

泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券 投资基金 2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 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：2014 年 8 月 26 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。本半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 2014 年 8 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§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合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 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	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.3 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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	49
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	49
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50

§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	53
§9 开放式基金份额变动	53
§10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
10.2 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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	56
§11 备查文件目录	57
11.1 备查文件目录.....	57
11.2 存放地点.....	58
11.3 查阅方式.....	58

§ 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		
场内简称	泰信 400		
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	31,622,896.87 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
场内简称	泰信 400A	泰信 400B	泰信 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	4,851,731.00 份	4,851,731.00 份	21,919,434.87 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	胡囡	赵会军
	联系电话	021-20899098	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》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ftfund.com
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	555,146.90
本期利润	-873,691.44
加权平均基金份额本期利润	-0.0274
本期加权平均净值利润率	-2.56%
本期基金份额净值增长率	-5.41%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	3,321,072.36
期末可供分配基金份额利润	0.1050
期末基金资产净值	33,724,407.07
期末基金份额净值	1.066
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	6.60%

注：1、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。

2、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、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

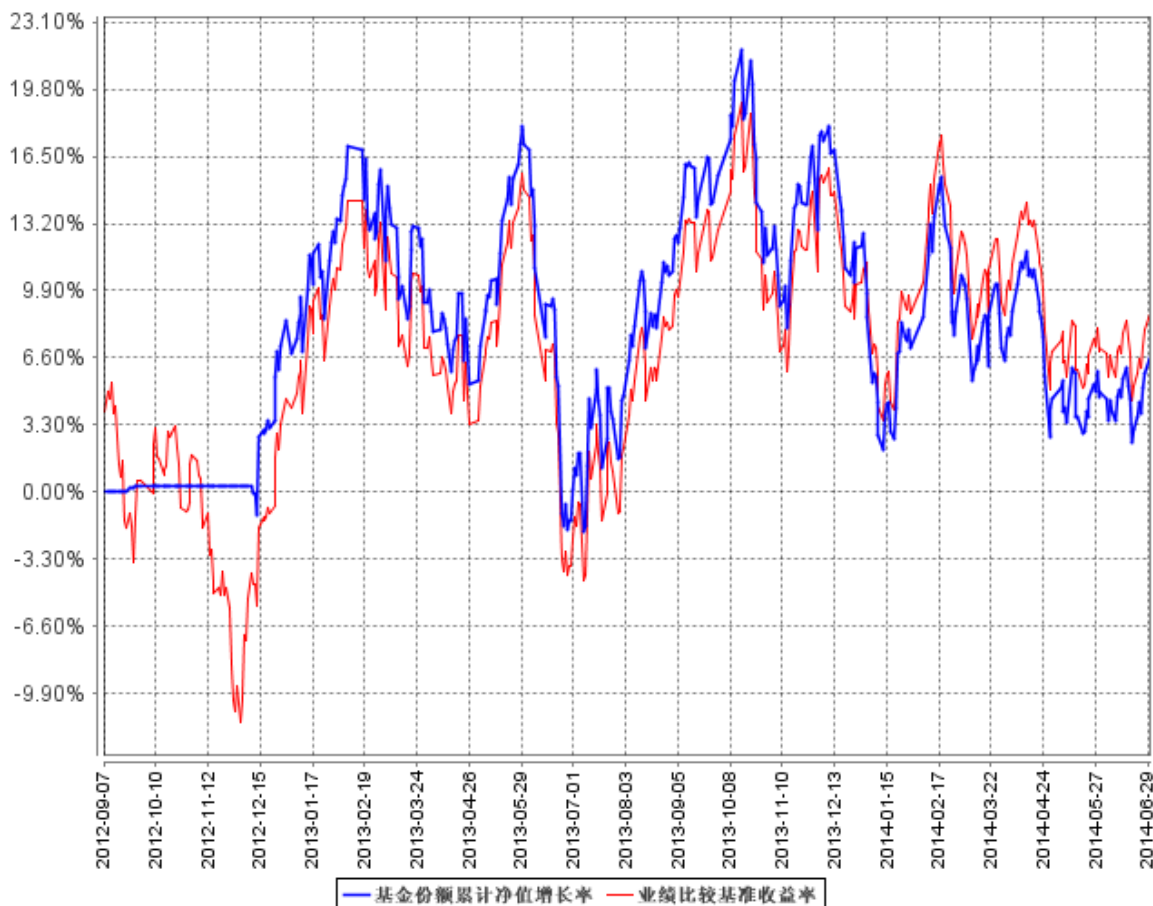
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.62%	0.87%	1.61%	0.88%	0.01%	-0.01%
过去三个月	0.09%	0.97%	0.12%	0.97%	-0.03%	0.00%
过去六个月	-5.41%	1.18%	-1.87%	1.16%	-3.54%	0.02%
过去一年	8.11%	1.25%	12.93%	1.24%	-4.82%	0.01%
自基金合同生效日起至 今	6.60%	1.20%	8.82%	1.31%	-2.22%	-0.11%

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，挑选基本面价值中间的第 201 家至第 600 家上市公司作为样本股，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。

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%。

§ 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：庄严

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。

公司目前下设锐懿资产管理有限公司、市场部、营销部（分华东、华北、华南三大营销中心）、理财顾问部、深圳分公司、北京分公司、电子商务部、客服中心、基金投资部、研究部、专户投资部、清算会计部、集中交易部、计划财务部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部。截至 2014 年 6 月，公司有正式员工 103 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 2014 年 6 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、泰信现代服务业股票基金、泰信鑫益定期开放债券共 15 只开放式基金及泰信恒益高息债分级、泰信乐利分级 1 号、泰信乐利 2 号、泰信乐利 3 号、泰信量化对冲分级 1 号、泰信财富分级 6 号、泰信财富分级 7 号共 7 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		
冯张鹏先生	本基金基金经理兼泰信中证	2013 年 7 月 5 日	-	6 年	工科博士。具备基金从业资格。曾在英国德意志银行担任分析师。2010 年 9 月加入泰信基金管

	200 指数基金经理			理有限公司担任风险管理部高级风险分析师，同时兼任研究部策略研究小组高级量化分析师。曾担任泰信中证 200 指数基金经理助理，泰信中证锐联基本面 400 指数分级基金经理助理职务。自 2013 年 7 月 5 日起同时担任泰信中证 200 指数基金经理。
--	------------	--	--	--

