

泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金 2013 年半年度报告

2013 年 6 月 30 日

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2013 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	48
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	48
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.10 投资组合报告附注	48
§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金前十名持有人（A、B 级）	50

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	53
§11 备查文件目录.....	55
11.1 备查文件目录	55
11.2 存放地点	55
11.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金		
基金简称	泰信基本面 400 指数分级		
场内简称	泰信 400		
基金主代码	162907		
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）		
基金合同生效日	2012 年 9 月 7 日		
基金管理人	泰信基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	33,756,902.09 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012-09-21		
下属分级基金的基金简称	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
场内简称	泰信 400A	泰信 400B	泰信 400
下属分级基金的交易代码	150094	150095	162907
报告期末下属分级基金份额总额	7,258,355.00 份	7,258,355.00 份	19,240,192.09 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对中证锐联基本面 400 指数的有效跟踪。		
投资策略	本基金主要采用完全复制法，按照在中证锐联基本面 400 指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合和跟踪中证锐联基本面 400 指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。		
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证锐联基本面 400 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率（税后）}$		
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。		
下属三级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。	高风险、高预期收益。	较高风险、较高预期收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	唐国培	赵会军
	联系电话	021-20899032	010—66105799

	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-5988	95588
传真		021-20899008	010—66105798
注册地址		上海市浦东新区浦东南路 256 号 37 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区浦东南路 256 号 华夏银行大厦 36-37 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		葛航（代任）	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
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 37 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2013 年 1 月 1 日 - 2013 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,474,835.91
本期利润	-1,669,576.12
加权平均基金份额本期利润	-0.0426
本期加权平均净值利润率	-3.86%
本期基金份额净值增长率	-9.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-145,906.56
期末可供分配基金份额利润	-0.0043
期末基金资产净值	33,269,599.38
期末基金份额净值	0.986
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	-1.40%
-------------	--------

注：1、本基金合同生效日为 2012 年 9 月 7 日，截至本报告期末不满一年。

2、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。

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

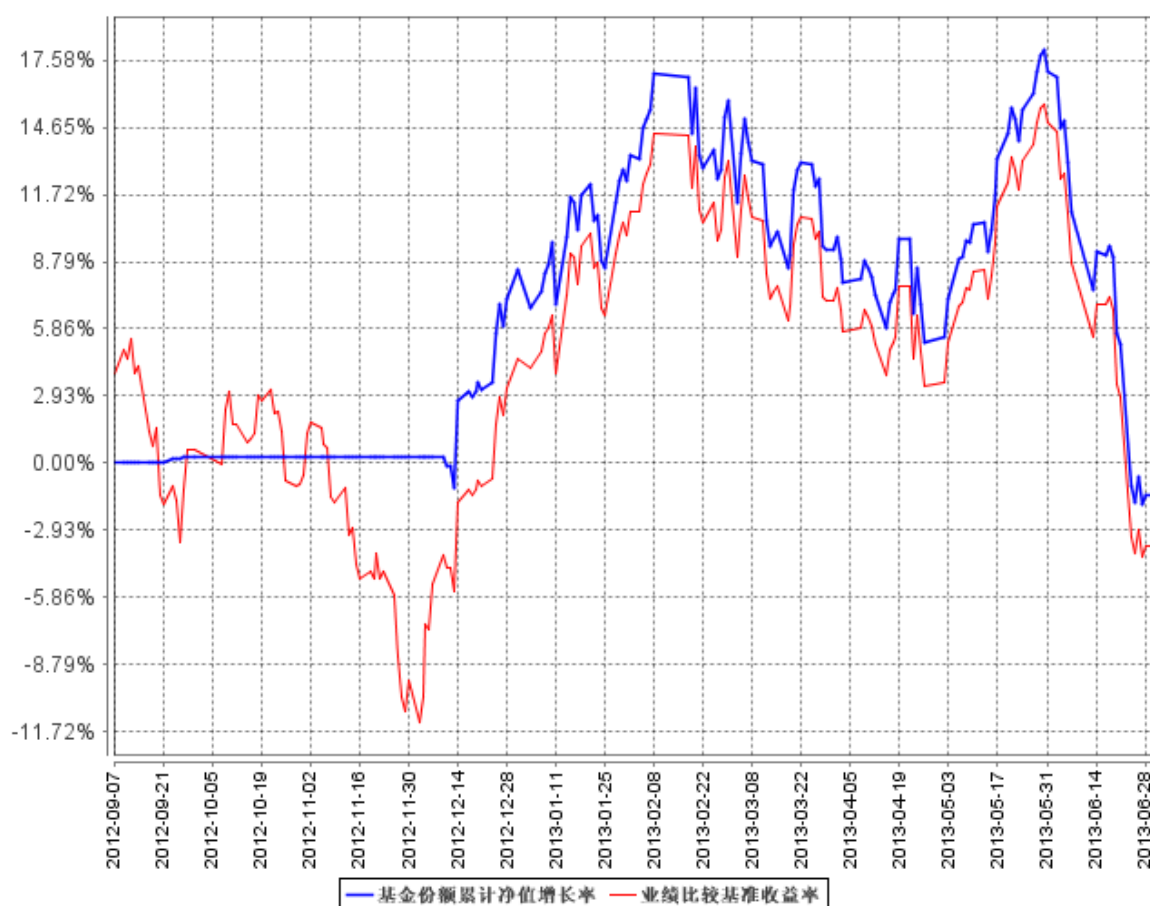
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-15.80%	1.77%	-16.12%	1.77%	0.32%	0.00%
过去三个月	-9.79%	1.41%	-10.03%	1.41%	0.24%	0.00%
过去六个月	-9.04%	1.39%	-7.87%	1.39%	-1.17%	0.00%
自基金合同生效日起至 今	-1.40%	1.13%	-3.64%	1.40%	2.24%	-0.27%

注：本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证锐联基本面 400 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率（税后）}$

中证锐联基本面 400 指数以沪深 A 股为样本空间，挑选基本面价值中间的第 201 家至第 600 家上市公司作为样本股，基本面价值由四个财务指标来衡量：营业收入、现金流、净资产和分红；样本股的权重配置由基本面价值决定，在一定程度上打破了样本市值与其权重之间的关联，避免了传统市值指数中过多配置高估股票的现象。

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

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 2012 年 9 月 7 日正式生效。截至报告期末未满一年。

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。本基金投资于中证锐联基本面 400 指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%；现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

§ 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：葛航（代任）

总经理：葛航

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：庄严

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 2013 年 6 月，公司有正式员工 111 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 2013 年 6 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、泰信现代服务业股票共 14 只开放式基金及泰信财富分级 5 号、泰信恒益高息债分级共 2 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		
陈大庆先生	本基金经理兼泰信中证 200 指数基金经理	2012 年 9 月 7 日	-	10	管理学硕士。具有基金从业资格。曾在中国建银投资证券有限责任公司、华林证券有限责任公司担任研究员。2008 年 2 月加入泰信基金管理有限公司，先后担任研究员、优质生活基金经理助

					理。自 2011 年 6 月 9 日起担任泰信中证 200 指数基金经理至今。
冯张鹏先生	本基金基金经理助理兼泰信中证 200 指数基金经理助理	2012 年 9 月 7 日	-	5	工科博士。具备基金从业资格。曾在英国德意志银行担任分析师。2010 年 9 月加入泰信基金管理有限公司担任风险管理部高级风险分析师，同时兼任研究部策略研究小组高级量化分析师。自 2011 年 8 月 15 日起担任泰信中证 200 指数基金经理助理。

