Disclosure 信息披露

基金管理人:泰信基金管理有限公司 基金托管人:中国光大银行股份有限公司 送出日期:2016年3月30日 1. 重要提示 1.

21 基金基本情况			§ 2 基金简介			
基金简称			泰信先行策略混合			
基金主代码			290002			
基金运作方式			契约型开放式			
基金合同生效日			2004年6月28日			
基金管理人			泰信基金管理有限公司			
基金托管人			中国光大银行股份有限公司			
报告期末基金份額总額			2,083,907,380.41份			
基金合同存续期			不定期			
2.2 基金产品识明						
投资目标			运用多层次先行策略,灵活配置各类资产,追求收益的长期稳定增长;提前发现 和介入价值被市场低估的价值成长股票,在其价值回归过程中获取超额收益。			
投资策略			本基金股票投资部分以先行策略为核心,实行自上而下三个层次的资产配置。本 基金债券投资部分主要运用久期调整、收益率曲线配置、类别配置、无风险套利和 融资杠杆等策略。			
业绩比较基准			65%×富时中国A600 指数+35%×富时中国国债指数			
风险收益特征			本基金为混合型基金。属于风险适度的基金品种,其长期平均的预期收益和风险高于债券基金,低于纯股票基金。			
2.3 基金管理人和基金		-	•	1		
项目			基金管理人	基金托管人		
名称		幸	给基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司		
	姓名		胡囡	张建春		
信息披露鱼带人	联系由话		021_20899098	010-63639180		

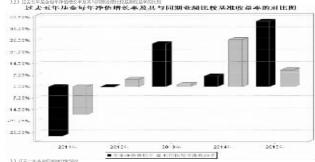
基金年度报告备置地点	ц	中国 (上海)自由贸易实验区浦东南路256号华夏银行大厦37层					
3.1 主要会计数据和财务指标	§ 3 主要财务指标、基金净值	1表現及利润分配情况	金額单位:人				
3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年				
本期已实现收益	2,419,784,215.87	335,837,420.75	-67,584,719				
本期利润	1,771,721,472.34	222,702,439.75	881,569,44				
加权平均基金份額本期利润	0.5725	0.0375	0.1				
本期基金份额净值增长率	41.22%	6.68%	27.1				
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末				
期末可供分配基金份額利润	0.3705	-0.3276	-0.3				
期末基金资产净值	1,899,683,803.86	3,272,137,476.25	4,046,608,159				
期末基金份额净值	0.9116	0.6455	0.6				

生。1.不是命行實子為原理人對於其主式生死。 4. 於江遙也會維持不包述基金的維持有人申助成交易基金的各項費用(例如,并依江基金的申助維因費。在利用投資費、基金幹差費等),計入費用后並 基本平要低于新产物交子。 大學是成工物政能和基本新明如於人,投資收益,其物從人,不含公允价值並均效益;預輸相关費用后的金額。本類時间为本期已实现收益加上本獨允允

增长率及其与同期业	统比较基准收益率的				
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
23.12%	2.36%	11.82%	1.10%	11.30%	1.26%
-10.60%	3.06%	-9.33%	1.74%	-1.27%	1.32%
41.22%	2.89%	10.49%	1.60%	30.73%	1.29%
91.55%	1.97%	37.81%	1.15%	53.74%	0.82%
31.28%	1.70%	18.54%	1.04%	12.74%	0.66%
313.09%	1.66%	156.49%	1.20%	156.60%	0.46%
	份额净值增长率	砂部単価増长率 砂部単価増长率	67部(中位別大半 67部(中位別大半 北京大大2店市収	67部争位等长率 (分部)を担任本 卓州大な15周収 連州大な15周収 を担任を1 1.10%	23,12% 2,36% 11,82% 1,10% 11,30% -1,06% -9,33% 1,74% -1,27% -1,27% -1,27% -1,27% -1,27% -1,27% 1,25% 1,97% 37,81% 1,15% 53,74% 31,28% 1,70% 18,54% 1,04% 12,74% 313,09% 1,66% 156,40% 1,20% 156,60% 1,20% 156,60% 1,20% 156,60% 1,20% 1,

SUBJECT OF	-	-		+	+	+	-	+		+	-	-	-	+			-		÷
577.778		-	-	4	1	+	-	4		+	+		-	+	-		-	-	1
404.04%		+	-		-	+	+	+		+	-	4		+	-				٠
4C5.56%		-	ł		1	1	+	4		+	+			+	+				1
343.40%			f		h	Λl													1
STOR					1	A													1
727 178		-		4	J	4	V.	4	11	h.				+	-				
1/4 2/1	-			-	1	N	1	v	P.W		<i>[</i>]	N		+	4	P	A	p	1
115.6%		-	-	- 1	1	4	и.	V	N	Purp.	de	r'in	1	,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,	1		•	1	! !k
28.00%		+	34	الحر		+	1	p.F		4	1	-	.0	1	V.	Land.	ساداب	900	+
F00.0	-	, ,	J.	4															
	200000	-		÷	1	-	200000	2000 53 06	10174000		700 X	N	2.21.8	20 200-4	1000	X 355.05	0-5-36	20 44100	10.35.00

