(上接B251版)

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》、《泰信行业精选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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年3月4日(基金合同转型生效日)至2015年12月31日止期间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2015年12月31日的财务状况以及2015年3月4日(基金合同生效日)至2015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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2015年3月4日(基金合同转型生效日)至2015年12月31日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告 [2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
活期存款	1,837,824.39
定期存款	–
其中:存款期限1-3个月	–
其他存款	–
合计:	1,837,824.39

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目		本期末 2015年12月31日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		33,180,946.89	32,725,690.43	–455,256.46
贵金属投资-金交所黄金合约		–	–	–
债券	交易所市场	415,330,762.52	411,310,924.70	–4,019,837.82
	银行间市场	–	–	–
	合计	415,330,762.52	411,310,924.70	–4,019,837.82
资产支持证券		–	–	–
基金		–	–	–
其他		–	–	–
合计		448,511,709.41	444,036,615.13	–4,475,094.28

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金无衍生金融资产余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位:人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	
	账面余额	其中:买断式逆回购
买入返售证券	133,400,000.00	–
合计	133,400,000.00	–

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未进行买断式逆回购。

7.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应收活期存款利息	121,986.74
应收定期存款利息	–
应收其他存款利息	–
应收结算备付金利息	9,173.00
应收债券利息	7,930,577.82
应收买入返售证券利息	20,265.66
应收申购款利息	–
应收黄金合约拆借孳息	–
其他	348.40
合计	8,082,351.62

7.4.7.6 其他资产

单位:人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
其他应收款	642,417.94
待摊费用	–
合计	642,417.94

7.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	84,334.76
银行间市场应付交易费用	–
合计	84,334.76

7.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	–
应付赎回费	1,655.20
预提费用	429,000.00
合计	430,655.20

7.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

项目	本期 2015年3月4日至2015年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	283,272,972.80	283,272,972.80
基金份额折算调整	–	–
未领取红利份额折算调整	–	–
集中申购募集资金本金及利息	–	–
基金拆分和集中申购完成后	–	–
本期申购	8,954,026,763.27	8,954,026,763.27
本期赎回(以"-"号填列)	–8,316,782,370.26	–8,316,782,370.26
本期末	920,517,365.81	920,517,365.81

7.4.7.10 未分配利润

金额单位:人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	52,699,529.99	–14,616,560.83	38,082,969.16
本期利润	113,946,889.13	–4,475,094.28	109,471,794.85
本期基金份额交易产生的变动数	–540,082.10	83,074,249.02	82,534,166.92
其中:基金申购款	2,262,907,761.78	17,372,103.81	2,280,279,865.59
基金赎回款	–2,263,447,843.88	65,702,145.21	–2,197,745,698.67
本期已分配利润	–19,138,488.21	–	–19,138,488.21
本期末	146,967,848.81	63,982,593.91	210,950,442.72

7.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年3月4日至2015年12月31日
活期存款利息收入	12,177,192.11
定期存款利息收入	–
其他存款利息收入	–
结算备付金利息收入	826,438.77
其他	251,880.68
合计	13,255,511.56

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年3月4日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	1,575,172,108.82
卖出股票成本总额	1,206,243,217.89
买卖股票差价收入	60,044,708.85

7.4.7.13债券投资收益

7.4.7.13.1债券投资收益项目构成

单位:人民币元

项目	本期 2015年3月4日至2015年12月31日
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	–5,529,454.72
债券投资收益——赎回差价收入	–
债券投资收益——申购差价收入	–
合计	–5,529,454.72

7.4.7.13.2债券投资收益——买卖债券差价收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年3月4日至2015年12月31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	2,454,038,069.57
减:卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	2,397,544,412.34
减:应收利息总额	62,023,111.95
债券投资收益	–5,529,454.72

7.4.7.13.3资产支持证券投资收益

报告期末本基金未投资资产支持证券。

7.4.7.14贵金属投资收益

报告期末本基金未投资贵金属。

7.4.7.15衍生工具收益

报告期末本基金无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2015年3月4日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,589,209.01
基金投资产生的股利收益	–
合计	1,589,209.01

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2015年3月4日至2015年12月31日
1.交易性金融资产	–4,475,094.28
——股票投资	–455,256.46
——债券投资	–4,019,837.82
——资产支持证券投资	–
——贵金属投资	–
——其他	–
2.衍生工具	–
——权证投资	–
3.其他	–
合计	–4,475,094.28

7.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年3月4日至2015年12月31日
基金赎回费收入	37,332,595.85
转出基金补偿费	994,877.45
其他	24,790.38
合计	38,352,263.68

注:1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和转入基金申购补差费构成，其中赎回费部分的 25%归入基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位:人民币元

