

---

泰信优质生活  
股票型证券投资基金 2009 年年度报告摘要  
2009 年 12 月 31 日

基金管理人：泰信基金管理有限公司  
基金托管人：中国银行股份有限公司  
送出日期：2010 年 3 月 31 日

---

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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 2009 年 1 月 1 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       | 泰信优质生活股票             |
| 基金主代码      | 290004               |
| 交易代码       | 290004               |
| 基金运作方式     | 契约型开放式               |
| 基金合同生效日    | 2006 年 12 月 15 日     |
| 基金管理人      | 泰信基金管理有限公司           |
| 基金托管人      | 中国银行股份有限公司           |
| 报告期末基金份额总额 | 1, 974, 175, 323. 46 |
| 基金合同存续期    | 不定期                  |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                          |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 分享中国经济可持续发展过程中那些最能够 满足人们优质生活需求的上市公司的长期稳定增长，在严格控制投资风险的基础上，谋求基金资产的长期稳定增值。                  |
| 投资策略   | 本基金采取“自上而下”的大类资产配置、以核心-卫星策略为基础的优质生活行业配置和“自下而上”的证券精选相结合的投资 策略。                            |
| 业绩比较基准 | 75%*新华富时 A600 指数 + 25%*新华富时国债指数                                                          |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。适合于能够承担一定股市风险，追求资本长期增值的个人和机构投资者。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人           | 基金托管人                    |
|---------|------|-----------------|--------------------------|
| 名称      |      | 泰信基金管理有限公司      | 中国银行股份有限公司               |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 唐国培             | 唐州徽                      |
|         | 联系电话 | 021-50372168    | 010-66594855             |
|         | 电子邮箱 | xxpl@ftfund.com | tgxxpl@bank-of-china.com |
| 客户服务电话  |      | 400-888-5988    | 95566                    |
| 传真      |      | 021-50372197    | 010-66594942             |

### 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 | <a href="http://www.ftfund.com">http://www.ftfund.com</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42F                                 |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2009 年           | 2008 年            | 2007 年           |
|---------------|------------------|-------------------|------------------|
| 本期已实现收益       | 260,647,696.52   | -1,555,848,891.46 | 3,311,616,420.20 |
| 本期利润          | 1,056,868,579.29 | -2,227,682,450.00 | 3,288,357,087.20 |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.4937           | -0.9169           | 0.9674           |
| 本期加权平均净值利润率   | 47.34%           | -85.83%           | 63.50%           |
| 本期基金份额净值增长率   | 65.11%           | -55.01%           | 111.00%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2009 年末          | 2008 年末           | 2007 年末          |
| 期末可供分配利润      | -110,129,135.83  | -607,037,850.75   | 1,318,301,995.01 |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0558          | -0.2697           | 0.4587           |
| 期末基金资产净值      | 2,380,408,231.25 | 1,643,925,592.91  | 4,665,043,750.04 |
| 期末基金份额净值      | 1.2058           | 0.7303            | 1.6231           |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2009 年末          | 2008 年末           | 2007 年末          |
| 基金份额累计净值增长率   | 69.74%           | 2.81%             | 128.49%          |

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，开放式基金的申购费、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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 19.90%   | 1.86%       | 14.63%     | 1.31%         | 5.27%  | 0.55% |
| 过去六个月      | 10.26%   | 2.16%       | 10.91%     | 1.58%         | -0.65% | 0.58% |
| 过去一年       | 65.11%   | 2.07%       | 66.03%     | 1.53%         | -0.92% | 0.54% |
| 过去三年       | 56.76%   | 2.21%       | 58.25%     | 1.89%         | -1.49% | 0.32% |
| 过去五年       | -        | -           | -          | -             | -      | -     |
| 自基金合同生效起至今 | 69.74%   | 2.20%       | 70.54%     | 1.88%         | -0.80% | 0.32% |

注：本基金业绩比较基准为：75%×新华富时中国 A600 指数+25%×新华富时中国国债指数。

新华富时中国 A600 指数是新华富时公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流通市值最大的 600 只

股票并以流通股本加权的股票指数，新华富时中国国债指数涵盖了在上海及深圳交易所交易的到期日至少在一年以上的纯定息债券，是目前中国证券市场中与本基金投资范围比较适配同时公信力较好的股票指数和债券指数。

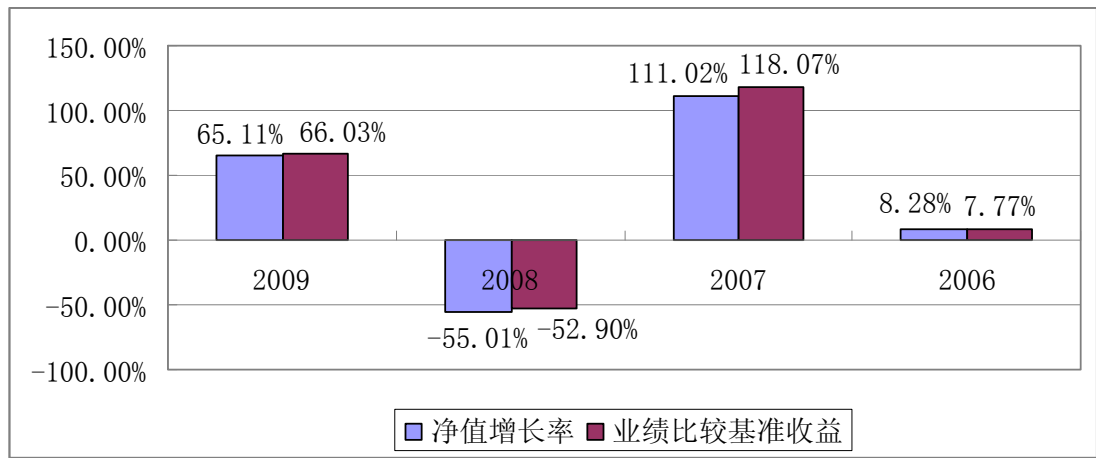
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金基金合同于 2006 年 12 月 15 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：股票资产 60-95%，，债券资产 0%-35%，基金保留的现金以及投资于剩余期限在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

3.2.3 自基金合同生效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



注：本基金合同生效日为 2006 年 12 月 15 日，2006 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度   | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额       | 再投资形式发放总额        | 年度利润分配合计         |
|------|-------------|----------------|------------------|------------------|
| 2009 | -           | -              | -                | -                |
| 2008 | -           | -              | -                | -                |
| 2007 | 5.000       | 466,516,954.02 | 1,111,540,163.49 | 1,578,057,117.51 |
| 合计   | 5.000       | 466,516,954.02 | 1,111,540,163.49 | 1,578,057,117.51 |

