

泰信增强收益债券型证券投资基金
2012 年年度报告
摘要

2012 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：2013 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示

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 2013 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 2012 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	118,562,505.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	泰信债券增强收益 A	泰信债券增强收益 C
下属分级基金的交易代码:	290007	291007
报告期末下属分级基金的份额总额	80,815,343.49 份	37,747,161.52 份

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，并跟踪影响资产配置的各种因素的变化，定期对资产配置比例进行调整。
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	021-20899032	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

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	上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 37 层
------------	------------------------------

§ 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012 年		2011 年		2010 年	
	泰信债券增强收益 A	泰信债券增强收益 C	泰信债券增强收益 A	泰信债券增强收益 C	泰信债券增强收益 A	泰信债券增强收益 C
本期已实现收益	7,625,698.17	1,759,391.32	258,955.34	-115,060.94	34,411,884.39	7,053,652.30
本期利润	13,586,674.92	2,440,117.96	-4,635,890.38	-881,538.20	28,485,826.74	7,876,752.45
加权平均基金份额本期利润	0.1090	0.0881	-0.0199	-0.0259	0.0616	0.0447
本期基金份额净值增长率	9.52%	9.13%	-3.44%	-3.82%	6.69%	6.29%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末		2011 年末		2010 年末	
	泰信债券增强收益 A	泰信债券增强收益 C	泰信债券增强收益 A	泰信债券增强收益 C	泰信债券增强收益 A	泰信债券增强收益 C
期末可供分配基金份额利润	0.0136	0.0100	-0.0297	-0.0353	0.0049	0.0030
期末基金资产净值	81,917,874.28	38,126,007.18	176,484,300.66	24,253,937.55	313,934,516.17	50,258,824.97
期末基金份额净值	1.0136	1.0100	0.9703	0.9647	1.0049	1.0030

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。

4、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

泰信债券增强收益 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	2.62%	0.05%	1.35%	0.02%	1.27%	0.03%
过去六个月	2.91%	0.13%	2.42%	0.03%	0.49%	0.10%
过去一年	9.52%	0.14%	6.65%	0.04%	2.87%	0.10%
过去三年	12.82%	0.23%	17.76%	0.05%	-4.94%	0.18%
自基金合同 生效日起至 今	11.55%	0.26%	18.61%	0.05%	-7.06%	0.21%

泰信债券增强收益 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	2.52%	0.05%	1.35%	0.02%	1.17%	0.03%
过去六个月	2.72%	0.13%	2.42%	0.03%	0.30%	0.10%
过去一年	9.13%	0.14%	6.65%	0.04%	2.48%	0.10%
过去三年	11.56%	0.23%	17.76%	0.05%	-6.20%	0.18%
自基金合同 生效日起至 今	10.10%	0.26%	18.61%	0.05%	-8.51%	0.21%

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。

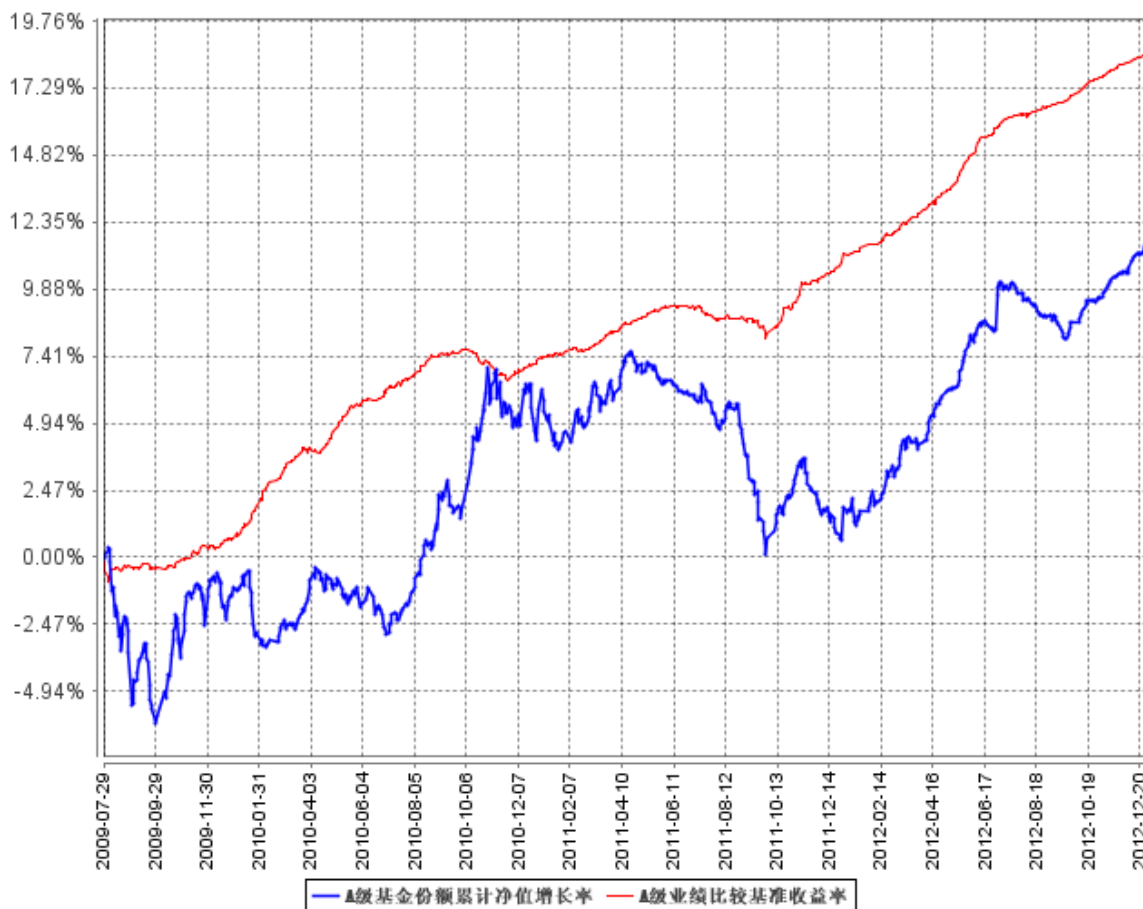
1、上证企业债指数，是按照科学客观的方法，从国内交易所上市企业债中挑选了满足一定条件的具有代表性的债券组成样本，按照债券发行量加权计算的指数，科学地反应了我国企业债券市场的变化。

