泰信增强收益

债券型证券投资基金 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	泰信债券增强收益	
基金主代码	290007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 7 月 29 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	719,662,329.14	
基金合同存续期	不定期	
	A 类	C 类
下属两级的基金简称	泰信债券增强收益 A	泰信债券增强收益 C
下属两级的交易代码	290007	291007
报告期末下属两级基金的份额总额	438,344,530.17	281,317,798.97

2.2 基金产品说明

投资目标	在获取债券稳定收益的基础上，通过股票一级市场申购等手段谋求高于比较基准的收益。
投资策略	本基金根据对宏观经济形势、货币和财政政策变化、经济周期及利益走势、企业盈利和信用状况、基金流动性情况等的动态分析，通过召开投资决策委员会，确定基金中各类资产的配置比例范围，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	80%*上证企业债指数+20%*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、低收益品种，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金，高于货币市场基金。

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	http://www.ftfund.com
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 7 月 29 日（基金合同生效日）-2009 年 12 月 31 日	
	A 类	C 类
本期已实现收益	-12,641,731.82	-8,658,948.69
本期利润	-10,399,567.71	-5,719,754.66
加权平均基金份额本期利润	-0.0147	-0.0136
本期加权平均净值利润率	-1.50%	-1.40%
本期基金份额净值增长率	-1.13%	-1.31%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年末	
期末可供分配利润	-7,695,409.58	-5,426,402.30
期末可供分配基金份额利润	-0.0176	-0.0193
期末基金资产净值	433,378,571.89	277,633,007.02
期末基金份额净值	0.9887	0.9869
3.1.3 累计期末指标	2009 年末	
基金份额累计净值增长率	-1.13%	-1.31%

注：
1、本基金基金合同于 2009 年 7 月 29 日正式生效。
2、所述基金业绩指标不包括持有人申购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

分级 A

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	5.00%	0.38%	1.07%	0.05%	3.93%	0.33%
过去六个月						
过去一年						
过去三年						
过去五年						
自基金合同生效起至今	-1.13%	0.45%	0.72%	0.07%	-1.85%	0.38%

分级 C

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	4.89%	0.38%	1.07%	0.05%	3.82%	0.33%
过去六个月						
过去一年						
过去三年						
过去五年						
自基金合同生效起至今	-1.31%	0.45%	0.72%	0.07%	-2.03%	0.38%