项目	本期 2015年3月4日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	3,685,962.18
银行间市场交易费用	–
合计	3,685,962.18

7.4.7.20 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2015年3月4日至2015年12月31日
审计费用	89,808.44
信息披露费	265,643.36
账户服务费	29,884.32
持有人大会费用	50,000.00
银行划款手续费	39,368.03
合计	474,704.15

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须做披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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	基金管理人、注册登记机构、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
中信银行股份有限公司("中信银行")	基金托管人、基金销售机构
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:1. 本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司的股东山东省国际信托有限公司于2015年7月30日变更注册为山东省国际信托股份有限公司。

2.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

报告期末本基金未通过关联方进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

报告期末本基金未通过关联方进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

报告期末本基金未通过关联方进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

报告期末本基金未通过关联方进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

报告期末本基金无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年3月4日至2015年12月31日
当期应支付的管理费	32,928,921.65
其中:支付销售机构的客户维护费	3,067,932.33

注:支付基金管理人泰信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%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×1.20%÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年3月4日至2015年12月31日
当期应支付的托管费	5,695,575.08

注:支付基金托管人中信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×0.25%÷当年天数。

7.4.10.2.3销售服务费

报告期末本基金无销售服务费用。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期末本基金未发生与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)的交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 2015年3月4日至2015年12月31日
期初持有的基金份额	39,524,703.56
期间申购/买入总份额	–
期间因拆分增加的份额	–
期间赎回/卖出总份额	–
期末持有的基金份额	39,524,703.56
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.29%

7.4.10.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2015年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
山东省国际信托股份有限公司	53,198,338.38	5.78%

7.4.10.5 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 2015年3月4日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中信银行	1,837,824.39	12,177,192.11

注:本基金的活期银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期末本基金未参与关联方主承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期末本基金无其他关联交易事项说明。

7.4.11 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

报告期末本基金未持有因认购新发/增发而持有的流通受限证券。

7.4.11.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
000657	中钨高新	2015年8月6日	重大事项公告	16.01	2016年2月25日	16.30	500,000	10,298,586.00	8,005,000.00

注:本基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

报告期末本基金未持有银行间市场正回购债券。

7.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金持有交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额380,000,000.00元，于2016年1月7日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按照证券交易所规定的比例折算成标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12 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2015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24,720,690.43元，属于第二层次的余额为419,315,924.70元，无属于第三层次的余额。

(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。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于2015年3月26日起改为采用中央国债登记结算有限责任公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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2015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。

(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)除公允价值外，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(转型前)

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	–	–
	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	239,478,377.24	73.45
7	其他资产	86,555,767.62	26.55
8	合计	326,034,144.86	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

截至报告期末(2015年3月3日)本基金未持有股票。

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

截至报告期末(2015年3月3日)本基金未持有股票。

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	600028	中国石化	23,039,259.51	6.29
2	600026	中海发展	9,871,792.70	2.70
3	601318	中国平安	9,620,502.76	2.63
4	601100	恒立油缸	8,319,958.58	2.27
5	601818	光大银行	5,594,000.00	1.53
6	600305	恒顺醋业	3,475,891.50	0.95
7	600809	山西汾酒	1,977,401.76	0.54
8	000401	冀东水泥	352,268.00	0.10
9	002739	万达院线	10,675.00	0.00
10	300413	快乐购	4,530.00	0.00

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	601318	中国平安	29,948,609.54	8.18
2	600028	中国石化	25,112,170.00	6.86
3	000060	中金岭南	20,016,282.19	5.46
4	600332	白云山	19,081,502.48	5.21
5	600315	上海家化	19,006,799.60	5.19
6	600362	江西铜业	17,493,429.95	4.78
7	600500	中化国际	17,239,385.91	4.71
8	000758	中色股份	16,947,868.70	4.63
9	000630	铜陵有色	16,744,908.98	4.57
10	600809	山西汾酒	15,139,986.39	4.13
11	002646	青青稞酒	12,292,626.68	3.36
12	601872	招商轮船	11,341,029.50	3.10
13	600026	中海发展	10,006,549.79	2.73
14	601818	光大银行	9,798,971.57	2.68
15	601369	陕鼓动力	9,771,620.13	2.67
16	601100	恒立油缸	7,951,329.00	2.17
17	000401	冀东水泥	6,950,741.74	1.90
18	600428	中远航运	6,811,469.45	1.86
19	300315	掌趣科技	6,021,501.60	1.64
20	000423	东阿阿胶	5,954,557.30	1.63

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	62,266,279.81
卖出股票收入(成交)总额	308,884,182.08

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

截至报告期末(2015年3月3日)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

截至报告期末(2015年3月3日)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

截至报告期末(2015年3月3日)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

截至报告期末(2015年3月3日)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

截至报告期末(2015年3月3日)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(2015年3月3日)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(2015年3月3日)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(2015年3月3日)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(2015年3月3日)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(2015年3月3日)本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
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

