

# 泰信双息双利债券型证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 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：2015 年 8 月 25 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 2015 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 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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.....	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.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	40
7.7 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.....	40
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	40
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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.11 投资组合报告附注.....	40
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>41</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	42
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>42</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	44
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>45</b>
11.1 备查文件目录.....	45
11.2 存放地点.....	46
11.3 查阅方式.....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰信双息双利债券型证券投资基金
基金简称	泰信双息双利债券
基金主代码	290003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 10 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
报告期末基金份额总额	142,865,881.27 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标是在获取债券稳定收益的基础上，通过股票一级市场申购及适当的二级市场投资等手段谋求高于比较基准的收益。
投资策略	在本基金投资管理计划中，投资策略由自上而下的资产配置计划和自下而上的选股（或债券）计划组成，本基金根据对宏观经济形势、货币和财政政策变化、经济周期及利率走势、企业盈利和信用状况等等的动态分析，在限定投资范围内，决定债券类资产、股票类等工具的配置比例。并跟踪影响资产策略配置的各种因素的变化，定期对资产策略配置比例进行调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为上证国债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的低风险品种，预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 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	胡因	蒋松云
	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	王小林	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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ftfund.com">http://www.ftfund.com</a>
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 36-37 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泰信基金管理有限公司	上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36、37 层

## § 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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,779,077.02
本期利润	4,826,925.45
加权平均基金份额本期利润	0.0606
本期加权平均净值利润率	5.56%
本期基金份额净值增长率	5.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	14,127,522.42
期末可供分配基金份额利润	0.0989
期末基金资产净值	158,508,095.65
期末基金份额净值	1.1095
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	42.17%

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	0.67%	0.10%	0.49%	0.04%	0.18%	0.06%
过去三个月	3.13%	0.14%	1.13%	0.06%	2.00%	0.08%
过去六个月	5.25%	0.13%	2.72%	0.05%	2.53%	0.08%
过去一年	10.81%	0.14%	5.37%	0.04%	5.44%	0.10%
过去三年	22.23%	0.12%	11.91%	0.05%	10.32%	0.07%
自基金合同生效日起至 今	42.17%	0.27%	36.13%	0.07%	6.04%	0.20%

