泰信中证 200 指数证券投资基金
2013 年年度报告
摘要

2013 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：2014 年 3 月 27 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 2014 年 3 月 25 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。

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 2013 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	泰信中证 200 指数
基金主代码	290010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 6 月 9 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	118,180,001.22 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资方法，通过严格的投资流程约束和数量化风险管理手段，以实现对标的指数的有效跟踪。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，按照在中证 200 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 200 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	中证 200 指数收益率×95% + 商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为指数型基金，具有较高风险和较高预期收益的特征，其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。其风险因素主要来自于市场风险和跟踪误差的风险。由于采用被动投资策略，在投资管理上将最大限度地分散掉非系统性风险。对于跟踪误差的风险，本基金将通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的跟踪误差在限定范围内。

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	fcid@bankofchina.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	2013 年	2012 年	2011 年 6 月 9 日(基金合同生效日)-2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-881,340.90	-13,260,130.43	-13,823,363.93
本期利润	3,577,633.52	-388,689.89	-33,463,331.84
加权平均基金份额本期利润	0.0288	-0.0029	-0.1999
本期基金份额净值增长率	3.57%	-0.71%	-28.10%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2752	-0.3000	-0.2948
期末基金资产净值	85,660,879.48	95,083,487.80	95,852,288.75
期末基金份额净值	0.725	0.700	0.705

注：1、本基金合同于 2011 年 6 月 9 日生效。

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

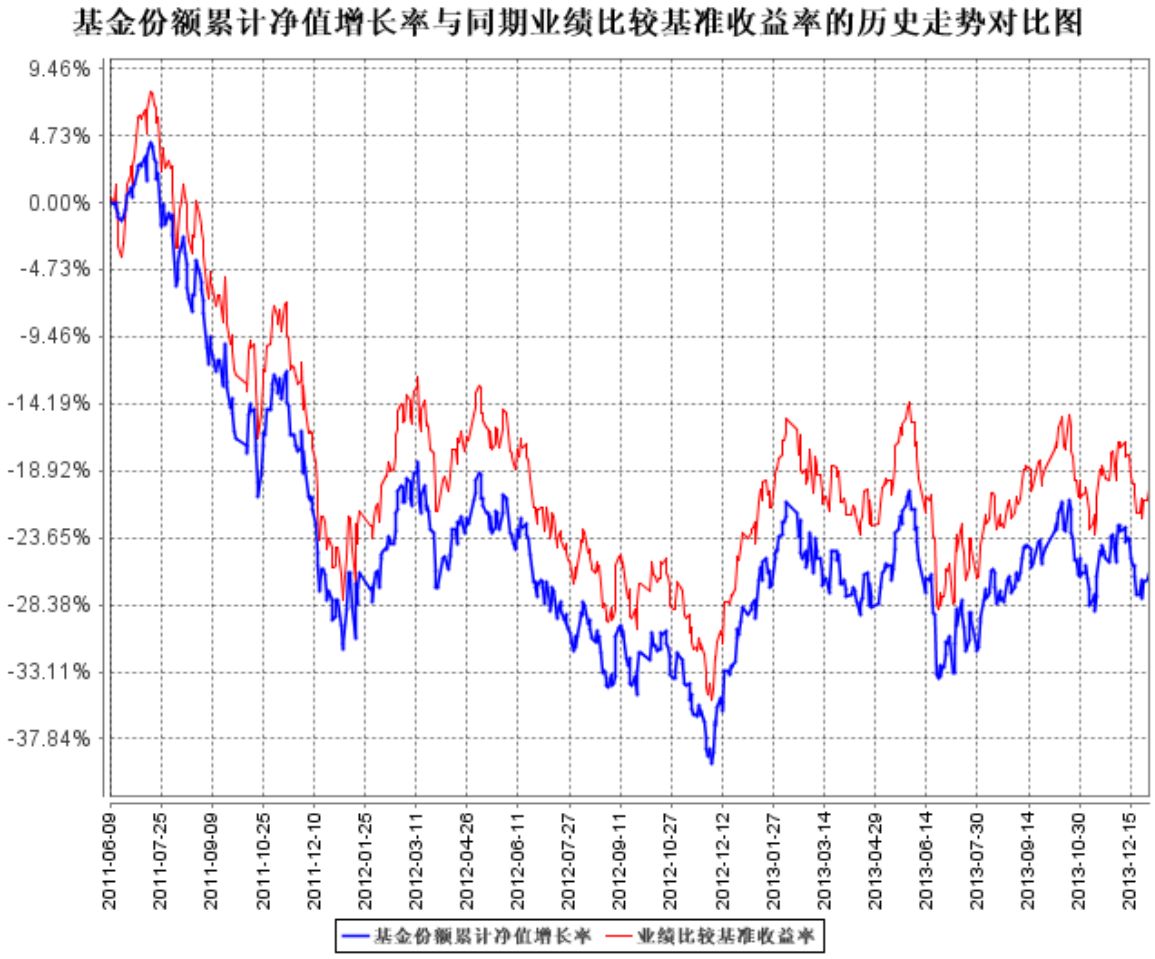
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-2.29%	1.21%	-1.97%	1.22%	-0.32%	-0.01%
过去六个月	10.02%	1.28%	10.40%	1.28%	-0.38%	0.00%
过去一年	3.57%	1.34%	3.88%	1.34%	-0.31%	0.00%
自基金合同生效起至今	-26.06%	1.35%	-20.27%	1.37%	-5.79%	-0.02%