注：1、以上日期均是指公司公告的日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易，未出现成交较少

的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况，亦无其他异常交易行为。

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

中证基本面 400 指数在 2014 年上半年波动较大，中证基本面 400 指数最高点为 4273.73，最低点为 3707.2，上半年下跌 2.02%。上证综指上半年下跌 3.2%，沪深 300 指数上半年下跌 7.08%。泰信基本面 400 指数基金同期最高价为 1.155 元，最低价为 1.021 元。

报告期内，我们严格遵守基金合同，以严格控制基金相对目标指数（基本面 400 指数）的跟踪偏离为投资目标，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差，追求跟踪误差的最小化，报告期内年化跟踪误差控制在 0.67%。

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 1.066 元，净值增长率为-5.41%，业绩比较基准增长率为-1.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2014 年下半年，中国宏观经济企稳态势将进一步确认，7 月统计局和汇丰 PMI 数据均创出新高，稳增长措施的积极传导，中央反腐和改革的决心将有效支撑中国经济持续和健康的成长。外需将继续改善，大型企业出口的增加值得关注。企业补库存的倾向和动能将可持续一段时间。在包括沪港通等一系列正面因素的刺激下，国内 A 股市场在下半年的表现整体值得期待，同时指数的波动和风险也需要加以关注。

作为指数分级型基金产品，我们将坚持指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数（基本面 400 指数）的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，使得投资者可以清晰地把握分级子基金的交易情况，把握住投资时机。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、泰信基金管理有限公司估值程序等事项的说明

委员会主席

韩波先生，本科学历。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。

蔡海成先生，硕士。2013 年加入泰信基金管理有限公司，现任公司清算会计部总监。

朱志权先生，学士。2008 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，现任基金投资部总监兼投资总监，泰信先行策略、泰信优势增长基金基金经理。

梁剑先生，硕士。2004 年 7 月加入泰信基金管理有限公司，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

本报告期内，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

本报告期内，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金的管理人——泰信基金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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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 2014 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,392,769.34	2,275,804.22
结算备付金		6.62	190.10
存出保证金		2,528.08	1,566.30
交易性金融资产	6.4.7.2	31,601,751.20	33,910,646.53
其中：股票投资		31,601,751.20	33,910,646.53
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	445.93	466.37
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	30,247.17	-
资产总计		34,027,748.34	36,188,673.52
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		54,339.57	23,759.01
应付管理人报酬		27,246.61	31,425.84
应付托管费		5,994.27	6,913.68

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	15,262.73	5,829.91
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	200,498.09	393,426.90
负债合计		303,341.27	461,355.34
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	30,403,334.71	31,381,202.38
未分配利润	6.4.7.10	3,321,072.36	4,346,115.80
所有者权益合计		33,724,407.07	35,727,318.18
负债和所有者权益总计		34,027,748.34	36,188,673.52

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 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 1.066 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 1.032 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 1.100 元；基金份额总额 31,622,896.87 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 21,919,434.87 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 4,851,731.00 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 4,851,731.00 份。

6.2 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		-394,216.74	-1,010,798.21
1.利息收入		8,313.65	14,206.43
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,313.65	14,206.43
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,024,421.76	6,030,438.61
其中：股票投资收益	6.4.7.12	745,219.00	5,698,378.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	279,202.76	332,060.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,428,838.34	-7,144,412.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,886.19	88,968.78
减：二、费用		479,474.70	658,777.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	169,260.13	215,419.91
2. 托管费	6.4.10.2.2	37,237.25	47,392.41
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	29,958.04	148,753.46
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	243,019.28	247,212.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-873,691.44	-1,669,576.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-873,691.44	-1,669,576.12

6.3 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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）	31,381,202.38	4,346,115.80	35,727,318.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-873,691.44	-873,691.44
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）	-977,867.67	-151,352.00	-1,129,219.67
其中：1.基金申购款	415,597.52	42,228.98	457,826.50

2. 基金赎回款	-1,393,465.19	-193,580.98	-1,587,046.17
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）	30,403,334.71	3,321,072.36	33,724,407.07
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 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）	68,775,016.14	5,747,688.34	74,522,704.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,669,576.12	-1,669,576.12
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）	-35,359,510.20	-4,224,018.78	-39,583,528.98
其中：1.基金申购款	28,336,034.21	3,254,993.50	31,591,027.71
2.基金赎回款	-63,695,544.41	-7,479,012.28	-71,174,556.69
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）	33,415,505.94	-145,906.56	33,269,599.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

葛航
基金管理人负责人

韩波
主管会计工作负责人

蔡海成
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 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”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股权的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 自2013年1月1日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
活期存款	2,392,769.34
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,392,769.34

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	30,475,319.14	31,601,751.20	1,126,432.06
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
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	30,475,319.14	31,601,751.20	1,126,432.06

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末本基金未持有返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有买断式逆回购中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	444.94
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.99
合计	445.93

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	30,247.17
合计	30,247.17

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	15,262.73
银行间市场应付交易费用	-
合计	15,262.73

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	102.15
预提费用	192,866.02
应付指数使用费	7,529.92
合计	200,498.09

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	31,702,039.71	31,381,202.38
本期申购	0.00	0.00
本期赎回(以“-”号填列)	0.00	0.00
2014 年 1 月 2 日 基金拆分/份额 折算前	31,702,039.71	31,381,202.38
基金拆分/份额折算变动份额	938,145.03	-
本期申购	432,183.19	415,597.52
本期赎回(以“-”号填列)	-1,449,471.06	-1,393,465.19
本期末	31,622,896.87	30,403,334.71

注：(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规定，本基金以 2014 年 1 月 2 日为份额折算基准日，对泰信基本面 400 的场外份额、场内份额以及泰信基本面 400A 份额实施定期份额折算。

(2) 根据《基金合同》规定，投资者可申购、赎回泰信基本面 400 份额，泰信基本面 400A 和泰信基本面 400B 份额只可深圳交易所上市交易，因此上表不再单独披露泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的情况。

6.4.7.10 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
上年度末	5,044,005.32	-697,889.52	4,346,115.80
本期利润	555,146.90	-1,428,838.34	-873,691.44
本期基金份额交易产生的变动数	-157,493.82	6,141.82	-151,352.00
其中：基金申购款	65,650.63	-23,421.65	42,228.98
基金赎回款	-223,144.45	29,563.47	-193,580.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,441,658.40	-2,120,586.04	3,321,072.36

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,259.92
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	29.71
其他	24.02
合计	8,313.65