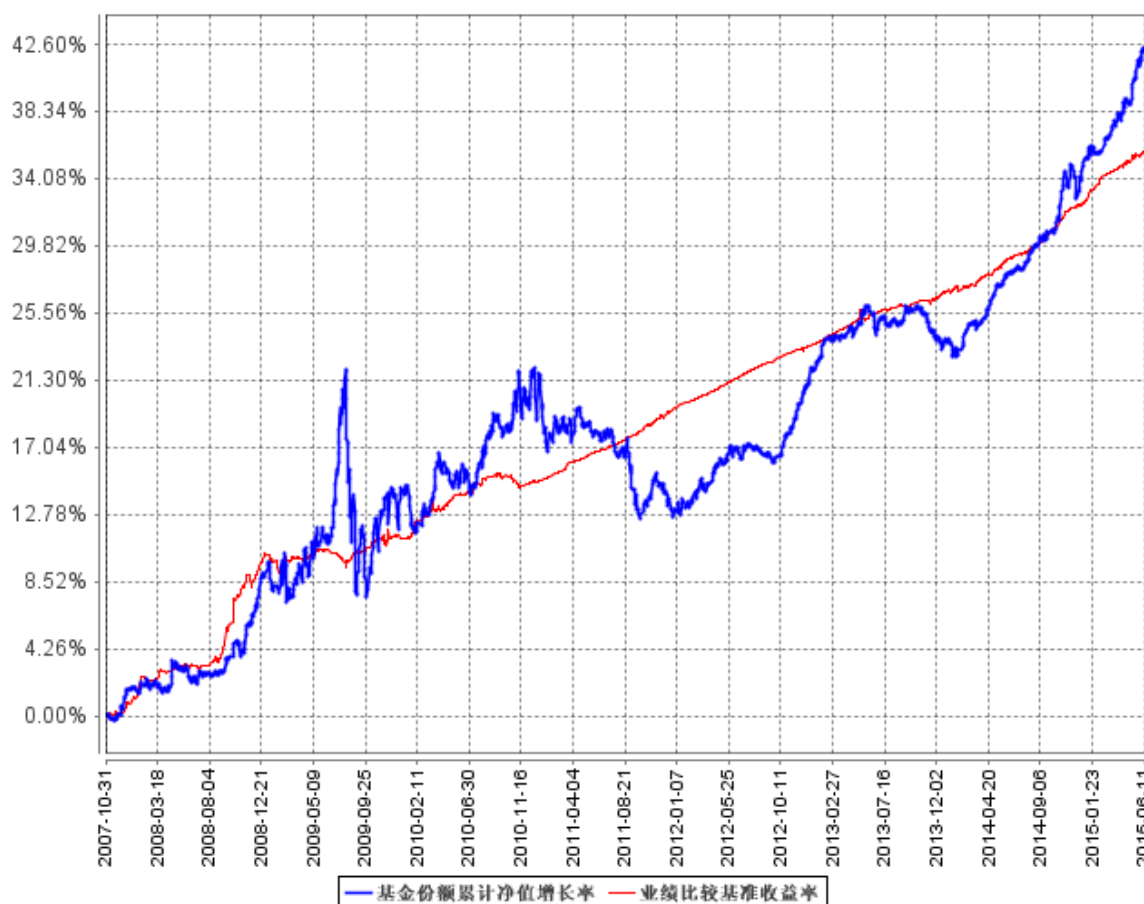
注：本基金业绩比较基准为：上证国债指数。

上证国债指数以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成。

上证国债指数的目的是反映我们债券市场整体变动状况，是我们债券市场价格变动的“指示器”。

### 3.2.2 自基金合同转型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 2007 年 10 月 31 日正式生效。

2、本基金建仓期为六个月。建仓期满各项投资比例符合基金合同关于投资组合的相关规定。本基金主要投资于债券类金融工具。债券类金融工具包括国债、央行票据、金融债、信用等级为投资级的企业债（包括可转债）、可分离性债券、短期融资券、资产支持证券等法律法规或中国证监会允许投资的固定收益品种。上述资产投资比例不低于基金资产的 80%。其中，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

3、经泰信中短期债券投资基金 2007 年 9 月 27 日基金份额持有人大会(通讯方式)表决通过，并经中国证监会 2007 年 10 月 26 日证监基金字[2007]293 号文核准，泰信中短期债券投资基金变更为泰信双息双利债券型证券投资基金，自 2007 年 10 月 31 日起，由《泰信中短期债券投资基金基金合同》修订而成的《泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同》正式生效。业绩比较基准由“2 年期银行定期存款利率（税后）”变更为“上证国债指数”。



## § 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：王小林

总经理：葛航

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：王斌

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（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、产品部、营销部（分华东、华北、华南三大营销中心）、理财顾问部、深圳分公司、北京分公司、电子商务部、客服中心、基金投资部、研究部、专户投资部、清算会计部、集中交易部、计划财务部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部。截至 2015 年 6 月底，公司有正式员工 104 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 2015 年 6 月底，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、泰信行业精选混合、泰信中证基本面 400 指数分级、泰信现代服务业股票基金、泰信鑫益定期开放债券共 15 只开放式基金及泰信乐利分级 4 号、泰信乐利 5 号、泰信至尊阿尔法、泰信至尊阿尔法 3 号、泰信至尊阿尔法 5 号、泰信至尊阿尔法 6 号、泰信道简阿尔法、泰信紫藤智慧金 1 号、泰信

吉渊分级 1 号、泰信梭鱼安盈新股 1 号共 10 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		
何俊春女士	基金投资部固定收益投资总监、本基金基金经理兼泰信债券增强收益、泰信债券周期回报、泰信鑫益定期开放债券基金经理	2008 年 10 月 10 日	-	19 年	工商管理硕士。具有基金从业资格。曾任职于上海鸿安投资咨询有限公司、齐鲁证券上海斜土路营业部。2002 年 12 月加入泰信基金管理有限公司，先后担任泰信天天收益基金交易员、交易主管，泰信天天收益基金经理。自 2009 年 7 月 29 日起担任泰信债券增强收益基金经理；自 2012 年 10 月 25 日起担任泰信债券周期回报基金经理；自 2013 年 7 月 17 日起担任泰信鑫益定期开放债券基金经理。现同时担任基金投资部固定收益投资总监。

注：1、以上日期均是指公司公告的日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信双息双利债券型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