注：1、以上日期均是指公司公告的日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》、《泰信中证锐利基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金的投资运作符合有关法规和基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

送的同日反向交易。本报告期内，本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况，亦无其他异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

中证基本面 400 指数在 2013 年上半年波动较大，中证基本面 400 指数最高点为 4160.45，最低点为 3457。沪深 300 指数上半年下跌 12.78%，泰信基本面 400 指数基金同期表现为下跌 9.04%，比较基准同期表现为下跌 7.87%。

报告期内，我们严格遵守基金合同，以严格控制基金相对目标指数（基本面 400 指数）的跟踪偏离为投资目标，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差，追求跟踪误差的最小化，报告期内年化跟踪误差控制在 1.39%。

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 0.986 元，净值增长率为-9.04%，业绩比较基准增长率为-7.87%。

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 2013 年下半年，国内货币告别钱荒，政府近期稳增长信号的释放，都有一定稳定市场的效应，但考虑到国外美联储 QE 退出以及美国经济复苏将引发的资金外流的风险，后期市场会是牛熊并存的行情，会有结构性机会。行业配置角度我们看好防御型成长股，如非酒食品、医药、家电、环保、TMT、地产、券商等。

作为指数分级型基金产品，我们将坚持指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数（基本面 400 指数）的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，使得投资者可以清晰地把握分级子基金的交易情况，把握住投资时机。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、泰信基金管理有限公司估值程序等事项的说明

委员会主席

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

委员会成员：

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

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、泰信优势增长基金基金经理。

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

2、本基金基金经理不参与本基金估值。

3、参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在基金存续期内，本基金（包括泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额）不进行收益分配。

§ 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，本基金托管人在对泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金的管理人——泰信基金管理有限公司在泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。在基金存续期内，本基金（包括泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额）不进行收益分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对泰信基金管理有限公司编制和披露的泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金 2013 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	2,097,496.60	2,859,997.93
结算备付金		1,227.32	7,277,272.73
存出保证金		54,826.58	250,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	31,210,377.16	62,679,700.36
其中：股票投资		31,210,377.16	62,679,700.36
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	-	-
应收证券清算款		312,182.13	-
应收利息	6.4.7.5	410.00	3,581.97
应收股利		22,388.75	-
应收申购款		98,812.76	2,988,047.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		33,797,721.30	76,058,600.80
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 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		92,899.13	-
应付赎回款		97,990.41	1,092,471.36
应付管理人报酬		30,205.43	61,077.36
应付托管费		6,645.19	13,436.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	8,700.15	60,530.09
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	291,681.61	308,380.52
负债合计		528,121.92	1,535,896.32
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	33,415,505.94	68,775,016.14
未分配利润	6.4.7.10	-145,906.56	5,747,688.34
所有者权益合计		33,269,599.38	74,522,704.48
负债和所有者权益总计		33,797,721.30	76,058,600.80

注：1、报告截止日 2013 年 6 月 30 日，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之基础份额净值 0.986 元，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 A 份额净值 1.032 元，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 B 份额净值 0.940 元；基金份额总额 33,756,902.09 份，其中泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之基础份额 19,240,192.09 份，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 A 份额 7,258,355.00 份，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 B 份额 7,258,355.00 份。

2、上年度财务报表的实际编制期间为 2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日。

6.2 利润表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		-1,010,798.21
1.利息收入		14,206.43
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,206.43
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		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,030,438.61
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,698,378.29
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		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	332,060.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-7,144,412.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

列)		
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	88,968.78
减：二、费用		658,777.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	215,419.91
2. 托管费	6.4.10.2.2	47,392.41
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.18	148,753.46
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	247,212.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,669,576.12
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,669,576.12

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	68,775,016.14	5,747,688.34	74,522,704.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,669,576.12	-1,669,576.12
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）	-35,359,510.20	-4,224,018.78	-39,583,528.98
其中：1.基金申购款	28,336,034.21	3,254,993.50	31,591,027.71
2. 基金赎回款	-63,695,544.41	-7,479,012.28	-71,174,556.69
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）	33,415,505.94	-145,906.56	33,269,599.38

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：

<u>葛航</u>	<u>韩波</u>	<u>庞少华</u>
基金管理人负责人	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

泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金(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 [2012] 第 252 号《关于核准泰信中证锐联基本面 400 指数分级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《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约开放型,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 300,797,873.45 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(2012)第 346 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 9 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 300,843,720.90 份,其中认购资金利息折合 45,847.45 份。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的基金份额包括泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“泰信基本面 400 份额”)、泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“泰信基本面 400A 份额”)与泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“泰信基本面 400B 份额”)。其中,泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比率不变。

在泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400 份额存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日,本基金将根据基金合同的规定进行基金的定期份额折算。泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行参考净值计算,对泰信基本面 400A 份额的应得收益进行定期份额折算,每 2 份泰信基本面 400 份额将按 1 份泰信基本面 400A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后,泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于泰信基本面 400A 份额期末的约定应得收益,即泰信基本面 400A 份额每个会计年度 12 月 31 日份额参考净值超出 1.000 元部分,将折算为场内泰信基本面 400 份额分配给泰信基本面 400A 份额持有人。泰信基本面 400 份额持有人持有的每 2 份泰信基本面 400 份额将按 1 份泰信基本面 400A 份额获得新增泰信基本面 400 份额

的分配。持有场外泰信基本面 400 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外泰信基本面 400 份额的分配；持有场内泰信基本面 400 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内泰信基本面 400 份额的分配。经过上述份额折算，泰信基本面 400A 份额的基金份额参考净值和泰信基本面 400 份额的基金份额净值将相应调整。每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400 份额进行应得收益的定期份额折算。

除以上定期份额折算外，本基金根据基金合同规定，还将在以下两种情况进行份额折算，即：当泰信基本面 400 份额的基金份额净值达到 2.000 元；当泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元。当泰信基本面 400 份额的基金份额净值达到 2.000 元后，本基金将分别对泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额和泰信基本面 400 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的比例为 1:1，份额折算后泰信基本面 400 份额的基金份额净值、泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值均调整为 1 元。当泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元后，本基金将分别对泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额和泰信基本面 400 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的比例为 1:1，份额折算后泰信基本面 400 份额的基金份额净值、泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

泰信基本面 400 份额设置单独的基金代码，但不上市交易。泰信基本面 400A 份额与泰信基本面 400B 份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，中证锐联基本面 400 指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，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%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的标的指数是中证锐联基本面 400 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》、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级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 2013 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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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》、财政部、国家税务总局、中国证监会联合发布财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(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。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所

得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
活期存款	2,097,496.60
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	2,097,496.60

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	32,877,002.26	31,210,377.16	-1,666,625.10
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	32,877,002.26	31,210,377.16	-1,666,625.10

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末本基金未持有返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有买断式逆回购中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	387.23
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	22.77
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
其他	—
合计	410.00

6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	8,700.15
银行间市场应付交易费用	—
合计	8,700.15

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	369.30
预提费用	282,618.80
应付指数使用费	8,693.51
合计	291,681.61

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	68,775,016.14	68,775,016.14
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-814,101.84	-814,101.84
2013 年 1 月 4 日 基金拆分/份额折算前	67,960,914.30	67,960,914.30
基金拆分/份额折算变动份额	689,507.65	-
本期申购	28,618,840.48	28,336,034.21
本期赎回(以“-”号填列)	-63,512,360.34	-62,881,442.57
本期末	33,756,902.09	33,415,505.94

