泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金 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。

本报告中的财务资料未经审计。

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.....11

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....12

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....13

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....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.....38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....47
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.....47
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.....47
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.....47
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.....47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....47
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.....57
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.....57

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....57

§12 备查文件目录.....58

12.1 备查文件目录.....58

12.2 存放地点.....58

12.3 查阅方式.....58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金
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	56,549,857.49 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
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》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
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）自由贸易实验区浦东南路 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	-1,877,114.07
本期利润	-3,648,619.13
加权平均基金份额本期利润	-0.0732
本期加权平均净值利润率	-7.32%
本期基金份额净值增长率	-6.66%
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	-3,463,377.84
期末可供分配基金份额利润	-0.0612
期末基金资产净值	53,086,479.65
期末基金份额净值	0.939
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	-6.10%

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

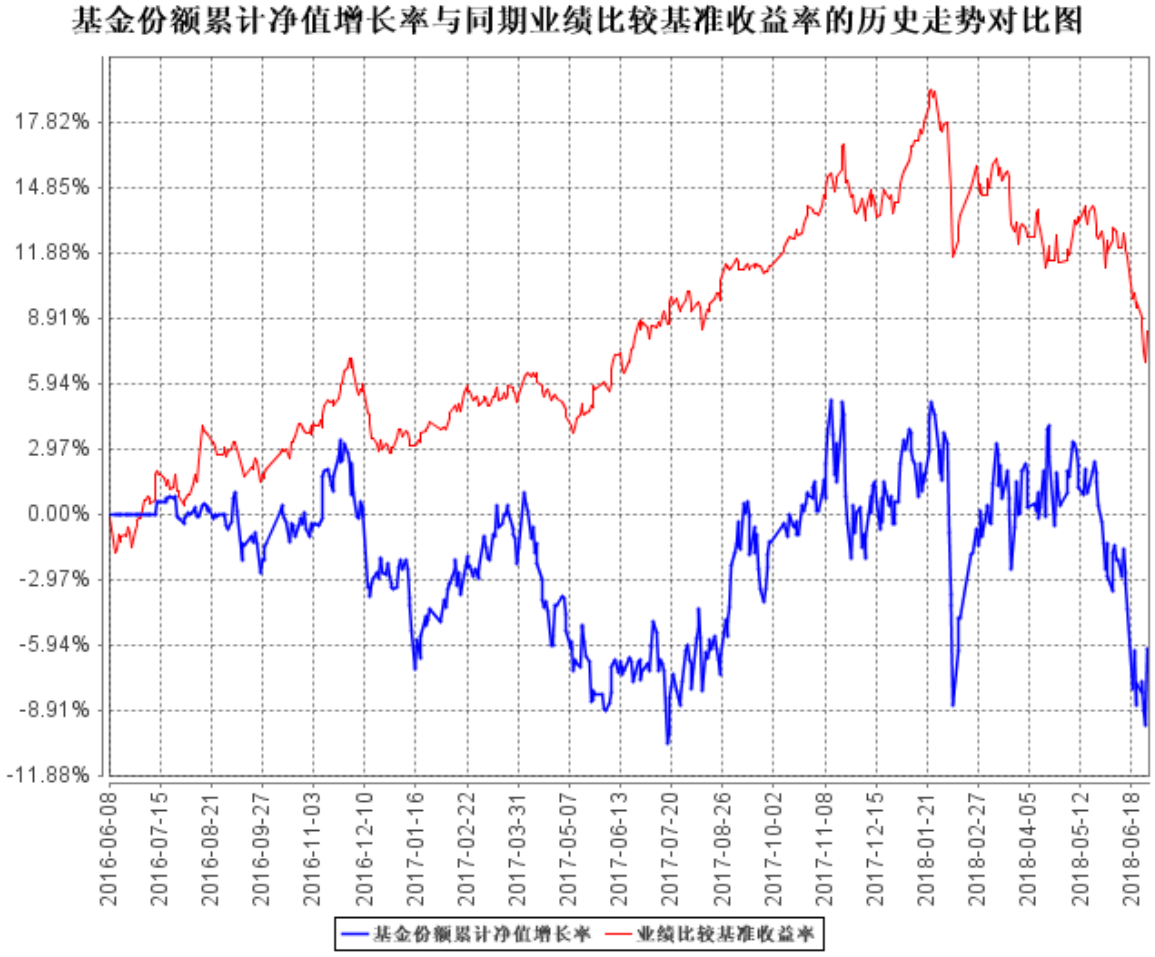
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-4.86%	1.65%	-3.65%	0.64%	-1.21%	1.01%
过去三个月	-7.94%	1.38%	-4.28%	0.57%	-3.66%	0.81%
过去六个月	-6.66%	1.44%	-5.15%	0.58%	-1.51%	0.86%
过去一年	0.97%	1.29%	-0.34%	0.48%	1.31%	0.81%
自基金合同生效起至今	-6.10%	1.02%	8.31%	0.42%	-14.41%	0.60%