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。

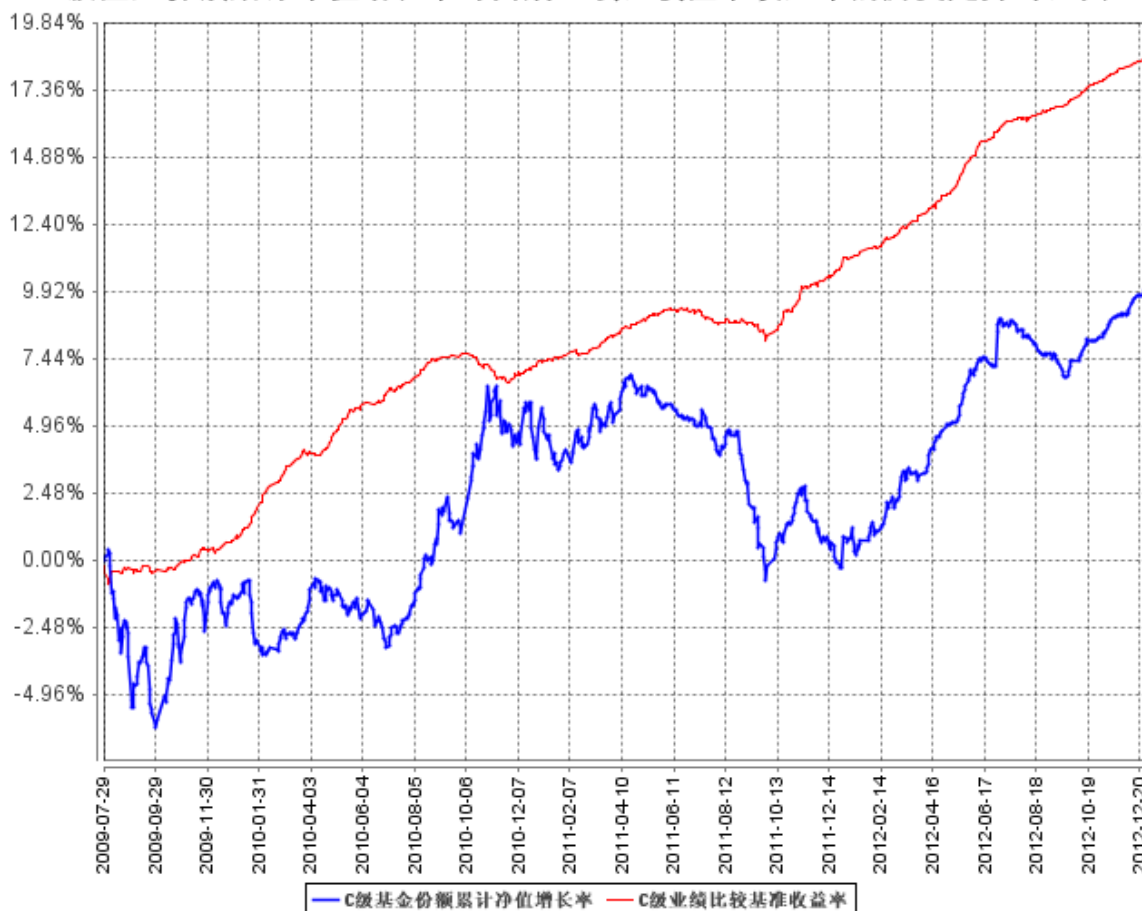
3、上证企业债指数与上证国债指数很好地反映了我国债券市场的整体状况，具有较高的权威和市场代表性，投资人可以从上交所行情、中国货币网等处获得。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