注:1. 未基金基金公司了2001年5月为1日:元年收. 2. 本基金建金为大人,建金融金和股市。据传·基金公司关于投资组合的相关规定。本基金组合投资的基本范围为-投票资产30%—93%。债务资产 0%—65%。提金或者到时任一年以外的投资债务。在下基金等资产约5%。 3. 经常品基金管理和假心司办会地议及上,提明整定并至14世长基金基金经理、未起双生年再排任本基金基金经理。具体详情请提2035年2月5日刊 登在(中国证券投)《广商证券投》(证券投资》及大公司网及上的《卷标基金管理有限公司关于泰信表行策略开放式逐步投资基金经理变更的公告)。 3.23 过去元年基金等存储的关键。是以与国际股份收益条件部的发生。



		任职日期	离任日期	亚士林	
袁园女士	本基金基金经理	2012年3月1日	-	8年	理学硕士。具有基金从业资格。2007年5月加入 泰信基金管理有限公司,先后担任研究部助理 研究员、理财制师部研究员、研究部高级研究 员、泰信优质生活混合基金经理助理。
钱鑫先生	本基金基金经理	2014年5月20日	-	6年	硕士,具有基金从业资格。曾任华为海思半导体 任产品市场经理、上海形额投资发展有限公司 TMT行业研究员。2012年3月加入泰信基金管理 有限公司,在研究部均任高级研究员岗位,自 2013年7月起任先行策略基金经理助理。
裁字虹 女士	本基金经理兼 泰信优质生活、 泰信现代服务 业基金经理	2015年2月5日	-	8年	金融率领土、具有基金从业资格。营先后任职于 国线控股有限公司、联基证券股份有限公司。 2008年10月加入泰信基金管理有限公司、先后 担任研究能端级研究、泰信发展主题基金经理 助理。自2012年3月由足相任泰信化版生务 合基金经理。自2013年3月由足知3年3月17日 担任秦信派代联务业保合基金经理。
朱志权 先生	基金投资部总 资总金 被 数 基 兼 基 兼 系 在 代 是 金 条 后 后 基 会 条 是 后 后 后 后 后 后 后 后 是 后 后 后 后 是 后 后 是 后 后 是 后 是 后 是 后 是 后 是 后 是 后 是 后 是 后 是 后 是 后 是 是 后 是 是 后 是	2012年3月1日	2015年2月5日	20年	经济学生上具有基金从业资格。曾任职于中信证券上海应游、水路基金管理有限公司。银河市等人第一次。 中海信托管理有限公司、银河基金管理有限公司、股河基金管理有限公司、2008年6月28日至2012年3月1日日起行零省次值生活基金经理,2010年1月1日日起任任零估次的单位基金经产等。

5. 基金新规约和自用的规范的目前。2次分长在1982年,2010年2010年,2

4.1 电影影形式的设置操作。 "国际的证书,从股际经历了上中联门加工作",每届在1517%(同网股次的大电大路、全年现出放展的中央回路在2.6 大基点上半年来分把度市场 主发、最大地与"TATT",被助场地点,这或特别或设计点。如今"1993"的设立资本。的均均离为增加的现代。 "这一个"1993"(1994),"这一个"1995"(1995)。"这一个"1995"(1995)。"这一个"1995"(1995)。 "1995—"

班孫於東方可能也將經經。 於相撲後者,是所任何任力較大,中美利獎扩大,我们預计将有呼吸值3-5%的關度,不經經期房1後沒会大規模外進,这样国内的降息空間接受限。 12回,明年被消性寬松力度不加今年,但是利率下行趋勢不变,从查利员關東看,今年工业企业经按状况不住,明年通过19%抵送,上市公司层面成长投

本是在各种,并且是由于1987年11870年,1987年,

5 本科学历。2002年加入泰信基金管理公司,现任公司副总经理。

泰信先行策略开放式证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31日

审计报告标题	审计报告			
审计报告收件人	泰信先行策略开放式证券投资基金全体基金份额持有人			
引言段	我们审计了后附的零信先行策略开放式证券投资基金(以下简称"零信先行策略基金")的财务报表。但结2015年12月31日的资产负债表、2015年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表记及政务报录制注。			
管理层对财务报表的责任段	编制的公元则则具各担表起牵信先行策略基金的基金管理人奉信基金管理有限公司管理层 的背压。这种产性包括。 (此按限企业全计推制中中国证券监督管理是员会以下海体中国证金全)发布的有关 规定处定计划是全位业务是特别制度系程、并被某来现公企设。 (2)设计,执行策维护必要的内部控制。以使财务报表不存在由于轉弊或错误导致的重大 替报。			
注册会计师的责任段	看到的任民在片下街上作的基础上对特别模求发现计算。我才探观中国进步会计 明显小证通守别,计划市场广场十二年,中国进步会计划市场观察大员,设计工作。 明显小证通守别,计划市场广场上了作人对特别技术是是不存在企业特技取各个规模还 研了工作业务工作研究。 研工作业务工作研究,但成为由于增加或指导中效的特别发展大场和发现的标准。 是他的工作工程,并且由于一个工程,就是由于一个工程,是他的工程,这样是是他的工程, 上述一个工程,但是一个工程,但是一个工程,但是一个工程,但是一个工程, 是一个工程,但是一个工程,但是一个工程,但是一个工程,但是一个工程, 是用会工程案的价值,但是一个工程,但是一个工程,但是一个工程,但是一个工程, 使用的工程,但是一个工程,但是一个工程,但是一个工程,但是一个工程,但是一个工程,就是一个工程, 使用的工程,就是一个工程,但是一个工程,但是一个工程,但是一个工程,就是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,是一个工程,可以可以可以是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,可以可以是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,可以可以是一个工程,可以可以是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,可以可以是一个工程,可以可以是一个工程,可以可以是一个工程,可以可以可以是一个工程,可以可以是一个工程,可以可以可以可以可以可以可以是一个工程,可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以			
审计意见段	我们认为。上述奉信先行策略基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在报表附注中所列示的丁奉信违监会。中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业操作编制。公允良换了零信先行策略基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经果和基金净值变动情况。			
注册会计师的姓名	单峰 問待			
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)			
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6楼			
由计报告日担	2016年3月25日			