注：本基金业绩比较基准为：中证 200 指数收益率×95% + 商业银行活期存款利率(税后)×5%。

中证 200 指数反映市场上不同规模特征股票的整体表现，中证指数有限公司以沪深 300 指数为基础，构建了包括大盘、中盘、小盘、大中盘、中小盘和大中小盘指数在内的规模指数体系，为市场提供丰富的分析工具和业绩基准，为指数产品和其他指数的研究开发奠定基础。

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



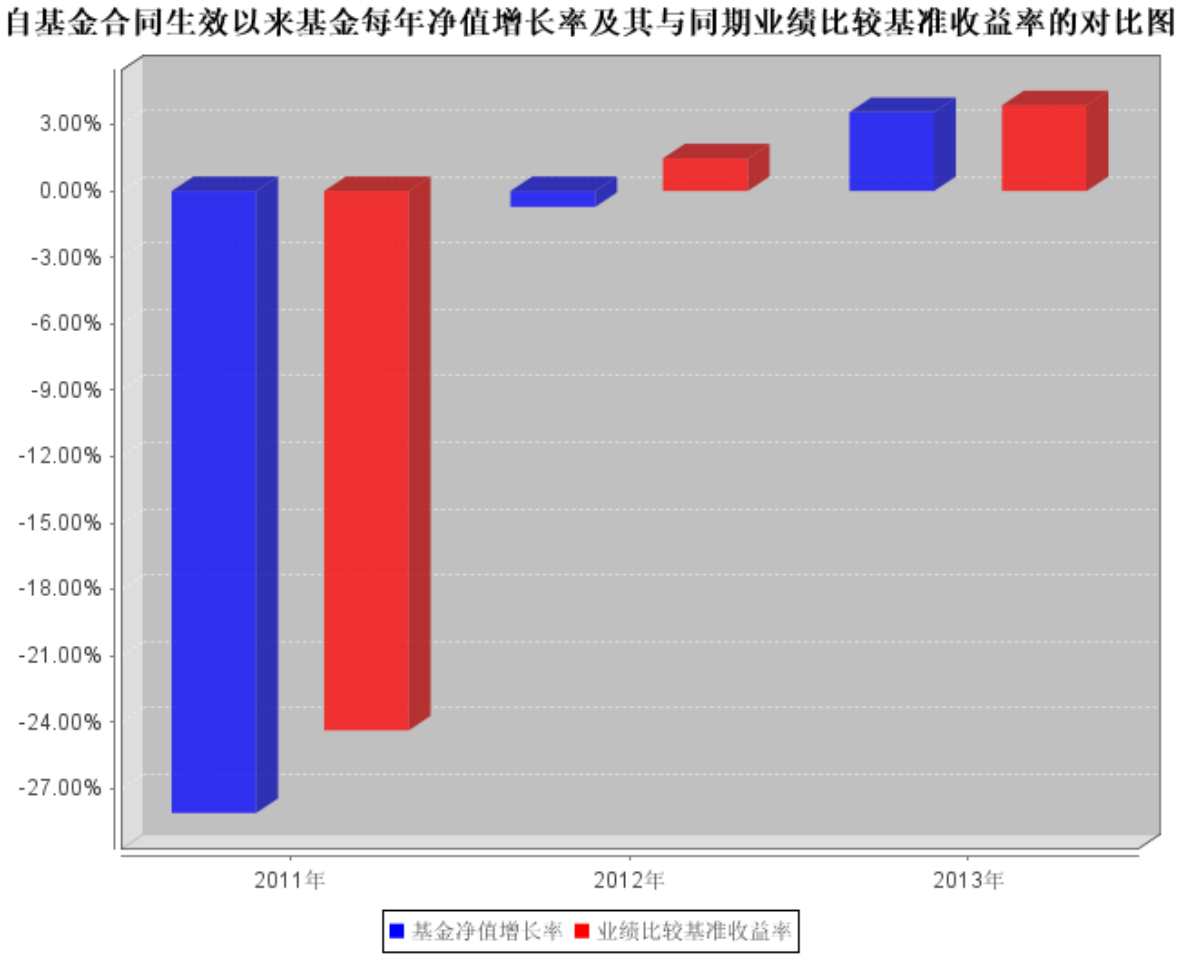
注：1、本基金基金合同于 2011 年 6 月 9 日正式生效。

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

资产占基金资产 90%-95%，投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于股票资产的90%。现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例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。

3、经泰信基金管理有限公司 2013 年第十二次总经理办公会议审议决定 ，冯张鹏先生担任泰信中证 200 指数证券投资基金经理职务，陈大庆先生不再担任本基金经理职务，具体详情请见 2013 年 7 月 5 日刊登在《中国证券报》、《证券时报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信中证 200 指数证券投资基金经理变更的公告》。

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



注：本基金基金合同于 2011 年 6 月 9 日正式生效，2011 年度相关数据根据实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013	-	-	-	-	

2012	-	-	-	-	
2011	0.2000	2,768,716.48	38,994.87	2,807,711.35	
合计	0.2000	2,768,716.48	38,994.87	2,807,711.35	

注：2012 年度、2013 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：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.）是原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（现更名为青岛国信发展（集团）有限责任公司）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，是国内第一家以信托投资公司为主发起人而发起设立的基金管理公司。