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42F

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42F

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：孟凡利

总经理：高清海

电话：(021) 50372168

传真：(021) 50372197

联系人：高海鸥

发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co., Ltd.）是山东省国际信托投资有限公司（现更名为山东省国际信托有限公司）联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司共同发起设立的基金管理公司。公司于 2002 年 9 月 24 日经中国证券监督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。

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

信优势增长、泰信蓝筹精选、泰信增强收益等 7 只开放式基金，基金资产规模 136.27 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务              | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                      |
|-----|-----------------|-----------------|------|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                 | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                         |
| 刘强  | 基金投资副总监、本基金基金经理 | 20070209        | —    | 7      | 工商管理硕士。具有基金从业资格。2002 年 10 月进入泰信基金管理有限公司，先后担任交易员、研究员、泰信先行策略基金经理助理，泰信优质生活基金经理助理。                          |
| 朱志权 | 本基金基金经理         | 20080628        | —    | 13     | 经济学学士。具有基金从业资格。曾任职于中信证券上海总部、长盛基金管理有限公司、富国基金管理有限公司、中海信托管理有限公司、银河基金管理有限公司。2008 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，担任基金经理至今 |
| 崔健  | 本基金基金经理助理       | 20090526        | —    | 3      | 金融学硕士。具有基金从业资格。曾任职于平安资产管理有限公司。2007 年 6 月进入泰信基金管理有限公司，先后担任研究部研究员、高级研究员。                                  |

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

2、基金经理的任职日期以公司公告日期为准。

#### 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守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他有关法律法规、《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》的规定，本着“诚实信用、勤勉尽责，取信于市场、取信于投资者”的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法规及基金合同的约定，未发生损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（中国证券监督管理委员会公告[2008] 9 号）自 2008 年 3 月 20 日起执行。公司相应地制定了《公平交易制度》，适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活

---

动相关的各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

#### **4.3.2 本投资组合与其它投资风格相似的投资组合之间的业绩比较**

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

#### **4.3.3 异常交易行为的专项说明**

报告期内不存在异常交易行为。

### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明**

#### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

2009 年全球及中国经济演绎出政策主导下从“去杠杆”到“再杠杆”的过程。极为宽松的货币环境、纷繁出台的经济刺激方案成功引领实体经济走出低谷并恢复良好。在流动性和基本面相互驱动下，股票、大宗商品等资产价格出现了广泛的、系统性上涨。就国内经济和股票市场而言，上半年信贷增长和内需启动一再超出预期，各种产业、区域发展规划不断对股票价格形成支撑，A 股市场大幅上扬，趋势投资、主题投资成为主基调。对流动性和经济复苏较为敏感的有色金属、煤炭、房地产、汽车、金融等行业涨幅居前。进入下半年，资产价格飞涨以及中长期的通胀压力促发国内政策开始微调，信贷增量受到抑制，房地产调控逐步展开，新股发行明显提速。与此同时，内需强劲增长的势头得以持续，发达经济体补充库存带动出口有所恢复，企业盈利快速回升。股票市场的核心驱动因素也由流动性向盈利增长过渡，投资者的风险偏好显著改变，家电、汽车、医药、食品饮料、电子元器件等行业表现较好。

本基金坚持全年高仓位运作，主要资产配置适当。在今年 2 月份和 8 月中旬部分投资者预期的经济“二次探底”期间，均保持了较高的仓位水平，这一策略在 2009 年大幅上涨的 A 股市场较为成功。在资产配置上重点配置了地产、医药、零售、煤炭、电力设备、有色金属等，对家用电器、交运设备等行业研究不深刻，配置较少。另外，对市场风格变化研究不足，在大小盘的切换过程中的效果不理想，也在一定程度上加剧了净值的波动和损失。

---

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2009 年 12 月 31 日，泰信优质生活基金净值为 1.2058 元，年度基金净值增长率为 65.11%，业绩比较基准涨幅为 66.03 %。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国对金融危机的成功治理避免了国内陷入长期停滞的风险，但如何调整 and 改变失衡的发展模式，摆脱对投资和出口的过度依赖，降低资源投入对经济增长的约束，依然是未来中国经济发展的主旨。展望 2010 年的宏观经济和资本市场，美国经济和美元趋势仍是全球宏观的核心问题之一，美国经济增长的内生动力已经有所恢复，下一阶段库存和设备投资有望继续强化其实体经济的复苏趋势，美元可能会随之结束单边下跌而保持相对强势，在增长优先于通胀的政策倾向下，我们认为联储加息的具体时点取决于美国房地产和信贷体系的修复进程。其次，从更为长期的视角审视中国经济，贸易顺差对周期性增长的贡献将趋于下降，投资会在区域经济平衡、新兴产业发展等方面继续发挥作用，城镇化、消费升级将为国内相关产业带来广泛的发展机遇。再次，在经济增长回到正常轨道的前提下，不排除因通胀变化而出现信贷供给被动收缩的可能性。最后，尽管 A 股相对其他金融资产具备较强的吸引力，但市场估值的持续性上升有赖于流动性和基本面的超预期变化，市场出现类似 09 年系统性、趋势性上升的可能性不大，估值波动更多地表现为区间震荡。

本基金将在防范系统性风险的前提下，一方面，在供给偏紧或存在瓶颈的传统产业部门中寻找投资机会，另一方面，重点研究在新的经济发展格局当中盈利模式和增长潜力较为突出的标的。预计食品饮料、化工、农业、零售、军工、家用电器、电子元器件、有色金属、煤炭等行业机会较大。此外，世博会以及海南、新疆等区域表现或主题投资值得关注。泰信优质生活证券投资基金将继续奉行“优质投资创造优质生活”的理念，规范运作，勤勉尽责，为基金持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 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，7 年基金从业经验，2002 年加入泰信基金管理有限公司，现任公司风

---

险管理部经理。

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

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

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

梁剑先生，硕士，具有 11 年证券从业经验，曾历任期货交易所研究员、券商研究员。2004 年 7 月加入泰信基金，现任研究部副总监兼泰信先行策略混合基金基金经理。

2、本基金基金经理不参与本基金的估值。

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) 基金收益分配采用现金方式，投资者可选择将获取的现金红利自动转为基金份额进行再投资； 基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