2015 年上半年宏观经济表现整体较为疲弱，GDP 连续两个季度破 7%。三驾马车中投资疲弱，除基建投资相对稳定外，地产、制造业投资均下滑明显。工业增加值自 3 月以来底部回升，带动工业企业利润改善。中采 PMI 指标上半年围绕荣枯线缓慢回升，6 月末达至 50.2。消费上半年相对疲弱，社会消费品同比下滑。人民币汇率一季度波动二季度平稳，出口在海外经济复苏带动下整体改善。上半年 M2 同比增速 11.8%，社融规模较去年同期下降，银行惜贷情绪依旧较浓。通胀上半年底部企稳。面对较为严峻的宏观经济情势，政府坚持推进积极的财政政策稳健的货币政策，上半年央行也多次通过降准降息，运用公开市场投放、PSL、MLF 等工具维持市场流动性，引导市场利率下行。

上半年债券市场整体表现良好，银行间 7 天回购利率自上年末 5.07% 下降 227 个基点至 6 月末 2.80%，中债总财富指数上涨 2.6%，中证转债指数下降 11.98%。上半年利率债在央行推动的宽松流动性支持下表现良好，短端收益率自 4 月以来快速下行，长端则在经济复苏的担忧和地方政府债供给压力下表现为区间震荡。截至 6 月末，1、10 年期国债分别收于 1.74% 和 3.60%，较上年末下行 152 和 2 个基点。1、10 年期国开债则分别收于 2.78% 和 4.09%。信用债上半年表现良好，受利率债影响，短端表现优于长端。具体产品中，城投债受地方债务置换带来系统性风险下降利好支撑，信用利差进一步压缩，表现好于中票等其他品种。上半年个别主体信用事件爆发，信用评级调低次数也超过上一年同期，但对市场整体估值的影响较少。转债市场上半年受到股票市场情绪影响波动加剧，转股溢价率先升后降，个券分化较大，市场规模伴随转债赎回降至低点。

2015 年上半年操作主要增加交易所高收益城投债的配置，以及三年期以内信用债的配置，股票主要通过波段操作来提高收益。

#### 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 1.1095 元，净值增长率为 5.25%，同期比较基准增长率为 2.72%。

#### 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 2015 年下半年，我们认为宏观经济整体有望在波动中逐步企稳。投资端来看，房地产投资能否回暖仍有待验证，“金九银十”表现值得关注。制造业投资继续保持相对弱势，而伴随着地方政府债务置换的推进，积极财政政策的进一步强化，基建投资将有望成为下半年经济增长的主要着力点。下半年通胀有望持续回升，食品端将在猪肉价格、厄尔尼诺影响等因素带动下走高，非食品端则仍受制于大宗商品整体低迷影响。我们认为下半年国家将进一步加强财政政策的积极力度，并积极改善当前的信贷环境。货币政策受到通胀上行、海外加息等因素制约进一步宽松空间有限。美国加息或将带来新兴市场资本外流，造成人民币贬值压力，央行也将采取针对性的举措来维持汇率和市场流动性的相对稳定。

因此，在当前的宏观形势下，我们认为下半年的债券多空因素交织，一方面经济波动企稳，通胀恢复上行，货币政策进一步宽松空间有限，对债市基本面形成制约，积极财政也将从供给压力和宏观预期改变对利率债产生压力；同时我们也可以看到，伴随 6 月后半月以来的股市大跌，市场风险情绪下降提高低风险资产配置价值，IPO 暂停发行后，打新资金也将陆续向债券资产回流，大类资产轮动对债市形成利好。在稳增长、控金融风险、海外加息的大背景下，政府需要维持相对稳定的货币政策环境，流动性对债市仍有支撑。

下半年基金资产主要以三年期以内债券做为基本配置，同时关注美联储加息对国内流动性带来的冲击。股票主要以主题投资及个股为主。

#### 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

1、基金合同关于利润分配的约定：

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

(3) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(4) 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

(5) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

(6) 每一基金份额享有同等分配权；

(7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

2、本报告期本基金未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金有连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况。

## § 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双息双利债券型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，泰信双息双利债券型证券投资基金的托管人——泰信基金管理有限公司在泰信双息双利债券型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。本报告期内，泰信双息双利债券型证券投资基金未进行利润分配。

## 5.3 托管人对本半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双息双利债券型证券投资基金 2015 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：泰信双息双利债券型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	47,305,747.45	13,389,826.33
结算备付金		317,007.47	384,086.43
存出保证金		31,992.40	22,798.26
交易性金融资产	6.4.7.2	140,711,609.10	41,564,231.90
其中：股票投资		4,516,265.00	1,438,150.00
基金投资		-	-
债券投资		136,195,344.10	40,126,081.90
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	3,078,104.31	1,346,370.80
应收股利		-	-
应收申购款		46,921.30	8,449.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		191,491,382.03	56,715,763.51

