

泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告 摘要

2017 年 12 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

送出日期：2018 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰信智选成长混合
基金主代码	003333
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 21 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
报告期末基金份额总额	81,051,093.99 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过相对灵活的资产配置，重点投资于受益于中国经济发展而快速成长的上市公司，谋求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金将结合“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”的个股精选策略，注重股票资产在其各相关行业的配置，并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波动的风险。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡囡	郭明
	联系电话	021-20899098	(010) 66105799
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-5988	95588
传真		021-20899008	(010) 66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ftfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年 12 月 21 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-4,170,170.87	310,176.51
本期利润	-3,794,504.94	310,176.51
加权平均基金份额本期利润	-0.0266	0.0009
本期基金份额净值增长率	-5.90%	0.09%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0742	0.0009
期末基金资产净值	76,330,627.99	348,499,456.45
期末基金份额净值	0.9418	1.0009

注：1、本基金基金合同于 2016 年 12 月 21 日正式生效。

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、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。

4、期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-7.49%	0.74%	3.10%	0.48%	-10.59%	0.26%
过去六个月	-4.92%	0.65%	6.04%	0.42%	-10.96%	0.23%

过去一年	-5.90%	0.49%	12.98%	0.38%	-18.88%	0.11%
自基金合同生效起至今	-5.82%	0.48%	13.09%	0.38%	-18.91%	0.10%

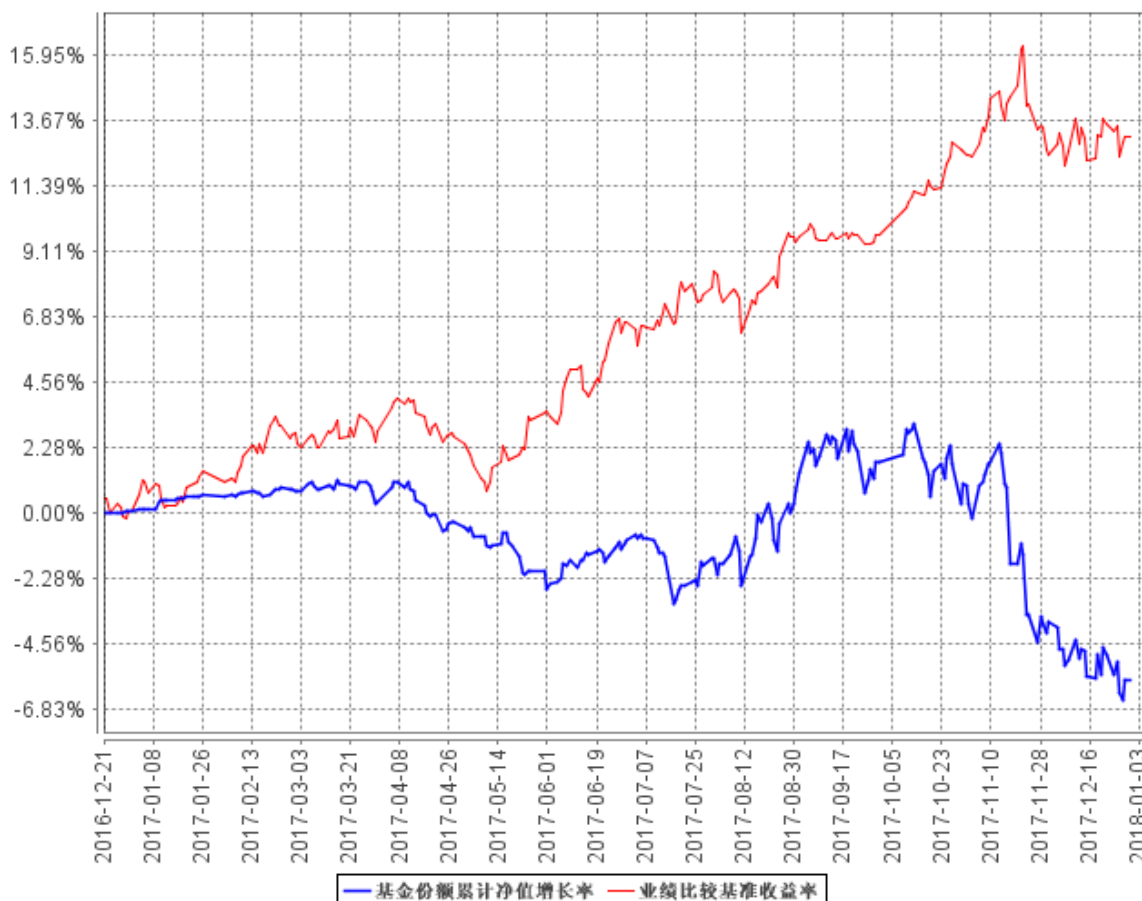
注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