7.1资产负债表
会计主体:泰信先行策略开放式证券投资基金

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产:	2013 127131	2014 1277214
银行存款	213,800,390.08	474,525,619.6
结算备付金	15,240,594,00	18.846.602.9
存出保证金	2,151,773.68	782,239.7
交易性金融资产	1,664,713,754.94	2,751,368,344.3
其中:股票投资	1,624,685,754.94	2,750,768,200.0
基金投资		2.2.2.2.2.2.
债券投资	40,028,000.00	600,143.
资产支持证券投资	_	
贵金属投资	_	
衍生金融资产	_	
买人返售金融资产	_	320,000,000.0
应收证券清算款	35,828,809.68	11,466,993.0
应收利息	262,394.67	54,487.
应收股利	-	
立收申购款	1.890.97	56.867.
递延所得税资产	-	
其他资产	_	
资产总计	1,931,999,608.02	3,577,101,155.
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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	19,339,932.21	283,282,053.
立付赎回款	1,024,068.00	7,166,372.
立付管理人报酬	2,437,189.51	4,383,070.
应付托管费	406,198.26	730,511.
应付销售服务费	-	
立付交易费用	7,442,059.03	7,735,617.
立交税费	-	
立付利息	-	
立付利润	-	
递延所得税负债	-	
其他负债	1,666,357.15	1,666,053
负债合计	32,315,804.16	304,963,679.
所有者权益:		
实收基金	949,107,587.74	2,308,850,010
未分配利润	950,576,216.12	963,287,465.
所有者权益合计	1,899,683,803.86	3,272,137,476.
负债和所有者权益总计	1,931,999,608.02	3,577,101,155.

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	1.873.962.734.47	306.400.248.
1.利息收入	5,401,096,42	8,005,898.
其中:存款利息收入	2,306,945.48	1,686,557.
债券利息收入	2,695,576.54	2,439,041.
资产支持证券利息收入	_	
买人返售金融资产收入	398,574.40	3,880,299.
其他利息收入	_	
2.投资收益 倾失以""填列)	2,516,316,113.57	411,365,215.
其中:股票投资收益	2,509,684,246.12	395,864,716.
基金投资收益	-	
债券投资收益	78,176.75	240,710.
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	6,553,690.70	15,259,788.
3.公允价值变动收益 假失以 ""号填列)	-648,062,743.53	-113,134,981
4.汇兑收益(损失以""号填列)	-	
5.其他收入 假失以 ""号填列)	308,268.01	164,115
域:二、费用	102,241,262.13	83,697,808.
1.管理人报酬	40,982,880.43	54,197,866.
2.托管费	6,830,480.01	9,032,977
3.销售服务费	-	
4.交易费用	53,984,701.69	20,023,563
5.利息支出	-	
其中:卖出回购金融资产支出	-	
6.其他费用	443,200.00	443,400.
三、利润总额 传报总额以 ""号填列)	1,771,721,472.34	222,702,439
域:所得税费用	-	
四、净利润(学亏损以""号填列) 7.3 所有者权益(基金净值)变动表 会计主体:泰信先行策略开放式证券投资基金	1,771,721,472.34	222,702,439.

		单位:人民币				
本期 2015年1月1日至2015年12月31日						
实收基金	未分配利润	所有者权益合计				
2,308,850,010.52	963,287,465.73	3,272,137,476.25				
=	1,771,721,472.34	1,771,721,472.34				
-1,359,742,422.78	-1,784,432,721.95	-3,144,175,144.73				
260,229,253.79	335,613,136.71	595,842,390.50				
-1,619,971,676.57	-2,120,045,858.66	-3,740,017,535.23				
=	-	=				
949,107,587.74	950,576,216.12	1,899,683,803.86				
上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日						
实收基金	未分配利润	所有者权益合计				
3,045,821,988.55	1,000,786,170.84	4,046,608,159.39				
-	222,702,439.75	222,702,439.75				
-736,971,978.03	-260,201,144.86	-997,173,122.89				
45,671,310.21	17,452,761.30	63,124,071.51				
-782,643,288.24	-277,653,906.16	-1,060,297,194.40				
-	-	=				
2,308,850,010.52	963,287,465.73	3,272,137,476.25				
	家收基金 2,308,850,010.52 -1,359,742,422.78 260,229,253,79 -1,619,971,676.57 -949,107,587,74 201 家收基金 3,045,821,988.55 -736,971,978.03 45,671,310,21 -782,643,288.24	2019年1月日至2019年12月3日 東牧振金 2.388.850,010.52 963.287.465.73 -1.771,721,472.34 -1.359,742.422.78 -1.784.432,721.95 260.229.253.79 335.613,136.71 -1.619.971.676.57 -2.120,045.858.66 940,107.587.74 950.576.216.12 上年度可比期間 2014年1月日至2014年12月3日 実收益金 3.045.821,988.55 1.000,786,170.84 -736,971.978.03 -202.00,011,44.86 45.671.310.21 17.452.761.30 -782.643.288.24 -277.653.906.16				

