泰信蓝筹精选
股票型证券投资基金 2009 年年度报告
2009 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：2010 年 3 月 31 日

§1 重要提示及目录

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 2010 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 2009 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 4
2.1 基金基本情况 4
2.2 基金产品说明 4
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 5
2.5 其它相关资料 5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 6
3.3 过去三年基金的利润分配情况 8
§4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
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 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 10
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
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 13
§6 审计报告 13
6.1 审计报告基本信息 13
6.2 审计报告的基本内容 13
§7 年度财务报表 15
7.1 资产负债表 15
7.2 利润表 16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 17
7.4 报表附注 17
§8 投资组合报告 32
8.1 期末基金资产组合情况 32
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 33
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 33
8.4 报告期内权益投资组合的重大变动 34
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 43
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 43
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 43

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 43
8.9 投资组合报告附注 43
§9 基金份额持有人信息 44
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 44
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况 44
§10 开放式基金份额变动 44
§11 重大事件揭示 45
11.1 基金份额持有人大会决议 45
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 45
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 45
11.4 基金投资策略的改变 45
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 45
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 46
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 46
11.8 其它重大事件 48
§12 备查文件目录 53

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信蓝筹精选股票型证券投资基金
基金简称	泰信蓝筹精选股票
基金主代码	290006
交易代码	290006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 4 月 22 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	390,330,531.73
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于在中国经济可持续发展过程中具有核心竞争优势、在其所属行业内占有领先地位，业绩持续增长、分红稳定的优质蓝筹公司，分享中国经济发展的成果。在严格控制投资风险的条件下，实现基金资产的稳健持续增长。
投资策略	本基金采取“自上而下”的大类资产配置和“自下而上”的精选证券相结合的投资策略。充分发挥投资管理人的研究优势，通过投资具有核心竞争优势、在其

	所属行业内占有领先地位、业绩持续增长、分红稳定的优质蓝筹公司，在严格控制投资风险的条件下实现基金资产的稳健持续增长。
业绩比较基准	75%*沪深 300 指数+25%上证国债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金、其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。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	唐国培	唐州徽
	联系电话	021-50372168	010-66594855
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-5988	95566
传真		021-50372197	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42F	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42F	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		孟凡利	肖钢

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42F

2.5 其它相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	泰信基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42F

§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

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2009 年 4 月 22 日（基金合同生效日）-2009 年 12 月 31 日
本期已实现收益	164,862,565.78
本期利润	188,530,821.40
加权平均基金份额本期利润	0.2809
本期加权平均净值利润率	26.40%
本期基金份额净值增长率	24.06%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年末
期末可供分配利润	33,614,447.60
期末可供分配基金份额利润	0.0861
期末基金资产净值	423,944,979.33
期末基金份额净值	1.0861
3.1.3 累计期末指标	2009 年末
基金份额累计净值增长率	24.06%

注：1、上述指标的计算时间的起始日为 2009 年 4 月 22 日。（基金合同生效日）

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。

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

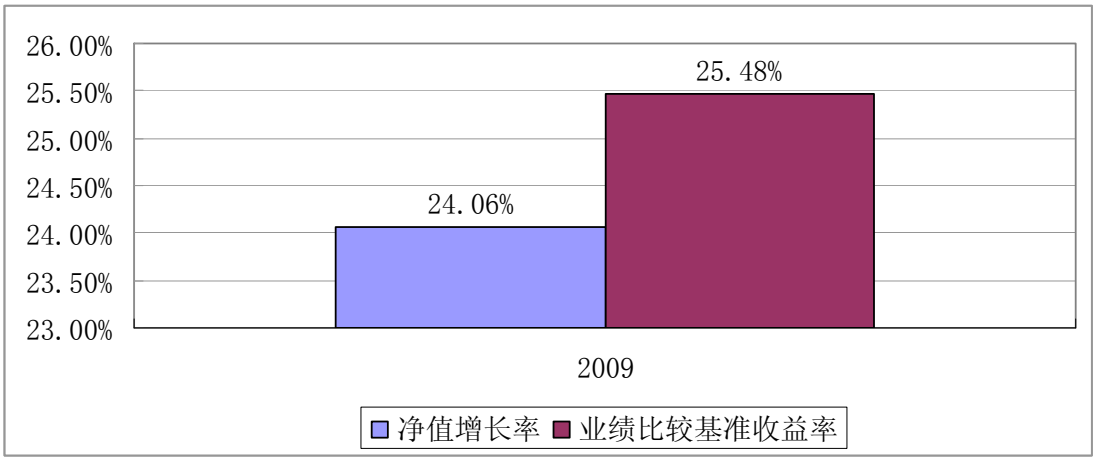
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	19.22%	1.57%	14.29%	1.32%	4.93%	0.25%
过去六个月	16.97%	1.77%	10.38%	1.60%	6.59%	0.17%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	24.06%	1.54%	25.48%	1.48%	-1.42%	0.06%

注：本基金业绩比较基准为：75%*沪深 300 指数+25%上证国债指数

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：1、本基金基金合同于 2009 年 4 月 22 日正式生效。
2、本基金的建仓期为六个月。至报告期末不满一年。本基金将基金资产的 60-95%投资于股票，基金资产的 5-40%投资于债券、现金类资产及权证、资产支持证券（其中，现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证不高于基金资产净值的 3%，资产支持证券不高于基金资产净值的 20%）。

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



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
2009年	1.500	46,772,537.56	24,359,576.94	71,132,114.50	-
合计	1.500	46,772,537.56	24,359,576.94	71,132,114.50	-

注： 本基金合同生效日为 2009 年 4 月 22 日，自基金合同生效日起至披露时点不满一年。

§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：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42F
办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42F
成立日期：2003 年 5 月 23 日
法定代表人：孟凡利
总经理：高清海
电话：（021）50372168
传真：（021）50372197
联系人：高海鸥
发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co.，Ltd.）是山东省国际信托投资有限公司（现更名为山东省国际信托有限公司）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。

公司目前下设市场营销团队（分华东、华北、华南三个业务团队）、营销策划及基金事务团队（分基金事务、客户服务、营销策划）、新业务团队（分理财顾问部、新业务销售）、基金投资部、研究部、风险管理部、清算会计部、信息技术部、监察稽核部、综合管理部。截至 2009 年 12 月 31 日，公司共管理泰信天天收益、泰信先行策略、泰信双息双利、泰信优质生活、泰信优势增长、泰信蓝筹精选、泰信增强收益等 7 只开放式基金，基金资产规模 136.27 亿元。

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		
柳菁女士	本基金基金经理	2009 年 4 月 22 日	-	14	工商管理硕士。具有基金从业资格。曾任天同证券有限责任公司资产管理

					部交易员、研究员、投资经理。2005 年加入泰信基金管理有限公司，先后任交易员、研究部高级研究员，曾任泰信先行策略基金的基金经理助理。
刘毅先生	本基金基金经理助理	2009 年 4 月 22 日	-	7	金融学硕士、技术经济及管理学博士。具有基金从业资格。曾任职于中国建设银行安徽省岳西支行、天安保险股份有限公司。2008 年 5 月加入泰信基金管理有限公司，曾担任理财顾问部投资经理。

