

泰信鑫选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

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

§1 重要提示

本基金管理人的董事会及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责任。

本基金的托管人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和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,基金的实际业绩并不表示其未来表现。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。

本报告期内基金资产净值未发生变动。

本报告期为2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金基本情况

Table with 2 columns: 基金名称, 泰信鑫选混合A; 基金代码, 001970; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2016年2月4日; 报告期末基金份额总额, 35,083,846.40份; 投资策略, 本基金在严格控制风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳定增值;

注:截至报告期末本基金C份额为0份。

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

Table with 3 columns: 主要财务指标, 泰信鑫选混合A, 泰信鑫选混合C; 1. 本期已实现收益, 174,207.51, 49,333.14; 2. 本期利润, 667,820.71, 56,171.63; 3. 加权平均基金份额本期利润, 0.0156, 0.0234; 4. 期末基金资产净值, 36,286,304.00, -; 5. 期末基金份额净值, 1.017, -

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。

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、截至报告期末本基金C份额为0份。

3.1 基金净值表现

3.1.1 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 2 columns: 泰信鑫选混合A, 泰信鑫选混合C; 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④; 过去三个月, 1.60%, 0.22%, 2.53%, 0.29%, -0.93%, -0.07%

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%

3.1.2 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

Table with 2 columns: 泰信鑫选混合A, 泰信鑫选混合C; 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④; 过去三个月, 1.60%, 0.43%, 2.53%, 0.29%, -0.93%, 0.14%

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%

3.2 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

票仓位控制在较低水平,获取股市反弹收益,等待安全垫积累到较高程度或规模有一定增长后积极参与网下新股申购。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金A份额单位净值为1.017元,本季度净值增长率为1.60%,业绩比较基准增长率为2.53%;本基金C份额单位净值为1.017元,本季度净值增长率为1.60%,业绩比较基准增长率为2.53%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期末基金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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%); 1 权益投资, 8,970,240.86, 24.54; 其中:股票, 8,970,240.86, 24.54; 2 基金投资, -; 3 固定收益投资, 24,345,477.10, 66.59; 其中:债券, 24,345,477.10, 66.59; 4 贵金属投资, -; 5 金融衍生品投资, -; 6 买入返售金融资产, 800,000.00, 2.19; 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, 1,320,453.23, 3.61; 8 其他资产, 1,121,804.68, 3.07; 9 合计, 36,575,975.87, 100.00

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 3 columns: 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, 155,000.00, 0.43; B 采矿业, -; C 制造业, 8,119,940.86, 22.38; 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 信息技术、软件和信息技术服务业, -; J 金融业, -; K 房地产业, 695,300.00, 1.92; 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 卫生、医药和医疗保健业, -; 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, 8,970,240.86, 24.72

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(%); 1 002214 大立科技, 250,921, 3,176,659.86, 8.75; 2 600875 南京医药, 140,000, 2,090,200.00, 5.76; 3 600755 上海机电, 50,000, 1,081,500.00, 2.98; 4 600792 盐湖股份, 50,000, 919,500.00, 2.53; 5 601566 九牧王, 50,000, 849,500.00, 2.34; 6 000882 华测检测, 170,000, 695,300.00, 1.92; 7 300106 西药药业, 10,000, 155,000.00, 0.43; 8 002250 联化科技, 100, 1,573.00, 0.00; 9 000172 润兴科技, 100, 1,008.00, 0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1 国家债券, -; 2 央行票据, -; 3 金融债券, -; 其中:政策性金融债, -; 4 企业债券, 23,516,477.10, 64.81; 5 企业短期融资券, -; 6 中期票据, -; 7 可转债(可交换债), 829,000.00, 2.28; 8 同业存单, -; 9 其他, -; 10 合计, 24,345,477.10, 67.09

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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1 120203 02中移(15), 35,980, 3,608,074.40, 9.94; 2 122229 12国电01, 35,000, 3,518,900.00, 9.70; 3 122239 13中油01, 35,000, 3,516,100.00, 9.69; 4 122211 13海通04, 35,020, 3,508,653.80, 9.67; 5 122166 12国电04, 30,000, 3,000,000.00, 8.27

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期末本基金未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

