泰信发展主题混合型证券投资基金
2018 年半年度报告
摘要

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 25 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 2018 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 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	泰信发展主题混合
基金主代码	290008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 12 月 15 日
基金管理人	泰信基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	52,502,747.50 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	充分把握中国经济可持续发展过程中的主题投资机会，通过主题配置和精选个股，分享中国经济社会在科学发展、和谐发展和可持续发展过程中的投资机遇。在严格控制投资风险的条件下，力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。
投资策略	本基金的股票资产采用以“核心主题投资为主，卫星主题投资和非主题类投资为辅”的投资策略，并考虑组合品种的估值风险和大类资产的系统风险，通过品种和仓位的动态调整降低资产的波动风险。
业绩比较基准	75%×沪深 300 指数+25%×中证全债指数
风险收益特征	本基金作为混合型基金，属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金。本基金适合于能够承担一定股市风险，追求资本长期增值的个人和机构投资者。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰信基金管理有限公司	中国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）66105798
	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）66105799

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	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(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,596,029.00
本期利润	-5,218,650.48
加权平均基金份额本期利润	-0.0940
本期基金份额净值增长率	-8.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.1030
期末基金资产净值	57,908,604.67
期末基金份额净值	1.103

注：1、本基金基金合同于 2010 年 12 月 15 日正式生效。本基金自 2015 年 8 月 7 日起变更为混合型基金。

2、所述基金业绩指标不包括持有人申购或交易基金的各项费用，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	-5.24%	1.54%	-5.61%	0.96%	0.37%	0.58%
过去三个月	-8.69%	1.34%	-6.98%	0.85%	-1.71%	0.49%
过去六个月	-8.31%	1.41%	-8.73%	0.86%	0.42%	0.55%
过去一年	-0.54%	1.26%	-1.99%	0.71%	1.45%	0.55%
过去三年	-28.01%	1.93%	-12.89%	1.12%	-15.12%	0.81%
自基金合同生效起至今	49.24%	1.64%	18.91%	1.09%	30.33%	0.55%

注：本基金的业绩比较基准为：75%×沪深 300 指数+25%×中证全债指数

1、沪深 300 指数，编制合理和透明，运用广泛，对中国 A 股市场具有较强的代表性和权威性。

2、中证全债指数以银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券为样本，是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，具有良好的债券市场代表性，运用较为广泛。

选择该业绩比较基准能够真实反映本基金长期动态的资产配置目标和风险收益特征。

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 2010 年 12 月 15 日正式生效。本基金自 2015 年 8 月 7 日起变更为混合型基金。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满，基金投资组合各项比例符合基金合同的约定。本基金将基金资产的 60%-95%投资于股票，基金资产的 5%-40%投资于债券、现金类资产及权证、资产支持证券。其中，现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证不高于基

金资产净值的 3%，资产支持证券不高于基金资产净值的 20%。其中投资于发展主题相关上市公司的比例不低于股票投资资产的 80%。

§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	本基金经理兼泰信互联网+基金经理	2016 年 1 月 27 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 6 月 8 日起担任泰信互联网+主题基金经理。

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》、《泰信发展主题混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金的投资运作符合有关法规和基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，投资经理严格遵守公平、公正、独立

的原则下达投资指令，所有投资指令在集中交易室集中执行，投资交易过程公平公正，投资交易监控贯穿于整个投资过程。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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。

本基金在 1 月份重点配置了房地产板块，2、3 月份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， 减持了金融、周期等行业配置，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 1.103 元；本报告期基金份额净值增长率为-8.31%，业绩比较基准收益率为-8.73%。

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。

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

1、基金合同关于利润分配的约定

（1）基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资两种。投资人可选择获取现金红利，或将分红资金按权益登记日该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金红利。

（2）每一基金份额享有同等分配权。

（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）在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多为 12 次。

