

泰信中小盘精选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

Table with 2 columns: Item (基金简称, 交易代码, etc.) and Value (泰信中小盘精选混合, 290011, etc.)

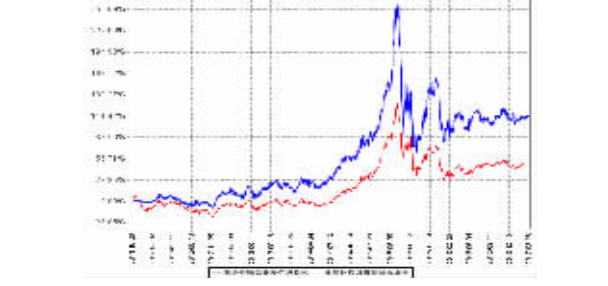
§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (5,321,738.04, 1,702,650.17, etc.)

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... 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...

3.2 基金净值表现

Table with 4 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益差③, 业绩比较基准收益差标准差④, ①-③, ②-④



注:1、泰信中小盘精选股票基金基金合同于 2011 年 10 月 26 日正式生效。本基金于 2015 年 8 月 7 日起变更为混合型基金。 2、本基金建仓期为六个月。建仓期间,本基金将基金资产的 60%-95%投资于股票,现金类资产在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%...

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明

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; 3、基金经理的姓名及任职日期、离任日期及公告日期,均以中国证监会公告为准...

4.3 公平交易专项说明

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》,适用于所有投资组合,以及所有投资管理活动... 4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年一季度,宏观经济基本面延续了 2015 年下半年以来的复苏态势,伴随着上游资源价格的上涨,复苏趋势开始向中下游传导,我们看到地产后周期的家电、食品饮料、汽车等主要消费品行业迎来了业绩与估值的双重提升...

§5 投资组合报告

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

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

报告期末本基金未持有债券。

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

报告期末本基金未持有资产支持证券。

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

报告期末本基金未持有贵金属。

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

报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期末本基金未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金本报告投资的前十名证券中无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、处罚的证券情况说明。

5.11.2 报告期内本基金投资的前十名证券中无在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。

§6 开放式基金资产净值

Table with 2 columns: 单位:份, 项目

§7 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

Table with 2 columns: 单位:份, 项目

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内本基金持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

Table with 4 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例(%)

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

§9 备查文件目录

- 1. 中国证监会批准泰信中小盘精选股票型证券投资基金设立的文件
- 2. 《泰信中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》
- 3. 《泰信中小盘精选混合型证券投资基金招募说明书》
- 4. 《泰信中小盘精选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、营业执照和公司章程
- 7. 存放地点
- 8. 报告存放地点
- 9. 查阅方式

泰信基金管理有限公司 2017 年 4 月 21 日

泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金 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:中国工商银行股份有限公司 报告送出日期:2017 年 4 月 21 日

Table with 2 columns: Item (基金简称, 场内简称, 交易代码, etc.) and Value (泰信基本面 400 指数分级, 泰信 400, 162907, etc.)

§3 主要财务指标和基金净值表现

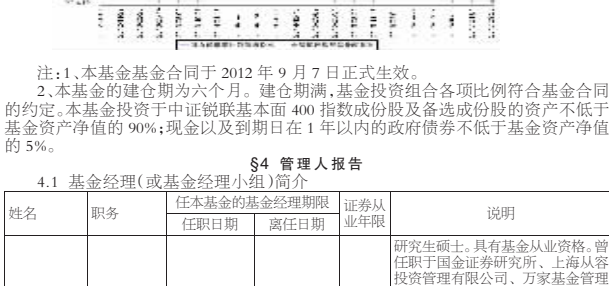
3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-248,769.05, 1,337,874.83, etc.)

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

Table with 4 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益差③, 业绩比较基准收益差标准差④, ①-③, ②-④



注:1、本基金基金合同于 2012 年 9 月 7 日正式生效。 2、本基金的建仓期为六个月。建仓期间,本基金投资组合各项比例符合基金合同的约定。本基金投资于中证锐联基本面 400 指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明

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; 3、基金经理的姓名及任职日期、离任日期及公告日期,均以中国证监会公告为准...

4.3 公平交易专项说明

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》,适用于所有投资组合,以及所有投资管理活动... 4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度,在经历 1 月份快速调整之后,市场走势较好。上证综指上涨 3.83%,中小板上涨 4.22%,创业板下跌 2.76%,结构性机会相对突出,多数行业上涨,家电、食品饮料、国防军工涨幅居前。消费类板块走强,周期类板块波动较大,而 TMT 板块仍处于弱势。

4.5 报告期末基金资产净值

报告期末基金资产净值为 5,212,869.00 元,本报告期末基金份额净值为 1.00 元。

5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.1 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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。

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: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3.2 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股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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。

5.4 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

报告期末本基金未持有债券。

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。

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五名贵金属投资明细

报告期末本基金未持有贵金属。

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权证投资明细

报告期末本基金未持有权证。

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。

5.9 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

报告期末本基金未持有权证。

5.10 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。

5.11 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

报告期末本基金未持有权证。

5.12 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。

5.13 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.1 报告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。

5.11.2 报告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。

5.11.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。

§6 开放式基金资产净值

Table with 2 columns: 单位:份, 项目

§7 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

Table with 2 columns: 单位:份, 项目

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内本基金持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

Table with 4 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例(%)

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

§9 备查文件目录

- 1. 中国证监会批准泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金设立的文件
- 2. 《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》
- 3. 《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金招募说明书》
- 4. 《泰信中证锐联基本面 400 指数分级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、营业执照和公司章程
- 7. 存放地点
- 8. 报告存放地点
- 9. 查阅方式

泰信基金管理有限公司 2017 年 4 月 21 日