公司目前下设上海锐懿资产管理有限公司、市场部、营销部（分华东、华北、华南三大营销中心）、理财顾问部、深圳分公司、北京分公司、电子商务部、客服中心、基金投资部、研究部、专户投资部、清算会计部、集中交易部、计划财务部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部。截至 2013 年 12 月底，公司有正式员工 105 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 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、泰信现代服务业股票、泰信鑫益定期开放债券共 15 只开放式基金及泰信恒益高息债分级资产管理计划。

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		
冯张鹏先生	本基金经理兼泰信中证 400 指数基金经理	2013 年 7 月 5 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。曾担任泰信中证 200 指数基金经理助理、泰信中证 400 指数基金经理助理职务。自 2013 年 7 月 5 日起同时担任泰信中证 400 指数分级基金经理。

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。

3、经泰信基金管理有限公司 2013 年第十二次总经理办公会议审议决定 ，冯张鹏先生担任泰信中证 200 指数证券投资基金经理职务，陈大庆先生不再担任本基金经理职务，具体详情请见 2013 年 7 月 5 日刊登在《中国证券报》、《证券时报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信中证 200 指数证券投资基金经理变更的公告》。

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》、《泰信中证 200 指数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。

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

国内 A 股市场在 2013 年呈现较为剧烈的震荡走势，沪深 300 指数在 2013 年全年，2013 年下半年和四季度分别下跌 7.65%，上涨 5.88%，和下跌 3.28%。泰信中证 200 指数基金同期表现依次为上涨 3.57%，上涨 10.02%和下跌 2.29%，比较基准同期表现依次为上涨 3.77%，上涨 10.36%和下跌 2.00%。

报告期内，我们严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，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。2013 全年，年化跟踪误差控制在 0.978%。