（5）每次基金收益分配比例不低于该次收益分配基准日可供分配利润的 50%。基金合同生效不满三个月，收益可不分配。

（6）基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过 15 个工作日。

（7）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

2、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，本基金托管人在对泰信发展主题混合型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，泰信发展主题混合型证券投资基金的管理人——泰信基金管理有限公司在泰信发展主题混合型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发展主题混合型证券投资基金 2018 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：泰信发展主题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	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	17,556,512.17	10,164,644.36
结算备付金	524,407.00	675,572.59
存出保证金	89,164.79	111,560.88
交易性金融资产	45,437,500.23	59,334,710.04
其中：股票投资	45,437,500.23	59,334,710.04
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	-	395,768.66
应收利息	3,311.94	2,900.41
应收股利	-	-
应收申购款	14,980.47	2,098.57
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	63,625,876.60	70,687,255.51
负债和所有者权益	**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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	5,213,767.32	950,297.77
应付赎回款	23,986.76	15,992.97
应付管理人报酬	72,919.92	87,367.01
应付托管费	12,153.33	14,561.17
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	320,058.10	333,546.78
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	74,386.50	210,000.00
负债合计	5,717,271.93	1,611,765.70
所有者权益：		
实收基金	52,502,747.50	57,408,766.00
未分配利润	5,405,857.17	11,666,723.81
所有者权益合计	57,908,604.67	69,075,489.81
负债和所有者权益总计	63,625,876.60	70,687,255.51

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.103 元，基金份额总额 52,502,747.50 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信发展主题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	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入	-3,469,873.71	1,152,016.33
1.利息收入	56,295.37	62,743.30
其中：存款利息收入	56,295.37	60,743.57
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	-	1,999.73
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-904,343.49	-860,335.73
其中：股票投资收益	-1,083,772.35	-1,041,344.48
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	179,428.86	181,008.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,622,621.48	1,948,543.85
4. 汇兑收益 （损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	795.89	1,064.91
减：二、费用	1,748,776.77	1,824,731.53
1. 管理人报酬	490,025.41	503,834.82
2. 托管费	81,670.91	83,972.52
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,093,415.50	1,115,589.37
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	83,664.95	121,334.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-5,218,650.48	-672,715.20
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-5,218,650.48	-672,715.20

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信发展主题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）	57,408,766.00	11,666,723.81	69,075,489.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-5,218,650.48	-5,218,650.48
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）	-4,906,018.50	-1,042,216.16	-5,948,234.66
其中：1.基金申购款	717,896.45	133,352.87	851,249.32
2. 基金赎回款	-5,623,914.95	-1,175,569.03	-6,799,483.98
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）	52,502,747.50	5,405,857.17	57,908,604.67
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）	60,304,885.61	7,304,927.62	67,609,813.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-672,715.20	-672,715.20
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）	-1,052,197.33	-146,447.14	-1,198,644.47
其中：1.基金申购款	723,452.45	99,357.62	822,810.07
2.基金赎回款	-1,775,649.78	-245,804.76	-2,021,454.54
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）	59,252,688.28	6,485,765.28	65,738,453.56

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

泰信发展主题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[2010]第 1280 号《关于核准泰信发展主题股票型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《泰信发展主题股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 707,154,077.00 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(2010)第 400 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰信

发展主题股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 12 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 707,192,791.05 份基金份额，其中认购资金利息折合 38,714.05 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,泰信发展主题股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为泰信发展主题混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信发展主题混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金将基金资产的 60%-95%投资于股票，基金资产的 5%-40%投资于债券、现金类资产及权证、资产支持证券，其中，现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证不高于基金资产净值的 3%，资产支持证券不高于基金资产净值的 20%。本基金投资于发展主题相关上市公司的比例不低于股票投资资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：75% ×沪深 300 指数 ＋ 25% ×中证全债指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则－基本准则》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》、《 泰信发展主题混合型证券投资基金 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 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 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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本期及上年度可比期间本基金无应支付关联方佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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	490,025.41	-
其中：支付销售机构的客户维护费	81,898.04	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5 %年费率计提。基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。计算方法如下：每日应计提的基金管理费＝前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 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	81,670.91	-

