泰信优质生活股票型证券投资基金
2012 年半年度报告

2012 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2012 年 8 月 29 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 27 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 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 9
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遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
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 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
§5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 14
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 14
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 15
6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 17
6.4 报表附注 18
§7 投资组合报告 32
7.1 期末基金资产组合情况 32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 32
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 33
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 36
7.6 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 36
7.7 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 37
7.8 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 37
7.9 投资组合报告附注 37
§8 基金份额持有人信息 38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况 38
§9 开放式基金份额变动 38

§10 重大事件揭示.....39
10.1 基金份额持有人大会决议.....39
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.....39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....39
10.4 基金投资策略的改变.....39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....39
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.....39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....40
10.8 其他重大事件.....42
§11 备查文件目录.....43
11.1 备查文件目录.....43
11.2 存放地点.....43
11.3 查阅方式.....43

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信优质生活股票型证券投资基金
基金简称	泰信优质生活股票
基金主代码	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	1,868,216,300.75 份
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%×富时中国 A600 指数＋25%×富时中国国债指数
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	021-20899032	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		021-20899008	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区浦东南路 256 号 37 层	北京西城区复兴门内大街 1 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	北京西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码	200120	100818
法定代表人	孟凡利	肖钢

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	http：//www.ftfund.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 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(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-336,010,736.28
本期利润	-12,761,086.75
加权平均基金份额本期利润	-0.0066
本期加权平均净值利润率	-0.91%
本期基金份额净值增长率	-0.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-707,669,453.22
期末可供分配基金份额利润	-0.3788
期末基金资产净值	1,358,299,494.19
期末基金份额净值	0.7271
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	11.41%

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

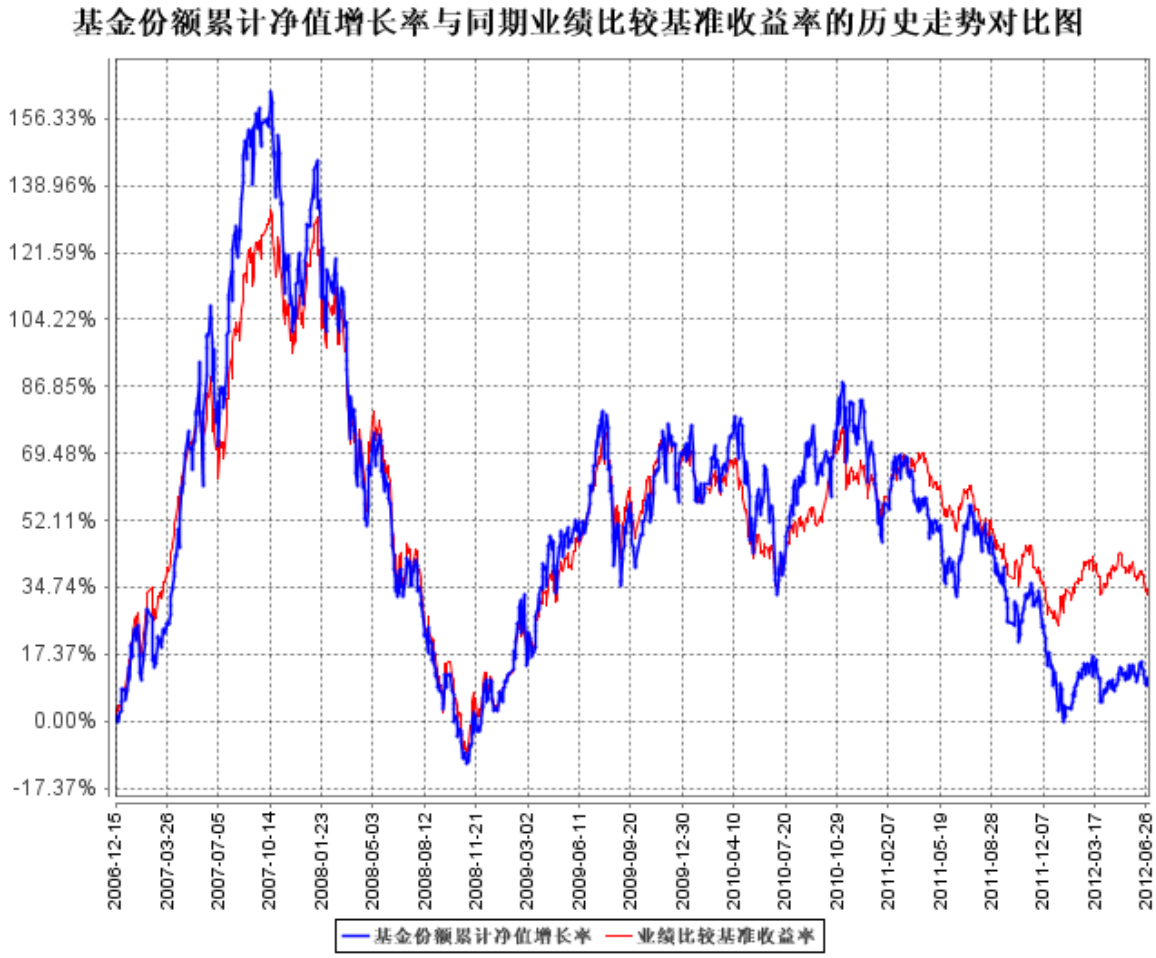
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-2.68%	1.14%	-4.57%	0.83%	1.89%	0.31%
过去三个月	6.02%	1.06%	0.89%	0.83%	5.13%	0.23%
过去六个月	-0.95%	1.52%	4.68%	1.01%	-5.63%	0.51%
过去一年	-22.50%	1.46%	-14.23%	1.03%	-8.27%	0.43%
过去三年	-27.63%	1.74%	-12.56%	1.17%	-15.07%	0.57%
自基金合同生效日起至今	11.41%	1.97%	34.45%	1.57%	-23.04%	0.40%