本报告了1至74數分报表由下列负责人签署; 本报告了1至74數分报表由下列负责人签署; 基金管理人负责人 主管会计工作负责人

前指数)。 企管理人泰信基金管理有限公司于2016年3月25日批准报出。

会计政策和会计估计 3古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。 80 智和会计估计变更以及差错更正的说明

打球。現代記古行文史以及老曲生出的的 付付就要更明的。 「相合資本文主会计定性变更。 打估了美型的图 「涉及另所上印度注射等认的固定改益品种可转物债务。资产支持证券和核募债务除外,鉴于其交易量和交易期率不足以提供持续的定价信息。本 所述,发展所上印度注射等认的固定改造品种可转物债务。资产支持证券和核募债务除外,鉴于其交易量和交易期率不足以提供持续的定价信息。本 版文素用中企器被有限公司根据(中国证券投资基金业协会估值核算工作为组长于2015年1季度固定改造品种的估值处理标准)所能立是限的估

大联刀石阶	一司平鉱並則大於
》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
上海鋭艷资产管理有限公司	基金管理人的子公司
中国光大银行股份有限公司("先大银行")	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
工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新信基金管理有限公司的股界山原省III所 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。 7.48 本限台朝及上年度可比期间的关联方交易 7.48.1 超过关联方安易甲元进行的交易 7.48.1 股票交易	富托有限公司于2015年7月30日变更注册为山东省国际富托威协有限公司。

7.48.11 股票交易。 本报告前来及上年度可比期间本基金未通过关联方进行股票交易。 7.48.12 债券交易。 本报告前来及10年发 7.48.12 成分 7.48.13 以下, 7.48.14 以下, 7.48.1.4 权证交易 本报告期末及上年度可比期间本基金未通过关联方进行权证交易。 7.48.1.5 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。 7.48.2 羊昨五粉屬

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
朋发生的基金应支付的管理费	40,982,880.43	54,197,866.89
中:支付销售机构的客户维护费	8,537,091.16	11,794,126.50
:文付基金管理人泰信基金管理有限/ 用=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当 4.8.2.2 基金托管费	公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率 年天教。	萨叶提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为;日管理单位;人民币元
项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
BUD II Ab to A photo LLAb LCAN III	C 020 400 01	0.022.077.80

				份額甲位
	2015	≰期末 ∓12月31日	上年度末 2014年12月31	B
关联方名称	持有的 基金份额	持有的基金份額 占基金总份額的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例
东省国际信托股份有限公	69,005,789.30	3.3100%	-	-

关联方 名称			2015年1月	本期 1日至2015年	-12月31日			上年度可比期 2014年1月1日至2014年	间 12月31日	
治称		期	未余額		当期利息	枚人	期末余額		当期利息收入	
中国光大	(银行 213,800,390.08 2,034,070.03					474,525,619.67	1,422,630.	.78		
7.4.9 期末 7.4.9.1 因 报告期末 7.4.9.2 期	(2015 认购新 本基金 未持有印	中度可比期间; 交易事项的说 支上年度可比) 年12月31日 发/增发证券而 未持有因认购。	本基金持 計一期末持 所发/增发前 充通受限服	有的流通受限 有的流通受限 i处于流通受 票	证券 证券 限的证券。				金额单位;人	R
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 开群单	数量 般)	期末 成本总額	期末估值总额	200.00
300336	新文 化	2015年12 月23日	重大事 项停牌	42.00	-	-	1,590,148	53,226,204.06	66,786,216.00	Ī
	长电	2015年11	重大事							t

	金额单位:人								民币	
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	数量 段)	期末 成本总額	期末估值总额	备注
300336	新文 化	2015年12 月23日	重大事 项停牌	42.00	-	-	1,590,148	53,226,204.06	66,786,216.00	-
600584	糨	2015年11 月27日	重大事 项停牌	22.02	-	-	1,879,987	45,024,335.40	41,397,313.74	-
300049	護夢	2015年11 月27日	重大事 项停牌	31.00	2016年1 月1日	30.95	1,200,240	31,620,058.06	37,207,440.00	-
600682	南京新百	2015年7月 1日	重大事 项停牌	32.98	2016年1 月27日	33.78	502,352	7,495,401.67	16,567,568.96	-
002568	夏海	2015年12 月18日	重大事 项停牌	42.69	2016年1 月18日	38.42	340,238	7,614,611.69	14,524,760.22	-
002228	合兴 包装	2015年8月 4日	重大事 项停牌	19.52	2016年2 月2日	15.21	666,144	14,457,295.06	13,003,130.88	-
600990	野	2015年9月 1日	重大事 项停牌	82.63	2016年3 月25日	69.03	107,135	7,941,136.21	8,852,565.05	-
300220	鑫克	2015年12 月9日	重大事 项停牌	41.10	-	-	167,600	5,667,013.03	6,888,360.00	-
002612	朗姿 股份	2015年12 月22日	重大事 项停牌	75.46	-	-	26,400	1,449,401.53	1,992,144.00	-
7F - ALM 9	PR022989	15±12 H 31 H	IF持有以		大學研刊的	产生重大验	测加	股票 逐季股票将在库公司	h 學山原的 東大拳川助海線 后。	2017