注：（1）根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金以 2013 年 1 月 4 日为份额折算基准日，对泰信基本面 400 的场外份额、场内份额以及泰信基本面 400A 份额实施定期份额折算。

（2）根据《基金合同》规定，投资者可申购、赎回泰信基本面 400 份额，泰信基本面 400A 和泰信基本面 400B 份额只可深圳交易所上市交易，因此上表不再单独披露泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的情况。

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	302,559.68	5,445,128.66	5,747,688.34
本期利润	5,474,835.91	-7,144,412.03	-1,669,576.12
本期基金份额交易产生的变动数	-1,077,455.76	-3,146,563.02	-4,224,018.78
其中：基金申购款	2,369,997.94	884,995.56	3,254,993.50
基金赎回款	-3,447,453.70	-4,031,558.58	-7,479,012.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,699,939.83	-4,845,846.39	-145,906.56

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,959.24
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	5,247.19
其他	-

合计	14,206.43
----	-----------

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	58,831,280.67
减：卖出股票成本总额	53,132,902.38
买卖股票差价收入	5,698,378.29

6.4.7.13 债券投资收益

本报告期末本基金无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本报告期末本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本报告期末本基金无衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	332,060.32
基金投资产生的股利收益	-
合计	332,060.32

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-7,144,412.03
——股票投资	-7,144,412.03
——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	-7,144,412.03

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	88,968.78
合计	88,968.78

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，本基金收取的赎回费中不低于 25% 的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	148,753.46
银行间市场交易费用	-
合计	148,753.46

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	158,686.32
债券帐户维护费——上清所	400.00
债券帐户维护费——中债登	8,926.92
指数使用费	19,387.83
上市年费	29,752.78
银行划款手续费	305.50
合计	247,212.13

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

截至本报告期末，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本报告期无需要说明资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
山东省国际信托有限公司（“山东国托”）	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信实业有限公司（“青岛国信”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本报告期本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

本报告期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

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本报告期本基金无应支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	215,419.91
其中：支付销售机构的客户维护费	14,275.62

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 1.0%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×1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	47,392.41

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22%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×0.22% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本报告期本基金未发生销售服务费用。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期末及上年度可比期间本基金与关联方未发生银行间同业市场债券（含回购）的交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

泰信基本面 400A				
关联方名称	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
山东省国际信 托有限公司	6,345,000.00	87.42%	4,570,000.00	74.62%

份额单位：份

泰信基本面 400B				
关联方名称	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
山东省国际信	6,925,382.00	95.41%	3,900,000.00	63.68%

托有限公司				
-------	--	--	--	--

份额单位：份

泰信基本面 400				
关联方名称	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
山东省国际信 托有限公司	17,424,566.56	90.56%	20,000,350.00	29.08%

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方中山东省国际信托有限公司于本期末持有本基金份额，其持有的份额为泰信基本面 400 份额、泰信基本面 A 份额与泰信基本面 B 份额。对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	2,097,496.60	8,959.24

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期末及上年度可比期间本基金在承销期内未参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

在基金存续期内，本基金（包括泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额）不进行收益分配。

6.4.12 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
000999	华润三九	2013 年 6 月 3 日	重大事项	29.60	2013 年 8 月 19 日	26.41	5,059	120,710.30	149,746.40	-
600284	浦东建设	2013 年 6 月 24 日	重大事项	9.50	-	-	11,132	92,523.51	105,754.00	-
000683	远兴能源	2013 年 4 月 8 日	重大事项	4.80	2013 年 7 月 18 日	4.55	19,927	97,758.66	95,649.60	-
601886	江河创建	2013 年 6 月 20 日	重大事项	13.22	2013 年 7 月 16 日	12.55	4,612	48,778.23	60,970.64	-
600725	云维股份	2013 年 6 月 24 日	重大事项	3.77	2013 年 7 月 1 日	3.59	15,719	67,143.35	59,260.63	-
600292	九龙电力	2013 年 6 月 5 日	重大事项	19.37	2013 年 7 月 1 日	18.55	2,840	34,232.34	55,010.80	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，泰信基本面 400A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；泰信基本面 400B 份额具有高风险、高预期收益的特征。本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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。本基金在控制风险的基础上，力争为持有人创造稳定的长期回报。

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

监察稽核部对公司经营、基金投资等业务运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购

赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的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的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，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。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 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	2,097,496.60	-	-	-	2,097,496.60
结算备付金	1,227.32	-	-	-	1,227.32
存出保证金	54,826.58	-	-	-	54,826.58

交易性金融资产	-	-	-	31,210,377.16	31,210,377.16
应收证券清算款	-	-	-	312,182.13	312,182.13
应收利息	-	-	-	410.00	410.00
应收股利	-	-	-	22,388.75	22,388.75
应收申购款	-	-	-	98,812.76	98,812.76
资产总计	2,153,550.50	-	-	31,644,170.80	33,797,721.30
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	92,899.13	92,899.13
应付赎回款	-	-	-	97,990.41	97,990.41
应付管理人报酬	-	-	-	30,205.43	30,205.43
应付托管费	-	-	-	6,645.19	6,645.19
应付交易费用	-	-	-	8,700.15	8,700.15
其他负债	-	-	-	291,681.61	291,681.61
负债总计	-	-	-	528,121.92	528,121.92
利率敏感度缺口	2,153,550.50	-	-	31,116,048.88	33,269,599.38
上年度末 2012 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	2,859,997.93	-	-	-	2,859,997.93
结算备付金	7,277,272.73	-	-	-	7,277,272.73
存出保证金	-	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	-	-	-	62,679,700.36	62,679,700.36
应收利息	-	-	-	3,581.97	3,581.97
应收申购款	-	-	-	2,988,047.81	2,988,047.81
资产总计	10,137,270.66	-	-	65,921,330.14	76,058,600.80
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,092,471.36	1,092,471.36
应付管理人报酬	-	-	-	61,077.36	61,077.36
应付托管费	-	-	-	13,436.99	13,436.99
应付交易费用	-	-	-	60,530.09	60,530.09
其他负债	-	-	-	308,380.52	308,380.52
负债总计	-	-	-	1,535,896.32	1,535,896.32
利率敏感度缺口	10,137,270.66	-	-	64,385,433.82	74,522,704.48

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2012 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。本基金投资组合中投资于中证锐联基本面 400 指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，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%，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 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 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	31,210,377.16	93.81	62,679,700.36	84.11
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	31,210,377.16	93.81	62,679,700.36	84.11

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2013 年 6 月 30 日，本基金成立未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无其他需要说明有助于理解和分析会计报表事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	31,210,377.16	92.34
	其中：股票	31,210,377.16	92.34
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	2,098,723.92	6.21
6	其他各项资产	488,620.22	1.45
7	合计	33,797,721.30	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	130,628.57	0.39
B	采矿业	613,272.47	1.84
C	制造业	16,939,031.26	50.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,465,908.89	4.41
E	建筑业	730,175.09	2.19
F	批发和零售业	2,597,624.55	7.81
G	交通运输、仓储和邮政业	997,407.38	3.00
H	住宿和餐饮业	—	—

I	信息传输、软件和信息技术服务业	858,302.00	2.58
J	金融业	540,656.04	1.63
K	房地产业	2,647,102.68	7.96
L	租赁和商务服务业	511,089.35	1.54
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	129,832.13	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	312,352.83	0.94
S	综合	540,406.76	1.62
	合计	29,013,790.00	87.21

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	120,114.00	0.36
C	制造业	1,541,183.16	4.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	59,800.00	0.18
E	建筑业	58,983.00	0.18
F	批发和零售业	89,299.00	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	59,424.00	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,325.00	0.18
J	金融业	30,134.00	0.09
K	房地产业	147,395.00	0.44
L	租赁和商务服务业	29,930.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,196,587.16	6.60