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	10,342,867.50
减：卖出股票成本总额	9,597,648.50
买卖股票差价收入	745,219.00

6.4.7.13 债券投资收益

本报告期末本基金未投资债券。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本期末本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

截至报告期末本基金未投资贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期末本基金无衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	279,202.76
基金投资产生的股利收益	-
合计	279,202.76

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,428,838.34
——股票投资	-1,428,838.34
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-1,428,838.34

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,886.19
合计	1,886.19

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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	29,958.04
银行间市场交易费用	-
合计	29,958.04

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	158,686.32
债券帐户维护费——上清所	400.00
债券帐户维护费——中债登	8,926.92
指数使用费	15,233.43
上市年费	29,752.83
银行划款手续费	267.00
合计	243,019.28

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本报告期无需要说明资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金新增上海锐懿资产管理有限公司为关联方。

6.4.9.2 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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
山东省国际信托有限公司（“山东国托”）	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信实业有限公司	基金管理人的股东
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

本报告期本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

本报告期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

本报告期本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

权证交易

本报告期本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

应支付关联方的佣金

本报告期本基金无应支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	169,260.13	215,419.91
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	37,237.25	47,392.41

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

本报告期及上年度可比期间本基金未发生销售服务费用。

6.4.10.3 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与关联方未发生银行间同业市场债券（含回购）的交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
山东省国际信 托有限公司	4,657,509.00	96.0000%	4,790,700.00	92.7200%

份额单位：份

泰信基本面 400B				
关联方名称	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
山东省国际信 托有限公司	4,658,558.00	96.0200%	4,721,850.00	91.3900%

份额单位：份

泰信基本面 400				
关联方名称	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
山东省国际信 托有限公司	18,223,743.90	83.1400%	17,424,566.56	81.5400%

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。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。

6.4.10.5 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	2,392,769.34	8,259.92	2,097,496.60	8,959.24

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。

6.4.10.6 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在承销期内未参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 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。

6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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
600832	东方明珠	2014 年 5 月 29 日	重大事项公布	10.98	-	-	20,347	118,213.34	223,410.06	-
600210	紫江企业	2014 年 6 月 26 日	重大事项公布	2.96	2014 年 7 月 3 日	3.18	62,900	189,582.00	186,184.00	-

600507	方大特钢	2014年6月30日	重大事项公布	3.16	2014年7月2日	3.03	34,091	128,221.11	107,727.56	-
002570	贝因美	2014年6月19日	重大事项公布	14.36	-	-	7,132	81,654.05	102,415.52	-
600582	天地科技	2014年6月26日	重大事项公布	7.97	-	-	12,754	106,212.95	101,649.38	-
600516	方大炭素	2014年6月30日	重大事项公布	9.59	2014年7月2日	9.05	10,597	81,060.38	101,625.23	-
000009	中国宝安	2014年5月28日	重大事项公布	10.21	-	-	9,259	70,910.07	94,534.39	-
000683	远兴能源	2014年6月25日	重大事项公布	3.56	2014年7月2日	3.99	24,938	113,677.59	88,779.28	-
600685	广船国际	2014年4月8日	重大事项公布	17.13	-	-	5,165	64,464.99	88,476.45	-
600498	烽火通信	2014年6月30日	重大事项公布	11.91	2014年7月7日	12.10	7,233	81,232.25	86,145.03	-
000612	焦作万方	2014年4月3日	重大事项公布	6.08	-	-	12,256	69,527.63	74,516.48	-
000960	锡业股份	2014年5月6日	重大事项公布	12.44	2014年8月5日	13.68	5,644	106,077.64	70,211.36	-
000807	云铝股份	2014年5月5日	重大事项公布	3.25	2014年7月28日	3.58	21,450	104,681.42	69,712.50	-
600295	鄂尔多斯	2014年5月6日	重大事项公布	7.38	-	-	9,264	74,886.93	68,368.32	-
601777	力帆股份	2014年6月28日	重大事项公布	6.39	2014年7月8日	6.70	8,600	58,224.00	54,954.00	-
000536	华映科技	2014年5月23日	重大事项公布	23.10	-	-	1,221	25,407.09	28,205.10	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.3 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，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同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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,392,769.34	-	-	-	2,392,769.34
结算备付金	6.62	-	-	-	6.62
存出保证金	2,528.08	-	-	-	2,528.08
交易性金融资产	-	-	-	31,601,751.20	31,601,751.20
应收利息	-	-	-	445.93	445.93
其他资产	-	-	-	30,247.17	30,247.17
资产总计	2,395,304.04	-	-	31,632,444.30	34,027,748.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	54,339.57	54,339.57
应付管理人报酬	-	-	-	27,246.61	27,246.61
应付托管费	-	-	-	5,994.27	5,994.27
应付交易费用	-	-	-	15,262.73	15,262.73
其他负债	-	-	-	200,498.09	200,498.09
负债总计	-	-	-	303,341.27	303,341.27
利率敏感度缺口	2,395,304.04	-	-	31,329,103.03	33,724,407.07
上年度末 2013 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	2,275,804.22	-	-	-	2,275,804.22
结算备付金	190.10	-	-	-	190.10
存出保证金	1,566.30	-	-	-	1,566.30
交易性金融资产	-	-	-	33,910,646.53	33,910,646.53
应收利息	-	-	-	466.37	466.37
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,277,560.62	-	-	33,911,112.90	36,188,673.52

负债					
应付赎回款	-	-	-	23,759.01	23,759.01
应付管理人报酬	-	-	-	31,425.84	31,425.84
应付托管费	-	-	-	6,913.68	6,913.68
应付交易费用	-	-	-	5,829.91	5,829.91
其他负债	-	-	-	393,426.90	393,426.90
负债总计	-	-	-	461,355.34	461,355.34
利率敏感度缺口	2,277,560.62	-	-	33,449,757.56	35,727,318.18

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2013 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2013 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	31,601,751.20	93.71	33,910,646.53	94.92
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	31,601,751.20	93.71	33,910,646.53	94.92

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除基金比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	基金比较基准上升 5%	1,670,233.72	1,670,000.00
	基金比较基准下降 5%	-1,670,233.72	-1,670,000.00