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 2.5‰的年费率计提。基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

每日应计提的基金托管费＝前一日基金资产净值 X 2.5‰ / 当年天数。

6.4.8.2.3 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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 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	32,653,603.97	62.1900%	36,653,603.97	63.8500%

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中国工商银行	17,556,512.17	50,593.27	11,141,007.10	55,194.67

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。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金无须作说明的其他关联交易事项。

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

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

报告期末本基金未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

6.4.9.2 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	临时停牌	53.06	-	-	20,000	1,102,000.00	1,061,200.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10 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	45,437,500.23	71.41
	其中：股票	45,437,500.23	71.41
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	18,080,919.17	28.42
7	其他各项资产	107,457.20	0.17
8	合计	63,625,876.60	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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	25,780,760.00	44.52
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	4,190,800.64	7.24
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,478,400.00	2.55
I	信息传输、软件和信息技术服务	5,824,703.59	10.06

	业		
J	金融业	2,560,400.00	4.42
K	房地产业	1,098,000.00	1.90
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,730,036.00	2.99
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	2,774,400.00	4.79
S	综合	-	-
	合计	45,437,500.23	78.46

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	002371	北方华创	50,000	2,483,500.00	4.29
2	600845	宝信软件	94,000	2,476,900.00	4.28
3	300012	华测检测	301,400	1,730,036.00	2.99
4	300398	飞凯材料	86,300	1,688,028.00	2.91
5	300567	精测电子	21,000	1,671,600.00	2.89
6	000977	浪潮信息	70,000	1,669,500.00	2.88
7	603883	老百姓	18,304	1,522,160.64	2.63
8	603345	安井食品	43,000	1,505,000.00	2.60
9	600754	锦江股份	40,000	1,478,400.00	2.55
10	300122	智飞生物	32,000	1,463,680.00	2.53

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。

7.4 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	4,932,000.00	7.14
2	603799	华友钴业	4,700,887.00	6.81
3	002709	天赐材料	4,229,705.00	6.12
4	002236	大华股份	4,228,447.64	6.12
5	000799	酒鬼酒	4,208,199.00	6.09
6	300474	景嘉微	4,061,549.00	5.88
7	000426	兴业矿业	4,054,768.00	5.87
8	600585	海螺水泥	4,039,869.00	5.85
9	000789	万年青	4,026,540.54	5.83
10	601336	新华保险	3,986,596.00	5.77
11	002156	通富微电	3,872,460.12	5.61
12	300059	东方财富	3,815,368.00	5.52
13	600690	青岛海尔	3,640,022.00	5.27
14	601233	桐昆股份	3,378,232.00	4.89
15	600845	宝信软件	3,328,986.89	4.82
16	000858	五粮液	3,323,351.00	4.81
17	300398	飞凯材料	3,312,175.00	4.80
18	600031	三一重工	3,234,263.00	4.68
19	300122	智飞生物	3,174,562.00	4.60
20	002049	紫光国微	3,149,000.00	4.56
21	601601	中国太保	3,086,728.00	4.47
22	600019	宝钢股份	3,012,399.00	4.36
23	002439	启明星辰	2,934,884.43	4.25
24	002146	荣盛发展	2,895,800.00	4.19
25	600754	锦江股份	2,891,000.00	4.19
26	600048	保利地产	2,890,294.00	4.18
27	600028	中国石化	2,821,000.00	4.08
28	000977	浪潮信息	2,774,010.00	4.02
29	002812	创新股份	2,763,690.00	4.00
30	600340	华夏幸福	2,749,800.00	3.98