负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>			
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		29,399,835.90	9,799,865.30
应付证券清算款		2,690,298.62	3,867,227.52
应付赎回款		27,905.20	-
应付管理人报酬		91,381.62	26,830.65
应付托管费		26,109.03	7,665.90
应付销售服务费		39,163.55	11,498.84
应付交易费用	6.4.7.7	300,062.33	122,608.89
应交税费		277,320.52	277,320.52
应付利息		2,901.23	21,038.70
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	128,308.38	309,000.00
负债合计		32,983,286.38	14,443,056.32
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	142,865,881.27	40,097,539.33
未分配利润	6.4.7.10	15,642,214.38	2,175,167.86
所有者权益合计		158,508,095.65	42,272,707.19
负债和所有者权益总计		191,491,382.03	56,715,763.51

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1095 元，基金份额总额 142,865,881.27 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰信双息双利债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		5,918,347.09	2,565,685.46
1.利息收入		1,745,431.63	1,590,493.39
其中：存款利息收入	6.4.7.11	42,433.29	19,309.19
债券利息收入		1,695,779.32	1,540,234.53
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,219.02	30,949.67
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,124,576.33	254,798.21
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,687,365.35	-7,699.17
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.13	431,291.66	258,222.38
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	5,919.32	4,275.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	47,848.43	720,047.93
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	490.70	345.93
<b>减：二、费用</b>		1,091,421.64	573,954.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	295,875.74	200,709.72
2. 托管费	6.4.10.2.2	84,535.91	57,345.69
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	126,803.89	86,018.46
4. 交易费用	6.4.7.19	374,419.84	26,512.37
5. 利息支出		70,887.68	31,141.19
其中：卖出回购金融资产支出		70,887.68	31,141.19
6. 其他费用	6.4.7.20	138,898.58	172,226.86
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,826,925.45	1,991,731.17
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,826,925.45	1,991,731.17

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信双息双利债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	40,097,539.33	2,175,167.86	42,272,707.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,826,925.45	4,826,925.45
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）	102,768,341.94	8,640,121.07	111,408,463.01
其中：1.基金申购款	119,905,023.45	10,061,889.02	129,966,912.47



2. 基金赎回款	-17,136,681.51	-1,421,767.95	-18,558,449.46
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）	142,865,881.27	15,642,214.38	158,508,095.65
项目	上年度可比期间 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）	62,247,460.28	1,901,778.25	64,149,238.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,991,731.17	1,991,731.17
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）	-11,933,502.18	-474,290.89	-12,407,793.07
其中：1.基金申购款	3,918,458.03	199,392.14	4,117,850.17
2.基金赎回款	-15,851,960.21	-673,683.03	-16,525,643.24
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）	50,313,958.10	3,419,218.53	53,733,176.63

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

泰信双息双利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据原泰信中短期债券投资基金（以下简称“原泰信中短债基金”）基金份额持有人大会 2007 年 9 月 27 日审议通过的《关于泰信中短期债券投资基金转型为泰信双息双利债券型证券投资基金有关事项的议案》及经中国证券监

督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]第 293 号《关于核准泰信中短期债券投资基金基金份额持有人大会有关变更基金类别决议的批复》批准,由原泰信中短债基金转型而来。

根据《泰信中短期债券投资基金转型方案说明书》以及相关法律法规的规定,经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致并经中国证监会核准,基金管理人泰信基金管理有限公司将《泰信中短期债券投资基金基金合同》修订为《泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同》。

《泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同》自 2007 年 10 月 31 日起生效,原《泰信中短期债券投资基金基金合同》同日失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围变更为主要投资于债券类金融工具。债券类金融工具包括国债、央行票据、金融债、信用等级为投资级的企业债(包括可转债)、可分离性债券、短期融资券、资产支持证券等法律法规或中国证监会允许投资的固定收益品种。上述资产投资比例不低于基金资产的 80%。其中,本基金持有现金或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,本基金可以参与一级市场新股申购、股票、权证的投资,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非债券类品种。非债券类金融工具的投资比例不超过基金资产的 20%。本基金的业绩比较基准为上证国债指数。

#### 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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信双息双利债券型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 2015 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

### 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、债券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、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。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 2015 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	47,305,747.45
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	47,305,747.45

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,801,222.50	4,516,265.00	-284,957.50
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	24,961,594.59	25,108,344.10
	银行间市场	110,822,519.30	111,087,000.00
	合计	135,784,113.89	136,195,344.10
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	140,585,336.39	140,711,609.10	126,272.71