所批准规则。 7.443. 司末债务上回购交易中作为抵押的债务 2.443. 司末债务上回购交易中作为抵押的债务 本股票原本基金未存件或用加贴债券正回购作为抵押的债务。 7.49.3.2 交易所加贴债券正回购作为抵押的债务。 7.410.1 有助于理解和分价会计报支票要设置的基础等现 7.410.1 有助于理解和分价会计报支票要设置的基础等现 10.5余价值

5分价值 本基金持有的以公允价值计量且其变动计人当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为1.417.466.256.09元,属于第二层次的余额为 第三层次的余额(2014年12月31日:第一层次2513,863,210.72元,第二层次237,565,133.62元,无第三层次)。 价值新属放水间的重大变态 交易时,即的等数制度,否则更多大事间能够,交易不得致何比别政策时分又易不活致,或属于非公开发行等情况,本基金不会干停停日至交 19周1 支急,不过长期间以强值期间将相关规密机构等的公元价值划以第一次公开排现的适调器中采用的不可观域和人组立于公众价值的原则经 25.5%,以为15.5%。25.5%,以为15.5%,以为15.5%。25.5%,以为15.5%。25.5%,以为15.5%。25.5%。

无。 (引非持续的以公允价值计量的金融工具 针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(2014年12月31日:同)。 (4)不以公允价值;量的金融工具 不以公允价值;指的金融资产和价值主要包括应收款资和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小 公除公允价值;我至第产债债表日本基金无需要说明的其他重要明确。 88. 数末基金债产和仓债契

29271	-manuscott Manuscott		金額单位:人民
序号	项目	金額	占基金总资产的比例 66)
1	权益投资	1,624,685,754.94	84.0
	其中:股票	1,624,685,754.94	84.0
2	固定收益投资	40,028,000.00	2.0
	其中:债券	40,028,000.00	2.0
	资产支持证券	-	
3	贵金属投资	-	
4	金融衍生品投资	-	
5	买人返售金融资产	-	
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	
6	银行存款和结算备付金合计	229,040,984.08	11.8
7	其他各项资产	38,244,869.00	1.9
8	合计	1,931,999,608.02	100.0
8.2 期末	來行业分类的股票投资组合		金額单位:人民

8.2 3	用未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	-	-
В	采矿业	-	-
С	制造业	843,939,098.65	44.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,942,400.00	0.47
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	32,196,968.96	1.69
G	交通运输、仓储和邮政业	26,444,709.57	1.39
Н	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	243,130,899.82	12.80
J	金融业	40,826,577.60	2.15
K	房地产业	91,125,163.50	4.80
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	57,830,159.64	3.04
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	17,366,378.86	0.91
R	文化、体育和娱乐业	230,037,006.22	12.11
S	综合	32,846,392.12	1.73
	合计	1,624,685,754.94	85.52

序号	股票代码	股票名称	数量 段)	公允价值	占基金资产净值比例 66)
1	002184	海得控制	1,773,997	76,299,610	0.97 4.0
2	002699	美盛文化	1,407,050	71,900,255	5.00 3.7
3	300336	新文化	1,590,148	66,786,216	5.00 3.5
4	002230	科大讯飞	1,499,940	55,572,777	7.00 2.5
5	002292	奥飞动漫	918,649	47,503,339	9.79 2.5
6	000681	视觉中国	1,099,742	41,801,193	3.42 2.2
7	600584	长电科技	1,879,987	41,397,313	3.74 2.1
8	600728	佳都科技	1,069,821	39,882,926	5.88 2.1
9	600651	飞乐音响	2,570,000	37,907,500	0.00 2.0
10	300049	福瑞股份	1,200,240	37,207,440	0.00 1.9
9	600651 300049	飞乐音响	2,570,000 1,200,240	37,907,500	0.00
rk B	80-300 AP-201	四里文於		相要计正人全编 。	金额单位:人 片期紅紅公路产為信比例:

