泰信增强收益债券型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30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:2015年10月24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银行股份有限公司根据基金合同已于2015年10月23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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为 2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信债券增强收益
交易代码	290007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月29日
报告期末基金份额总额	77,289,721.67份
投资目标	在获取债券稳定收益的基础上,通过股票一级市场申购等手段谋求高于比较基准的收益。
投资策略	本基金根据对宏观经济形势、货币和财政政策变化、经济周期及利益走势、企业盈利和信用状况、基金流动性情况等的动态分析,通过自下而上自顶向下相结合的方式分析各类资产的配置比例范围,并跟踪影响资产策略配置的各种因素的变化,定期对资产策略配置比例进行调整。
业绩比较基准	80%*上证企业债指数+20%*上证国债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的低风险、低收益品种,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金,高于货币市场基金。
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
下属分级基金的基金简称	泰信债券增强收益A	泰信债券增强收益C
下属分级基金的交易代码	290007	291007
报告期末下属分级基金的份额总额	73,483,457.18份	3,806,264.49份

§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	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)	
	泰信债券增强收益A	泰信债券增强收益C
1.本期已实现收益	585,863.62	26,620.09
2.本期利润	728,284.38	33,754.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0098	0.0087
4.期末基金资产净值	82,322,935.49	4,222,145.63
5.期末基金份额净值	1.1203	1.1093

注:1,上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

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

泰信债券增强收益A

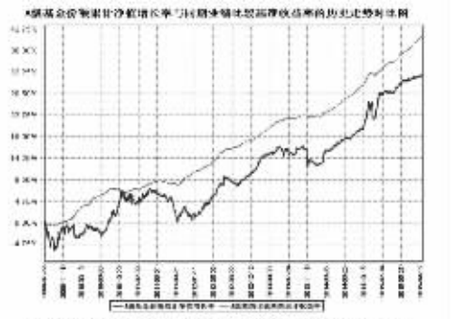
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.91%	0.06%	2.36%	0.02%	-1.45%	0.04%

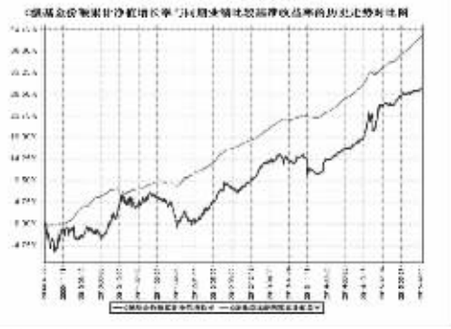
泰信债券增强收益C

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	0.81%	0.06%	2.36%	0.02%	-1.55%	0.04%

注:本基金的业绩比较基准为:80%上证企业债指数+20%上证国债指数。

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





注:1,本基金基金合同于2009年7月29日正式生效。

2,本基金建仓期为六个月。建仓期满,本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的80%,投资于权益类资产的比例不高于基金资产的20%,现金或者到期日在一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

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		
何俊春女士	基金投资部固定收益投资总监、本基金基金经理兼泰信双息双利基金、泰信债券增强回报基金、泰信鑫益定期开放债券基金经理	2009年7月29日	-	19年	工商管理硕士,具有基金从业资格,曾任职于上海政安投资咨询有限公司,齐鲁证券上海证券营业部。2002年12月加入泰信基金管理有限公司,先后担任泰信天天收益基金交易员、交易主管、泰信天天收益基金经理。自2008年10月10日起担任泰信双息双利债券基金基金经理;自2012年10月25日起担任泰信债券增强回报基金经理;自2013年7月17日起担任泰信鑫益定期开放债券基金经理。现同时担任基金投资部固定收益投资总监。

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遵规守信情况的说明

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》、《泰信增强收益债券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

2015年三季度我国宏观经济表现依旧疲弱。8月末固定资产投资同比下滑至10.9%,主要部门制造业投资、基建投资、房地产投资月度同比都有不同程度的下滑。中采制汇率PMI也继续走弱并低于"荣枯线"之下。社会消费品零售总额同比增长,但是房地产回暖依旧低于预期,汽车产销量仍然疲弱。海外方面,制造业下滑,就业不达预期,推迟了美国加息的进程,欧日则呈现整体经济企稳的迹象。8月央行对人民币汇率定价方式实施改革,在政府强导人多次表态人民币不具备持续贬值的背景下,汇率波动逐步稳定,截止9月底,离岸及在岸美元对人民币价格仍较季初上涨2.5%左右。三季度,央行货币政策整体宽松,分别于6月下旬和8月下旬两次"双降",货币供应量也因为救市举措影响有所增加。积极财政政策继续推进,国企改革总体方案出台,十三五规划也在紧密密装的制定,房贷政策也进一步放宽。

