

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 摘要

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

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ftfund.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 37 层

§ 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

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

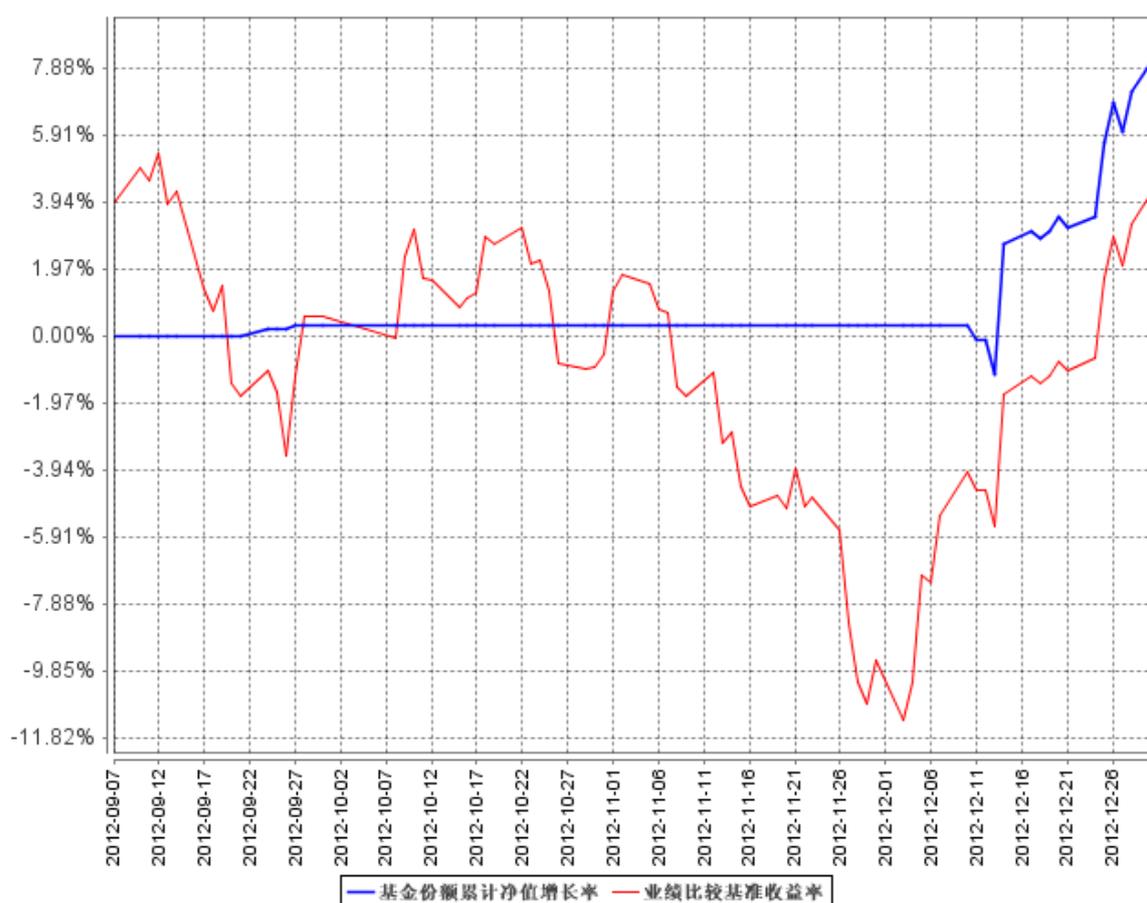
过去三个月	8.08%	0.64%	3.98%	1.34%	4.10%	-0.70%
自基金合同 生效日起至 今	8.40%	0.57%	4.58%	1.43%	3.82%	-0.86%

注：本基金业绩比较基准为： $95\% \times$ 中证锐联基本面 400 指数收益率 $+ 5\% \times$ 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