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。

§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		
钱鑫先生	本基金经理兼泰信发展主题混合基金经理	2016 年 6 月 8 日	-	9 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 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、任职日期为合同生效日。

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 公平交易制度的执行情况

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《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相关的各环节，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，基金经理严格遵守公平、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本基金与其他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

进入 2018 年，市场呈现波动率显著提升、轮动加快、市场投资逻辑快速演绎等特点，表现出与 2017 年较为迥异的市场特征。我们认为这与前两年不断强化的低估值投资理念，以及由此带来的交易过于集中拥挤有关。近一阶段的投资收益主要来自行业或公司的边际变化，或为业绩超预期的短期驱动，或为行业景气度、政策超预期的长期驱动。进入 2 季度，受中美贸易谈判摩擦升级，国内金融去杠杆背景下债券市场接连曝出信用违约事件，以及上市公司股权质押等风险事件的影响，市场风险偏好显著下降，6 月中人民币对美元快速贬值，棚改 PSL 资金政策变动等进一步加剧了市场担忧，内部金融政策趋紧与外部国际环境紧张带来负面影响，各主要指数出现抵抗式下跌。

互联网+部分子领域呈现行业景气度加速的趋势，包括云计算、半导体设备等，龙头公司的订单与业绩增长显著。

本基金在 1 季度提高了成长类板块仓位，主要加仓计算机、 半导体、医药等行业。2 季度根据市场变化降低了股票仓位，基于中报业绩预测情况对持仓进行了调整， 减持了互联网金融等行业配置，增加了行业景气度高，业绩增长确定的医药消费、科技创新类个股，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 0.939 元；本报告期基金份额净值增长率为-6.66%，业绩比较基准收益率为-5.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7 月 31 日中央政治局会议部署下半年经济工作，指出当前经济运行稳中有变，面临一些新问题新挑战，外部环境发生明显变化。提出稳就业、稳金融、稳外贸、稳外资、稳投资、稳预期工作，加大基础设施领域补短板力度，实施好乡村振兴战略，继续研究推出一批重大改革措施。我们认为政治局会议传递出下半年维护稳定的信号，金融去杠杆节奏、力度有望边际放缓，几项重点工作的展开也带来相应的投资线索。此外，我们关注中美贸易谈判的持续进展，并从策略上做好应对。

总体上，我们计划维持优质公司底仓配置的基础上，控制合理仓位，关注政策边际变化带来的投资机会。在国家不断提升自主研发技术实力的背景下，寻找互联网+领域的优质公司。

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、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。

4.8 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

本报告期本基金于 2018 年 1 月 4 日至 2018 年 3 月 20 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：泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金

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	17,116,891.20	10,093,009.55
结算备付金		361,456.18	490,146.64
存出保证金		41,222.08	47,861.54
交易性金融资产	6.4.7.2	39,732,335.00	40,124,919.40
其中：股票投资		39,732,335.00	40,124,919.40
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		-	1,293,536.68
应收利息	6.4.7.5	3,012.63	2,617.84
应收股利		-	-
应收申购款		2,491.07	309.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		57,257,408.16	52,052,401.19
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		3,749,190.52	-
应付赎回款		-	981.77
应付管理人报酬		66,546.61	60,433.74
应付托管费		11,091.09	10,072.35
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	254,841.95	248,939.54

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	89,258.34	160,001.84
负债合计		4,170,928.51	480,429.24
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	56,549,857.49	51,266,534.92
未分配利润	6.4.7.10	-3,463,377.84	305,437.03
所有者权益合计		53,086,479.65	51,571,971.95
负债和所有者权益总计		57,257,408.16	52,052,401.19

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.939 元，基金份额总额 56,549,857.49 份。