#### 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 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,858.98
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	128.34
应收债券利息	3,075,104.03
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	12.96
合计	3,078,104.31

#### 6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	297,726.25
银行间市场应付交易费用	2,336.08
合计	300,062.33

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	439.80
预提费用	127,868.58
合计	128,308.38

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	40,097,539.33	40,097,539.33
本期申购	119,905,023.45	119,905,023.45
本期赎回(以“-”号填列)	-17,136,681.51	-17,136,681.51
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	142,865,881.27	142,865,881.27

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 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	1,649,549.16	525,618.70	2,175,167.86
本期利润	4,779,077.02	47,848.43	4,826,925.45
本期基金份额交易产生的变动数	7,698,896.24	941,224.83	8,640,121.07
其中：基金申购款	8,909,256.18	1,152,632.84	10,061,889.02
基金赎回款	-1,210,359.94	-211,408.01	-1,421,767.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,127,522.42	1,514,691.96	15,642,214.38

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	39,941.48
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	2,270.54
其他	221.27
合计	42,433.29

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	123,671,279.09
减：卖出股票成本总额	119,983,913.74
买卖股票差价收入	3,687,365.35

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	431,291.66
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	431,291.66

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	94,745,241.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	92,389,936.24
减：应收利息总额	1,924,013.60
买卖债券差价收入	431,291.66

**6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益**

本报告期末本基金未投资资产支持证券。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本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。

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,919.32
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,919.32

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	47,848.43
——股票投资	-337,291.59
——债券投资	385,140.02
——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	47,848.43

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	234.20
转出基金补偿费	256.50
合计	490.70

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

2. 本基金的转换费用由转出基金的赎回费、转出和转入基金的申购费补差构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	372,360.59
银行间市场交易费用	2,059.25
合计	374,419.84

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78



信息披露费	89,261.96
账户服务费	18,053.84
银行划款手续费	1,830.00
合计	138,898.58

## 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

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

本报告期本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 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、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司(中国工商银行)	基金托管人、基金代销机构
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(“青岛国信”)	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

#### 6.4.10.1.1 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。

**6.4.10.1.2 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。

**6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

本报告期及上年度可比期间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 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	295,875.74	200,709.72
其中：支付销售机构的客户维护费	35,230.09	53,208.59

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 0.70%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： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.70\% / \text{当年天数}$ 。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	84,535.91	57,345.69

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 0.20%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： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}$ 。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费 各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国工商银行	29,725.91
泰信基金管理有限公司	71,732.70
合计	101,458.61
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日

	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国工商银行	45,536.16
泰信基金管理有限公司	444.25
合计	45,980.41

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泰信基金管理有限公司，再由泰信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数。

#### 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固有资金投资本基金的情况

本期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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

关联方名称	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014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	113,720,127.86	79.6000%	-	-

#### 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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	47,305,747.45	39,941.48	1,247,661.50	16,916.24

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未参与在承销期内关联方承销的证券。

#### 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

本报告期本基金未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2015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

报告期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 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

本基金为债券型基金，属于低风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于货币市场基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”的风险收益目标。

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

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

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

#### 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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
A-1	9,977,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	60,324,000.00	10,017,000.00
合计	70,301,000.00	10,017,000.00

注：未评级的部分为政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
AAA	4,113,308.80	1,720,180.40

AAA 以下	17,408,585.30	18,048,901.50
未评级	44,372,450.00	10,340,000.00
合计	65,894,344.10	30,109,081.90