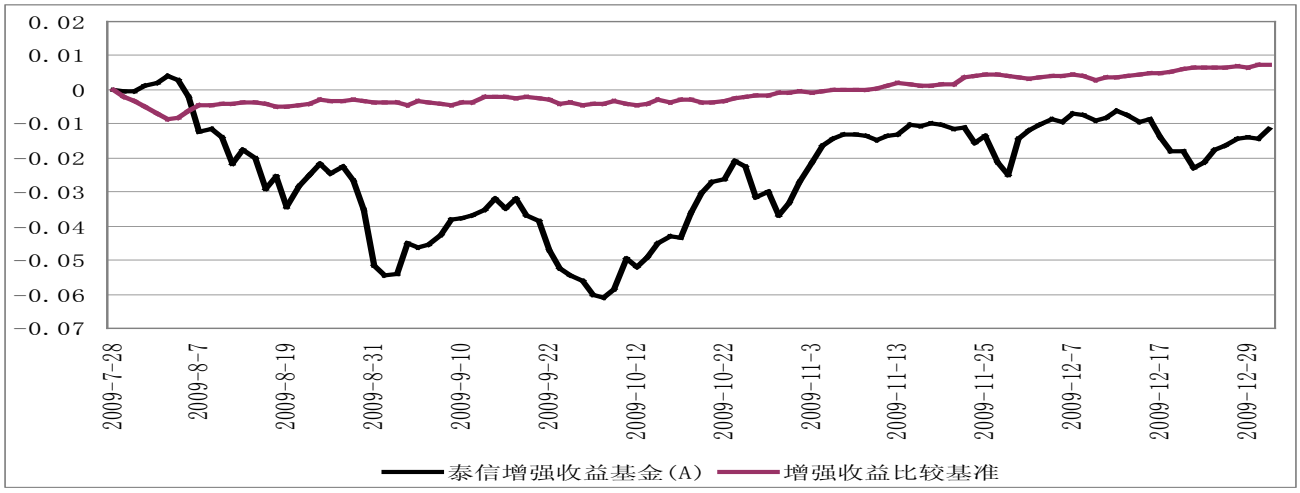
注:本基金的业绩比较基准为：80%上证企业债指数+20%上证国债指数。

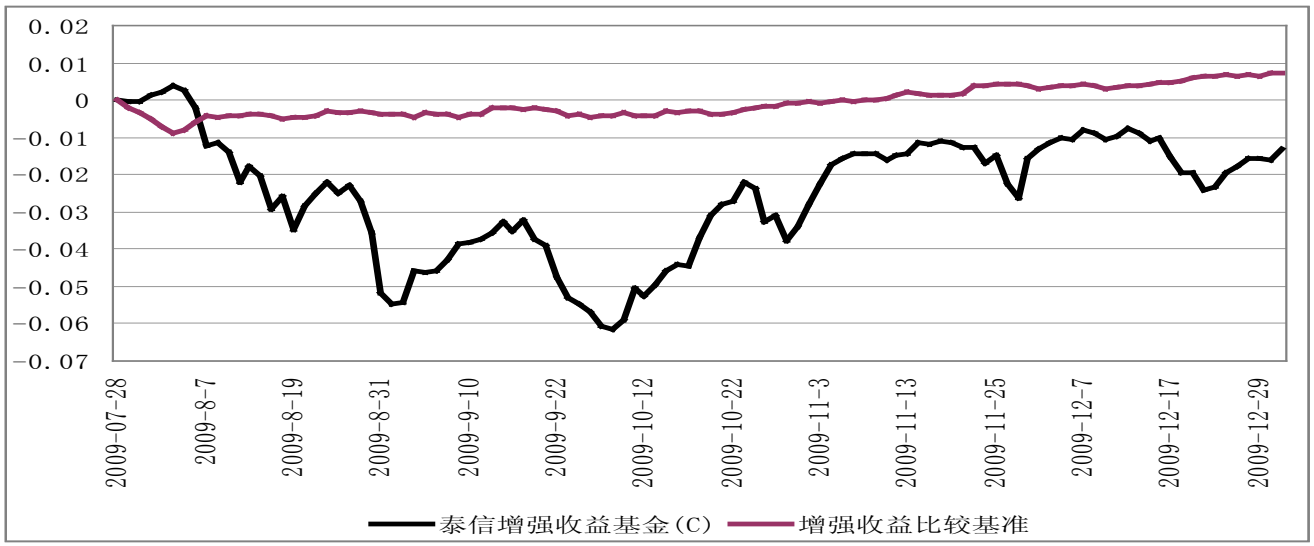
1、上证企业债指数，是按照科学客观的方法，从国内交易所上市企业债中挑选了满足一定条件的具有代表性的债券组成样本，按照债券发行量加权计算的指数，科学地反应了我国企业债券市场的变化。