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 0.725 元，净值增长率为 3.57%，同期业绩比较基准收益率为 3.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国 GDP 增速在 2013 年回落为 7.7%，2014 年中国经济依然将是负重前行的一年，去产能和去杠杆任务繁重，经济增长方式的转型任重道远。经济增长动力的疲软必然在未来持续拖累经济增长，进而拖累企业利润的持续改善。但党的十八届三中全会已经开启未来十年的改革进程，促进传统经济模式的转变和产业的转型升级，带动中国经济进入新的增长轨道，促进中国经济持续健康发展。国企改革也有望带来效益的提升，释放改革红利。同时全球需求回暖有望推动中国出口增速到达更高的水平。股票市场在 2014 年面临的各种挑战和机遇将会并存，市场环境更为复杂，A 股市场较强的波动将会持续，产能过剩问题，地方融资平台的债务问题和 IPO 等因素会对国内 A 股市场带来一定的抑制影响。

本基金作为一只投资于中证 200 指数的被动指数基金产品，我们将坚持指数化投资理念，运

用定量分析技术，减少各种因素对基金跟踪误差造成的冲击，把基金的跟踪误差控制在较低的水平，以维护投资者的利益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、泰信基金管理有限公司估值程序等事项的说明

委员会主席

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

委员会成员：

唐国培先生，硕士。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。

蔡海成先生，硕士。2013 年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，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

一、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或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；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、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；

4、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；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

二、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”）在对泰信中证 200 指数证券投资基金（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(2014)第 20673 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	泰信中证 200 指数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中证 200 指数证券投资基金(以下简称“泰信中证 200 基金”)的财务报表，包括 2013 年 12 月 31 日的资产负债表、2013 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中证 200 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。 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。	
审计意见段	我们认为，上述泰信中证 200 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，公允反映了泰信中证 200 基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 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	傅琛慧
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
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	2014 年 3 月 24 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泰信中证 200 指数证券投资基金

报告截止日： 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	4,835,423.25	5,450,508.57
结算备付金	1,049.70	-
存出保证金	4,506.55	-
交易性金融资产	81,228,490.02	89,928,888.66
其中：股票投资	81,228,490.02	89,928,888.66
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资		
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	973.51	1,439.92
应收股利	-	-
应收申购款	25,355.40	99,148.18
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	86,095,798.43	95,479,985.33
负债和所有者权益	**本期末 2013 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	10,617.11	681.46
应付管理人报酬	51,629.37	50,219.68
应付托管费	11,063.46	10,761.37
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	132,683.61	86,087.90
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	228,925.40	248,747.12
负债合计	434,918.95	396,497.53
所有者权益：		

实收基金	118,180,001.22	135,832,305.81
未分配利润	-32,519,121.74	-40,748,818.01
所有者权益合计	85,660,879.48	95,083,487.80
负债和所有者权益总计	86,095,798.43	95,479,985.33

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.725 元，基金份额总额 118,180,001.22 份。

7.2 利润表

会计主体：泰信中证 200 指数证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
一、收入	4,833,414.97	1,290,254.32
1.利息收入	38,129.19	42,301.64
其中：存款利息收入	38,129.19	42,301.64
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）	316,773.89	-11,629,961.92
其中：股票投资收益	-798,406.86	-12,619,509.75
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益		
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,115,180.75	989,547.83
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	4,458,974.42	12,871,440.54
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	19,537.47	6,474.06
减：二、费用	1,255,781.45	1,678,944.21
1．管理人报酬	630,276.99	657,965.25
2．托管费	135,059.46	140,992.55
3．销售服务费	-	-
4．交易费用	231,860.76	600,451.83
5．利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6．其他费用	258,584.24	279,534.58
三、利润总额 （亏损总额以“-”号	3,577,633.52	-388,689.89

填列）		
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	3,577,633.52	-388,689.89

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信中证200指数证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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）	135,832,305.81	-40,748,818.01	95,083,487.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	3,577,633.52	3,577,633.52
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）	-17,652,304.59	4,652,062.75	-13,000,241.84
其中：1.基金申购款	3,107,168.80	-836,925.51	2,270,243.29
2.基金赎回款	-20,759,473.39	5,488,988.26	-15,270,485.13
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）	118,180,001.22	-32,519,121.74	85,660,879.48
项目	**上年度可比期间 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）	135,913,517.61	-40,061,228.86	95,852,288.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-388,689.89	-388,689.89
三、本期基金份额交易产	-81,211.80	-298,899.26	-380,111.06