6.2 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：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		-2,367,543.82	-439,165.99
1.利息收入		44,851.95	155,277.34
其中：存款利息收入	6.4.7.11	44,851.95	38,724.96
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		-	116,552.38
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-688,835.59	-1,567,557.66
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-840,758.82	-1,687,155.90
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	151,923.23	119,598.24
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,771,505.06	958,487.15
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	47,944.88	14,627.18
减：二、费用		1,281,075.31	1,125,846.21

1．管理人报酬	6.4.10.2.1	367,611.54	373,226.41
2．托管费	6.4.10.2.2	61,268.61	62,204.35
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.19	754,821.01	571,902.27
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	97,374.15	118,513.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,648,619.13	-1,565,012.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,648,619.13	-1,565,012.20

6.3 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：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）	51,266,534.92	305,437.03	51,571,971.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,648,619.13	-3,648,619.13
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）	5,283,322.57	-120,195.74	5,163,126.83
其中：1.基金申购款	22,924,466.92	423,424.82	23,347,891.74
2.基金赎回款	-17,641,144.35	-543,620.56	-18,184,764.91
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	56,549,857.49	-3,463,377.84	53,086,479.65

金净值）			
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）	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（本期利润）	-	-1,565,012.20	-1,565,012.20
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）	-829,779.40	-496,977.13	-1,326,756.53
其中：1.基金申购款	11,309,319.63	-773,435.26	10,535,884.37
2.基金赎回款	-12,139,099.03	276,458.13	-11,862,640.90
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）	57,605,402.89	-4,020,194.27	53,585,208.62

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%。

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。

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	17,116,891.20
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：	17,116,891.20

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		39,617,670.68	39,732,335.00	114,664.32
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	39,617,670.68	39,732,335.00	114,664.32

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买入返售金融资产。

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	2,849.55
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	146.34
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	16.74
合计	3,012.63

6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

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	254,841.95
银行间市场应付交易费用	-
合计	254,841.95

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	-
预提费用	89,258.34
合计	89,258.34

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	51,266,534.92	51,266,534.92
本期申购	22,924,466.92	22,924,466.92
本期赎回 (以"-"号填列)	-17,641,144.35	-17,641,144.35
- 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	56,549,857.49	56,549,857.49

注：申购含转换入份额；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	-161,677.12	467,114.15	305,437.03
本期利润	-1,877,114.07	-1,771,505.06	-3,648,619.13
本期基金份额交易产生的变动数	-90,250.67	-29,945.07	-120,195.74
其中：基金申购款	-63,138.05	486,562.87	423,424.82
基金赎回款	-27,112.62	-516,507.94	-543,620.56
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-2,129,041.86	-1,334,335.98	-3,463,377.84

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	40,594.69
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	3,415.73
其他	841.53
合计	44,851.95

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	250,676,551.61
减：卖出股票成本总额	251,517,310.43
买卖股票差价收入	-840,758.82

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本报告期本基金未投资资产支持证券。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未投资贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

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	151,923.23
基金投资产生的股利收益	-
合计	151,923.23

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	-1,771,505.06
——股票投资	-1,771,505.06
——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	-1,771,505.06

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	47,618.29
转出基金补偿费	326.59
合计	47,944.88

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

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，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	754,821.01
银行间市场交易费用	-
合计	754,821.01

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	59,505.56
帐户维护费	6,000.00
银行划款手续费	2,115.81
其他	-
合计	97,374.15

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

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
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
山东省国际信托股份有限公司(“山东国托”)	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信实业有限公司(“青岛国信”)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本期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	367,611.54	373,226.41
其中：支付销售机构的客户维护费	91,722.05	178,852.57

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。

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的托管费	61,268.61	62,204.35

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。

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无销售服务费用。

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

本报告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	4,964,250.25	-
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	4,964,250.25	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.7800%	-

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	28,220,605.03	49.9000%	8,613,742.28	16.8000%

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	17,116,891.20	40,594.69	3,741,961.96	28,260.69

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未参与在承销期内关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期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

本基金本报告期内无利润分配。

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。

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
603939	益丰药房	2018 年 4 月 17 日	重大资产重组	53.06	2018 年 7 月 16 日	65.69	20,000	1,102,000.00	1,061,200.00	-

6.4.12.3 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。

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。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、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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。

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 2.00%。

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 53,100,035.68 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、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	17,116,891.20	-	-	-	17,116,891.20