注：1、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

2、基金经理的任职日期以基金合同生效日为准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他有关法律法规、《泰信蓝筹精选股票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 公平交易制度的执行情况

《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（中国证券监督管理委员会公告[2008] 9 号）自 2008 年 3 月 20 日起执行。公司相应地制定了《公平交易制度》，适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

4.3.2 本投资组合与其它投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，公司旗下的泰信优质生活基金和泰信蓝筹精选基金同为股票型基金。泰信优质

生活股票基金过去一年的净值增长率为 65.11%，泰信蓝筹精选股票基金自基金合同生效之日（2009 年 4 月 22 日）到 2009 年 12 月 31 日净值增长率为 24.06%，两基金在本报告期内的净值增长率之差超过 5%，主要原因是泰信蓝筹精选股票基金成立于 2009 年 4 月 22 日，处于建仓期，二者并不存在利益输送的情况。除此之外，公司旗下其他基金中不存在与本基金风格类似的基金，亦未发现异常交易行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内不存在异常交易行为。

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

2009 年是宏观经济快速复苏的一年，A 股市场的表现充分反映了宏观经济复苏的状况和预期，同时在充裕的流动性助推下，上证指数年度涨幅达到 79.98%。在 4 万亿投资政策及刺激消费政策的推动下，采掘、有色、交运设备、地产、家电、电子行业在 09 年的行情中表现突出。作为 4 月下旬开始建仓的新基金，我们在建仓初期采取了稳步加仓的策略，自下而上精选个股，重点配置了房地产、节能减排、资源品和医药等行业，后期随着市场上行和基金净值的上升，我们逐渐提高仓位。总体来看，虽然在行业和个股的选择和配置上取得了良好的效果，但蓝筹精选在 2 季度的建仓相对比较谨慎，特别是建仓初期对仓位进行了控制，从一定程度上影响了基金的收益水平。7 月份，我们将基金仓位提高至较高水平，8 月初我们认为系统性风险在不断增大，果断降低了仓位，对钢铁、有色、煤炭、地产等周期类行业进行了大比例减持，有效地规避了系统性风险。4 季度，我们重点增持了业绩预期明确、估值水平处于历史低位的行业如金融服务行业，并对在四季度处于销售、结算旺季的消费类行业主要是高端白酒行业、医药行业以及农林牧渔行业的部分公司进行了重点增持，并对地产行业进行了波段操作，在 11 月底成功减持。主题投资方面，09 年我们参与了节能减排板块和迪斯尼板块的投资，取得了较好的效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金基金合同于 2009 年 4 月 22 日正式生效，截至本报告期末，本基金单位净值为 1.0861 元，净值增长率为 24.06% ，同期比较基准增长率为 25.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总体来看，在经历了 2009 年宽松的政策环境和市场环境之后，2010 年的市场具有较多的不确定性：

1、宏观经济：从消费、投资和出口三方面看，投资与出口占 GDP 的比重过高的形势似乎难以持续，消费占比也难以快速上升，中国经济在快速复苏之后，出现增速减缓的风险正在加大；

2、流动性：相对于 2009 年，2010 年国内资本市场流动性的充裕程度将明显下降；

3、上市公司盈利增速：经过 09 年的复苏，上市公司业绩在 2010 年 2 季度可能开始同比下滑的现象。 我们将 2010 年定义为政策转折年。从历史上看，作为危机过后的政策转折年，市场难有出色表现。基于此，我们认为明年资本市场指数表现将相对平淡，呈现区间震荡走势。由于 1 季度流动性相对宽松的预期落空，2010 年可能更多的是跌出来的机会，在控制仓位的前提下，自下而上的个股选择在震荡市中也尤为重要。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，公司内部监察稽核工作本着对基金份额持有人权益高度负责的精神，以独立于各业务部门的监察稽核部为控制主体，对基金销售、投资运作、后台保障等主要业务活动，进行了积极的以合规性为主的监督与控制，较好地保证了基金运作的合规性。主要工作情况如下：

1、完善公司风险控制体系。为进一步理顺公司的风险控制体系，经总经理办公会会提议、董事会审议批准，公司在 2009 年新设风险管理部，并对原监察稽核部的职能进行了适当的调整。目前，公司事前、事中、事后三个控制层次的风险管理体系更为清晰，各业务部门负责事前风险防范，风险管理部负责对公司运营过程中产生或潜在的风险进行事中管理和监控，监察稽核部负责对公司各项运营中的风险进行定期、不定期检查，负责事后监督检查。

2、认真落实基金销售适用性原则，加强公司销售内部控制。公司根据《证券投资基金销售适用性指导意见》的要求，设计了针对代销机构的审慎调查表，调查和评估的结果将作为选择基金代销机构的重要依据。同时，采用问卷等方式，对投资者进行风险承受能力调查和评价，并提示投资者应在基金购买过程中注意核对自己的风险承受能力和基金产品风险的匹配情况。

3、加强基金投资风险控制。在基金投资风险控制方面，公司针对薄弱环节着重完善了投资管理体系，在进一步落实防火墙制度、加强基金经理决策的独立性、加强投管人员合规培训等方面做了积极的尝试。同时，在年终对投资研究人员的量化考核中，增加了合规考核在考评中的比重，以提高投研人员的合规意识。

4、严格落实公平交易制度。公司旗下基金实行集中交易制度，在投资交易系统中，公司采用了强制公平交易模式。在公平交易的各环节建立了责任追究制，实行各部门责任人、分管领导责任人负责制，以最大限度地监控并处置可能造成不公平交易或利益输送的行为。

5、通过技术手段规范员工网络行为。公司采用技术手段对网站、交易、行情等进行屏蔽，对其他非受控方式上网及即时通讯做出进一步规范。加强投管人员的资讯管理，对基金经理集中区域进行录像监控，对于证券公司的网站、网页委托进行了屏蔽，对办公电脑安装软件的权限进行严格限制。

在本报告期内，本基金的投资运作等各环节基本符合规定的要求，未出现异常交易、操纵市场、内幕交易等违法违规现象。今后公司将继续加强监察稽核人员的业务技能的培训提高，合理配置监察稽核工作力度，重点加强事前防范及动态跟踪，保证基金运作的合规性。

4.7 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。曾任职于山东省国际信托投资公司计财部、山东省国际信托投资公司上海证券部、鲁信香港投资有限公司，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，7 年基金从业经验，2002 年加入泰信基金管理有限公司，现任公司风险管理部经理。

高伟女士，本科，英国牛津大学 Catalysts 公司风险投资方向访问学者，高级会计师,11 年金融业、7 年其他行业从业经验，曾在大型商贸公司、证券公司、资产管理公司担任财务部门、业务部门负责人并兼任所属公司财务总监、监事等职务。现任公司监察稽核部副经理。

庞少华先生，硕士，会计师，14 年证券从业经验。曾供职于天一证券有限责任总公司稽核部内部稽核、营业部财务会计、总公司计划财务部。2005 年 1 月加入泰信基金管理有限公司，公司清算会计部经理。

