泰信中证200指数证券投资基金

2015年度报告摘要

2015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：中国银行股份有限公司
送出日期：2016年3月30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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月28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2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰信中证200指数
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	62,111,287.93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。由于采用被动投资策略，在投资管理上将最大限度地分散掉非系统性风险。对于跟踪误差的风险，本基金将通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的跟踪误差在限定范围内。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡囡	王永民
	联系电话	021-20899098	010-66594896
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-5988	95566
传真		021-20899008	010-66594942

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	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	34,524,252.40	1,290,402.67	-881,340.90
本期利润	24,144,236.68	22,076,404.95	3,577,633.52
加权平均基金份额本期利润	0.4294	0.2107	0.0288
本期基金份额净值增长率	23.44%	34.76%	3.57%
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额利润	0.2056	-0.2098	-0.2752
期末基金资产净值	74,882,209.65	87,239,286.76	85,660,879.48
期末基金份额净值	1.206	0.977	0.725

注：1、本基金合同于2011年6月9日生效。

2、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。

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

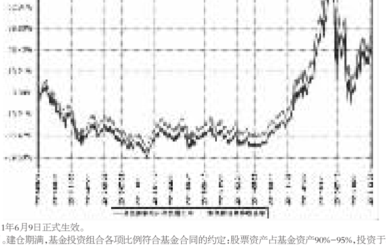
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	22.69%	2.00%	19.23%	1.91%	3.46%	0.09%
过去六个月	-14.35%	3.18%	-16.39%	3.02%	2.04%	0.16%
过去一年	23.44%	2.76%	19.69%	2.67%	3.75%	0.09%
过去三年	72.29%	1.88%	68.82%	1.84%	3.47%	0.04%
自基金合同生效起至今	22.99%	1.72%	29.57%	1.70%	-6.58%	0.02%

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%。

中证200指数反映市场上不同规模特征股票的整体表现，中证指数有限公司以沪深300指数为基础，构建了包括大盘、中盘、小盘、大中盘、中小盘和大中小盘指数在内的规模指数体系，为市场提供丰富的分析工具和业绩基准，为指数产品和其他指数的研究开发奠定基础。

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

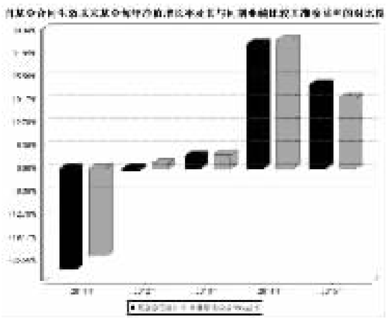


注：1、本基金基金合同于2011年6月9日正式生效。

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。

3、经泰信基金管理有限公司总办会审议决定，由张彦先生担任本基金基金经理，冯张鹏先生不再担任本基金基金经理。具体详情请见2015年1月6日刊登在《中国证券报》、《证券时报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信中证200指数证券投资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



注：本基金基金合同于2011年6月9日正式生效，2011年度相关数据根据实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未进行利润分配。

§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）自由贸易实验区浦东南路256号37层
办公地址：中国（上海）自由贸易实验区浦东南路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：王小林
总经理：葛航
电话：021-20899188
传真：021-20899008
联系人：王斌
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日经中国证券监督委员会批准正式筹建，2003年5月8日获准开业，是国内第一家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2015年12月底，公司有正式员工108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2015年12月底，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、泰信国策驱动混合共16只开放式基金及泰信乐利5号、泰信至尊阿尔法6号、泰信吉渊分级1号、泰信鲁信1号、泰信磐晟稳健1号、泰信磐晟定增1号、泰信价值1号、泰信添盈债券分级1号、泰信中行新时代6号共9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		
张彦先生	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5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锐联基本面400指数分级基金经理。
冯张鹏先生	本基金经理兼泰信中证400指数基金经理	2013年7月5日	2015年1月6日	6年	工科博士。具备基金从业资格。曾在英国德意志银行担任分析师。2010年9月加入泰信基金管理有限公司担任风险管理部高级风险分析师，同时兼任研究部策略研究小组高级量化分析师。曾担任泰信中证200指数基金经理助理、泰信中证400指数基金经理助理职务。自2013年7月5日起同时担任泰信中证400指数分级基金经理。已于2015年1月6日离职。