2、上证国债指数是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，具有广泛的市场代表性。

3、上证企业债指数与上证国债指数很好地反映了我国债券市场的整体状况，具有较高的权威和市场代表性，投资人可以从上交所行情、中国货币网等处获得。

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



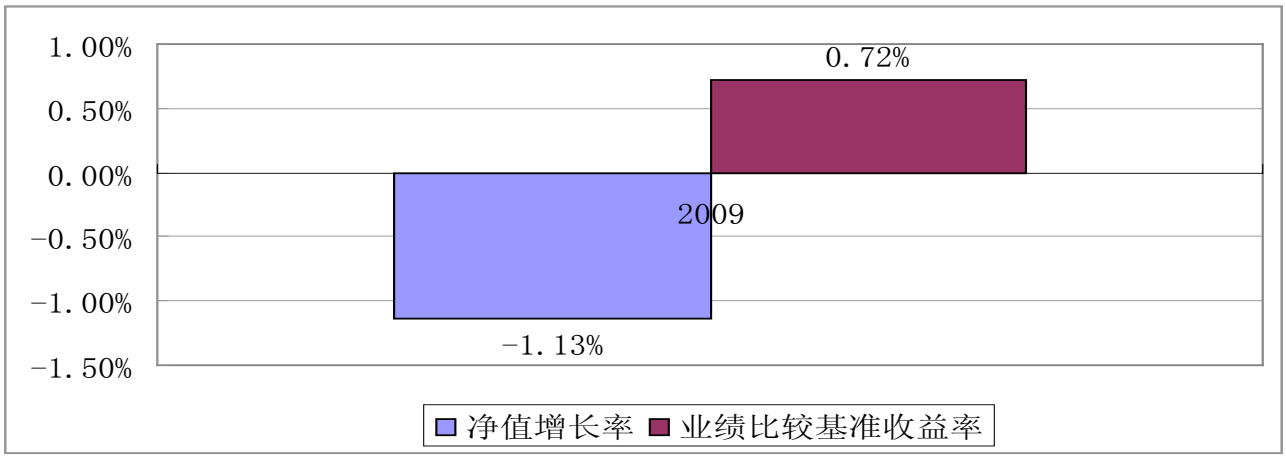


注：1、本基金基金合同于 2009 年 7 月 29 日正式生效。

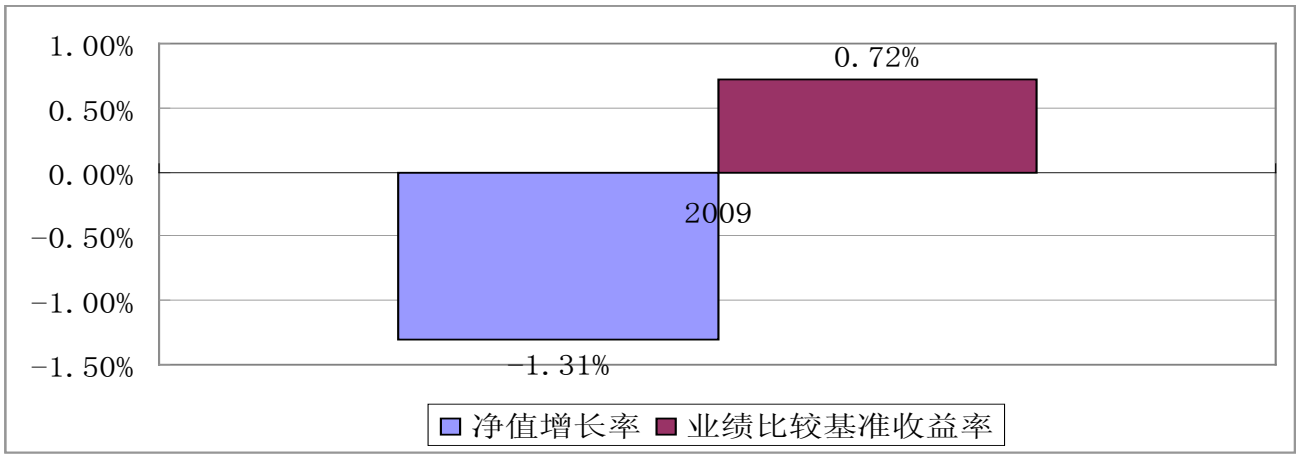
2、本基金建仓期为六个月。至报告期末不满一年。本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于权益类资产的比例不高于基金资产的 20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