1、沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，从上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本的综合性指数；样本选择标准为规模大、流动性好的股票，目前沪深 300 指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。

2、上证国债指数样本涵盖了上海证券交易所所有的国债品种，交易所的国债交易市场具有参与主体丰富、竞价交易连续的特性，能反映出市场利率的瞬息变化，也使得上证国债指数能真实地標示出利率市场整体的收益风险度。因此本基金选取的基准具有较好的代表性。

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

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 2016 年 12 月 21 日正式生效。

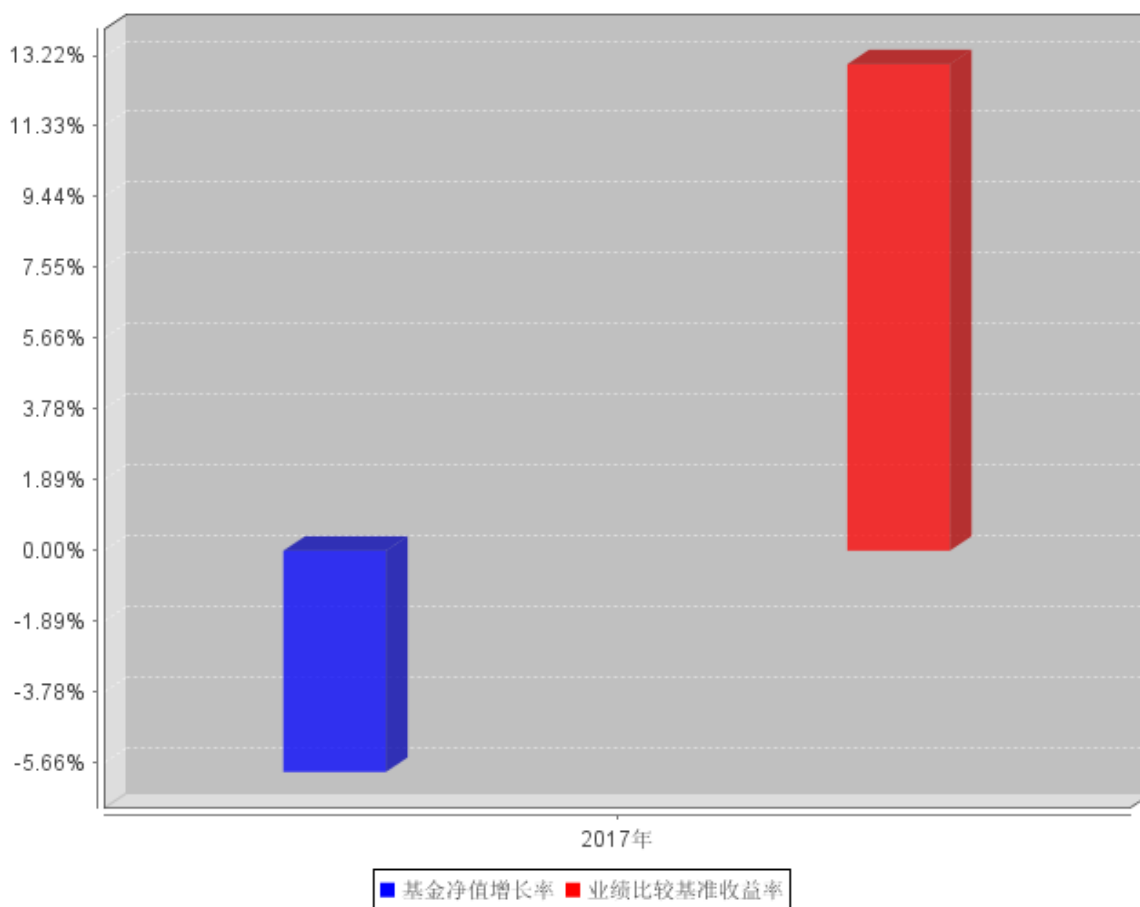
2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满，基金投资组合各项比例符合基金合同的约定，股票资产占基金资产的 0%-95%，投资于成长主题的证券资产不低于本基金非现金基金资产的 80%，权

