

泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3月31日

泰信现代服务业混合型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3月31日

基金管理人:泰信基金管理有限公司 基金托管人:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2017年4月21日 重要提示

本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司中国银行股份有限公司根据基金合同已于2017年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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并运用基金资产,但不保证基金一定盈利,基金的未来业绩并不代表其未来表现,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

本报告期为2017年1月1日起至3月31日止

82 基金产品概况

Table with 2 columns: Item and Value. Includes fund name, code, investment style, contract date, etc.

83 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: Item and Value. Financial indicators for the quarter.

注:1、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、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字

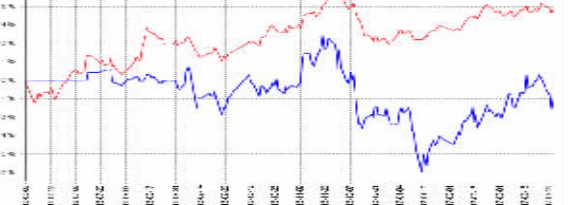
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益

3.2 基金净值表现 3.2.1 本报告期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

Table with 5 columns: Period, Net Value Growth Rate, Benchmark Return, etc.

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%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

4 基金管理人 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: Name, Position, Tenure, and Bio. Lists fund managers.

注:1、以上日期均是指公告的日期 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

报告期内,本基金管理人严格遵守《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

4.3 公平交易专项说明 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

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

进入2017年,在基建投资、三四线房地产和工业企业投资的带动下,制造业PMI、工业企业利润、进出口等经济数据持续向好,由此带来股票市场的轮动表现

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金单位净值为0.985元,本季度净值增长率为1.97%,同期业绩比较基准增长率为2.33%

85 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: Item, Amount, and Ratio. Portfolio composition at the end of the quarter.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 4 columns: Code, Industry, Fair Value, and Ratio. Domestic equity portfolio by industry.

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

5.3 报告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

Table with 5 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, and Ratio. Top 10 stocks by fair value.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 5.5 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债券投资明细

报告期末本基金未投资债券

5.6 报告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

5.7 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

5.8 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权证投资明细

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 5.10.1 本期国债期货持仓和损益明细

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 5.11.1 本期国债期货持仓和损益明细

5.12 报告期末本基金投资的期权交易情况说明 5.12.1 本期期权持仓和损益明细

5.13 其他资产构成

Table with 2 columns: Item and Amount. Other assets breakdown.

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.16 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

86 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: Item and Amount. Open-end fund share changes.

87 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 7.1 基金管理人持有本基金基金份额变动情况

88 影响投资者决策的其他重要信息 8.1 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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

89 备查文件目录 9.1 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

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》

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

报告送出日期:2017年4月21日 重要提示

本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司中国工商银行股份有限公司根据基金合同已于2017年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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并运用基金资产,但不保证基金一定盈利,基金的未来业绩并不代表其未来表现,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

本报告期为2017年1月1日起至3月31日止

82 基金产品概况

Table with 2 columns: Item and Value. Fund product details for the modern services fund.

83 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: Item and Value. Financial indicators for the quarter.

注:1、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

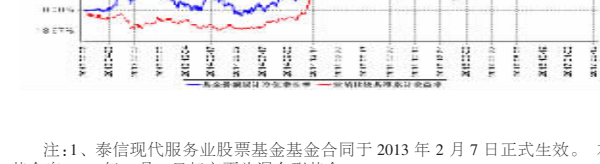
2、所述基金业绩指标不包括持有人申购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字

3.2 基金净值表现 3.2.1 本报告期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

Table with 5 columns: Period, Net Value Growth Rate, Benchmark Return, etc.

注:本基金业绩比较基准为:75%*沪深300指数+25%*中证全债指数

3.2.2 自基金合同生效以来基金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、泰信现代服务业股票基金合同于2013年2月7日正式生效 2、本基金的建仓期为六个月

4 基金管理人 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: Name, Position, Tenure, and Bio. Lists fund managers.

注:1、以上日期均是指公告的日期 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

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信现代服务业混合型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场的原则管理和运用基金资产

4.3 公平交易专项说明 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

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年一季度,市场震荡上行,成交交投放大,指数波动收放,市场风格持续偏向于低估值个股,建筑、水泥为代表的周期类个股表现强势,消费类个股、新能源等个股都有较好的表现

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金单位净值为1.631元,本季度基金净值增长率为2.19%,业绩比较基准增长率为3.22%

85 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: Item, Amount, and Ratio. Portfolio composition at the end of the quarter.

报告期末本基金未持有沪港通股票

5.3 报告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

Table with 5 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, and Ratio. Top 10 stocks by fair value.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.5 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债券投资明细

5.6 报告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

5.7 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

5.8 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权证投资明细

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 5.10.1 本期国债期货持仓和损益明细

5.11 报告期末本基金投资的期权交易情况说明 5.11.1 本期期权持仓和损益明细

5.12 其他资产构成

Table with 2 columns: Item and Amount. Other assets breakdown.

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.16 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

86 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: Item and Amount. Open-end fund share changes.

87 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 7.1 基金管理人持有本基金基金份额变动情况

88 影响投资者决策的其他重要信息 8.1 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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

89 备查文件目录 9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰信现代服务业股票型证券投资基金设立的文

2、《泰信现代服务业混合型证券投资基金基金合同》

3、《泰信现代服务业混合型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信现代服务业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

9.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的办公场所,供投资者免费查阅

9.3 查阅方式

投资者可直接登录基金管理人公司网站(www.ftfund.com)查阅上述相关文件

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

89 备查文件目录 9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰信现代服务业股票型证券投资基金设立的文

2、《泰信现代服务业混合型证券投资基金基金合同》

3、《泰信现代服务业混合型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信现代服务业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