31	002304	洋河股份	2,740,400.00	3.97
32	300017	网宿科技	2,734,559.02	3.96
33	002648	卫星石化	2,734,000.00	3.96
34	601155	新城控股	2,665,832.00	3.86
35	600446	金证股份	2,663,083.00	3.86
36	600271	航天信息	2,642,851.00	3.83
37	000768	中航飞机	2,641,596.00	3.82
38	601939	建设银行	2,622,000.00	3.80
39	300182	捷成股份	2,534,026.00	3.67
40	600782	新钢股份	2,478,800.00	3.59
41	600884	杉杉股份	2,477,579.00	3.59
42	603345	安井食品	2,471,158.00	3.58
43	002371	北方华创	2,467,104.56	3.57
44	603019	中科曙光	2,369,512.00	3.43
45	002172	澳洋科技	2,359,190.00	3.42
46	600570	恒生电子	2,303,289.00	3.33
47	002458	益生股份	2,300,948.00	3.33
48	000703	恒逸石化	2,280,329.00	3.30
49	300178	腾邦国际	2,261,288.00	3.27
50	000951	中国重汽	2,225,455.40	3.22
51	300458	全志科技	2,167,125.00	3.14
52	300296	利亚德	2,138,367.00	3.10
53	300352	北信源	2,118,766.00	3.07
54	002624	完美世界	2,100,046.00	3.04
55	002396	星网锐捷	2,086,661.00	3.02
56	002460	赣锋锂业	2,074,250.00	3.00
57	300601	康泰生物	2,072,570.52	3.00
58	600138	中青旅	2,067,400.00	2.99
59	600562	国睿科技	2,059,805.00	2.98
60	601288	农业银行	2,044,600.00	2.96
61	600196	复星医药	2,043,122.00	2.96
62	002294	信立泰	2,035,000.00	2.95
63	603883	老百姓	2,028,787.00	2.94
64	002465	海格通信	2,024,265.00	2.93
65	601628	中国人寿	2,010,472.00	2.91
66	000002	万科 A	2,003,756.00	2.90

67	300353	东土科技	1,988,792.00	2.88
68	002769	普路通	1,970,938.00	2.85
69	600702	舍得酒业	1,935,900.00	2.80
70	600119	长江投资	1,934,848.87	2.80
71	600536	中国软件	1,931,913.00	2.80
72	300498	温氏股份	1,929,712.00	2.79
73	002466	天齐锂业	1,927,760.06	2.79
74	603993	洛阳钼业	1,908,000.00	2.76
75	300078	思创医惠	1,906,392.73	2.76
76	300170	汉得信息	1,898,000.00	2.75
77	300388	国祯环保	1,894,000.00	2.74
78	002268	卫士通	1,885,389.00	2.73
79	300070	碧水源	1,884,400.00	2.73
80	002470	金正大	1,873,357.00	2.71
81	002596	海南瑞泽	1,847,578.00	2.67
82	002279	久其软件	1,830,948.90	2.65
83	601699	潞安环能	1,827,967.00	2.65
84	002223	鱼跃医疗	1,827,446.00	2.65
85	000060	中金岭南	1,821,668.00	2.64
86	002320	海峡股份	1,820,756.80	2.64
87	002152	广电运通	1,817,400.00	2.63
88	002449	国星光电	1,807,525.00	2.62
89	300136	信维通信	1,801,163.00	2.61
90	002234	民和股份	1,798,943.00	2.60
91	600172	黄河旋风	1,798,718.00	2.60
92	601198	东兴证券	1,788,803.43	2.59
93	600352	浙江龙盛	1,764,134.60	2.55
94	600188	兖州煤业	1,757,300.00	2.54
95	603233	大参林	1,752,279.50	2.54
96	603365	水星家纺	1,712,980.00	2.48
97	300590	移为通信	1,709,842.00	2.48
98	002747	埃斯顿	1,707,711.00	2.47
99	300012	华测检测	1,701,780.00	2.46
100	300212	易华录	1,688,500.00	2.44
101	300424	航新科技	1,683,977.00	2.44
102	300133	华策影视	1,661,723.00	2.41