三季度市场流动性整体充裕,银行间7天回购季度均值为2.48%。三季度,纯债市场在基本面利好支撑,流动性充裕和市场风险偏好下行背景下获得了较好表现,季末中债总财富(总值)指数上涨2.13%,从具体产品看,利率债成牛平走势,10年期国债及国开债分别下行36和39个基点至3.24%及3.7%。信用债则整体下行,7年期AAA及AA级企业债及中票分别下行36个基点以上,信用利差整体收窄。三季度,虽然信用事件依旧陆续爆发,但二重债最终获得国家兜底,仍加强了市场对央企刚性兑付预期。转债市场三季度受股市影响大幅下跌,中证转债指数季度下跌14.46%,个券表现偏弱,转股溢价率走扩,伴随民生等多只转债退市转债市场规模大幅下降。增强三季度主要拉长久期与杠杆操作为主,重点配置3年期金融债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,泰信债券增强收益A基金份额净值为1.1203元,本季度份额净值增长率为0.91%,同期业绩比较基准增长率为2.36%;泰信债券增强收益C基金份额净值为1.1093元,本季度份额净值增长率为0.81%,同期业绩比较基准增长率为2.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

前三季度宏观经济增长放缓,四季度则是达成全年经济增长目标的关键时点,稳增长依旧任重道远。目前看,制造业仍低迷的处于荣枯线之下,高频数据显示电力耗煤和相关铁产量均为负值,工业生产受到拖累。地产整体回暖不达预期,央行放宽房贷政策后的市场表现仍有待观察。基建则仍将继续成为现阶段稳增长的主要力量。"黄金周"期间消费与去年基本持平,未来内需消费依旧难有明显改善。当前国际经济形势复杂化加强,海外经济复苏虽有波折但是整体趋势向好,美元仍存加息空间,未来新兴市场流行性仍将受到考验。猪肉价格目前仍在企稳调整,未来对通胀的拉动作用有限,国际大宗商品价格持续低迷,四季度通胀表现或将维持低位。稳增长背景下,货币政策将继续维持稳定。

我们对四季度债市仍然看好,通胀和基本面继续对债市表现形成支撑,叠加汇率影响和内需疲弱,宽松货币政策仍将延续,降息降准空间仍存。银行理财资金规模增长将继续推动低风险资产的配置需求。当然,四季度仍有较多外部变量的边际改变将对债市预期形成影响,进而影响市场表现:一是政策发力后经济增长边际改善带来预期调整;二是股市表现向好或重启新股发行带动市场风险偏好上升,进而影响大类资产转移;三是流动性超预期收紧,带来的债市去杠杆的冲击。信用债套息空间仍存,但信用利差目前处于历史中位数之下,进一步压缩空间有限。虽然二重债股东兜底后,市场对央企兑付担忧有所缓解,但经济走弱背景下,中小企业信用风险仍需时刻警惕。我们将继续重点配置中高等级投资标的,做好信用风险防范。四季度A股市场或在融资去杠杆结束后有所反弹,届时转债市场有望获益于正股走势取得表现。增强四季度继续维持杠杆操作,增加可转债的配置比例。

§5 投资组合报告

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	81,232,051.50	92.58
	其中:债券	81,232,051.50	92.58
	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	4,354,254.07	4.96
7	其他资产	2,154,188.34	2.46
8	合计	87,740,493.91	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末本基金未持有股票。

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

报告期末本基金未持有股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	81,231,000.00	93.86
	其中:政策性金融债	81,231,000.00	93.86
4	企业债券	1,051.50	0.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	81,232,051.50	93.86

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	150201	15国开01	300,000	30,369,000.00	35.09
2	150207	15国开07	200,000	20,436,000.00	23.61
3	140225	14国开25	200,000	20,428,000.00	23.60
4	150215	15国开15	100,000	9,998,000.00	11.55
5	124362	13欧洲海	10	1,051.50	0.00