3.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

分级 A



分级 C



3.4 过去三年基金的利润分配情况

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	备注
2009年	-	-	-	-	
合计					

注：本基金基金合同于 2009 年 7 月 29 日正式生效，2009 年没有进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 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		
何俊春女士	本基金基金经理、泰信双息双利债券基金基金经理	2009 年 7 月 29 日	-	12	工商管理硕士。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。
马成先生	本基金基金经理、泰信天天收益货币基金基金经理	2009 年 7 月 29 日	-	7	经济学硕士。2003年7月加入泰信基金管理公司，先后担任理财顾问部高级经理、投资管理部经理助理、交易室交易主管、泰信双息双利基金经理助

					理。

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本基金基金合同生效日为准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《泰信增强收益债券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

本报告期内，本基金与本公司旗下其他基金不存在风格相似的情形。

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

09 年我国经济经历了增速小幅下探随即企稳回升的历程，在适度宽松的货币政策和积极财政政策的共同作用下，投资与信贷投放的大幅增加使经济得到迅速的恢复，产业结构得到一定程度的优化，通货紧缩的趋势得以遏制，GDP 逐渐呈现较快增长。 在中国经济企稳回升的大背景下，09 年中国债券市场行情也经历了较大起伏，中债指数呈现震荡下行的整体趋势。截止到 12 月 30 日中债综合指数（净价）为 101.1203 点，较年初下跌 4.03 点，跌幅为 3.83%。 增强收益基金建仓期根据宏观经济形势及未来利率走势判断，采取短久期策略，规避债市下跌的风险，但由于权益类资产配置过高，给基金净值造成较大波动。四季度震荡行情中，对权益类资产进行结构性调整，并积极参与新股申购，分享股市上涨带来的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金基金合同于 2009 年 7 月 29 日正式生效，截至 2009 年 12 月 31 日，泰信债券增强收益 A 基金份额净值为 0.9887 元，本报告期份额净值增长率为-1.13%；泰信债券增强收益 C 基金份额净值为 0.9869 元，本报告期份额净值增长率为-1.31%，同期业绩比较基准增长率为 0.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2010 年一季度经济增长将处于全年高点，预计 GDP 为 11%左右。投资增速环比出现下降，但受新开工项目及城镇化建设需求，增速同比仍处于高位。进出口的形势在海外经济复苏及去年低基数效应带动下，同比及环比数据持续好转。受季节性因素及 09 年高增长的货币供应量对价格的刺激作用等因素影响，通货膨胀将出现明显上升态势，对通胀的预期会更加强烈。2010 年一季度新增信贷预计在 2.5-3 万亿。出口好转，人民币升值预期增强导致海外热钱流入加速，通货膨胀上升提高居民储蓄搬家的积极性，这都将增加市场流动性。市场目前主要的风险来自政策的不确定性对投资者心理的影响，包括刺激政策退出的时间、通胀的预期引发货币政策的快速调整及融资规模偏大对市场流动性的压力等。 增强收益基金继续坚持稳健投资策略，以短久期规避债券价格下跌风险，把握中长期债券交易性机会，增加信用债配置提高票息收入，新股申购将对上市公司进行优选，积极为持有人创造收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、泰信基金管理有限公司估值程序等事项的说明
委员会主席

韩波先生，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，现任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）基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资两种。投资人可选择获取现金红利，或将分红资金按除权日该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金红利。
（2）由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案，同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。
（3）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去

每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。
（4）在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多为12次。
（5）每次基金收益分配比例不低于期末可供分配利润的50%。基金合同生效不满三个月，收益可不分配。
（6）基金红利发放日距离收益分配基准日（期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过15个工作日。
（7）法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

2、报告期内已实施的利润分配情况：
截止本报告期内，本基金本报告期已实现收益-21,300,680.51 元，期末可供分配利润-13,121,811.88 元。不符合收益分配条件，未进行利润分配。

