

泰信优质生活混合型证券投资基金 2018 年年度报告 摘要

2018 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：2019 年 3 月 28 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 2019 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 2018 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	泰信优质生活混合
基金主代码	290004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 12 月 15 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	492,490,555.69 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国经济可持续发展过程中那些最能够 满足人们优质生活需求的上市公司的长期稳定增长，在严格控制投资风险的基础上，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的大类资产配置、以核心-卫星策略为基础的优质生活行业配置和“自下而上”的证券精选相结合的投资 策略。
业绩比较基准	75%×富时中国 A600 指数+25%×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。适合于能够承担一定股市风险，追求资本长期增值的个人和机构投资者。

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	胡因	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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-143,102,889.26	-67,065,747.30	-218,794,664.84
本期利润	-117,036,695.19	-107,321,373.47	-330,228,708.16
加权平均基金份额本期利润	-0.2309	-0.1496	-0.3503
本期基金份额净值增长率	-29.86%	-16.64%	-28.58%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.4501	-0.2160	-0.0595
期末基金资产净值	270,818,418.84	454,097,478.83	866,611,520.38
期末基金份额净值	0.5499	0.7840	0.9405

注：1、本基金合同于 2006 年 12 月 15 日正式生效。

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	-11.51%	1.41%	-9.45%	1.25%	-2.06%	0.16%
过去六个月	-12.41%	1.22%	-11.16%	1.12%	-1.25%	0.10%
过去一年	-29.86%	1.18%	-20.32%	1.01%	-9.54%	0.17%
过去三年	-58.24%	1.31%	-21.38%	0.91%	-36.86%	0.40%
过去五年	-21.85%	1.72%	16.34%	1.15%	-38.19%	0.57%
自基金合同生效起至今	-0.72%	1.80%	50.98%	1.34%	-51.70%	0.46%

注：本基金业绩比较基准为：75%×富时中国 A600 指数+25%×富时中国国债指数

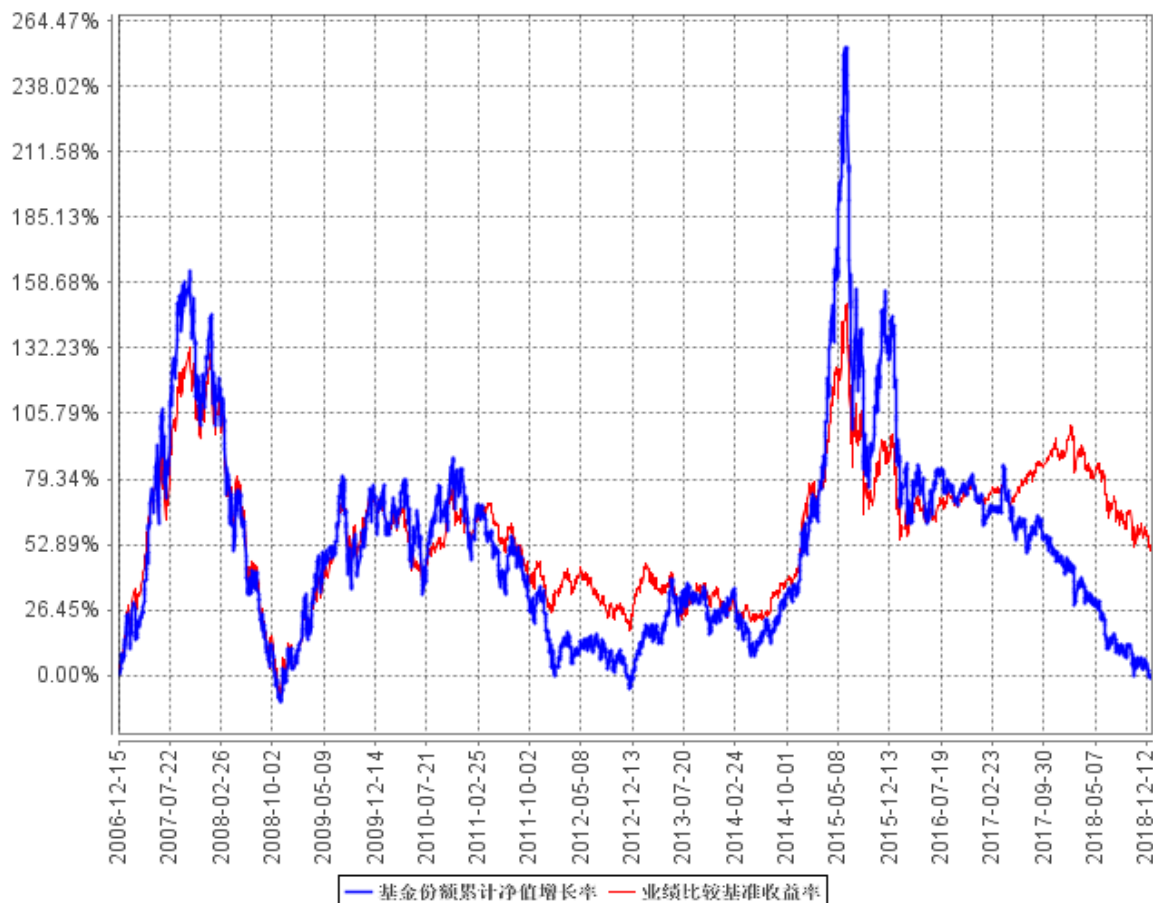
1、富时中国 A600 指数是富时中国指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流通市值最大