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无其他需要说明有助于理解和分析会计报表事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	31,601,751.20	92.87
	其中：股票	31,601,751.20	92.87
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,392,775.96	7.03
7	其他各项资产	33,221.18	0.10
8	合计	34,027,748.34	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	187,910.56	0.56
B	采矿业	1,078,304.51	3.20
C	制造业	17,555,309.04	52.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,179,154.06	3.50
E	建筑业	777,788.07	2.31
F	批发和零售业	3,561,121.58	10.56
G	交通运输、仓储和邮政业	1,304,934.46	3.87
H	住宿和餐饮业	50,871.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	885,677.23	2.63
J	金融业	865,362.70	2.57
K	房地产业	2,450,696.34	7.27
L	租赁和商务服务业	665,402.92	1.97
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	278,250.06	0.83
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	437,863.67	1.30

S	综合	323,105.00	0.96
	合计	31,601,751.20	93.71

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

截至报告期末本基金未持有积极投资股票。

7.3 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

7.3.1 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	77,358	284,677.44	0.84
2	600739	辽宁成大	18,351	279,485.73	0.83
3	000012	南玻A	34,093	232,855.19	0.69
4	000060	中金岭南	33,703	229,180.40	0.68
5	000488	晨鸣纸业	51,938	226,449.68	0.67
6	600832	东方明珠	20,347	223,410.06	0.66
7	600352	浙江龙盛	12,860	207,689.00	0.62
8	600518	康美药业	13,792	206,190.40	0.61
9	600216	浙江医药	21,392	195,736.80	0.58
10	600655	豫园商城	25,935	190,881.60	0.57
11	600210	紫江企业	62,900	186,184.00	0.55
12	000623	吉林敖东	11,921	185,013.92	0.55
13	000423	东阿阿胶	5,383	179,361.56	0.53
14	600497	驰宏锌锗	19,211	176,933.31	0.52
15	601901	方正证券	31,100	168,873.00	0.50
16	601377	兴业证券	19,496	168,055.52	0.50
17	002092	中泰化学	26,024	160,828.32	0.48
18	000581	威孚高科	5,909	159,365.73	0.47
19	600686	金龙汽车	17,552	157,090.40	0.47
20	000768	中航飞机	14,580	153,527.40	0.46
21	601717	郑煤机	31,531	153,240.66	0.45
22	000877	天山股份	24,998	152,737.78	0.45
23	000759	中百集团	18,795	152,239.50	0.45
24	000559	万向钱潮	14,724	151,362.72	0.45

25	000680	山推股份	52,761	150,368.85	0.45
26	000926	福星股份	22,890	149,242.80	0.44
27	600675	中华企业	30,604	148,429.40	0.44
28	601933	永辉超市	23,338	147,496.16	0.44
29	600320	振华重工	45,700	145,783.00	0.43
30	600581	八一钢铁	39,670	144,398.80	0.43
31	600122	宏图高科	28,877	143,807.46	0.43
32	000690	宝新能源	35,183	143,546.64	0.43
33	600325	XD 华发股	23,041	143,084.61	0.42
34	600600	青岛啤酒	3,563	142,733.78	0.42
35	600859	王府井	8,853	139,877.40	0.41
36	600315	上海家化	3,795	139,086.75	0.41
37	000963	华东医药	2,556	138,024.00	0.41
38	002001	新 和 成	11,111	137,665.29	0.41
39	000830	鲁西化工	38,895	136,910.40	0.41
40	000829	天音控股	16,169	136,789.74	0.41
41	600183	生益科技	21,489	132,372.24	0.39
42	600787	中储股份	10,087	131,837.09	0.39
43	600873	梅花生物	25,564	131,143.32	0.39
44	600426	华鲁恒升	18,114	130,420.80	0.39
45	600157	永泰能源	54,926	130,174.62	0.39
46	600971	恒源煤电	23,710	126,611.40	0.38
47	000900	现代投资	27,429	126,447.69	0.37
48	600596	新安股份	13,727	125,602.05	0.37
49	002081	金 螳 螂	8,858	125,429.28	0.37
50	600256	广汇能源	17,611	123,629.22	0.37
51	600067	冠城大通	24,659	123,541.59	0.37
52	600805	XD 悦达投	13,423	123,357.37	0.37
53	600811	东方集团	23,696	122,982.24	0.36
54	600160	巨化股份	24,981	120,908.04	0.36
55	601866	中海集运	57,100	120,481.00	0.36
56	600062	华润双鹤	6,915	118,868.85	0.35
57	600535	天士力	3,041	117,899.57	0.35
58	600718	东软集团	8,660	116,823.40	0.35
59	000726	鲁 泰 A	13,285	116,775.15	0.35
60	600729	重庆百货	5,970	116,653.80	0.35
61	600008	首创股份	18,825	116,338.50	0.34
62	601106	中国一重	60,500	116,160.00	0.34
63	000731	四川美丰	17,699	115,928.45	0.34

64	600742	一汽富维	5,586	115,462.62	0.34
65	002422	科伦药业	2,884	114,927.40	0.34
66	600415	小商品城	22,783	114,598.49	0.34
67	600549	厦门钨业	4,506	114,452.40	0.34
68	002008	大族激光	6,537	113,351.58	0.34
69	600138	中青旅	5,201	113,277.78	0.34
70	002048	宁波华翔	7,489	111,586.10	0.33
71	600601	方正科技	34,961	111,525.59	0.33
72	601101	昊华能源	19,760	111,248.80	0.33
73	600713	南京医药	19,626	110,886.90	0.33
74	600006	东风汽车	37,191	110,829.18	0.33
75	600522	中天科技	8,456	110,689.04	0.33
76	600141	兴发集团	11,229	110,156.49	0.33
77	600169	太原重工	38,763	110,086.92	0.33
78	000616	亿城投资	34,544	109,849.92	0.33
79	600406	国电南瑞	8,174	108,959.42	0.32
80	600085	同仁堂	6,248	108,902.64	0.32
81	000951	中国重汽	9,200	108,284.00	0.32
82	600507	方大特钢	34,091	107,727.56	0.32
83	600017	日照港	41,336	107,060.24	0.32
84	600369	西南证券	12,500	106,875.00	0.32
85	000758	中色股份	10,719	106,546.86	0.32
86	600635	大众公用	22,084	105,782.36	0.31
87	000021	长城开发	17,878	105,480.20	0.31
88	600895	张江高科	16,137	105,213.24	0.31
89	000839	中信国安	13,790	104,804.00	0.31
90	002242	九阳股份	10,600	104,728.00	0.31
91	600720	祁连山	16,572	103,906.44	0.31
92	000016	深康佳 A	23,297	103,438.68	0.31
93	600835	上海机电	6,593	102,718.94	0.30
94	002570	贝因美	7,132	102,415.52	0.30
95	600582	天地科技	12,754	101,649.38	0.30
96	600516	方大炭素	10,597	101,625.23	0.30
97	600267	海正药业	6,736	99,894.88	0.30
98	600597	光明乳业	6,218	99,736.72	0.30
99	000917	电广传媒	6,505	99,071.15	0.29
100	000572	海马汽车	26,708	98,819.60	0.29
101	002385	大北农	8,608	97,786.88	0.29
102	000417	合肥百货	18,858	97,495.86	0.29