§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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在泰信增强收益债券型证券投资基金（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财务信息等内容的真实、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：泰信增强收益债券型证券投资基金
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 2009 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	445,454,172.38
结算备付金		445,404.44
存出保证金		82,175.14
交易性金融资产	7.4.7.2	271,905,326.61
其中：股票投资		84,175,267.75
基金投资		-
债券投资		187,730,058.86
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	420,326.41
应收股利		-
应收申购款		19,999,600.00
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		**738,307,004.98**
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2009 年 12 月 31 日**
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-

应付证券清算款		-
应付赎回款		26,166,967.39
应付管理人报酬		491,083.55
应付托管费		163,694.51
应付销售服务费		105,976.37
应付交易费用	7.4.7.7	73,384.97
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	294,319.28
负债合计		**27,295,426.07**
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	719,662,329.14
未分配利润	7.4.7.10	-8,650,750.23
所有者权益合计		**711,011,578.91**
负债和所有者权益总计		**738,307,004.98**

注：

1. 报告截止日 2009 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 0.9887 元，C 类基金份额净值 0.9869 元，基金份额总额 719,662,329.14 份，其中 A 类基金份额 438,344,530.17 份，C 类基金份额 281,317,798.97 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2009 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：泰信增强收益债券型证券投资基金

本报告期：2009 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2009 年 7 月 29 日(基金合同生效日) 至 2009 年 12 月 31 日
一、收入		**-11,148,079.61**
1. 利息收入		3,187,480.54
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,085,093.23
债券利息收入		748,959.86
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		353,427.45
其他利息收入		-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-19,688,490.07
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-4,424,674.58
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-15,963,867.48
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	699,007.99
股利收益	7.4.7.15	1,044.00

3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	5,181,358.14
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	171,571.78
减：二、费用		**4,971,242.76**
1. 管理人报酬		2,807,434.71
2. 托管费		935,811.52
3. 销售服务费		696,794.08
4. 交易费用	7.4.7.18	251,527.49
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.19	279,674.96
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		**-16,119,322.37**
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		**-16,119,322.37**

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：泰信增强收益债券型证券投资基金

本报告期：2009 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 7 月 29 日(基金合同生效日)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)	1,175,986,774.72	-	1,175,986,774.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-16,119,322.37	-16,119,322.37
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)	-456,324,445.58	7,468,572.14	-448,855,873.44
其中：1. 基金申购款	241,357,176.82	-3,933,720.74	237,423,456.08
2. 基金赎回款	-697,681,622.40	11,402,292.88	-686,279,329.52
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)	719,662,329.14	-8,650,750.23	711,011,578.91

注：后附财务报表附注为本财务报表的组成部分

基金管理公司负责人：高清海　主管会计工作的负责人：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

泰信增强收益债券型证券投资基金 (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”)证监许可[2009]480 号《关于核准泰信增强收益债券型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《泰信增强收益债券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 1,175,877,200.51 元，折合为 1,175,877,200.51 份基金份额(其中 A 类份额 723,971,941.85 份，C 类份额 451,905,258.66 份)，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 (2009)第 128 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰信增强收益债券型证券投资基金基金合同》于 2009 年 7 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,175,986,774.72 份基金份额，其中认购资金利息折合 109,574.21 份基金份额，其中 A 类份额 69,303.32 份，C 类份额 40,270.89 份。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《泰信增强收益债券型证券投资基金基金合同》和《泰信增强收益债券型证券投资基金招募说明书》，本基金自募集期起根据申购费用及销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费的，称为 A 类；不收取认购/申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信增强收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的国债、金融债、央行票据、企业(公司)债、短期融资券、可转换债券、可分离债券、资产支持证券、次级债等；本基金也可投资于一级市场新股、增发新股、可转换债券转股和因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等。本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于权益类资产的比例不高于基金资产的 20%，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%。本基金的业绩比较基准为：80%上证企业债指数+20%上证国债指数。

根据《泰信增强收益债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资组合应在基金成立 6 个月内达到基金合同规定的比例限制。截至 2009 年 12 月 31 日止，本基金尚处于建仓期。