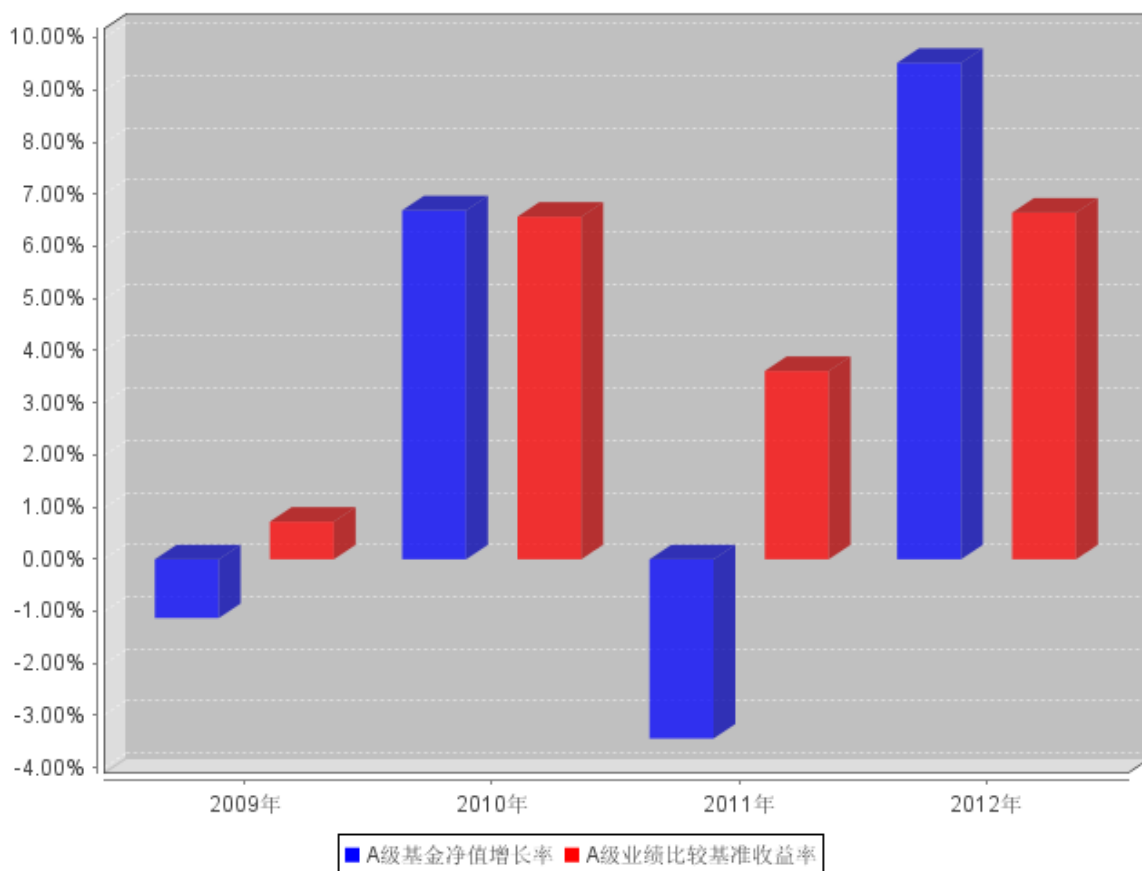


注：1、本基金基金合同于 2009 年 7 月 29 日正式生效。

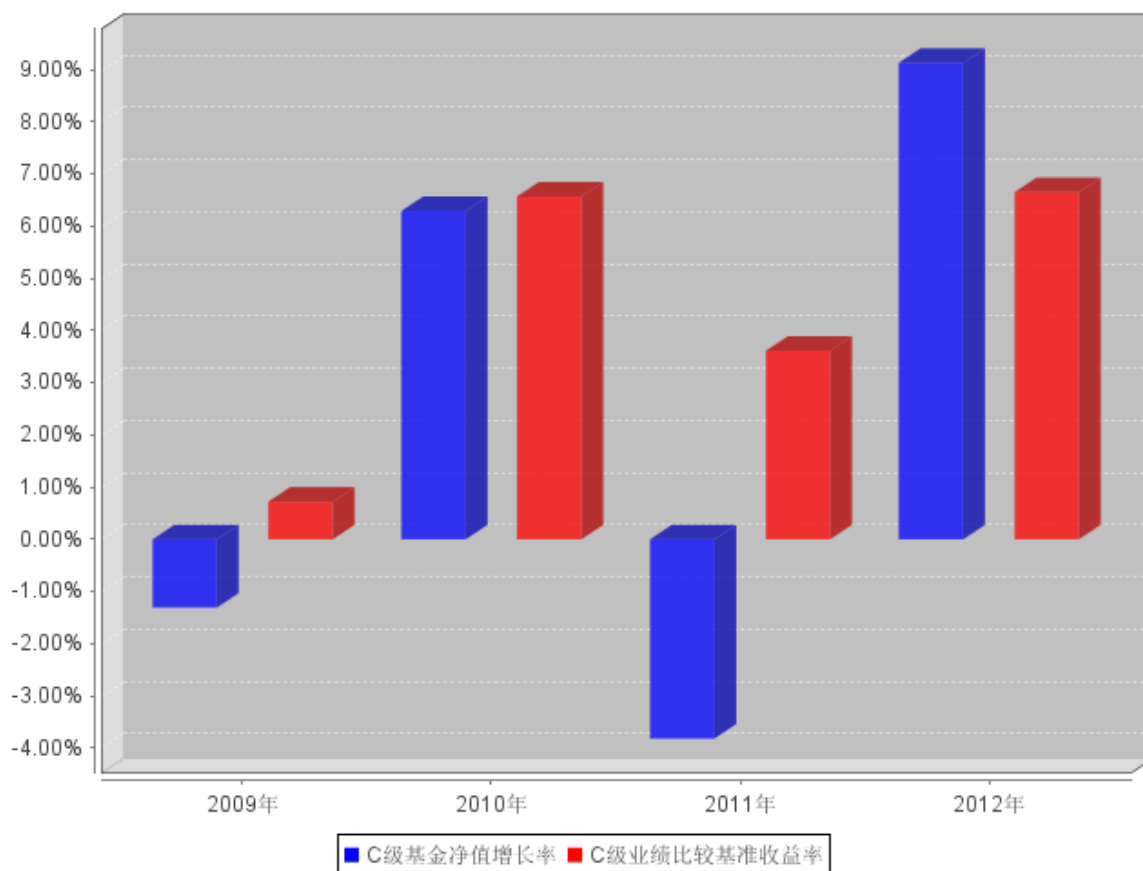
2、本基金建仓期为六个月。建仓期满，本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于权益类资产的比例不高于基金资产的 20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

3.2.3 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

A级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对比图



C级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对比图



注：本基金合同生效日为 2009 年 7 月 29 日，2009 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

泰信债券增强收益 A					
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
2012	0.4800	3,589,059.93	2,472,239.67	6,061,299.60	
2011	-	-	-	-	
2010	0.5000	7,444,785.25	10,100,448.90	17,545,234.15	
合计	0.9800	11,033,845.18	12,572,688.57	23,606,533.75	

泰信债券增强收益 C					
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
2012	0.4200	1,254,580.24	321,915.26	1,576,495.50	
2011	-	-	-	-	
2010	0.4600	2,595,580.32	709,849.68	3,305,430.00	
合计	0.8800	3,850,160.56	1,031,764.94	4,881,925.50	

注：2011 年度本基金未进行利润分配。

§ 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：上海市浦东新区浦东南路 256 号 37 层

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36、37 层

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：孟凡利

总经理：葛航

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：王伟毅

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。

