

泰信行业精选混合型证券投资基金
(原泰信保本混合型证券投资基金)
2015 年第 1 季度报告

2015 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：2015 年 4 月 22 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 2015 年 4 月 21 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。

本基金系原泰信保本混合型证券投资基金保本到期转型而来。根据《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，该基金的保本期为三年。自《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》生效之日（2012 年 2 月 22 日）起至三个公历年后对应日 2015 年 2 月 25 日（依据《基金合同》规定如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日）止，该保本周期到期。保本周期到期后，依据《基金合同》规定，本基金未能符合保本基金存续条件，该基金转型为非保本的混合型证券投资基金，基金名称变更为“泰信行业精选混合型证券投资基金”。经基金管理人和基金托管人同意，本基金管理人对转型后的《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》进行了修改，并据此修改了《泰信行业精选混合型证券投资基金托管协议》、更新了《泰信行业精选混合型证券投资基金招募说明书》，并报中国证监会备案。自 2015 年 3 月 4 日起，《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》转型生效，《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》自该日起失效。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告中，原泰信保本混合型证券投资基金报告期为 2015 年 1 月 1 日起至 3 月 3 日止；泰信行业精选混合型证券投资基金报告期为 2015 年 3 月 4 日至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

转型后：

| | |
|------|----------|
| 基金简称 | 泰信行业精选混合 |
|------|----------|

| | |
|------------|---|
| 交易代码 | 290012 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 3 月 4 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 346, 592, 768. 18 份 |
| 投资目标 | 把握行业发展趋势和市场运行趋势，在经济发展以及市场运行的不同阶段所蕴含的行业投资机会，在控制风险的前提下，追求基金资产的稳定增值。 |
| 投资策略 | 紧密跟踪中国经济动向，把握中国经济的长期发展趋势和周期变动特征，挖掘不同发展阶段下的行业投资机会，综合运用主题投资、行业轮动等投资策略，追求基金资产的长期、持续增值。本基金将结合“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”的个券精选策略，同时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 | 沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品。 |
| 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 |

转型前：

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 泰信保本混合 |
| 交易代码 | 290012 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012 年 2 月 22 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 283, 272, 972. 80 份 |
| 投资目标 | 本基金通过运用优化的恒定比例组合保险方法（CPPI），在保证保本期到期本金安全的基础上，寻求资产的稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金以优化的恒定比例组合保险方法（CPPI）为基础来实现保本和增值，在保本周期中，通过严格的投资纪律约束和风险管理，对基金的资产配置进行优化动态调整，确保投资者的投资本金的安全性。同时，通过积极稳健的收益资产投资策略，谋取基金资产的增值。 |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款的税后收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金为保本基金，属于证券投资基金中的低风险品种。 |
| 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 |
|-------|------------|

§ 3 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

| 主要财务指标 | 转型后 |
|-----------------|--------------------------------------|
| 报告期 | (2015 年 3 月 4 日 — 2015 年 3 月 31 日) |
| 1. 本期已实现收益 | 13,028,562.44 |
| 2. 本期利润 | 11,751,864.08 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0391 |
| 4. 期末基金资产净值 | 406,222,352.88 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.172 |

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。

3.1 主要财务指标

| 主要财务指标 | 转型前 |
|-----------------|-------------------------------------|
| 报告期 | (2015 年 1 月 1 日 — 2015 年 3 月 3 日) |
| 1. 本期已实现收益 | 7,446,950.43 |
| 2. 本期利润 | -9,258,905.05 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0310 |
| 4. 期末基金资产净值 | 321,355,941.96 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.134 |