证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

3、经泰信基金管理有限公司总办会审议决定，增聘张彦担任本基金基金经理。具体详情请见 2017 年 11 月 15 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信智选成长混合基金经理变更的公告》。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2016 年 12 月 21 日生效。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于 2016 年 12 月 21 日正式生效。2016 年、2017 年为进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 37 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36-37 层

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：万众

总经理：葛航

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：姚慧

发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co., Ltd.）是原山东省国际信托投资有限公司（现更名为山东省国际信托股份有限公司）联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司共同发起设立的基金管理公司。公司于 2002 年 9 月 24 日经中国证券监督管理委员会批准正式筹建，2003 年 5 月 8 日获准开业，是以信托投资公司为主发起人而发起设立的基金管理公司。

公司目前下设上海锐懿资产管理有限公司、市场部、产品部、营销部（分华东、华北、华南三大营销中心）、理财顾问部、深圳分公司、北京分公司、电子商务部、客服中心、基金投资部、研究部、专户投资部、清算会计部、集中交易部、计划财务部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部。截至 2017 年 12 月底，公司有正式员工 102 人，多数具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

截至 2017 年 12 月 31 日，泰信基金管理有限公司旗下共有泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活混合、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选混合、泰信债券增强收益、泰信发展主题混合、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选混合、泰信行业精选混合、泰信中证基本面 400 指数分级、泰信现代服务业混合、泰信鑫益定期开放债券、泰信国策驱动混合、泰信鑫选混合、泰信互联网+混合、泰信智选成长、泰信鑫利混合共 20 只开放式基金及 19 个资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱志权先生	基金投资部总监兼投资总监、本基金基金经理兼泰信优势增长基金经理	2016年12月21日	-	22	经济学学士。具有基金从业资格。曾任职于中信证券上海总部、长盛基金管理有限公司、富国基金管理有限公司、中海信托管理有限公司、银河基金管理有限公司。2008年6月加入泰信基金管理有限公司，2008年6月28日至2012年3月1日担任泰信优质生活基金经理；自2012年3月1日至2015年2月5日担任泰信先行策略混合基金经理；2010年1月16日至今担任泰信优势增长基金经理。现同时担任基金投资部总监兼投资总监。
张彦先生	本基金基金经理兼泰信中证200指数、中证基本面400指数基金经理	2017年11月15日	-	11年	研究生硕士。具有基金从业资格。曾任职于国金证券研究所、上海从容投资管理有限公司、万家基金管理有限公司。2011年6月加入泰信基金管理有限公司，担任高级研究员。自2011年10月至2014年5月任泰信中小盘精选基金经理助理。2012年4月至2015年1月任泰信优势增长混合基金经理助理。自2015年1月6日起任泰信中证200指数、泰信中证基本面400指数分级基金经理。

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。

3、经泰信基金管理有限公司总办会审议决定，增聘张彦担任本基金基金经理。具体详情请见2017年11月15日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信智选成长混合基金经理变更的公告》。

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》、《泰信智选成长灵活配置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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司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，投资经理严格遵守公平、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 公平交易制度的执行情况

公司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，投资经理严格遵守公平、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。

4.3.3 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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年，我国 A 股市场出现了明显的结构性行情。随着供给侧改革、经济复苏的带动下，上证综指上涨 6.56%，市场风格分化比较严重，以大盘蓝筹为主导，上证 50 上涨 25.08%，而创业板下跌 10.67%，全年来看食品饮料、家电、金融涨幅比较显著。

本基金从下半年开始逐步提高股票资产配置，适当布局了周期股和成长股的龙头，保持基金操作的灵活性，但是市场年底剧烈波动，未能保持住收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9418 元；本报告期基金份额净值增长率为-5.90%，业绩比较基准收益率为 12.98%。

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 2018 年，机遇与风险同在，预计全年呈现宽幅震荡，整体相对谨慎。