刘强先生，工商管理硕士。2002 年 10 月加入泰信基金管理有限公司，现任基金投资副总监兼泰信优质生活股票基金基金经理。

梁剑先生，硕士，具有 10 年证券从业经验，曾历任期货交易所研究员、券商研究员。2004 年 7 月加入泰信基金，现任研究部副总监兼泰信先行策略混合基金基金经理。

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。

4.8 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)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，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3)基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(4)基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

(5)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

(6)每一基金份额享有同等分配权；

(7)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

2、本报告期利润分配情况的说明：本基金基金合同于 2009 年 4 月 22 日正式生效.截止至 2009 年 12 月 31 日,本基金本期已实现收益为 164,862,565.78 元,本期已分配收益为 71,132,114.50 元。符合本基金分红约定。

§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”）在泰信蓝筹精选股票型证券投资基金（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。

中国银行
2010 年 3 月 26 日

§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(2010)第 20385 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	泰信蓝筹精选股票型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蓝筹精选股票型证券投资基金(以下简称“泰信蓝筹精选股票基金”)的财务报表，包括 2009 年 12 月 31 日的资产负债表、2009 年 4 月 22 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是泰信蓝筹精选股票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) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报； (2) 选择和运用恰当的会计政策； (3) 作出合理的会计估计。
注册会计师的责任段	我们的责任是在实施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职业道德规范，计划和实施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，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，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，上述财务报表已经按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了泰信蓝筹精选股票基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年 4 月 22 日(基金合同生效日) 至 2009 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛竞　徐振晨
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2010 年 3 月 29 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泰信蓝筹精选股票型证券投资基金
报告截止日： 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2009 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	81,098,448.89
结算备付金		1,946,475.30
存出保证金		627,786.93
交易性金融资产	7.4.7.2	352,939,837.00
其中：股票投资		352,939,837.00
债券投资		-
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	15,931.39
应收股利		-
应收申购款		396,176.56
其它资产	7.4.7.6	-
资产总计		437,024,656.07
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2009 年 12 月 31 日**
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		10,574,440.52
应付赎回款		445,348.54
应付管理人报酬		547,717.21
应付托管费		91,286.20
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	1,059,705.92
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
其它负债	7.4.7.8	361,178.35

负债合计		13,079,676.74
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	390,330,531.73
未分配利润	7.4.7.10	33,614,447.60
所有者权益合计		423,944,979.33
负债和所有者权益总计		437,024,656.07

注：1. 报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0861 元，基金份额总额 390,330,531.73 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2009 年 4 月 22 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：泰信蓝筹精选股票型证券投资基金
本报告期： 2009 年 4 月 22 日（基金合同生效日） 至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2009 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日
一、收入		208,877,834.18
1.利息收入		1,285,431.33
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,285,211.62
债券利息收入		219.71
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其它利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		182,674,271.35
其中：股票投资收益	7.4.7.12	179,185,238.55
债券投资收益	7.4.7.13	110,191.25
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	3,378,841.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	23,668,255.62
4.其它收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,249,875.88
减：二、费用		20,347,012.78
1．管理人报酬		7,395,973.86
2．托管费		1,232,662.37
3．销售服务费		-
4．交易费用	7.4.7.18	11,348,702.06
5．利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-

6．其它费用	7.4.7.19	369,674.49
三、利润总额		188,530,821.40
减：所得税费用		-
四、净利润		188,530,821.40

注：本期财务报表的实际编制期间为 2009 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信蓝筹精选股票型证券投资基金
本报告期： 2009 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2009 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）	1,075,266,237.12	-	1,075,266,237.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	188,530,821.40	188,530,821.40
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）	-684,935,705.39	-83,784,259.30	-768,719,964.69
其中：1.基金申购款	209,210,322.88	21,969,963.96	231,180,286.84
2.基金赎回款（以“-”号填列）	-894,146,028.27	-105,754,223.26	-999,900,251.53
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）	-	-71,132,114.50	-71,132,114.50
五、期末所有者权益（基金净值）	390,330,531.73	33,614,447.60	423,944,979.33

注：本期财务报表的实际编制期间为 2009 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

基金管理公司负责人：高清海　　主管会计工作负责人：韩波　会计机构负责人：庞少华

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰信蓝筹精选股票型证券投资基金(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”)证监许可[2009]第 103 号《关于核准泰信蓝筹精选股票型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《泰信蓝筹精选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 1,075,066,130.00 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 (2009)第 075 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰信蓝筹精选股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 4 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,075,266,237.12 份基金份额，其中认购资金利息折合 200,107.12 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《泰信蓝筹精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行上市的各类股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。本基金的投资组合为：股票资产占基金资产的 60%-95%，债券、现金类资产及权证、资产支持证券占基金资产的 5%-40%，现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证不高于基金资产净值的 3%，资产支持证券不高于基金资产净值的 20%。本基金的业绩比较基准为：75%X 沪深 300 指数 + 25%X 上证国债指数。

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 2010 年 3 月 29 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 日颁布的《企业会计准则－基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信蓝筹精选股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其它有关规定的声明

本基金 2009 年 4 月 22 日(基金合同生效日) 至 2009 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 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年 4 月 22 日(基金合同生效日) 至 2009 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 2009 年 4 月 22 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日。

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。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资和债券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。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，包括银行存款和各类应收款项等。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，于交易日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；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当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。

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，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。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

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和债券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。当本基金依法有权抵销债权债务且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；处置时其公允价值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也可按直线法计算。

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也可按直线法计算。

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(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)为正数，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(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。

本基金目前以一个经营分部运作。

7.4.4.13 其它重要的会计政策和会计估计

(1)计量属性 本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

(2) 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的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，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》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。

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：无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明：无。

7.4.5.3 差错更正的说明：无。

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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(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 2009 年 12 月 31 日
活期存款	81,098,448.89
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其它存款	-
合计：	81,098,448.89

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2009 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		329,271,581.38	352,939,837.00	23,668,255.62
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
其它		-	-	-
合计		329,271,581.38	352,939,837.00	23,668,255.62

7.4.7.3 衍生金融资产/负债：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产：无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	15,250.14
应收定期存款利息	-
应收其它存款利息	-
应收结算备付金利息	681.20
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.05
其它	-
合计	15,931.39

7.4.7.6 其它资产：无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,059,705.92
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,059,705.92

7.4.7.8 其它负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,678.35
预提费用	359,500.00
合计	361,178.35

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日(2009 年 4 月 22 日)	1,075,266,237.12	1,075,266,237.12
本期申购	209,210,322.88	209,210,322.88
本期赎回（以“-”号填列）	-894,146,028.27	-894,146,028.27
本期末	390,330,531.73	390,330,531.73

注:1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2009 年 3 月 2 日至 2009 年 4 月 17 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 1,075,066,130.00 元。根据《泰信蓝筹精选股票型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 200,107.12 元在本基金成立后，折算为 200,107.12 份基金份额，划入基金份额持有者账户。