103	600120	浙江东方	8,598	97,157.40	0.29
104	600340	华夏幸福	3,839	96,627.63	0.29
105	000999	华润三九	5,247	96,492.33	0.29
106	600703	三安光电	4,089	95,805.27	0.28
107	600584	长电科技	10,841	95,726.03	0.28
108	600064	南京高科	8,882	95,481.50	0.28
109	600858	银座股份	13,522	94,789.22	0.28
110	000009	中国宝安	9,259	94,534.39	0.28
111	000970	中科三环	7,932	94,232.16	0.28
112	600079	人福医药	3,149	93,997.65	0.28
113	601098	中南传媒	6,506	93,946.64	0.28
114	600978	宜华木业	19,180	93,598.40	0.28
115	600276	恒瑞医药	2,804	92,980.64	0.28
116	600879	航天电子	7,774	91,577.72	0.27
117	002191	劲嘉股份	6,881	91,517.30	0.27
118	601233	桐昆股份	14,900	91,337.00	0.27
119	600761	安徽合力	9,220	90,724.80	0.27
120	000598	兴蓉投资	18,898	90,143.46	0.27
121	600126	杭钢股份	25,900	90,132.00	0.27
122	601555	东吴证券	12,609	89,776.08	0.27
123	002241	歌尔声学	3,352	89,364.32	0.26
124	600252	中恒集团	7,600	89,148.00	0.26
125	600963	岳阳林纸	29,615	89,141.15	0.26
126	000683	远兴能源	24,938	88,779.28	0.26
127	600409	三友化工	20,306	88,737.22	0.26
128	600588	用友软件	6,304	88,697.28	0.26
129	600575	芜湖港	23,814	88,588.08	0.26
130	000543	皖能电力	13,415	88,539.00	0.26
131	600685	广船国际	5,165	88,476.45	0.26
132	600125	铁龙物流	18,355	88,471.10	0.26
133	601888	中国国旅	2,654	87,688.16	0.26
134	000701	厦门信达	7,799	87,660.76	0.26
135	600674	川投能源	7,437	87,310.38	0.26
136	600611	大众交通	13,260	87,118.20	0.26
137	600037	歌华有线	8,221	86,484.92	0.26
138	600823	世茂股份	10,112	86,356.48	0.26
139	600498	烽火通信	7,233	86,145.03	0.26
140	600804	鹏博士	5,954	85,975.76	0.25
141	600697	欧亚集团	4,800	85,632.00	0.25

142	600322	天房发展	25,021	85,571.82	0.25
143	000786	北新建材	6,234	85,530.48	0.25
144	600469	风神股份	9,143	85,395.62	0.25
145	600410	华胜天成	7,166	85,203.74	0.25
146	600366	宁波韵升	5,741	85,196.44	0.25
147	000652	泰达股份	21,953	84,958.11	0.25
148	000501	鄂武商 A	7,198	84,216.60	0.25
149	000006	深振业 A	18,325	83,928.50	0.25
150	600815	厦工股份	22,975	83,858.75	0.25
151	000031	中粮地产	25,428	82,895.28	0.25
152	600284	浦东建设	8,800	82,808.00	0.25
153	000939	凯迪电力	11,163	82,606.20	0.24
154	000541	佛山照明	8,290	82,568.40	0.24
155	600388	龙净环保	3,415	82,472.25	0.24
156	000061	农产品	8,924	82,368.52	0.24
157	600893	航空动力	3,193	82,283.61	0.24
158	002465	海格通信	5,151	82,055.43	0.24
159	002083	孚日股份	20,012	81,849.08	0.24
160	002155	辰州矿业	10,928	81,741.44	0.24
161	601928	凤凰传媒	8,800	81,664.00	0.24
162	601118	海南橡胶	13,221	81,176.94	0.24
163	002399	海普瑞	4,300	80,324.00	0.24
164	600779	水井坊	11,096	79,558.32	0.24
165	000686	东北证券	11,094	79,543.98	0.24
166	600109	国金证券	3,985	79,181.95	0.23
167	002106	莱宝高科	6,980	78,874.00	0.23
168	600246	万通地产	25,616	78,128.80	0.23
169	600481	双良节能	7,994	78,101.38	0.23
170	600428	中远航运	26,393	77,331.49	0.23
171	600511	国药股份	3,402	77,225.40	0.23
172	000906	物产中拓	5,300	76,744.00	0.23
173	600509	天富热电	9,412	75,954.84	0.23
174	000540	中天城投	14,815	75,556.50	0.22
175	000666	经纬纺机	7,527	75,270.00	0.22
176	000718	苏宁环球	16,689	75,267.39	0.22
177	000667	美好集团	43,969	75,186.99	0.22
178	600809	山西汾酒	5,659	75,151.52	0.22
179	000961	中南建设	11,508	75,147.24	0.22
180	001696	宗申动力	16,584	75,125.52	0.22