4	300027	华谊兄弟	175,418,427.16	5.36
5	000024	招商地产	160,767,157.40	4.91
6	002699	美盛文化	158,732,823.80	4.85
7	300049	福瑞股份	157,631,626.26	4.82
8	601628	中国人寿	147,560,461.99	4.51
9	300144	宋城演艺	145,556,277.00	4.45
10	300359	全通教育	138,552,306.34	4.23
11	600030	中信证券	135,777,424.29	4.15
12	002230	科大讯飞	134,845,656.42	4.12
13	600048	保利地产	121,684,260.29	3.72
14	300178	腾邦国际	119,999,405.59	3.67
15	000793	华闻传媒	119,240,235.79	3.64
16	000532	力合股份	113,668,782.45	3.47
17	300336	新文化	110,880,209.42	3.39
18	300212	易华录	109,051,576.43	3.33
19	002348	高乐股份	105,230,383.07	3.22
20	002154	报喜鸟	99,872,978.03	3.05
21	300006	莱美药业	99,180,923.31	3.03
22	600446	金证股份	96,157,330.03	2.94
23	002184	海得控制	92,389,414.40	2.82
24	002657	中科金財	91,946,552.74	2.81
25	600571	信雅达	91,812,356.84	2.81
26	002313	日海通讯	90,656,646.95	2.77
27	600410	华胜天成	90,507,271.86	2.77
28	002405	四维图新	88,528,933.68	2.71
29	600000	浦发银行 爱迪尔	88,411,872.51	2.70
30	002740		85,200,963.07	2.60 2.58
32	600837	海通证券 首开股份	84,485,022.53 78,463,331.83	2.38
33	600651	飞乐音响	78,086,804.02	2.39
34	000523	广州浪奇	78,068,058.63	2.39
35	000323	中期股份	77,437,439.80	2.39
36	601186	中国铁建	77,193,166.62	2.36
37	300219	鸿利光电	76,515,814.38	2.34
38	000402	金融街	72,315,310.89	2.21
39	600388	龙净环保	72,171,440.47	2.21
40	600767	运盛医疗	71,763,501.33	2.19
41	300377	贏时胜	71,231,141.12	2.18
42	300071	华谊嘉信	70,842,862.78	2.17
43	600687	刚泰控股	69,965,163.18	2.14
44	600169	太原重工	69,279,756.18	2.12
45	002421	达实智能	68,663,937.58	2.10
46	603898	好菜客	68,004,355.73	2.08
47	000558	莱茵体育	66,887,561.87	2.04
48	000620	新华联	66,604,969.31	2.04
49	300227	光韵达	66,053,092.40	2.02
注:本项的	"买人金额"均按买 赤山金额超山加加到	人成交金額(成交单价乘以成了	(数量)填列,不考虑相关交易费用。 用细	

1	300253	卫宁健康	480,126,653.73	14.67
2	300070	碧水源	314,221,813.60	9.60
3	600079	人福医药	253,139,367.53	7.74
4	000002	万 科A	239,870,090.06	7.33
5	601318	中国平安	222,356,762.96	6.80
6	300027	华谊兄弟	195,285,625.99	5.97
7	600571	信雅达	187,905,890.76	5.74
8	002400	省广股份	187,430,368.29	5.73
9	601166	兴业银行	180,351,347.44	5.51
10	600446	金证股份	177,586,970.15	5.43
11	002292	奥飞动漫	173,450,152.08	5.30
12	300049	福瑞股份	171,434,888.02	5.24
13	300144	宋城演艺	170,256,326.56	5.20
14	600030	中信证券	166,882,093.82	5.10
15	300178	腾邦国际	158,257,256.38	4.84
16	601628	中国人寿	157,583,100.45	4.82
17	000024	招商地产	150,097,721.06	4.59
18	300359	全通教育	138,645,463.13	4.24
19	300006	莱美药业	129,186,998.85	3.95
20	600388	龙净环保	125,563,709.18	3.84
21	002568	百润股份	120,635,858.16	3.69
22	002152	广电运通	119,864,138.90	3.66
23	600048	保利地产	119,625,240.12	3.66
24	300015	爱尔眼科	117,533,010.30	3.59
25	000793	华闻传媒	116,829,585.42	3.57
26	300075	数字政通	115,898,576.08	3.54
27	300212	易华录	106,976,505.63	3.27
28	600000	浦发银行	105,882,798.26	3.24
29	002657	中科金财	101,777,633.33	3.11
30	002699	美盛文化	101,390,551.78	3.10
31	002230	科大讯飞	101,364,392.84	3.10
32	002154	报喜鸟	101,280,150.22	3.10
33	002348	高乐股份	100,182,572.86	3.06
34	300287	飞利信	99,439,533.46	3.04
35	600837	海通证券	97,603,558.70	2.98
36	002642	荣之联	94,544,432.65	2.89
37	000532	力合股份	91,935,506.50	2.81
38	002405	四维图新	89,379,737.23	2.73
39	300151	昌红科技	87,969,526.50	2.69

-10	500500	54,404 (127.65)	07,410,002.00	2.07
41	603898	好莱客	86,817,224.42	2.65
42	002313	日海通讯	86,466,991.31	2.64
43	002573	清新环境	85,130,952.94	2.60
44	002740	爱迪尔	84,612,177.87	2.59
45	002184	海得控制	84,522,365.96	2.58
46	000523	广州浪奇	83,696,144.04	2.56
47	601186	中国铁建	83,688,135.99	2.56
48	000997	新大陆	82,951,379.95	2.54
49	300377	贏时胜	81,229,421.69	2.48
50	000887	中期股份	78,519,984.09	2.40
51	600410	华胜天成	77,186,247.87	2.36
52	600169	太原重工	74,868,152.48	2.29
53	300183	东软载波	73,620,612.77	2.25
54	002503	搜于特	72,679,139.94	2.22
55	600687	刚泰控股	72,161,682.35	2.21
56	300182	捷成股份	72,002,802.82	2.20
57	600276	恒瑞医药	71,982,577.53	2.20
58	000732	泰禾集团	71,917,573.31	2.20
59	000777	中核科技	70,327,486.96	2.15
60	300315	掌趣科技	70,167,488.51	2.14
61	002581	未名医药	70,138,012.44	2.14
62	002022	科华生物	69,815,330.10	2.13
63	601607	上海医药	69,689,532.20	2.13
64	300336	新文化	68,632,252.34	2.10
65	300133	华策影视	68,479,021.68	2.09
66	300071	华谊嘉信	68,385,757.22	2.09
67	300227	光韵达	68,076,807.64	2.08
68	600767	运盛医疗	67,833,435.40	2.07
69	000402	金融街	67,799,559.03	2.07
70	000070	特发信息	66,865,033.39	2.04
71	300251	光线传媒	65,453,573.24	2.00
注:本项"			数量)填列,不考虑相关交易费用。	

