

泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资 基金 2012 年年度报告

2012 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2013 年 3 月 29 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 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 2012 年 9 月 7 日（基金合同生效日）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	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§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.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告	41
8.1 期末基金资产组合情况.....	41
8.2 期末按行业分类的股票指数投资组合.....	41
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.....	42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	55
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.....	55

8.9 投资组合报告附注	55
§9 基金份额持有人信息.....	56
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
9.2 期末基金前十名持有人 (A 级)	56
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
§10 开放式基金份额变动.....	57
§11 重大事件揭示	58
11.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
11.4 基金投资策略的改变	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8 其他重大事件	60
§12 备查文件目录.....	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金		
基金简称	泰信基本面 400 指数分级		
基金主代码	162907		
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)		
基金合同生效日	2012 年 9 月 7 日		
基金管理人	泰信基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	68,775,016.14 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012-09-21		
下属分级基金的基金简称	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
下属分级基金的交易代码	150094	150095	162907
报告期末下属分级基金份额总额	6,124,685.00 份	6,124,685.00 份	56,525,646.14 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对中证锐联基本面 400 指数的有效跟踪。		
投资策略	本基金主要采用完全复制法，按照在中证锐联基本面 400 指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合和跟踪中证锐联基本面 400 指数的收益表现，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	95%×中证锐联基本面 400 指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率（税后）		
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。		
下属三级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。	高风险、高预期收益。	较高风险、较高预期收益。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	唐国培	赵会军
	联系电话	021-20899032	010-66105799
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-5988	95588

传真	021-20899008	010—66105798
注册地址	上海市浦东新区浦东南路 256 号 37 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市浦东新区浦东南路 256 号 华夏银行大厦 36-37 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	孟凡利	姜建清

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》、《证券时报》、《证券时报》、《证券日报》
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	上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 37 层

2.5 其他相关资料

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	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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	2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)-2012 年 12 月 31 日
本期已实现收益	470,859.76
本期利润	5,948,646.69
加权平均基金份额本期利润	0.0493
本期加权平均净值利润率	4.90%
本期基金份额净值增长率	8.40%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末
期末可供分配利润	302,559.68
期末可供分配基金份额利润	0.0044
期末基金资产净值	74,522,704.48
期末基金份额净值	1.084
3.1.3 累计期末指标	2012 年末
基金份额累计净值增长率	8.40%

注：1、上述指标的计算时间的起始日为 2012 年 9 月 7 日（基金合同生效日），截至本报告期末不

满半年，仍处在建仓期。

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

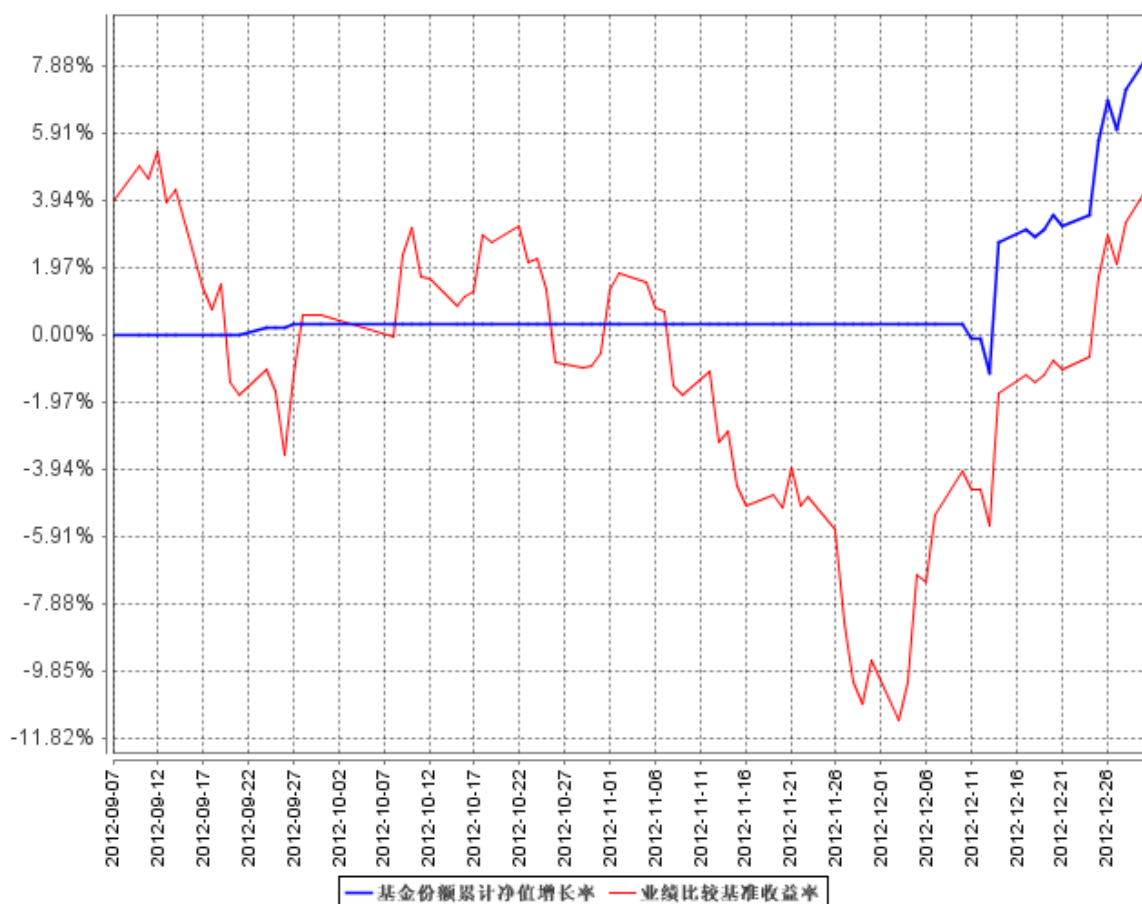
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.08%	0.64%	3.98%	1.34%	4.10%	-0.70%
自基金合同生效日起至今	8.40%	0.57%	4.58%	1.43%	3.82%	-0.86%

注：本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证锐联基本面 400 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率（税后）}$

中证锐联基本面 400 指数以沪深 A 股为样本空间，挑选基本面价值排列第 201 至第 600 家的上市公司作为样本，基本面价值由四个财务指标来衡量：营业收入、现金流、净资产和分红；样本股的权重配置由基本面价值决定，在一定程度上打破了样本市值与其权重之间的关联，避免了传统市值指数中过多配置高估股票的现象。