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

富时中国 A600 指数是富时中国指数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，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



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、经泰信基金管理有限公司第三届董事会 2012 年第一次（通讯）会议审议通过，决定新增戴宇虹女士担任泰信优质生活基金经理，与刘强先生共同管理本基金，朱志权先生不再担任泰信优质生活基金经理职务。具体详情见 2012 年 3 月 1 日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信优质生活股票基金基金经理变更的公告》。

§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 华夏银行大厦 37 层

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号 华夏银行大厦 36-37 层

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：孟凡利

总经理：高清海

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：王伟毅

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。

公司目前下设市场部、营销部（分华东、华北、华南三大营销中心）、电子商务部、客服中心、基金投资部、研究部、理财顾问部、清算会计部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部、北京分公司、深圳分公司。截至 2012 年 6 月底，公司有正式员工 119 人，多数具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

截至 2012 年 6 月 30 日，泰信基金管理有限公司共管理泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活股票、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、泰信发展主题股票、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选股票、泰信保本混合共 12 只开放式基金及泰信财富分级 1 号资产管理计划。

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		

刘强先生	基金投资部投资副总监、本基金基金经理	2007 年 2 月 9 日	-	10	工商管理硕士，上海复旦大学博士研究生在读。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。现同时担任基金投资部投资副总监。
戴宇虹女士	本基金基金经理	2012 年 3 月 1 日	-	6	金融学硕士。具有基金从业资格。曾先后任职于国药控股有限公司、群益证券股份有限公司。2008 年 10 月加入泰信基金管理有限公司，先后担任研究部高级研究、泰信发展主题股票基金经理助理。
朱志权先生	基金投资部投资总监、本基金经理兼泰信先行策略混合基金、泰信优势增长混合基金经理	2008 年 6 月 28 日	2012 年 3 月 1 日	17	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，担任本基金基金经理。自 2010 年 1 月 16 日起担任泰信优势增长混合基金基金经理。自 2012 年 3 月 1 日起担任泰信先行策略混合基金基金经理，并于同日开始不再担任本基金基金经理。现同时担任基金投资部投资总监。

注：1、经泰信基金管理有限公司第三届董事会 2012 年第一次（通讯）会议审议通过，决定新增戴宇虹女士担任泰信优质生活基金经理，与刘强先生共同管理本基金，朱志权先生不再担任泰信优质生活基金经理职务。具体详情见 2012 年 3 月 1 日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信优质生活股票基金基金经理变更的公告》。