单位:人民						
15,928,728,175.5	·			本 成交 治額	买入股票成	
18,916,542,827.5			卖出股票收入 (战交) 総額			
作用。 金額単位: 人民:	交数量)填列,不考虑相关交易	交金額(成交单价乗以成	"票收人"均接买卖成 资组合	天人股票成本"。"卖出股 货债券品种分类的债券投资	注:本项" 8.5 期末报	
占基金资产净值比例 66)	价值	公允	品种	债券品	序号	
	-			国家债券	1	
	-			央行票据	2	
2.1	40,028,000.00	全债券 40,02		金融债券		
2.1	40,028,000.00		其中:政策性金融债			
	-			企业债券	4	
	-			企业短期融资券	5	
	-	=		中期票据	6	
	-	-		可转债	7	
	-	存单 -			8	
	-		其他		9	
2.1	40,028,000.00		10 合计			
金額单位:人民		五名债券投资明细	直比例大小排序的前五	女公允价值占基金资产净1	8.6 期末技	
占其全资产净值比例			10.00			

9	其他			-		-
10	合计			40,028,000.00		2.11
6 期末担	公允价值占基金资产净[直比例大小排序的前去	1名债券投资明细			金額单位:人民币元
字号	债券代码	债券名称	数量 张)	公允价值	Į.	占基金资产净值比例 %)
1	150222	15国开22	200,000		20,014,000.00	1.05
1	150219	15国开19	200,000		20,014,000.00	1.05
8 报告期 15 期本本 16 期本本 10 10 10 10 10 20 10 10 20 11 11 11 11 11 11 11 11 11 11 11 11 11	明末未持有资产支持证券]末按公允价值占基金资/ r.其金丰均资券金属/	。 "净值比例大小排字的 直比例大小排字的前五 旋交易情况说明 前货持仓和损益明细 货。 续策 货。 多情况说明	名员产生中止多投资明 的前五名贵金属投资明组 1.名权证投资明细			

	截至报告 8.12 投资 8.12.1 本基金投 8.12.2	臨時階級時齡 期本基金共敗張國體關係。 组合相告附注 歲齡十名股票中没有沒行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制 該齡十名的思票中,不存在投資于超过基金合同规定备选股票单之外, 其集結各項於可能	
Г	序号	名称	金額
F	1	存出保证金	2,151,773
Г	2	应收证券清算款	35,828,809
Г	3	应收股利	
Г	4	应收利息	262,394
Г	5	应收申购款	1,890
Г	6	其他应收款	
Г	7	待摊费用	
Г	8	其他	
Г	0	승난	38 244 860

8.12.5	胡末本基金未持有 阴末前十名股票中	存在流通受限情	泛 的说前。		金额单位:人民币;
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	300336	新文化	66,786,216.00	3.52	重大事项停牌
2	600584	长电科技	41,397,313.74	2.18	重大事项停牌
3	300049	福瑞股份	37,207,440.00	1.96	重大事项停牌
8.12.6 7	本报告涉及合计数	相关比例的,均以	以合计数除以相关数据计算,而不是 69 基金份額	对不同比例进行合计。	
9.1 期末	表。分份额持有人	户数及持有人结	\$ 2 MEMERY 19	DATE VIEW	

9.1 期末基金份額份	·有人尸数及持有人结构					份额单位:		
			持有人结构					
持有人户数(户)	户均持有的基金份额	机构投资者		个人投资者				
		持有份額	占总份额比例		持有份額 占总份額比 1,921,968,911.26 92.23%			
80,557	25,868.73	161,938,469.	15 7.77%					
9.3 期末基金管理人	、的从业人员持有本基金的	情况						
Ij	项目		持有份額总数(份)			占基金总份额比例		
基金管理人所有从。	L人员持有本基金		208,433.55			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			持有基金份額总量的数量区间 (万份)					
本公司高级管理人员 放式基金	员、基金投资和研究部门负	负责人持有本开						
本基金基金经理持有本开放式基金			(

	単位:1
基金合同生效日(2004年6月28日)基金份额总额	748,846,262.32
本报告期期初基金份額总額	5,069,444,064.09
本报告期基金总申购份額	571,366,471.16
减:本报告期基金总赎回份額	3,556,903,154.84
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	=
本报告期期末基金份额总额	2,083,907,380.41
注:总申购份额含红利再投资、转换人份额;总赎回份额含转换出份额。 611 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。	

1.本格比斯以基金杆管人协专门基金杆管部门末少生重大人等重动。 2.经考虑金管销有损处河边少年认及进一种财富产年之村任本基金基金经理、朱老权先生不再担任本基金基金经理 205年2月5日特营在 中国证券报入 (金属工券报入 破卖并投放本公司网站上的 希信基金管理有限公司关于零信先行策略引 基金经理要现分公告,本公司上长人事变应上按杆规定时间签件的成立并备案 施比从开关限值大人事实。	。具体详情请见 F放式证券投资
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	
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10.7万元。该审计机构从基金合同生效日 2004年6本基金提供审计服务。	月28日)开始为
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查成处罚等情况	
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	