宏观经济总体相对平稳，预计 2018 年相比 2017 年经济会稳中有降，主要在于地产投资增速还将延续下行，制造业投资相对低迷，基建投资在政府主动引导下，预计增速稳中有降。总体而言，2018 年我国经济正处于动能转换期。

流动性方面，美联储加息对流动性收紧的牵制依然存在，而国内，紧货币、严监管依旧是主导国内流动性偏紧的核心要素。尽管宏观审慎监管要求下的杠杆管控将在 2018 年继续维持中性偏紧的流动性环境，但从紧的边际力度预计难以进一步提升。此外，以目前经济形势推测，2018 年国内通胀水平总体平稳，然而考虑到中东地缘政治的潜在冲击，需谨防通胀超预期对货币政策的意外冲击。

市场方面，考虑到流动性偏紧对于估值的冲击，我们判断 2018 年 A 股市场将呈现震荡市的特点，难有趋势性行情，更多体现在结构性行情。

2018 年市场投资风格会相对弱化，投资机会将从市场抱团的大盘蓝筹股逐步向中小市值板块扩散。本基金在操作上，继续保持主动性和前瞻性，在震荡市寻找结构性机会，优化行业配置，努力为基金持有人获取长期稳定收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，本基金管理人内部控制工作本着对基金份额持有人利益高度负责的精神，以独立于各业务部门的风险管理部、监察稽核部为主体，对基金销售、投资运作、后台保障等主要业务活动进行监督与控制，较好地保证了基金运作的合规性。

1、进一步完善制度建设，构建全面有效的内部控制体系

本基金管理人根据最新出台的相关法律法规，及时补充及完善了内部管理制度，同时对业务流程进一步梳理，严格按照监管要求进行风险控制评估及合规管理有效性评估，确保风险控制及合规管理的有效性，不断提升内部控制水平。

2、进一步规范基金投资管理 workflow，加强基金投资风险控制。

(1) 加强基金的日常投资交易进行监控，及时提示相关风险。公司风险管理部负责基金日常投资行为的监控，并与相关基金经理沟通，提示相关风险。同时根据投委会的投资决议、政策法规规定对风险指标设置进行调整，不定期检查风险监控指标设置，并根据新的需求对风险监控指标进行测试和更新。根据证监会发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》，在 2017 年 10 月后加强了对旗下公募基金的流动性管控。另外注意对监管机构处罚信息与市场负面信息搜集，提示投研部门注意潜在风险。

(2) 规范投资交易行为，防范交易环节的操作风险。公司禁止基金内的同日反向交易，严格控制旗下管理投资组合间的同日反向交易，对基金间同日同向交易、所有投资组合对单只股票成交量占其市场总成交异常等指标进行预警监控。对于日常的投资监控，公司实行的是事前控制、事中监督、事后检查的方法，在公平交易的各环节建立了责任追究制，实行各部门责任人、分管领导责任人负责制，以最大限度地监控并处置可能造成不公平交易或利益输送的行为。

3、针对基金投资运作通过日常监察与专项稽核相结合，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，通过查漏补缺、及时整改强化了风险控制流程，提高了投资管理及运营相关人员的风险意识水平，从而较好地预防风险，维护基金持有人利益。

4、做好投研交易等人员的合规培训，提高合规意识。公司组织投研人员开展内幕交易案例合规培训，就近年来发生的典型内幕交易案例作了分类汇报，并对目前市场上的疑似内幕交易、有争议的内幕交易案例进行了说明，要求投研人员遵守投资纪律，规范决策流程，从源头避免内幕交易事件的发生，加强了投研人员的合规意识。

5、公司采用技术手段对网站、交易、行情等进行屏蔽，对其他非受控方式上网及即时通讯做出进一步规范。加强投研人员的资讯管理，本年度公司购买了手机保管箱，在保管箱上方安装了

探头，对基金经理、交易人员在交易时间的移动电话、掌上电脑等移动通讯工具实行集中管理，规范了手机上交异常记录表，不定期抽查；对基金经理集中区域进行录像监控，对于证券公司的网站、网页委托进行了屏蔽，对投研人员的办公电脑安装截屏软件进行留痕处理，并对安装软件的权限进行严格限制。