结算备付金	361,456.18	-	-	-	361,456.18
存出保证金	41,222.08	-	-	-	41,222.08
交易性金融资产	-	-	-	39,732,335.00	39,732,335.00
应收利息	-	-	-	3,012.63	3,012.63
应收申购款	-	-	-	2,491.07	2,491.07
资产总计	17,519,569.46	-	-	39,737,838.70	57,257,408.16
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,749,190.52	3,749,190.52
应付管理人报酬	-	-	-	66,546.61	66,546.61
应付托管费	-	-	-	11,091.09	11,091.09
应付交易费用	-	-	-	254,841.95	254,841.95
其他负债	-	-	-	89,258.34	89,258.34
负债总计	-	-	-	4,170,928.51	4,170,928.51
利率敏感度缺口	17,519,569.46	-	-	35,566,910.19	53,086,479.65
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	10,093,009.55	-	-	-	10,093,009.55
结算备付金	490,146.64	-	-	-	490,146.64
存出保证金	47,861.54	-	-	-	47,861.54
交易性金融资产	-	-	-	40,124,919.40	40,124,919.40
应收证券清算款	-	-	-	1,293,536.68	1,293,536.68
应收利息	-	-	-	2,617.84	2,617.84
应收申购款	-	-	-	309.54	309.54
资产总计	10,631,017.73	-	-	41,421,383.46	52,052,401.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	981.77	981.77
应付管理人报酬	-	-	-	60,433.74	60,433.74
应付托管费	-	-	-	10,072.35	10,072.35
应付交易费用	-	-	-	248,939.54	248,939.54
其他负债	-	-	-	160,001.84	160,001.84
负债总计	-	-	-	480,429.24	480,429.24
利率敏感度缺口	10,631,017.73	-	-	40,940,954.22	51,571,971.95

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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投资(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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金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%。本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。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。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	39,732,335.00	74.84	40,124,919.40	77.80
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	39,732,335.00	74.84	40,124,919.40	77.80

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%	2,640,123.81	4,894,370.20
	2.业绩比较基准下降 5%	-2,640,123.81	-4,894,370.20

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	39,732,335.00	69.39
	其中：股票	39,732,335.00	69.39
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	17,478,347.38	30.53
8	其他各项资产	46,725.78	0.08
9	合计	57,257,408.16	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	21,079,908.00	39.71
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	3,431,780.00	6.46

G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,108,800.00	2.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,725,250.00	12.67
J	金融业	1,157,760.00	2.18
K	房地产业	1,007,720.00	1.90
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,492,400.00	2.81
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	1,181,717.00	2.23
R	文化、体育和娱乐业	2,547,000.00	4.80
S	综合	-	-
	合计	39,732,335.00	74.84

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未投资港股通股票。

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

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	600845	宝信软件	87,000	2,292,450.00	4.32
2	002371	北方华创	40,000	1,986,800.00	3.74
3	300398	飞凯材料	77,400	1,513,944.00	2.85
4	300567	精测电子	19,000	1,512,400.00	2.85
5	300012	华测检测	260,000	1,492,400.00	2.81
6	000977	浪潮信息	60,000	1,431,000.00	2.70
7	300144	宋城演艺	60,000	1,410,000.00	2.66
8	300302	同有科技	125,000	1,275,000.00	2.40
9	300601	康泰生物	20,000	1,241,000.00	2.34
10	300347	泰格医药	19,100	1,181,717.00	2.23
11	000651	格力电器	25,000	1,178,750.00	2.22
12	603799	华友钴业	12,000	1,169,640.00	2.20
13	002368	太极股份	40,000	1,162,800.00	2.19
14	601336	新华保险	27,000	1,157,760.00	2.18
15	300182	捷成股份	150,000	1,137,000.00	2.14

16	600754	锦江股份	30,000	1,108,800.00	2.09
17	300037	新宙邦	40,000	1,071,600.00	2.02
18	603939	益丰药房	20,000	1,061,200.00	2.00
19	600570	恒生电子	20,000	1,059,000.00	1.99
20	300122	智飞生物	23,000	1,052,020.00	1.98
21	603345	安井食品	30,000	1,050,000.00	1.98
22	002396	星网锐捷	50,000	1,023,500.00	1.93
23	600048	保利地产	82,600	1,007,720.00	1.90
24	300078	思创医惠	99,400	942,312.00	1.78
25	300451	创业软件	60,000	936,000.00	1.76
26	002236	大华股份	40,000	902,000.00	1.70
27	603233	大参林	13,000	889,980.00	1.68
28	601233	桐昆股份	50,000	861,000.00	1.62
29	000799	酒鬼酒	30,000	832,500.00	1.57
30	603883	老百姓	10,000	831,600.00	1.57
31	600690	青岛海尔	40,000	770,400.00	1.45
32	603808	歌力思	34,200	769,842.00	1.45
33	600855	航天长峰	60,000	704,400.00	1.33
34	002727	一心堂	20,000	649,000.00	1.22
35	000703	恒逸石化	42,000	624,960.00	1.18
36	600779	水井坊	8,000	441,840.00	0.83