注：1、经泰信基金管理有限公司总办会审议决定，由张彦先生担任本基金基金经理，冯张鹏先生不再担任本基金基金经理。具体详情请见2015年1月6日刊登在《中国证券报》、《证券时报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信中证200指数证券投资基金经理变更的公告》。

2、以上日期均是指公司公告的日期。

3、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律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

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《泰信基金管理有限公司公平交易制度》，主要控制方法如下：

1、建立统一的研究平台，所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放。

2、建立全公司投资对象备选库和各投资组合的投资对象备选库。

3、投委会作为公司受托资产投资的最高决策机构，主要负责对公司所管理的受托资产进行投资决策。投资总监在其权限范围内审批超出投资组合经理权限的投资计划。投资组合经理在其权限范围内进行投资决策。

4、投资组合经理同时管理多个投资组合时，必须公平公正的对待管理的所有投资组合，除申购赎回、个股投资比例超标等客观因素之外，同一交易日投资同一交易品种时，应尽可能使他们获得相同或相近的交易价格。

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。

5、集中交易室负责所有投资指令的执行，必须确保所有同向指令的公平公正，平等对待所有投资组合。发现异常指令或者涉嫌利益输送的指令，交易室应立即停止执行指令，并向投资总监和风险管理部报告。对非竞争竞价指令，不同投资组合也必须公平对待，主要采取成交结果按比例分配和轮侯方式处理。

6、风险管理部通过交易系统监控指标设置，实时监控交易指令，禁止同一投资组合内部的同日反向交易，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。

7、公司在交易系统中设置强制公平委托参数，强制交易系统对符合要求的同一交易品种的同向指令执行公平委托。

8、风险管理部定期与不定期对交易指令的公平性和交易委托的公平性进行分析，对强制公平委托的执行过程与结果进行检查；对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，并完成定期分析报告。

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

国内A股市场在2015年全年大起大落，上半年表现为牛市，下半年调整之后又有所反弹，全年在指数上仍有良好收益。上证综指上半年依然上涨9.41%，创业板上涨84.41%。

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2015年诸多公司停牌，无法有效调整成分股，基金不能做到完全拟合指数成份。报告期内跟踪误差控制在2.84%。报告期跟踪误差主要是由于基金申购赎回和标的指数成分股定期调整等因素所造成。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金单位净值为1.206元，净值增长率为23.44%，同期业绩比较基准收益率为19.69%。

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2016年，宏观经济仍然处于寻底的过程当中，而外围市场同样面临不确定性，调结构和稳增长成为管理层需要平衡的政策目标，政策取向比较纠结。

在传统经济尚没有被出清的背景下，国内企业投资意愿薄弱，工业增加值持续下行，PPI通缩，CPI 低位徘徊，上半年经济难有起色，经济基本面较差仍需要宽松的货币政策来支撑。但是在国内传统产能过剩，结构亟待转型的背景下，流动性对经济的刺激越来越微弱，货币未能有效地传导至实体。2015年多次降准降息留给2016年空间相对有限，全年对货币政策的运用显著小于2015年。

供给侧改革实施的力度极大考验管理层改革的魄力和智慧，是2016年市场面临最关心的问题之一。如果在保增长的层面推进，则难以实现供给侧改革的目标，转型又将延后。而大刀阔斧的搞供给侧改革，通过破产、兼并收购消灭过剩产能，又将以阶段性衰退为代价，经济数据的出现恶化，对资金链和就业造成极大的冲击。但长期来看有助于促进经济加快调整，为市场树立长期的信心。

外部环境2016年同样面临不确定性。除了美国，西方国家竞相实施货币贬值，人民币贬值的压力和美元加息周期开启极大制约了国内宽松政策的实施。国际因素的不确定极大制约了市场的风险偏好。预计每一次美元加息和人民币贬值都将对国内资产价格形成巨大的冲击。