的 600 只股票并以流通股本加权的股票指数。

2、富时中国国债指数涵盖了在上海及深圳交易所交易的到期日至少在一年以上的纯定息债券，是目前中国证券市场中与本基金投资范围比较适配同时公信力较好的股票指数和债券指数。

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

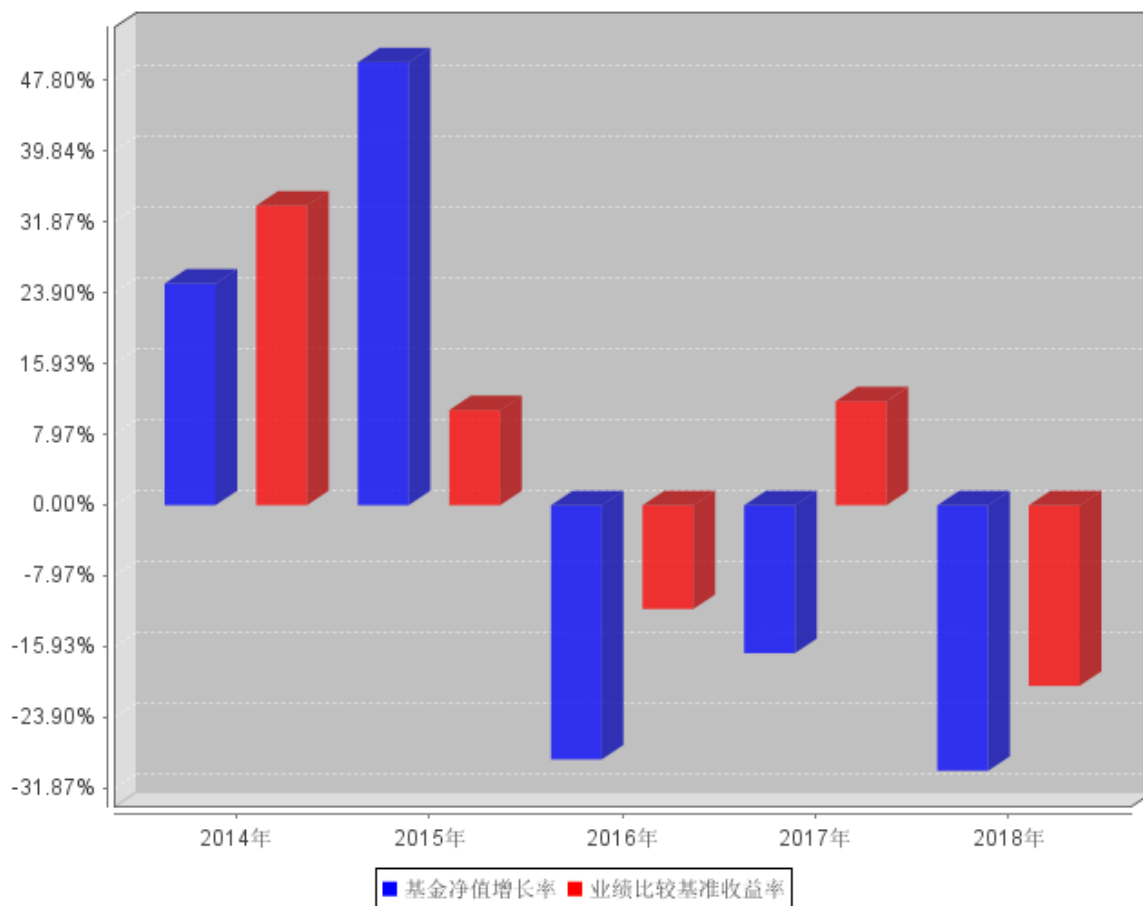


注：1、本基金基金合同于 2006 年 12 月 15 日正式生效。本基金自 2015 年 8 月 7 日起变更为混合型基金。

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 60%–95%，债券资产 0%–35%，基金保留的现金以及投资于剩余期限在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