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	600029	南方航空	5,210,700.00	10.10
2	603799	华友钴业	3,507,387.00	6.80
3	300474	景嘉微	3,368,657.00	6.53
4	601336	新华保险	3,326,867.00	6.45
5	002236	大华股份	3,268,147.00	6.34
6	600845	宝信软件	2,898,016.00	5.62
7	300498	温氏股份	2,775,697.22	5.38
8	300122	智飞生物	2,769,461.00	5.37

9	300398	飞凯材料	2,748,546.00	5.33
10	600884	杉杉股份	2,694,652.00	5.23
11	002156	通富微电	2,675,032.56	5.19
12	600690	青岛海尔	2,655,740.00	5.15
13	600271	航天信息	2,623,009.00	5.09
14	000858	五粮液	2,604,565.00	5.05
15	002709	天赐材料	2,549,254.00	4.94
16	002439	启明星辰	2,408,585.43	4.67
17	601607	上海医药	2,390,618.00	4.64
18	601233	桐昆股份	2,381,328.00	4.62
19	300059	东方财富	2,357,774.00	4.57
20	601155	新城控股	2,339,362.00	4.54
21	600570	恒生电子	2,317,889.00	4.49
22	000426	兴业矿业	2,250,675.00	4.36
23	601118	海南橡胶	2,219,222.00	4.30
24	002648	卫星石化	2,212,400.00	4.29
25	600754	锦江股份	2,209,000.00	4.28
26	300302	同有科技	2,197,584.00	4.26
27	300017	网宿科技	2,186,114.00	4.24
28	002458	益生股份	2,121,711.00	4.11
29	002371	北方华创	2,089,634.24	4.05
30	000977	浪潮信息	2,038,474.00	3.95
31	600048	保利地产	2,033,376.00	3.94
32	002049	紫光国微	1,963,938.46	3.81
33	300601	康泰生物	1,942,500.00	3.77
34	300182	捷成股份	1,918,029.00	3.72
35	603019	中科曙光	1,894,789.00	3.67
36	300352	北信源	1,859,596.00	3.61
37	300161	华中数控	1,734,204.00	3.36
38	603345	安井食品	1,712,973.00	3.32
39	002777	久远银海	1,711,684.00	3.32
40	002268	卫士通	1,707,970.00	3.31
41	002747	埃斯顿	1,705,544.00	3.31
42	300590	移为通信	1,703,400.00	3.30
43	300571	平治信息	1,699,406.00	3.30
44	300353	东土科技	1,698,681.96	3.29

45	002294	信立泰	1,693,986.00	3.28
46	300271	华宇软件	1,680,611.49	3.26
47	600119	长江投资	1,679,574.00	3.26
48	002668	奥马电器	1,668,283.00	3.23
49	002152	广电运通	1,665,400.00	3.23
50	601699	潞安环能	1,664,639.00	3.23
51	002769	普路通	1,663,634.00	3.23
52	002470	金正大	1,655,762.00	3.21
53	002465	海格通信	1,652,642.00	3.20
54	600562	国睿科技	1,649,599.25	3.20
55	300212	易华录	1,649,000.00	3.20
56	300388	国祯环保	1,640,000.00	3.18
57	300078	思创医惠	1,636,559.00	3.17
58	603365	水星家纺	1,629,734.03	3.16
59	000613	大东海 A	1,618,424.00	3.14
60	600536	中国软件	1,609,037.00	3.12
61	002223	鱼跃医疗	1,599,301.50	3.10
62	300178	腾邦国际	1,592,271.00	3.09
63	000661	长春高新	1,585,500.00	3.07
64	002596	海南瑞泽	1,579,500.00	3.06
65	002234	民和股份	1,575,875.00	3.06
66	002320	海峡股份	1,565,631.00	3.04
67	601899	紫金矿业	1,558,091.00	3.02
68	600196	复星医药	1,526,909.00	2.96
69	600340	华夏幸福	1,512,371.00	2.93
70	000768	中航飞机	1,509,347.00	2.93
71	300012	华测检测	1,464,800.00	2.84
72	002396	星网锐捷	1,458,354.38	2.83
73	300458	全志科技	1,449,138.00	2.81
74	600007	中国国贸	1,435,842.00	2.78
75	300377	赢时胜	1,411,950.00	2.74
76	002139	拓邦股份	1,400,944.00	2.72
77	002299	圣农发展	1,396,305.00	2.71
78	300045	华力创通	1,365,288.00	2.65
79	300144	宋城演艺	1,364,600.00	2.65
80	002074	国轩高科	1,349,991.00	2.62