103	300161	华中数控	1,657,396.00	2.40
104	000729	燕京啤酒	1,638,600.00	2.37
105	600337	美克家居	1,636,212.00	2.37
106	601636	旗滨集团	1,629,449.00	2.36
107	300244	迪安诊断	1,611,304.00	2.33
108	601607	上海医药	1,604,218.00	2.32
109	300377	赢时胜	1,603,295.00	2.32
110	600030	中信证券	1,602,880.00	2.32
111	601998	中信银行	1,599,000.00	2.31
112	000776	广发证券	1,594,865.00	2.31
113	300316	晶盛机电	1,576,130.00	2.28
114	600511	国药股份	1,548,527.10	2.24
115	002798	帝欧家居	1,539,000.00	2.23
116	600338	西藏珠峰	1,534,000.00	2.22
117	600487	亨通光电	1,528,921.00	2.21
118	603589	口子窖	1,506,677.00	2.18
119	000613	大东海 A	1,501,049.00	2.17
120	300571	平治信息	1,495,500.00	2.17
121	600837	海通证券	1,491,894.00	2.16
122	300045	华力创通	1,481,799.00	2.15
123	300567	精测电子	1,480,408.00	2.14
124	000651	格力电器	1,457,018.00	2.11
125	000681	视觉中国	1,437,113.00	2.08
126	300232	洲明科技	1,434,646.00	2.08
127	600760	中航沈飞	1,416,000.00	2.05
128	300302	同有科技	1,408,000.00	2.04
129	002299	圣农发展	1,399,338.00	2.03
130	002568	百润股份	1,397,618.96	2.02

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	6,223,361.00	9.01

2	002709	天赐材料	5,514,346.69	7.98
3	601233	桐昆股份	4,807,457.00	6.96
4	002156	通富微电	4,172,884.00	6.04
5	300316	晶盛机电	4,164,110.20	6.03
6	000426	兴业矿业	3,920,802.00	5.68
7	000789	万年青	3,906,080.00	5.65
8	600585	海螺水泥	3,889,331.00	5.63
9	600271	航天信息	3,881,436.14	5.62
10	603799	华友钴业	3,823,143.00	5.53
11	300059	东方财富	3,818,880.95	5.53
12	300474	景嘉微	3,809,712.00	5.52
13	601288	农业银行	3,764,200.00	5.45
14	600048	保利地产	3,724,918.00	5.39
15	300232	洲明科技	3,514,916.90	5.09
16	002049	紫光国微	3,430,395.00	4.97
17	600760	中航沈飞	3,339,040.00	4.83
18	600031	三一重工	3,246,600.00	4.70
19	600019	宝钢股份	3,217,704.62	4.66
20	000799	酒鬼酒	3,120,639.00	4.52
21	002798	帝欧家居	3,064,490.12	4.44
22	300017	网宿科技	3,000,448.15	4.34
23	600487	亨通光电	2,996,800.00	4.34
24	000858	五粮液	2,953,540.00	4.28
25	002439	启明星辰	2,944,554.78	4.26
26	002146	荣盛发展	2,828,782.51	4.10
27	002812	创新股份	2,685,640.00	3.89
28	000768	中航飞机	2,652,591.99	3.84
29	002236	大华股份	2,627,321.00	3.80
30	002531	天顺风能	2,613,240.00	3.78
31	600028	中国石化	2,576,000.00	3.73
32	603019	中科曙光	2,516,083.77	3.64
33	600340	华夏幸福	2,489,475.00	3.60
34	600884	杉杉股份	2,479,668.00	3.59
35	002202	金风科技	2,468,691.20	3.57
36	601155	新城控股	2,465,314.00	3.57
37	600782	新钢股份	2,457,551.00	3.56
38	002458	益生股份	2,453,692.00	3.55
39	002648	卫星石化	2,449,486.00	3.55