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

7.3.1 期末指数投资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	600596	新安股份	31,637	333,770.35	1.00
2	000012	南 玻 A	34,365	318,563.55	0.96
3	600352	浙江龙盛	33,001	309,549.38	0.93
4	600535	天士力	6,721	263,127.15	0.79
5	600686	金龙汽车	25,876	241,940.60	0.73
6	600881	亚泰集团	58,238	226,545.82	0.68
7	600518	康美药业	11,475	220,664.25	0.66
8	600008	首创股份	32,649	208,300.62	0.63
9	000538	云南白药	2,464	207,000.64	0.62
10	600256	广汇能源	15,899	206,051.04	0.62
11	000623	吉林敖东	13,422	195,692.76	0.59
12	600388	龙净环保	8,378	189,929.26	0.57
13	601377	兴业证券	20,507	186,203.56	0.56
14	600835	上海机电	16,788	184,500.12	0.55
15	600655	豫园商城	27,825	181,140.75	0.54
16	600332	广州药业	5,171	177,158.46	0.53
17	000768	中航飞机	19,668	175,045.20	0.53
18	000400	许继电气	6,435	174,259.80	0.52
19	000731	四川美丰	20,554	170,803.74	0.51
20	600804	鹏博士	15,904	168,423.36	0.51
21	600600	青岛啤酒	4,414	167,643.72	0.50
22	002008	大族激光	14,200	158,898.00	0.48
23	000900	现代投资	20,591	157,932.97	0.47
24	600067	冠城大通	19,721	157,570.79	0.47
25	000726	鲁 泰 A	18,635	157,279.40	0.47
26	600675	中华企业	33,413	155,704.58	0.47
27	600601	方正科技	67,441	155,114.30	0.47
28	000581	威孚高科	4,641	154,962.99	0.47
29	600893	航空动力	9,300	153,264.00	0.46
30	000423	东阿阿胶	3,950	152,786.00	0.46
31	600315	上海家化	3,377	151,931.23	0.46
32	600143	金发科技	31,445	151,879.35	0.46
33	600497	驰宏锌锗	15,510	151,222.50	0.45

34	000999	华润三九	5,059	149,746.40	0.45
35	600271	航天信息	11,274	149,042.28	0.45
36	600216	浙江医药	7,098	145,650.96	0.44
37	600308	华泰股份	54,089	144,958.52	0.44
38	600062	XD 华润双	7,208	144,304.16	0.43
39	000422	湖北宣化	21,182	142,978.50	0.43
40	600584	长电科技	24,513	142,665.66	0.43
41	000793	华闻传媒	14,046	140,740.92	0.42
42	000829	天音控股	24,600	136,776.00	0.41
43	000616	亿城股份	47,290	134,776.50	0.41
44	600138	中青旅	10,288	134,464.16	0.40
45	601588	北辰实业	49,320	133,657.20	0.40
46	600325	华发股份	21,931	133,340.48	0.40
47	002146	荣盛发展	9,422	132,944.42	0.40
48	600085	同仁堂	6,072	132,855.36	0.40
49	002028	思源电气	8,411	132,305.03	0.40
50	000572	海马汽车	39,193	130,120.76	0.39
51	600832	东方明珠	23,563	129,832.13	0.39
52	000559	万向钱潮	24,530	128,782.50	0.39
53	600713	南京医药	29,455	127,834.70	0.38
54	000009	中国宝安	11,578	127,358.00	0.38
55	600428	中远航运	41,718	125,988.36	0.38
56	600703	三安光电	6,409	125,872.76	0.38
57	002570	贝因美	4,503	125,858.85	0.38
58	000830	鲁西化工	34,417	125,622.05	0.38
59	000759	中百集团	22,912	124,870.40	0.38
60	000690	宝新能源	26,488	123,698.96	0.37
61	002048	宁波华翔	14,790	123,644.40	0.37
62	000926	福星股份	17,110	123,363.10	0.37
63	000963	华东医药	3,078	122,658.30	0.37
64	600787	中储股份	18,971	121,034.98	0.36
65	600183	生益科技	26,608	119,736.00	0.36
66	002001	新 和 成	8,091	119,261.34	0.36
67	600718	东软集团	14,621	119,014.94	0.36
68	600805	悦达投资	12,712	116,441.92	0.35
69	600122	宏图高科	35,264	116,371.20	0.35
70	000839	中信国安	17,947	115,758.15	0.35
71	002422	科伦药业	2,152	114,723.12	0.34
72	600765	中航重机	8,518	114,481.92	0.34

73	000680	山推股份	33,989	113,523.26	0.34
74	600498	烽火通信	6,870	113,217.60	0.34
75	002092	中泰化学	22,245	113,004.60	0.34
76	600120	浙江东方	9,974	110,811.14	0.33
77	000917	电广传媒	9,350	110,049.50	0.33
78	600522	中天科技	12,937	109,188.28	0.33
79	600517	置信电气	7,712	108,739.20	0.33
80	600720	祁连山	12,714	108,577.56	0.33
81	600567	山鹰纸业	51,014	107,129.40	0.32
82	600284	浦东建设	11,132	105,754.00	0.32
83	000598	兴蓉投资	21,892	105,300.52	0.32
84	000016	深康佳 A	34,332	103,682.64	0.31
85	600811	东方集团	20,968	103,372.24	0.31
86	000786	北新建材	5,861	103,270.82	0.31
87	600533	栖霞建设	29,783	102,751.35	0.31
88	600169	太原重工	44,000	102,520.00	0.31
89	600426	华鲁恒升	18,618	101,840.46	0.31
90	000652	泰达股份	31,104	101,710.08	0.31
91	600597	光明乳业	7,322	98,773.78	0.30
92	600674	川投能源	9,702	98,669.34	0.30
93	600859	王府井	6,064	97,691.04	0.29
94	600635	大众公用	25,425	97,123.50	0.29
95	000683	远兴能源	19,927	95,649.60	0.29
96	600270	外运发展	14,193	95,093.10	0.29
97	600507	方大特钢	25,843	94,843.81	0.29
98	600761	安徽合力	12,222	94,842.72	0.29
99	000612	焦作万方	11,191	94,787.77	0.28
100	600820	隧道股份	12,482	92,990.90	0.28
101	600276	恒瑞医药	3,506	92,418.16	0.28
102	600978	宜华木业	20,931	91,887.09	0.28
103	000550	江铃汽车	5,961	91,262.91	0.27
104	600611	大众交通	17,786	90,886.46	0.27
105	600895	张江高科	17,086	90,555.80	0.27
106	600246	万通地产	28,701	89,260.11	0.27
107	600064	南京高科	9,011	88,037.47	0.26
108	601901	方正证券	15,802	87,385.06	0.26
109	600037	XD 歌华有	14,368	87,070.08	0.26
110	600266	北京城建	8,485	86,801.55	0.26
111	600210	紫江企业	30,791	86,214.80	0.26