公司目前下设市场部、营销部（分华东、华北、华南三大营销中心和电子商务部）、客服中心、基金投资部、研究部、专户投资部、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、计划财务部、综合管理部、北京分公司、深圳分公司。截至 2012 年 12 月底，公司有正式员工 115 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 12 月，泰信基金管理有限公司旗下共有泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活股票、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、泰信发展主题股票、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选股票、泰信保本混合、泰信中证基本面 400 指数分级共 13 只开放式基金及泰信财富分级 2 号、泰信财富分级 3 号、泰信财富分级 4 号、泰信乐享分级 1 号、泰信恒益高息债分级共 5 个资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
何俊春 女士	投资部投资 副总监兼固 定收益投资 总监、本基 金基金经理 兼泰信双 息双利基 金、泰信 债券周期 回报基金 经理	2009年7月29 日	-	15	工商管理硕士。具有基金从业资格。曾任职于上海鸿安投资咨询有限公司、齐鲁证券上海斜土路营业部。2002年12月加入泰信基金管理有限公司，先后担任泰信天天收益基金交易员、交易主管，泰信天天收益基金经理。自2008年10月10日起担任泰信双息双利债券基金基金经理；自2012年10月25日起担任泰信债券周期回报基金经理。同时担任投资部投资副总监兼固定收益投资总监。

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和离职日期以公司公告为准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》、《泰信增强收益债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金的投资运作符合有关法律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候方式处理。

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时反向交易，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

一、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。

二、本报告期基金同向交易价差专项分析

本公司截至 2012 年 12 月 31 日,共有 13 只公募基金,5 只专户产品。剔除 2 只指数基金(被动指数在交易过程中采用自动化交易),对其余投资组合进行两两分组,进行同向交易价差分析。