2、以上日期均是指公司公告的日期。

3、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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《泰信优质生活股票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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（中国证监会公告[2011]18 号），公司制定了《泰信基金管理有限公司公平交易制度》，主要控制方法如下：

1、建立统一的研究平台，所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放。

2、建立全公司投资对象备选库和各投资组合的投资对象备选库。

3、投委会作为公司受托资产投资的最高决策机构，主要负责对公司所管理的受托资产进行投资决策。投资总监在其权限范围内审批超出投资组合经理权限的投资计划。投资组合经理在其权限范围内进行投资决策。

4、投资组合经理同时管理多个投资组合时，必须公平公正的对待管理的所有投资组合，除申购赎回、个股投资比例超标等客观因素之外，同一交易日投资同一交易品种时，应尽可能使他们获得相同或相近的交易价格。

严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

5、集中交易室负责所有投资指令的执行，必须确保所有同向指令的公平公正，平等对待所有投资组合。发现异常指令或者涉嫌利益输送的指令，交易室应立即停止执行指令，并向投资总监和风险管理部报告。对非竞争竞价指令，不同投资组合也必须公平对待，主要采取成交结果按比例分配和轮侯方式处理。

6、风险管理部通过交易系统监控指标设置，实时监控交易指令，禁止同一投资组合内部的同日反向交易，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

7、公司在交易系统中设置强制公平委托参数，强制交易系统对符合要求的同一交易品种的同

向指令执行公平委托。

8、风险管理部定期与不定期对交易指令的公平性和交易委托的公平性进行分析，对强制公平委托的执行过程与结果进行检查；对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，并完成定期分析报告。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司公平交易制度适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，投资经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在集中交易室集中执行，投资交易过程公平公正，投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内，投资交易监控与价差分析未发现基金之间存在利益输送行为，公平交易制度整体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

今年以来市场出现的反弹行情主要源自于对政策放松的预期，而宏观和政策等方面均没有明显的变化。4 月份以后在市场对货币政策放松的预期以及金融改革创新政策预期的影响下，地产和券商板块引领了一波上扬行情。然而随着 5 月经济下行压力的加大，市场对企业盈利前景的悲观预期成为主导市场的主要因素，加上欧债危机的不断恶化以及美国经济复苏的不确定性，导致市场走势疲弱，医药和公用事业等防御类板块逐步受到投资者的青睐，同时业绩稳定增长的食品饮料行业表现持续强势。

本报告期内，主要大幅增加了对食品饮料行业的配置，对超配的医药行业持仓结构进行优化，对文化传媒、纺织服装等行业进行适当的增持，而前期超配的公用事业、建筑建材等行业适当减持部分锁定收益，同时我们也适当参与了地产和券商板块的波段操作并及时进行获利了结，使得本报告期基金业绩相对年初有较好的表现。

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 0.7271 元，基金净值增长率为-0.95%，业绩比较基准涨幅为 4.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们认为投资机会大于投资风险。一方面随着二季度货币政策和财政政策有所放松，政策效应将对三季度经济产生正面的影响，经济增速环比或回升，我们认为下半年在政策回暖的影响下，经济出现一定的复苏是大概率事件但过程可能会有波折。另一方面我国经济转型的曲折性、大规模解禁对市场估值的压制、国际版的若隐若现以及欧美经济复苏进程的不确定性也将始终制约市场向上的空间。我们认为市场将继续震荡，市场向上的空间或将大于向下的空间，并将出现较好的买入时机。

在行业配置上，我们主要关注以下方向，业绩增长稳定性较高且低于预期可能性较小的必需消费品行业如食品饮料、医药等行业；受益于政策出现好转的可选消费品行业，如地产以及相关行业等；同时我们继续看好在“调结构、稳增长”政策下的节能环保、文化传媒等行业。

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经理。

庞少华先生，硕士，会计师。2005 年 1 月加入泰信基金管理有限公司，现任公司清算会计部经理。

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

梁剑先生，硕士。2004 年 7 月加入泰信基金管理有限公司，曾任泰信先行策略混合基金经理。现任研究部研究副总监。

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）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：

本报告期本基金未进行利润分配。

§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”）在对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。