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

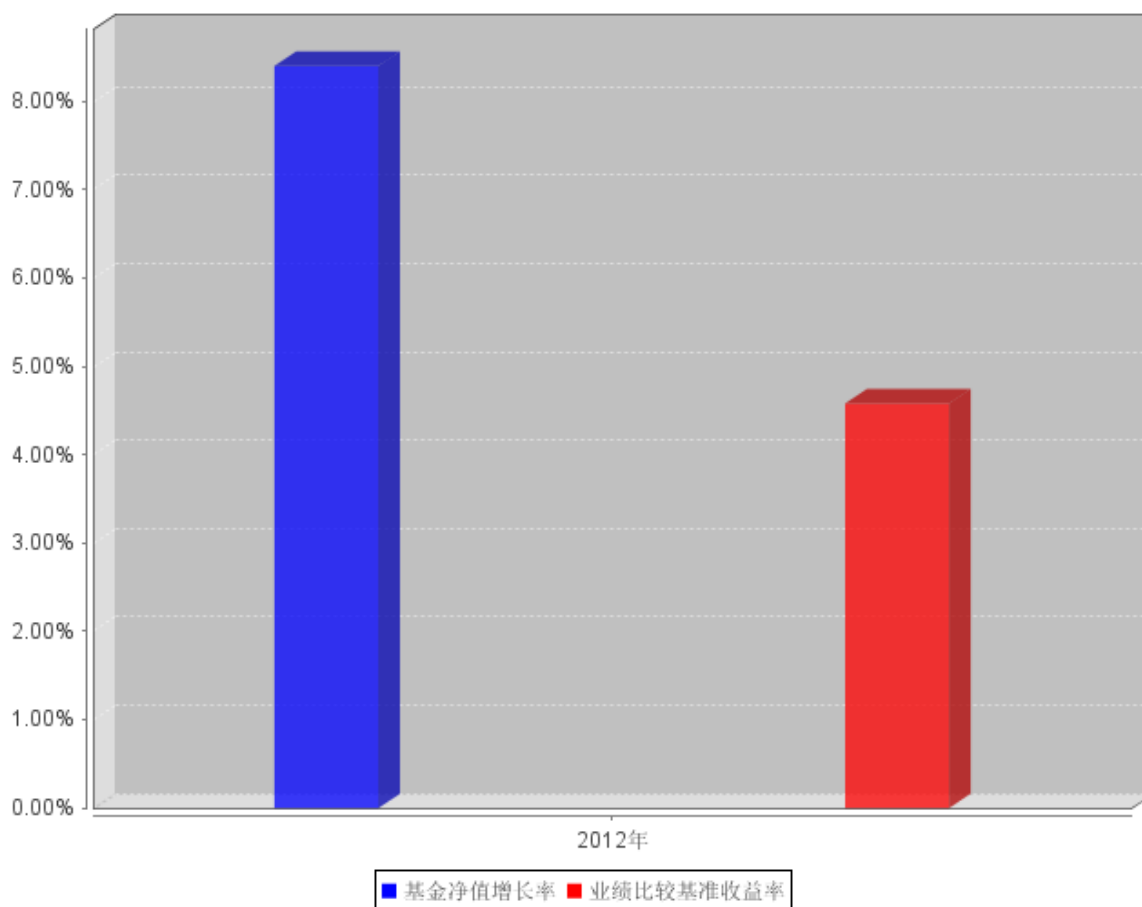


注：1、本基金基金合同于 2012 年 9 月 7 日正式生效。截至报告期末不足半年，还处在建仓期。

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。本基金投资于中证锐联基本面 400 指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%；现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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

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对比图



注：本基金基金合同于 2012 年 9 月 7 日正式生效，本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

在基金存续期内，本基金（包括泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额）不进行收益分配。

§ 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：上海市浦东新区浦东南路 256 号 37 层

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 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：孟凡利

总经理：葛航

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：王伟毅

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。

公司目前下设市场部、营销部（分华东、华北、华南三大营销中心和电子商务部）、客服中心、基金投资部、研究部、专户投资部、理财顾问部、清算会计部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、计划财务部、综合管理部、北京分公司、深圳分公司。截至 2012 年 12 月底，公司有正式员工 115 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 2012 年 12 月，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、泰信优质生活股票、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、泰信发展主题股票、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选股票、泰信保本混合、泰信中证基本面 400 指数分级共 13 只开放式基金及泰信财富分级 2 号、泰信财富分级 3 号、泰信财富分级 4 号、泰信乐享分级 1 号、泰信恒益高息债分级共 5 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		
陈大庆先生	本基金经理兼泰信中证 200 指数基金经理	2012 年 9 月 7 日	-	8	管理学硕士。具有基金从业资格。曾在中国建银投资证券有限责任公司、华林证券有限责任公司担任研究员。2008 年 2 月加入泰信基金管理有限公司，先后担任研究员、优质生活基金经理助理。自 2011 年

					6 月 9 日起担任泰信中证 200 指数基金经理至今。
--	--	--	--	--	------------------------------

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

本报告期内，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《泰信中证锐利基本面 400 指数分级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双日反向交易，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

一、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。

二、本报告期基金同向交易价差专项分析

本公司截至 2012 年 12 月 31 日，共有 13 只公募基金，5 只专户产品。剔除 2 只指数基金（被动指数在交易过程中采用自动化交易），对其余投资组合进行两两分组，进行同向交易价差分析。

我们采用连续样本计算方法，对 2012 年连续 4 个季度的同向价差数据，分别进行时间窗口在 1 天、3 天、5 天内的数据 T 检验分析，结果表明：

- 1) 通过 T 检验的和正溢价次数占比在 45%~55%的数据符合公平公正原则；
- 2) 未通过 T 检验的数据的溢价金额占基金净值比均在 1%以内，连续四个季度的溢价金额不足以对基金净值造成显著影响，各基金之间不存在利益输送；
- 3) 未发现其他异常。

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

2012 年，A 股市场依靠年初和年末的两轮上涨行情，扭转了连续两年的下跌趋势。以金融行业为代表的大盘蓝筹股成为推动市场反转的主力。按照投资风格分类的大盘指数走势普遍强于中小盘指数。

本基金于 2012 年 9 月 7 日成立，基于对年内行情的谨慎判断，采取了延迟建仓的策略，待 12 月初市场上升趋势明确后在短期内完成了对指数的完全复制，到年底实现了 8.4% 的正收益。

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 1.084 元，净值增长率为 8.40%，业绩比较基准增长率为 4.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012 年底延续至今的行情给困顿了两年的股市带来了复苏的希望，随着行情的深入，各种有利因素也不断浮现，并为越来越多的投资者所认识。

从宏观经济上看，未来几年国内经济增速还将保持在较高的水平。新一届中央领导集体提出的新型城镇化思路，一方面明确了投资在未来较长时间内仍将作为拉动经济增长的主导力量，另一方面也有针对性的为今后逐步提高消费在经济增长中所发挥的作用做出了提前的安排。国际上，随着美国房地产显著复苏，全球经济也将走出低谷。而作为领先指标，世界主要市场指数普遍出现大幅上涨，已经或者即将创出历史新高。

上市公司利润在 2012 年遭遇大幅下滑，但从历史上看，还从未出现过连续两年负增长的情况，结合对宏观经济见底回升的判断，我们可以乐观地估计 2013 年上市公司的业绩将出现显著的上升，这让我们对 2013 年末的指数点位可以抱有较高的期望。

流动性也支持股市的进一步上涨。银行理财产品的高收益一度被视为无风险收益的标杆，从而导致了大量资金流出股市。随着理财产品风险逐步暴露，从此类市场流出的资金也会分流至估值水平偏低的股市。更不用说美联储的量化宽松政策还将推动国际资金源源不断地流入新兴市场，特别是已成为价值洼地的中国 A 股市场。

总体上看，2013 年 A 股市场有望走出一轮较好的行情，指数基金的表现可以期待。我们将继续严格遵守基金合同，坚持指数化投资策略，做好成份股研究工作，积极应对成份股调整和基金申购赎回，严格控制基金相对比较基准的跟踪误差，实现对中证锐联基本面 400 指数的有效跟踪，以维护投资者的利益。

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，公司内部控制工作本着对基金份额持有人利益高度负责的精神，以独立于各业务部门的风险管理部、监察稽核部为主体，对基金销售、投资运作、后台保障等主要业务活动进行监督与控制，较好地保证了基金运作的合规性。主要工作情况如下：

1、加强公司制度体系建设。公司根据监管部门规定和要求，及时对公司原有制度流程修改审定，促进了业务的合规开展。主要包括《公司公平交易制度》、《异常交易监控与报告制度》、《公司员工直系亲属股票投资管理办法》、《基金参与上市公司股东大会管理办法》、《系统操作权限管理办法》等，完善了内部风险控制和管理。

2、进一步规范基金投资管理 workflow，加强基金投资风险控制。

(1) 做好股票出入库流程管理。公司本报告期的股票入库管理工作基本实现了电子化，首先是投资研究联席会议成员对研究员通过研究报告管理系统提交的入库报告进行审阅，决定是否可加入核心库。风险管理部在复核前述审核流程是否完备、是否存在公司关联方后，再加入投资管理系统中的股票池。管理方式的改变，提高了流程的效率，也提高了材料存档的安全与可靠性。

(2) 做好投资交易指标控制工作。2012 年度，证券市场表现不佳，投资者的申购赎回行为对投资组合的影响较大。风险管理部专人负责指标的跟踪、监控与提示工作，对于因申购赎回或者个股大幅波动导致的被动局面，经投资组合经理申请、相关人员批准后及时修正，确保投资监控指标的控制效果。

3、规范投资交易行为，防范交易环节的操作风险。公司禁止基金内的同日反向交易，严格控制旗下管理投资组合间的同日反向交易，新增了基金间同日同向交易、所有投资组合对单只股票成交量占其市场总成交异常等指标预警。对于日常的投资监控，公司实行的是事前控制、事中监督、事后检查的方法，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。