3. 根据《泰信蓝筹精选股票型证券投资基金基金合同》及《泰信蓝筹精选股票型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于 2009 年 4 月 22 日(基金合同生效日)至 2009 年 5 月 3 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务自 2009 年 5 月 4 日起开始办理，赎回业务自 2009 年 7 月 1 日起开始办理，转换业务自 2009 年 11 月 5 日起开始办理。

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（2009 年 4 月 22 日）	-	-	-
本期利润	164,862,565.78	23,668,255.62	188,530,821.40
本期基金份额交易产生的变动数	-50,397,036.45	-33,387,222.85	-83,784,259.30
其中：基金申购款	19,276,088.65	2,693,875.31	21,969,963.96
基金赎回款（以“-”号填列）	-69,673,125.10	-36,081,098.16	-105,754,223.26
本期已分配利润	-71,132,114.50	-	-71,132,114.50
本期末	43,333,414.83	-9,718,967.23	33,614,447.60

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,247,145.84
定期存款利息收入	-
其它存款利息收入	-
结算备付金利息收入	38,056.08
其它	9.70
合计	1,285,211.62

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	3,670,605,918.15
卖出股票成本总额	3,491,420,679.60
买卖股票差价收入	179,185,238.55

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年4月22日（基金合同生效日）至2009年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	280,310.96
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	169,900.00
减：应收利息总额	219.71
债券投资收益	110,191.25

7.4.7.14 衍生工具收益：无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,378,841.55
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,378,841.55

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2009 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	
——股票投资	23,668,255.62
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其它	-
合计	23,668,255.62

7.4.7.17 其它收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 4 月 22 日（基金合同

	生效日）至 2009 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,248,845.58
基金转出费收入	1,030.30
合计	1,249,875.88

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

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	11,348,702.06
银行间市场交易费用	-
合计	11,348,702.06

7.4.7.19 其它费用

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31
审计费用	85,000.00
信息披露费	270,000.00
债券托管账户维护费	12,000.00
银行划款手续费	1,774.49
其他	900.00
合计	369,674.49

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

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金代销机构
山东省国际信托有限公司	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	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易：无。
7.4.10.1.1 股票交易：无。
7.4.10.1.2 权证交易：无。
7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金：无。

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 2009 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,395,973.86
其中：支付销售机构的客户维护费	844,935.97

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 1.5%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 1.5%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,232,662.37

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 0.25%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 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费
无。

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
无。
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 2009 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2009 年 4 月 22 日）持有的基金份额	40,004,600.00

期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	40,004,600.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	10.25%

注：基金管理人泰信基金管理有限公司在会计期间认购本基金的交易委托中国银行办理，适用手续费为人民币 1,000.00 元。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其它关联方投资本基金的情况

无。

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 2009 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	81,098,448.89	1,247,145.84

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其它关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	本期利润分配合计	备注
1	2009 年 7 月 24 日	2009 年 7 月 24 日	0.500	20,881,853.42	10,578,579.74	31,460,433.16	
2	2009 年 11 月 13 日	2009 年 11 月 13 日	0.500	13,562,602.38	6,898,256.45	20,460,858.83	
3	2009 年 12 月 28 日	2009 年 12 月 28 日	0.500	12,328,081.76	6,882,740.75	19,210,822.51	
合计	-	-	1.500	46,772,537.56	24,359,576.94	71,132,114.50	-

7.4.12 期末（2009 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601117	中国化学	2009 年 12 月 29 日	2010 年 1 月 7 日	新股网上申购	5.43	5.43	13,000.00	70,590.00	70,590.00	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 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
600359	新农开发	2009 年 12 月 22 日	资产重组	20.87	2010 年 1 月 21 日	19.05	430,000.00	10,290,373.04	8,974,100.00	-

注：本基金截至 2009 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购：无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型证券投资基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立了以审计、合规与风险控制委员会、督察长为核心，对公司所有经营管理行为进行监督的四道监控防线。

监察稽核部对公司经营、基金投资等业务运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，如有必要则由督察长向公司董事长和中国证监会报告。目前，公司的事前、事中、事后三个控制层次的风险管理体系相对清晰。各业务部门负责事前风险防范；风险管理部负责对公司运营过程中产生或潜在的风险进行事中管理和监控，并负责运用定量分析模型，根据各基金的投资目标及投资策略，定期对基金的投资组合风险进行评估，向投资决策委员会提交业绩评估报告；监察稽核部负责对公司各项业务进行定期、不定期检查，负责事后监督。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2009 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金

管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值 (所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2009 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	81,098,448.89	-	-	-	81,098,448.89
结算备付金	1,946,475.30	-	-	-	1,946,475.30

存出保证金	400,000.00	-	-	227,786.93	627,786.93
交易性金融资产	-	-	-	352,939,837.00	352,939,837.00
应收利息	-	-	-	15,931.39	15,931.39
应收申购款	-	-	-	396,176.56	396,176.56
资产总计	**83,444,924.19**	-	-	**353,579,731.88**	**437,024,656.07**
负债					
应付证券清算款	-	-	-	10,574,440.52	10,574,440.52
应付赎回款	-	-	-	445,348.54	445,348.54
应付管理人报酬	-	-	-	547,717.21	547,717.21
应付托管费	-	-	-	91,286.20	91,286.20
应付交易费用	-	-	-	1,059,705.92	1,059,705.92
其他负债	-	-	-	361,178.35	361,178.35
负债总计	-	-	-	**13,079,676.74**	**13,079,676.74**
利率敏感度缺口	**83,444,924.19**	-	-	**340,500,055.14**	**423,944,979.33**

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2009 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其它价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中采取“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 60%-95%，债券、现金类资产及权证、资产支持证券占基金资产的 5%-40%。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪

和控制。

7.4.13.4.3.1 其它价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期 2009 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	352,939,837.00	83.25
衍生金融资产－权证投资	-	-
合计	352,939,837.00	83.25

7.4.13.4.3.2 其它价格风险的敏感性分析

于 2009 年 12 月 31 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其它事项

无。

§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	352,939,837.00	80.76
	其中：股票	352,939,837.00	80.76
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	83,044,924.19	19.00
6	其它各项资产	1,039,894.88	0.24
	合计	437,024,656.07	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	8,974,100.00	2.12
B	采掘业	42,514,978.77	10.03
C	制造业	119,692,875.00	28.23
C0	食品、饮料	22,741,600.00	5.36
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	7,234,500.00	1.71
C4	石油、化学、塑胶、塑料	8,732,000.00	2.06
C5	电子	15,001,000.00	3.54
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	43,529,072.00	10.27
C8	医药、生物制品	22,454,703.00	5.30
C99	其它制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,130,000.00	1.92
F	交通运输、仓储业	7,768,000.00	1.83
G	信息技术业	12,696,227.88	2.99
H	批发和零售贸易	30,216,600.00	7.13
I	金融、保险业	122,876,465.35	28.98
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	70,590.00	0.02
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	352,939,837.00	83.25

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

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	600202	哈空调	943,300.00	17,771,772.00	4.19
2	601318	中国平安	300,000.00	16,527,000.00	3.90
3	000858	五 粮 液	510,000.00	16,146,600.00	3.81
4	600812	华北制药	1,380,000.00	16,146,000.00	3.81
5	601166	兴业银行	384,485.00	15,498,590.35	3.66