宽松的货币政策对市场的正向推动在衰减，而市场风险偏好的降低，导致证券资产正日益接近中长期价值中枢。因此我们预计2016年证券市场呈现宽幅震荡的行情，一方面利率仍处于下行通道，面临供给侧改革带来的政策红利。另一方面汇率波动、美元加息以及经济政策调整等扰动因素贯穿全年。

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 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：

唐国培先生，硕士。2002年加入泰信基金管理有限公司，现任公司风险管理部总监。

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，泰信优势增长基金基金经理。

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。

4.7 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、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、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12次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%；若基金合同生效不满3个月，可不进行收益分配；

4、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；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

二、本报告期本基金未进行利润分配。

4.8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

本报告期本基金有连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情况。

§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，中国银行股份有限公司（以下称"本托管人"）在对泰信中证200指数证券投资基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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(2016)第20847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	泰信中证200指数证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的泰信中证200指数证券投资基金(以下简称"泰信中证200基金")的财务报表，包括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)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是泰信中证200基金的基金管理人泰信基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")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，并使其实现公允反映； (2)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弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 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。	
审计意见段	我们认为，上述泰信中证200基金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，公允反映了泰信中证200基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	单峰	周祎
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	
审计报告日期	2016年3月25日	

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体：泰信中证200指数证券投资基金
报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产：		
银行存款	5,377,995.41	6,562,779.76
结算备付金	–	11,387.74
存出保证金	4,146.60	25,113.71
交易性金融资产	69,799,101.48	81,138,958.87
其中：股票投资	69,799,101.48	81,138,958.87
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	–	–
应收证券清算款	–	–
应收利息	1,474.97	1,556.25
应收股利	–	–
应收申购款	494.07	17,143.66
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	75,183,212.53	87,756,939.99
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	–	–
应付赎回款	–	47,582.91
应付管理人报酬	33,932.36	49,840.73
应付托管费	7,271.21	10,680.16
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	32,584.41	177,542.18
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	227,214.90	232,007.25
负债合计	301,002.88	517,653.23
所有者权益：		
实收基金	62,111,287.93	89,264,629.96
未分配利润	12,770,921.72	-2,025,343.20
所有者权益合计	74,882,209.65	87,239,286.76
负债和所有者权益总计	75,183,212.53	87,756,939.99

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.206元，基金份额总额62,111,287.93份。

7.2 利润表

会计主体：泰信中证200指数证券投资基金
本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

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
一、收入	25,183,657.54	23,143,076.85
1.利息收入	34,673.90	35,090.24
其中：存款利息收入	34,673.90	35,090.24
债券利息收入	–	–
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	–	–
其他利息收入	–	–
2.投资收益（损失以"-"填列）	35,508,580.69	2,319,359.74
其中：股票投资收益	35,094,329.62	1,289,787.80
基金投资收益	–	–
债券投资收益	–	–
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	414,251.07	1,029,571.94
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	-10,380,015.72	20,786,002.28
4. 汇兑收益（损失以"-"号填列）	–	–
5.其他收入（损失以"-"号填列）	20,418.67	2,624.59
减：二、费用	1,039,420.86	1,066,671.90
1. 管理人报酬	466,456.40	539,174.38
2. 托管费	99,954.86	115,537.32
3. 销售服务费	–	–
4. 交易费用	218,111.61	155,824.48
5. 利息支出	–	–
其中：卖出回购金融资产支出	–	–
6. 其他费用	254,897.99	256,135.72
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	24,144,236.68	22,076,404.95
减：所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	24,144,236.68	22,076,404.95

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信中证200指数证券投资基金
本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	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
一、期初所有者权益（基金净值）	89,264,629.96	-2,025,343.20	87,239,286.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	–	24,144,236.68	24,144,236.68
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）	-27,153,342.03	-9,347,971.76	-36,501,313.79
其中：1.基金申购款	33,531,638.90	7,429,389.10	40,961,028.00
2.基金赎回款	-60,684,980.93	-16,777,360.86	-77,462,341.79
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）	62,111,287.93	12,770,921.72	74,882,209.65
项目	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
一、期初所有者权益（基金净值）	118,180,001.22	-32,519,121.74	85,660,879.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	–	22,076,404.95	22,076,404.95
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）	-28,915,371.26	8,417,373.59	-20,497,997.67
其中：1.基金申购款	9,569,557.62	-709,996.55	8,859,561.07
2.基金赎回款	-38,484,928.88	9,127,370.14	-29,357,558.74
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）	89,264,629.96	-2,025,343.20	87,239,286.76