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

本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

本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

截至报告期末基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,798.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,146,016.80
5	应收申购款	5,372.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,154,188.34

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金未投资股票。

5.10.6 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

项目	泰信债券增强收益A	泰信债券增强收益C
报告期期初基金份额总额	100,107,470.51	3,980,913.24
报告期期间基金总申购份额	3,407,170.26	909,995.02
减:报告期期间基金总赎回份额	30,031,183.59	1,084,643.77
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	73,483,457.18	3,806,264.49

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰信增强收益债券型证券投资基金设立的文件

2、《泰信增强收益债券型证券投资基金基金合同》

3、《泰信增强收益债券型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信增强收益债券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.fttfund.com)免费查阅上述相关文件,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10月24日

泰信中证200指数证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30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:2015年10月24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银行股份有限公司根据基金合同已于2015年10月23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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为 2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信中证200指数
交易代码	290010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月9日
报告期末基金份额总额	46,192,741.75份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资方法,通过严格的投资流程约束和数量化风险管理手段,以实现对标的指数的有效跟踪。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金主要采用完全复制法,按照在中证200指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合和跟踪中证200的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	中证200指数收益率*95% + 商业银行活期存款利率(税后)*5%。
风险收益特征	本基金为指数型基金,具有较高风险和较高预期收益的特征,其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。其风险因素主要来自于市场风险和跟踪误差的风险。
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

§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	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	366,623.13
2.本期利润	-18,963,352.79
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4242
4.期末基金资产净值	45,421,377.12
5.期末基金份额净值	0.983

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。

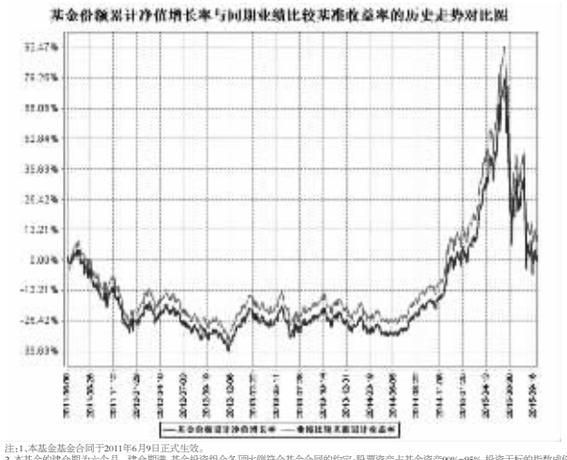
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-30.18%	3.97%	-29.88%	3.76%	-0.30%	0.21%

注:本基金业绩比较基准为:中证200指数收益率×95% + 商业银行活期存款利率(税后)×5%。

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



注:1,本基金基金合同于2011年6月9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90%-95%,投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于股票资产的90%。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%,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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

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		
张凌先生	本基金经理兼泰信中证基本面400指数分级基金经理	2015年1月6日	-	9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4月任泰信中小盘精选基金经理助理。2012年4月至2014年12月任泰信优势增长混合基金经理助理。自2015年1月6日起同时兼任泰信中证500联接基本面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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《泰信中证200指数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

风险偏好上升推动了A股上半年上涨,政府本着降温的意图,严格连续资金入市,实施从严的去杠杆化措施,清理场外配资,引发了3季度市场暴跌,尽管政府在7月份进行救市,但是随着人民币贬值以及基本面疲弱影响,A股市仍然继续下挫。3季度上证综指依然下跌28.63%,创业板下跌27.14%。

报告期内,本基金作为被动操作的指数基金,严格执行基金合同规定的投资策略,按照规定的投资策略和方法进行投资操作,努力拟合标的指数,减小跟踪误差,但是由于近期涨多公司面临停牌,无法有效调整成分股,加之市场波动大,资金进出频繁,基金不能做到完全拟合指数成份。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金单位净值为0.983元,本季度净值增长率为-30.18%,业绩比较基准增长率为-29.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期宏观数据表明,国内经济依然疲弱,9月中采PMI小幅反弹,但仍处荣枯线下,且为历史同期最低。为了对冲国内经济下行压力,近期政府稳增长的措施继续加强,9月陆续出台了购车税收优惠和住房按揭便利政策。在当前货币政策已经相对宽松的情况下,实体经济的确实企稳更多需要财政政策发挥积极作用。