4、针对重点业务环节开展专项检查，查漏补缺，做好事后环节督促改进工作。公司于年初制定了《2012 年度专项稽核工作计划》，稽查工作覆盖主要业务板块，突出了核查重点。全年完成了清算会计、销售业务和研究、投资、交易相关环节、公平交易相关环节、一级市场申购相关环节的专项稽核，对稽核中发现的问题通过书面报告的形式及时通报部门总监、报告督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果，切实保证了基金运作和公司经营的合法合规。

5、做好投研交易等人员的合规培训，提高合规意识。公司组织投研人员开展内幕交易案例合规培训，就近年来发生的典型内幕交易案例作了分类汇报，并对目前市场上的疑似内幕交易、有争议

的内幕交易案例进行了说明，要求投研人员遵守投资纪律，规范决策流程，从源头避免内幕交易事件的发生，加强了投研人员的合规意识。

6、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。加强投研人员的资讯管理，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，对投研人员的办公电脑安装截屏软件进行留痕处理，并对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。今后公司将继续夯实内部控制和风险管理工作，保证基金运作的合规性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

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，大学本科。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，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。

庞少华先生，硕士，会计师。2005 年 1 月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，经济学学士。2008 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，现任投资部总监兼投资总监，泰信先行策略、泰信优势增长基金经理。

梁剑先生，硕士。2004 年 7 月加入泰信基金管理有限公司，曾任泰信先行策略混合基金经理。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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在基金存续期内，本基金（包括泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额）不进行收益分配。

§ 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

2012 年，本基金托管人在对泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2012 年，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金的管理人——泰信管理有限公司在泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对泰信基金管理有限公司编制和披露的泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金 2012 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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(2013)第 20078 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	泰信中证锐联基本面 400 指数分级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锐联基本面 400 指数分级证券投资基金(以下简称“泰信基本面 400 基金”)的财务报表,包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间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基本面 400 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，上述泰信基本面 400 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，公允反映了泰信基本面 400 基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2012 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	单峰 张晓艺
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	2013 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日
资产:		
银行存款	7.4.7.1	2,859,997.93
结算备付金		7,277,272.73
存出保证金		250,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	62,679,700.36
其中: 股票投资		62,679,700.36
基金投资		-
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	3,581.97
应收股利		-
应收申购款		2,988,047.81
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		76,058,600.80
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 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		-
应付赎回款		1,092,471.36
应付管理人报酬		61,077.36
应付托管费		13,436.99
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	60,530.09
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	308,380.52
负债合计		1,535,896.32
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	68,775,016.14
未分配利润	7.4.7.10	5,747,688.34
所有者权益合计		74,522,704.48
负债和所有者权益总计		76,058,600.80

注：1. 报告截止日 2012 年 12 月 31 日，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之基础份额净值 1.084 元，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 A 份额净值 1.022 元，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 B 份额净值 1.146 元；基金份额总额 68,775,016.14 份，其中泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之基础份额 56,525,646.14 份，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 A 份额 6,124,685.00 份，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 B 份额 6,124,685.00 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金

本报告期：2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日
一、收入		6,855,406.09
1.利息收入		794,630.70
其中：存款利息收入	7.4.7.11	91,366.94
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		703,263.76
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		286,346.30
其中：股票投资收益	7.4.7.12	275,033.30
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
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	11,313.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	5,477,786.93
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	296,642.16
二、费用		906,759.40
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	379,328.16
2. 托管费	7.4.10.2.2	83,452.18
3. 销售服务费		-

4. 交易费用	7.4.7.18	74,325.02
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.19	369,654.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,948,646.69
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,948,646.69

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金

本报告期：2012 年 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2012 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）	300,843,720.90	-	300,843,720.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,948,646.69	5,948,646.69
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）	-232,068,704.76	-200,958.35	-232,269,663.11
其中：1. 基金申购款	4,717,621.03	262,458.20	4,980,079.23
2. 基金赎回款	-236,786,325.79	-463,416.55	-237,249,742.34
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）	68,775,016.14	5,747,688.34	74,522,704.48

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

基金管理公司负责人

韩波

主管会计工作负责人

庞少华

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金(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[2012]第 252 号《关于核准泰信中证锐联基本面 400 指数分级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《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约开放式,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 300,797,873.45 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(2012)第 346 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 9 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 300,843,720.90 份,其中认购资金利息折合 45,847.45 份。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的基金份额包括泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“泰信基本面 400 份额”)、泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“泰信基本面 400A 份额”)与泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“泰信基本面 400B 份额”)。其中,泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比率不变。

在泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400 份额存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日,本基金将根据基金合同的规定进行基金的定期份额折算。泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行参考净值计算,对泰信基本面 400A 份额的应得收益进行定期份额折算,每 2 份泰信基本面 400 份额将按 1 份泰信基本面 400A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后,泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于泰信基本面 400A 份额期末的约定应得收益,即泰信基本面 400A 份额每个会计年度 12 月 31 日份额参考净值超出 1.000 元部分,将折算为场内泰信基本面 400 份额分配给泰信基本面 400A 份额持有人。泰信基本面 400 份额持有人持有的每 2 份泰信基本面 400 份额将按 1 份泰信基本面 400A 份额获得新增泰信基本面 400 份额的分配。持有场外泰信基本面 400 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外泰信基本面 400 份额的分配;持有场内泰信基本面 400 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内泰信基本面 400 份额的分配。经过上述份额折算,泰信基本面 400A 份额的基金份额参考净值和泰信基本面 400 份额的基金份额净值将相应调整。每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日,本基金将对泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400 份额进行应得收益的定期份额折算。

除以上定期份额折算外，本基金根据基金合同规定，还将在以下两种情况进行份额折算，即：当泰信基本面 400 份额的基金份额净值达到 2.000 元；当泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元。当泰信基本面 400 份额的基金份额净值达到 2.000 元后，本基金将分别对泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额和泰信基本面 400 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的比例为 1:1，份额折算后泰信基本面 400 份额的基金份额净值、泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值均调整为 1 元。当泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元后，本基金将分别对泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额和泰信基本面 400 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的比例为 1:1，份额折算后泰信基本面 400 份额的基金份额净值、泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

泰信基本面 400 份额设置单独的基金代码，但不上市交易。泰信基本面 400A 份额与泰信基本面 400B 份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于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。其中，中证锐联基本面 400 指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的标的指数是中证锐联基本面 400 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 2013 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》、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级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 2012 年 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2012 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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 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 2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 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。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票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、买入返售金融资产和各类应收款项等。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；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动作为公允价值变动损益计入

当期损益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利以及处置时产生的处置损益计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资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 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；2) 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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其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则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在存续期内，本基金(包括泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额)将不进行收益分配。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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[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) 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，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。

(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 2012 年 12 月 31 日
活期存款	2,859,997.93
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,859,997.93

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	57,201,913.43	62,679,700.36	5,477,786.93
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	57,201,913.43	62,679,700.36	5,477,786.93

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末及上年度末本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末及上年度末本基金未持有返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度可比期间本基金未持有买断式逆回购中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	307.17
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,274.80
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	3,581.97

7.4.7.6 其他资产

本报告期末及上年度可比期间本基金无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	60,530.09
银行间市场应付交易费用	-
合计	60,530.09

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,117.34
预提费用	284,500.00
应付指数使用费	19,763.18
合计	308,380.52

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额

基金合同生效日	300,843,720.90	300,843,720.90
本期申购	4,717,621.03	4,717,621.03
本期赎回（以“-”号填列）	-236,786,325.79	-236,786,325.79
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	68,775,016.14	68,775,016.14

注：1. 本基金自 2012 年 8 月 6 日至 2012 年 8 月 31 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 300,797,873.45 元（其中场内净认购资金 23,995,000.00 元，场外净认购资金 276,802,873.45 元）。根据《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 45,847.45 元（其中场内募集资金产生利息 908.00 元，场外募集资金产生利息 44,939.45 元）。在本基金成立后，基金于 2012 年 9 月 10 日进行份额确认，其中场外认购的全部份额确认为泰信基本面 400 份额 276,847,812.90 份，场内认购部分按照基金合同约定的 1:1 比例份额确认为泰信基本面 A 份额 11,997,954.00 份和泰信基本面 B 份额 11,997,954.00 份，划入基金份额持有人账户。

2、根据《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于 2012 年 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2012 年 9 月 20 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购、赎回业务自 2012 年 9 月 21 日起开始办理。