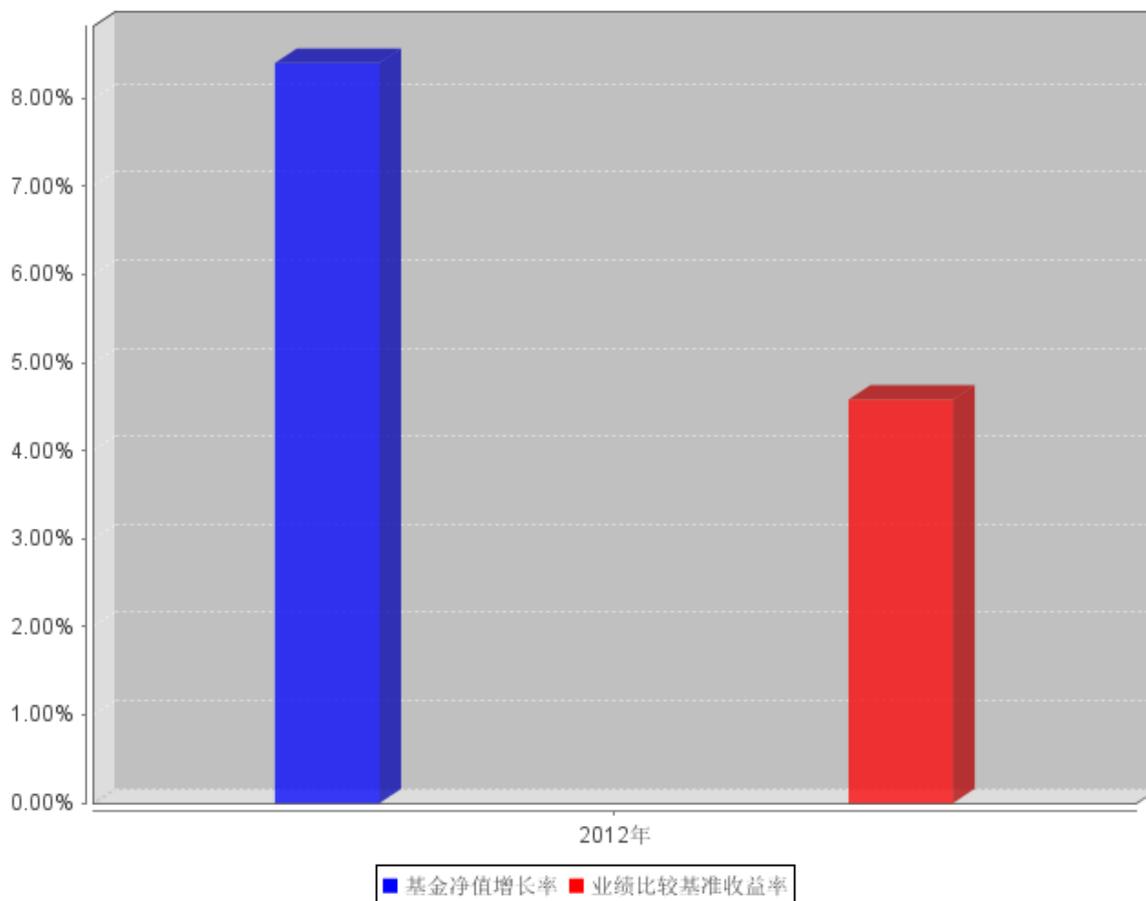


注：1、本基金基金合同于 2012 年 9 月 7 日正式生效。截至报告期末不足半年，还处在建仓期。

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。

4.7 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托管人——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	本期末 2012 年 12 月 31 日
资产：	
银行存款	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	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	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	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	-
资产总计	76,058,600.80
负债和所有者权益	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	-
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	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	308,380.52
负债合计	1,535,896.32
所有者权益:	
实收基金	68,775,016.14
未分配利润	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	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	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	275,033.30
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	11,313.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	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）	296,642.16
二、费用	906,759.40
1. 管理人报酬	379,328.16
2. 托管费	83,452.18
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	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	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（本期净利润）	-	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：

<u>葛航</u>	<u>韩波</u>	<u>庞少华</u>
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰信中证锐联基本面 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。本基金为契约开放型,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

7.4.5 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 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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本期末及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

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。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	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。

7.4.8.2.2 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。

7.4.8.2.3 销售服务费

本报告期及上年度本基金未发生销售服务费用。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期末及上年度可比期间本基金未发生与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期末及上年度可比期间本基金未在承销期内持有关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2012 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量(股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
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	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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前十名股票投资明细

8.3.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	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	湖北宣化	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

8.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	湖北宣化	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前十名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	泰信基本面 400A	-	-

员持有本基金	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份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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-------	------	-----------	----

	量	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	-	-	-	-	-	-

泰信基金管理有限公司
2013 年 3 月 29 日