181	000521	美菱电器	15,373	74,559.05	0.22
182	000612	焦作万方	12,256	74,516.48	0.22
183	000046	泛海控股	16,639	74,376.33	0.22
184	000656	金科股份	10,758	74,122.62	0.22
185	600517	置信电气	7,202	73,172.32	0.22
186	600628	新世界	9,400	72,944.00	0.22
187	600327	大东方	12,651	72,869.76	0.22
188	000966	长源电力	11,400	72,732.00	0.22
189	601880	大连港	27,613	72,622.19	0.22
190	600612	老凤祥	2,836	71,779.16	0.21
191	600663	陆家嘴	4,516	71,533.44	0.21
192	002022	科华生物	3,100	71,455.00	0.21
193	600373	中文传媒	5,103	71,442.00	0.21
194	002051	中工国际	4,408	71,409.60	0.21
195	000979	中弘股份	24,039	71,395.83	0.21
196	002050	三花股份	6,571	71,361.06	0.21
197	002029	七匹狼	8,824	71,297.92	0.21
198	600577	精达股份	15,040	70,838.40	0.21
199	000793	华闻传媒	6,024	70,782.00	0.21
200	000969	安泰科技	7,682	70,674.40	0.21
201	600765	中航重机	5,870	70,440.00	0.21
202	000960	锡业股份	5,644	70,211.36	0.21
203	000088	盐田港	13,800	70,104.00	0.21
204	000807	云铝股份	21,450	69,712.50	0.21
205	002028	思源电气	7,405	69,607.00	0.21
206	600499	科达洁能	3,900	69,576.00	0.21
207	600332	白云山	2,750	68,447.50	0.20
208	600295	鄂尔多斯	9,264	68,368.32	0.20
209	002078	太阳纸业	21,631	68,137.65	0.20
210	600480	凌云股份	8,379	68,121.27	0.20
211	601678	滨化股份	9,090	67,993.20	0.20
212	000860	顺鑫农业	4,841	67,967.64	0.20
213	600057	象屿股份	11,087	67,963.31	0.20
214	000930	中粮生化	18,305	67,911.55	0.20
215	002440	闰土股份	3,667	67,839.50	0.20
216	600622	嘉宝集团	11,200	67,200.00	0.20
217	600657	信达地产	21,136	67,001.12	0.20
218	600723	首商股份	10,878	66,790.92	0.20
219	600812	华北制药	13,597	66,761.27	0.20

220	000789	江西水泥	7,624	66,633.76	0.20
221	600973	宝胜股份	8,184	66,454.08	0.20
222	600496	精工钢构	10,155	66,312.15	0.20
223	600531	豫光金铅	6,922	66,105.10	0.20
224	600736	苏州高新	16,991	66,094.99	0.20
225	600778	友好集团	8,600	65,962.00	0.20
226	002344	海宁皮城	5,208	64,943.76	0.19
227	000601	韶能股份	15,639	64,901.85	0.19
228	600039	四川路桥	11,596	64,705.68	0.19
229	600626	申达股份	8,299	64,400.24	0.19
230	002244	滨江集团	11,293	64,031.31	0.19
231	601000	唐山港	14,513	63,566.94	0.19
232	600676	交运股份	11,200	63,392.00	0.19
233	600449	宁夏建材	8,660	63,391.20	0.19
234	000987	广州友谊	6,933	63,159.63	0.19
235	600586	金晶科技	21,010	61,349.20	0.18
236	000028	国药一致	1,533	61,243.35	0.18
237	002237	恒邦股份	4,785	61,104.45	0.18
238	600270	外运发展	5,052	61,028.16	0.18
239	002152	广电运通	3,581	61,020.24	0.18
240	000090	天健集团	7,800	60,138.00	0.18
241	000685	中山公用	5,906	60,064.02	0.18
242	600662	强生控股	9,000	59,940.00	0.18
243	002011	盾安环境	7,542	59,808.06	0.18
244	002236	大华股份	2,200	59,290.00	0.18
245	600176	中国玻纤	7,626	59,177.76	0.18
246	601608	中信重工	18,816	58,894.08	0.17
247	000780	平庄能源	14,928	58,816.32	0.17
248	600416	湘电股份	6,134	58,702.38	0.17
249	002500	山西证券	8,993	58,364.57	0.17
250	002299	圣农发展	5,032	58,320.88	0.17
251	002065	东华软件	2,883	58,005.96	0.17
252	002254	泰和新材	6,845	57,840.25	0.17
253	000848	承德露露	2,900	57,623.00	0.17
254	600056	中国医药	5,416	57,572.08	0.17
255	600316	洪都航空	3,360	57,422.40	0.17
256	600438	通威股份	6,005	56,987.45	0.17
257	600380	健康元	11,307	56,987.28	0.17
258	002556	辉隆股份	6,729	56,860.05	0.17

259	002183	怡亚通	7,350	56,815.50	0.17
260	000418	小天鹅 A	5,561	56,777.81	0.17
261	600401	海润光伏	7,112	56,753.76	0.17
262	002311	海大集团	5,151	56,712.51	0.17
263	603766	隆鑫通用	6,400	56,576.00	0.17
264	002375	亚厦股份	2,498	56,354.88	0.17
265	601886	江河创建	8,998	56,237.50	0.17
266	002277	友阿股份	5,912	56,164.00	0.17
267	002561	徐家汇	5,700	55,746.00	0.17
268	600278	东方创业	5,779	55,709.56	0.17
269	600880	博瑞传播	4,700	55,648.00	0.17
270	002007	华兰生物	2,109	55,044.90	0.16
271	601777	力帆股份	8,600	54,954.00	0.16
272	600300	维维股份	13,589	54,899.56	0.16
273	600998	九州通	4,100	54,899.00	0.16
274	000671	阳光城	6,243	54,875.97	0.16
275	000826	桑德环境	2,400	54,840.00	0.16
276	002429	兆驰股份	7,014	54,288.36	0.16
277	600521	华海药业	4,900	54,145.00	0.16
278	600785	新华百货	5,048	53,256.40	0.16
279	600748	上实发展	7,155	53,161.65	0.16
280	002042	华孚色纺	12,854	53,087.02	0.16
281	600298	安琪酵母	3,602	52,517.16	0.16
282	600750	江中药业	3,348	52,463.16	0.16
283	600487	亨通光电	3,632	52,228.16	0.15
284	002648	卫星石化	3,628	51,916.68	0.15
285	000410	沈阳机床	8,349	51,763.80	0.15
286	600118	中国卫星	2,800	51,744.00	0.15
287	600510	黑牡丹	9,937	51,672.40	0.15
288	601929	吉视传媒	4,515	51,651.60	0.15
289	000589	黔轮胎 A	10,015	51,376.95	0.15
290	002085	万丰奥威	2,400	51,024.00	0.15
291	000043	中航地产	10,582	51,005.24	0.15
292	600754	锦江股份	3,100	50,871.00	0.15
293	002233	塔牌集团	8,347	50,582.82	0.15
294	600780	通宝能源	11,734	50,573.54	0.15
295	603366	日出东方	3,708	50,095.08	0.15
296	600705	中航投资	3,100	49,817.00	0.15
297	002489	浙江永强	4,767	49,672.14	0.15