我们采用连续样本计算方法,对 2012 年连续 4 个季度的同向价差数据,分别进行时间窗口在 1 天、3 天、5 天内的数据 T 检验分析,结果表明:

- 1) 通过 T 检验的和正溢价次数占比在 45%~55%的数据符合公平公正原则;
- 2) 未通过 T 检验的数据的溢价金额占基金净值比均在 1%以内,连续四个季度的溢价金额不足以对基金净值造成显著影响,各基金之间不存在利益输送;
- 3) 未发现其他异常。

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

2012 年国内宏观经济经历了软着陆之后,自四季度开始温和复苏,全年 GDP 增长 7.8%。PMI 指标 4 月达到年内高点之后一路下行,并于 8、9 月份下到荣枯线之下,4 季度才重新回到 50 以上。固定资产投资自 6 月开始呈现逐步回升的趋势。工业增加值年初一路下行后,自 9 月开始逐步回升。从物价指数及资金成本看,全年 CPI 平均涨幅为 2.6%,银行间 7 天回购利率全年中枢在 3.5%附近。央行 2 次降息和 2 次降准也为市场带来了宽松的政策预期。从债市表现看,上半年 10 年期国债收益率一度下行至 3.24%,三季度以来开始反弹,年末达到 3.57%;信用产品主要受高信用利差的缩窄和资金面的宽松双重作用,全年表现较好;转债全年表现一般,但 12 月随股市有大幅上涨。

本基金 2012 年在信用债牛市中始终保持着较高的企业债仓位,较好的把握了信用债牛市机会,期间通过减持偏股类资产有效回避了权益市场风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金 A 类单位净值为 1.0136 元,份额净值增长率为 9.52%,同期业绩比较基准收益率为 6.65%;C 类单位净值为 1.0100 元,份额净值增长率为 9.13%,同期业绩比较基准收益率为 6.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前,我们对 2013 年的经济较为乐观。外部来看,美国、欧洲、日本经济呈企稳回升的态势。内部来看,受益于新政治周期下的投资增长、持续的去库存化,内外需将会同时推动中国经济复

苏，有望终结持续三年的下行周期，目前 PMI 指数、制造业数据均延续着温和回升趋势，不过复苏的力度暂时尚无法寄望太多。我们预计通胀上半年将在 2-2.5% 之间波动，并对下半年走势比较担忧。综合对经济和通胀两者的判断，预计货币政策短期内应该会保持中性，这将有利于资金继续维持整体宽松的局面。放眼债券市场，现在正处于牛市尾声，但熊市尚未到来的阶段。利率债价值不高，经过前期的调整后，短期内收益率继续上行的压力较轻，但也不存在明显的交易性机会。信用债方面，继续像去年那样获得丰厚的资本利得难度较高，考虑到上半年通胀温和，暂不会对货币政策产生方向性影响，因此，依赖于票息收益的高收益债仍具有一定的吸引力。相对纯债而言，我们更看好转债，今年偏股型转债将会获得较高的收益。

2013 年增强收益基金将做好久期管理，有效调整进行资产配置。投资品种仍以信用债为主，并通过精选资质较好的债券标的，规避信用事件对投资组合造成的影响。同时，基金将关注转债市场走势，我们相对看好转债市场，同时也会精选个券并努力把握住配置的时点。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，公司内部控制工作本着对基金份额持有人利益高度负责的精神，以独立于各业务部门的风险管理部、监察稽核部为主体，对基金销售、投资运作、后台保障等主要业务活动进行监督与控制，较好地保证了基金运作的合规性。主要工作情况如下：

1、加强公司制度体系建设。公司根据监管部门规定和要求，及时对公司原有制度流程修改审定，促进了业务的合规开展。主要包括《公司公平交易制度》、《异常交易监控与报告制度》、《公司员工直系亲属股票投资管理办法》、《基金参与上市公司股东大会管理办法》、《系统操作权限管理办法》等，完善了内部风险控制和管理。

2、进一步规范基金投资管理 workflow，加强基金投资风险控制。2012 年度，证券市场表现不佳，投资者的申购赎回行为对投资组合的影响较大。风险管理部专人负责指标的跟踪、监控与提示工作，对于因申购赎回或者个股大幅波动导致的被动局面，经投资组合经理申请、相关人员批准后及时修正，确保投资监控指标的控制效果。

3、规范投资交易行为，防范交易环节的操作风险。公司禁止基金内的同日反向交易，严格控制旗下管理投资组合间的同日反向交易。对于日常的投资监控，公司实行的是事前控制、事中监督、事后检查的方法，在公平交易的各环节建立了责任追究制，实行各部门责任人、分管领导责任人负责制，以最大限度地监控并处置可能造成不公平交易或利益输送的行为。