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。

3.2 基金净值表现（转型后）

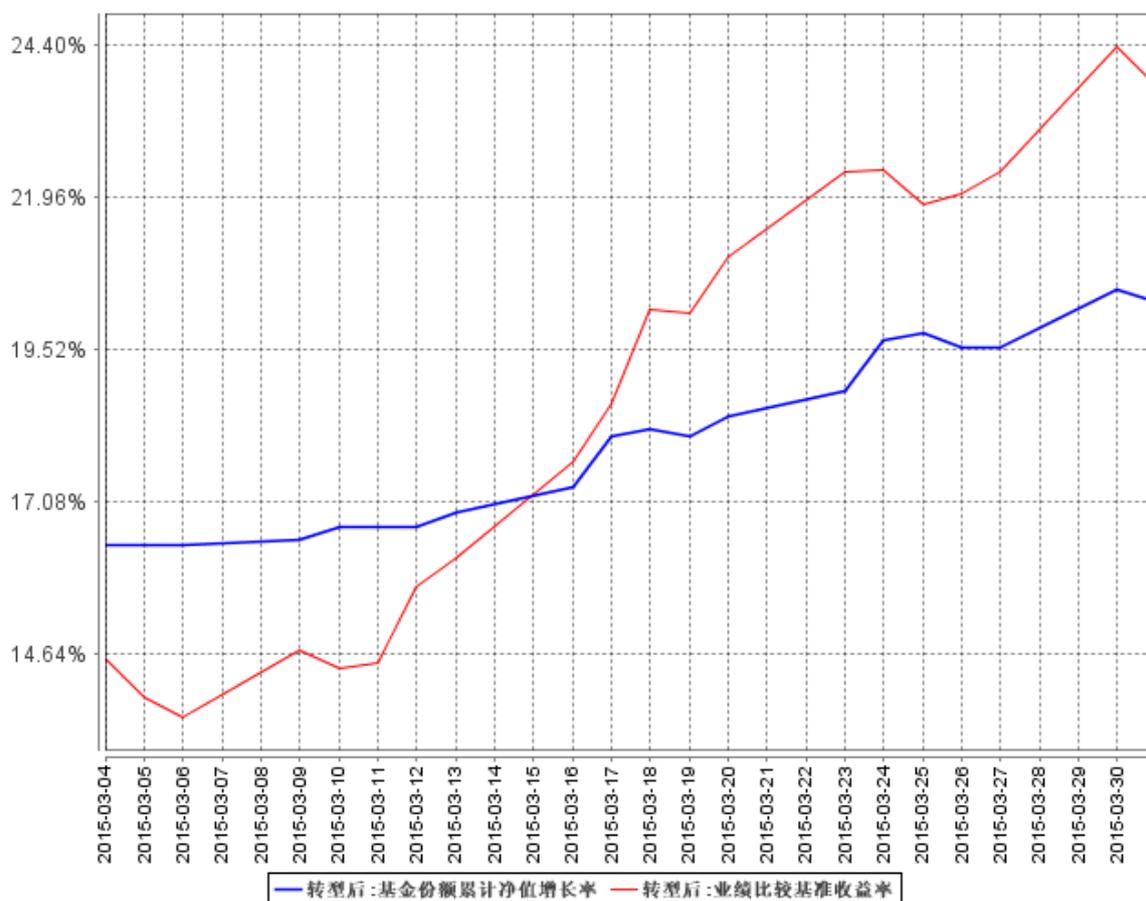
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 |
|----------------------|--------|---------------|----------------|-------------------|--------|--------|
| 2015年3月4 日--3月31日 | 3.35% | 0.28% | 7.99% | 0.67% | -4.64% | -0.39% |

注：沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%

3.2.2 自基金合同转型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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2015 年 3 月 4 日正式转型生效。

2、本基金的建仓期为六个月，截至 2015 年 3 月 31 日本基金仍在建仓期。建仓期满，本基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 30%-80%；债券投资比例为基金资产的 15%-65%；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；并保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

| 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 |
|---------------------|--------|---------------|----------------|-------------------|--------|-------|
| 2015年1月1日 --3月3日 | -2.81% | 1.73% | 0.69% | 0.02% | -3.50% | 1.71% |

注：本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款的税后收益率。

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 2012 年 2 月 22 日正式生效。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满，本基金的投资组合比例为：股票、权证等收益资产占基金资产的 0%-40%，其中，持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的 60%-100%，其中，基金持有现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例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（转型前）

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-------|-------------------|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 董山青先生 | 基金投资部总监助理、本基金基金经理 | 2012年2月22日 | - | 11年 | 香港大学工商管理硕士，CFA。具有基金、期货从业资格。曾任职于中国银行上海分行。2004年8月加入泰信基金管理有限公司，先后在清算会计部、研究部工作，曾任泰信优势增长基金经理助理。2010年9月至2012年10月担任研究总监助理职务。现同时担任基金投资部总监助理职务。 |