298	000921	海信科龙	5,700	49,590.00	0.15
299	002416	爱施德	3,333	49,495.05	0.15
300	002154	报喜鸟	8,534	49,411.86	0.15
301	600425	青松建化	10,481	49,365.51	0.15
302	002463	沪电股份	15,240	49,225.20	0.15
303	002386	天原集团	6,500	48,750.00	0.14
304	600987	航民股份	8,844	48,642.00	0.14
305	002069	獐子岛	3,463	48,412.74	0.14
306	002701	奥瑞金	2,400	48,408.00	0.14
307	002004	华邦颖泰	2,600	48,360.00	0.14
308	002249	大洋电机	3,424	47,593.60	0.14
309	600567	山鹰纸业	23,263	46,758.63	0.14
310	600436	片仔癀	600	46,518.00	0.14
311	002251	步步高	3,600	46,368.00	0.14
312	002470	金正大	2,399	46,036.81	0.14
313	600580	卧龙电气	6,000	46,020.00	0.14
314	600456	宝钛股份	3,098	45,974.32	0.14
315	600648	外高桥	1,719	45,794.16	0.14
316	000400	许继电气	2,276	45,633.80	0.14
317	002408	齐翔腾达	3,265	45,514.10	0.13
318	601058	赛轮股份	3,861	45,328.14	0.13
319	002353	杰瑞股份	1,124	45,241.00	0.13
320	002393	力生制药	1,549	45,215.31	0.13
321	002309	中利科技	2,600	45,214.00	0.13
322	601010	文峰股份	6,446	44,993.08	0.13
323	601339	百隆东方	5,538	44,802.42	0.13
324	002419	天虹商场	4,709	44,735.50	0.13
325	600132	重庆啤酒	2,993	44,655.56	0.13
326	000022	深赤湾 A	3,436	44,599.28	0.13
327	002310	东方园林	2,700	44,577.00	0.13
328	600310	桂东电力	4,771	44,465.72	0.13
329	000887	中鼎股份	4,600	44,436.00	0.13
330	002157	正邦科技	5,996	44,310.44	0.13
331	600277	亿利能源	6,764	43,966.00	0.13
332	000919	金陵药业	3,155	43,917.60	0.13
333	600397	安源煤业	12,812	43,432.68	0.13
334	002275	桂林三金	2,833	43,004.94	0.13
335	600195	中牧股份	3,297	42,893.97	0.13
336	601566	九牧王	4,052	42,708.08	0.13

337	601231	环旭电子	1,381	42,590.04	0.13
338	601311	骆驼股份	3,959	42,440.48	0.13
339	600650	锦江投资	4,700	42,347.00	0.13
340	000875	吉电股份	15,000	42,300.00	0.13
341	002444	巨星科技	4,452	42,294.00	0.13
342	002482	广田股份	3,518	42,110.46	0.12
343	002394	联发股份	4,800	41,856.00	0.12
344	002210	飞马国际	3,300	41,613.00	0.12
345	000927	一汽夏利	11,624	41,497.68	0.12
346	000525	红太阳	2,860	40,068.60	0.12
347	002203	海亮股份	3,567	39,272.67	0.12
348	600673	东阳光科	3,187	39,040.75	0.12
349	002557	洽洽食品	2,354	39,029.32	0.12
350	002294	信立泰	1,290	38,725.80	0.11
351	600329	中新药业	2,482	38,446.18	0.11
352	002673	西部证券	3,557	38,415.60	0.11
353	002430	杭氧股份	5,554	37,822.74	0.11
354	601139	深圳燃气	5,655	37,775.40	0.11
355	002293	罗莱家纺	1,871	37,607.10	0.11
356	600551	时代出版	2,254	37,574.18	0.11
357	002574	明牌珠宝	1,461	37,240.89	0.11
358	002204	大连重工	2,900	37,004.00	0.11
359	600375	华菱星马	3,268	36,895.72	0.11
360	601216	内蒙君正	3,462	36,454.86	0.11
361	600038	哈飞股份	1,300	36,179.00	0.11
362	000415	渤海租赁	4,705	36,134.40	0.11
363	600372	中航电子	1,575	35,705.25	0.11
364	600874	创业环保	4,475	35,576.25	0.11
365	002441	众业达	2,300	35,466.00	0.11
366	600801	华新水泥	5,309	35,411.03	0.11
367	600743	华远地产	12,730	35,389.40	0.10
368	000631	顺发恒业	7,824	35,364.48	0.10
369	000600	建投能源	6,200	34,658.00	0.10
370	000596	古井贡酒	1,776	33,868.32	0.10
371	600983	合肥三洋	2,600	33,748.00	0.10
372	600639	浦东金桥	3,242	33,003.56	0.10
373	601789	宁波建工	4,497	32,558.28	0.10
374	002372	伟星新材	2,708	32,468.92	0.10
375	601038	一拖股份	4,079	32,020.15	0.09

376	600869	远东电缆	3,631	29,592.65	0.09
377	002194	武汉凡谷	2,300	29,325.00	0.09
378	600280	中央商场	2,900	29,261.00	0.09
379	603001	奥康国际	2,112	29,040.00	0.09
380	603077	和邦股份	2,200	28,600.00	0.08
381	002267	陕天然气	3,131	28,492.10	0.08
382	601636	旗滨集团	3,959	28,346.44	0.08
383	000536	华映科技	1,221	28,205.10	0.08
384	002013	中航机电	1,900	28,139.00	0.08
385	000882	华联股份	9,300	27,249.00	0.08
386	601801	皖新传媒	2,005	26,806.85	0.08
387	600658	电子城	2,700	26,460.00	0.08
388	000750	国海证券	2,800	26,460.00	0.08
389	601515	东风股份	2,204	26,183.52	0.08
390	002662	京威股份	3,009	24,162.27	0.07
391	600737	XD 中粮屯	4,900	23,422.00	0.07
392	002498	汉缆股份	3,186	22,875.48	0.07
393	000603	盛达矿业	1,676	19,793.56	0.06
394	000620	新华联	3,139	17,609.79	0.05
395	002653	海思科	904	17,356.80	0.05
396	603993	洛阳钼业	2,503	16,770.10	0.05
397	600398	海澜之家	1,800	16,560.00	0.05
398	002603	以岭药业	556	16,357.52	0.05

7.3.2 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

截至报告期末本基金未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600210	紫江企业	189,582.00	0.53
2	601901	方正证券	173,845.00	0.49
3	600320	振华重工	145,753.00	0.41