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》、《泰信增强收益债券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他有关规定的声明

本基金 2009 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2009 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2)本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

(1) 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

(2) 重要会计估计及其关键假设

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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[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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
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	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

股票交易：无。

权证交易：无。

应支付关联方的佣金：无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,807,434.71
其中：支付销售机构的客户维护费	376,594.68

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 0.6%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 X 0.6% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 7 月 29 日(基金合同生效日) 至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	935,811.52

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 0.2%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 X0.2%/当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

C 类

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A 类	C 类	合计
泰信基金管理有限公司	-	105,179.86	105,179.86
中国银行	-	436,925.89	436,925.89
合计	-	542,105.75	542,105.75

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40%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＝C 类基金份额前一日基金资产净值 X0.40%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

A 类

份额单位：份

项目	本期 2009 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2009 年 7 月 29 日)持有的基金份额	17,999,360.00
期初持有的基金份额	-
期间申购总份额	-
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	17,999,360.00
期末持有的基金份额 占 A 类基金总份额比例	4.11%

C 类

无。

注：

1. 基金管理人泰信基金管理有限公司在本会计期间认购本基金的交易委托中国银行办理，适用手续费为人民币 1,000.00 元。

2.期间申购总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回总份额含转换出份额。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2009 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	445,454,172.38	2,070,512.28

注：本基金的银行存款均由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

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

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601989	中国重工	09/12/09	10/03/16	新股网下申购	7.38	7.81	1,255,814	9,267,907.32	9,807,907.34	-
601299	中国北车	09/12/23	10/03/29	新股网下申购	5.56	6.13	1,126,490	6,263,284.40	6,905,383.70	-
600999	招商证券	09/11/12	10/02/22	新股网下申购	31.00	29.39	204,836	6,349,916.00	6,020,130.04	-
300029	天龙光电	09/12/18	10/03/25	新股网下申购	18.18	29.10	159,974	2,908,327.32	4,655,243.40	-
300039	上海凯宝	09/12/28	10/04/08	新股网下申购	38.00	38.00	111,457	4,235,366.00	4,235,366.00	-
002320	海峡股份	09/12/09	10/03/16	新股网下申购	33.60	51.18	52,529	1,764,974.40	2,688,434.22	-
002317	众生药业	09/12/03	10/03/11	新股网下申购	55.00	70.77	26,782	1,473,010.00	1,895,362.14	-
300042	朗科科技	09/12/28	10/04/08	新股网下申购	39.00	39.00	46,705	1,821,495.00	1,821,495.00	-
002308	威创股份	09/11/18	10/03/01	新股网下申购	23.80	31.83	53,295	1,268,421.00	1,696,379.85	-
002310	东方园林	09/11/20	10/03/01	新股网下申购	58.60	110.88	13,914	815,360.40	1,542,784.32	-
002315	焦点科技	09/12/01	10/03/09	新股网下申购	42.00	69.18	21,354	896,868.00	1,477,269.72	-
002316	键桥通讯	09/12/01	10/03/09	新股网下申购	18.80	31.13	35,953	675,916.40	1,119,216.89	-
300030	阳普医疗	09/12/18	10/03/25	新股网下申购	25.00	35.10	25,052	626,300.00	879,325.20	-
合计								**38,367,146.24**	**44,744,297.82**	

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。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 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	84,175,267.75	11.40
	其中：股票	84,175,267.75	11.40
2	固定收益投资	187,730,058.86	25.43
	其中：债券	187,730,058.86	25.43
	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	445,899,576.82	60.39
6	其它各项资产	20,502,101.55	2.78
	合计	738,307,004.98	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	-	-
B	采掘业	20,349,819.36	2.86
C	制造业	47,278,618.35	6.65
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	6,000,000.00	0.84
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	12,900,030.57	1.81
C7	机械、设备、仪表	22,247,859.64	3.13
C8	医药、生物制品	6,130,728.14	0.86
C99	其它制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,672,864.32	0.24
F	交通运输、仓储业	2,688,434.22	0.38