40	600690	青岛海尔	2,448,787.00	3.55
41	000703	恒逸石化	2,445,327.00	3.54
42	000002	万科 A	2,428,912.00	3.52
43	002172	澳洋科技	2,407,462.74	3.49
44	600446	金证股份	2,401,125.00	3.48
45	601336	新华保险	2,368,273.00	3.43
46	300458	全志科技	2,342,004.85	3.39
47	600216	浙江医药	2,296,510.60	3.32
48	601939	建设银行	2,262,200.00	3.27
49	002640	跨境通	2,250,715.00	3.26
50	600196	复星医药	2,231,961.00	3.23
51	300178	腾邦国际	2,212,392.00	3.20
52	300352	北信源	2,173,200.00	3.15
53	000951	中国重汽	2,151,289.00	3.11
54	002027	分众传媒	2,117,270.00	3.07
55	000786	北新建材	2,114,194.00	3.06
56	600138	中青旅	2,102,972.49	3.04
57	300170	汉得信息	2,084,190.00	3.02
58	600562	国睿科技	2,071,345.00	3.00
59	002304	洋河股份	2,068,000.00	2.99
60	300296	利亚德	2,026,888.00	2.93
61	002460	赣锋锂业	2,019,200.00	2.92
62	300398	飞凯材料	2,012,054.25	2.91
63	600536	中国软件	1,998,000.00	2.89
64	002294	信立泰	1,990,319.00	2.88
65	600119	长江投资	1,986,767.00	2.88
66	300388	国祯环保	1,984,000.00	2.87
67	300353	东土科技	1,981,961.00	2.87
68	002268	卫士通	1,981,120.00	2.87
69	002466	天齐锂业	1,980,000.00	2.87
70	002234	民和股份	1,974,827.32	2.86
71	002747	埃斯顿	1,972,090.33	2.85
72	000910	大亚圣象	1,971,007.74	2.85
73	002449	国星光电	1,965,727.00	2.85
74	002371	北方华创	1,965,359.00	2.85
75	300377	赢时胜	1,962,144.00	2.84
76	300498	温氏股份	1,929,028.00	2.79
77	002279	久其软件	1,910,629.40	2.77

78	000613	大东海 A	1,896,207.00	2.75
79	300122	智飞生物	1,889,600.00	2.74
80	600521	华海药业	1,888,060.70	2.73
81	300070	碧水源	1,877,010.00	2.72
82	002624	完美世界	1,865,362.00	2.70
83	002465	海格通信	1,864,182.00	2.70
84	300590	移为通信	1,862,130.00	2.70
85	601628	中国人寿	1,861,798.38	2.70
86	600835	上海机电	1,859,334.00	2.69
87	600038	中直股份	1,847,141.00	2.67
88	603900	莱绅通灵	1,845,300.00	2.67
89	300078	思创医惠	1,833,674.00	2.65
90	002152	广电运通	1,828,778.00	2.65
91	600702	舍得酒业	1,822,115.19	2.64
92	002596	海南瑞泽	1,816,353.00	2.63
93	002320	海峡股份	1,810,477.40	2.62
94	002769	普路通	1,793,040.00	2.60
95	300133	华策影视	1,788,772.00	2.59
96	000060	中金岭南	1,776,000.00	2.57
97	603993	洛阳钼业	1,766,000.00	2.56
98	600352	浙江龙盛	1,749,765.66	2.53
99	002470	金正大	1,740,600.00	2.52
100	300212	易华录	1,733,701.00	2.51
101	601699	潞安环能	1,729,087.00	2.50
102	000001	平安银行	1,727,800.00	2.50
103	600172	黄河旋风	1,719,830.00	2.49
104	300136	信维通信	1,714,041.00	2.48
105	002223	鱼跃医疗	1,688,117.00	2.44
106	601198	东兴证券	1,676,993.00	2.43
107	600388	龙净环保	1,661,257.00	2.40
108	600188	兖州煤业	1,655,166.00	2.40
109	601600	中国铝业	1,648,000.00	2.39
110	600337	美克家居	1,615,373.60	2.34
111	000063	中兴通讯	1,610,900.00	2.33
112	300244	迪安诊断	1,603,934.00	2.32
113	002299	圣农发展	1,591,110.65	2.30
114	300045	华力创通	1,565,812.00	2.27
115	000729	燕京啤酒	1,541,062.80	2.23