4、针对重点业务环节开展专项检查，查漏补缺，做好事后环节督促改进工作。公司于年初制定了《2012 年度专项稽核工作计划》，稽查工作覆盖主要业务板块，突出了核查重点。全年完成了清算会计、销售业务和研究、投资、交易相关环节、公平交易相关环节、一级市场申购相关环

节的专项稽核，对稽核中发现的问题通过书面报告的形式及时通报部门总监、报告督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果，切实保证了基金运作和公司经营的合法合规。

5、做好投研交易等人员的合规培训，提高合规意识。公司组织投研人员开展内幕交易案例合规培训，就近年来发生的典型内幕交易案例作了分类汇报，并对目前市场上的疑似内幕交易、有争议的内幕交易案例进行了说明，要求投研人员遵守投资纪律，规范决策流程，从源头避免内幕交易事件的发生，加强了投研人员的合规意识。

6、公司采用技术手段对网站、交易、行情等进行屏蔽，对其他非受控方式上网及即时通讯做出进一步规范。加强投研人员的资讯管理，对基金经理集中区域进行录像监控，对于证券公司的网站、网页委托进行了屏蔽，对投研人员的办公电脑安装截屏软件进行留痕处理，并对安装软件的权限进行严格限制。

在本报告期内，本基金的投资运作各环节基本符合规定的要求，未出现异常交易、操纵市场、内幕交易等违法违规现象。今后公司将继续夯实内部控制和风险管理工作，保证基金运作的合规性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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，大学本科。曾任职于山东省国际信托投资公司计财部、山东省国际信托投资公司上海证券部、鲁信香港投资有限公司。2002 年加入泰信基金管理公司，现任公司副总经理。

委员会成员：

唐国培先生，硕士，2002 年加入泰信基金管理有限公司，现任公司风险管理部总监。

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总监。

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，现任投资部总监兼投资总监，泰信先行策略、泰信优势增长基金经理。

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

2、本基金基金经理不参与本基金估值。

3、参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.8 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、本报告期，本基金 A 类每 10 份分配 0.4800 元，利润分配合计 6,061,299.60 元，（其中，现金形式发放 3,589,059.93 元，再投资形式发放 2,472,239.67 元）；C 类每 10 份分配 0.4200 元，利润分配合计 1,576,495.50 元，（其中，现金形式发放 1,254,580.24 元，再投资形式发放 321,915.26 元）符合基金合同的约定。

§ 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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2013)第 20418 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰信增强收益债券型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的泰信增强收益债券型证券投资基金(以下简称“泰信增强收益基金”)的财务报表,包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是泰信增强收益基金的基金管理人泰信基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“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财务报表,并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相

	<p>关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述泰信增强收益基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的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，公允反映了泰信增强收益基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	单峰 张晓艺
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
审计报告日期	2013 年 3 月 26 日

§ 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：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	1,188,625.11	25,586,745.23
结算备付金	528,020.07	641,400.80
存出保证金	-	1,559.88
交易性金融资产	112,027,746.13	181,228,997.07
其中：股票投资	-	7,820,712.10
基金投资	-	-
债券投资	112,027,746.13	173,408,284.97
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	6,000,000.00	-
应收证券清算款	3,805.55	-
应收利息	1,691,516.66	3,215,668.93
应收股利	-	-
应收申购款	96,519.23	12,500.85
递延所得税资产	-	-

其他资产	-	-
资产总计	121,536,232.75	210,686,872.76
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2012年12月31日	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	8,401,958.93
应付赎回款	19,148.57	20,965.78
应付管理人报酬	63,351.66	101,944.56
应付托管费	21,117.22	33,981.49
应付销售服务费	14,519.54	8,251.32
应付交易费用	2,995.76	4,564.74
应交税费	940,705.06	932,404.54
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	430,513.48	444,563.19
负债合计	1,492,351.29	9,948,634.55
所有者权益:		
实收基金	118,562,505.01	207,030,650.30
未分配利润	1,481,376.45	-6,292,412.09
所有者权益合计	120,043,881.46	200,738,238.21
负债和所有者权益总计	121,536,232.75	210,686,872.76

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.0136 元，C 类基金份额净值 1.0100 元，基金份额总额 118,562,505.01 份，其中 A 类基金份额 80,815,343.49 份，C 类基金份额 37,747,161.52 份。

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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年12 月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年 12月31日
一、收入	17,819,982.16	-1,952,761.23
1.利息收入	6,196,530.44	8,272,704.58
其中：存款利息收入	85,195.87	236,566.15
债券利息收入	6,004,918.66	8,036,138.43