6	600348	国阳新能	299,921.00	14,507,178.77	3.42
7	601169	北京银行	700,000.00	13,538,000.00	3.19
8	600056	中国医药	480,000.00	13,368,000.00	3.15
9	601788	光大证券	510,000.00	13,015,200.00	3.07
10	601088	中国神华	350,000.00	12,187,000.00	2.87
11	601601	中国太保	450,000.00	11,529,000.00	2.72
12	600015	华夏银行	900,000.00	11,178,000.00	2.64
13	601009	南京银行	564,500.00	10,923,075.00	2.58
14	600036	招商银行	600,000.00	10,830,000.00	2.55
15	001696	宗申动力	520,000.00	9,718,800.00	2.29
16	600359	新农开发	430,000.00	8,974,100.00	2.12
17	000983	西山煤电	220,000.00	8,775,800.00	2.07
18	002092	中泰化学	400,000.00	8,732,000.00	2.06
19	600690	青岛海尔	350,000.00	8,676,500.00	2.05
20	002268	卫 士 通	239,699.00	8,657,927.88	2.04
21	002277	家润多	250,000.00	8,615,000.00	2.03
22	600030	中信证券	260,000.00	8,260,200.00	1.95
23	600704	中大股份	310,000.00	8,233,600.00	1.94
24	601618	中国中冶	1,500,000.00	8,130,000.00	1.92
25	601111	中国国航	800,000.00	7,768,000.00	1.83
26	600363	联创光电	700,000.00	7,763,000.00	1.83
27	600031	三一重工	200,000.00	7,362,000.00	1.74
28	002236	大华股份	100,000.00	7,238,000.00	1.71
29	002078	太阳纸业	350,000.00	7,234,500.00	1.71
30	600028	中国石化	500,000.00	7,045,000.00	1.66
31	000848	承德露露	250,000.00	6,595,000.00	1.56
32	600000	浦发银行	300,000.00	6,507,000.00	1.53
33	002294	信立泰	71,100.00	6,308,703.00	1.49
34	601628	中国人寿	160,000.00	5,070,400.00	1.20
35	000063	中兴通讯	90,000.00	4,038,300.00	0.95
36	601117	中国化学	13,000.00	70,590.00	0.02

8.4 报告期内权益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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	72,251,469.60	17.04

2	601088	中国神华	63,934,007.00	15.08
3	600000	浦发银行	62,562,594.30	14.76
4	000002	万　科Ａ	56,828,560.63	13.40
5	600036	招商银行	55,490,645.54	13.09
6	600622	嘉宝集团	50,201,110.13	11.84
7	601601	中国太保	47,667,495.73	11.24
8	000816	江淮动力	44,363,085.13	10.46
9	600900	长江电力	43,337,329.80	10.22
10	601168	西部矿业	43,237,895.96	10.20
11	000893	广州冷机	42,654,582.92	10.06
12	600869	三普药业	42,427,597.88	10.01
13	601166	兴业银行	40,562,774.37	9.57
14	000937	金牛能源	40,109,952.62	9.46
15	600348	国阳新能	39,477,895.05	9.31
16	601318	中国平安	38,576,896.78	9.10
17	600016	民生银行	38,030,936.82	8.97
18	600050	中国联通	37,008,977.69	8.73
19	600837	海通证券	34,736,230.88	8.19
20	600329	中新药业	34,420,590.31	8.12
21	002028	思源电气	33,669,627.83	7.94
22	601328	交通银行	33,062,238.00	7.80
23	600312	平高电气	32,378,852.78	7.64
24	601939	建设银行	31,595,743.83	7.45
25	600326	西藏天路	30,729,488.00	7.25
26	000630	铜陵有色	29,868,624.89	7.05
27	601628	中国人寿	28,539,243.07	6.73
28	600660	福耀玻璃	27,882,327.68	6.58
29	000069	华侨城Ａ	26,090,801.03	6.15
30	600252	中恒集团	25,913,563.45	6.11
31	000009	中国宝安	25,501,182.97	6.02
32	600893	航空动力	25,254,598.64	5.96
33	601919	中国远洋	24,632,392.59	5.81
34	000911	南宁糖业	24,619,195.09	5.81
35	601169	北京银行	24,275,650.66	5.73
36	600481	双良股份	23,965,401.45	5.65
37	000338	潍柴动力	23,867,164.43	5.63
38	601666	平煤股份	23,601,874.14	5.57

39	600586	金晶科技	23,079,669.86	5.44
40	601009	南京银行	23,018,062.37	5.43
41	000887	中鼎股份	22,825,476.04	5.38
42	600475	华光股份	22,618,574.49	5.34
43	600028	中国石化	22,397,415.71	5.28
44	601390	中国中铁	22,383,952.24	5.28
45	600123	兰花科创	21,749,171.56	5.13
46	601398	工商银行	21,505,500.00	5.07
47	000983	西山煤电	21,488,125.52	5.07
48	600005	武钢股份	21,309,089.90	5.03
49	600872	中炬高新	21,238,406.11	5.01
50	600428	中远航运	20,568,175.96	4.85
51	601766	中国南车	20,480,269.73	4.83
52	000060	中金岭南	20,213,943.17	4.77
53	000031	中粮地产	20,179,350.27	4.76
54	600642	申能股份	20,092,866.58	4.74
55	000755	山西三维	19,914,133.10	4.70
56	600675	中华企业	19,286,441.69	4.55
57	600406	国电南瑞	19,242,420.50	4.54
58	600048	保利地产	18,157,708.50	4.28
59	000917	电广传媒	18,078,187.34	4.26
60	600383	金地集团	17,893,503.41	4.22
61	002233	塔牌集团	17,727,877.19	4.18
62	600997	开滦股份	17,711,219.29	4.18
63	600649	城投控股	17,685,302.32	4.17
64	001696	宗申动力	17,556,073.15	4.14
65	600037	歌华有线	17,386,428.83	4.10
66	600202	哈空调	16,956,528.16	4.00
67	000898	鞍钢股份	16,900,983.92	3.99
68	600284	浦东建设	16,899,660.14	3.99
69	600418	江淮汽车	16,776,421.94	3.96
70	000407	胜利股份	16,669,968.84	3.93
71	000968	煤 气 化	16,213,884.50	3.82
72	002268	卫 士 通	16,146,338.70	3.81
73	000826	合加资源	16,096,290.00	3.80
74	000157	中联重科	16,063,684.63	3.79
75	000425	徐工机械	16,014,318.40	3.78