§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：泰信优质生活股票型证券投资基金
报告截止日： 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	160,829,969.68	82,504,475.53
结算备付金		6,203,519.01	2,298,578.00
存出保证金		3,961,196.46	3,241,895.33
交易性金融资产	6.4.7.2	1,177,238,073.32	1,460,617,393.54
其中：股票投资		1,177,238,073.32	1,460,617,393.54
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	80,000,000.00	-
应收证券清算款		25,334,400.00	-
应收利息	6.4.7.5	30,997.89	19,667.50
应收股利		-	-
应收申购款		57,792.18	15,597,618.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,453,655,948.54	1,564,279,628.79
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2012 年 6 月 30 日**	**上年度末 2011 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		85,963,396.05	6,759,018.40
应付赎回款		194,136.86	80,839.20
应付管理人报酬		1,691,422.70	2,048,388.74
应付托管费		281,903.80	341,398.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,172,080.23	870,509.80
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	4,053,514.71	3,504,512.91
负债合计		95,356,454.35	13,604,667.18
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,868,216,300.75	2,112,350,155.25
未分配利润	6.4.7.10	-509,916,806.56	-561,675,193.64
所有者权益合计		1,358,299,494.19	1,550,674,961.61
负债和所有者权益总计		1,453,655,948.54	1,564,279,628.79

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7271 元，基金份额总额 1,868,216,300.75 份。

6.2 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： 2012 年 1 月 1 日 至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		7,169,613.62	-321,961,741.50
1.利息收入		652,055.12	415,139.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	453,683.14	415,139.62
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		198,371.98	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-316,901,644.13	-81,088,109.77
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-322,712,774.37	-90,162,024.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	5,811,130.24	9,073,915.05
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	323,249,649.53	-241,568,737.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	169,553.10	279,965.68
减：二、费用		19,930,700.37	23,278,926.40
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	10,483,675.89	14,683,495.53
2．托管费	6.4.10.2.2	1,747,279.34	2,447,249.23
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.19	7,487,081.95	5,934,588.51
5．利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．其他费用	6.4.7.20	212,663.19	213,593.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-12,761,086.75	-345,240,667.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12,761,086.75	-345,240,667.90

6.3 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：2012 年 1 月 1 日 至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	2,112,350,155.25	-561,675,193.64	1,550,674,961.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,761,086.75	-12,761,086.75
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）	-244,133,854.50	64,519,473.83	-179,614,380.67
其中：1.基金申购款	28,202,098.21	-7,943,245.88	20,258,852.33
2.基金赎回款	-272,335,952.71	72,462,719.71	-199,873,233.00
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）	1,868,216,300.75	-509,916,806.56	1,358,299,494.19
项目	**上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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）	2,104,558,848.15	239,529,267.20	2,344,088,115.35
二、本期经营活动产生	-	-345,240,667.90	-345,240,667.90

的基金净值变动数（本期利润）			
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）	-212,248,374.46	-11,316,869.03	-223,565,243.49
其中：1.基金申购款	98,033,811.45	266,031.18	98,299,842.63
2.基金赎回款	-310,282,185.91	-11,582,900.21	-321,865,086.12
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）	1,892,310,473.69	-117,028,269.73	1,775,282,203.96

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：

高清海	韩波	庞少华
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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类股票、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 富时中国 A 600 指数+25%X 富时中

国国债指数。

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》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 2012 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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

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[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。

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 2012 年 6 月 30 日
活期存款	160,829,969.68
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	160,829,969.68

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,214,408,219.39	1,177,238,073.32	-37,170,146.07
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,214,408,219.39	1,177,238,073.32	-37,170,146.07

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	80,000,000.00	-
合计	80,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	20,436.34
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	2,512.44
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	8,042.09
应收申购款利息	7.02
其他	-
合计	30,997.89

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	3,172,006.46
银行间市场应付交易费用	73.77
合计	3,172,080.23

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	3,750,000.00

应付赎回费	157.97
预提费用	303,356.74
合计	4,053,514.71

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,112,350,155.25	2,112,350,155.25
本期申购	28,202,098.21	28,202,098.21
本期赎回(以"-"号填列)	-272,335,952.71	-272,335,952.71
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	1,868,216,300.75	1,868,216,300.75