注：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：

______葛航______　　______韩波______　　____蔡海成____
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

泰信中证200指数证券投资基金(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[2011]第534号《关于核准泰信中证200指数证券投资基金募集的批复》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《泰信中证200指数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316,771,140.56元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第228号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰信中证200指数证券投资基金基金合同》于2011年6月9日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为316,786,119.38份基金份额，其中认购资金利息折合14,978.82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《泰信中证200指数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、权证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。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为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。本基金的业绩比较基准为：本基金的业绩比较基准为：中证200指数收益率× 95%+商业银行活期存款利率(税后) ×5%。

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2016年3月25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》、《泰信中证200指数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年度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年度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[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 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、基金销售机构、注册登记机构
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司
中国银行股份有限公司(中国银行)	基金托管人、基金代销机构
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。

7.4.8 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

本期末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 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
当期发生的基金应支付的管理费	466,456.40	539,174.38
其中：支付销售机构的客户维护费	89,725.58	90,814.54

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的0.7%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 0.7% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	99,954.86	115,537.32

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%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 0.15% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

本报告期及上年度本基金未发生销售服务费用。

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

本期末及上年度可比期间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。

7.4.8.4 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 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
期初持有的基金份额	15,999,320.00	15,999,320.00
期间申购/买入总份额	8,037,781.35	–
期间因拆分变动份额	–	–
减：期间赎回/卖出总份额	5,000,000.00	–
期末持有的基金份额	19,037,101.35	15,999,320.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	30.6500%	17.9200%

注：1.期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。

2.期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

3.基金管理人泰信基金管理有限公司在本年度申购/赎回本基金的交易委托中国银行办理，申购费用为人民币1,000.00元，无赎回费。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014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	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	36,439,218.54	58.6700%	49,999,000.00	56.0100%

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	5,377,995.41	33,637.69	6,562,779.76	34,339.56

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本报告期末及上年度可比期间本基金未在承销期内持有关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2015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

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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	备注
300104	乐视网	2015年12月7日	重大事项	58.80	–	–	13,400	846,008.03	787,920.00	–
600649	城投控股	2015年12月30日	重大事项	23.16	2016年1月7日	20.84	20,223	104,333.51	468,364.68	–
002465	海格通信	2015年12月30日	重大事项	16.69	2016年2月4日	15.02	23,210	247,854.15	387,374.90	–
000876	新希望	2015年8月17日	重大事项	18.99	2016年3月2日	17.09	15,107	268,928.75	286,881.93	–
002065	东华软件	2015年12月22日	重大事项	25.10	–	–	10,644	194,636.87	267,164.40	–
600873	梅花生物	2015年12月17日	重大事项	9.14	–	–	25,333	178,270.72	231,543.62	–
000712	锦龙股份	2015年12月25日	重大事项	29.12	2016年1月4日	28.00	6,300	230,696.00	183,456.00	–
600578	京能电力	2015年11月5日	重大事项	6.07	2016年2月24日	5.49	20,137	119,666.82	122,231.59	–
600153	建发股份	2015年6月29日	重大事项	14.74	–	–	17,796	133,011.78	262,313.04	–
600271	航天信息	2015年10月12日	重大事项	71.46	–	–	8,022	257,877.49	573,252.12	–

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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

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66,228,599.20元，属于第二层次的余额为3,570,502.28元，无属于第三层次的余额(2014年12月31日：第一层次78,878,055.43元，第二层次2,260,903.44元，无第三层次)。