3. 截至 2012 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 12,249,370.00 份（其中基本面 A 份额 6,124,685.00 份，基本面 B 份额 6,124,685.00 份），托管在场内未上市交易的基金份额为 467,375.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 56,525,646.14 份，均为泰信基本面 400 份额。场内的泰信基本面份额登记在证券登记结算系统，场外的泰信基本面份额登记在注册登记系统，可按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 未分配利润

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	-	-	-
本期利润	470,859.76	5,477,786.93	5,948,646.69
本期基金份额交易产生的变动数	-168,300.08	-32,658.27	-200,958.35
其中：基金申购款	15,634.08	246,824.12	262,458.20
基金赎回款	-183,934.16	-279,482.39	-463,416.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	302,559.68	5,445,128.66	5,747,688.34

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	63,619.03
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	27,747.91
其他	-
合计	91,366.94

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	5,158,334.65
减：卖出股票成本总额	4,883,301.35
买卖股票差价收入	275,033.30

7.4.7.13 债券投资收益

本报告期及上年度可比期间本基金无债券投资收益。

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本报告期及上年度可比期间本基金无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本报告期末及上年度可比期间本基金无衍生工具投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	11,313.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	11,313.00

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	5,477,786.93
——股票投资	5,477,786.93
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	5,477,786.93

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	296,565.59
其他	76.57
合计	296,642.16

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，本基金收取的赎回费中不低于 25% 的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	74,325.02
银行间市场交易费用	-
合计	74,325.02

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00
信息披露费	230,000.00
债券帐户维护费——中债登	4,500.00
指数使用费	34,139.54

上市年费	50,000.00
银行划款手续费	114.50
其他	900.00
合计	369,654.04

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至本报告期末，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

(1) 根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所(以下简称“深交所”)和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金以 2013 年 1 月 4 日为份额折算基准日，对泰信基本面 400 的场内份额、场外份额和泰信基本面 400A 实施定期份额折算。份额折算结果如下：

2013 年 1 月 4 日，泰信基本面 400 份额的场外份额经折算后的份额数按截位法保留到小数点后两位，舍去部分计入基金财产；泰信基本面 400 份额的场内份额、泰信基本面 400A 份额经折算后的份额数取整计算(最小单位为 1 份)，舍弃部分计入基金财产。份额折算比例按截位法精确到小数点后第 9 位，如下表所示：

基金份额名称	折算前份额	新增份额 折算比例	折算后份额	折算后 基金份 额净值	折算后基 金份额累 计净值
泰信基本面 400 场外份额	55,701,621.30	0.010145677	56,266,751.95	1.068	1.079
泰信基本面 400 场内份额	328,603.00	0.010145677	452,980.00	1.068	1.079
泰信基本面 400A 份额	5,965,345.00	0.020291355	5,965,345.00	1.001	1.022

注：泰信基本面 400 场外份额经份额折算后产生新增的泰信基本面 400 场外份额；泰信基本面 400 场内份额经份额折算后产生新增的泰信基本面 400 场内份额；泰信基本面 400A 份额经份额折算后产生新增的泰信基本面 400 场内份额。

自 2013 年 1 月 8 日起，本基金恢复申购、赎回、转托管(包括场外转托管和跨系统转托管)和配对转换业务，泰信基本面 400A 份额在深圳证券交易所复牌。根据深圳证券交易所《关于分级基金份额折算后次日前收盘价调整的通知》，2013 年 1 月 8 日泰信基本面 400A 复牌首日即时行情显示的收盘价为 2013 年 1 月 7 日的泰信基本面 400A 的份额净值(四舍五入至 0.001)，即 1.001 元。

(2) 财政部、国家税务总局、中国证监会于 2012 年 11 月 16 日联合发布财税[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》(以下简称“通知”)，要求个人从

公开发行为和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%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。证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得，按照本通知的规定计征个人所得税。通知自 2013 年 1 月 1 日起施行。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
山东省国际信托有限公司(“山东国投”)	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：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

7.4.10.1.1 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。

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。

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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.2 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
----	----

	2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	379,328.16
其中:支付销售机构的客户维护费	79,907.72

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 1.0%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期
	2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	83,452.18

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22%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×0.22%/当年天数。

7.4.10.2.3 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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期末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。

7.4.10.4 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

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

泰信基本面 400A		
关联方名称	本期末 2012 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
山东国托	4,570,000.00	74.62%

泰信基本面 400B

关联方名称	本期末 2012 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
山东国托	3,900,000.00	63.68%

泰信基本面 400		
关联方名称	本期末 2012 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
山东国托	20,000,350.00	29.08%

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方中山东省国际信托有限公司于本期末持有本基金份额，其持有的份额为泰信基本面 400 份额、泰信基本面 A 份额与泰信基本面 B 份额。对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。本基金除基金管理人之外的其他关联方于 2012 年 12 月 31 日未持有本基金份额。除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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 2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	2,859,997.93	63,619.03

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期末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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

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

在基金存续期内，本基金（包括泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额）不进行收益分配。

7.4.12 期末（2012 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

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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
600236	桂冠电力	2012 年 12 月 21 日	重大资产重组	3.98	2013 年 2 月 5 日	4.36	55,400	193,885.00	220,492.00	-
000698	沈阳化工	2012 年 12 月 24 日	重大事项未公告	4.22	2013 年 1 月 31 日	4.64	44,500	184,970.00	187,790.00	-
000903	云内动力	2012 年 12 月 31 日	未收到要约收购结果	4.65	2013 年 1 月 4 日	4.72	32,100	149,265.00	149,265.00	-
000973	佛塑科技	2012 年 12 月 28 日	拟非公开发行股份购买资产	4.15	2013 年 1 月 18 日	4.57	31,600	120,080.00	131,140.00	-
000042	深长城	2012 年 12 月 18 日	重大事项未公告	20.10	2013 年 2 月 5 日	22.11	4,500	87,885.00	90,450.00	-

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

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 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作为抵押的债券。

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

本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，泰信基本面 400A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；泰信基本面 400B 份额具有高风险、高预期收益的特征。本基金投资于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。本基金在控制风险的基础上，力争为持有人创造稳定的长期回报。

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工商银行，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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 2012 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在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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，其余均能以合理价格适时变现。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、结算备付金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	2,859,997.93	-	-	-	2,859,997.93
结算备付金	7,277,272.73	-	-	-	7,277,272.73
存出保证金	-	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	-	-	-	62,679,700.36	62,679,700.36
应收利息	-	-	-	3,581.97	3,581.97
应收申购款	-	-	-	2,988,047.81	2,988,047.81
资产总计	10,137,270.66	-	-	65,921,330.14	76,058,600.80
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,092,471.36	1,092,471.36
应付管理人报酬	-	-	-	61,077.36	61,077.36
应付托管费	-	-	-	13,436.99	13,436.99
应付交易费用	-	-	-	60,530.09	60,530.09
其他负债	-	-	-	308,380.52	308,380.52
负债总计	-	-	-	1,535,896.32	1,535,896.32
利率敏感度缺口	10,137,270.66	-	-	64,385,433.82	74,522,704.48

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 2012 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 其他价格风险

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或银行间同业市场交易的股票和债券，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，采用“自上而下”的策略，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。本基金投资组合中投资于中证锐联基本面 400 指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，此外，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 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 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	62,679,700.36	84.11
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	62,679,700.36	84.11

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2012 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

7.4.14 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) 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。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2012 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 61,900,563.36 元，属于第二层级的余额为 779,137.00 元，无属于第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(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	62,679,700.36	82.41
	其中：股票	62,679,700.36	82.41
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	10,137,270.66	13.33
6	其他各项资产	3,241,629.78	4.26
7	合计	76,058,600.80	100.00

8.2 期末按行业分类的股票指数投资组合

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	462,351.00	0.62
B	采掘业	1,733,275.70	2.33
C	制造业	33,822,401.74	45.39
C0	食品、饮料	1,972,474.00	2.65
C1	纺织、服装、皮毛	1,160,089.00	1.56
C2	木材、家具	247,800.00	0.33
C3	造纸、印刷	1,243,755.00	1.67
C4	石油、化学、塑胶、塑料	6,516,681.00	8.74
C5	电子	1,579,758.34	2.12
C6	金属、非金属	6,443,226.20	8.65
C7	机械、设备、仪表	9,379,183.10	12.59
C8	医药、生物制品	4,560,140.92	6.12
C99	其他制造业	719,294.18	0.97
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,404,299.31	3.23
E	建筑业	1,661,102.00	2.23
F	交通运输、仓储业	2,110,161.90	2.83
G	信息技术业	2,233,717.00	3.00
H	批发和零售贸易	5,437,785.98	7.30
I	金融、保险业	1,325,977.00	1.78
J	房地产业	6,047,642.73	8.12
K	社会服务业	1,179,394.00	1.58
L	传播与文化产业	669,858.00	0.90
M	综合类	3,591,734.00	4.82
	合计	62,679,700.36	84.11