3.2.3 过去五年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

过去五年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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	-	-	-	-	
2017	-	-	-	-	
2016	2.1370	100,042,746.78	73,075,496.22	173,118,243.00	
合计	2.1370	100,042,746.78	73,075,496.22	173,118,243.00	

§ 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 2018 年 12 月底，公司有正式员工 100 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 2018 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、泰信竞争优选混合共 21 只开放式基金及 8 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		
刘杰先生	本基金经理兼泰信中小盘精选混合基金经理	2016年12月1日	-	9年	研究生硕士。具有基金从业资格。2009年7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、研究员、高级研究员兼专户投资部投资顾问。自2015年3月17日起担任泰信中小盘精选混合基金经理。
徐慕浩先生	基金经理助理	2015年11月9日	-	8年	南开大学金融学硕士，具有基金从业资格。2011年加入泰信基金管理有限公司，历任助理研究员，现任研究部研究员兼基金经理助理。

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合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他有关法律法规、《泰信优质生活混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着“诚实信用、勤勉尽责，取信于市场、取信于投资者”的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法规及基金合同的约定，未发生损害基金持有人利益的行为。

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候方式处理。

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时反向交易，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

2018 年宏观环境基本上被三条线索主导，一是中美贸易摩擦；二是主动去杠杆；三是美国加息。三条线索背后是过去 20 年比较少见的中美名义增长周期的背离。这一环境下的资产定价是一个比较“纠结”的存在：贸易摩擦的不确定性，相当于在经济增长函数中多了一个难以验证的未知变量，随时需要警惕下行风险；而要对冲这一外部环境的不确定，就需要微观经济稳，财政和货币政策保持一定扩张性；但财政政策和货币政策又分别约束于实体去杠杆下的负债空间、金融去杠杆下的信用扩张能力，及美国不断加息下的内外利差环境，只能大致维持中性。所以 2018 年对于资产定价方程来说，增长、无风险利率、风险偏好三者都存在约束。

从市场表现来看，由于面临多重约束的共同作用，权益市场表现明显偏弱。特别是出口依赖度相对较高的行业收到中美贸易摩擦的影响更为突出，内需相关行业相对较好。

报告期内，本基金结合基金风格，围绕业绩与估值选股，对于能满足人民优质生活的行业（大金融、大消费等）重点进行了配置。上半年配置主要集中在医药和新能源车、计算机等；下半年主要集中在房地产、金融板块。上半年医药、消费等板块配置比例相对较低，以及下半年过早的切入金融防御是导致今年业绩不佳的主要原因。

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 0.5499 元；本报告期基金份额净值增长率为-29.86%，业绩比较基准收益率为-20.32%。

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 2019 年，宏观经济下行压力仍然存在，主要源自外患与内忧叠加共振。从外部看，即使无贸易战扰动，全球动能也已步入下行通道。若加上贸易战冲击，外需放缓态势更趋明显。从国内看，前期去杠杆对经济的滞后影响还将进一步体现，加之棚改货币化刺激政策等陆续退出，内需动能也呈弱势。从政策的角度看，逆周期调节政策势必加大力度。财政政策更积极，但预算赤字率难破 3%。供给侧约束放松，将缓冲制造业投资下行压力。房地产调控存在因城施策调整可能。宏观经济或将呈现先抑后稳格局。在外需趋弱背景下，财政不断对冲发力，基建投资逐步抬升。进一步地，随着银行间市场利率向信贷端不断传导，房地产投资经历较大幅度回落后有望趋稳。