112	000877	天山股份	14,772	85,529.88	0.26
113	600231	凌钢股份	26,896	84,991.36	0.26
114	000028	国药一致	3,042	84,932.64	0.26
115	000698	沈阳化工	21,785	84,525.80	0.25
116	600704	物产中大	15,696	83,659.68	0.25
117	600316	洪都航空	5,340	83,304.00	0.25
118	000807	云铝股份	22,361	83,182.92	0.25
119	600963	岳阳林纸	30,378	82,628.16	0.25
120	600638	新黄浦	8,539	82,486.74	0.25
121	600322	天房发展	27,323	82,242.23	0.25
122	000601	韶能股份	24,927	82,009.83	0.25
123	000541	佛山照明	13,246	81,992.74	0.25
124	600550	天威保变	15,002	81,910.92	0.25
125	000701	厦门信达	10,636	81,790.84	0.25
126	600511	国药股份	5,673	81,350.82	0.24
127	002106	莱宝高科	5,278	81,017.30	0.24
128	000061	农产品	13,440	80,774.40	0.24
129	600331	宏达股份	19,867	80,461.35	0.24
130	000006	深振业 A	18,884	80,445.84	0.24
131	002083	孚日股份	22,072	80,342.08	0.24
132	600406	国电南瑞	5,379	80,308.47	0.24
133	002385	大北农	7,780	80,289.60	0.24
134	600663	陆家嘴	7,549	79,490.97	0.24
135	600267	海正药业	6,231	79,258.32	0.24
136	000717	*ST 韶钢	46,757	79,019.33	0.24
137	600021	上海电力	19,119	78,770.28	0.24
138	600578	京能热电	11,313	78,399.09	0.24
139	600879	航天电子	11,612	77,916.52	0.23
140	600415	小商品城	15,115	76,481.90	0.23
141	601717	郑煤机	12,232	76,450.00	0.23
142	600516	方大炭素	9,426	76,350.60	0.23
143	000960	锡业股份	6,254	76,298.80	0.23
144	600971	恒源煤电	9,869	75,991.30	0.23
145	600469	风神股份	10,024	75,180.00	0.23
146	600017	日照港	32,965	75,160.20	0.23
147	600626	申达股份	24,778	75,077.34	0.23
148	002081	金螳螂	2,603	74,107.41	0.22
149	000667	名流置业	41,508	73,884.24	0.22
150	000046	泛海建设	15,138	73,873.44	0.22

151	600595	中孚实业	20,884	73,720.52	0.22
152	600438	通威股份	14,185	72,769.05	0.22
153	002440	闰土股份	3,520	72,758.40	0.22
154	000686	东北证券	4,455	72,349.20	0.22
155	000822	山东海化	23,485	72,333.80	0.22
156	000589	黔轮胎 A	16,276	72,102.68	0.22
157	600744	华银电力	22,171	70,947.20	0.21
158	600481	双良节能	9,916	70,601.92	0.21
159	000860	顺鑫农业	6,466	70,350.08	0.21
160	600160	巨化股份	12,040	70,193.20	0.21
161	002254	泰和新材	11,038	69,980.92	0.21
162	002415	海康威视	1,965	69,443.10	0.21
163	601888	中国国旅	2,367	69,116.40	0.21
164	600729	重庆百货	3,539	68,550.43	0.21
165	600742	一汽富维	4,914	68,501.16	0.21
166	000417	合肥百货	13,173	68,236.14	0.21
167	600588	用友软件	7,627	68,185.38	0.20
168	600685	广船国际	6,870	67,600.80	0.20
169	600366	宁波韵升	4,266	67,360.14	0.20
170	600121	郑州煤电	12,332	67,209.40	0.20
171	600410	华胜天成	11,041	67,129.28	0.20
172	600409	三友化工	18,285	66,923.10	0.20
173	600509	天富热电	7,697	65,732.38	0.20
174	600117	西宁特钢	17,643	65,455.53	0.20
175	600491	龙元建设	17,439	65,396.25	0.20
176	600801	华新水泥	6,161	65,183.38	0.20
177	000758	中色股份	6,422	65,054.86	0.20
178	601877	正泰电器	3,244	64,360.96	0.19
179	000501	鄂武商 A	5,740	64,288.00	0.19
180	600884	杉杉股份	5,939	64,081.81	0.19
181	601101	昊华能源	8,069	63,987.17	0.19
182	600496	精工钢构	9,284	63,316.88	0.19
183	000031	中粮地产	17,312	63,188.80	0.19
184	600858	银座股份	7,988	62,705.80	0.19
185	600549	厦门钨业	2,346	62,638.20	0.19
186	001696	宗申动力	13,168	61,889.60	0.19
187	600874	创业环保	8,110	61,879.30	0.19
188	600812	华北制药	13,747	61,861.50	0.19
189	601098	中南传媒	6,586	61,249.80	0.18

190	000970	中科三环	4,678	61,001.12	0.18
191	601886	江河创建	4,612	60,970.64	0.18
192	000659	珠海中富	31,326	60,459.18	0.18
193	000708	大冶特钢	11,314	60,416.76	0.18
194	600125	铁龙物流	11,367	60,245.10	0.18
195	600380	健康元	14,474	60,211.84	0.18
196	002244	滨江集团	7,161	60,152.40	0.18
197	600586	金晶科技	18,081	60,028.92	0.18
198	002191	劲嘉股份	6,895	59,641.75	0.18
199	600295	鄂尔多斯	8,891	59,391.88	0.18
200	600815	厦工股份	15,274	59,263.12	0.18
201	600725	云维股份	15,719	59,260.63	0.18
202	002078	太阳纸业	13,422	59,191.02	0.18
203	600748	上实发展	10,139	58,806.20	0.18
204	002152	广电运通	5,308	58,281.84	0.18
205	000042	深 长 城	2,240	57,948.80	0.17
206	600369	西南证券	7,554	57,939.18	0.17
207	600487	亨通光电	3,051	57,938.49	0.17
208	000685	中山公用	6,212	57,895.84	0.17
209	002007	华兰生物	2,533	57,195.14	0.17
210	000718	苏宁环球	9,675	56,889.00	0.17
211	600303	曙光股份	16,323	56,804.04	0.17
212	000540	中天城投	8,050	56,430.50	0.17
213	000961	中南建设	5,698	55,726.44	0.17
214	600779	水井坊	4,821	55,248.66	0.17
215	002011	盾安环境	5,440	55,161.60	0.17
216	002042	华孚色纺	10,442	55,133.76	0.17
217	000521	美菱电器	17,528	55,037.92	0.17
218	600292	九龙电力	2,840	55,010.80	0.17
219	601880	大连港	24,542	54,974.08	0.17
220	600416	湘电股份	11,445	54,821.55	0.16
221	002500	山西证券	9,257	54,801.44	0.16
222	002051	中工国际	1,963	54,708.81	0.16
223	002556	辉隆股份	10,105	54,465.95	0.16
224	002375	亚厦股份	1,764	54,331.20	0.16
225	000912	泸 天 化	13,347	54,322.29	0.16
226	600736	苏州高新	15,266	54,194.30	0.16
227	600141	兴发集团	4,833	54,129.60	0.16
228	000410	沈阳机床	10,464	53,784.96	0.16