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合规守信情况的说明

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》、《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》、《泰信行业精选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 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，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相关的各环节，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，基金经理严格遵守公平、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本基金与其他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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

债券市场本季度先涨后跌，走出震荡调整行情。利率债收益率先受经济悲观及宽松货币政策预期下行，而后受到地方政府债务置换计划预期冲击快速反弹。信用债在利率债背景下，同样走出区间震荡行情，中票及城投产品中长久期表现优于短久期，低等级表现优于高等级。民营企业信用事件增加也逐渐引发市场担忧，ST 湘鄂债成为首支违约的公募债券。转债市场伴随 A 股走势呈现区间波动行情，多只转债面临赎回，一季度新发转债表现较好。

股票市场上证综指本季度震荡大涨，中小盘类的成长股表现优于大盘股。本季度上证综指涨幅 18.39%，中小板综指涨幅 46.38%，创业板指涨幅 59.93%。新股持续增量发行，涨幅依旧可观。

报告期内正是本基金转型期间，根据合同要求保持较低股票仓位较低。转型后的建仓期，申购和赎回难以确定，因此在当前资本市场环境下，基于基金的风险收益定位、中长期的市场判断及持有人的利益，本基金以新股申购为核心策略；同时，基于对二级市场股票投资所持审慎态度，本基金在以新股申购为核心策略期间将主动买入股票仓位控制在较低水平，并且债券组合以保持流动性为主要目的，债券组合久期 1-2 年左右，AA 及 AA 以上的流动性好，安全性高的债券品种，以 AAA 为主，适当配置 AA+，少量配置 AA 国有债券。后期根据市场信号适当调整策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

原泰信保本混合型证券投资基金在报告期（自 2015 年 1 月 1 日至 3 月 3 日）净值增长率为 -2.81%，业绩比较基准增长率为 0.69%；自保本基金合同成立以来净值增长率为 16.39%，实现了为投资者保本的目标。

转型后泰信行业精选混合型证券投资基金在报告期（自 2015 年 3 月 4 日至 3 月 31 日）净值增长率为 3.35%，业绩比较基准增长率为 7.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一段时间，弱复苏进行中，管理层继续推行宽松的货币政策。受油价大幅下跌影响，

CPI 继续维持低位, 经济政策继续底线思维, 推出一路一带、自贸区和京津冀区域规划等政策, 稳住传统产业, 实现过剩产能向海外转移, 平稳推动产业转型。稳增长政策的着力点包括, 继续抓前期政策落实, 大力推进改革和强化定向调控, 新兴产业和新兴业态将得到更多政策支持。

未来一段时间, 市场关注的焦点在于宏观经济及市场流动性变化。后者受股市上涨带动市场风险偏好提升, IPO 增量发行扰动, 财政存款季节性投放等因素影响, 二季度仍面临一定压力。央行在 4 月初货币政策例会上明确“继续实施稳健的货币政策, 更加注重松紧适度”, “保持适度流动性, 实现货币信贷及社会融资规模合理增长”的总体思路, 我们判断货币政策仍有进一步宽松的空间, 信贷有望维持偏松, 但央行更多将在稳增长、调结构、化解存量债务风险背景下进行流动性对冲操作, 市场资金或继续维持紧平衡。

注册制预计第四季度可能推出, 新股持续不断增量上市, 将逐渐对成长股估值体系造成影响, 新股网下申购可能出现中签率提高的重要投资机会。未来一段时间, 国企改革和互联网是关注重点。二季度债券市场或在宏观企稳, 流动性紧平衡环境下整体呈现区间震荡表现, 债市以持有票息收益为主, 注意防范低评级债券下调评级和个别公司出现信用风险, 转债品种中仍关注新发转债的投资机会及尚无赎回风险的存量主题性标的。