综上所述，我们认为 2019 年企业盈利增速下滑（剔除金融大概率负增长）与广谱利率下行是确定性的，A 股主要矛盾由风险偏好下行转向企业盈利下行，预计呈现此消（盈利）彼长（估值）的震荡格局。因此，2019 年，相对业绩、流动性与监管周期都转向有利于成长风格，但需等待年报商誉减值集中释放，小市值真成长孕育大牛股。北向资金仍将流入，价值风格需等盈利下滑压

力减轻。行业配置：1) 景气趋势逆周期（畜禽养殖、游戏、云计算、军工）；2) 政策对冲—减税降费（建筑、军工）、传统与新兴基建提速（电气设备、基建、5G）、民企纾困潜在加杠杆高端制造业（军工、计算机）。主题投资捕捉体系性与产业性增量线索，传统基建（新疆）与区域战略（京津冀/长三角一体化/海南特区），技术周期拐点（5G、云计算）。

本基金将继续依据基金合同，以及基金风格的约束进行投资选股，对于从长期角度能够改善人民生活水平，满足人民群众对于幸福生活向往的行业给予重点关注。

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：

张敬燕女士，硕士。2017 年加入泰信基金管理有限公司，曾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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、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，投资者可选择将获取的现金红利自动转为基金份额进行再投资； 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) 基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；

(4) 基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；

(5) 如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；

(6) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少 1 次；

(7) 全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 50%。基金合同生效不满三个月，收益可不分配；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

2、本报告期本基金未进行利润分配。

4.8 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。

4.9 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在泰信优质生活混合型证券投资基金（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(2019)第 21228 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	泰信优质生活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>我们审计了泰信优质生活混合型证券投资基金(以下简称“泰信优质生活混合基金”)的财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表,2018 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,公允反映了泰信优质生活混合基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 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,我们独立于泰信优质生活混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>泰信优质生活混合基金的基金管理人泰信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)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弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估泰信优质生活混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算泰信优质生活混</p>

	<p>合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督泰信优质生活混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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在某一重大错报存在时总能发现。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) 评价基金管理人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) 对基金管理人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，就可能导致对泰信优质生活混合基金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得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致泰信优质生活混合基金不能持续经营。</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</p>

	财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人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。	
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	2019 年 3 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泰信优质生活混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	92,390,078.75	61,976,342.21
结算备付金	942,083.98	493,162.99
存出保证金	111,536.91	188,784.23
交易性金融资产	178,587,955.75	373,263,429.30
其中：股票投资	178,587,955.75	373,263,429.30
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	-	50,055,150.08
应收证券清算款	-	-
应收利息	18,187.55	37,046.93
应收股利	-	-
应收申购款	5,580.89	100,253.03
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	272,055,423.83	486,114,168.77
负债和所有者权益	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 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	-	30,000,000.00
应付赎回款	33,867.92	158,994.67
应付管理人报酬	355,587.95	598,537.77
应付托管费	59,264.68	99,756.29
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	428,284.34	540,144.62
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	360,000.10	619,256.59
负债合计	1,237,004.99	32,016,689.94
所有者权益：		
实收基金	492,490,555.69	579,212,134.94
未分配利润	-221,672,136.85	-125,114,656.11
所有者权益合计	270,818,418.84	454,097,478.83
负债和所有者权益总计	272,055,423.83	486,114,168.77

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.5499 元，基金份额总额 492,490,555.69 份。

7.2 利润表

会计主体：泰信优质生活混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	-107,352,554.94	-88,043,321.09
1. 利息收入	671,798.64	1,969,894.32
其中：存款利息收入	601,176.95	910,874.77
债券利息收入	-	1,043.66
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	70,621.69	1,057,975.89
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-134,122,211.72	-49,989,040.13
其中：股票投资收益	-138,270,493.01	-53,605,437.98
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	305,732.45
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	4,148,281.29	3,310,665.40
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	26,066,194.07	-40,255,626.17
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	31,664.07	231,450.89
减：二、费用	9,684,140.25	19,278,052.38
1. 管理人报酬	5,072,381.99	9,657,358.93
2. 托管费	845,396.96	1,609,559.84
3. 销售服务费	-	-

4. 交易费用	3,363,835.31	7,591,495.35
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	402,525.99	419,638.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-117,036,695.19	-107,321,373.47
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-117,036,695.19	-107,321,373.47