在本报告期内，本基金的投资运作各环节基本符合规定的要求，未出现异常交易、操纵市场、内幕交易等违法违规现象。今后公司将继续夯实内部控制和风险管理工作，保证基金运作的合规性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、泰信基金管理有限公司估值程序等事项的说明

委员会主席

韩波先生，本科学历。2002 年加入泰信基金管理公司，现任公司副总经理。

委员会成员：

张敬燕女士，硕士。2017 年加入泰信基金管理有限公司，现任公司风险管理部副总监。

蔡海成先生，硕士。2013 年加入泰信基金管理有限公司，现任公司清算会计部总监。

朱志权先生，学士。2008 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，现任基金投资部总监兼投资总监，泰信优势增长混合基金、泰信智选成长混合基金经理。

梁剑先生，硕士。2004 年 7 月加入泰信基金管理有限公司，现任研究部副总监兼研究副总监。

2、本基金基金经理不参与本基金估值。

3、参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、基金合同关于利润分配的约定

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

二、本报告期本基金未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金的管理人——泰信基金管理有限公司在泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对泰信基金管理有限公司编制和披露的泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 21813 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金以下简称“泰信智选成长混合”)的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日和 2016 年 12 月 21 日的资产负债表，2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了泰信智选成长混合 2017 年 12 月 31 日和 2016 年 12 月 21 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于泰信智选成长混合，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>泰信智选成长混合的基金管理人泰信基金管理有限公司管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞</p>

	<p>弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估泰信智选成长混合的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非管理层计划清算泰信智选成长混合、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>泰信智选成长混合的基金管理人泰信基金管理有限公司治理层负责监督泰信智选成长混合的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计一定会发现存在的重大错报。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对泰信智选成长混合持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获</p>

	<p>得的信息。然而未来的事项或情况可能导致泰信智选成长混合不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露), 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与泰信智选成长混合的基金管理人泰信基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	许康玮	周祎
会计师事务所的地址	上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2018 年 3 月 29 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日: 2017 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产:		
银行存款	23,251,766.68	48,452,921.12
结算备付金	386,725.02	-
存出保证金	36,556.23	-
交易性金融资产	50,119,095.98	-
其中: 股票投资	50,119,095.98	-
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	320,000,000.00
应收证券清算款	3,102,225.49	-
应收利息	4,596.28	213,062.94
应收股利	-	-

应收申购款	1,038.07	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	76,902,003.75	368,665,984.06
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017年12月31日	2016年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	20,000,000.00
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	99,093.23	142,737.95
应付托管费	16,515.56	23,789.66
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	189,766.97	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	266,000.00	-
负债合计	571,375.76	20,166,527.61
所有者权益:		
实收基金	81,051,093.99	348,189,279.94
未分配利润	-4,720,466.00	310,176.51
所有者权益合计	76,330,627.99	348,499,456.45
负债和所有者权益总计	76,902,003.75	368,665,984.06

注：1. 报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9418 元，基金份额总额 81,051,093.99 份（于 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值为 1.0009 元，基金份额总额为 348,189,279.94 份）。

2. 本基金合同生效日为 2016 年 12 月 21 日，本财务报表的实际编制期间为 2017 年度和 2016 年 12 月 21 日至 2016 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017	上年度可比期间 2016年12月21日(基金
----	----------------------	---------------------------

	年 12 月 31 日	合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	-503,758.47	476,704.12
1. 利息收入	2,862,324.08	476,704.12
其中：存款利息收入	305,205.52	24,954.89
债券利息收入	16,569.23	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,540,549.33	451,749.23
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-5,017,378.69	-
其中：股票投资收益	-5,283,630.15	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	360.00	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	265,891.46	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	375,665.93	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,275,630.21	-
减：二、费用	3,290,746.47	166,527.61
1. 管理人报酬	2,161,883.30	142,737.95
2. 托管费	360,313.89	23,789.66
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	491,431.28	-
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	277,118.00	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-3,794,504.94	310,176.51
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-3,794,504.94	310,176.51