81	300296	利亚德	1,345,706.00	2.61
82	000799	酒鬼酒	1,343,997.00	2.61
83	300567	精测电子	1,340,800.00	2.60
84	600410	华胜天成	1,338,791.20	2.60
85	002812	创新股份	1,334,156.00	2.59
86	002343	慈文传媒	1,328,000.00	2.58
87	002460	赣锋锂业	1,323,824.00	2.57
88	300070	碧水源	1,320,400.00	2.56
89	002202	金风科技	1,313,400.00	2.55
90	000002	万科 A	1,300,583.00	2.52
91	000729	燕京啤酒	1,276,500.00	2.48
92	600138	中青旅	1,270,000.00	2.46
93	600581	八一钢铁	1,259,397.00	2.44
94	300236	上海新阳	1,243,882.00	2.41
95	002146	荣盛发展	1,238,400.00	2.40
96	300604	长川科技	1,229,845.00	2.38
97	603233	大参林	1,223,752.01	2.37
98	000651	格力电器	1,215,400.00	2.36
99	000997	新大陆	1,206,310.15	2.34
100	002798	帝欧家居	1,199,000.00	2.32
101	300424	航新科技	1,183,950.12	2.30
102	603883	老百姓	1,162,600.00	2.25
103	000681	视觉中国	1,161,445.00	2.25
104	603993	洛阳钼业	1,154,590.00	2.24
105	600338	西藏珠峰	1,153,000.00	2.24
106	000039	中集集团	1,139,600.00	2.21
107	002368	太极股份	1,135,764.00	2.20
108	600598	北大荒	1,130,525.00	2.19
109	300529	健帆生物	1,124,000.00	2.18
110	601398	工商银行	1,123,200.00	2.18
111	600337	美克家居	1,119,400.00	2.17
112	603939	益丰药房	1,102,000.00	2.14
113	603387	基蛋生物	1,097,168.80	2.13
114	000703	恒逸石化	1,097,000.00	2.13
115	000060	中金岭南	1,092,127.00	2.12
116	002304	洋河股份	1,085,000.00	2.10

117	601628	中国人寿	1,083,561.00	2.10
118	002157	正邦科技	1,072,400.00	2.08
119	300133	华策影视	1,068,000.00	2.07
120	002279	久其软件	1,066,788.00	2.07
121	600760	中航沈飞	1,063,000.00	2.06
122	300347	泰格医药	1,060,148.00	2.06
123	002466	天齐锂业	1,052,860.00	2.04
124	002555	三七互娱	1,052,500.00	2.04
125	300037	新宙邦	1,052,000.00	2.04
126	000830	鲁西化工	1,045,000.00	2.03
127	600461	洪城水业	1,044,000.00	2.02
128	300433	蓝思科技	1,043,827.00	2.02
129	300418	昆仑万维	1,036,000.00	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。

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	600029	南方航空	6,305,790.73	12.23
2	600271	航天信息	3,885,775.00	7.53
3	002709	天赐材料	3,358,939.00	6.51
4	300474	景嘉微	3,143,453.75	6.10
5	300059	东方财富	3,074,068.00	5.96
6	300017	网宿科技	2,980,800.00	5.78
7	600048	保利地产	2,904,779.00	5.63
8	002156	通富微电	2,824,229.00	5.48
9	600884	杉杉股份	2,702,288.00	5.24
10	300498	温氏股份	2,669,200.00	5.18
11	300232	洲明科技	2,601,089.80	5.04
12	002202	金风科技	2,580,415.00	5.00
13	603799	华友钴业	2,561,467.00	4.97
14	002439	启明星辰	2,407,065.95	4.67
15	601233	桐昆股份	2,375,601.00	4.61
16	002458	益生股份	2,346,359.00	4.55

