

泰信中小盘精选股票型证券投资基金

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	泰信中小盘精选股票
基金主代码	290011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 10 月 26 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	121,362,484.20 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资具有高成长潜力的中小盘股票，追求基金资产的长期稳定增值。在严控风险的前提下，力争获取超越业绩基准的稳健收益。
投资策略	本基金将结合“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”的个股精选策略，重点投资于萌芽期和成长期行业中具有持续成长潜力以及未来成长空间广阔的中小型上市公司，同时考虑组合品种的估值风险和大类资产的系统风险，通过品种和仓位的动态调整降低资产的波动风险。
业绩比较基准	中证700指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金主要通过发掘具有高成长潜力的中小盘股票实现基金资产增值，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，理论上预期风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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	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

注：《证券日报》所有广告、公告、信息披露等业务均由证券日报所属北京正金时代广告有限责任公司全权代理。

§ 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 10 月 26 日 (基金合同生效日)-2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	21,079,044.93	5,733,430.50	628,074.27
本期利润	10,155,643.98	13,291,401.74	-1,714,464.08
加权平均基金份额本期利润	0.0949	0.1998	-0.0076
本期基金份额净值增长率	9.53%	9.23%	-1.10%
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	0.1273	0.051	-0.0111
		2	
期末基金资产净值	136,812,073.79	78,058,663.49	148,793,668.45
期末基金份额净值	1.127	1.065	0.989

注：1、本基金合同于 2011 年 10 月 26 日正式生效。

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	-3.99%	1.40%	-1.68%	1.07%	-2.31%	0.33%
过去六个月	13.81%	1.43%	10.89%	1.09%	2.92%	0.34%
过去一年	9.53%	1.47%	8.17%	1.13%	1.36%	0.34%
自基金合同生效起至今	18.33%	1.19%	-2.13%	1.17%	20.46%	0.02%

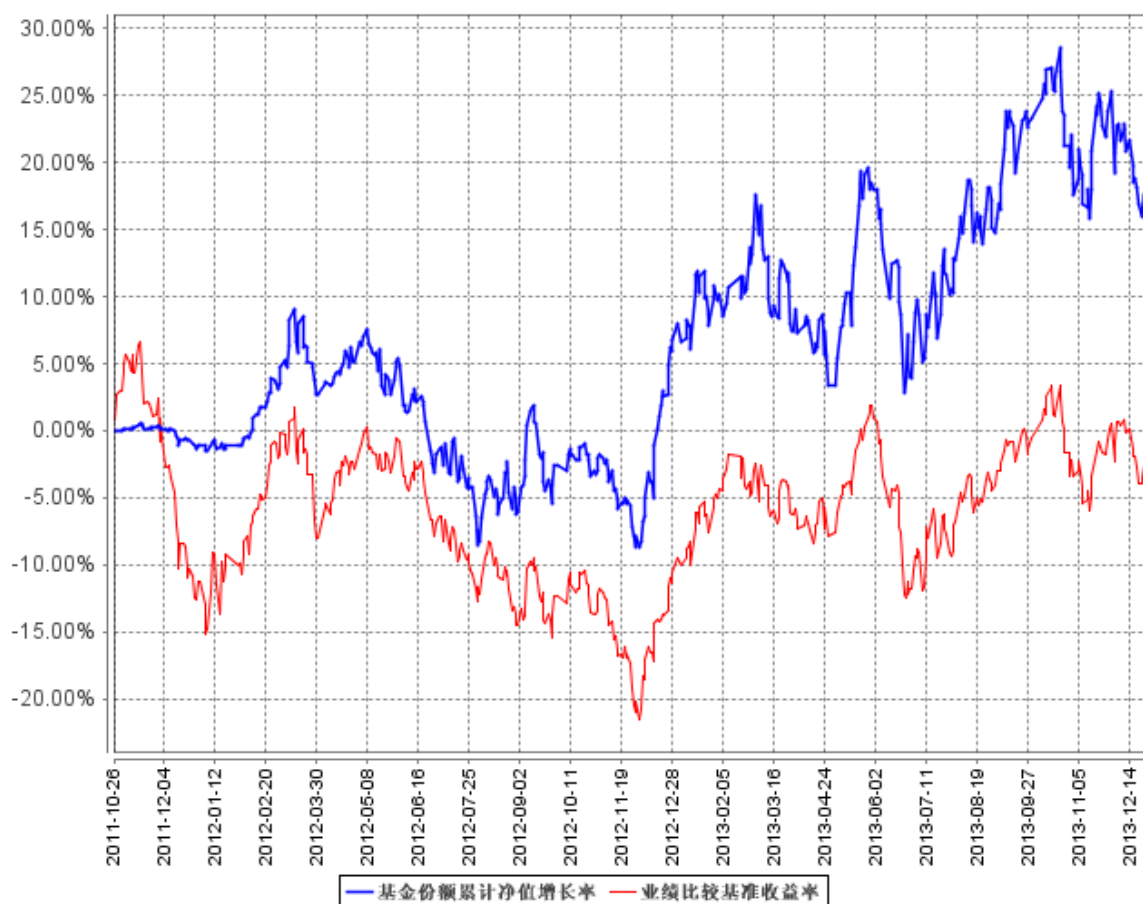
注：本基金业绩比较基准为：中证 700 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%