G	信息技术业	6,114,361.46	0.86
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	6,071,170.04	0.85
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	84,175,267.75	11.84

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	600971	恒源煤电	601,354	20,349,819.36	2.86
2	600219	南山铝业	975,059	12,900,030.57	1.81
3	601989	中国重工	1,255,814	9,807,907.34	1.38
4	601299	中国北车	1,126,490	6,905,383.70	0.97
5	600999	招商证券	204,836	6,020,130.04	0.85
6	600567	山鹰纸业	1,000,000	6,000,000.00	0.84
7	300029	天龙光电	159,974	4,655,243.40	0.65
8	300039	上海凯宝	111,457	4,235,366.00	0.60
9	002320	海峡股份	52,529	2,688,434.22	0.38
10	002317	众生药业	26,782	1,895,362.14	0.27

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600219	南山铝业	88,693,051.15	12.47
2	600971	恒源煤电	40,654,838.70	5.72
3	600567	山鹰纸业	15,014,192.58	2.11

4	000527	美的电器	9,558,139.50	1.34
5	601989	中国重工	9,267,907.32	1.30
6	600999	招商证券	6,349,916.00	0.89
7	601299	中国北车	6,263,284.40	0.88
8	300039	上海凯宝	4,235,366.00	0.60
9	300029	天龙光电	2,908,327.32	0.41
10	300042	朗科科技	1,821,495.00	0.26
11	002320	海峡股份	1,764,974.40	0.25
12	002317	众生药业	1,473,010.00	0.21
13	002308	威创股份	1,268,421.00	0.18
14	002315	焦点科技	896,868.00	0.13
15	002310	东方园林	815,360.40	0.11
16	002316	键桥通讯	675,916.40	0.10
17	300030	阳普医疗	626,300.00	0.09
18	601618	中国中冶	130,080.00	0.02
19	601788	光大证券	42,160.00	0.01

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600219	南山铝业	73,863,204.12	10.39
2	600971	恒源煤电	16,961,918.00	2.39
3	000527	美的电器	9,526,551.25	1.34
4	600567	山鹰纸业	8,916,338.06	1.25

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	192,459,608.17
卖出股票收入（成交）总额	109,268,011.43

8.5 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	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,192,000.00	4.25
6	可转债	157,538,058.86	22.16
7	其它	-	-
	合计	187,730,058.86	26.40

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	125709	唐钢转债	352,708.00	42,998,632.28	6.05
2	0981243	09 蓉希望 CP01	300,000.00	30,192,000.00	4.25
3	110006	龙盛转债	153,030.00	23,529,892.80	3.31
4	110007	博汇转债	173,440.00	22,994,675.20	3.23
5	110003	新钢转债	153,090.00	21,062,122.20	2.96

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

8.9.2 本基金不从二级市场主动投资股票。

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	82,175.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	420,326.41
5	应收申购款	19,999,600.00
6	其它应收款	-
7	待摊费用	-
8	其它	-
	合计	20,502,101.55

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	125709	唐钢转债	42,998,632.28	6.05
2	110003	新钢转债	21,062,122.20	2.96
3	110598	大荒转债	19,093,309.20	2.69
4	125960	锡业转债	5,635,717.23	0.79

8.9.5 期末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	601989	中国重工	9,807,907.34	1.38	网下新股申购3个月锁定期
2	601299	中国北车	6,905,383.70	0.97	网下新股申购3个月锁定期
3	600999	招商证券	6,020,130.04	0.85	网下新股申购3个月锁定期
4	300029	天龙光电	4,655,243.40	0.65	网下新股申购3个月锁定期
5	300039	上海凯宝	4,235,366.00	0.60	网下新股申购3个月锁定期
6	002320	海峡股份	2,688,434.22	0.38	网下新股申购3个月锁定期
7	002317	众生药业	1,895,362.14	0.27	网下新股申购3个月锁定期