8.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资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	600881	亚泰集团	110,000	552,200.00	0.74
2	000012	南玻A	64,800	534,600.00	0.72
3	601377	兴业证券	38,200	469,096.00	0.63
4	600596	新安股份	60,300	452,250.00	0.61

5	000422	湖北宜化	39,800	442,178.00	0.59
6	600704	物产中大	59,100	431,430.00	0.58
7	000623	吉林敖东	25,300	430,100.00	0.58
8	600820	隧道股份	47,100	428,610.00	0.58
9	600210	紫江企业	116,292	408,184.92	0.55
10	000717	韶钢松山	176,300	405,490.00	0.54
11	600352	浙江龙盛	62,200	377,554.00	0.51
12	600655	豫园商城	52,500	376,950.00	0.51
13	600308	华泰股份	102,000	353,940.00	0.47
14	600535	天士力	6,400	353,728.00	0.47
15	600325	华发股份	41,200	350,200.00	0.47
16	000900	现代投资	38,700	339,012.00	0.45
17	600675	中华企业	62,900	332,741.00	0.45
18	600686	金龙汽车	48,800	330,376.00	0.44
19	600256	广汇能源	20,000	327,800.00	0.44
20	600497	驰宏锌锗	22,898	324,006.70	0.43
21	600143	金发科技	59,200	319,088.00	0.43
22	600271	航天信息	21,300	315,666.00	0.42
23	600111	包钢稀土	8,400	314,580.00	0.42
24	000538	云南白药	4,600	312,800.00	0.42
25	000680	山推股份	64,200	312,654.00	0.42
26	600062	华润双鹤	13,700	310,990.00	0.42
27	600428	中远航运	78,600	308,898.00	0.41
28	600138	中青旅	19,400	308,848.00	0.41
29	000768	中航飞机	37,100	308,672.00	0.41
30	000616	亿城股份	74,500	305,450.00	0.41
31	000926	福星股份	32,300	305,235.00	0.41
32	000423	东阿阿胶	7,472	301,943.52	0.41
33	600601	方正科技	127,300	301,701.00	0.40
34	600169	太原重工	82,800	300,564.00	0.40
35	600787	中储股份	38,700	299,151.00	0.40
36	002092	中泰化学	42,000	299,040.00	0.40
37	002001	新和成	15,400	289,520.00	0.39
38	000759	中百集团	43,200	284,256.00	0.38
39	600216	浙江医药	13,500	283,770.00	0.38
40	601588	北辰实业	92,900	283,345.00	0.38
41	600600	青岛啤酒	8,400	277,704.00	0.37
42	000581	威孚高科	8,700	277,530.00	0.37
43	600426	华鲁恒升	35,100	272,025.00	0.37

44	600859	王府井	11,300	270,748.00	0.36
45	600008	首创股份	61,500	268,755.00	0.36
46	600122	宏图高科	66,600	266,400.00	0.36
47	000877	天山股份	28,100	264,702.00	0.36
48	000830	鲁西化工	64,899	259,596.00	0.35
49	600533	栖霞建设	56,000	256,480.00	0.34
50	600835	上海机电	31,700	255,502.00	0.34
51	600713	南京医药	55,688	255,051.04	0.34
52	600369	西南证券	28,400	253,612.00	0.34
53	600720	祁连山	23,800	252,280.00	0.34
54	600331	宏达股份	37,400	250,206.00	0.34
55	600832	东方明珠	44,500	247,420.00	0.33
56	600067	冠城大通	37,200	244,032.00	0.33
57	600971	恒源煤电	18,800	242,144.00	0.32
58	000088	盐田港	59,778	242,100.90	0.32
59	600231	凌钢股份	50,600	240,350.00	0.32
60	601717	郑煤机	23,100	238,392.00	0.32
61	600266	北京城建	16,000	238,240.00	0.32
62	000612	焦作万方	21,900	237,177.00	0.32
63	600805	悦达投资	19,900	236,810.00	0.32
64	600963	岳阳林纸	57,300	234,357.00	0.31
65	000960	锡业股份	11,700	232,596.00	0.31
66	000400	许继电气	9,400	231,710.00	0.31
67	000726	鲁泰A	35,100	231,309.00	0.31
68	600895	张江高科	32,200	226,044.00	0.30
69	601877	正泰电器	12,300	225,951.00	0.30
70	000999	华润三九	9,500	225,150.00	0.30
71	000690	宝新能源	50,000	224,000.00	0.30
72	000807	云铝股份	42,200	222,394.00	0.30
73	002028	思源电气	15,900	221,805.00	0.30
74	600236	桂冠电力	55,400	220,492.00	0.30
75	600567	山鹰纸业	73,200	219,600.00	0.29
76	600315	上海家化	4,300	219,257.00	0.29
77	002422	科伦药业	3,900	218,478.00	0.29
78	002242	九阳股份	31,300	218,474.00	0.29
79	002008	大族激光	26,700	218,406.00	0.29
80	000572	海马汽车	73,900	218,005.00	0.29
81	600718	东软集团	27,900	214,551.00	0.29
82	600811	东方集团	39,500	214,485.00	0.29

83	000652	泰达股份	58,800	209,328.00	0.28
84	600064	南京高科	17,100	208,107.00	0.28
85	000559	万向钱潮	46,300	207,887.00	0.28
86	600246	万通地产	54,200	207,044.00	0.28
87	600761	安徽合力	23,100	206,514.00	0.28
88	601101	昊华能源	15,400	205,128.00	0.28
89	600085	同仁堂	11,500	204,930.00	0.27
90	000016	深康佳A	64,600	204,136.00	0.27
91	000839	中信国安	33,800	203,476.00	0.27
92	000550	江铃汽车	11,285	202,904.30	0.27
93	002048	宁波华翔	27,800	202,662.00	0.27
94	600208	新湖中宝	46,700	201,277.00	0.27
95	600322	天房发展	51,569	199,572.03	0.27
96	600635	大众公用	48,100	199,134.00	0.27
97	000028	国药一致	5,600	197,680.00	0.27
98	600595	中孚实业	39,800	196,612.00	0.26
99	000786	北新建材	11,200	195,888.00	0.26
100	600584	长电科技	46,200	195,888.00	0.26
101	600978	宜华木业	39,500	194,340.00	0.26
102	000758	中色股份	9,500	193,800.00	0.26
103	600522	中天科技	24,500	193,305.00	0.26
104	000009	中国宝安	21,900	192,720.00	0.26
105	600491	龙元建设	33,800	191,984.00	0.26
106	600270	外运发展	27,000	191,430.00	0.26
107	600415	小商品城	28,800	191,232.00	0.26
108	000963	华东医药	5,600	190,400.00	0.26
109	000731	四川美丰	26,200	189,950.00	0.25
110	600507	方大特钢	48,600	189,054.00	0.25
111	600653	申华控股	74,000	187,960.00	0.25
112	000698	沈阳化工	44,500	187,790.00	0.25
113	002146	荣盛发展	13,400	187,466.00	0.25
114	600550	天威保变	28,200	183,582.00	0.25
115	000829	天音控股	46,300	181,959.00	0.24
116	600517	置信电气	13,160	181,608.00	0.24
117	600961	株冶集团	17,900	181,506.00	0.24
118	000601	韶能股份	50,800	181,356.00	0.24
119	000822	山东海化	44,900	180,947.00	0.24
120	600037	歌华有线	27,000	180,900.00	0.24
121	600276	恒瑞医药	6,000	180,600.00	0.24