券商名称	交易单元数量	股票	占当期股票	应支付该券商的佣金 占当期佣金		备注
		成交金額	成交总额的比例	佣金	总量的比例	
东兴证券	1	4,086,863,181.04	11.73%	3,674,930.15	11.69%	-
安信证券	1	3,671,098,878.09	10.54%	3,263,357.20	10.38%	-
国信证券	1	3,195,279,350.16	9.17%	2,897,212.90	9.21%	-
平安证券	2	3,083,185,345.56	8.85%	2,753,334.75	8.75%	-
民生证券	1	2,745,552,812.35	7.88%	2,454,330.45	7.80%	-
兴业证券	2	2,490,489,766.17	7.15%	2,220,628.60	7.06%	-
华创证券	1	2,210,664,210.89	6.34%	2,023,560.23	6.43%	-
中国建银投资证 券	2	1,572,759,681.92	4.51%	1,409,755.94	4.48%	-
渤海证券	1	1,506,446,169.29	4.32%	1,371,466.84	4.36%	-
中国银河证券	1	1,418,220,969.45	4.07%	1,299,581.15	4.13%	-
华泰证券	1	1,359,153,157.73	3.90%	1,237,370.69	3.93%	-
海通证券	1	1,188,607,710.14	3.41%	1,100,610.56	3.50%	-
申万宏源	1	1,172,896,314.14	3.37%	1,092,315.16	3.47%	-
中信证券	2	1,050,463,924.41	3.01%	929,557.13	2.96%	-
东北证券	1	932,602,577.73	2.68%	868,531.77	2.76%	-
国海证券	1	730,962,316.06	2.10%	646,829.53	2.06%	-
东方证券	1	727,218,477.92	2.09%	662,059.40	2.11%	-
长江证券	1	650,790,457.69	1.87%	592,478.42	1.88%	-
华泰证券	1	498,351,793.78	1.43%	440,992.11	1.40%	-
招商证券	1	328,710,369.63	0.94%	306,128.83	0.97%	-
长城证券	1	224,553,914.00	0.64%	204,431.81	0.65%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
西藏证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
注:根据中国证监的年交易佣金,不得 同告。对证券公司的	会《关于完善证券投 超过其当年所有基 时究能力。由公司	资基金交易居位有关问题 金买卖证券交易佣金30 开究人员对其提供的研 用待20进行调整	的通知》(证监基金字【 %"的要求,本基金管理 究报告、研究成果的质量	2007】48号)中关于"一家是 人在选择租用交易单元。 提行定期评估。公司将根	。金公司通过一家证券 付,注重所选证券公司 据内部评估报告,对	经营机构: 引的综合实 交易单元

						金额甲位:人氏巾:
	债券	交易	债券回购	咬易	权证	と易
券商名称	成交金額	占当期债券 成交总额的比例	成交金額	占当期债券回 购 成交总额的比 例	成交金額	占当期权证 成交总额的比例
东兴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	330,000,000.00	9.52%	-	-
华创证券	-	-	184,000,000.00	5.31%	-	-
中国建银投资证 券	-	-	=	-	=	-
渤海证券	-	-	633,000,000.00	18.25%	-	-
中国银河证券	-	-	486,000,000.00	14.01%	-	-
华泰证券	673,486.20	100.00%	-	-	-	-
海通证券	-	-	866,000,000.00	24.97%	-	-
申万宏源	-	-	500,000,000.00	14.42%	-	-
中信证券	-	-	I	-	ı	-
东北证券	-	-	272,000,000.00	7.84%	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	103,000,000.00	2.97%	ı	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	94,000,000.00	2.71%	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
西藏证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	ı	-	I	-
国泰君安	-	-	=	-	-	-
英大证券	-	-	I	-	I	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
11/2/2013					· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	

	V 2				
-	-	-	-	-	东兴证券
-	-	-	-	-	安信证券
-	-	-	-	-	国信证券
-	-	-	-	-	平安证券
-	-	-	-	-	民生证券
-	9.52%	330,000,000.00	-	-	兴业证券
-	5.31%	184,000,000.00	-	-	华创证券
=	=	-	=	=	中国建银投资证 券
-	18.25%	633,000,000.00	-	-	渤海证券
-	14.01%	486,000,000.00	-	-	中国银河证券
-	-	-	100.00%	673,486.20	华泰证券
-	24.97%	866,000,000.00	-	-	海通证券
-	14.42%	500,000,000.00	-	-	申万宏源
-	-	-	-	-	中信证券
-	7.84%	272,000,000.00	-	-	东北证券
-	-	-	-	-	国海证券
-	-	-	-	-	东方证券
1	2.97%	103,000,000.00	1	-	长江证券
-	-	-	-	-	华泰证券
-	2.71%	94,000,000.00	-	-	招商证券
-	-	-	-	-	长城证券
1	-	-	1	-	中金公司
-	-	-	1	-	国金证券
-	-	-	-	-	浙商证券
-	-	-	-	-	西藏证券
-	-	-	-	-	民族证券
1	-	-	1	-	中泰证券
-	-	-	1	-	宏源证券
-	-	-	-	-	华宝证券
-	-		-	-	国联证券
-	-		-	=	国泰君安
-	-	-	-	-	英大证券
-	-	-	-	-	西南证券
_	_	_	_	_	中信建投

泰信基金管理有限公司 2016年3月30日