(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)。

(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

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	69,799,101.48	92.84
	其中：股票	69,799,101.48	92.84
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	5,377,995.41	7.15
7	其他各项资产	6,115.64	0.01
8	合计	75,183,212.53	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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	168,346.08	0.22
B	采矿业	2,835,542.33	3.79
C	制造业	29,394,433.99	39.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,148,485.06	4.20
E	建筑业	1,728,654.69	2.31
F	批发和零售业	2,535,788.98	3.39
G	交通运输、仓储和邮政业	3,878,215.06	5.18
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,373,234.45	8.51
J	金融业	7,356,112.98	9.82
K	房地产业	4,284,686.14	5.72
L	租赁和商务服务业	1,925,289.00	2.57
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	979,167.66	1.31
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	233,186.72	0.31
R	文化、体育和娱乐业	3,109,217.64	4.15
S	综合	851,419.20	1.14
	合计	68,801,779.98	91.88

8.2.2 期末积极投资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	–	–
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	997,321.50	1.33
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	997,321.50	1.33

注：积极投资股票为被动持有非当前成分股，基金视公司复牌情况，逐步进行调整成分股。

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

8.3.1 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

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	002450	康得新	24,271	924,725.10	1.23
2	001979	招商蛇口	43,612	909,746.32	1.21
3	000783	长江证券	64,755	804,257.10	1.07
4	300027	华谊兄弟	18,259	757,383.32	1.01
5	002673	西部证券	21,836	718,622.76	0.96
6	000100	TCL 集团	160,687	684,526.62	0.91
7	601555	东吴证券	42,140	677,189.80	0.90
8	601099	太平洋	68,800	675,616.00	0.90
9	601009	南京银行	38,005	672,688.50	0.90
10	002202	金风科技	29,436	670,846.44	0.90

8.3.2 积极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

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	300104	乐视网	13,400	787,920.00	1.05
2	000839	中信国安	10,290	209,401.50	0.28

注：积极投资股票为被动持有非当前成分股，基金视公司复牌情况，逐步进行调整成分股。

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	300059	东方财富	1,239,613.00	1.42
2	001979	招商蛇口	1,103,382.00	1.26
3	601099	太平洋	978,775.11	1.12
4	300104	乐视网	846,008.03	0.97
5	000157	中联重科	693,957.00	0.80
6	000338	潍柴动力	673,467.00	0.77
7	601919	中国远洋	664,746.00	0.76
8	601106	中国一重	662,598.00	0.76
9	002241	歌尔声学	591,018.86	0.68
10	600383	金地集团	583,342.02	0.67
11	600703	三安光电	577,380.00	0.66
12	002236	大华股份	516,920.00	0.59
13	600196	复星医药	512,211.52	0.59
14	601377	兴业证券	492,800.00	0.56
15	000046	泛海控股	489,890.84	0.56
16	601888	中国国旅	488,654.00	0.56
17	600535	天士力	480,960.65	0.55
18	600637	东方明珠	477,832.52	0.55
19	600005	武钢股份	461,116.00	0.53
20	601555	东吴证券	457,293.00	0.52

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	601377	兴业证券	2,083,726.23	2.39
2	600705	中航资本	1,567,441.72	1.80
3	600886	国投电力	1,176,752.47	1.35
4	600570	恒生电子	1,049,429.20	1.20
5	000783	长江证券	1,035,152.44	1.19
6	300059	东方财富	1,014,203.00	1.16
7	600340	华夏幸福	1,013,916.08	1.16
8	600893	中航动力	968,166.40	1.11
9	000768	中航飞机	936,150.65	1.07
10	000100	TCL 集团	916,958.45	1.05
11	600089	特变电工	855,000.67	0.98
12	600109	国金证券	793,141.25	0.91
13	600839	四川长虹	774,693.81	0.89
14	600739	辽宁成大	748,148.00	0.86
15	000402	金 融 街	742,673.76	0.85
16	002230	科大讯飞	731,015.02	0.84
17	600115	东方航空	717,401.36	0.82
18	000009	中国宝安	704,756.95	0.81
19	600741	华域汽车	701,741.84	0.80
20	600352	浙江龙盛	655,237.60	0.75