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	-440,942,313.19	-120,732,880.45	-561,675,193.64
本期利润	-336,010,736.28	323,249,649.53	-12,761,086.75
本期基金份额交易产生的变动数	69,283,596.25	-4,764,122.42	64,519,473.83
其中：基金申购款	-8,214,254.14	271,008.26	-7,943,245.88
基金赎回款	77,497,850.39	-5,035,130.68	72,462,719.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-707,669,453.22	197,752,646.66	-509,916,806.56

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	414,303.85
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	38,438.38
其他	940.91

合计	453,683.14

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,563,621,976.75
减：卖出股票成本总额	2,886,334,751.12
买卖股票差价收入	-322,712,774.37

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,811,130.24
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,811,130.24

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	323,249,649.53
——股票投资	323,249,649.53
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-

合计	323,249,649.53

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	128,519.03
转出基金补偿费	8,444.06
其他	32,590.01
合计	169,553.10

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. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	7,487,081.95
银行间市场交易费用	-
合计	7,487,081.95

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,179.94
帐户维护费	8,950.76
银行划款手续费	4,806.45
合计	212,663.19

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

无。

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、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	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,483,675.89	14,683,495.53
其中：支付销售机构的客户维护费	1,053,971.14	1,537,345.89

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 X 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,747,279.34	2,447,249.23

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

无。

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

本报告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

无。

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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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
中国银行	160,829,969.68	414,303.85	106,445,012.46	388,700.11

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（ 2012 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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600436	片仔癀	2012 年 6 月 29 日	重大事项停牌	87.89	2012 年 7 月 2 日	91.19	265,322	20,373,286.87	23,319,150.58	-

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，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。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“风险和收益相匹配”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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产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约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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 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	160,829,969.68	-	-	-	160,829,969.68
结算备付金	6,203,519.01	-	-	-	6,203,519.01
存出保证金	-	-	-	3,961,196.46	3,961,196.46
交易性金融资产	-	-	-	1,177,238,073.32	1,177,238,073.32
买入返售金融资产	80,000,000.00	-	-	-	80,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	25,334,400.00	25,334,400.00

应收利息	-	-	-	30,997.89	30,997.89
应收申购款	-	-	-	57,792.18	57,792.18
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	247,033,488.69	-	-	1,206,622,459.85	1,453,655,948.54
负债					
应付证券清算款	-	-	-	85,963,396.05	85,963,396.05
应付赎回款	-	-	-	194,136.86	194,136.86
应付管理人报酬	-	-	-	1,691,422.70	1,691,422.70
应付托管费	-	-	-	281,903.80	281,903.80
应付交易费用	-	-	-	3,172,080.23	3,172,080.23
其他负债	-	-	-	4,053,514.71	4,053,514.71
负债总计	-	-	-	95,356,454.35	95,356,454.35
利率敏感度缺口	247,033,488.69	-	-	1,111,266,005.50	1,358,299,494.19
上年度末 2011 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	82,504,475.53	-	-	-	82,504,475.53
结算备付金	2,298,578.00	-	-	-	2,298,578.00
存出保证金	-	-	-	3,241,895.33	3,241,895.33
交易性金融资产	-	-	-	1,460,617,393.54	1,460,617,393.54
应收利息	-	-	-	19,667.50	19,667.50
应收申购款	15,403,970.18	-	-	193,648.71	15,597,618.89
资产总计	100,207,023.71	-	-	1,464,072,605.08	1,564,279,628.79
负债					
应付证券清算款	-	-	-	6,759,018.40	6,759,018.40
应付赎回款	-	-	-	80,839.20	80,839.20
应付管理人报酬	-	-	-	2,048,388.74	2,048,388.74
应付托管费	-	-	-	341,398.13	341,398.13
应付交易费用	-	-	-	870,509.80	870,509.80
其他负债	-	-	-	3,504,512.91	3,504,512.91
负债总计	-	-	-	13,604,667.18	13,604,667.18
利率敏感度缺口	100,207,023.71	-	-	1,450,467,937.90	1,550,674,961.61

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规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

于 2012 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2011 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2011 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金组合投资的范围为：股票资产 60%-95%，债券资产 0%-35%。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 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 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	1,177,238,073.32	86.67	1,460,617,393.54	94.19
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,177,238,073.32	86.67	1,460,617,393.54	94.19