229	000043	中航地产	10,706	53,530.00	0.16
230	600823	世茂股份	6,360	53,233.20	0.16
231	000939	凯迪电力	10,861	53,110.29	0.16
232	601933	永辉超市	4,530	52,865.10	0.16
233	600582	天地科技	8,220	52,772.40	0.16
234	000088	盐田港	15,846	52,767.18	0.16
235	002022	科华生物	3,554	52,634.74	0.16
236	600176	中国玻纤	6,891	52,578.33	0.16
237	002183	怡亚通	7,819	51,761.78	0.16
238	600449	宁夏建材	7,616	51,560.32	0.15
239	600408	安泰集团	18,302	51,428.62	0.15
240	600456	宝钛股份	4,330	50,790.90	0.15
241	600208	新湖中宝	16,354	50,533.86	0.15
242	600810	神马股份	10,424	50,139.44	0.15
243	601118	海南橡胶	12,065	49,949.10	0.15
244	002003	伟星股份	6,083	49,880.60	0.15
245	600132	重庆啤酒	3,214	48,306.42	0.15
246	000525	红太阳	3,164	47,428.36	0.14
247	600327	大东方	12,445	47,291.00	0.14
248	002299	圣农发展	5,198	46,989.92	0.14
249	600111	包钢稀土	2,235	46,644.45	0.14
250	002122	天马股份	13,014	46,459.98	0.14
251	600577	精达股份	12,686	46,303.90	0.14
252	000626	如意集团	8,123	46,301.10	0.14
253	000987	广州友谊	5,401	46,286.57	0.14
254	600432	吉恩镍业	5,294	46,110.74	0.14
255	000919	金陵药业	6,946	46,051.98	0.14
256	601000	唐山港	17,567	46,025.54	0.14
257	000418	小天鹅 A	6,472	46,015.92	0.14
258	600809	山西汾酒	1,867	45,741.50	0.14
259	000969	安泰科技	5,874	45,582.24	0.14
260	600639	浦东金桥	6,369	45,410.97	0.14
261	600531	豫光金铅	4,802	45,330.88	0.14
262	002444	巨星科技	3,474	44,918.82	0.14
263	002416	爱施德	5,308	44,905.68	0.13
264	600641	万业企业	14,225	44,808.75	0.13
265	002242	九阳股份	7,756	44,752.12	0.13
266	002277	友阿股份	5,984	44,520.96	0.13
267	002465	海格通信	1,473	44,116.35	0.13

268	002155	辰州矿业	5,453	43,842.12	0.13
269	600236	桂冠电力	13,542	43,740.66	0.13
270	000707	双环科技	11,831	43,301.46	0.13
271	000543	皖能电力	7,425	43,065.00	0.13
272	600785	新华百货	3,969	43,023.96	0.13
273	000536	华映科技	1,668	42,867.60	0.13
274	600298	安琪酵母	2,459	42,737.42	0.13
275	601555	东吴证券	6,236	42,716.60	0.13
276	000850	华茂股份	9,813	42,686.55	0.13
277	600277	亿利能源	7,006	42,596.48	0.13
278	000789	江西水泥	5,058	42,487.20	0.13
279	600797	浙大网新	7,948	42,362.84	0.13
280	002203	海亮股份	6,000	42,000.00	0.13
281	600653	中华控股	19,576	41,696.88	0.13
282	000968	煤气化	5,711	41,576.08	0.12
283	002110	三钢闽光	7,411	41,501.60	0.12
284	600750	江中药业	2,327	41,490.41	0.12
285	002344	海宁皮城	2,170	41,468.70	0.12
286	002470	金正大	2,941	41,409.28	0.12
287	000666	经纬纺机	5,774	41,168.62	0.12
288	600375	华菱星马	3,876	40,930.56	0.12
289	000823	超声电子	4,994	40,800.98	0.12
290	600499	科达机电	3,431	40,794.59	0.12
291	600966	XD 博汇纸	8,996	40,392.04	0.12
292	600195	中牧股份	3,612	40,237.68	0.12
293	600780	XD 通宝能	7,063	40,117.84	0.12
294	600612	老凤祥	2,450	40,106.50	0.12
295	601216	内蒙君正	5,304	39,780.00	0.12
296	600580	卧龙电气	7,352	39,700.80	0.12
297	002233	塔牌集团	6,821	39,698.22	0.12
298	600776	东方通信	8,893	39,484.92	0.12
299	600109	国金证券	3,414	39,261.00	0.12
300	600510	黑牡丹	8,259	39,065.07	0.12
301	002237	恒邦股份	2,821	38,478.44	0.12
302	000090	深天健	5,501	38,286.96	0.12
303	600628	新世界	6,885	37,867.50	0.11
304	601718	际华集团	15,372	37,200.24	0.11
305	002267	陕天然气	3,594	36,910.38	0.11
306	600373	中文传媒	2,158	36,793.90	0.11

307	600056	中国医药	2,239	36,697.21	0.11
308	002311	海大集团	3,190	36,557.40	0.11
309	002249	大洋电机	4,770	35,822.70	0.11
310	601002	晋亿实业	4,494	35,817.18	0.11
311	000780	平庄能源	6,659	35,758.83	0.11
312	000903	云内动力	8,478	35,607.60	0.11
313	601928	凤凰传媒	4,115	34,607.15	0.10
314	600743	华远地产	13,104	34,463.52	0.10
315	000415	渤海租赁	5,507	34,088.33	0.10
316	000655	金岭矿业	4,584	33,921.60	0.10
317	600723	首商股份	5,391	33,855.48	0.10
318	600863	内蒙华电	5,984	33,809.60	0.10
319	601789	宁波建工	5,058	33,787.44	0.10
320	002069	獐子岛	2,843	33,689.55	0.10
321	600657	信达地产	10,816	33,637.76	0.10
322	002082	栋梁新材	5,974	33,394.66	0.10
323	000301	东方市场	11,979	32,582.88	0.10
324	600051	宁波联合	5,604	32,166.96	0.10
325	002073	软控股份	3,833	32,158.87	0.10
326	000927	一汽夏利	8,847	31,849.20	0.10
327	600575	芜湖港	13,290	31,763.10	0.10
328	600310	桂东电力	3,526	31,275.62	0.09
329	600676	交运股份	8,071	31,154.06	0.09
330	002060	粤水电	8,191	30,798.16	0.09
331	600829	三精制药	4,623	30,511.80	0.09
332	002194	武汉凡谷	4,545	30,360.60	0.09
333	000599	青岛双星	9,385	30,313.55	0.09
334	002408	齐翔腾达	2,626	30,067.70	0.09
335	002304	洋河股份	550	29,865.00	0.09
336	600425	青松建化	7,854	29,845.20	0.09
337	601678	滨化股份	4,160	29,619.20	0.09
338	600220	江苏阳光	13,403	29,352.57	0.09
339	002386	天原集团	4,526	29,192.70	0.09
340	600300	维维股份	6,830	29,027.50	0.09
341	000637	茂化实华	7,224	28,968.24	0.09
342	600998	九州通	2,460	28,511.40	0.09
343	600662	强生控股	8,387	27,760.97	0.08
344	600873	梅花集团	6,971	27,674.87	0.08
345	002489	浙江永强	3,153	27,557.22	0.08

