126	000709	河钢股份	56,688	167,229.60	0.33
127	002085	万丰奥威	17,500	164,500.00	0.32
128	000060	中金岭南	33,398	162,314.28	0.32
129	600977	中国电影	9,971	159,934.84	0.31
130	000983	西山煤电	21,028	157,920.28	0.31
131	600489	中金黄金	23,047	157,180.54	0.31
132	600038	中直股份	3,924	156,920.76	0.31
133	600415	小商品城	36,329	156,577.99	0.31
134	000961	中南建设	24,780	156,361.80	0.31
135	600583	海油工程	29,494	155,138.44	0.30
136	600663	陆家嘴	9,800	154,742.00	0.30
137	600188	兖州煤业	11,820	154,132.80	0.30
138	002500	山西证券	22,673	152,816.02	0.30
139	601216	君正集团	45,002	151,656.74	0.30
140	600118	中国卫星	7,887	150,641.70	0.29
141	600820	隧道股份	25,184	148,837.44	0.29
142	600157	永泰能源	82,894	147,551.32	0.29
143	600346	恒力股份	10,060	147,479.60	0.29
144	300433	蓝思科技	7,000	146,860.00	0.29
145	601992	金隅集团	44,546	146,110.88	0.29
146	002470	金正大	21,032	144,700.16	0.28
147	601228	广州港	24,800	144,088.00	0.28

148	000415	渤海金控	24,561	143,436.24	0.28
149	002555	三七互娱	11,472	139,384.80	0.27
150	000627	天茂集团	19,810	139,066.20	0.27
151	600909	华安证券	24,205	138,452.60	0.27
152	000898	鞍钢股份	24,629	137,183.53	0.27
153	300027	华谊兄弟	22,216	136,850.56	0.27
154	600008	首创股份	32,141	135,635.02	0.26
155	000671	阳光城	21,642	129,202.74	0.25
156	000402	金融街	15,993	128,743.65	0.25
157	601021	春秋航空	3,669	128,525.07	0.25
158	002074	国轩高科	9,106	128,030.36	0.25
159	000559	万向钱潮	18,382	124,997.60	0.24
160	002153	石基信息	4,274	123,946.00	0.24
161	000938	紫光股份	1,952	122,195.20	0.24
162	600682	南京新百	7,400	121,656.00	0.24
163	600376	首开股份	17,230	121,126.90	0.24
164	600704	物产中大	22,976	120,164.48	0.23
165	300251	光线传媒	11,749	119,604.82	0.23
166	601898	中煤能源	24,437	118,030.71	0.23
167	002385	大北农	28,297	116,866.61	0.23
168	002411	必康股份	4,091	115,938.94	0.23
169	600688	上海石化	19,586	111,444.34	0.22
170	300033	同花顺	2,867	111,440.29	0.22
171	600959	江苏有线	20,760	105,876.00	0.21
172	601866	中远海发	42,407	105,593.43	0.21
173	002601	龙蟒佰利	8,148	105,353.64	0.21
174	600061	国投资本	11,300	104,864.00	0.20
175	600339	中油工程	22,400	100,576.00	0.20
176	601991	大唐发电	33,138	100,408.14	0.20
177	600373	中文传媒	7,372	94,730.20	0.18
178	601718	际华集团	23,402	94,076.04	0.18
179	000723	美锦能源	17,200	93,396.00	0.18
180	600372	中航电子	7,038	91,916.28	0.18
181	000959	首钢股份	21,213	87,185.43	0.17
182	601611	中国核建	10,505	82,989.50	0.16
183	601958	金钼股份	12,960	81,259.20	0.16
184	603160	汇顶科技	1,204	78,127.56	0.15
185	601808	中海油服	7,900	75,366.00	0.15
186	603260	合盛硅业	1,000	70,570.00	0.14

187	002468	申通快递	4,088	70,109.20	0.14
188	002625	光启技术	5,700	66,747.00	0.13
189	002925	盈趣科技	1,200	66,456.00	0.13
190	601828	美凯龙	4,200	64,176.00	0.13
191	001965	招商公路	7,400	60,236.00	0.12
192	600233	圆通速递	4,543	59,967.60	0.12
193	601108	财通证券	5,300	59,784.00	0.12
194	600390	五矿资本	7,000	54,250.00	0.11
195	601838	成都银行	5,300	46,375.00	0.09
196	601212	白银有色	11,100	45,399.00	0.09
197	601878	浙商证券	4,874	40,941.60	0.08

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002450	康得新	28,072	479,469.76	0.94
2	601118	海南橡胶	17,893	118,451.66	0.23
3	000008	神州高铁	23,621	117,160.16	0.23

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	600867	通化东宝	490,436.00	0.87
2	300015	爱尔眼科	474,765.00	0.84
3	600487	亨通光电	431,962.00	0.77
4	600516	方大炭素	389,997.00	0.69
5	300408	三环集团	338,906.00	0.60
6	600176	中国巨石	336,280.00	0.60
7	601901	方正证券	321,714.00	0.57
8	600398	海澜之家	320,425.00	0.57