(3) 基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；

(4) 基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；

(5) 如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；

(6) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少 1 次；

(7) 全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 50%。基金合同生效不满三个月， 收益可不分配；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

2、本报告期利润分配情况的说明：

本基金基金合同于 2006 年 12 月 15 日正式生效。截止至 2009 年 12 月 31 日，本基金本期已实现收益为 260,647,696.52 元，可供分配利润为-110,129,135.83 元，不满足基金分红条件。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在泰信优质生活股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告/半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

中国银行  
2010年3月26日

## § 6 审计报告

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。  
投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：泰信优质生活股票型证券投资基金  
报告截止日：2009年12月31日

单位：人民币元

| 资 产  | 附注号 | 本期末<br>2009年12月31日 | 上年度末<br>2008年12月31日 |
|------|-----|--------------------|---------------------|
| 资 产： |     |                    |                     |

|                   |            |                            |                             |
|-------------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 银行存款              | 7.4.7.1    | 117,119,229.34             | 139,558,856.81              |
| 结算备付金             |            | 6,509,655.28               | 3,666,792.95                |
| 存出保证金             |            | 5,192,851.33               | 2,750,000.00                |
| 交易性金融资产           | 7.4.7.2    | 2,235,743,515.24           | 1,502,628,499.94            |
| 其中：股票投资           |            | 2,235,743,515.24           | 1,308,107,481.94            |
| 债券投资              |            | -                          | 194,521,018.00              |
| 资产支持证券投资          |            | -                          | -                           |
| 衍生金融资产            | 7.4.7.3    | -                          | 308,116.25                  |
| 买入返售金融资产          | 7.4.7.4    | -                          | -                           |
| 应收证券清算款           |            | 29,362,838.76              | -                           |
| 应收利息              | 7.4.7.5    | 24,943.26                  | 2,054,443.24                |
| 应收股利              |            | -                          | -                           |
| 应收申购款             |            | 417,566.67                 | 4,151.88                    |
| 其它资产              | 7.4.7.6    | 13,482.77                  | 33,723.30                   |
| <b>资产总计</b>       |            | <b>2,394,384,082.65</b>    | <b>1,651,004,584.37</b>     |
| <b>负债和所有者权益</b>   | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2009年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2008年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>       |            |                            |                             |
| 短期借款              |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债           |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债            | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款         |            | -                          | -                           |
| 应付证券清算款           |            | -                          | -                           |
| 应付赎回款             |            | 4,322,213.78               | 186,829.97                  |
| 应付管理人报酬           |            | 3,028,810.19               | 2,151,840.31                |
| 应付托管费             |            | 504,801.71                 | 358,640.04                  |
| 应付销售服务费           |            | -                          | -                           |
| 应付交易费用            | 7.4.7.7    | 2,461,294.07               | 1,226,856.32                |
| 应交税费              |            | -                          | -                           |
| 应付利息              |            | -                          | -                           |
| 应付利润              |            | -                          | -                           |
| 其它负债              | 7.4.7.8    | 3,658,731.65               | 3,154,824.82                |
| <b>负债合计</b>       |            | <b>13,975,851.40</b>       | <b>7,078,991.46</b>         |
| <b>所有者权益：</b>     |            |                            |                             |
| 实收基金              | 7.4.7.9    | 1,974,175,323.46           | 2,250,963,443.66            |
| 未分配利润             | 7.4.7.10   | 406,232,907.79             | -607,037,850.75             |
| <b>所有者权益合计</b>    |            | <b>2,380,408,231.25</b>    | <b>1,643,925,592.91</b>     |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |            | <b>2,394,384,082.65</b>    | <b>1,651,004,584.37</b>     |

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2058 元，基金份额总额 1,974,175,323.46 份。

## 7.2 利润表

会计主体：泰信优质生活股票型证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号         | 本期<br>2009 年 1 月 1 日至<br>2009 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2008 年 1 月 1 日至<br>2008 年 12 月 31 日 |
|------------------------|-------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>            |             | <b>1, 120, 010, 849. 17</b>               | <b>-2, 141, 137, 836. 34</b>                   |
| 1. 利息收入                |             | 4, 124, 457. 71                           | 13, 300, 775. 55                               |
| 其中：存款利息收入              | 7. 4. 7. 11 | 898, 771. 52                              | 2, 719, 576. 81                                |
| 债券利息收入                 |             | 3, 225, 686. 19                           | 10, 429, 285. 94                               |
| 资产支持证券利息收入             |             | -                                         | -                                              |
| 买入返售金融资产收入             |             | -                                         | 151, 912. 80                                   |
| 其它利息收入                 |             | -                                         | -                                              |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |             | 318, 774, 744. 09                         | -1, 483, 948, 010. 55                          |
| 其中：股票投资收益              | 7. 4. 7. 12 | 312, 145, 023. 15                         | -1, 491, 142, 530. 95                          |
| 债券投资收益                 | 7. 4. 7. 13 | -8, 360, 925. 33                          | -9, 401, 047. 11                               |
| 资产支持证券投资收益             |             | -                                         | -                                              |
| 衍生工具收益                 | 7. 4. 7. 14 | 448, 320. 44                              | 3, 876, 149. 33                                |
| 股利收益                   | 7. 4. 7. 15 | 14, 542, 325. 83                          | 12, 719, 418. 18                               |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7. 4. 7. 16 | 796, 220, 882. 77                         | -671, 833, 558. 54                             |
| 4. 其它收入（损失以“-”号填列）     | 7. 4. 7. 17 | 890, 764. 60                              | 1, 342, 957. 20                                |
| <b>二、费用</b>            |             | <b>63, 142, 269. 88</b>                   | <b>86, 544, 613. 66</b>                        |
| 1. 管理人报酬               |             | 33, 215, 733. 57                          | 39, 296, 751. 01                               |
| 2. 托管费                 |             | 5, 535, 955. 65                           | 6, 549, 458. 47                                |
| 3. 销售服务费               |             | -                                         | -                                              |
| 4. 交易费用                | 7. 4. 7. 18 | 23, 970, 114. 79                          | 40, 017, 566. 59                               |
| 5. 利息支出                |             | -                                         | 231, 674. 92                                   |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |             | -                                         | 231, 674. 92                                   |
| 6. 其它费用                | 7. 4. 7. 19 | 420, 465. 87                              | 449, 162. 67                                   |
| <b>三、利润总额</b>          |             | <b>1, 056, 868, 579. 29</b>               | <b>-2, 227, 682, 450. 00</b>                   |
| <b>四、净利润</b>           |             | <b>1, 056, 868, 579. 29</b>               | <b>-2, 227, 682, 450. 00</b>                   |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信优质生活股票型证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日 |                      |                      |
|-----------------------------------|----------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                   | 实收基金                                   | 未分配利润                | 所有者权益合计              |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                   | 2, 250, 963, 443. 66                   | -607, 037, 850. 75   | 1, 643, 925, 592. 91 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                      | 1, 056, 868, 579. 29 | 1, 056, 868, 579. 29 |
| 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） | -276, 788, 120. 20                     | -43, 597, 820. 75    | -320, 385, 940. 95   |
| 其中：1. 基金申购款                       | 764, 851, 018. 12                      | 49, 144, 654. 70     | 813, 995, 672. 82    |