346	600961	*ST 株冶	4,700	27,495.00	0.08
347	601107	四川成渝	10,008	26,621.28	0.08
348	000973	佛塑科技	7,656	26,489.76	0.08
349	002574	明牌珠宝	2,227	26,256.33	0.08
350	601010	文峰股份	4,201	25,710.12	0.08
351	002419	天虹商场	3,212	25,696.00	0.08
352	600673	东阳光铝	3,748	24,961.68	0.08
353	600075	新疆天业	3,925	24,099.50	0.07
354	601777	力帆股份	4,497	23,699.19	0.07
355	002091	江苏国泰	1,832	23,687.76	0.07
356	000911	南宁糖业	4,026	23,632.62	0.07
357	000656	金科股份	2,015	23,353.85	0.07
358	601369	陕鼓动力	3,449	23,280.75	0.07
359	601801	皖新传媒	2,230	23,214.30	0.07
360	600403	大有能源	2,720	23,174.40	0.07
361	002399	海普瑞	1,293	23,015.40	0.07
362	600399	抚顺特钢	5,227	22,998.80	0.07
363	600258	首旅股份	1,752	22,933.68	0.07
364	002056	横店东磁	1,673	21,046.34	0.06
365	002561	徐家汇	2,900	20,822.00	0.06
366	600475	华光股份	2,260	20,701.60	0.06
367	601139	深圳燃气	2,325	20,669.25	0.06
368	000597	东北制药	3,596	20,461.24	0.06
369	000936	华西股份	6,010	20,253.70	0.06
370	000989	九 芝 堂	1,824	20,173.44	0.06
371	002430	杭氧股份	2,804	19,628.00	0.06
372	600724	宁波富达	4,540	19,385.80	0.06
373	000703	恒逸石化	2,186	18,821.46	0.06
374	600052	浙江广厦	6,243	18,541.71	0.06
375	600737	中粮屯河	3,690	18,523.80	0.06
376	600888	新疆众和	3,382	18,262.80	0.05
377	002085	万丰奥威	2,081	18,042.27	0.05
378	002463	沪电股份	5,558	17,785.60	0.05
379	601268	*ST 二重	4,180	17,723.20	0.05
380	600981	汇鸿股份	5,927	17,425.38	0.05
381	002498	汉缆股份	3,226	17,033.28	0.05
382	600636	三爱富	1,638	16,314.48	0.05
383	002461	珠江啤酒	2,081	16,252.61	0.05
384	002563	森马服饰	806	16,120.00	0.05

385	000755	山西三维	4,621	16,034.87	0.05
386	002603	以岭药业	700	15,932.00	0.05
387	600825	新华传媒	3,162	15,746.76	0.05
388	601677	明泰铝业	2,137	15,172.70	0.05
389	300003	乐普医疗	1,340	15,075.00	0.05
390	002534	杭锅股份	1,193	14,996.01	0.05
391	601566	九牧王	1,198	14,292.14	0.04
392	002478	常宝股份	1,570	13,109.50	0.04
393	000918	嘉凯城	4,707	12,897.18	0.04
394	000950	建峰化工	3,273	12,699.24	0.04
395	002269	美邦服饰	1,379	12,190.36	0.04
396	600869	三普药业	1,765	11,048.90	0.03
397	002342	巨力索具	1,898	10,799.62	0.03
398	002204	大连重工	1,033	10,608.91	0.03
399	002075	沙钢股份	3,176	8,003.52	0.02
400	600623	双钱股份	650	5,674.50	0.02

7.3.2 期末积极投资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	600079	人福医药	1,200	31,296.00	0.09
2	601005	重庆钢铁	11,500	30,935.00	0.09
3	000869	张裕A	900	30,726.00	0.09
4	601929	吉视传媒	4,900	30,625.00	0.09
5	002050	三花股份	2,500	30,500.00	0.09
6	000060	中金岭南	4,600	30,452.00	0.09
7	600157	永泰能源	5,200	30,420.00	0.09
8	000021	长城开发	6,800	30,260.00	0.09
9	002585	双星新材	3,992	30,259.36	0.09
10	603366	日出东方	2,000	30,240.00	0.09
11	601100	恒立油缸	3,100	30,194.00	0.09
12	600006	东风汽车	10,900	30,193.00	0.09
13	600004	白云机场	4,800	30,192.00	0.09
14	600739	辽宁成大	2,300	30,176.00	0.09
15	600397	安源煤业	6,700	30,150.00	0.09
16	603993	洛阳钼业	4,500	30,150.00	0.09
17	002673	西部证券	2,600	30,134.00	0.09

18	002293	罗莱家纺	1,800	30,132.00	0.09
19	601058	赛轮股份	3,000	30,000.00	0.09
20	002429	兆驰股份	4,000	29,960.00	0.09
21	000531	穗恒运 A	3,200	29,952.00	0.09
22	000930	中粮生化	7,600	29,944.00	0.09
23	601608	中信重工	9,100	29,939.00	0.09
24	002662	京威股份	4,900	29,939.00	0.09
25	600057	象屿股份	8,200	29,930.00	0.09
26	601038	一拖股份	4,400	29,920.00	0.09
27	603766	隆鑫通用	4,200	29,904.00	0.09
28	002479	富春环保	4,100	29,848.00	0.09
29	601311	骆驼股份	3,100	29,791.00	0.09
30	000979	中弘股份	4,400	29,788.00	0.09
31	600867	通化东宝	2,000	29,780.00	0.09
32	601515	东风股份	2,500	29,750.00	0.09
33	600278	东方创业	5,200	29,744.00	0.09
34	002372	伟星新材	2,900	29,725.00	0.09
35	600199	金种子酒	2,200	29,722.00	0.09
36	600329	中新药业	2,300	29,716.00	0.09
37	000619	海螺型材	4,800	29,712.00	0.09
38	601908	京运通	5,000	29,700.00	0.09
39	002065	东华软件	1,500	29,700.00	0.09
40	601636	旗滨集团	5,400	29,700.00	0.09
41	601231	环旭电子	1,900	29,697.00	0.09
42	002154	报喜鸟	4,900	29,645.00	0.09
43	000488	晨鸣纸业	8,300	29,631.00	0.09
44	000671	阳光城	2,500	29,625.00	0.09
45	600039	四川路桥	5,700	29,583.00	0.09
46	600096	云天化	3,700	29,563.00	0.09
47	603001	奥康国际	2,100	29,547.00	0.09
48	600581	八一钢铁	7,000	29,540.00	0.09
49	002157	正邦科技	5,100	29,529.00	0.09
50	600480	凌云股份	4,600	29,486.00	0.09
51	601388	怡球资源	3,400	29,478.00	0.09
52	601339	百隆东方	3,900	29,445.00	0.09
53	601011	宝泰隆	4,000	29,400.00	0.09
54	002482	广田股份	1,400	29,400.00	0.09
55	000603	盛达矿业	2,300	29,394.00	0.09
56	600648	外高桥	2,100	29,379.00	0.09

57	002275	桂林三金	1,900	29,374.00	0.09
58	000631	顺发恒业	6,600	29,370.00	0.09
59	600372	中航电子	1,400	29,330.00	0.09
60	000620	新华联	6,200	29,326.00	0.09
61	002029	七匹狼	4,100	29,315.00	0.09
62	600340	华夏幸福	900	29,286.00	0.09
63	000596	古井贡酒	1,400	29,232.00	0.09
64	000022	深赤湾 A	2,800	29,232.00	0.09
65	600987	航民股份	5,400	29,214.00	0.09
66	002241	歌尔声学	800	29,032.00	0.09
67	600401	海润光伏	5,000	29,000.00	0.09
68	002294	信立泰	1,000	28,940.00	0.09
69	002557	洽洽食品	1,700	28,883.00	0.09
70	002005	德豪润达	3,086	28,699.80	0.09
71	002648	卫星石化	1,300	28,561.00	0.09
72	002653	海思科	1,000	28,500.00	0.09
73	002393	力生制药	900	28,152.00	0.08
74	002353	杰瑞股份	400	27,600.00	0.08

注：上述股票为满足 2013 年 7 月 1 日中证基本面 400 成份股调整在报告期末买入并持有的。

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	600518	康美药业	400,902.00	0.54
2	600596	新安股份	249,605.76	0.33
3	600881	亚泰集团	248,187.00	0.33
4	000012	南 玻 A	247,369.00	0.33
5	601901	方正证券	218,974.00	0.29
6	000623	吉林敖东	203,190.51	0.27
7	600352	浙江龙盛	202,785.00	0.27
8	601377	兴业证券	199,630.80	0.27
9	000422	湖北宜化	199,360.29	0.27
10	600820	隧道股份	190,469.00	0.26
11	600210	XD 紫江企	178,635.00	0.24
12	600704	物产中大	178,592.00	0.24