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信优质生活混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	579,212,134.94	-125,114,656.11	454,097,478.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-117,036,695.19	-117,036,695.19
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）	-86,721,579.25	20,479,214.45	-66,242,364.80
其中：1. 基金申购款	20,302,140.45	-6,260,836.24	14,041,304.21
2. 基金赎回款	-107,023,719.70	26,740,050.69	-80,283,669.01
五、期末所有者权益（基金净值）	492,490,555.69	-221,672,136.85	270,818,418.84
项目	上年度可比期间 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）	921,469,868.55	-54,858,348.17	866,611,520.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-107,321,373.47	-107,321,373.47
三、本期基金份额交易产	-342,257,733.61	37,065,065.53	-305,192,668.08

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	76,503,458.39	-3,125,553.39	73,377,905.00
2. 基金赎回款	-418,761,192.00	40,190,618.92	-378,570,573.08
五、期末所有者权益(基金净值)	579,212,134.94	-125,114,656.11	454,097,478.83

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

泰信优质生活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”)证监基金字[2006]第 229 号《关于同意泰信优质生活股票型证券投资基金设立的批复》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《泰信优质生活股票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 1,591,255,543.43 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(2006)第 191 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》于 2006 年 12 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,591,662,103.09 份基金份额,其中认购资金利息折合 406,559.66 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 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,泰信优质生活股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为泰信优质生活混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信优质生活混合型证券投资基金基金合同》本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市各类股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金组合投资的范围为:股票资产 60%-95%,债券资产 0-35%,基金保留的现金以及投资于剩余期限在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:75%×富时中国 A600 指数(原新华富时 A600 指数)+25%×富时中国国债指数(原新华富时国债指数)。

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 2019 年 3 月 26 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》、《泰信优质生活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 2018 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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》、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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产

品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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

青岛国信实业有限责任公司	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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

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	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,072,381.99	9,657,358.93
其中：支付销售机构的客户维护费	724,507.04	1,159,500.33

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	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日

当期发生的基金应支付的托管费	845,396.96	1,609,559.84
----------------	------------	--------------

注：支付基金托管行中国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。

7.4.8.3 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发生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

本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

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

于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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	92,390,078.75	579,996.79	61,976,342.21	802,754.02

注：本基金的银行存款由基金托管行中国银行保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2018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

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
600030	中信证券	2018年12月25日	重大事项	16.01	2019年1月10日	17.15	450,000	7,325,046.46	7,204,500.00	-

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 2018 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 171,383,455.75 元，属于第二层次的余额为 7,204,500.00 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 329,348,721.94 元，第二层次 15,858,500.00 元，第三层次 28,056,207.36 元)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产 权益工具投资
2018 年 1 月 1 日	28,056,207.36
购买	-
出售	-
转入第三层次	-
转出第三层次	-28,056,207.36
当期利得或损失总额	-
计入损益的利得或损失	-
2018 年 12 月 31 日	-
2018 年 12 月 31 日仍持 有的资产计入 2018 年度 损益的未实现利得或损失 的变动	
——公允价值变动损益	-

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

	交易性金融资产 权益工具投资
2017 年 1 月 1 日	-
购买	-
出售	-
转入第三层次	28,056,207.36
转出第三层次	-
当期利得或损失总额	-
计入损益的利得或损失	-
2017 年 12 月 31 日	28,056,207.36

于 2017 年 12 月 31 日仍持有的第三层次金融资产中计入 2017 年度损益的利得为 -12,543,785.11 元。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 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(2017 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	178,587,955.75	65.64
	其中：股票	178,587,955.75	65.64
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	93,332,162.73	34.31
8	其他各项资产	135,305.35	0.05
9	合计	272,055,423.83	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	15,939,000.00	5.89
C	制造业	49,809,500.00	18.39
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	25,020,400.00	9.24
H	住宿和餐饮业	8,092,104.30	2.99
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,249,000.00	5.26
J	金融业	20,724,500.00	7.65
K	房地产业	33,782,451.45	12.47
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	7,532,500.00	2.78
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,438,500.00	1.27
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	178,587,955.75	65.94

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	000401	冀东水泥	1,020,000	12,627,600.00	4.66
2	600547	山东黄金	300,000	9,075,000.00	3.35
3	300168	万达信息	700,000	8,393,000.00	3.10
4	600754	锦江股份	379,911	8,092,104.30	2.99
5	300012	华测检测	1,150,000	7,532,500.00	2.78
6	600276	恒瑞医药	140,000	7,385,000.00	2.73
7	300122	智飞生物	190,000	7,364,400.00	2.72
8	000671	阳光城	1,400,000	7,266,000.00	2.68
9	600030	中信证券	450,000	7,204,500.00	2.66
10	000002	万科 A	300,000	7,146,000.00	2.64