122	600804	鹏博士	30,000	178,800.00	0.24
123	600438	通威股份	26,700	178,623.00	0.24
124	600779	水井坊	9,200	178,204.00	0.24
125	600582	天地科技	15,700	178,195.00	0.24
126	600801	华新水泥	11,700	177,489.00	0.24
127	002304	洋河股份	1,900	177,403.00	0.24
128	600267	海正药业	11,900	177,191.00	0.24
129	600284	浦东建设	20,200	177,154.00	0.24
130	600628	新世界	26,200	176,850.00	0.24
131	600183	生益科技	41,954	176,626.34	0.24
132	000667	名流置业	78,200	175,950.00	0.24
133	000917	电广传媒	17,600	175,472.00	0.24
134	601718	际华集团	57,800	173,978.00	0.23
135	600729	重庆百货	6,700	171,453.00	0.23
136	600863	内蒙华电	22,800	171,000.00	0.23
137	600663	陆家嘴	14,298	170,146.20	0.23
138	600021	上海电力	36,400	168,896.00	0.23
139	600388	龙净环保	7,700	168,630.00	0.23
140	600160	巨化股份	18,200	168,168.00	0.23
141	600549	厦门钨业	4,300	167,614.00	0.22
142	000006	深振业 A	33,730	166,963.50	0.22
143	600117	西宁特钢	33,600	165,648.00	0.22
144	600469	风神股份	18,900	165,375.00	0.22
145	000541	佛山照明	24,900	165,087.00	0.22
146	600748	上实发展	19,300	165,015.00	0.22
147	000659	珠海中富	59,700	164,772.00	0.22
148	000860	顺鑫农业	12,300	164,205.00	0.22
149	600703	三安光电	12,000	164,160.00	0.22
150	600626	申达股份	47,800	163,954.00	0.22
151	600638	新黄浦	16,200	163,620.00	0.22
152	600611	大众交通	33,800	163,254.00	0.22
153	600742	一汽富维	9,200	162,840.00	0.22
154	000683	远兴能源	33,700	162,771.00	0.22
155	600966	博汇纸业	34,200	161,766.00	0.22
156	600120	浙江东方	18,800	160,740.00	0.22
157	002385	大北农	7,400	159,840.00	0.21
158	000708	大冶特钢	21,600	159,624.00	0.21
159	600744	华银电力	42,200	159,516.00	0.21
160	000701	厦门信达	20,100	158,388.00	0.21

161	601901	方正证券	35,700	157,437.00	0.21
162	600511	国药股份	10,800	157,356.00	0.21
163	002082	栋梁新材	22,800	156,864.00	0.21
164	000061	农产品	27,500	156,750.00	0.21
165	002155	辰州矿业	7,800	156,624.00	0.21
166	600125	铁龙物流	21,600	155,304.00	0.21
167	600141	兴发集团	8,600	155,144.00	0.21
168	002078	太阳纸业	29,900	154,882.00	0.21
169	600531	豫光金铅	9,000	154,170.00	0.21
170	000046	泛海建设	28,500	153,900.00	0.21
171	600674	川投能源	18,300	152,988.00	0.21
172	600685	广船国际	12,300	152,520.00	0.20
173	600121	郑州煤电	19,600	150,332.00	0.20
174	000417	合肥百货	21,500	150,285.00	0.20
175	600295	鄂尔多斯	16,900	150,241.00	0.20
176	000043	中航地产	20,400	150,144.00	0.20
177	002106	莱宝高科	9,800	150,038.00	0.20
178	600051	宁波联合	21,300	149,313.00	0.20
179	000903	云内动力	32,100	149,265.00	0.20
180	600498	烽火通信	6,500	147,940.00	0.20
181	002244	滨江集团	13,600	147,560.00	0.20
182	000961	中南建设	10,700	146,804.00	0.20
183	000589	黔轮胎A	30,700	146,746.00	0.20
184	002254	泰和新材	16,100	146,510.00	0.20
185	600588	用友软件	14,800	145,928.00	0.20
186	000718	苏宁环球	18,400	145,912.00	0.20
187	600809	山西汾酒	3,500	145,810.00	0.20
188	600812	华北制药	26,200	145,672.00	0.20
189	001696	宗申动力	25,100	145,580.00	0.20
190	600017	日照港	50,300	145,367.00	0.20
191	002083	孚日股份	35,900	144,318.00	0.19
192	600220	江苏阳光	51,100	143,591.00	0.19
193	000031	中粮地产	32,900	143,444.00	0.19
194	600456	宝钛股份	8,080	143,339.20	0.19
195	002022	科华生物	13,600	142,800.00	0.19
196	600858	银座股份	15,200	142,424.00	0.19
197	600879	航天电子	21,800	142,136.00	0.19
198	600496	精工钢构	17,700	142,131.00	0.19
199	002110	三钢闽光	28,200	141,282.00	0.19

200	000301	东方市场	45,700	141,213.00	0.19
201	002081	金螳螂	3,200	140,864.00	0.19
202	600823	世茂股份	12,000	140,400.00	0.19
203	000686	东北证券	8,400	140,280.00	0.19
204	000970	中科三环	4,300	140,137.00	0.19
205	600815	厦工股份	20,000	139,800.00	0.19
206	002556	辉隆股份	19,200	139,008.00	0.19
207	600893	航空动力	11,000	138,930.00	0.19
208	600408	安泰集团	34,900	138,902.00	0.19
209	000939	凯迪电力	20,700	138,276.00	0.19
210	600316	洪都航空	10,000	137,200.00	0.18
211	002122	天马股份	24,800	136,896.00	0.18
212	600736	苏州高新	29,000	136,880.00	0.18
213	600597	光明乳业	13,900	136,637.00	0.18
214	600303	曙光股份	31,100	136,218.00	0.18
215	600432	吉恩镍业	9,900	133,650.00	0.18
216	600176	中国玻纤	13,100	132,965.00	0.18
217	600449	宁夏建材	14,500	132,675.00	0.18
218	600409	三友化工	34,900	132,620.00	0.18
219	600516	方大炭素	14,900	132,312.00	0.18
220	000090	深天健	17,400	132,066.00	0.18
221	601118	海南橡胶	23,100	131,208.00	0.18
222	000973	佛塑科技	31,600	131,140.00	0.18
223	600797	浙大网新	30,300	130,896.00	0.18
224	000968	煤气化	10,600	130,804.00	0.18
225	601880	大连港	45,900	129,897.00	0.17
226	600481	双良节能	18,700	129,778.00	0.17
227	000685	中山公用	11,700	128,817.00	0.17
228	000912	泸天化	25,400	128,778.00	0.17
229	600366	宁波韵升	8,100	128,547.00	0.17
230	600509	天富热电	15,900	128,472.00	0.17
231	601107	四川成渝	38,200	127,588.00	0.17
232	600676	交运股份	30,800	127,512.00	0.17
233	600662	强生控股	32,000	126,720.00	0.17
234	000521	美菱电器	33,400	126,586.00	0.17
235	000599	青岛双星	35,800	125,658.00	0.17
236	000911	南宁糖业	15,300	124,695.00	0.17
237	600380	健康元	27,700	124,650.00	0.17
238	000501	鄂武商A	10,800	124,200.00	0.17

239	600765	中航重机	16,200	123,282.00	0.17
240	600510	黑牡丹	15,700	123,088.00	0.17
241	600725	云维股份	29,400	122,304.00	0.16
242	000780	平庄能源	12,700	121,666.00	0.16
243	002191	劲嘉股份	13,100	119,210.00	0.16
244	600578	京能热电	15,842	118,498.16	0.16
245	000969	安泰科技	11,200	118,272.00	0.16
246	601369	陕鼓动力	13,100	118,162.00	0.16
247	000987	广州友谊	10,100	117,968.00	0.16
248	601888	中国国旅	4,300	117,906.00	0.16
249	600586	金晶科技	34,400	117,648.00	0.16
250	600406	国电南瑞	7,300	117,019.00	0.16
251	600410	华胜天成	18,400	116,840.00	0.16
252	002152	广电运通	8,200	116,358.00	0.16
253	000789	江西水泥	9,400	116,090.00	0.16
254	600884	杉杉股份	11,300	116,051.00	0.16
255	600109	国金证券	6,500	115,960.00	0.16
256	000418	小天鹅A	12,290	115,771.80	0.16
257	000707	双环科技	22,200	115,440.00	0.15
258	600487	亨通光电	5,600	115,080.00	0.15
259	600641	万业企业	26,800	114,168.00	0.15
260	000666	经纬纺机	10,800	112,968.00	0.15
261	002415	海康威视	3,600	111,996.00	0.15
262	600416	湘电股份	21,900	111,690.00	0.15
263	600499	科达机电	12,600	110,376.00	0.15
264	601098	中南传媒	12,300	109,962.00	0.15
265	002003	伟星股份	11,400	109,668.00	0.15
266	002073	软控股份	14,500	109,620.00	0.15
267	601777	力帆股份	17,100	109,269.00	0.15
268	002233	塔牌集团	13,000	109,200.00	0.15
269	600785	新华百货	7,500	109,125.00	0.15
270	600639	浦东金桥	12,100	108,900.00	0.15
271	601933	永辉超市	4,300	108,403.00	0.15
272	000637	茂化实华	27,500	108,075.00	0.15
273	000655	金岭矿业	8,700	107,880.00	0.14
274	600327	大东方	23,400	107,406.00	0.14
275	600810	神马股份	19,500	106,470.00	0.14
276	000540	中天城投	15,300	106,182.00	0.14
277	000410	沈阳机床	17,100	105,849.00	0.14