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至报告期末(2015年3月3日)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

截至报告期末(2015年3月3日)本基金未持有股票。

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。

§8 投资组合报告(转型后)

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	32,725,690.43	2.16
	其中:股票	32,725,690.43	2.16
2	固定收益投资	411,310,924.70	27.14
	其中:债券	411,310,924.70	27.14
	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	133,400,000.00	8.80
	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	22,222,324.23	1.47
7	其他资产	915,931,820.12	60.43
8	合计	1,515,590,759.48	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	16,895,980.78	1.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,802,000.00	0.78
E	建筑业	569,223.75	0.05
F	批发和零售业	1,737,304.44	0.15
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	233,257.06	0.02
J	金融业	–	–
K	房地产业	2,572,800.00	0.23
L	租赁和商务服务业	932,400.00	0.08
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	982,724.40	0.09
S	综合	–	–
	合计	32,725,690.43	2.89

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细(转型后)

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	000690	宝新能源	900,000	8,802,000.00	0.78
2	000657	中钨高新	500,000	8,005,000.00	0.71
3	601588	北辰实业	480,000	2,572,800.00	0.23
4	600521	华海药业	100,000	2,539,000.00	0.22
5	600887	伊利股份	110,000	1,807,300.00	0.16
6	601933	永辉超市	150,000	1,515,000.00	0.13
7	603100	川仪股份	60,000	1,088,400.00	0.10
8	600513	联环药业	40,000	1,042,400.00	0.09
9	603999	读者传媒	16,713	982,724.40	0.09
10	600138	中青旅	40,000	932,400.00	0.08

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601211	国泰君安	92,855,426.22	8.21
2	600332	白云山	90,221,471.81	7.97
3	600109	国金证券	81,965,373.96	7.24
4	601919	中国远洋	80,179,196.98	7.09
5	600999	招商证券	72,893,767.01	6.44
6	600395	盘江股份	68,655,399.36	6.07
7	600026	中海发展	61,078,797.23	5.40
8	601866	中海集运	60,676,845.14	5.36
9	002353	杰瑞股份	42,207,582.71	3.73
10	600428	中远航运	33,239,967.31	2.94
11	601985	中国核电	32,649,100.17	2.89
12	601872	招商轮船	31,028,846.70	2.74
13	603567	珍宝岛	25,255,339.30	2.23
14	600028	中国石化	23,039,259.51	2.04
15	000783	长江证券	22,346,054.00	1.97
16	300286	安科瑞	21,997,367.45	1.94
17	000100	TCL 集团	17,597,956.46	1.56
18	600688	上海石化	14,349,189.80	1.27
19	600169	太原重工	14,127,787.00	1.25
20	002709	天赐材料	12,550,055.10	1.11

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601211	国泰君安	147,079,980.04	13.00
2	601985	中国核电	133,313,052.28	11.78
3	600332	白云山	70,198,538.71	6.20
4	601919	中国远洋	66,769,455.45	5.90
5	601866	中海集运	58,867,064.10	5.20
6	600999	招商证券	57,404,235.61	5.07
7	600026	中海发展	54,296,646.40	4.80
8	600395	盘江股份	46,645,424.94	4.12
9	600428	中远航运	38,056,521.05	3.36
10	601872	招商轮船	36,526,606.99	3.23
11	600109	国金证券	34,192,930.45	3.02
12	002353	杰瑞股份	31,722,884.49	2.80
13	000783	长江证券	23,597,904.00	2.09
14	300286	安科瑞	22,617,113.55	2.00
15	603567	珍宝岛	19,536,348.92	1.73
16	000100	TCL 集团	18,184,000.00	1.61
17	600688	上海石化	14,914,936.40	1.32
18	600169	太原重工	14,243,706.90	1.26
19	002709	天赐材料	12,807,636.40	1.13
20	002293	罗莱生活	12,687,238.93	1.12

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	1,301,690,444.59
卖出股票收入(成交)总额	1,575,172,108.82

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

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	75,183,073.80	6.64
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	336,127,850.90	29.71
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	411,310,924.70	36.35

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019317	13国债17	634,820	64,021,597.00	5.66
2	112079	12长安债	540,905	55,713,215.00	4.92
3	122733	11京资01	471,280	48,084,698.40	4.25
4	122065	11上港01	456,670	45,913,601.80	4.06
5	122097	11浦路桥	357,400	36,858,662.00	3.26

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

截至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

截至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

截至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

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	774,232.91
2	应收证券清算款	906,429,762.58
3	应收股利	–
4	应收利息	8,082,351.62
5	应收申购款	3,055.07
6	其他应收款	642,417.94
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	915,931,820.12