|                                            |                                  |                   |                   |
|--------------------------------------------|----------------------------------|-------------------|-------------------|
| 2. 基金赎回款（以“-”号填列）                          | -1,041,639,138.32                | -92,742,475.45    | -1,134,381,613.77 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动<br>（净值减少以“-”号填列） | -                                | -                 | -                 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                            | 1,974,175,323.46                 | 406,232,907.79    | 2,380,408,231.25  |
| 项目                                         | 上年度可比期间<br>2008年1月1日至2008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）                            | 2,874,204,435.95                 | 1,790,839,314.09  | 4,665,043,750.04  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）                   | -                                | -2,227,682,450.00 | -2,227,682,450.00 |
| 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）          | -623,240,992.29                  | -170,194,714.84   | -793,435,707.13   |
| 其中：1. 基金申购款                                | 249,157,400.25                   | 96,129,278.18     | 345,286,678.43    |
| 2. 基金赎回款（以“-”号填列）                          | -872,398,392.54                  | -266,323,993.02   | -1,138,722,385.56 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动<br>（净值减少以“-”号填列） | -                                | -                 | -                 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                            | 2,250,963,443.66                 | -607,037,850.75   | 1,643,925,592.91  |

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：

基金管理公司负责人：高清海

主管会计工作负责人：韩波

会计机构负责人：庞少华

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

泰信优质生活股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]第 229 号《关于同意泰信优质生活股票型证券投资基金设立的批复》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《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,591,255,543.43 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(2006)第 191 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》于 2006 年 12 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,591,662,103.09 份基金份额，其中认购资金利息折合 406,559.66 份基金份额。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》

---

的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的各种股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金组合投资的范围为：股票资产 60%-95%，债券资产 0%-35%，基金保留的现金以及投资于剩余期限在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：75%X 新华富时 A 600 指数+25%X 新华富时国债指数。

本财务报表由本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司于 2010 年 3 月 29 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其它有关规定的声明

本基金 2009 年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 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

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

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

(5) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 7.4.6 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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”)  | 基金托管人、基金代销机构        |
| 山东省国际信托有限公司(“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。

#### 7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.7.1 通过关联方交易单人民币元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易：无

7.4.7.1.2 权证交易：无

7.4.7.1.3 应支付关联方的佣金：无

##### 7.4.7.2 关联方报酬

###### 7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2009 年 1 月 1 日至<br>2009 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2008 年 1 月 1 日至<br>2008 年 12 月 31 日 |
|-----------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 33,215,733.57                             | 39,296,751.01                                  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,859,236.24                              | 4,511,066.23                                   |

注：支付基金管理人泰信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

###### 7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2009 年 1 月 1 日至<br>2009 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2008 年 1 月 1 日至<br>2008 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,535,955.65                              | 6,549,458.47                                   |

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期<br>2009年1月1日至2009年12月31日                 |                |                |       |      |       |      |
|---------------------------------------------|----------------|----------------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                          | 债券交易金额         |                | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                             | 基金买入           | 基金卖出           | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| -                                           | -              | -              | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间<br>2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日 |                |                |       |      |       |      |
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                          | 债券交易金额         |                | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                             | 基金买入           | 基金卖出           | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 中国银行                                        | 297,711,152.46 | 299,366,690.17 | -     | -    | -     | -    |

#### 7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                    | 本期<br>2009 年 1 月 1 日至<br>2009 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2008 年 1 月 1 日至<br>2008 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 期初持有的基金份额             | 6,041,839.87                              | 6,041,839.87                                   |
| 期间申购总份额               | 11,365,082.97                             | -                                              |
| 期间因拆分变动份额             | -                                         | -                                              |
| 减：期间赎回总份额             | -                                         | -                                              |
| 期末持有的基金份额             | 17,406,922.84                             | 6,041,839.87                                   |
| 期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例 | 0.88%                                     | 0.27%                                          |

注：基金管理人泰信基金管理有限公司在本年度申购本基金的交易委托中国银行办理，适用手续费为人民币 1000.00 元。

##### 7.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其它关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2009 年 12 月 31 日 |                      | 上年度末<br>2008 年 12 月 31 日 |                      |
|-------|-------------------------|----------------------|--------------------------|----------------------|
|       | 持有的<br>基金份额             | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例 | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例 |
| 青岛国信  | 27,014,655.82           | 1.37%                | 27,014,655.82            | 1.20%                |

#### 7.4.7.5 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<br>2009年1月1日至2009年12月31日 |            | 上年度可比期间<br>2008年1月1日至2008年12月31日 |              |
|-------|-----------------------------|------------|----------------------------------|--------------|
|       | 期末余额                        | 当期利息收入     | 期末余额                             | 当期利息收入       |
| 中国银行  | 117,119,229.34              | 816,126.74 | 139,558,856.81                   | 2,628,978.56 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期参与关联方承销证券。

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

##### 7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |            |        |          |            |        |            |            |        |
|----------------------|------|------------|------------|--------|----------|------------|--------|------------|------------|--------|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功<br>认购日  | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购<br>价格 | 期末估值<br>单价 | 数量（股）  | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备<br>注 |
| 300015               | 爱尔眼科 | 2009-10-15 | 2010-02-01 | 新股网下申购 | 28.00    | 48.80      | 11,513 | 322,364.00 | 561,834.40 | -      |

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

##### 7.4.8.2 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<br>估值单价 | 复牌日期       | 复牌<br>开盘单价 | 数量（股）   | 期末成本总额        | 期末估值总额        | 备<br>注 |
|--------|------|------------|--------|------------|------------|------------|---------|---------------|---------------|--------|
| 600359 | 新农开发 | 2009-12-22 | 资产重组   | 20.87      | 2010-01-21 | 19.05      | 570,000 | 13,093,670.98 | 11,895,900.00 | -      |
| 600739 | 辽宁成大 | 2009-12-28 | 公告重大事项 | 38.09      | 2010-01-11 | 41.90      | 100,000 | 3,494,873.83  | 3,809,000.00  | -      |