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	000426	兴业矿业	20,296,593.76	4.47
2	600837	海通证券	19,539,393.00	4.30
3	601601	中国太保	19,050,457.38	4.20
4	601336	新华保险	18,476,167.70	4.07
5	601818	光大银行	17,635,598.00	3.88
6	002223	鱼跃医疗	16,224,748.00	3.57

7	002146	荣盛发展	16,191,243.58	3.57
8	002368	太极股份	16,142,663.00	3.55
9	601899	紫金矿业	16,063,932.72	3.54
10	600030	中信证券	15,945,125.46	3.51
11	600031	三一重工	15,128,572.00	3.33
12	000001	平安银行	15,105,346.36	3.33
13	600498	烽火通信	14,972,709.04	3.30
14	600048	保利地产	14,950,950.00	3.29
15	002353	杰瑞股份	14,411,671.67	3.17
16	000002	万科 A	14,261,580.76	3.14
17	600028	中国石化	14,111,156.40	3.11
18	300122	智飞生物	13,373,040.00	2.94
19	601688	华泰证券	13,093,064.00	2.88
20	000961	中南建设	13,007,641.00	2.86
21	600507	方大特钢	12,436,913.44	2.74
22	600019	宝钢股份	12,164,963.18	2.68
23	000401	冀东水泥	12,164,775.00	2.68
24	600362	江西铜业	11,907,575.14	2.62
25	600256	广汇能源	11,802,192.50	2.60
26	600718	东软集团	11,774,902.93	2.59
27	601398	工商银行	11,690,921.00	2.57
28	000630	铜陵有色	11,682,792.00	2.57
29	000858	五粮液	11,523,899.00	2.54
30	600383	金地集团	11,398,000.00	2.51
31	601229	上海银行	11,346,270.90	2.50
32	300182	捷成股份	11,327,844.51	2.49
33	600803	新奥股份	11,171,360.19	2.46
34	600584	长电科技	11,169,477.76	2.46
35	601939	建设银行	11,169,422.00	2.46
36	000568	泸州老窖	11,097,415.00	2.44
37	300352	北信源	10,972,376.00	2.42
38	002049	紫光国微	10,949,676.27	2.41
39	002466	天齐锂业	10,804,793.39	2.38
40	601288	农业银行	10,671,000.00	2.35
41	300353	东土科技	10,563,066.00	2.33
42	600782	新钢股份	10,547,538.00	2.32

43	600172	黄河旋风	10,507,362.00	2.31
44	601318	中国平安	10,171,271.14	2.24
45	002156	通富微电	10,123,839.60	2.23
46	600884	杉杉股份	9,936,502.67	2.19
47	002063	远光软件	9,893,494.00	2.18
48	000878	云南铜业	9,810,000.00	2.16
49	002925	盈趣科技	9,780,012.68	2.15
50	002439	启明星辰	9,454,283.48	2.08
51	600754	锦江股份	9,376,733.67	2.06
52	000060	中金岭南	9,348,372.00	2.06
53	603799	华友钴业	9,328,872.60	2.05
54	002139	拓邦股份	9,285,184.00	2.04
55	603609	禾丰牧业	9,247,157.38	2.04
56	600276	恒瑞医药	9,137,545.40	2.01

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	600031	三一重工	28,580,938.42	6.29
2	600340	华夏幸福	27,541,263.97	6.07
3	002694	顾地科技	20,092,336.00	4.42
4	000426	兴业矿业	19,124,470.25	4.21
5	601601	中国太保	18,158,511.01	4.00
6	601766	中国中车	18,061,524.00	3.98
7	000417	合肥百货	18,000,407.42	3.96
8	601818	光大银行	17,018,261.19	3.75
9	002368	太极股份	16,072,817.30	3.54
10	300070	碧水源	16,045,060.59	3.53
11	601336	新华保险	15,775,981.74	3.47
12	002285	世联行	15,313,287.98	3.37
13	600038	中直股份	15,298,240.43	3.37
14	601899	紫金矿业	15,175,843.69	3.34
15	600507	方大特钢	15,162,881.68	3.34
16	000001	平安银行	14,331,576.87	3.16