当前物价重新回落,随着美联储降息预期淡化,人民币汇率问题弱化,4季度降准降息空间开启,放松预期增强,宽松货币政策仍将持续。

我们预计4季度前期市场将会有明显的反弹。股市去杠杆阶段已然过去,截至9月底前大部分场外配资清理结束,对市场冲击实际已经逐步消除。美元9月份未能加息,尔后的9月新增非农就业人数、ISM 制造业和非制造业指数均低于市场预期,疲软数据致美联储后续加息预期减弱,推动了风险资产价格强劲反弹。而对于国内而言,美元指数短期弱势有助于稳定人民币回避预期。

10月中旬十八届五中全会将讨论十三五规划,对证券市场影响深远,是市场反弹的重要线索。

本基金作为一只投资于中证200指数的被动指数基金产品,我们将坚持指数化投资理念,控制基金跟踪误差,通过模拟指数,跟踪市场趋势,使本产品成为投资者良好的资产配置工具。本基金将继续规范运作,审慎投资,勤勉尽责地维护基金份额持有人利益。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期本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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	42,500,411.42	93.12
	其中:股票	42,500,411.42	93.12
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	3,094,284.85	6.78
7	其他资产	44,050.38	0.10
8	合计	45,638,746.65	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	289,071.31	0.64
B	采矿业	1,768,939.70	3.89
C	制造业	17,661,233.29	38.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,068,878.18	4.55
E	建筑业	1,256,121.99	2.77
F	批发和零售业	1,677,541.33	3.69
G	交通运输、仓储和邮政业	2,765,819.92	6.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,443,051.97	9.78
J	金融业	4,042,511.40	8.90
K	房地产业	2,505,118.91	5.52
L	租赁和商务服务业	1,133,777.16	2.50
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	513,425.98	1.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	217,913.76	0.48
R	文化、体育和娱乐业	1,504,639.19	3.31
S	综合	321,618.30	0.71
	合计	42,169,662.39	92.84

5.2.2 报告期末积极投资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	采掘业	40,710.60	0.09
C	制造业	80,306.66	0.18
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	信息传输、软件和信息技术服务业	209,731.77	0.46
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	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	330,749.03	0.73

注:由于近期诸多公司面临停牌,无法有效调整成分股,基金不能做到完全拟合指数成份,因此基金被动持有了一些非当前成分股,基金视公司复牌情况,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

5.3.1 报告期末指数投资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	000024	招商地产	27,244	776,181.56	1.71
2	002450	康得新	20,771	629,153.59	1.39
3	300059	东方财富	17,200	618,856.00	1.36
4	300104	乐视网	13,400	547,792.00	1.21
5	601377	兴业证券	61,898	484,661.34	1.07
6	000100	TCL 集团	123,787	466,676.99	1.03
7	000783	长江证券	49,455	458,447.85	1.01
8	600066	宇通客车	23,207	436,291.60	0.96
9	000768	中航飞机	19,304	432,988.72	0.95
10	600271	航天信息	8,022	430,701.18	0.95

5.3.2 报告期末积极投资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

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	600637	东方明珠	6,759	209,731.77	0.46
2	002429	兆驰股份	8,374	80,306.66	0.18
3	600395	盘江股份	6,462	40,710.60	0.09

注:由于近期诸多公司面临停牌,无法有效调整成分股,基金不能做到完全拟合指数成份,因此基金被动持有了一些非当前成分股,基金视公司复牌情况,逐步进行调整成分股。

5.4 报告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。

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

本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

本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

本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	43,352.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	697.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,050.38

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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金积极投资前五名股票中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

报告期期初基金份额总额	39,737,235.55
报告期期间基金总申购份额	11,163,256.58
减:报告期期间基金总赎回份额	4,707,750.38
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	46,192,741.75

§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份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,999,320.00
报告期期间买入申购总份额	8,037,781.35
报告期期间卖出赎回总份额	0.00
报告期末管理人持有的本基金份额	19,037,101.35
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	41.21

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2015年7月29日	8,037,781.35	9,999,000.00	-
合计			8,037,781.35	9,999,000.00	

注:依据《泰信中证200指数证券投资基金招募说明书》相关约定,本次交易收取固定费用1000元。

§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中证200指数证券投资基金设立的文件

2、《泰信中证200指数证券投资基金基金合同》

3、《泰信中证200指数证券投资基金招募说明书》

4、《泰信中证200指数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.fttfund.com