13	600497	驰宏锌锗	171,714.00	0.23
14	000717	*ST 韶钢	171,603.00	0.23
15	600567	山鹰纸业	169,089.00	0.23
16	600535	天士力	166,747.70	0.22
17	000731	四川美丰	166,243.00	0.22
18	600655	豫园商城	165,859.00	0.22
19	600208	新湖中宝	165,834.00	0.22
20	002146	荣盛发展	164,957.00	0.22

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	600596	新安股份	539,140.28	0.72
2	600881	亚泰集团	525,524.46	0.71
3	000012	南 玻 A	514,743.97	0.69
4	600820	隧道股份	489,416.74	0.66
5	600210	XD 紫江企	456,848.40	0.61
6	600704	物产中大	452,790.88	0.61
7	000717	*ST 韶钢	436,970.78	0.59
8	000623	吉林敖东	432,093.32	0.58
9	601377	兴业证券	424,049.95	0.57
10	600352	浙江龙盛	416,445.04	0.56
11	000422	湖北宜化	411,259.53	0.55
12	601901	方正证券	370,772.61	0.50
13	600655	豫园商城	346,139.27	0.46
14	600535	天士力	343,005.05	0.46
15	600686	金龙汽车	330,503.39	0.44
16	000768	中航飞机	325,845.65	0.44
17	600308	华泰股份	315,994.06	0.42
18	000900	现代投资	313,550.46	0.42
19	600256	广汇能源	309,913.79	0.42
20	600675	中华企业	307,583.05	0.41

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	28,807,991.21
卖出股票收入（成交）总额	58,831,280.67

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

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有债券。

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

报告期末本基金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

报告期末本基金未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

截至报告期末本基金未投资股指期货。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

7.10 投资组合报告附注**7.10.1**

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

7.10.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.10.3 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	54,826.58
2	应收证券清算款	312,182.13
3	应收股利	22,388.75
4	应收利息	410.00
5	应收申购款	98,812.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
N-1	其他	-
N	合计	488,620.22

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.10.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.10.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
泰信基本面 400A	43	168,798.95	6,345,000.00	87.42%	913,355.00	12.58%
泰信基本面 400B	84	86,408.99	6,925,582.00	95.42%	332,773.00	4.58%
泰信基本面 400	45	427,559.82	17,424,566.56	90.56%	1,815,625.53	9.44%

合计	172	196,261.06	30,695,148.56	90.93%	3,061,753.53	9.07%
----	-----	------------	---------------	--------	--------------	-------

8.2 期末基金前十名持有人（A 级）

序列	名称	份额	占上市总份额比例（%）
1	山东省国际信托有限公司	6,345,000.00	87.42
2	咸铨	256,900.00	3.54
3	魏群	183,532.00	2.53
4	甘遵义	70,177.00	0.97
5	林鼎	69,500.00	0.96
6	刘欢	52,555.00	0.72
7	郑龙根	32,601.00	0.45
8	刘国烜	30,000.00	0.41
9	俞正保	25,803.00	0.36
10	高明桂	24,897.00	0.34

期末基金前十名持有人（B 级）

序列	名称	份额	占上市总份额比例（%）
1	山东省国际信托有限公司	6,925,382.00	95.41
2	王宣军	30,000.00	0.41
3	俞正保	25,803.00	0.36
4	梁兴才	22,200.00	0.31
5	林志鹏	20,000.00	0.28
6	张志平	13,500.00	0.19
7	董亚茹	13,200.00	0.18
8	罗玉强	11,700.00	0.16
9	林承伟	11,000.00	0.15
10	姜育新	11,000.00	0.15

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	泰信基本面 400A	0.00	0.0000%
	泰信基本面 400B	0.00	0.0000%
	泰信基本面 400	150,089.82	0.7801%
	合计	150,089.82	0.4446%

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：10 万份–50 万份（含）

2、本基金基金经理持有该基金份额总量的数量区间：0–10 万份（含）

3、对于泰信基本面 400A、泰信基本面 400B、泰信基本面 400 份额，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用期末基金份额总额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰信基本面 400A	泰信基本面 400B	泰信基本面 400
基金合同生效日（2012 年 9 月 7 日） 基金份额总额	–	–	300,843,720.90
本报告期期初基金份额总额	6,124,685.00	6,124,685.00	56,525,646.14
本报告期基金总申购份额	–	–	28,618,840.48
减：本报告期基金总赎回份额	–	–	64,326,462.18
本报告期基金拆分变动份额	1,133,670.00	1,133,670.00	–1,577,832.35
本报告期期末基金份额总额	7,258,355.00	7,258,355.00	19,240,192.09

注：拆分变动份额含本基金三级份额之间的配对转换份额和基金定期份额折算中新增的份额。

§ 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

- 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。
- 2、经泰信基金管理有限公司股东会 2013 年第二次（通讯）会议审议通过，孟凡利先生不再

担任公司董事职务；经泰信基金管理有限公司第四届董事会 2013 年第三次（通讯）会议审议通过，公司总经理葛航先生代为履行董事长职务。具体详情参见 2013 年 6 月 25 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基金行业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向监管机构进行备案。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，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

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	
华创证券	2	52,507,096.53	59.91%	47,804.74	60.59%	-
中国银河证券	1	35,132,175.35	40.09%	31,088.64	39.41%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	2	-	-	-	-	-

广发证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	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工商银行托管的泰信优势增长、泰信发展主题、泰信现代服务业基金共用交易单元。

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
华创证券	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-

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	泰信 400A 停牌的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及 公 司 网 站 (www.ftfund.com)	2013 年 1 月 7 日
2	泰信 400A 第二个运作周年 预定年基准收益率的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及 公 司 网 站 (www.ftfund.com)	2013 年 1 月 7 日
3	定期份额折算结果及泰信 400A 恢复交易公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及 公 司 网 站 (www.ftfund.com)	2013 年 1 月 8 日
4	泰信 400A 份额定期折算后 次日前收盘价调整公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及 公 司 网 站 (www.ftfund.com)	2013 年 1 月 8 日
5	12 年 4 季报	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及 公 司 网 站 (www.ftfund.com)	2013 年 1 月 22 日
6	网上直销新增易宝通为支付 渠道及费率优惠公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及 公 司 网 站 (www.ftfund.com)	2013 年 3 月 9 日
7	参加工商银行个人网上渠道 申购费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及 公 司 网 站 (www.ftfund.com)	2013 年 3 月 27 日
8	12 年年报	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及 公 司 网 站 (www.ftfund.com)	2013 年 3 月 29 日
9	新增天天基金销售为代销机 构并开通费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及 公 司 网 站 (www.ftfund.com)	2013 年 4 月 8 日
10	13 年 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及 公 司 网 站 (www.ftfund.com)	2013 年 4 月 20 日
11	调整场外申购限额公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及 公 司 网 站 (www.ftfund.com)	2013 年 4 月 24 日

12	停牌股票估值调整	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及 公 司 网 站 (www.ftfund.com)	2013 年 5 月 15 日
13	新增中信银行为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及 公 司 网 站 (www.ftfund.com)	2013 年 5 月 17 日
14	关于行业高级人员变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及 公 司 网 站 (www.ftfund.com)	2013 年 6 月 25 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中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照

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

投资者可直接登录本基金管理人公司网站(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)，和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司
2013 年 8 月 27 日