1、中证 700 指数是中证指数有限公司以沪深 300 指数为基础编制的系列规模指数之一，全称为中证中小盘 700 指数（中 CSI Small&Midcap 700 index），上海行情代码为 000907，深圳行情代码为 399907。其成分股由代表中盘特征的中证 200 指数的成分股和代表小盘特征的中证 500 指数的成分股共同构成，中证 700 指数编制合理、透明，运用广泛，能够综合反映沪深证券市场内中小市值公司的整体状况，对中国 A 股中小盘市场具有较强的代表性和权威性。

2、中证全债指数以银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券为样本，是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，具有良好的债券市场代表性，运用较为广泛。

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

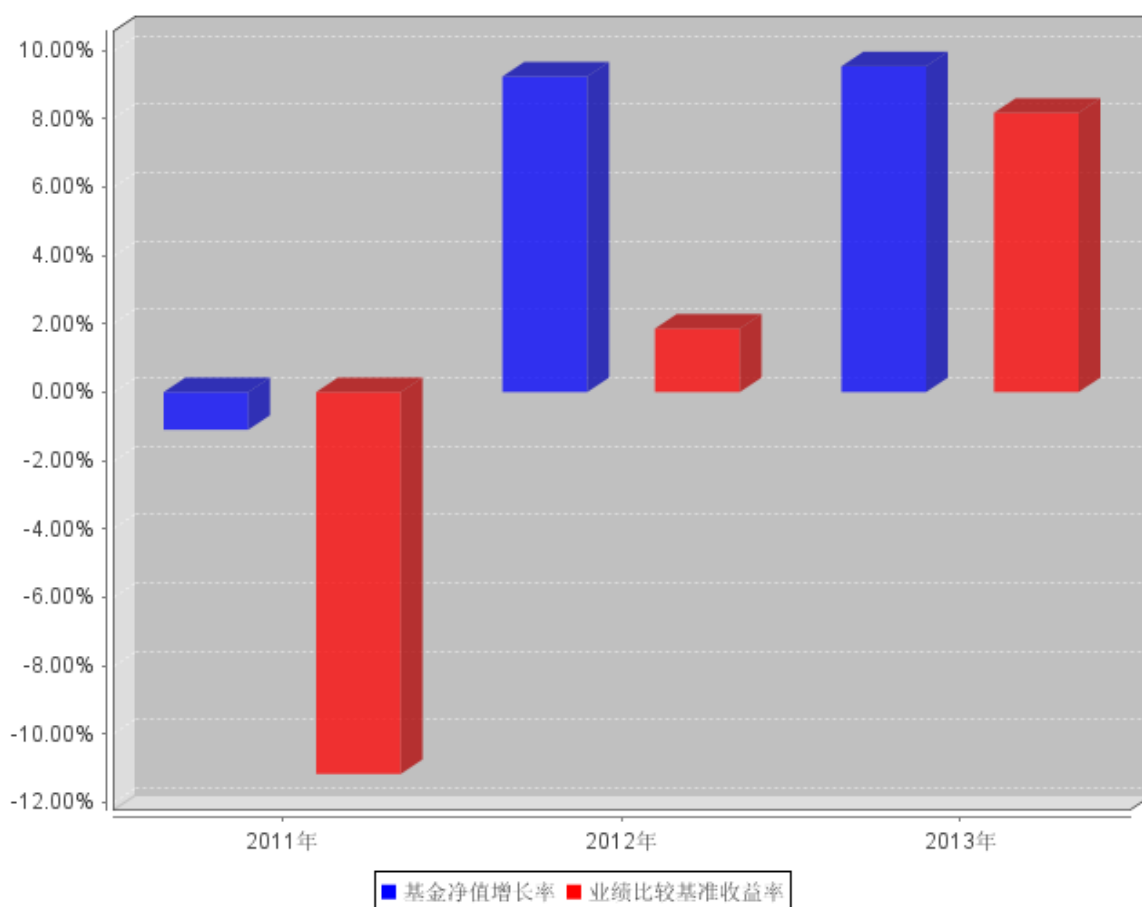


注：1、本基金合同于 2011 年 10 月 26 日正式生效。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满，本基金将基金资产的 60%-95%投资于股票，现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，债券、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规和监管机构的规定执行。本基金投资于中小盘股票的比例不低于股票投资资产的 80%。

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

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：本基金合同于 2011 年 10 月 26 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	0.400	4,742,757.97	104,080.78	4,846,838.75	
2012	0.150	674,419.53	20,687.87	695,107.40	
2011	-	-	-	-	
合计	0.550	5,417,177.50	124,768.65	5,541,946.15	

注：本基金合同于 2011 年 10 月 26 日正式生效，依据《泰信中小盘精选股票型证券投资基金招募说明书》的相关约定，基金合同生效不满 3 个月可不进行利润分配，2011 年度未进行利润分配。

§ 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 日经中国证券监督管理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		
柳菁女士	研究部总监兼研究总监、本基金经理兼泰信蓝筹精选基金经理	2011 年 10 月 26 日	—	19	工商管理硕士。具有基金从业资格。曾任天同证券有限责任公司资产管理部交易员、研究员、投资经理。2005 年加入泰信基金管理有限公司，先后任交易员、研究部高级研究员、泰信先行策略基金基金经理助理。自 2009 年 4 月 22 日起担任泰信蓝筹精选基金经理。现同时担任研究部总监兼研究总监。