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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 （ 2012 年 6 月 30 日 ）	上年度末 （ 2011 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准上升 5%	29,806,348.92	97,270,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-29,806,348.92	-97,270,000.00

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	1,177,238,073.32	80.98
	其中：股票	1,177,238,073.32	80.98
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	80,000,000.00	5.50
	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	167,033,488.69	11.49
6	其他各项资产	29,384,386.53	2.02
7	合计	1,453,655,948.54	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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	88,619,764.00	6.52
B	采掘业	3,291,200.00	0.24
C	制造业	713,558,612.91	52.53
C0	食品、饮料	315,955,109.76	23.26
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	66,785,407.52	4.92
C5	电子	64,173,595.10	4.72

C6	金属、非金属	41,444,378.53	3.05
C7	机械、设备、仪表	74,054,862.90	5.45
C8	医药、生物制品	151,145,259.10	11.13
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,479,150.00	0.11
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	112,648,666.22	8.29
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	40,797,610.80	3.00
K	社会服务业	156,558,367.99	11.53
L	传播与文化产业	60,284,701.40	4.44
M	综合类	-	-
	合计	1,177,238,073.32	86.67

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	601888	中国国旅	2,700,000	76,194,000.00	5.61
2	600519	贵州茅台	309,000	73,897,350.00	5.44
3	600079	人福医药	2,658,399	61,648,272.81	4.54
4	601928	凤凰传媒	7,009,849	60,284,701.40	4.44
5	000566	海南海药	2,993,640	57,777,252.00	4.25
6	300005	探路者	2,666,356	46,714,557.12	3.44
7	000551	创元科技	8,790,000	46,674,900.00	3.44
8	000869	张　裕A	653,977	43,986,493.02	3.24
9	002304	洋河股份	319,515	42,990,743.25	3.17
10	000860	顺鑫农业	2,579,900	41,329,998.00	3.04
11	600059	古越龙山	2,709,869	38,669,830.63	2.85
12	002241	歌尔声学	990,000	36,125,100.00	2.66
13	002183	怡 亚 通	5,707,923	34,989,567.99	2.58
14	600257	大湖股份	4,396,200	32,663,766.00	2.40
15	300070	碧水源	1,090,000	32,591,000.00	2.40
16	600199	金种子酒	1,199,769	29,970,229.62	2.21
17	000729	燕京啤酒	3,599,914	26,279,372.20	1.93
18	000639	西王食品	1,929,359	26,277,869.58	1.93
19	600261	阳光照明	2,079,291	24,743,562.90	1.82

20	600511	国药股份	1,749,936	24,499,104.00	1.80
21	600707	彩虹股份	3,999,900	23,679,408.00	1.74
22	600436	片仔癀	265,322	23,319,150.58	1.72
23	600559	老白干酒	799,999	22,831,971.46	1.68
24	600739	辽宁成大	1,390,000	21,684,000.00	1.60
25	600056	中国医药	899,818	19,751,005.10	1.45
26	600315	上海家化	500,000	19,505,000.00	1.44
27	002428	云南锗业	899,721	18,831,160.53	1.39
28	600527	江南高纤	4,299,000	16,766,100.00	1.23
29	600549	厦门钨业	350,000	15,368,500.00	1.13
30	002108	沧州明珠	1,470,987	11,856,155.22	0.87
31	000665	武汉塑料	863,934	11,619,912.30	0.86
32	002477	雏鹰农牧	610,000	11,498,500.00	0.85
33	000826	桑德环境	500,000	11,450,000.00	0.84
34	600048	保利地产	800,000	9,072,000.00	0.67
35	600422	昆明制药	450,917	8,400,583.71	0.62
36	600675	中华企业	1,700,000	7,956,000.00	0.59
37	600376	首开股份	600,000	7,944,000.00	0.58
38	600702	沱牌舍得	209,000	7,576,250.00	0.56
39	600459	贵研铂业	412,100	7,244,718.00	0.53
40	002167	东方锆业	372,000	7,038,240.00	0.52
41	600383	金地集团	1,000,000	6,480,000.00	0.48
42	000608	阳光股份	899,000	4,611,870.00	0.34
43	600060	海信电器	259,910	4,369,087.10	0.32
44	002155	辰州矿业	170,000	3,291,200.00	0.24
45	002069	獐子岛	150,000	3,127,500.00	0.23
46	600239	云南城投	300,000	2,547,000.00	0.19
47	300273	和佳股份	140,000	2,486,400.00	0.18
48	600779	水井坊	100,000	2,427,000.00	0.18
49	000718	苏宁环球	269,968	2,186,740.80	0.16
50	300244	迪安诊断	60,000	1,333,800.00	0.10
51	002325	洪涛股份	80,000	1,185,600.00	0.09
52	000799	酒鬼酒	20,000	1,048,000.00	0.08
53	002310	东方园林	5,000	293,550.00	0.02
54	002266	浙富股份	20,000	150,000.00	0.01