17	600028	中国石化	13,987,150.62	3.08
18	002353	杰瑞股份	13,965,526.95	3.08
19	600019	宝钢股份	13,925,430.07	3.07
20	600498	烽火通信	13,919,202.20	3.07
21	002457	青龙管业	13,116,724.99	2.89
22	600835	上海机电	12,897,069.65	2.84
23	601992	金隅集团	12,853,762.52	2.83
24	600584	长电科技	12,577,258.04	2.77
25	300498	温氏股份	12,500,590.92	2.75
26	002049	紫光国微	12,457,723.02	2.74
27	300352	北信源	12,416,457.00	2.73
28	002466	天齐锂业	12,115,983.50	2.67
29	600008	首创股份	12,100,826.00	2.66
30	600837	海通证券	12,032,548.91	2.65
31	000800	一汽轿车	12,028,947.56	2.65
32	601229	上海银行	11,622,800.04	2.56
33	000401	冀东水泥	11,442,440.97	2.52
34	600782	新钢股份	11,424,542.55	2.52
35	600216	浙江医药	11,375,667.46	2.51
36	002709	天赐材料	11,104,612.80	2.45
37	600718	东软集团	10,667,404.92	2.35
38	600256	广汇能源	10,653,443.20	2.35
39	600172	黄河旋风	10,629,467.45	2.34
40	000630	铜陵有色	10,522,445.00	2.32
41	002573	清新环境	10,396,362.08	2.29
42	600362	江西铜业	9,979,038.84	2.20
43	000858	五粮液	9,768,302.01	2.15
44	000568	泸州老窖	9,637,159.39	2.12
45	002013	中航机电	9,537,071.43	2.10
46	300061	康旗股份	9,521,564.37	2.10
47	002063	远光软件	9,487,340.11	2.09
48	600760	中航沈飞	9,481,926.00	2.09
49	600803	新奥股份	9,480,355.78	2.09
50	600383	金地集团	9,477,756.28	2.09
51	603609	禾丰牧业	9,279,284.79	2.04
52	601288	农业银行	9,230,215.00	2.03

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	1,064,853,477.58
卖出股票收入（成交）总额	1,147,324,652.19

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

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

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	111,536.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	18,187.55
5	应收申购款	5,580.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	135,305.35

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	600030	中信证券	7,204,500.00	2.66	停牌

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
22,274	22,110.56	2,959,054.50	0.60%	489,531,501.19	99.40%

9.2 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。

9.3 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（ 2006 年 12 月 15 日 ）基金份额总额	1,591,662,103.09
本报告期期初基金份额总额	579,212,134.94
本报告期期间基金总申购份额	20,302,140.45
减:本报告期期间基金总赎回份额	107,023,719.70
本报告期末基金份额总额	492,490,555.69

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、报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2、报告期内，基金管理人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉基金管理人、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 万元。该审计机构从基金合同生效日（2006 年 12 月 15 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	
安信证券	3	291,248,741.86	13.17%	271,240.34	13.43%	-
中信建投	2	272,707,924.85	12.33%	250,747.33	12.41%	-
东吴证券	2	263,196,426.40	11.90%	239,850.64	11.87%	-
中金公司	1	225,203,680.22	10.18%	209,730.85	10.38%	-

海通证券	2	221,967,091.43	10.03%	205,547.39	10.17%	-
华泰证券	1	148,969,796.33	6.73%	135,756.56	6.72%	-
国泰君安	1	127,648,492.79	5.77%	116,325.79	5.76%	-
西南证券	1	121,899,826.64	5.51%	113,526.48	5.62%	-
长江证券	1	118,534,506.07	5.36%	108,020.17	5.35%	-
方正证券	1	106,181,006.24	4.80%	96,762.91	4.79%	-
天风证券	1	85,459,011.91	3.86%	60,787.12	3.01%	-
广州证券	1	80,693,605.71	3.65%	75,149.51	3.72%	-
万联证券	1	75,797,545.11	3.43%	70,589.58	3.49%	-
东方证券	1	47,880,917.53	2.16%	43,634.25	2.16%	-
华安证券	1	24,789,556.68	1.12%	22,590.68	1.12%	-
华泰联合证 券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中国建银投 资证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

招商证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	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、本报告期内本基金新增交易单元：国盛证券上海 41834；退租交易单元：无。

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
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	50,000,000.00	62.50%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	30,000,000.00	37.50%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证 券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中国建银投 资证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

§ 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

2019 年 3 月 28 日