

泰信行业精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

本基金经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。

本报告期内未发生基金份额持有人申购或赎回基金份额的事项。

本报告期为2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

Table with columns: 基金简称, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 下属分级基金的基金简称, 下属分级基金的交易代码, 报告期末下属分级基金的份额总额

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

3.1 主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

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。

3.2 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 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

泰信行业精选混合 C

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

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

3.2.2 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

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 1.168 元,本季度净值增长率为 3.03%,业绩比较基准增长率为 2.53%;本基金 C 份额单位净值为 1.168 元,本季度净值增长率为 3.12%,业绩比较基准增长率为 2.53%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 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

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 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

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 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

Table with columns: 序号, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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 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(%)

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

5.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.13 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.14 报告期末本基金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 本报告涉及公允价值相关信息的,均以公允价值除以相关数据计算,而不是对同比例进行合计。

§6 开放式基金份额变动

Table with columns: 项目, 泰信行业精选混合 A, 泰信行业精选混合 C

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

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

§8 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

8.3 影响投资者决策的其他重要信息

8.4 影响投资者决策的其他重要信息

8.5 影响投资者决策的其他重要信息

8.6 影响投资者决策的其他重要信息

8.7 影响投资者决策的其他重要信息

8.8 影响投资者决策的其他重要信息

8.9 影响投资者决策的其他重要信息

8.10 影响投资者决策的其他重要信息

8.11 影响投资者决策的其他重要信息

8.12 影响投资者决策的其他重要信息

8.13 影响投资者决策的其他重要信息

8.14 影响投资者决策的其他重要信息

8.15 影响投资者决策的其他重要信息

8.16 影响投资者决策的其他重要信息

8.17 影响投资者决策的其他重要信息

8.18 影响投资者决策的其他重要信息

8.19 影响投资者决策的其他重要信息

8.20 影响投资者决策的其他重要信息

泰信国策驱动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

本基金经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。

本报告期内未发生基金份额持有人申购或赎回基金份额的事项。

本报告期为2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

Table with columns: 基金简称, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 下属分级基金的基金简称, 下属分级基金的交易代码, 报告期末下属分级基金的份额总额

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

3.1 主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

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。

3.2 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 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

注: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%

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

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 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

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 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

Table with columns: 序号, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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 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(%)

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权证投资明细

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

5.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.13 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.14 报告期末本基金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 本报告涉及公允价值相关信息的,均以公允价值除以相关数据计算,而不是对同比例进行合计。

§6 开放式基金份额变动

Table with columns: 项目, 泰信国策驱动混合 A, 泰信国策驱动混合 C

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

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

§8 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

8.3 影响投资者决策的其他重要信息

8.4 影响投资者决策的其他重要信息

8.5 影响投资者决策的其他重要信息

8.6 影响投资者决策的其他重要信息

8.7 影响投资者决策的其他重要信息

8.8 影响投资者决策的其他重要信息

8.9 影响投资者决策的其他重要信息

8.10 影响投资者决策的其他重要信息

8.11 影响投资者决策的其他重要信息

8.12 影响投资者决策的其他重要信息

8.13 影响投资者决策的其他重要信息

8.14 影响投资者决策的其他重要信息

8.15 影响投资者决策的其他重要信息

8.16 影响投资者决策的其他重要信息

8.17 影响投资者决策的其他重要信息

8.18 影响投资者决策的其他重要信息

8.19 影响投资者决策的其他重要信息

8.20 影响投资者决策的其他重要信息

泰信基金管理有限公司 2017 年 4 月 21 日

泰信基金管理有限公司 2017 年 4 月 21 日