278	002051	中工国际	3,600	105,840.00	0.14
279	002194	武汉凡谷	17,400	105,618.00	0.14
280	000543	皖能电力	13,791	105,501.15	0.14
281	601928	凤凰传媒	15,500	105,090.00	0.14
282	000626	如意集团	15,400	104,104.00	0.14
283	002277	友阿股份	11,400	103,056.00	0.14
284	600873	梅花集团	18,800	102,084.00	0.14
285	600998	九州通	9,200	101,476.00	0.14
286	002007	华兰生物	4,800	100,992.00	0.14
287	600403	大有能源	4,900	100,891.00	0.14
288	600075	新疆天业	14,900	99,830.00	0.13
289	600399	抚顺特钢	19,900	99,500.00	0.13
290	600052	浙江广厦	23,400	98,982.00	0.13
291	002237	恒邦股份	4,200	97,314.00	0.13
292	600612	老凤祥	4,500	96,975.00	0.13
293	600577	精达股份	20,400	95,472.00	0.13
294	002500	山西证券	13,000	95,290.00	0.13
295	601555	东吴证券	11,700	94,302.00	0.13
296	000850	华茂股份	18,400	93,656.00	0.13
297	002561	徐家汇	10,800	92,556.00	0.12
298	000703	恒逸石化	8,300	92,462.00	0.12
299	002011	盾安环境	10,100	92,314.00	0.12
300	000936	华西股份	22,900	92,287.00	0.12
301	600425	青松建化	9,300	91,977.00	0.12
302	000755	山西三维	17,500	90,825.00	0.12
303	600132	重庆啤酒	5,900	90,683.00	0.12
304	002386	天原集团	13,800	90,528.00	0.12
305	000042	深 长 城	4,500	90,450.00	0.12
306	600737	中粮屯河	17,100	89,604.00	0.12
307	600300	维维股份	13,000	89,570.00	0.12
308	000919	金陵药业	13,000	89,440.00	0.12
309	000823	超声电子	9,300	88,536.00	0.12
310	600575	芜湖港	12,400	88,164.00	0.12
311	002399	海普瑞	4,700	88,125.00	0.12
312	600981	汇鸿股份	22,600	87,914.00	0.12
313	601002	晋亿实业	8,500	87,465.00	0.12
314	600750	江中药业	4,400	86,768.00	0.12
315	600657	信达地产	20,500	86,715.00	0.12
316	600475	华光股份	8,600	86,516.00	0.12

317	600743	华远地产	21,800	86,328.00	0.12
318	002203	海亮股份	11,500	86,135.00	0.12
319	600195	中牧股份	6,820	86,068.40	0.12
320	002056	横店东磁	6,100	85,644.00	0.11
321	600332	广州药业	4,400	85,448.00	0.11
322	600888	新疆众和	9,000	84,870.00	0.11
323	002375	亚厦股份	3,200	84,736.00	0.11
324	000597	东北制药	13,500	84,510.00	0.11
325	002408	齐翔腾达	5,000	83,800.00	0.11
326	002069	獐子岛	5,300	83,634.00	0.11
327	002299	圣农发展	7,800	83,304.00	0.11
328	601000	唐山港	25,000	83,250.00	0.11
329	002440	闰土股份	6,700	83,080.00	0.11
330	600056	中国医药	4,100	82,779.00	0.11
331	000927	一汽夏利	16,600	82,668.00	0.11
332	600636	三爱富	6,200	82,026.00	0.11
333	601268	二重重装	15,900	80,454.00	0.11
334	002311	海大集团	4,700	80,370.00	0.11
335	002042	华孚色纺	19,500	79,755.00	0.11
336	600829	三精制药	8,800	79,288.00	0.11
337	600277	亿利能源	13,300	79,002.00	0.11
338	601678	滨化股份	7,900	78,763.00	0.11
339	601789	宁波建工	9,500	78,755.00	0.11
340	000989	九芝堂	6,900	78,660.00	0.11
341	000598	兴蓉投资	10,600	78,334.00	0.11
342	002470	金正大	5,400	78,138.00	0.10
343	002465	海格通信	2,700	77,895.00	0.10
344	002463	沪电股份	17,500	77,350.00	0.10
345	600258	首旅股份	6,700	76,045.00	0.10
346	600723	首商股份	10,200	75,990.00	0.10
347	601010	文峰股份	5,300	75,207.00	0.10
348	000525	红太阳	6,400	75,200.00	0.10
349	000918	嘉凯城	17,900	72,853.00	0.10
350	600776	东方通信	16,700	72,478.00	0.10
351	600874	创业环保	15,400	72,226.00	0.10
352	002060	粤水电	13,700	70,418.00	0.09
353	002444	巨星科技	7,100	70,077.00	0.09
354	002085	万丰奥威	8,400	69,216.00	0.09
355	600724	宁波富达	9,300	68,355.00	0.09

356	000415	渤海租赁	10,400	68,328.00	0.09
357	002419	天虹商场	6,100	67,954.00	0.09
358	002249	大洋电机	9,800	67,914.00	0.09
359	002269	美邦服饰	5,200	67,912.00	0.09
360	002563	森马服饰	3,100	67,704.00	0.09
361	600310	桂东电力	6,600	67,650.00	0.09
362	601886	江河幕墙	3,100	67,580.00	0.09
363	601216	内蒙君正	10,600	65,932.00	0.09
364	600292	九龙电力	5,200	65,416.00	0.09
365	000950	建峰化工	13,500	64,935.00	0.09
366	600375	华菱星马	7,300	64,605.00	0.09
367	002091	江苏国泰	7,500	63,525.00	0.09
368	002183	怡亚通	13,225	61,893.00	0.08
369	600825	新华传媒	12,700	61,849.00	0.08
370	002267	陕天然气	7,400	60,828.00	0.08
371	600298	安琪酵母	3,700	60,421.00	0.08
372	002416	爱施德	10,758	58,415.94	0.08
373	000656	金科股份	4,000	58,000.00	0.08
374	600673	东阳光铝	7,500	56,700.00	0.08
375	002430	杭氧股份	5,500	54,560.00	0.07
376	002489	浙江永强	6,000	53,460.00	0.07
377	600373	中文传媒	3,700	52,762.00	0.07
378	002342	巨力索具	7,600	52,288.00	0.07
379	002574	明牌珠宝	3,386	52,178.26	0.07
380	002344	海宁皮城	1,900	50,502.00	0.07
381	002075	沙钢股份	12,700	47,752.00	0.06
382	601677	明泰铝业	4,200	47,418.00	0.06
383	002204	大连重工	3,700	47,360.00	0.06
384	601801	皖新传媒	4,400	45,672.00	0.06
385	002570	贝因美	2,000	44,160.00	0.06
386	601139	深圳燃气	4,600	43,838.00	0.06
387	002498	汉缆股份	4,200	37,968.00	0.05
388	601566	九牧王	2,300	37,214.00	0.05
389	002461	珠江啤酒	4,200	36,666.00	0.05
390	300003	乐普医疗	3,600	32,940.00	0.04
391	002534	杭锅股份	2,400	32,928.00	0.04
392	002603	以岭药业	1,400	32,578.00	0.04
393	002478	常宝股份	3,000	30,960.00	0.04
394	600869	三普药业	3,500	27,545.00	0.04