注：本基金截至2009年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2009年12月31日止，本基金无银行间市场债券正回购。

###### 7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2009年12月31日止，本基金无证券交易所债券正回购。

##### 7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其它事项

无。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 2,235,743,515.24 | 93.37         |
|    | 其中：股票             | 2,235,743,515.24 | 93.37         |
| 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      | 123,628,884.62   | 5.16          |
| 6  | 其它各项资产            | 35,011,682.79    | 1.46          |
|    | 合计                | 2,394,384,082.65 | 100.00        |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码  | 行业类别           | 公允价值             | 占基金资产净值比例 (%) |
|-----|----------------|------------------|---------------|
| A   | 农、林、牧、渔业       | 155,458,149.06   | 6.53          |
| B   | 采掘业            | 292,890,700.00   | 12.30         |
| C   | 制造业            | 1,155,260,901.78 | 48.53         |
| C0  | 食品、饮料          | 90,436,998.20    | 3.80          |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | 4,353,000.00     | 0.18          |
| C2  | 木材、家具          | -                | -             |
| C3  | 造纸、印刷          | 1,850,792.80     | 0.08          |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 88,839,955.92    | 3.73          |
| C5  | 电子             | 309,263,479.00   | 12.99         |
| C6  | 金属、非金属         | 29,302,422.40    | 1.23          |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 438,991,153.46   | 18.44         |
| C8  | 医药、生物制品        | 192,012,000.00   | 8.07          |
| C99 | 其它制造业          | 211,100.00       | 0.01          |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | -                | -             |
| E   | 建筑业            | -                | -             |
| F   | 交通运输、仓储业       | -                | -             |
| G   | 信息技术业          | 87,211,265.00    | 3.66          |
| H   | 批发和零售贸易        | 160,399,875.00   | 6.74          |
| I   | 金融、保险业         | 4,474,200.00     | 0.19          |

|   |         |                  |       |
|---|---------|------------------|-------|
| J | 房地产业    | 100,187,850.00   | 4.21  |
| K | 社会服务业   | 11,358,674.40    | 0.48  |
| L | 传播与文化产业 | -                | -     |
| M | 综合类     | 268,501,900.00   | 11.28 |
|   | 合计      | 2,235,743,515.24 | 93.92 |

### 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

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  | 000009 | 中国宝安 | 9,500,000  | 104,310,000.00 | 4.38         |
| 2  | 600584 | 长电科技 | 11,700,000 | 102,375,000.00 | 4.30         |
| 3  | 002179 | 中航光电 | 4,700,000  | 99,029,000.00  | 4.16         |
| 4  | 600380 | 健康元  | 8,270,000  | 96,593,600.00  | 4.06         |
| 5  | 600655 | 豫园商城 | 3,510,000  | 95,928,300.00  | 4.03         |
| 6  | 000933 | 神火股份 | 2,600,000  | 95,888,000.00  | 4.03         |
| 7  | 000016 | 深康佳A | 11,300,000 | 86,897,000.00  | 3.65         |
| 8  | 600195 | 中牧股份 | 4,190,000  | 84,931,300.00  | 3.57         |
| 9  | 600354 | 敦煌种业 | 4,500,000  | 81,675,000.00  | 3.43         |
| 10 | 002155 | 辰州矿业 | 3,200,000  | 81,472,000.00  | 3.42         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www.ftfund.com网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内权益投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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  | 000009 | 中国宝安 | 201,574,891.67 | 12.26          |
| 2  | 000937 | 金牛能源 | 172,531,884.15 | 10.50          |
| 3  | 002155 | 辰州矿业 | 157,181,853.47 | 9.56           |
| 4  | 600606 | 金丰投资 | 155,070,552.31 | 9.43           |
| 5  | 600655 | 豫园商城 | 151,442,931.19 | 9.21           |
| 6  | 600622 | 嘉宝集团 | 144,608,127.91 | 8.80           |
| 7  | 000758 | 中色股份 | 133,907,986.99 | 8.15           |
| 8  | 600739 | 辽宁成大 | 132,641,022.54 | 8.07           |