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	11,103,386.18	-3,583,345.62	7,520,040.56
2.基金赎回款	-11,184,597.98	3,284,446.36	-7,900,151.62
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）	135,832,305.81	-40,748,818.01	95,083,487.80

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	韩波	蔡海成
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰信中证 200 指数证券投资基金(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[2011]第 534 号《关于核准泰信中证 200 指数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 200 指数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 316,771,140.56 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(2011)第 228 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 6 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 316,786,119.38 份基金份额，其中认购资金利息折合 14,978.82 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《泰信中证 200 指数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、权证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。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于股票资产的 90%。现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例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。本基金的业绩比较基准为：本基金的业绩比较基准为：中证 200 指数收益率× 95%＋商业银行活期存款利率(税后) ×5%。

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 2014 年 3 月 24 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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信中证 200 指数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 2013 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 12 月 31 日的财务状况以及 2013 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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。基金买卖股票的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股权的股息、红利收入及其

他收入，暂不征收企业所得税。

(3)自 2013 年 1 月 1 日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。

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、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
青岛国信发展（集团）有限责任公司(“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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	630,276.99	657,965.25
其中：支付销售机构的客户维护费	109,829.34	123,824.83

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的 0.7%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 0.7% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	135,059.46	140,992.55

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 0.15%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 0.15% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

本报告期及上年度本基金未发生销售服务费用。

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

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	15,999,320.00	15,999,320.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-

减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	15,999,320.00	15,999,320.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.54%	11.78%

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2013 年 12 月 31 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
山东国托	49,999,000.00	42.31%	49,999,000.00	36.81%

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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	4,835,423.25	37,124.99	5,450,508.57	38,719.93

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 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（2013 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

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

7.4.9.2 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
000625	长安汽车	2013 年 12	临时停牌	11.45	2014 年 1 月	11.72	83,059	401,551.78	951,025.55	-

		月 31 日			3 日					
601901	方正证券	2013 年 8 月 26 日	重大资产重组	6.20	2014 年 1 月 13 日	6.24	149,135	791,336.61	924,637.00	-
600058	五矿发展	2013 年 7 月 24 日	重大资产重组	13.56	2014 年 1 月 6 日	14.92	20,900	528,517.47	283,404.00	-

注：本基金截至 2013 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 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)各层级金融工具公允价值

于 2013 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 79,069,423.47 元，属于第二层级的余额为 2,159,066.55 元，无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日，第一层级 89,260,483.34 元，第二层级 668,405.32 元，无第三层级)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票的公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv)第三层级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	81,228,490.02	94.35
	其中：股票	81,228,490.02	94.35
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资		
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,836,472.95	5.62
7	其他各项资产	30,835.46	0.04
8	合计	86,095,798.43	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例（%）

A	农、林、牧、渔业	1,670,710.35	1.95
B	采矿业	4,021,752.55	4.69
C	制造业	40,724,121.79	47.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,066,979.89	3.58
E	建筑业	2,525,165.73	2.95
F	批发和零售业	5,587,951.25	6.52
G	交通运输、仓储和邮政业	2,546,416.39	2.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,295,162.62	5.01
J	金融业	7,101,427.09	8.29
K	房地产业	4,890,494.12	5.71
L	租赁和商务服务业	1,594,078.02	1.86
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,282,243.18	1.50
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	1,141,427.79	1.33
S	综合	780,559.25	0.91
	合计	81,228,490.02	94.83

8.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

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

8.3.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600383	金地集团	197,472	1,319,112.96	1.54
2	600089	特变电工	116,441	1,248,247.52	1.46
3	600637	百视通	29,482	1,089,949.54	1.27

4	600739	辽宁成大	61,687	1,081,989.98	1.26
5	600196	复星医药	50,464	988,589.76	1.15
6	000625	长安汽车	83,059	951,025.55	1.11
7	601901	方正证券	149,135	924,637.00	1.08
8	000423	东阿阿胶	23,069	912,609.64	1.07
9	600315	上海家化	20,756	876,525.88	1.02
10	000100	TCL 集团	374,301	872,121.33	1.02