注：未评级的部分为国债及政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

### 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证券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，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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015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	47,305,747.45	-	-	-	47,305,747.45
结算备付金	317,007.47	-	-	-	317,007.47
存出保证金	31,992.40	-	-	-	31,992.40
交易性金融资产	78,951,281.00	54,613,326.10	2,630,737.00	4,516,265.00	140,711,609.10
应收利息	-	-	-	3,078,104.31	3,078,104.31
应收申购款	-	-	-	46,921.30	46,921.30
资产总计	126,606,028.32	54,613,326.10	2,630,737.00	7,641,290.61	191,491,382.03
负债					
卖出回购金融资产款	29,399,835.90	-	-	-	29,399,835.90
应付证券清算款	-	-	-	2,690,298.62	2,690,298.62
应付赎回款	-	-	-	27,905.20	27,905.20
应付管理人报酬	-	-	-	91,381.62	91,381.62
应付托管费	-	-	-	26,109.03	26,109.03
应付销售服务费	-	-	-	39,163.55	39,163.55
应付交易费用	-	-	-	300,062.33	300,062.33
应付利息	-	-	-	2,901.23	2,901.23
应交税费	-	-	-	277,320.52	277,320.52
其他负债	-	-	-	128,308.38	128,308.38
负债总计	29,399,835.90	-	-	3,583,450.48	32,983,286.38
利率敏感度缺口	97,206,192.42	54,613,326.10	2,630,737.00	4,057,840.13	158,508,095.65
上年度末 2014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	13,389,826.33	-	-	-	13,389,826.33
结算备付金	384,086.43	-	-	-	384,086.43
存出保证金	22,798.26	-	-	-	22,798.26
交易性金融资产	14,074,852.00	24,757,595.50	1,293,634.40	1,438,150.00	41,564,231.90
应收利息	-	-	-	1,346,370.80	1,346,370.80
应收申购款	-	-	-	8,449.79	8,449.79
资产总计	27,871,563.02	24,757,595.50	1,293,634.40	2,792,970.59	56,715,763.51
负债					
卖出回购金融资产款	9,799,865.30	-	-	-	9,799,865.30
应付证券清算款	-	-	-	3,867,227.52	3,867,227.52
应付管理人报酬	-	-	-	26,830.65	26,830.65
应付托管费	-	-	-	7,665.90	7,665.90
应付销售服务费	-	-	-	11,498.84	11,498.84
应付交易费用	-	-	-	122,608.89	122,608.89
应付利息	-	-	-	21,038.70	21,038.70
应交税费	-	-	-	277,320.52	277,320.52
其他负债	-	-	-	309,000.00	309,000.00
负债总计	9,799,865.30	-	-	4,643,191.02	14,443,056.32
利率敏感度缺口	18,071,697.72	24,757,595.50	1,293,634.40	-1,850,220.43	42,272,707.19

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	439,190.40	190,000.00
	市场利率上升 25 个基点	-435,864.68	-190,000.00



#### 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。本基金投资组合中债券类金融工具投资比例不低于基金资产的 80%，非债券类金融工具的投资比例不超过基金资产的 20%。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 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	4,516,265.00	2.85	1,438,150.00	3.40
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	136,195,344.10	85.92	40,126,081.90	94.92
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	140,711,609.10	88.77	41,564,231.90	98.32

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 2.85%（2014 年 12 月 31 日：3.40%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2014 年 12 月 31 日：同）。

**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	4,516,265.00	2.36
	其中：股票	4,516,265.00	2.36
2	固定收益投资	136,195,344.10	71.12
	其中：债券	136,195,344.10	71.12
	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	47,622,754.92	24.87
7	其他各项资产	3,157,018.01	1.65
8	合计	191,491,382.03	100.00

**7.2 期末按行业分类的股票投资组合**

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,310,430.00	2.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	395,500.00	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	810,335.00	0.51
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,516,265.00	2.85

### 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

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	002241	歌尔声学	35,000	1,256,500.00	0.79
2	601727	上海电气	80,000	1,194,400.00	0.75
3	300075	数字政通	21,500	810,335.00	0.51
4	002049	同方国芯	10,000	480,000.00	0.30
5	600018	上港集团	50,000	395,500.00	0.25
6	002312	三泰控股	10,000	374,600.00	0.24
7	002770	N 科迪	500	4,930.00	0.00

### 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	002241	歌尔声学	3,640,359.00	8.61
2	300254	仟源医药	3,034,585.16	7.18
3	002731	萃华珠宝	2,534,399.71	6.00
4	601929	吉视传媒	2,145,194.12	5.07
5	002400	省广股份	1,844,719.00	4.36
6	600016	民生银行	1,838,500.00	4.35
7	000905	厦门港务	1,662,947.31	3.93
8	600018	上港集团	1,550,311.00	3.67
9	300005	探路者	1,544,062.00	3.65
10	601727	上海电气	1,517,700.00	3.59
11	000002	万科A	1,475,634.80	3.49
12	600011	华能国际	1,474,500.00	3.49
13	600057	象屿股份	1,453,395.00	3.44
14	603993	洛阳钼业	1,407,974.04	3.33
15	002609	捷顺科技	1,394,300.00	3.30
16	002146	荣盛发展	1,358,072.00	3.21
17	600116	三峡水利	1,338,447.00	3.17
18	300027	华谊兄弟	1,314,460.00	3.11
19	600010	包钢股份	1,306,100.00	3.09
20	300112	万讯自控	1,275,851.00	3.02
21	002009	天奇股份	1,272,532.00	3.01
22	600035	楚天高速	1,230,832.32	2.91
23	000596	古井贡酒	1,229,605.00	2.91
24	600028	中国石化	1,196,100.00	2.83
25	603567	珍宝岛	1,192,274.50	2.82
26	002353	杰瑞股份	1,188,519.00	2.81
27	600079	人福医药	1,175,798.00	2.78
28	000402	金融街	1,129,930.05	2.67
29	000783	长江证券	1,127,350.00	2.67
30	601006	大秦铁路	1,105,624.00	2.62
31	000925	众合科技	1,088,400.00	2.57
32	002065	东华软件	1,087,141.00	2.57
33	600149	廊坊发展	1,081,950.00	2.56
34	000758	中色股份	1,075,594.00	2.54
35	002738	中矿资源	1,067,500.00	2.53