|    |        |      |                |      |
|----|--------|------|----------------|------|
| 9  | 600675 | 中华企业 | 130,982,573.24 | 7.97 |
| 10 | 600193 | 创兴置业 | 127,564,621.80 | 7.76 |
| 11 | 600549 | 厦门钨业 | 127,031,183.64 | 7.73 |
| 12 | 000623 | 吉林敖东 | 127,012,782.97 | 7.73 |
| 13 | 002179 | 中航光电 | 126,112,439.46 | 7.67 |
| 14 | 600508 | 上海能源 | 119,350,220.16 | 7.26 |
| 15 | 600869 | 三普药业 | 112,113,698.70 | 6.82 |
| 16 | 000933 | 神火股份 | 109,157,516.83 | 6.64 |
| 17 | 600195 | 中牧股份 | 108,642,768.11 | 6.61 |
| 18 | 002073 | 青岛软控 | 104,403,902.57 | 6.35 |
| 19 | 600354 | 敦煌种业 | 93,919,766.67  | 5.71 |
| 20 | 000927 | 一汽夏利 | 92,878,409.76  | 5.65 |
| 21 | 601168 | 西部矿业 | 91,839,225.19  | 5.59 |
| 22 | 600380 | 健康元  | 91,546,838.23  | 5.57 |
| 23 | 000969 | 安泰科技 | 91,435,042.80  | 5.56 |
| 24 | 600584 | 长电科技 | 90,556,561.20  | 5.51 |
| 25 | 000423 | 东阿阿胶 | 87,965,325.80  | 5.35 |
| 26 | 000562 | 宏源证券 | 82,555,243.87  | 5.02 |
| 27 | 600151 | 航天机电 | 82,174,289.63  | 5.00 |
| 28 | 000016 | 深康佳A | 80,012,681.15  | 4.87 |
| 29 | 600971 | 恒源煤电 | 79,026,928.25  | 4.81 |
| 30 | 601808 | 中海油服 | 78,958,449.00  | 4.80 |
| 31 | 000815 | 美利纸业 | 77,349,964.60  | 4.71 |
| 32 | 601899 | 紫金矿业 | 77,257,907.31  | 4.70 |
| 33 | 000584 | 友利控股 | 77,147,643.74  | 4.69 |
| 34 | 000800 | 一汽轿车 | 75,468,023.10  | 4.59 |
| 35 | 601919 | 中国远洋 | 74,829,376.50  | 4.55 |
| 36 | 600649 | 城投控股 | 73,608,622.47  | 4.48 |
| 37 | 000651 | 格力电器 | 72,767,233.57  | 4.43 |
| 38 | 000677 | 山东海龙 | 70,549,527.02  | 4.29 |
| 39 | 600550 | 天威保变 | 69,923,231.30  | 4.25 |
| 40 | 000031 | 中粮地产 | 69,249,760.20  | 4.21 |
| 41 | 601088 | 中国神华 | 67,152,886.04  | 4.08 |
| 42 | 600219 | 南山铝业 | 64,903,218.42  | 3.95 |
| 43 | 000568 | 泸州老窖 | 64,387,645.55  | 3.92 |
| 44 | 600467 | 好当家  | 62,828,706.06  | 3.82 |
| 45 | 600036 | 招商银行 | 62,062,429.18  | 3.78 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 46 | 002083 | 孚日股份 | 61,286,726.87 | 3.73 |
| 47 | 000021 | 长城开发 | 59,761,920.11 | 3.64 |
| 48 | 000514 | 渝开发  | 59,428,747.17 | 3.62 |
| 49 | 600391 | 成发科技 | 59,302,964.57 | 3.61 |
| 50 | 000069 | 华侨城A | 58,765,646.73 | 3.57 |
| 51 | 000983 | 西山煤电 | 54,943,382.67 | 3.34 |
| 52 | 000978 | 桂林旅游 | 54,318,130.65 | 3.30 |
| 53 | 000826 | 合加资源 | 53,969,928.84 | 3.28 |
| 54 | 000636 | 风华高科 | 53,551,719.52 | 3.26 |
| 55 | 000527 | 美的电器 | 52,935,666.12 | 3.22 |
| 56 | 601918 | 国投新集 | 52,674,925.94 | 3.20 |
| 57 | 600251 | 冠农股份 | 49,791,692.87 | 3.03 |
| 58 | 600030 | 中信证券 | 48,669,716.05 | 2.96 |
| 59 | 600519 | 贵州茅台 | 48,266,330.46 | 2.94 |
| 60 | 600100 | 同方股份 | 47,811,341.53 | 2.91 |
| 61 | 600016 | 民生银行 | 47,419,754.43 | 2.88 |
| 62 | 000767 | 漳泽电力 | 47,409,489.44 | 2.88 |
| 63 | 002025 | 航天电器 | 47,215,970.28 | 2.87 |
| 64 | 000680 | 山推股份 | 47,090,596.00 | 2.86 |
| 65 | 600438 | 通威股份 | 44,286,122.60 | 2.69 |
| 66 | 600050 | 中国联通 | 42,932,310.28 | 2.61 |
| 67 | 000792 | 盐湖钾肥 | 41,736,726.46 | 2.54 |
| 68 | 601601 | 中国太保 | 41,134,575.56 | 2.50 |
| 69 | 600895 | 张江高科 | 39,403,922.92 | 2.40 |
| 70 | 000002 | 万科A  | 38,353,711.80 | 2.33 |
| 71 | 600704 | 中大股份 | 38,215,686.14 | 2.32 |
| 72 | 600122 | 宏图高科 | 35,960,882.25 | 2.19 |
| 73 | 000612 | 焦作万方 | 34,746,893.67 | 2.11 |
| 74 | 601958 | 金钼股份 | 34,278,642.83 | 2.09 |
| 75 | 000869 | 张裕A  | 33,364,212.89 | 2.03 |
| 76 | 002107 | 沃华医药 | 33,193,333.45 | 2.02 |

#### 8.4.2 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  | 000758 | 中色股份 | 157,763,366.76 | 9.60           |
| 2  | 000933 | 神火股份 | 150,093,807.05 | 9.13           |