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	601928	凤凰传媒	65,463,070.60	4.22
2	000566	海南海药	60,175,899.08	3.88
3	600079	人福医药	55,168,818.66	3.56
4	000860	顺鑫农业	46,613,257.36	3.01
5	002183	怡 亚 通	46,053,439.41	2.97
6	002460	赣锋锂业	45,341,082.02	2.92
7	600707	彩虹股份	45,233,216.44	2.92
8	002466	天齐锂业	45,209,689.40	2.92
9	002304	洋河股份	44,163,243.85	2.85
10	000869	张 裕A	43,725,117.55	2.82
11	002241	歌尔声学	43,165,453.17	2.78
12	600059	古越龙山	41,461,896.38	2.67
13	600257	大湖股份	40,869,161.49	2.64
14	300196	长海股份	35,212,400.20	2.27
15	002292	奥飞动漫	34,835,197.29	2.25
16	600467	好当家	33,845,303.78	2.18
17	600153	建发股份	32,066,885.05	2.07
18	002162	斯 米 克	31,947,932.60	2.06
19	600559	老白干酒	30,719,368.53	1.98
20	002407	多氟多	30,634,020.94	1.98

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	000423	东阿阿胶	87,684,809.13	5.65
2	000541	佛山照明	80,433,726.50	5.19
3	002073	软控股份	77,519,414.24	5.00
4	002091	江苏国泰	76,287,629.91	4.92

5	600993	马应龙	75,433,123.45	4.86
6	600750	江中药业	75,277,086.46	4.85
7	300070	碧水源	70,527,480.87	4.55
8	000538	云南白药	66,420,723.46	4.28
9	002086	东方海洋	65,991,312.45	4.26
10	000639	西王食品	55,857,615.13	3.60
11	000568	泸州老窖	49,172,771.79	3.17
12	000811	烟台冰轮	48,144,904.04	3.10
13	002460	赣锋锂业	47,450,719.89	3.06
14	002223	鱼跃医疗	47,360,383.13	3.05
15	002466	天齐锂业	46,552,095.01	3.00
16	002298	鑫龙电器	45,846,113.30	2.96
17	002155	辰州矿业	44,215,622.83	2.85
18	000826	桑德环境	37,700,781.46	2.43
19	600467	好当家	37,416,806.75	2.41
20	002162	斯 米 克	36,214,263.70	2.34
21	300068	南都电源	32,280,109.31	2.08
22	600519	贵州茅台	32,160,845.22	2.07
23	300196	长海股份	32,101,994.56	2.07
24	600655	豫园商城	31,987,060.88	2.06
25	600153	建发股份	31,402,968.85	2.03
26	300027	华谊兄弟	31,324,559.30	2.02

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	2,279,705,781.37
卖出股票收入（成交）总额	2,563,621,976.75

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

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。

7.9.2

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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,961,196.46
2	应收证券清算款	25,334,400.00
3	应收股利	-
4	应收利息	30,997.89
5	应收申购款	57,792.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,384,386.53

7.9.4 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。

7.9.5 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。

7.9.6 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。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
70,605	26,460.11	298,348,214.73	15.97%	1,569,868,086.02	84.03%

8.2 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	92,553.22	0.00%

注：1、本公司高级管理人员、投资部、研究部负责人持有该基金份额总量的数量区间：0 万

2、本基金基金经理持有该基金份额总量的数量区间：0 万

§9 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	2,112,350,155.25
本报告期基金总申购份额	28,202,098.21
减:本报告期基金总赎回份额	272,335,952.71
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,868,216,300.75