36	600026	中海发展	1,065,200.00	2.52
37	600369	西南证券	1,061,000.00	2.51
38	300036	超图软件	1,051,915.00	2.49
39	600702	沱牌舍得	1,049,300.00	2.48
40	000790	华神集团	1,031,200.00	2.44
41	000709	河北钢铁	1,023,600.00	2.42
42	600875	东方电气	1,019,970.76	2.41
43	600153	建发股份	1,010,626.00	2.39
44	300146	汤臣倍健	995,320.00	2.35
45	600519	贵州茅台	974,148.00	2.30
46	300314	戴维医疗	972,318.00	2.30
47	600352	浙江龙盛	966,600.00	2.29
48	002454	松芝股份	953,600.00	2.26
49	000401	冀东水泥	951,489.00	2.25
50	601000	唐山港	948,900.00	2.24
51	000985	大庆华科	946,100.00	2.24
52	601989	中国重工	932,500.00	2.21
53	002408	齐翔腾达	907,880.00	2.15
54	300372	欣泰电气	904,400.00	2.14
55	000501	鄂武商A	896,739.70	2.12
56	000009	中国宝安	892,600.00	2.11
57	600581	八一钢铁	873,000.00	2.07
58	300275	梅安森	864,292.00	2.04

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	300254	仟源医药	3,201,720.00	7.57
2	002731	萃华珠宝	2,408,441.58	5.70
3	002241	歌尔声学	2,258,827.00	5.34
4	601929	吉视传媒	2,236,180.00	5.29
5	002400	省广股份	1,892,973.46	4.48
6	600016	民生银行	1,807,500.00	4.28

7	000002	万 科A	1,799,000.00	4.26
8	600028	中国石化	1,781,400.00	4.21
9	000905	厦门港务	1,670,644.00	3.95
10	300005	探路者	1,576,500.00	3.73
11	600057	象屿股份	1,548,794.00	3.66
12	603993	洛阳钼业	1,495,797.95	3.54
13	600011	华能国际	1,491,009.00	3.53
14	002609	捷顺科技	1,475,341.00	3.49
15	002146	荣盛发展	1,440,134.00	3.41
16	300112	万讯自控	1,412,271.00	3.34
17	600010	包钢股份	1,343,000.00	3.18
18	300027	华谊兄弟	1,339,340.00	3.17
19	600116	三峡水利	1,325,910.00	3.14
20	002009	天奇股份	1,294,461.00	3.06
21	600035	楚天高速	1,255,360.64	2.97
22	000596	古井贡酒	1,246,504.20	2.95
23	002738	中矿资源	1,230,538.00	2.91
24	600079	人福医药	1,211,925.12	2.87
25	002353	杰瑞股份	1,185,830.00	2.81
26	002065	东华软件	1,152,650.44	2.73
27	000402	金 融 街	1,151,200.00	2.72
28	600149	廊坊发展	1,136,604.50	2.69
29	000783	长江证券	1,136,150.00	2.69
30	000758	中色股份	1,133,834.13	2.68
31	600153	建发股份	1,122,156.00	2.65
32	002454	松芝股份	1,112,747.00	2.63
33	000925	众合科技	1,106,415.85	2.62
34	601006	大秦铁路	1,092,423.15	2.58
35	000790	华神集团	1,086,127.88	2.57
36	600702	沱牌舍得	1,074,731.00	2.54
37	600369	西南证券	1,072,325.00	2.54
38	000709	河北钢铁	1,056,600.00	2.50
39	603567	珍宝岛	1,056,080.00	2.50
40	300146	汤臣倍健	1,042,425.70	2.47
41	600026	中海发展	1,036,800.00	2.45
42	601000	唐山港	1,020,042.00	2.41
43	600875	东方电气	1,012,816.00	2.40
44	300314	戴维医疗	994,157.00	2.35