76	600063	皖维高新	15,869,644.90	3.74
77	601006	大秦铁路	15,813,130.10	3.73
78	600178	东安动力	15,792,845.13	3.73
79	600657	信达地产	15,602,295.49	3.68
80	601111	中国国航	15,385,066.54	3.63
81	000959	首钢股份	15,065,967.80	3.55
82	600835	上海机电	15,033,976.95	3.55
83	600415	小商品城	14,965,140.46	3.53
84	600812	华北制药	14,745,881.04	3.48
85	600516	方大炭素	14,493,348.36	3.42
86	600097	开创国际	14,473,883.81	3.41
87	600251	冠农股份	13,925,992.70	3.28
88	600318	巢东股份	13,804,806.92	3.26
89	600117	西宁特钢	13,768,325.28	3.25
90	000728	国元证券	13,496,303.05	3.18
91	000949	新乡化纤	13,278,362.19	3.13
92	600791	京能置业	13,122,023.64	3.10
93	000420	吉林化纤	13,078,894.45	3.09
94	600528	中铁二局	13,048,254.87	3.08
95	600122	宏图高科	13,033,826.22	3.07
96	600754	锦江股份	12,999,123.96	3.07
97	600056	中国医药	12,860,320.95	3.03
98	600300	维维股份	12,785,605.76	3.02
99	600026	中海发展	12,756,322.21	3.01
100	000858	五 粮 液	12,573,691.94	2.97
101	600127	金健米业	12,458,667.00	2.94
102	000709	唐钢股份	12,417,716.92	2.93
103	600362	江西铜业	12,384,090.42	2.92
104	600078	澄星股份	12,378,703.14	2.92
105	601788	光大证券	12,238,820.03	2.89
106	600717	天津港	12,224,140.86	2.88
107	000021	长城开发	11,983,816.76	2.83
108	601899	紫金矿业	11,938,800.21	2.82
109	600271	航天信息	11,929,582.54	2.81
110	600193	创兴置业	11,854,848.05	2.80
111	600256	广汇股份	11,797,786.00	2.78
112	600015	华夏银行	11,785,439.15	2.78

113	600606	金丰投资	11,698,980.94	2.76
114	600392	太工天成	11,570,404.58	2.73
115	000969	安泰科技	11,298,044.39	2.66
116	000027	深圳能源	11,242,363.45	2.65
117	000400	许继电气	11,115,597.13	2.62
118	000402	金 融 街	11,112,296.51	2.62
119	000768	西飞国际	10,977,516.16	2.59
120	000952	广济药业	10,968,595.16	2.59
121	002092	中泰化学	10,908,811.42	2.57
122	000901	航天科技	10,821,938.77	2.55
123	002133	广宇集团	10,763,887.18	2.54
124	000039	中集集团	10,705,761.87	2.53
125	600895	张江高科	10,535,578.83	2.49
126	600971	恒源煤电	10,525,865.00	2.48
127	000066	长城电脑	10,407,695.90	2.45
128	600359	新农开发	10,290,373.04	2.43
129	600626	申达股份	10,232,251.52	2.41
130	600587	新华医疗	10,214,064.00	2.41
131	002087	新野纺织	9,991,351.04	2.36
132	600031	三一重工	9,850,392.62	2.32
133	002129	中环股份	9,831,968.69	2.32
134	002078	太阳纸业	9,823,320.80	2.32
135	000528	柳　　工	9,809,631.06	2.31
136	000825	太钢不锈	9,777,745.09	2.31
137	600694	大商股份	9,677,371.10	2.28
138	000608	阳光股份	9,646,797.50	2.28
139	600550	天威保变	9,508,653.09	2.24
140	600426	华鲁恒升	9,493,058.39	2.24
141	002123	荣信股份	9,421,190.29	2.22
142	600391	成发科技	9,400,661.69	2.22
143	600378	天科股份	9,267,211.12	2.19
144	600151	航天机电	9,199,797.75	2.17
145	002023	海特高新	9,096,217.63	2.15
146	600575	芜湖港	8,615,324.11	2.03
147	000888	峨眉山 A	8,604,321.55	2.03
148	600322	天房发展	8,558,043.92	2.02
149	600060	海信电器	8,515,573.17	2.01

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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	60,452,051.98	14.26
2	000002	万　科Ａ	60,033,083.58	14.16
3	600622	嘉宝集团	59,944,349.56	14.14
4	600000	浦发银行	53,993,441.68	12.74
5	601088	中国神华	53,633,351.28	12.65
6	000816	江淮动力	50,096,279.09	11.82
7	601601	中国太保	48,777,529.36	11.51
8	000893	广州冷机	47,107,013.00	11.11
9	600869	三普药业	46,244,882.29	10.91
10	600036	招商银行	45,842,577.59	10.81
11	000937	金牛能源	45,786,982.87	10.80
12	600900	长江电力	41,154,412.02	9.71
13	601168	西部矿业	41,022,458.42	9.68
14	600329	中新药业	39,268,041.60	9.26
15	600050	中国联通	38,136,464.83	9.00
16	600016	民生银行	38,095,955.08	8.99
17	600312	平高电气	38,086,753.66	8.98
18	600348	国阳新能	37,502,464.06	8.85
19	600837	海通证券	36,972,666.42	8.72
20	601328	交通银行	36,848,995.48	8.69
21	601939	建设银行	36,461,778.00	8.60
22	002028	思源电气	35,896,911.10	8.47
23	600326	西藏天路	34,902,371.49	8.23
24	600252	中恒集团	32,134,922.65	7.58
25	600660	福耀玻璃	30,073,105.07	7.09
26	000069	华侨城Ａ	29,467,071.21	6.95
27	000630	铜陵有色	28,910,832.50	6.82
28	000009	中国宝安	27,766,387.64	6.55
29	601666	平煤股份	27,040,615.58	6.38
30	000338	潍柴动力	26,658,685.71	6.29
31	601166	兴业银行	25,659,351.28	6.05
32	000911	南宁糖业	25,439,170.83	6.00
33	600481	双良股份	25,383,720.12	5.99
34	601318	中国平安	24,847,201.86	5.86

35	600586	金晶科技	23,751,075.68	5.60
36	600675	中华企业	23,379,528.58	5.51
37	601628	中国人寿	23,220,404.92	5.48
38	600475	华光股份	23,071,253.49	5.44
39	601919	中国远洋	23,067,593.65	5.44
40	000031	中粮地产	22,956,412.56	5.41
41	600893	航空动力	22,822,628.82	5.38
42	601398	工商银行	21,955,355.00	5.18
43	601390	中国中铁	21,654,761.38	5.11
44	600872	中炬高新	21,321,844.35	5.03
45	600123	兰花科创	21,252,769.36	5.01
46	000887	中鼎股份	21,190,453.28	5.00
47	600997	开滦股份	21,041,944.06	4.96
48	600642	申能股份	20,941,792.75	4.94
49	000060	中金岭南	20,612,897.12	4.86
50	600005	武钢股份	20,537,109.60	4.84
51	000755	山西三维	20,295,884.46	4.79
52	600428	中远航运	19,917,337.92	4.70
53	601766	中国南车	19,829,324.00	4.68
54	000407	胜利股份	19,295,292.85	4.55
55	600418	江淮汽车	19,135,618.11	4.51
56	000968	煤 气 化	18,837,184.50	4.44
57	600383	金地集团	18,736,985.70	4.42
58	600406	国电南瑞	18,332,874.07	4.32
59	000157	中联重科	18,311,219.92	4.32
60	600649	城投控股	18,168,468.97	4.29
61	600178	东安动力	18,165,131.45	4.28
62	600516	方大炭素	18,121,910.29	4.27
63	600063	皖维高新	18,086,233.95	4.27
64	600037	歌华有线	17,376,200.06	4.10
65	000425	徐工机械	17,362,487.75	4.10
66	600048	保利地产	17,112,094.96	4.04
67	000898	鞍钢股份	17,064,443.46	4.03
68	000917	电广传媒	16,864,002.99	3.98
69	601006	大秦铁路	16,548,566.86	3.90
70	600117	西宁特钢	16,508,409.36	3.89
71	600657	信达地产	16,334,892.86	3.85
72	600300	维维股份	16,293,117.15	3.84
73	002233	塔牌集团	16,270,230.10	3.84