§ 5 投资组合报告

转型后：泰信行业精选混合型证券投资基金

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额 (元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 61,283,219.88 | 13.52 |
| | 其中：股票 | 61,283,219.88 | 13.52 |
| 2 | 固定收益投资 | 122,894,400.74 | 27.10 |
| | 其中：债券 | 122,894,400.74 | 27.10 |
| | 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 | 195,000,000.00 | 43.01 |
| | 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 | 34,100,241.29 | 7.52 |
| 7 | 其他资产 | 40,136,895.31 | 8.85 |
| 8 | 合计 | 453,414,757.22 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 11,273,994.72 | 2.78 |
| C | 制造业 | 33,190,085.16 | 8.17 |
| 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 | 116,500.00 | 0.03 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 12,204,000.00 | 3.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 743,000.00 | 0.18 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 3,746,000.00 | 0.92 |
| 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 | 9,640.00 | 0.00 |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 61,283,219.88 | 15.09 |

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

| 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 | 601872 | 招商轮船 | 1,800,000 | 12,204,000.00 | 3.00 |
| 2 | 600395 | 盘江股份 | 869,907 | 11,273,994.72 | 2.78 |
| 3 | 002353 | 杰瑞股份 | 269,901 | 10,377,693.45 | 2.55 |
| 4 | 300086 | 康芝药业 | 422,167 | 7,691,882.74 | 1.89 |
| 5 | 600332 | 白云山 | 199,960 | 6,832,633.20 | 1.68 |
| 6 | 600114 | 东睦股份 | 310,000 | 5,697,800.00 | 1.40 |
| 7 | 000042 | 中洲控股 | 200,000 | 3,746,000.00 | 0.92 |
| 8 | 600060 | 海信电器 | 99,950 | 2,321,838.50 | 0.57 |
| 9 | 002657 | 中科金财 | 10,000 | 743,000.00 | 0.18 |
| 10 | 300435 | 中泰股份 | 8,849 | 249,807.27 | 0.06 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 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 | 18,707,425.60 | 4.61 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 104,186,975.14 | 25.65 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 122,894,400.74 | 30.25 |

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

| 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 | 122051 | 10 石化 01 | 414,500 | 41,408,550.00 | 10.19 |
| 2 | 112090 | 12 中兴 01 | 317,021 | 31,683,078.74 | 7.80 |
| 3 | 122153 | 12 京能 01 | 191,500 | 19,150,000.00 | 4.71 |
| 4 | 122140 | 12 宁港 01 | 119,340 | 11,935,193.40 | 2.94 |
| 5 | 019321 | 13 国债 21 | 85,000 | 8,525,500.00 | 2.10 |

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

报告期末本基金未投资贵金属。

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

截至报告期末本基金未投资股指期货。

5.9.2 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。

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

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.10.3 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。

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本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

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 515,763.98 |
| 2 | 应收证券清算款 | 30,647,713.09 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,334,640.19 |
| 5 | 应收申购款 | 5,638,778.05 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 40,136,895.31 |

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

报告期末本基金前十名股票中存在流通受限情况。

5.11.6 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。

转型前：泰信保本混合型证券投资基金

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 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 | 239,478,377.20 | 73.45 |
| 7 | 其他资产 | 86,555,767.62 | 26.55 |
| 8 | 合计 | 326,034,144.86 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末本基金未投资股票。

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

报告期末本基金未投资股票。

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

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本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

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 515,763.98 |
| 2 | 应收证券清算款 | 85,963,326.72 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 76,676.92 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |

| | | |
|---|------|---------------|
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 86,555,767.62 |

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不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同转型生效日（2015年3月4日）基金份额总额 | 279,050,292.85 |
| 报告期期初基金份额总额 | - |
| 报告期期间基金总申购份额 | 116,718,001.02 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 49,175,525.69 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 346,592,768.18 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

单位：份

| | |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 39,524,703.56 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 39,524,703.56 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 11.40 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

本报告期基金管理人未运用固有资金申购、赎回本基金。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

单位：份

| | |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 39,524,703.56 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 39,524,703.56 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 13.95 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

本报告期基金管理人未运用固有资金申购、赎回本基金。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰信行业精选混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信行业精选混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信行业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和营业执照

8.2 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制件或复印件。

8.3 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)查阅上述相关文件，或拨打客户服务中心电话(400-888-5988, 021-38784566)，和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司
2015 年 4 月 22 日