17	000858	五粮液	2,311,921.00	4.48
18	601607	上海医药	2,269,760.00	4.40
19	000426	兴业矿业	2,235,876.00	4.34
20	601155	新城控股	2,189,019.00	4.24
21	002236	大华股份	2,184,276.00	4.24
22	002049	紫光国微	2,127,766.80	4.13
23	600487	亨通光电	2,110,740.00	4.09
24	601118	海南橡胶	2,073,000.00	4.02
25	000613	大东海 A	2,060,226.00	3.99
26	002648	卫星石化	1,979,632.00	3.84
27	002747	埃斯顿	1,971,783.00	3.82
28	002531	天顺风能	1,922,703.00	3.73
29	300352	北信源	1,892,200.00	3.67
30	300122	智飞生物	1,890,523.02	3.67
31	002640	跨境通	1,878,832.00	3.64
32	300590	移为通信	1,860,000.00	3.61
33	002668	奥马电器	1,799,224.00	3.49
34	002268	卫士通	1,789,742.00	3.47
35	601336	新华保险	1,787,837.00	3.47
36	002234	民和股份	1,771,188.58	3.43
37	300388	国祯环保	1,737,681.00	3.37
38	600690	青岛海尔	1,730,180.00	3.35
39	300212	易华录	1,725,000.00	3.34
40	600119	长江投资	1,722,760.00	3.34
41	002777	久远银海	1,721,600.00	3.34
42	000703	恒逸石化	1,715,000.00	3.33
43	603019	中科曙光	1,698,510.23	3.29
44	300353	东土科技	1,696,771.00	3.29
45	300271	华宇软件	1,688,955.20	3.27
46	002152	广电运通	1,681,200.00	3.26
47	000661	长春高新	1,678,598.00	3.25
48	601899	紫金矿业	1,666,000.00	3.23
49	002294	信立泰	1,664,262.00	3.23
50	600536	中国软件	1,654,000.00	3.21
51	600562	国睿科技	1,643,648.00	3.19
52	300377	赢时胜	1,634,538.00	3.17
53	000002	万科 A	1,614,044.58	3.13
54	000786	北新建材	1,610,186.00	3.12

55	600196	复星医药	1,606,823.96	3.12
56	300178	腾邦国际	1,597,000.00	3.10
57	002299	圣农发展	1,593,188.18	3.09
58	002470	金正大	1,573,100.00	3.05
59	601699	潞安环能	1,571,775.00	3.05
60	002465	海格通信	1,559,700.00	3.02
61	300458	全志科技	1,558,888.92	3.02
62	002596	海南瑞泽	1,554,152.00	3.01
63	002320	海峡股份	1,553,665.00	3.01
64	000768	中航飞机	1,518,070.00	2.94
65	002769	普路通	1,511,907.00	2.93
66	300161	华中数控	1,496,934.00	2.90
67	300166	东方国信	1,478,082.00	2.87
68	002223	鱼跃医疗	1,477,434.00	2.86
69	002027	分众传媒	1,474,390.00	2.86
70	600340	华夏幸福	1,443,011.00	2.80
71	300045	华力创通	1,442,758.00	2.80
72	600216	浙江医药	1,433,084.00	2.78
73	002153	石基信息	1,415,199.00	2.74
74	600410	华胜天成	1,391,663.16	2.70
75	600521	华海药业	1,388,534.00	2.69
76	600007	中国国贸	1,381,640.00	2.68
77	600835	上海机电	1,378,446.00	2.67
78	300398	飞凯材料	1,371,750.00	2.66
79	603365	水星家纺	1,369,080.00	2.65
80	300529	健帆生物	1,366,890.00	2.65
81	300571	平治信息	1,361,060.00	2.64
82	600183	生益科技	1,339,384.00	2.60
83	300316	晶盛机电	1,320,000.00	2.56
84	002460	赣锋锂业	1,317,200.00	2.55
85	300070	碧水源	1,311,600.00	2.54
86	002371	北方华创	1,310,566.00	2.54
87	002139	拓邦股份	1,301,633.50	2.52
88	002343	慈文传媒	1,300,404.00	2.52
89	600138	中青旅	1,296,880.00	2.51
90	300296	利亚德	1,288,060.00	2.50
91	002573	清新环境	1,268,660.00	2.46
92	002812	创新股份	1,248,000.00	2.42