74	600284	浦东建设	15,876,489.57	3.74
75	000826	合加资源	15,796,043.70	3.73
76	000959	首钢股份	15,749,608.76	3.72
77	600415	小商品城	15,318,052.98	3.61
78	600097	开创国际	15,184,357.03	3.58
79	600028	中国石化	14,942,452.92	3.52
80	600318	巢东股份	14,860,825.65	3.51
81	000728	国元证券	14,536,972.66	3.43
82	600791	京能置业	14,373,281.14	3.39
83	600251	冠农股份	14,029,495.45	3.31
84	000949	新乡化纤	13,810,161.72	3.26
85	600754	锦江股份	13,674,411.83	3.23
86	601169	北京银行	13,664,741.00	3.22
87	000983	西山煤电	13,568,159.79	3.20
88	600606	金丰投资	13,474,747.70	3.18
89	600528	中铁二局	13,454,092.03	3.17
90	600835	上海机电	13,362,127.14	3.15
91	000420	吉林化纤	13,348,701.91	3.15
92	600122	宏图高科	13,302,768.42	3.14
93	000027	深圳能源	13,177,816.83	3.11
94	000608	阳光股份	13,147,839.43	3.10
95	600392	太工天成	13,146,869.09	3.10
96	000969	安泰科技	13,130,269.90	3.10
97	600078	澄星股份	13,009,235.52	3.07
98	601009	南京银行	12,630,039.55	2.98
99	600256	广汇股份	12,441,252.08	2.93
100	000709	唐钢股份	12,399,368.50	2.92
101	600026	中海发展	12,358,918.07	2.92
102	600378	天科股份	12,353,583.44	2.91
103	000021	长城开发	12,068,947.97	2.85
104	600717	天津港	12,068,384.97	2.85
105	600199	金种子酒	11,979,258.66	2.83
106	000901	航天科技	11,905,356.60	2.81
107	000402	金 融 街	11,873,922.64	2.80
108	600362	江西铜业	11,687,407.06	2.76
109	000528	柳 工	11,447,713.69	2.70
110	000952	广济药业	11,446,834.83	2.70
111	600271	航天信息	11,365,604.30	2.68
112	000400	许继电气	11,041,758.00	2.60

113	600127	金健米业	11,018,193.60	2.60
114	000768	西飞国际	11,009,703.88	2.60
115	601899	紫金矿业	10,983,000.00	2.59
116	600193	创兴置业	10,967,744.49	2.59
117	600895	张江高科	10,853,734.49	2.56
118	600626	申达股份	10,835,840.68	2.56
119	600694	大商股份	10,805,479.46	2.55
120	002133	广宇集团	10,715,344.43	2.53
121	000039	中集集团	10,583,427.55	2.50
122	002129	中环股份	10,268,878.79	2.42
123	600971	恒源煤电	10,262,824.72	2.42
124	001696	宗申动力	10,199,345.08	2.41
125	002087	新野纺织	10,137,940.73	2.39
126	002123	荣信股份	9,890,271.60	2.33
127	600550	天威保变	9,880,401.93	2.33
128	000066	长城电脑	9,741,038.09	2.30
129	002023	海特高新	9,671,508.19	2.28
130	000825	太钢不锈	9,580,381.84	2.26
131	600587	新华医疗	9,560,374.83	2.26
132	600426	华鲁恒升	9,316,894.67	2.20
133	600135	乐凯胶片	9,099,991.90	2.15
134	000960	锡业股份	9,066,540.36	2.14
135	600322	天房发展	8,976,433.90	2.12
136	000926	福星股份	8,955,377.92	2.11
137	600612	老凤祥	8,887,253.00	2.10
138	002064	华峰氨纶	8,682,427.72	2.05
139	000888	峨眉山Ａ	8,663,822.57	2.04
140	600575	芜湖港	8,649,490.03	2.04
141	000987	广州友谊	8,643,996.60	2.04
142	002268	卫 士 通	8,603,533.31	2.03
143	600060	海信电器	8,566,767.00	2.02
144	600151	航天机电	8,537,466.86	2.01

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	3,820.692.260.98
卖出股票收入（成交）总额	3,670,605,918.15

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名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名的所有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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

报告期末本基金未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 2009年9月9日，五粮液发布公告，接到中国证券监督管理委员会立案调查通知书。五粮液被立案调查的原因主要涉嫌未按照规定披露重大证券投资行为及较大投资损失、未如实披露重大证券投资损失、且披露的主营业务收入数据存在差错。
对该股票的投资决策程序的说明：
本基金管理人经过研究认为该项调查所涉及事项均为2008年以前公司发生的违规行为，不影响五粮液的正常经营活动，与2009年的会计信息无关。本基金认为该公司经营情况良好，经过调查事件，将进一步提升公司的管理规范性。五粮液作为白酒行业的龙头公司之一，具有长期投资价值，因此决定继续持有该公司股份。本基金在这一投资过程中经过投研团队的深入研究，严格遵守了本基金的投资决策程序。
除此之外，报告期内本基金投资的前十名证券的其他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。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其它各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	627,786.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,931.39
5	应收申购款	396,176.56
6	其它应收款	-

7	待摊费用	-
	合计	1,039,894.88

8.9.4 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。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金未持有流通受限的股票。

8.9.6 投资组合报告附注的其它文字描述部分

报告期内本基金未投资控股股东主承销的证券，未从二级市场投资分离交易可转债附送的权证，投资流通受限证券（因认购新发证券而持有的流通受限证券）未违反相关法规或本基金管理公司的规定。

§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
5,757	67,801.03	85,096,074.30	21.80%	305,234,457.43	78.20%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

份额单位：份

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	25,087.40	0.01%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 4 月 22 日）基金份额总额	1,075,266,237.12
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	209,210,322.88
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	894,146,028.27

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	390,330,531.73

注：总申购份额含红利再投、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、经泰信基金管理有限公司第二届董事会2009年半年度会议审议通过，决定聘任桑维英女士、韩波先生担任公司副总经理。桑维英女士、韩波先生的任职资格已获中国证监会核准。详细情况请见刊登在2009年12月31日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上的《泰信基金管理有限公司聘任副总经理的公告》。

2、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

无。

11.4 基金投资策略的改变

无。

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8.5万元。该审计机构从基金合同生效日（2009年4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