报告期末本基金未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期末本基金未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元); 1 存出保证金, 14,808.75; 2 应收证券清算款, 701,167.50; 3 应收股利, -; 4 应收利息, 405,828.43; 5 应收申购款, -; 6 其他应收款, -; 7 待摊费用, -; 8 其他, -; 9 合计, 1,121,804.68

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 本报告涉及及会计数据相关比例,均以合计数据除以相关数据计算,而不是对不同比例进行合计。

§6 开放式基金份额变动

Table with 3 columns: 项目, 泰信鑫选混合A, 泰信鑫选混合C; 报告期初基金份额总额, 47,630,127.43, -; 报告期基金申购份额, 2,556,471.79, 9,829,794.86; 减:报告期基金赎回份额, -; 减:报告期基金总申购份额, 14,502,752.82, 9,829,794.86; 减:报告期基金总赎回份额, -; 报告期末基金份额总额, 35,083,846.40, -

注:截至报告期末本基金C份额为0份。

§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

本报告期基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金申购、赎回本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内基金投资运作合规性报告

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、原中国证监会批准泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

2、《泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信鑫选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

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。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印件或复印件。

9.3 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)查阅上述备查文件,或拨打客户服务电话(400-888-5988,010-38784566),和本基金管理人直接联系。

泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金 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:中信银行股份有限公司 报告送出日期:2017年4月21日

§1 重要提示

本基金管理人的董事会及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责任。

本基金的托管人中信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和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,基金的实际业绩并不表示其未来表现。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。

本报告期内基金资产净值未发生变动。

本报告期为2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金基本情况

Table with 2 columns: 基金名称, 泰信鑫益定期开放; 基金代码, 000212; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2013年7月17日; 报告期末基金份额总额, 161,371,288.96份; 投资策略, 本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行整体资产配置和债券资产配置,在深入研究宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例,在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上,根据策略配置原则对投资组合内各券种进行最佳配置和时点选择。

注:1、本基金业绩比较基准为:中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)+0.5%

2、本基金业绩比较基准为:中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)+0.5%

3、截至报告期末本基金C份额为0份。

3.1 基金净值表现

3.1.1 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 2 columns: 泰信鑫益定期开放A, 泰信鑫益定期开放C; 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④; 过去三个月, 0.00%, 0.07%, 0.50%, 0.01%, -0.50%, 0.00%

注:1、本基金业绩比较基准为:中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)+0.5%

2、本基金业绩比较基准为:中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)+0.5%

3、截至报告期末本基金C份额为0份。

3.2 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

Table with 2 columns: 泰信鑫益定期开放A, 泰信鑫益定期开放C; 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④; 过去三个月, -0.19%, 0.06%, 0.50%, 0.01%, -0.69%, 0.05%

注:本基金业绩比较基准为:中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)+0.5%

3.2 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

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

3.2.2 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

3.2.3 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

3.2.4 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

3.2.5 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

3.2.6 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

3.2.7 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

3.2.8 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

3.2.9 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

3.2.10 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

3.2.11 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

3.2.12 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

3.2.13 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

3.2.14 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

3.2.15 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

3.2.16 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

3.2.17 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

3.2.18 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

3.2.19 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

3.2.20 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

3.2.21 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

3.2.22 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

3.2.23 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

3.2.24 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

3.2.25 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

3.2.26 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

3.2.27 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

3.2.28 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

3.2.29 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

3.2.30 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

3.2.31 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

3.2.32 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

3.2.33 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

3.2.34 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

3.2.35 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

3.2.36 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

3.2.37 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

3.2.38 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

3.2.39 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

3.2.40 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

3.2.41 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

3.2.42 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

3.2.43 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

3.2.44 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

3.2.45 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

3.2.46 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

3.2.47 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

3.2.48 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

3.2.49 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

3.2.50 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

3.2.51 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

3.2.52 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

3.2.53 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

3.2.54 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

3.2.55 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

3.2.56 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

3.2.57 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

3.2.58 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

3.2.59 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

3.2.60 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

3.2.61 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

3.2.62 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

3.2.63 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

3.2.64 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

3.2.65 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

3.2.66 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

3.2.67 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

3.2.68 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

3.2.69 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

3.2.70 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

3.2.71 本报告