93	000910	大亚圣象	1,235,145.10	2.39
94	600388	龙净环保	1,204,833.60	2.34
95	002146	荣盛发展	1,201,618.00	2.33
96	000729	燕京啤酒	1,199,920.86	2.33
97	002074	国轩高科	1,185,216.00	2.30
98	600197	伊力特	1,170,460.00	2.27
99	000997	新大陆	1,164,323.00	2.26
100	300604	长川科技	1,159,706.00	2.25
101	000039	中集集团	1,142,500.00	2.22
102	300133	华策影视	1,140,138.00	2.21
103	600581	八一钢铁	1,140,000.00	2.21
104	600570	恒生电子	1,132,502.00	2.20
105	000063	中兴通讯	1,127,000.00	2.19
106	300236	上海新阳	1,126,206.00	2.18
107	000425	徐工机械	1,120,800.00	2.17
108	002279	久其软件	1,113,000.00	2.16
109	600598	北大荒	1,107,050.00	2.15
110	002157	正邦科技	1,095,046.00	2.12
111	600337	美克家居	1,094,400.00	2.12
112	002798	帝欧家居	1,089,791.00	2.11
113	600461	洪城水业	1,087,937.47	2.11
114	600754	锦江股份	1,086,943.00	2.11
115	300170	汉得信息	1,075,084.00	2.08
116	000060	中金岭南	1,064,700.00	2.06
117	603387	基蛋生物	1,064,000.00	2.06
118	002449	国星光电	1,060,139.00	2.06
119	603993	洛阳钼业	1,059,600.00	2.05
120	002304	洋河股份	1,034,648.00	2.01

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	252,896,231.09
卖出股票收入（成交）总额	250,676,551.61

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

报告期末本基金未投资债券。

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

报告期末本基金未投资债券。

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

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	41,222.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,012.63
5	应收申购款	2,491.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,725.78

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

报告期末本基金投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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
437	129,404.71	33,184,855.28	58.68%	23,365,002.21	41.32%

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份额。

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（ 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	51,266,534.92
本报告期基金总申购份额	22,924,466.92
减:本报告期基金总赎回份额	17,641,144.35
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	56,549,857.49

§ 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

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	
海通证券	2	194,038,199.92	38.53%	176,826.71	38.48%	-

中信建投	2	76,789,735.73	15.25%	71,514.29	15.56%	-
东方证券	1	74,427,396.67	14.78%	67,825.96	14.76%	-
安信证券	3	43,839,371.23	8.71%	40,827.78	8.89%	-
国泰君安	1	29,964,099.80	5.95%	27,306.43	5.94%	-
长江证券	1	25,175,733.65	5.00%	22,942.71	4.99%	-
浙商证券	1	24,655,281.61	4.90%	22,468.44	4.89%	-
广州证券	1	21,991,973.04	4.37%	20,481.17	4.46%	-
川财证券	1	12,690,991.05	2.52%	9,280.88	2.02%	-
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	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券	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	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中国建银投资证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

华安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	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、本报告期内本基金无新增和退租的交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

第一创业	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中国建银投资证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》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》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 1 月 11 日
3	在利得基金开通转换、定投业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站	2018 年 1 月 19 日

		（www.ftfund.com）	
4	新增嘉实基金为销售机构并开通转换及费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 1 月 19 日
5	17 年 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 1 月 19 日
6	在大泰金石、中泰证券开通申购、定投费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 1 月 30 日
7	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》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 1 月 31 日
8	停牌股票估值调整（恒逸石化）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 2 月 3 日
9	17 年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 3 月 29 日
10	东海证券、工商银行费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 3 月 30 日
11	2018 年 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 4 月 21 日
12	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》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 5 月 26 日
13	参加银河证券申购定投费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 5 月 30 日
14	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》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站	2018 年 5 月 30 日

		（www.ftfund.com）	
15	参加华宝证券费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 6 月 6 日
16	在国金证券开通转换定投业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 6 月 13 日
17	旗下基金终止懒猫金服销售业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 6 月 20 日
18	停牌股票估值调整（益丰药房）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 6 月 22 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	20180112-20180115、20180124-20180630	8,613,742.28	19,606,862.75	-	28,220,605.03	49.90%
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互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

2、《泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信互联网+主题灵活配置混合型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、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