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
----	--

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	348,189,279.94	310,176.51	348,499,456.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-3,794,504.94	-3,794,504.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-267,138,185.95	-1,236,137.57	-268,374,323.52
其中：1. 基金申购款	6,192,414.15	44,168.77	6,236,582.92
2. 基金赎回款	-273,330,600.10	-1,280,306.34	-274,610,906.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	81,051,093.99	-4,720,466.00	76,330,627.99
项目	上年度可比期间 2016 年 12 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	348,189,279.94	-	348,189,279.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	310,176.51	310,176.51
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	348,189,279.94	310,176.51	348,499,456.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>葛航</u>	<u>韩波</u>	<u>蔡海成</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1958 号《关于准予泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由泰信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 348,059,789.82 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1685 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 348,189,279.94 份基金份额,其中认购资金利息折合 129,490.12 份基金份额。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换公司债券等)、资产支持证券、货币市场工具(含同业存单)、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 0%-95%,投资于成长主题的证券资产不低于本基金非现金基金资产的 80%,权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司于 2018 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信智选成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度和 2016 年 12 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日和 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度和 2016 年 12 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开

营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司（“泰信基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司
山东省国际信托股份有限公司（“山东国托”）	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信实业有限公司（“青岛国信”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本期及上年度可比期间本基金无应支付关联方佣金余额。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年12月21日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,161,883.30	142,737.95
其中：支付销售机构的客户维护费	1,338,170.87	58,484.12

注：支付基金管理人泰信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年12月21日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	360,313.89	23,789.66

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
基金合同生效日 (2016 年 12 月 21 日) 持有的基金份额	-	10,004,400.00
期初持有的基金份额	10,004,400.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减: 期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,004,400.00	10,004,400.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.3400%	2.8700%

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		2016 年 12 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	23,251,766.68	185,329.19	48,452,921.12	24,954.89

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管, 按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末 (2017 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 50,119,095.98 元，无属于第二层次以及第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：无属于第一层次、第二层次以及第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融房

地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金 2017 年 12 月 31 日(和 2016 年 12 月 31 日)的财务状况以及 2017 年度(和 2016 年 12 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的)的经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	50,119,095.98	65.17
	其中：股票	50,119,095.98	65.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	23,638,491.70	30.74
8	其他各项资产	3,144,416.07	4.09
9	合计	76,902,003.75	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	22,732,130.00	29.78
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	1,594,387.09	2.09
G	交通运输、仓储和邮政业	5,702,860.00	7.47
H	住宿和餐饮业	1,711,370.00	2.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,332,414.15	8.30
J	金融业	6,556,000.00	8.59
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	980,100.00	1.28
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	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	4,509,834.74	5.91
S	综合	-	-
	合计	50,119,095.98	65.66

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有港股通股票。

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002373	千方科技	184,031	2,696,054.15	3.53
2	000725	京东方 A	400,000	2,316,000.00	3.03
3	002142	宁波银行	130,000	2,315,300.00	3.03
4	600104	上汽集团	72,000	2,306,880.00	3.02
5	600125	铁龙物流	200,000	2,164,000.00	2.84
6	000001	平安银行	161,000	2,141,300.00	2.81
7	601318	中国平安	30,000	2,099,400.00	2.75
8	300059	东方财富	162,000	2,097,900.00	2.75
9	601900	南方传媒	161,000	1,874,040.00	2.46
10	300144	宋城演艺	99,989	1,865,794.74	2.44

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601900	南方传媒	4,952,189.32	1.42
2	600718	东软集团	4,746,660.60	1.36
3	600559	老白干酒	4,214,604.64	1.21
4	002373	千方科技	3,974,274.98	1.14
5	601211	国泰君安	3,902,999.00	1.12
6	600820	隧道股份	3,854,481.00	1.11
7	600114	东睦股份	3,765,974.27	1.08
8	600348	阳泉煤业	3,741,554.00	1.07

9	600259	广晟有色	3,631,236.00	1.04
10	002440	闰土股份	3,500,703.00	1.00
11	300161	华中数控	3,459,706.00	0.99
12	002081	金螳螂	3,403,931.96	0.98
13	600497	驰宏锌锗	3,370,000.00	0.97
14	002156	通富微电	3,333,471.26	0.96
15	300336	新文化	3,260,911.10	0.94
16	603678	火炬电子	3,112,646.50	0.89
17	300424	航新科技	2,919,289.00	0.84
18	002064	华峰氨纶	2,885,600.64	0.83
19	300059	东方财富	2,484,539.00	0.71
20	000681	视觉中国	2,454,072.00	0.70