1、上海证监局于2009年6月1日至6月5日对本基金管理人泰信基金管理有限公司对公司2005年以来的经营情况进行了现场检查。并于2009年9月29日向公司出具了《关于泰信基金管理有限公司现场检查的整改意见函》（以下简称《意见函》），认为公司副总经理长期缺位，不符合公司章程对管理层组织架构的规定，过去的部分基金投资中出现异常交叉交易情况，公司自有资金投资未能严格执行公司的自有资金投资管理规定，存在超范围投资于短期融资券的现象等。《意见函》对管理人在公司治理结构、投研管理、风险控制体系和监察稽核工作、人员资格管理等方面提出了整改意见，并对公司有关责任人采取了监管谈话、记入诚信档案和出具警示函等行政监管措施。

根据现场检查情况和《意见函》的要求，公司组成了以董事长为组长的工作领导小组，针对整改意见制定了详尽的整改计划及落实措施。通过全面认真整改，上述问题已基本得到解决，2010年初上海局已对管理人进行了整改验收。

通过本次整改和公司的一系列自我整固措施的逐步落实，公司运营的风控能力和基金管理能力均得到明显提高，使我们更有信心为广大基金投资人提供优质的服务。

2、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和处罚。

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

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	1	815,928,041.23	10.90%	693,537.30	11.07%	
渤海证券	1	473,451,431.12	6.33%	402,433.10	6.42%	
长财证券	1	153,540,340.87	2.05%	124,753.03	1.99%	
东方证券	1	199,480,557.40	2.67%	162,078.82	2.59%	
广发证券	1	31,215,532.12	0.42%	26,533.29	0.42%	
国泰君安证券	1	334,550,976.01	4.47%	271,825.05	4.34%	

国信证券	1	283,865,513.24	3.79%	241,283.21	3.85%	
国元证券	1	1,181,061,854.00	15.78%	1,003,898.79	16.02%	
华宝证券	1	150,932,770.95	2.02%	122,634.84	1.96%	
华泰证券	1	32,670,250.51	0.44%	26,544.88	0.42%	此交易单元原为信泰证券所有，该公司后并入华泰证券。
江海证券	1	349,429,131.38	4.67%	283,913.12	4.53%	新增
江南证券	1	408,691,651.89	5.46%	332,066.18	5.30%	
华泰联合证券	1	432,198,259.04	5.78%	351,166.42	5.60%	原联合更名为华泰联合
上海证券	1	437,579,190.23	5.85%	371,939.55	5.94%	
申银万国证券	1	52,526,980.24	0.70%	44,647.31	0.71%	
万联证券	1	99,577,641.29	1.33%	84,641.69	1.35%	
五矿证券	1	91,055,218.85	1.22%	73,983.14	1.18%	新增
招商证券	1	214,983,220.81	2.87%	174,675.60	2.79%	
中国建银投资证券	1	340,401,825.01	4.55%	289,337.51	4.62%	
中金公司	1	69,149,293.00	0.92%	58,775.67	0.94%	新增
中信建投	1	781,604,774.22	10.44%	664,361.52	10.60%	
中信证券	2	391,862,224.09	5.24%	333,082.43	5.32%	
中银国际	2	113,175,262.56	1.51%	91,957.73	1.47%	
国金证券	1	44,234,807.69	0.59%	35,941.41	0.57%	退租
大通证券	1	-	-	-	-	
第一创业	1	-	-	-	-	
东海证券	1	-	-	-	-	
光大证券	1	-	-	-	-	
海通证券	2	-	-	-	-	
金元证券	1	-	-	-	-	
南京证券	1	-	-	-	-	
西南证券	1	-	-	-	-	
新时代证券	1	-	-	-	-	退租

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其他基金共用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其它证券投资的情况

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
国泰君安证券	280,310.96	100.00%	0	0.00%	0	0.00%

11.8 其它重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	新增财富证券为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 3 月 10 日
2	新增宁波银行为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 3 月 10 日
3	新增浦发银行为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 3 月 10 日
4	新增远东证券为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 3 月 12 日
5	新增上海银行为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 3 月 16 日
6	新增中银国际证券为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 3 月 19 日

7	新增东海证券为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 3 月 19 日
8	新增宏源证券为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 3 月 19 日
9	基金延长募集期	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 3 月 28 日
10	新增长城证券为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 4 月 9 日
11	新增农业银行为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 4 月 10 日
12	开放日常申购业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 4 月 29 日
13	新增爱建证券为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 5 月 7 日
14	参与申银万国证券非现场交易申购费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 5 月 12 日
15	新增华宝证券为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 5 月 14 日
16	参加光大银行网银申购费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 5 月 15 日

17	参加光大银行基金定投及其费率优惠活动	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 5 月 15 日
18	开放日常赎回业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 6 月 29 日
19	调整中国光大银行定期定额起点金额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 7 月 10 日
20	参加中国工商银行基金定投及其费率优惠活动	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 7 月 21 日
21	第一次分红预告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 7 月 22 日
22	第一次分红公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 7 月 27 日
23	新增英大证券为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 8 月 7 日
24	公司旗下部分基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 8 月 18 日
25	锦江股份恢复市价估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 9 月 3 日
26	参加中国农业银行基金网银申购费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 9 月 5 日

27	公司旗下部分基金参加齐鲁证券网银申购费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 9 月 9 日
28	新增南京银行为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 9 月 23 日
29	关于旗下基金投资创业板的股票和可转换债券的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 9 月 24 日
30	在宁波银行开通转换业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 10 月 10 日
31	在中国银行开通基金定期定额申购业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 10 月 17 日
32	开通基金转换公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 11 月 3 日
33	第二次分红预告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 11 月 11 日
34	新增广发华福为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 11 月 13 日
35	第二次分红公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 11 月 17 日
36	在国信证券、南京银行开通基金定期定额申购业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 11 月 18 日

37	在网上直销渠道及各大银行代销机构开通基金定期定额申购业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 11 月 23 日
38	参加中国银行开展的定期定额申购业务及其费率优惠活动	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 11 月 25 日
39	在浦发银行开通基金定期定额申购及转换业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 11 月 25 日
40	开通农业银行基金定期定额申购业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 12 月 7 日
41	在中信银行开通基金定期定额申购及转换业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 12 月 8 日
42	在华安、招商、爱建、江海开通定期定投业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 12 月 9 日
43	第三次分红预告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 12 月 24 日
44	第三次分红实施公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 12 月 29 日
45	参加中信建投证券开展的基金定期定额申购业务及其费率优惠活动	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 12 月 30 日
46	参加中国工商银行基金定投优惠活动	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 12 月 30 日

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰信蓝筹精选股票型证券投资基金设立的文件

2、《泰信蓝筹精选股票型证券投资基金基金合同》

3、《泰信蓝筹精选股票型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信蓝筹精选股票型证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。在支付必要的工本费后，投资者可在有效的工作时间内取得本报告及上述备查文件的复制件或复印件。

12.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站(www.ftfund.com)查阅上述相关文件，或拨打客户服务中心电话(400-888-5988，021-38784566)，和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司

20010 年 3 月 31 日