4	601866	中海集运	121,965.00	0.34
5	601106	中国一重	115,679.00	0.32
6	000951	中国重汽	112,898.00	0.32
7	000012	南玻A	111,610.00	0.31
8	600369	西南证券	109,225.00	0.31
9	002242	九阳股份	105,329.10	0.29
10	601233	桐昆股份	92,177.00	0.26
11	600697	欧亚集团	88,712.00	0.25
12	600518	康美药业	88,420.00	0.25
13	600252	中恒集团	87,747.87	0.25
14	600126	杭钢股份	85,945.00	0.24
15	600284	浦东建设	85,284.00	0.24
16	002399	海普瑞	81,038.47	0.23
17	600497	驰宏锌锗	79,390.70	0.22
18	601928	凤凰传媒	77,145.00	0.22
19	000690	宝新能源	76,663.00	0.21
20	000423	东阿阿胶	73,835.00	0.21

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600271	航天信息	266,171.11	0.75
2	600331	宏达股份	222,464.95	0.62
3	000422	湖北宜化	216,983.99	0.61
4	000550	江铃汽车	210,230.92	0.59
5	600143	金发科技	141,009.52	0.39
6	600308	华泰股份	130,858.03	0.37
7	600352	浙江龙盛	126,628.21	0.35
8	600004	白云机场	123,011.72	0.34
9	600626	申达股份	115,723.37	0.32
10	000538	云南白药	114,388.94	0.32
11	000829	天音控股	113,600.69	0.32
12	000626	如意集团	112,797.71	0.32

13	600503	华丽家族	109,661.39	0.31
14	600138	中青旅	108,071.47	0.30
15	000531	穗恒运 A	105,994.15	0.30
16	600787	中储股份	104,987.16	0.29
17	600595	中孚实业	101,787.29	0.28
18	601588	北辰实业	97,986.65	0.27
19	600266	北京城建	97,160.65	0.27
20	600021	上海电力	92,686.80	0.26

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。

7.4.3 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	8,717,591.51
卖出股票收入（成交）总额	10,342,867.50

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末本基金未投资贵金属。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.12.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	2,528.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	445.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.17
8	其他	-
9	合计	33,221.18

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600832	东方明珠	223,410.06	0.66	重大事项公告

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金未持有积极投资股票。

7.12.6 本报告涉及合计数相关比例的，均以合计数除以相关数据计算，而不是对不同比例进行合计。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
泰信基本 面 400A	43	112,830.95	4,657,509.00	96.00%	194,222.00	4.00%
泰信基本 面 400B	48	101,077.73	4,658,558.00	96.02%	193,173.00	3.98%
泰信基本 面 400	55	398,535.18	18,223,743.90	83.14%	3,695,690.97	16.86%
合计	146	216,595.18	27,539,810.90	87.09%	4,083,085.97	12.91%

8.2 期末上市基金前十名持有人

泰信基本面 400A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份 额比例
1	山东省国际信托有限公司	4,657,509.00	96.00%
2	郑龙根	46,003.00	0.95%
3	王国君	36,100.00	0.74%
4	黄晖	23,184.00	0.48%
5	甘遵义	20,000.00	0.41%
6	张润强	11,000.00	0.23%
7	黄文利	11,000.00	0.23%
8	朱孟宇	9,000.00	0.19%
9	邬月秀	8,000.00	0.16%
10	杨波	6,333.00	0.13%

泰信基本面 400B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份 额比例
1	山东省国际信托有限公司	4,658,558.00	96.02%
2	赵晋闽	28,500.00	0.59%
3	俞正保	26,466.00	0.55%
4	郑盛泰	26,199.00	0.54%
5	梁小红	20,205.00	0.42%
6	王兴成	20,000.00	0.41%
7	许玲玲	16,300.00	0.34%
8	钱海仙	9,505.00	0.20%
9	李伟	7,528.00	0.16%
10	王颖	7,300.00	0.15%

8.3 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	泰信基本面 400A	0.00	0.0000%
	泰信基本面 400B	0.00	0.0000%
	泰信基本面 400	103,030.27	0.4700%
	合计	103,030.27	0.3258%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泰信基本面 400A	0
	泰信基本面 400B	0
	泰信基本面 400	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	泰信基本面 400A	0
	泰信基本面 400B	0
	泰信基本面 400	0
	合计	0

注：基金份额总量的数量区间为 0、0 至 10 万份（含）、10 万份至 50 万份（含）、50 万份至 100 万份（含）、100 万份以上。

§ 9 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) 基金份额总额	-	-	300,843,720.90
本报告期期初基金份额总额	5,166,968.00	5,166,968.00	21,368,103.71
本报告期基金总申购份额	-	-	432,183.19
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	1,449,471.06
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-315,237.00	-315,237.00	1,568,619.03
本报告期期末基金份额总额	4,851,731.00	4,851,731.00	21,919,434.87

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

2、经泰信基金管理有限公司第四届董事会 2013 年第三次（通讯）会议审议通过，王小林先生担任董事长职务。具体详情参见 2014 年 4 月 9 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基金行业高级管理人员变更的公告》，公告同日起公司总经理葛航先生不再代任董事长职务。本公司上述人事变动已按相关规定向监管机构进行备案。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所，仍为普华永道中天会计师事务所有限公司。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	11,268,736.25	59.12%	10,259.82	59.81%	-
中国银河证券	1	7,791,722.76	40.88%	6,894.94	40.19%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 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	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

高华证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

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、泰信现代服务业基金共用交易单元。

10.8 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	泰信基本面 400 基金定期折算期间泰信 400A 份额停牌公告	《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）	2014 年 1 月 3 日
2	第三个运作周年基准收益率公告	《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）	2014 年 1 月 3 日
3	泰信基本面 400 定期折算结果及泰信 400A 份额恢复交易公告	《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）	2014 年 1 月 6 日
4	泰信 400A 份额前收盘价调整公告	《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）	2014 年 1 月 6 日
5	提醒投资者更新过期身份证信息	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2014 年 1 月 15 日

		报》及公司网站 (www.ftfund.com)	
6	13 年 4 季度报告	《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)	2014 年 1 月 21 日
7	信息披露负责人变更公告	《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)	2014 年 3 月 18 日
8	基金 13 年年度报告	《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)	2014 年 3 月 27 日
9	新增嘉实财富为代销机构并开通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)	2014 年 4 月 8 日
10	行业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)	2014 年 4 月 9 日
11	14 年 1 季度报告	《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)	2014 年 4 月 19 日
12	停牌股票估值调整	《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)	2014 年 4 月 29 日

§ 11 备查文件目录

11.1 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

11.2 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。

11.3 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
2014年8月26日