|    |        |       |                |      |
|----|--------|-------|----------------|------|
| 3  | 600739 | 辽宁成大  | 147,846,926.11 | 8.99 |
| 4  | 600549 | 厦门钨业  | 147,097,696.47 | 8.95 |
| 5  | 000623 | 吉林敖东  | 135,119,232.13 | 8.22 |
| 6  | 600518 | 康美药业  | 134,702,542.77 | 8.19 |
| 7  | 600550 | 天威保变  | 132,878,756.42 | 8.08 |
| 8  | 600655 | 豫园商城  | 123,879,229.81 | 7.54 |
| 9  | 000009 | 中国宝安  | 123,860,117.96 | 7.53 |
| 10 | 000969 | 安泰科技  | 122,570,105.88 | 7.46 |
| 11 | 600606 | 金丰投资  | 119,422,852.97 | 7.26 |
| 12 | 601899 | 紫金矿业  | 116,967,663.68 | 7.12 |
| 13 | 600508 | 上海能源  | 111,266,520.28 | 6.77 |
| 14 | 002073 | 青岛软控  | 111,265,096.24 | 6.77 |
| 15 | 600895 | 张江高科  | 110,815,552.31 | 6.74 |
| 16 | 002083 | 孚日股份  | 109,329,112.95 | 6.65 |
| 17 | 000568 | 泸州老窖  | 106,958,002.37 | 6.51 |
| 18 | 000069 | 华侨城 A | 93,973,569.35  | 5.72 |
| 19 | 002155 | 辰州矿业  | 93,159,895.42  | 5.67 |
| 20 | 000937 | 金牛能源  | 92,942,831.84  | 5.65 |
| 21 | 600869 | 三普药业  | 92,631,447.56  | 5.63 |
| 22 | 600036 | 招商银行  | 90,974,413.95  | 5.53 |
| 23 | 601168 | 西部矿业  | 89,569,741.01  | 5.45 |
| 24 | 600016 | 民生银行  | 87,766,018.77  | 5.34 |
| 25 | 000815 | 美利纸业  | 87,308,829.81  | 5.31 |
| 26 | 601088 | 中国神华  | 86,872,887.42  | 5.28 |
| 27 | 600649 | 城投控股  | 86,113,177.98  | 5.24 |
| 28 | 600219 | 南山铝业  | 84,465,470.44  | 5.14 |
| 29 | 600151 | 航天机电  | 84,248,130.58  | 5.12 |
| 30 | 000978 | 桂林旅游  | 83,146,702.73  | 5.06 |
| 31 | 000800 | 一汽轿车  | 81,718,755.19  | 4.97 |
| 32 | 600622 | 嘉宝集团  | 81,411,729.57  | 4.95 |
| 33 | 600675 | 中华企业  | 79,914,116.21  | 4.86 |
| 34 | 000562 | 宏源证券  | 78,550,814.61  | 4.78 |
| 35 | 000677 | 山东海龙  | 78,251,298.31  | 4.76 |
| 36 | 600519 | 贵州茅台  | 76,203,562.53  | 4.64 |
| 37 | 000869 | 张 裕 A | 74,250,112.45  | 4.52 |
| 38 | 601919 | 中国远洋  | 74,014,368.81  | 4.50 |
| 39 | 601808 | 中海油服  | 73,879,932.04  | 4.49 |
| 40 | 000826 | 合加资源  | 73,771,497.85  | 4.49 |
| 41 | 600971 | 恒源煤电  | 73,150,879.50  | 4.45 |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 42 | 000031 | 中粮地产  | 69,503,309.59 | 4.23 |
| 43 | 002179 | 中航光电  | 66,827,068.62 | 4.07 |
| 44 | 600391 | 成发科技  | 66,638,950.67 | 4.05 |
| 45 | 002025 | 航天电器  | 65,024,434.35 | 3.96 |
| 46 | 000514 | 渝 开 发 | 63,660,766.62 | 3.87 |
| 47 | 000584 | 友利控股  | 62,704,944.60 | 3.81 |
| 48 | 600456 | 宝钛股份  | 58,361,214.90 | 3.55 |
| 49 | 600309 | 烟台万华  | 56,060,028.42 | 3.41 |
| 50 | 601918 | 国投新集  | 55,840,271.63 | 3.40 |
| 51 | 600030 | 中信证券  | 53,567,399.24 | 3.26 |
| 52 | 000636 | 风华高科  | 53,010,933.66 | 3.22 |
| 53 | 600100 | 同方股份  | 52,531,545.46 | 3.20 |
| 54 | 000001 | 深发展 A | 52,493,607.72 | 3.19 |
| 55 | 600050 | 中国联通  | 52,467,636.20 | 3.19 |
| 56 | 600000 | 浦发银行  | 50,158,428.36 | 3.05 |
| 57 | 601318 | 中国平安  | 49,794,041.80 | 3.03 |
| 58 | 002241 | 歌尔声学  | 48,181,105.00 | 2.93 |
| 59 | 600276 | 恒瑞医药  | 47,417,213.34 | 2.88 |
| 60 | 601601 | 中国太保  | 47,164,409.12 | 2.87 |
| 61 | 000927 | 一汽夏利  | 45,318,950.50 | 2.76 |
| 62 | 000060 | 中金岭南  | 44,264,943.17 | 2.69 |
| 63 | 600966 | 博汇纸业  | 43,808,970.84 | 2.66 |
| 64 | 600438 | 通威股份  | 41,886,368.05 | 2.55 |
| 65 | 600879 | 航天电子  | 40,810,823.66 | 2.48 |
| 66 | 000338 | 潍柴动力  | 40,697,943.83 | 2.48 |
| 67 | 000612 | 焦作万方  | 40,093,298.97 | 2.44 |
| 68 | 000767 | 漳泽电力  | 39,940,238.71 | 2.43 |
| 69 | 600354 | 敦煌种业  | 39,806,083.52 | 2.42 |
| 70 | 000680 | 山推股份  | 39,571,819.25 | 2.41 |
| 71 | 002024 | 苏宁电器  | 39,264,218.26 | 2.39 |
| 72 | 601958 | 金钼股份  | 38,699,335.49 | 2.35 |
| 73 | 000002 | 万 科 A | 38,118,999.35 | 2.32 |
| 74 | 600858 | 银座股份  | 38,037,397.98 | 2.31 |
| 75 | 600177 | 雅戈尔   | 38,004,193.36 | 2.31 |
| 76 | 600704 | 中大股份  | 37,380,002.38 | 2.27 |
| 77 | 600193 | 创兴置业  | 36,420,840.48 | 2.22 |
| 78 | 600963 | 岳阳纸业  | 35,924,572.10 | 2.19 |
| 79 | 600251 | 冠农股份  | 35,483,397.16 | 2.16 |
| 80 | 002107 | 沃华医药  | 34,651,935.25 | 2.11 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 81 | 600089 | 特变电工 | 34,522,931.16 | 2.10 |
| 82 | 600737 | 中粮屯河 | 34,166,338.37 | 2.08 |
| 83 | 600720 | 祁连山  | 34,014,221.95 | 2.07 |
| 84 | 000423 | 东阿阿胶 | 33,918,586.64 | 2.06 |

#### 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 | 7,776,865,561.97 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 7,959,302,556.65 |

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 2008年10月8日，深康佳因其在财政部2007年度会计信息质量检查中被查出问题，收到财政部驻深圳财政监察专员办事处的《行政处罚决定书》（财驻深监[2008]131号），处罚款8万元，补缴企业所得税30万元。对该股票的投资决策程序的说明：本基金管理人经过研究认为该处罚数额很小，不影响深康佳的正常经营活动，该处罚所涉及的财务会计信息的追溯调整也只涉及2007年度的会计信息，与2009年的会计信息无关。本基金认为该公司经营情况良好，家电行业受到国家的大力支持发展迅速，该公司作为行业中龙头公司之一，具有投资价值，因此决定继续投资该公司。本基金在这一投资过程中经过投研团队的深入研究，严格遵守了本基金的投资决策程序。

除此之外，报告期内本基金投资的前十名证券的其他发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

8.9.2 本报告期内基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的股票备选库。

#### 8.9.3 期末其它各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额           |
|----|-------|--------------|
| 1  | 存出保证金 | 5,192,851.33 |

|   |         |               |
|---|---------|---------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 29,362,838.76 |
| 3 | 应收股利    | -             |
| 4 | 应收利息    | 24,943.26     |
| 5 | 应收申购款   | 417,566.67    |
| 6 | 其它应收款   | 13,482.77     |
| 7 | 待摊费用    | -             |
| 8 | 其它      | -             |
|   | 合计      | 35,011,682.79 |