资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	106,415.91	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	4,962,826.05	-4,608,288.82
其中：股票投资收益	152,027.27	4,073,355.18
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,810,798.78	-8,699,141.98
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	17,497.98
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6,641,703.39	-5,661,322.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	18,922.28	44,145.99
减：二、费用	1,793,189.28	3,564,667.35
1. 管理人报酬	924,277.68	1,614,132.79
2. 托管费	308,092.46	538,044.26
3. 销售服务费	110,913.37	136,342.18
4. 交易费用	36,591.86	212,673.57
5. 利息支出	58,680.84	682,340.38
其中：卖出回购金融资产支出	58,680.84	682,340.38
6. 其他费用	354,633.07	381,134.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	16,026,792.88	-5,517,428.58
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	16,026,792.88	-5,517,428.58

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：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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）	207,030,650.30	-6,292,412.09	200,738,238.21

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	16,026,792.88	16,026,792.88
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）	-88,468,145.29	-615,209.24	-89,083,354.53
其中：1. 基金申购款	97,870,812.50	1,249,971.85	99,120,784.35
2. 基金赎回款	-186,338,957.79	-1,865,181.09	-188,204,138.88
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）	-	-7,637,795.10	-7,637,795.10
五、期末所有者权益（基金净值）	118,562,505.01	1,481,376.45	120,043,881.46
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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）	362,505,847.99	1,687,493.15	364,193,341.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-5,517,428.58	-5,517,428.58
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）	-155,475,197.69	-2,462,476.66	-157,937,674.35
其中：1. 基金申购款	97,112,549.60	-665,846.66	96,446,702.94
2. 基金赎回款	-252,587,747.29	-1,796,630.00	-254,384,377.29
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）	207,030,650.30	-6,292,412.09	200,738,238.21

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：

葛航
基金管理公司负责人

韩波
主管会计工作负责人

庞少华
会计机构负责人

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类基金份额和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% X 上证企业债指数+20% X 上证国债指数。

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2013年3月26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》和在财务报表附注7.4.4所列示的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。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2012年度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

7.4.5 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[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)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。
- (3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。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。
- (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、基金销售机构
山东省国际信托有限公司（“山东国托”）	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信实业有限公司（“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。

7.4.8 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

7.4.8.1.1 股票交易

本期末及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本期及上年度可比期间本基金无应支付关联方佣金余额。

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 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	924,277.68	1,614,132.79
其中：支付销售机构的客户维护费	85,424.45	106,900.36

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: $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.6\% / \text{当年天数}$ 。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	308,092.46	538,044.26

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: $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}$ 。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位: 人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰信债券增强收益 A	泰信债券增强收益 C	合计
泰信基金该有限公司	-	640.89	640.89
中国银行	-	61,888.82	61,888.82
合计	-	62,529.71	62,529.71
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰信债券增强收益 A	泰信债券增强收益 C	合计
泰信基金管理有限公司	-	646.14	646.14
中国银行	-	77,388.01	77,388.01
合计	-	78,034.15	78,034.15

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 0.4% 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: $\text{日销售服务费} = \text{C 类基金份额前一日基金资产净值} \times 0.4\% / \text{当年天数}$ 。

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

单位: 人民币元

本期

2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	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	19,528,119.45	-	-	-	-	-

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自有资金投资本基金的情况

本报告期末及上年度可比期间本基金未运用自有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		2011 年 1 月 1 日至 2011 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	1,188,625.11	77,130.96	25,586,745.23	217,577.13

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

本报告期末及上年度可比期间本基金未在承销期内持有关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2012 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

7.4.10.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限	认购价格	期末估值单价	数量（单位：）	期末成本总额	期末估值总额	备注

				类型			张)			
1280484	12 东 台债	2012 年 12 月 28 日	2013 年 1 月 10 日	网下新 债申购	100.00	100.00	300,000	30,000,000.00	30,000,000.00	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2012 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 20,930,746.13 元，属于第二层级的余额为 91,097,000.00 元，无属于第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日：第一层级 166,805,997.07 元，第二层级 14,423,000.00 元，无

第三层级)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	112,027,746.13	92.18
	其中：债券	112,027,746.13	92.18
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	6,000,000.00	4.94
	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	1,716,645.18	1.41
6	其他各项资产	1,791,841.44	1.47
7	合计	121,536,232.75	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

报告期末本基金未持有股票。

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

报告期末本基金未持有股票。

8.4 报告期内股票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	603002	宏昌电子	607,953.60	0.30
2	002673	西部证券	17,400.00	0.01
3	002666	德联集团	8,500.00	0.00

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。

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	601555	东吴证券	3,063,718.48	1.53
2	601028	玉龙股份	2,963,708.16	1.48
3	600886	国投电力	1,819,700.00	0.91
4	603002	宏昌电子	850,173.57	0.42
5	601336	新华保险	515,896.00	0.26
6	601908	京运通	514,905.06	0.26
7	002673	西部证券	28,420.00	0.01
8	002614	蒙发利	16,105.00	0.01
9	002649	博彦科技	9,845.00	0.00
10	002666	德联集团	9,160.00	0.00

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。

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	633,853.60
卖出股票收入（成交）总额	9,791,631.27