9	601788	光大证券	305,754.00	0.54
10	600637	东方明珠	295,686.00	0.52
11	000786	北新建材	262,285.00	0.47
12	000625	长安汽车	253,240.00	0.45
13	002493	荣盛石化	239,992.00	0.43
14	600809	山西汾酒	232,389.00	0.41
15	600352	浙江龙盛	213,740.00	0.38
16	002797	第一创业	207,760.00	0.37
17	600977	中国电影	207,452.00	0.37
18	002050	三花智控	207,446.00	0.37
19	002085	万丰奥威	192,911.00	0.34
20	600438	通威股份	192,455.00	0.34

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600309	万华化学	929,644.83	1.65
2	600009	上海机场	752,099.20	1.33
3	000568	泸州老窖	693,026.06	1.23
4	601933	永辉超市	445,314.30	0.79
5	000686	东北证券	288,569.17	0.51
6	600977	中国电影	216,247.00	0.38
7	300015	爱尔眼科	207,416.90	0.37
8	002465	海格通信	196,341.86	0.35
9	600352	浙江龙盛	187,412.45	0.33
10	600369	西南证券	173,954.75	0.31
11	000750	国海证券	156,869.13	0.28
12	300315	掌趣科技	141,351.00	0.25
13	600895	张江高科	140,179.69	0.25
14	601377	兴业证券	137,405.32	0.24
15	600827	百联股份	126,928.34	0.23
16	002174	游族网络	123,776.10	0.22
17	600271	航天信息	121,437.64	0.22

18	600649	城投控股	120,203.31	0.21
19	601966	玲珑轮胎	114,924.00	0.20
20	600150	*ST 船舶	113,928.26	0.20

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	11,849,607.48
卖出股票收入（成交）总额	8,214,463.24

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

本报告期末本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末本基金未投资贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金本期末投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	1,262.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	643.66
5	应收申购款	6,524.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,430.35

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金未持有的处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	002450	康得新	479,469.76	0.94	重大事项
2	601118	海南橡胶	118,451.66	0.23	重大事项
3	000008	神州高铁	117,160.16	0.23	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

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
1,558	34,956.62	45,476,319.89	83.50%	8,986,091.85	16.50%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 6 月 9 日）基金份额总额	316,786,119.38
本报告期期初基金份额总额	51,801,747.09
本报告期基金总申购份额	6,307,698.45
减:本报告期基金总赎回份额	3,647,033.80
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	54,462,411.74

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘会计师事务所，仍为普华永道中天会计师事务所有限公司。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	1	10,146,094.41	50.57%	9,449.22	50.97%	-

华泰证券	1	7,337,308.41	36.57%	6,686.52	36.07%	-
中信建投	2	2,580,667.90	12.86%	2,403.47	12.96%	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

华安证券	1	-	-	-	-	-
中国建银投资证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-

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

2、本报告期本基金交易单元无变化。

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
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中国建银投资证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	新增盈米财富为销售机构并开通转换定投及费率优惠业务	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 1 月 4 日
2	新增世纪证券为销售机构并开通转换定投业务	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 1 月 11 日
3	在嘉实基金开通转换及费率优惠	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站	2018 年 1 月 19 日

		（www.ftfund.com）	
4	17 年 4 季度报告	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 1 月 19 日
5	在大泰金石、中泰证券开通申购、定投费率优惠	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 1 月 30 日
6	新增上海基煜基金为销售机构并开通转换、定投及费率优惠业务	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 1 月 31 日
7	17 年度报告	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 3 月 29 日
8	东海证券、工商银行费率优惠	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 3 月 30 日
9	交通银行手机银行费率优惠	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 3 月 30 日
10	2018 年 1 季度报告	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 4 月 21 日
11	新增济安财富（北京）基金为销售机构并开通转换定投费率优惠	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 5 月 26 日
12	参加银河证券申购定投费率优惠	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 5 月 30 日
13	新增天津国美基金销售有限公司为销售机构并开通转换及费率优惠业务	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 5 月 30 日
14	参加华宝证券费率优惠业务	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 6 月 6 日
15	旗下基金终止懒猫金服销售业务	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 6 月 20 日
16	参加交通银行手机银行费率优惠业务	《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 6 月 30 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

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	20180101-20180630	26,439,218.54	0.00	0.00	26,439,218.54	48.55%
	2	20180101-20180630	19,037,101.35	0.00	0.00	19,037,101.35	34.95%
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。							

11.2 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。

§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中证 200 指数证券投资基金设立的文件

2、《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》

3、《泰信中证 200 指数证券投资基金招募说明书》

4、《泰信中证 200 指数证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

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

投资者可直接登录本基金管理人公司网站(www.ftfund.com)查阅上述相关文件，或拨打客户服务中 心电话(400-888-5988，021-38784566)，和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司

2018 年 8 月 25 日