116	600030	中信证券	1,536,800.00	2.22
117	600197	伊力特	1,523,000.00	2.20
118	300424	航新科技	1,519,561.30	2.20
119	600183	生益科技	1,507,768.00	2.18
120	000661	长春高新	1,495,642.00	2.17
121	601636	旗滨集团	1,495,214.00	2.16
122	601607	上海医药	1,491,108.43	2.16
123	000776	广发证券	1,485,454.00	2.15
124	600511	国药股份	1,484,400.00	2.15
125	601766	中国中车	1,465,200.00	2.12
126	603365	水星家纺	1,450,000.00	2.10
127	000977	浪潮信息	1,441,333.01	2.09
128	603589	口子窖	1,436,770.00	2.08
129	601998	中信银行	1,429,150.00	2.07
130	300161	华中数控	1,410,004.00	2.04
131	600410	华胜天成	1,394,474.60	2.02
132	601666	平煤股份	1,391,000.00	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	362,458,168.34
卖出股票收入（成交）总额	372,648,984.32

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	89,164.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,311.94
5	应收申购款	14,980.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	107,457.20

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

注：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	户均持有的	持有人结构

(户)	基金份额	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
839	62,577.77	32,653,603.97	62.19%	19,849,143.53	37.81%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	79,807.69	0.1520%

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	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	0~10
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（ 2010 年 12 月 15 日 ）基金份额总额	707,192,791.05
本报告期期初基金份额总额	57,408,766.00
本报告期基金总申购份额	717,896.45
减:本报告期基金总赎回份额	5,623,914.95
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	52,502,747.50

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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	
浙商证券	1	329,275,789.76	44.79%	300,068.70	45.77%	-

民生证券	1	113,065,186.94	15.38%	105,297.65	16.06%	-
天风证券	1	100,869,067.42	13.72%	73,765.11	11.25%	-
渤海证券	1	89,263,120.91	12.14%	81,345.65	12.41%	-
华泰证券	1	56,426,406.33	7.68%	52,549.91	8.02%	-
中国银河证券	1	25,259,605.91	3.44%	23,019.29	3.51%	-
中泰证券	1	16,532,309.39	2.25%	15,396.47	2.35%	-
东兴证券	1	4,415,666.00	0.60%	4,112.36	0.63%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	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：国信证券 上海 34699，国信证券深圳 397448；无退租交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

浙商证券		-	-	-	-	-	-
民生证券		-	-	-	-	-	-
天风证券		-	-	-	-	-	-
渤海证券		-	-	-	-	-	-
华泰证券		-	-	-	-	-	-
中国银河证券		-	-	-	-	-	-
中泰证券		-	-	-	-	-	-
东兴证券		-	-	-	-	-	-
国信证券		-	-	-	-	-	-
新时代证券		-	-	-	-	-	-
华创证券		-	-	-	-	-	-
广发证券		-	-	-	-	-	-
中银国际		-	-	-	-	-	-
申万宏源		-	-	-	-	-	-
中山证券		-	-	-	-	-	-
国盛证券		-	-	-	-	-	-
兴业证券		-	-	-	-	-	-
瑞银证券		-	-	-	-	-	-
高华证券		-	-	-	-	-	-
川财证券		-	-	-	-	-	-
广州证券		-	-	-	-	-	-
东北证券		-	-	-	-	-	-

§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	20180101-20180630	36,653,603.97	0.00	4,000,000.00	32,653,603.97	62.19%
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。

泰信基金管理有限公司
2018 年 8 月 25 日