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。

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	9,993,000.00	8.32
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	61,047,630.00	50.85
5	企业短期融资券	29,976,000.00	24.97
6	中期票据	-	-
7	可转债	11,011,116.13	9.17
8	其他	-	-
9	合计	112,027,746.13	93.32

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（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1280484	12 东台债	300,000	30,000,000.00	24.99
2	1280088	12 海安债	200,000	21,128,000.00	17.60
3	011220004	12 中铝 SCP004	100,000	10,009,000.00	8.34
4	1001042	10 央票 42	100,000	9,993,000.00	8.32
5	041253027	12 澜沧江 CP001	100,000	9,987,000.00	8.32

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产。

8.9.3 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	-
2	应收证券清算款	3,805.55
3	应收股利	-
4	应收利息	1,691,516.66

5	应收申购款	96,519.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,791,841.44

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	125089	深机转债	5,929,134.13	4.94
2	110017	中海转债	2,168,740.00	1.81
3	110012	海运转债	2,128,070.00	1.77
4	110019	恒丰转债	551,900.00	0.46
5	129031	巨轮转 2	233,272.00	0.19

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金未投资股票。

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

§ 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
泰信债券增强收益 A	1,350	59,863.22	56,332,264.18	69.70%	24,483,079.31	30.30%
泰信债券增强	1,142	33,053.56	30,002.40	0.08%	37,717,159.12	99.92%

收益 C						
合计	2,492	47,577.25	56,362,266.58	47.54%	62,200,238.43	52.46%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

- 1、报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。
- 2、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
- 3、本基金基金经理持有该基金份额总量的数量区间：0 万

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰信债券增强收 益 A	泰信债券增强收 益 C
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
本报告期期初基金份额总额	181,889,379.39	25,141,270.91
本报告期基金总申购份额	17,363,986.63	80,506,825.87
减：本报告期基金总赎回份额	118,438,022.53	67,900,935.26
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	80,815,343.49	37,747,161.52

注：总申购份额含红利再投资、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、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。2013 年 3 月 17 日，根据国家金融工作需要，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于 2013 年 3 月 17 日公告上述事项。

2、经泰信基金管理有限公司第四届董事会 2012 年第一次会议审议通过，公司副总经理桑维英女士代任公司总经理职务，高清海先生不再担任公司总经理职务。具体详情参见 2012 年 9 月 22 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》上的《泰信基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

3、经泰信基金管理有限公司第四届董事会 2012 年第一次会议审议通过，聘任葛航先生担任公司总经理职务。根据证监会《关于核准泰信基金管理有限公司葛航基金行业高级管理人员任职资格的批复》（证监许可[2012]1745 号），核准葛航先生担任公司总经理职务。具体详情参见 2012 年 12 月 29 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》上的《泰信基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本公司上述人事变动已按相关规定备案并公告。

11.3 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了审理，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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金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 6 万元。该审计机构从基金合同生效日（2009 年 7 月 29 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

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。

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	

光大证券	1	3,912,180.48	39.95%	3,325.28	39.87%	-
中信证券	2	2,081,613.57	21.26%	1,788.91	21.45%	-
申银万国	1	2,044,105.06	20.88%	1,737.50	20.83%	-
浙商证券	1	885,092.16	9.04%	752.33	9.02%	-
第一创业	1	514,610.00	5.26%	437.41	5.24%	-
上海证券	1	290,500.00	2.97%	246.88	2.96%	-
广发证券	2	37,580.00	0.38%	30.53	0.37%	-
华泰联合证券	1	16,105.00	0.16%	13.08	0.16%	-
方正证券	1	9,845.00	0.10%	8.00	0.10%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
长财证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中国建银投资 证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
信泰证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

长江证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	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、泰信中证 200 指数基金、泰信中小盘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
光大证券	44,162,812.02	4.82%	-	-	-	-
中信证券	552,092,666.03	60.28%	885,300,000.00	95.78%	-	-
申银万国	51,967,159.89	5.67%	-	-	-	-
浙商证券	73,271,969.14	8.00%	24,000,000.00	2.60%	-	-
第一创业	50,306,930.49	5.49%	15,000,000.00	1.62%	-	-
上海证券	19,522,904.77	2.13%	-	-	-	-
广发证券	90,776,819.40	9.91%	-	-	-	-
华泰联合证券	1,490,037.40	0.16%	-	-	-	-
方正证券	679,709.06	0.07%	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长财证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-

国元证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中国建银投资 证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安	3,170,798.00	0.35%	-	-	-	-
中银国际	1,755,714.48	0.19%	-	-	-	-
信泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	3,029,980.40	0.33%	-	-	-	-
长江证券	986,841.45	0.11%	-	-	-	-
海通证券	613,157.29	0.07%	-	-	-	-
国联证券	22,074,140.14	2.41%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

泰信基金管理有限公司
2013年3月29日