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000657	中钨高新	8,005,000.00	0.71	重大事项公告

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(转型前)

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
447	633,720.30	230,048,319.21	81.21%	53,224,653.59	18.79%

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	119,809.20	0.0423%

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	0~10

§9 基金份额持有人信息(转型后)

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
2,852	322,762.05	635,931,113.69	69.08%	284,586,252.12	30.92%

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	92,210.75	0.0100%

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2015年3月4日)基金份额总额	283,272,972.80
报告期期初基金份额总额	–
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	8,954,026,763.27
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	8,316,782,370.26
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
报告期期末基金份额总额	920,517,365.81

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，泰信行业精选混合型证券投资基金(以下简称"泰信行业精选基金"或"本基金")的基金管理人泰信基金管理有限公司(以下简称"本基金管理人")于2015年7月22日15:00起至2015年8月26日15:00通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，并与2015年8月28日表决通过《关于修改泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

本次《基金合同》主要修改内容集中在如下几方面:

1、调整本基金投资范围，增加资产支持证券、中小企业私募债券、股指期货等投资品种，以及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。

2、调整本基金投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例范围为0-95%，业绩比较基准不变，并按照证监会要求相应地将基金名称调整为"泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金"。

3、调低基金管理人的管理费率，由原合同中的1.5%调整为1.2%。

4、整体调低《招募说明书》中的基金赎回费率，将原赎回费率结构:T<7天，1.5%;7天≤T<30天，0.75%;30天≤T<365天，0.5%;365天≤T<730天，0.25%;T≥730天，0%调整为:T<7天，1.5%;7天≤T<30天，0.75%;30天≤T<180天，0.5%;180天≤T<365天，0.1%;365天≤T<730天，0.05%;T≥730天，0%。归人基金资产比例不变。

5、近年来《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》等法律法规、证监会规范性文件陆续修订并颁布实施，原《基金合同》中部分条款及措辞已不符合新规要求或不符合监管机构最新监管要求，本基金管理人泰信基金管理有限公司经与基金托管人中信银行股份有限公司协商一致，对《基金合同》中以上相关内容进行修改并完善。

6、原《基金合同》中相关内容表述不够完善，本基金管理人泰信基金管理有限公司经与基金托管人中信银行股份有限公司协商一致，对《基金合同》中以上相关内容进行修改并完善。

关于本次基金份额持有人大会具体详情请参见本基金管理人于2015年7月18日在指定媒介及泰信基金网站上对外披露的《泰信行业精选混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会公告》，2015年8月31日对外披露的《泰信行业精选混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》。

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

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

1、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，该基金自2015年3月4日起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"，基金业绩比较基准变更为"沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%"，各项投资比例变更为"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。"基金托管人及基金注册机构保持不变，基金代码亦保持不变仍为"290012"。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。

2、经泰信行业精选混合型证券投资基金2015年8月28日基金份额持有人大会(通讯方式)表决通过，并报中国证监会备案，泰信行业精选混合型证券投资基金变更为泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金。自2015年9月1日起，由《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效。本基金的投资组合比例调整为:"本基金股票投资占基金资产的比例范围为0-95%。本基金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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券"，业绩比较基准不变。

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10万元。该审计机构从基金合同生效日(2012年2月22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、托管人托管业务部门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 (转型后)

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	
海通证券	2	2,259,163,026.87	95.21%	2,046,653.34	95.25%	–
中山证券	1	113,621,021.68	4.79%	101,951.43	4.75%	–

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，对交易单元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、本基金与公司旗下在中信银行托管的泰信周期回报债券基金、泰信鑫益定期开放债券基金共用交易单元。

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
海通证券	3,907,210,693.50	99.58%	124,646,810,000.00	99.22%	–	–
中山证券	16,284,823.56	0.42%	975,138,000.00	0.78%	–	–

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)

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	
海通证券	2	338,224,204.68	100.00%	305,488.23	100.00%	–
中山证券	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，对交易单元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、本基金与公司旗下在中信银行托管的泰信周期回报债券基金、泰信鑫益定期开放债券基金共用交易单元。

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
海通证券	595,792,080.70	100.00%	4,010,800,000.00	100.00%	–	–
中山证券	–	–	–	–	–	–

§12 影响投资者决策的其他重要信息

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。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"。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。

经泰信行业精选混合型证券投资基金2015年8月28日基金份额持有人大会(通讯方式)表决通过，并报中国证监会备案，泰信行业精选混合型证券投资基金变更为泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金。自2015年9月1日起，由《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效。本基金的投资组合比例调整为:"本基金股票投资占基金资产的比例范围为0-95%。本基金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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券"，业绩比较基准不变。

泰信基金管理有限公司

2016年3月30日