#### 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.9.6 投资组合报告附注的其它文字描述部分

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

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>比例 | 持有份额             | 占总份额<br>比例 |
| 83,753       | 23,571.40     | 149,870,219.12 | 7.59%      | 1,824,305,104.34 | 92.41%     |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

| 项目                   | 持有份额总数(份)  | 占基金总份额比例 |
|----------------------|------------|----------|
| 基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金 | 292,301.77 | 0.01%    |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                  |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2006年12月15日）基金份额总额 | 1,591,662,103.09 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 2,250,963,443.66 |

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 本报告期基金总申购份额   | 764,851,018.12   |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 1,041,639,138.32 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额  | 1,974,175,323.46 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

2、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 11.4 基金投资策略的改变

无。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费用为人民币10万元。该审计机构从基金合同生效日（2006年12月15日）开始为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、上海证监局于2009年6月1日至6月5日对本基金管理人泰信基金管理有限公司对公司2005年以来的经营情况进行了现场检查。并于2009年9月29日向公司出具了《关于泰信基金管理有限公司现场检查的整改意见函》（以下简称《意见函》），认为公司副总经理长期缺位，

不符合公司章程对管理层组织架构的规定，过去的部分基金投资中出现异常交叉交易情况，公司自有资金投资未能严格执行公司的自有资金投资管理规定，存在超范围投资于短期融资券的现象等。《意见函》对管理人在公司治理结构、投研管理、风险控制体系和监察稽核工作、人员资格管理等方面提出了整改意见，并对公司有关责任人采取了监管谈话、记入诚信档案和出具警示函等行政监管措施。

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

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

2、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易             |              | 应支付该券商的佣金    |            | 备注         |
|------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|------------|
|      |        | 成交金额             | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金           | 占当期佣金总量的比例 |            |
| 安信证券 | 1      | 2,084,322,853.70 | 13.27%       | 1,771,669.93 | 13.54%     |            |
| 渤海证券 | 1      | 424,886,726.56   | 2.70%        | 361,153.61   | 2.76%      |            |
| 长财证券 | 1      | 132,850,797.43   | 0.85%        | 107,942.61   | 0.82%      |            |
| 东方证券 | 1      | 370,878,300.79   | 2.36%        | 301,341.58   | 2.30%      |            |
| 光大证券 | 1      | 149,267,812.93   | 0.95%        | 126,875.78   | 0.97%      |            |
| 广发证券 | 1      | 129,574,967.86   | 0.82%        | 110,137.91   | 0.84%      |            |
| 国泰君安 | 1      | 808,801,438.14   | 5.15%        | 657,155.67   | 5.02%      |            |
| 国信证券 | 1      | 600,750,146.60   | 3.82%        | 510,635.14   | 3.90%      |            |
| 国元证券 | 1      | 1,515,011,983.45 | 9.64%        | 1,287,751.41 | 9.84%      |            |
| 华宝证券 | 1      | 551,897,527.82   | 3.51%        | 448,421.15   | 3.43%      |            |
| 江海证券 | 1      | 1,309,238,103.58 | 8.33%        | 1,063,762.52 | 8.13%      | 新增         |
| 江南证券 | 1      | 977,449,242.80   | 6.22%        | 794,185.91   | 6.07%      |            |
| 华泰联合 | 1      | 1,564,127,899.61 | 9.95%        | 1,270,867.82 | 9.71%      | 原联合更名为华泰联合 |
| 上海证券 | 1      | 579,545,837.21   | 3.69%        | 492,613.13   | 3.77%      |            |
| 申银万国 | 1      | 13,409,886.46    | 0.09%        | 11,398.35    | 0.09%      |            |

|       |   |                  |       |            |       |                           |
|-------|---|------------------|-------|------------|-------|---------------------------|
| 万联证券  | 1 | 252,144,234.75   | 1.60% | 214,323.27 | 1.64% |                           |
| 五矿证券  | 1 | 128,881,396.20   | 0.82% | 104,716.78 | 0.80% | 新增                        |
| 新时代证券 | 1 | 200,254,235.50   | 1.27% | 170,215.79 | 1.30% | 退租                        |
| 华泰证券  | 1 | 233,589,780.86   | 1.49% | 189,794.03 | 1.45% | 此交易单元原为信泰证券所有，该公司后并入华泰证券。 |
| 招商证券  | 1 | 445,867,985.99   | 2.84% | 362,273.51 | 2.77% |                           |
| 中投证券  | 1 | 652,210,494.07   | 4.15% | 554,380.50 | 4.24% |                           |
| 中金公司  | 1 | 133,485,248.47   | 0.85% | 113,462.45 | 0.87% | 新增                        |
| 中信建投  | 1 | 1,082,955,142.13 | 6.89% | 920,503.43 | 7.04% |                           |
| 中信证券  | 2 | 854,956,856.14   | 5.44% | 726,709.23 | 5.55% |                           |
| 中银国际  | 2 | 252,852,054.47   | 1.61% | 205,445.13 | 1.57% |                           |
| 国金证券  | 1 | 253,838,201.01   | 1.62% | 206,246.27 | 1.58% | 退租                        |
| 大通证券  | 1 | -                | -     | -          | -     |                           |
| 第一创业  | 1 | -                | -     | -          | -     |                           |
| 东海证券  | 1 | -                | -     | -          | -     |                           |
| 海通证券  | 2 | -                | -     | -          | -     |                           |
| 金元证券  | 1 | -                | -     | -          | -     |                           |
| 南京证券  | 1 | -                | -     | -          | -     |                           |
| 西南证券  | 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。

2、本基金与公司旗下在中国银行托管的其他基金共用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其它证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易          |              | 债券回购交易 |                | 权证交易       |              |
|------|---------------|--------------|--------|----------------|------------|--------------|
|      | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额       | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东方证券 | 12,983,745.83 | 8.47%        | -      | -              | -          | -            |
| 国信证券 | 19,500,265.14 | 12.72%       | -      | -              | -          | -            |
| 华泰联合 | -             | -            | -      | -              | 448,320.44 | 100.00%      |
| 国泰君安 | 36,772,214.00 | 23.99%       | -      | -              | -          | -            |
| 国元证券 | 11,792,622.10 | 7.69%        | -      | -              | -          | -            |

|      |               |        |   |   |   |   |
|------|---------------|--------|---|---|---|---|
| 安信证券 | 358,810.00    | 0.23%  | - | - | - | - |
| 中银国际 | 9,529,650.70  | 6.22%  | - | - | - | - |
| 江海证券 | 61,623,616.65 | 40.20% | - | - | - | - |
| 中金公司 | 722,400.00    | 0.47%  | - | - | - | - |

泰信基金管理有限公司

2010 年 3 月 31 日