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	49,791,883.41
卖出股票收入（成交）总额	85,846,054.70

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

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	4,146.60
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	1,474.97
5	应收申购款	494.07
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	6,115.64

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

8.12.5.1期末指数投资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。

8.12.5.2期末积极投资前五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	300104	乐视网	787,920.00	1.05	重大事项

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
303	204,987.75	55,476,319.89	89.32%	6,634,968.04	10.68%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年6月9日）基金份额总额	316,786,119.38
本报告期期初基金份额总额	89,264,629.96
本报告期基金总申购份额	33,531,638.90
减：本报告期基金总赎回份额	60,684,980.93
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	62,111,287.93

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§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、2015年4月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2、经泰信基金管理有限公司总办会审议决定，由张彦先生担任本基金基金经理，冯张鹏先生不再担任本基金基金经理。具体详情请见2015年1月6日刊登在《中国证券报》、《证券时报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信中证200指数证券投资基金经理变更的公告》。本公司上述人事变动已按相关规定向监管机构进行备案。除此以外无其他重大人事变动。

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

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6万元。该审计机构从基金合同生效日（2011年6月9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、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
申万宏源	1	73,196,195.38	55.25%	67,185.79	55.88%	–
海通证券	2	59,279,313.69	44.75%	53,035.90	44.12%	–
华安证券	1	–	–	–	–	–
中金公司	1	–	–	–	–	–
广州证券	1	–	–	–	–	–
瑞银证券	1	–	–	–	–	–
国金证券	2	–	–	–	–	–
浙商证券	1	–	–	–	–	–
方正证券	1	–	–	–	–	–
长城证券	1	–	–	–	–	–
东吴证券	2	–	–	–	–	–
招商证券	1	–	–	–	–	–
光大证券	1	–	–	–	–	–
华宝证券	1	–	–	–	–	–
国联证券	1	–	–	–	–	–
第一创业	1	–	–	–	–	–
东方证券	2	–	–	–	–	–
长江证券	1	–	–	–	–	–
华泰联合证券	1	–	–	–	–	–
国泰君安	1	–	–	–	–	–
中航证券	1	–	–	–	–	–
财富证券	1	–	–	–	–	–
西南证券	1	–	–	–	–	–
南京证券	1	–	–	–	–	–
中信证券	2	–	–	–	–	–
国信证券	1	–	–	–	–	–
上海证券	1	–	–	–	–	–
广发证券	2	–	–	–	–	–
中信建投	2	–	–	–	–	–
安信证券	3	–	–	–	–	–
国海证券	1	–	–	–	–	–
万联证券	1	–	–	–	–	–
中国建银投资证券	2	–	–	–	–	–
华泰证券	1	–	–	–	–	–
中银国际	2	–	–	–	–	–

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国银行托管的泰信优质生活基金、泰信蓝筹精选基金、泰信增强收益基金、泰信中小盘精选基金共用交易单元。

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
申万宏源	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–
华安证券	–	–	–	–	–	–
中金公司	–	–	–	–	–	–
广州证券	–	–	–	–	–	–
瑞银证券	–	–	–	–	–	–
国金证券	–	–	–	–	–	–
浙商证券	–	–	–	–	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–
长城证券	–	–	–	–	–	–
东吴证券	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–
华宝证券	–	–	–	–	–	–
国联证券	–	–	–	–	–	–
第一创业	–	–	–	–	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–
长江证券	–	–	–	–	–	–
华泰联合证券	–	–	–	–	–	–
国泰君安	–	–	–	–	–	–
中航证券	–	–	–	–	–	–
财富证券	–	–	–	–	–	–
西南证券	–	–	–	–	–	–
南京证券	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	–	–	–	–
上海证券	–	–	–	–	–	–
广发证券	–	–	–	–	–	–
中信建投	–	–	–	–	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–
国海证券	–	–	–	–	–	–
万联证券	–	–	–	–	–	–
中国建银投资证券	–	–	–	–	–	–
华泰证券	–	–	–	–	–	–
中银国际	–	–	–	–	–	–

泰信基金管理有限公司
2016年3月30日