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，未从二级市场主动投资股票及权证，报告期内持有的权证是投资可分离债成本拆分而被动持有，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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
A	1,696	258,457.86	320,088,201.94	73.02%	118,256,328.23	26.98%
C	2,000	140,658.90	33,033,406.40	11.74%	248,284,392.57	88.26%
合计	3,696	194,713.83	353,121,608.34	49.07%	366,540,720.80	50.93%

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	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	A	-	-
	C	20,000.00	0.01%
	合计	20,000.00	0.00%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	A 类	C 类
基金合同生效日（2009 年 7 月 29 日）基金份额总额	724,041,245.17	451,945,529.55
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	205,650,158.86	35,707,017.96
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	491,346,873.86	206,334,748.54
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	438,344,530.17	281,317,798.97

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

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、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

普华永道中天会计师事务所有限公司自2009年7月29日本基金成立日之日起为本基金提供审计服务，本报告期本基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费为人民币9万元。

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	61,851,776.95	56.61%	52,573.87	56.82%	
渤海证券	1	-	-	-	-	
东方证券	1	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
国泰君安证券	1	-	-	-	-	
国信证券	1	-	-	-	-	
国元证券	1	13,670,975.21	12.51%	11,620.17	12.56%	
江海证券	1	9,526,551.25	8.72%	7,740.36	8.37%	新增
江南证券	1	-	-	-	-	
万联证券	1	-	-	-	-	
五矿证券	1	-	-	-	-	新增
华泰证券	1	-	-	-	-	此交易单元原为信泰证券所有，该公司后并入华泰证券。

中金公司	1	17,185,894.57	15.73%	14,607.76	15.79%	新增
中信证券	2	7,032,813.45	6.44%	5,978.34	6.46%	
中银国际	2	-	-	-	-	
长财证券	1	-	-	-	-	
大通证券	1	-	-	-	-	
第一创业	1	-	-	-	-	
东海证券	1	-	-	-	-	
光大证券	1	-	-	-	-	
海通证券	2	-	-	-	-	
华宝证券	1	-	-	-	-	
金元证券	1	-	-	-	-	
华泰联合证券	1	-	-	-	-	原联合更名为华泰联合
南京证券	1	-	-	-	-	
上海证券	1	-	-	-	-	
申银万国证券	1	-	-	-	-	
西南证券	1	-	-	-	-	
新时代证券	1	-	-	-	-	退租
招商证券	1	-	-	-	-	
中国建银投资证券	1	-	-	-	-	
中信建投	1	-	-	-	-	

注：

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

2、本基金与公司旗下在中国银行托管的泰信优质生活、泰信蓝筹精选基金共用交易单元。

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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
安信证券	271,654,204.50	24.51%	410,200,000.00	40.84%	-	-
渤海证券	31,498,765.60	2.84%	-	-	-	-
东方证券	23,375,786.50	2.11%	-	-	-	-
广发证券	24,001,576.10	2.17%	-	-	-	-
国泰君安证券	164,441,952.97	14.84%	-	-	-	-
国信证券	99,856,289.00	9.01%	180,000,000.00	17.92%	-	-
国元证券	137,636,518.73	12.42%	414,100,000.00	41.23%	1,846,922.06	100.00%
江海证券	83,601,709.37	7.54%	-	-	-	-
江南证券	58,894,294.59	5.31%	-	-	-	-
万联证券	61,638,998.75	5.56%	-	-	-	-
五矿证券	65,287,295.40	5.89%	-	-	-	-
华泰证券	18,419,786.42	1.66%	-	-	-	-
中金公司	15,090,193.80	1.36%	-	-	-	-
中信证券	34,367,388.60	3.10%	-	-	-	-
中银国际	18,504,422.11	1.67%	-	-	-	-

泰信基金管理有限公司

2010 年 3 月 31 日