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

经泰信基金管理有限公司第三届董事会 2012 年第一次（通讯）会议审议通过，决定新增戴宇虹女士担任泰信优质生活基金经理，与刘强先生共同管理本基金，朱志权先生不再担任泰信优质生活基金经理职务。具体详情见 2012 年 3 月 1 日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信优质生活股票基金基金经理变更的公告》。

除此以外，报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无其他重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

我公司诉华远星海运有限公司房屋租赁合同纠纷一案经浦东新区法院 2011 年 11 月 28 日受理后，于 2012 年 1 月 4 日首次公开开庭进行了审理。法院依法追加了上海宏普实业投资有限公司作为第三人参加诉讼，并组成合议庭于 2012 年 6 月 19 日第二次公开开庭进行审理，本案现已审理终结。法院支持我公司全部诉求，判决华远星海运有限公司向我公司支付剩余租金及其违约金。本公司认为，上述案件不会对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响。

除此以外，无其他涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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	
国泰君安	1	566,956,308.59	11.71%	460,655.97	11.45%	-
东方证券	1	551,777,696.47	11.39%	454,746.05	11.31%	-
申银万国	1	546,221,593.11	11.28%	466,614.84	11.60%	-
中银国际	2	440,964,741.50	9.10%	358,286.99	8.91%	-
华泰联合	1	417,348,757.36	8.62%	339,099.49	8.43%	-
方正证券	1	368,557,301.60	7.61%	299,455.68	7.44%	-
长江证券	1	342,602,091.55	7.07%	278,930.83	6.93%	-
浙商证券	1	308,535,941.53	6.37%	262,256.26	6.52%	-
光大证券	1	287,815,708.39	5.94%	244,642.13	6.08%	-
国联证券	1	279,833,357.56	5.78%	237,856.63	5.91%	-
第一创业	1	242,844,401.46	5.01%	207,767.84	5.17%	-
财富证券	1	179,552,635.90	3.71%	152,654.71	3.80%	-
海通证券	2	157,067,064.18	3.24%	127,618.39	3.17%	-
中投证券	1	74,789,950.47	1.54%	65,291.57	1.62%	-
中信证券	2	63,957,942.29	1.32%	54,364.02	1.35%	-
上海证券	1	6,740,277.83	0.14%	5,729.19	0.14%	-
招商证券	1	5,295,068.37	0.11%	4,302.31	0.11%	-
广发证券	2	2,466,919.96	0.05%	2,090.74	0.05%	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券	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泰信蓝筹精选基金、泰信增强收益基金、泰信中证 200 指数基金、泰信中小盘股票基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	100,000,000.00	6.99%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	540,000,000.00	37.76%	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	640,000,000.00	44.76%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	150,000,000.00	10.49%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-

中航证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

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	2011 年 4 季报	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2012 年 1 月 20 日
2	新增中信证券（浙江）为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2012 年 2 月 10 日
3	基金经理变更	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2012 年 3 月 1 日
4	2011 年年报	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2012 年 3 月 26 日
5	在渤海证券、中航证券、国金证券开通转换业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2012 年 3 月 27 日
6	在中信证券、中信万通、中信证券（浙江）、国信证券、平安证券开通定投及转换业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2012 年 3 月 27 日
7	在东方证券、国都证券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）	2012 年 3 月 28 日
8	在海通证券、长城证券、华安证券、江海证券、信达证券、中信建投证券开通定投、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）	2012 年 3 月 28 日
9	参加工商银行费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券	2012 年 4 月 7 日

		报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	
10	在华宝证券开通定投、转换、费率优惠业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2012 年 4 月 21 日
11	2012 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）	2012 年 4 月 24 日
12	在上海证券开通转换、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）	2012 年 6 月 13 日
13	参加中信银行费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2012 年 6 月 28 日

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰信优质生活股票型证券投资基金设立的文件

2、《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》

3、《泰信优质生活股票型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信优质生活股票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、报告期内泰信优质生活股票型证券投资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(400-888-5988，021-38784566)，和本公司客服联系。

泰信基金管理有限公司
2012 年 8 月 29 日