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600718	东软集团	4,262,120.98	1.22
2	600114	东睦股份	4,150,941.00	1.19
3	600559	老白干酒	3,962,512.59	1.14
4	002081	金螳螂	3,923,174.29	1.13
5	002156	通富微电	3,816,000.88	1.09
6	601211	国泰君安	3,801,137.00	1.09
7	002440	闰土股份	3,685,138.04	1.06
8	603678	火炬电子	3,465,582.00	0.99
9	600348	阳泉煤业	3,260,322.00	0.94
10	600820	隧道股份	3,212,076.10	0.92
11	300424	航新科技	2,755,732.62	0.79
12	000681	视觉中国	2,580,395.92	0.74
13	600259	广晟有色	2,547,813.00	0.73
14	600497	驰宏锌锗	2,452,800.00	0.70
15	002064	华峰氨纶	2,405,000.00	0.69
16	300161	华中数控	2,309,584.00	0.66
17	002396	星网锐捷	2,302,536.43	0.66
18	300336	新文化	2,239,245.76	0.64

19	601900	南方传媒	2,180,911.47	0.63
20	000429	粤高速 A	2,129,033.14	0.61

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	199,446,926.78
卖出股票收入（成交）总额	144,419,866.58

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

8.6 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

本报告期末本基金未持有债券。

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

报告期末本基金未投资贵金属。

8.9 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

本报告期末本基金未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	36,556.23
2	应收证券清算款	3,102,225.49
3	应收股利	-
4	应收利息	4,596.28
5	应收申购款	1,038.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,144,416.07

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
772	104,988.46	10,004,400.00	12.34%	71,046,693.99	87.66%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	31,645.93	0.0390%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：基金份额总量的数量区间为 0、0 至 10 万份（含）、10 万份至 50 万份（含）、50 万份至 100 万份（含）、100 万份以上。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年12月21日）基金份额总额	348,189,279.94
本报告期期初基金份额总额	348,189,279.94
本报告期基金总申购份额	6,192,414.15
减：本报告期基金总赎回份额	273,330,600.10
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	81,051,093.99

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2017年1月23日起，公司董事总经理葛航先生代理公司董事长职务，王小林先生不再担任公司董事长职务；自2017年7月17日起，万众先生担任泰信基金管理有限公司董事长职务；公司于2017年9月22日发布公告，公司法定代表人变更为万众先生；自2017年11月15日起，增聘张彦先生担任本基金基金经理。上述管理人重大人事变动在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站上披露，并报监管机构备案。

2、本报告期资产托管人的专门资产托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

公司与万科企业股份有限公司工会委员会就泰信价值1号诉讼一案，深圳市罗湖区人民法院于2017年7月10日作出民事裁定书，准许原告万科企业股份有限公司工委会撤回起诉并结案。

本报告期无涉及基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费为人民币 6.6 万元。该审计机构从基金合同生效日（2016 年 12 月 21 日）开始为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
川财证券	1	151,449,692.04	44.04%	141,045.52	44.61%	-
中国银河证券	1	124,573,345.15	36.23%	113,524.25	35.91%	-
华创证券	2	42,455,653.26	12.35%	38,689.70	12.24%	-
广发证券	2	13,501,707.37	3.93%	12,304.15	3.89%	-
华泰证券	1	9,550,502.94	2.78%	8,894.45	2.81%	-
天风证券	1	2,326,367.60	0.68%	1,701.28	0.54%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

中山证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）中关于“一家基金公司通过一家证券经营机构买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金 30%”的要求，本基金管理人在选择租用交易单元时，注重所选证券公司的综合实力、市场声誉。对证券公司的研究能力，由公司研究人员对其提供的研究报告、研究成果的质量进行定期评估。公司将根据内部评估报告，对席位租用情况进行总体评价，决定是否对交易单元租用情况进行调整。

2、本报告期新增交易单元：渤海证券深圳 390860、中银国际深圳 003346，退租交易单元：高华证券上海 24008。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
川财证券	-	-	11,072,200,000.00	68.74%	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	5,034,400,000.00	31.26%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

中山证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

泰信基金管理有限公司
2018 年 3 月 29 日