8.3.2 积极投资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

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

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	000970	中科三环	1,462,572.00	1.54
2	601901	方正证券	1,158,788.00	1.22
3	000422	湖北宜化	1,131,160.00	1.19
4	600372	中航电子	1,084,369.00	1.14
5	601607	上海医药	1,064,055.54	1.12
6	600089	特变电工	1,046,143.24	1.10
7	600637	百视通	1,037,040.56	1.09
8	002450	康得新	994,543.64	1.05
9	002236	大华股份	988,624.94	1.04
10	000012	南　玻Ａ	983,605.00	1.03
11	600332	白云山	943,299.00	0.99
12	600027	华电国际	933,814.00	0.98
13	600498	烽火通信	915,507.00	0.96
14	601168	西部矿业	911,923.00	0.96
15	600809	山西汾酒	880,115.00	0.93
16	600703	三安光电	842,441.00	0.89
17	600340	华夏幸福	825,574.92	0.87
18	002081	金 螳 螂	818,298.10	0.86
19	600118	中国卫星	816,520.00	0.86

20	600068	葛洲坝	765,384.00	0.80

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	600690	青岛海尔	2,080,476.39	2.19
2	600518	康美药业	1,875,893.53	1.97
3	600887	伊利股份	1,853,169.05	1.95
4	600535	天士力	1,756,180.94	1.85
5	002236	大华股份	1,577,877.27	1.66
6	000422	湖北宜化	1,424,576.36	1.50
7	002353	杰瑞股份	1,303,573.89	1.37
8	000024	招商地产	1,289,576.85	1.36
9	002241	歌尔声学	1,219,620.23	1.28
10	600372	中航电子	1,165,351.09	1.23
11	601633	长城汽车	1,111,865.73	1.17
12	000012	南　玻Ａ	1,087,028.24	1.14
13	601901	方正证券	1,064,012.18	1.12
14	600498	烽火通信	1,036,230.54	1.09
15	000562	宏源证券	1,022,841.32	1.08
16	600703	三安光电	996,012.21	1.05
17	600809	山西汾酒	953,176.82	1.00
18	600118	中国卫星	948,393.58	1.00
19	000100	TCL 集团	933,536.66	0.98
20	600276	恒瑞医药	925,564.76	0.97

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	68,102,707.54
卖出股票收入（成交）总额	80,463,673.74

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

本报告期末本基金未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期本基金未投资贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末本基金未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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库之外的股票。

8.12.3 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	4,506.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	973.51
5	应收申购款	25,355.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,835.46

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000625	长安汽车	951,025.55	1.11	临时停牌

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

8.12.6 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

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
882	133,990.93	87,548,966.55	74.08%	30,631,034.67	25.92%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	15,981.19	0.0135%

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 6 月 9 日）基金份额总额	316,786,119.38
本报告期期初基金份额总额	135,832,305.81
本报告期基金总申购份额	3,107,168.80
减:本报告期基金总赎回份额	20,759,473.39
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	118,180,001.22

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、2013 年 3 月 17 日中国银行股份有限公司公告，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。2013 年 6 月 1 日中国银行股份有限公司公告，自 2013 年 5 月 31 日起，田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

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》。

3、经泰信基金管理有限公司 2013 年第十二次总经理办公会议审议决定 ，冯张鹏先生担任泰信中证 200 指数证券投资基金经理职务，陈大庆先生不再担任本基金经理职务，具体详情请见 2013 年 7 月 5 日刊登在《中国证券报》、《证券时报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信中证 200 指数证券投资基金经理变更的公告》。 本公司上述人事变动已按相关规定备案。

除此以外无其他重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

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（2011 年 6 月 9 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	
第一创业	1	74,682,983.95	50.28%	67,991.37	50.87%	-
华宝证券	1	61,133,386.91	41.16%	54,097.11	40.47%	-
申银万国	1	12,713,473.62	8.56%	11,574.57	8.66%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-

海通证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中国建银投资证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-

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基金、泰信蓝筹精选基金、泰信增强收益基金、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
第一创业	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中国建银投资证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

泰信基金管理有限公司
2014 年 3 月 27 日