45	000501	鄂武商 A	990,802.00	2.34
46	600018	上港集团	985,100.00	2.33
47	600519	贵州茅台	982,986.00	2.33
48	601989	中国重工	978,772.00	2.32
49	300372	欣泰电气	978,500.00	2.31
50	000401	冀东水泥	960,000.00	2.27
51	002409	雅克科技	954,209.30	2.26
52	000985	大庆华科	952,017.00	2.25
53	300036	超图软件	951,208.00	2.25
54	002408	齐翔腾达	949,489.14	2.25
55	600352	浙江龙盛	936,900.00	2.22
56	600581	八一钢铁	924,265.99	2.19
57	000009	中国宝安	884,832.00	2.09
58	300275	梅安森	863,881.00	2.04

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。

### 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	123,399,320.33
卖出股票收入（成交）总额	123,671,279.09

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	104,696,450.00	66.05
	其中：政策性金融债	104,696,450.00	66.05
4	企业债券	31,197,894.10	19.68
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	301,000.00	0.19
9	合计	136,195,344.10	85.92

**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**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	150202	15 国开 02	600,000	60,324,000.00	38.06
2	140220	14 国开 20	300,000	30,624,000.00	19.32
3	140225	14 国开 25	100,000	10,162,000.00	6.41
4	041554038	15 沪城建 CP001	100,000	9,977,000.00	6.29
5	018001	国开 1301	35,000	3,586,450.00	2.26

**7.7 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**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

报告期末本基金未投资贵金属。

**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**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.10.1 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。

**7.10.2 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。

**7.10.3 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。

**7.11 投资组合报告附注****7.11.1**

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。



### 7.11.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选库之外的股票。

### 7.11.3 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	31,992.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,078,104.31
5	应收申购款	46,921.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,157,018.01

### 7.11.4 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。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.11.6 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
1,931	73,985.44	113,720,127.86	79.60%	29,145,753.41	20.40%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007 年 10 月 31 日）基金份额总额	382,550,774.21
本报告期期初基金份额总额	40,097,539.33
本报告期基金总申购份额	119,905,023.45
减：本报告期基金总赎回份额	17,136,681.51
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	142,865,881.27

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 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

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

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

本报告期内，本基金管理人、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

## 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	
中金公司	1	139,791,682.32	56.75%	123,701.95	56.05%	-
华泰证券	1	106,535,517.75	43.25%	96,989.74	43.95%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-

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

### 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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

		例		成交总额 的比例		比例
中金公司	1,385,424.80	1.33%	-	-	-	-
华泰证券	102,505,906.18	98.67%	69,600,000.00	100.00%	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-

## 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	14 年 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2015 年 1 月 21 日
2	新增上海联泰资产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》及公司网站 (www.ftfund.com)	2015 年 2 月 7 日
3	在齐鲁证券开通网上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》及公司网站 (www.ftfund.com)	2015 年 3 月 13 日
4	在银行证券开通申购、定投费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2015 年 3 月 13 日
5	提醒投资者更新身份信息	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2015 年 3 月 18 日
6	14 年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2015 年 3 月 26 日
7	对交易所固定收益品种进行估值调整	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网	2015 年 3 月 27 日

		站 (www.ftfund.com)	
8	15 年 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2015 年 4 月 22 日
9	新增利得基金为代销机构并开通定投及费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2015 年 5 月 6 日
10	参加农业银行手机银行、网上银行费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2015 年 5 月 29 日
11	新增中信期货为代销机构并开通定投转换业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2015 年 6 月 16 日
12	新增上海好买基金为代销机构并开通定投、转换及费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2015 年 6 月 17 日
13	参加交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2015 年 6 月 27 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1、中国证监会《关于核准泰信中短期债券投资基金基金份额持有人大会有关变更基金类别决议的批复》

2、《泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同》

3、《泰信双息双利债券型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信双息双利债券型证券投资基金托管协议》

5、中国证监会批准设立泰信基金管理有限公司的文件

6、报告期内泰信双息双利基金在指定报刊上披露的各项公告

7、报告期内泰信中短债基金在指定报刊上披露的各项公告

### **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**

投资者可登录本基金管理人公司网站(<http://www.ftfund.com>)查阅上述相关文件，或拨打客户服务中心电话(021-38784566)，和本公司客服联系。

泰信基金管理有限公司  
2015年8月25日