395	600623	双钱股份	2,400	20,088.00	0.03
396	600518	康美药业	1,400	18,396.00	0.02

8.3.2 期末积极投资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

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600881	亚泰集团	560,662.00	0.75
2	000012	南 玻 A	520,241.00	0.70
3	600596	新安股份	459,476.00	0.62
4	000422	湖北宜化	439,143.00	0.59
5	601377	兴业证券	430,874.00	0.58
6	600210	紫江企业	429,224.72	0.58
7	600820	隧道股份	427,245.00	0.57
8	000717	韶钢松山	420,193.00	0.56
9	600704	物产中大	383,994.00	0.52
10	000623	吉林敖东	379,351.00	0.51
11	600352	浙江龙盛	378,217.00	0.51
12	600655	豫园商城	376,888.00	0.51
13	600308	华泰股份	361,818.00	0.49
14	000900	现代投资	358,245.00	0.48
15	600518	康美药业	351,183.00	0.47
16	600535	天士力	345,552.00	0.46
17	600256	广汇能源	344,038.00	0.46
18	600325	华发股份	336,958.00	0.45
19	600497	驰宏锌锗	329,876.86	0.44
20	600686	金龙汽车	318,384.00	0.43

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600518	康美药业	294,140.00	0.39
2	600881	亚泰集团	44,730.00	0.06
3	000012	南玻A	43,513.00	0.06
4	601377	兴业证券	36,673.00	0.05
5	600596	新安股份	36,651.00	0.05
6	000422	湖北宜化	35,970.00	0.05
7	000623	吉林敖东	34,518.00	0.05
8	600820	隧道股份	34,428.00	0.05
9	600704	物产中大	33,841.00	0.05
10	600210	紫江企业	33,312.00	0.04
11	000717	韶钢松山	32,770.00	0.04
12	600352	浙江龙盛	30,855.00	0.04
13	600655	豫园商城	30,573.00	0.04
14	002051	中工国际	28,750.00	0.04
15	600308	华泰股份	28,728.00	0.04
16	600325	华发股份	28,245.00	0.04
17	600256	广汇能源	27,479.64	0.04
18	000900	现代投资	27,456.00	0.04
19	600535	天士力	27,050.00	0.04
20	600686	金龙汽车	26,800.00	0.04

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	62,085,214.78
卖出股票收入（成交）总额	5,158,334.65

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

本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

本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**

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。

8.9.2

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股票库之外的股票。

8.9.3 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	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,581.97
5	应收申购款	2,988,047.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,241,629.78

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**8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

8.9.6 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

份额级别	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
泰信基本面 400A	43	142,434.53	5,508,530.00	89.94%	616,155.00	10.06%
泰信基本面 400B	41	149,382.56	4,866,130.00	79.45%	1,258,555.00	20.55%
泰信基本面 400	174	324,860.04	40,001,153.00	70.77%	16,524,493.14	29.23%
合计	258	266,569.83	50,375,813.00	73.25%	18,399,203.14	26.75%

9.2 期末基金前十名持有人 (A 级)

序列	名称	份额	占上市总份额比例 (%)
1	山东省国际信托有限公司	4,570,000.00	74.62
2	中信证券股份有限公司	938,530.00	15.32
3	魏群	172,901.00	2.82
4	于振芬	89,640.00	1.46
5	梁淑华	66,900.00	1.09
6	嵇黎婴	54,001.00	0.88
7	李萍	25,001.00	0.41
8	张利	25,001.00	0.41
9	郝斌	25,001.00	0.41
10	刘伟光	25,000.00	0.41

期末基金前十名持有人 (B 级)

序列	名称	份额	占上市总份额比例 (%)
----	----	----	--------------

1	山东省国际信托有限公司	3,900,000.00	63.68
2	中信证券股份有限公司	966,130.00	15.77
3	毛志娣	166,000.00	2.71
4	梁小红	150,000.00	2.45
5	于振芬	148,540.00	2.43
6	金延	141,600.00	2.31
7	张振芳	111,303.00	1.82
8	梁淑华	105,256.00	1.72
9	郑志坤	100,054.00	1.63
10	郑凯鹏	42,900.00	0.70

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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基金	泰信基本面 400A	-	-
	泰信基本面 400B	-	-
	泰信基本面 400	148,582.35	0.2629%
	合计	148,582.35	0.2160%

注：1、本公司高级管理人员、投资部、研究部负责人持有该基金份额总量的数量区间：0-10 万份（含）

2、本基金基金经理持有该基金份额总量的数量区间：0-10 万份（含）

3、对于泰信基本面 400A、泰信基本面 400B、泰信基本面 400 份额，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用期末基金份额总额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
基金合同生效日(2012 年 9 月 7 日)	-	-	300,843,720.90
基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	-	-	-
本报告期基金总申购份额	-	-	4,717,621.03
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	236,786,325.79

本报告期基金拆分变动份额	6,124,685.00	6,124,685.00	-12,249,370.00
本报告期期末基金份额总额	6,124,685.00	6,124,685.00	56,525,646.14

注：拆分变动份额含本基金三基金份额之间的配对转换份额和基金份额折算后的调整份额。

§ 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、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

2、经泰信基金管理有限公司第四届董事会 2012 年第一次会议审议通过，公司副总经理桑维英女士代任公司总经理职务，高清海先生不再担任公司总经理职务。具体详情参见 2012 年 9 月 22 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》上的《泰信基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

3、经泰信基金管理有限公司第四届董事会 2012 年第一次会议审议通过，聘任葛航先生担任公司总经理职务。根据证监会《关于核准泰信基金管理有限公司葛航基金行业高级管理人员任职资格的批复》（证监许可[2012]1745 号），核准葛航先生担任公司总经理职务。具体详情参见 2012 年 12 月 29 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》上的《泰信基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本公司上述人事变动已按相关规定备案并公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

我公司诉华远星海运有限公司房屋租赁合同纠纷一案经浦东新区法院 2011 年 11 月 28 日受理后，于 2012 年 1 月 4 日首次公开开庭进行了审理。法院依法追加了上海宏普实业投资有限公司作为第三人参加诉讼，并组成合议庭于 2012 年 6 月 19 日第二次公开开庭进行了审理，本案现已审理终结。法院支持我公司全部诉求，判决华远星海运有限公司向我公司支付剩余租金及其违约金。

本公司认为，上述案件不会对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响。

除此以外，无其他涉及基金管理人、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 5 万元。该审计机构从基金合同生效日（2012 年 9 月 7 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

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

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	
华创证券	2	40,241,402.65	59.84%	36,635.83	60.52%	-
中国银河证券	1	27,002,146.78	40.16%	23,894.26	39.48%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位有关问题的通知》（证监基金字【2007】48 号）中关于“一家基金公司通过一家证券经营机构买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金 30%”的要求，本基金管理人在选择租用交易单元时，注重所选证券公司的综合实力、市场声誉。对证券公司的研究能力，由公司研究人员对其提供的研究报告、研究成果的质量进行定期评估。公司将根据内部评估报告，对交易单元租用情况进行总体评价，决定是否对交易单元租用情况进行调整。

2、本基金与公司旗下在中国工商银行托管的泰信优势增长、泰信发展主题基金共用交易单元。

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
华创证券	-	-	447,000,000.00	9.47%	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	4,275,500,000.00	90.53%	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	基金合同生效公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2012年9月8日
2	上市交易公告书	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2012年9月18日
3	开放申购、赎回业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2012年9月18日
4	开通跨系统转托管及份额配对转换业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2012年9月18日
5	高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2012年9月22日

6	新增量销售为代销机构并开通费率优惠、定投	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2012 年 10 月 24 日
7	新增恒泰长财、西藏同信、长江证券、江海证券为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2012 年 10 月 24 日
8	公司网上直销开通定投业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2012 年 10 月 24 日
9	新增众禄销售为代销机构并开通定投、费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2012 年 10 月 27 日
10	新增诺亚正行为代销机构并开通定投业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2012 年 12 月 12 日
11	提醒投资者更新已过期身份证件	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2012 年 12 月 12 日
12	调整基金转换补差费用计算方法	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2012 年 12 月 15 日
13	定期份额折算业务提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2012 年 12 月 25 日
14	定期折算业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2012 年 12 月 27 日
15	泰信 400A 折算后次日前收盘价调整的风险提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2012 年 12 月 27 日
16	中信建投证券开通定投转换及费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2012 年 12 月 29 日
17	基金行业高级管理人员变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2012 年 12 月 29 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中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金设立的文件

- 2、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级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、基金托管人的办公场所，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
2013 年 3 月 29 日