张彦先生	本基金经理助理兼泰信优势增长基金经理助理	2011 年 10 月 26 日	—	8	经济学硕士。具备基金从业资格。曾任职于国金证券研究所、上海从容投资管理有限公司、万家基金管理有限公司。2011 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，担任高级研究员。自 2012 年 4 月 6 日起担任泰信优势增长基金经理助理职务。

注：1、基金经理的任职日期以基金合同生效日为准。

2、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。

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》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金的投资运作符合有关法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两日反向交易，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

2013 年的 A 股市场表现为较为极端的分化走势，主板持续低迷，而中小板、创业板指数创出新高。由于市场对宏观经济的悲观预期，市场热点全面转向以 TMT 和传媒为代表的新兴行业。我们之所以认为市场走势相当极端，是因为在这一年里，传统的经济分析框架以及估值分析完全失灵，传统蓝筹股和新兴产业股票之间的估值差屡创历史新高。

报告期内，本基金在一季度将配置重点放在了以新兴产业为代表的成长股以及我们认为年内出现行业拐点的部分传统行业，如军工、新能源领域部分个股，二季度开始，本基金加大了对传媒、TMT 行业的配置，三季度，我们认为成长股涨幅较大、估值过高，出现泡沫，出于控制风险的考虑本基金对重仓持有的创业板股票进行了减持，但由于市场对创业板的热情仍然较高，我们对市场的判断出现了较大的失误，对基金业绩产生了一定的负面影响。三季度开始，本基金积极参与了上海自贸区、十八届三中全会等制度改革和政策红利带来的行业投资机会。

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 1.127 元，净值增长率为 9.53%，同期业绩比较基准收益率为 8.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为 2014 年的 A 股市场机会与风险并存。

机会方面，我们认为 2014 年的中国经济不会失速下跌但复苏力度仍然较弱。在此宏观背景下改革和转型是个股上涨的重要催化因素。

十八届三中全会之后，全面的改革即将铺开，政府将通过对这些领域的改革来推动整个国民经济的转型，在这个过程中能符合政府主导的转型方向的产业和部分能通过体制革新、落实激励、淘汰落后产能、提高劳动生产率、推出符合未来发展方向的新产品而成功实现转型的传统行业的低估值大盘蓝筹股可能是未来的市场亮点。

在经济转型过程中会出现一些行业和公司，它们既符合世界经济和技术发展潮流，又符合我

国产业转型的方向，加上其本身受宏观经济的影响较小，在目前的宏观环境下将成为今年市场的重要结构性机会。

风险我们认为主要存在两个方面：去杠杆带来的阶段性流动性风险和改革阵痛带来的经济数据阶段性下滑以及在季末、年末的一些敏感时点市场流动性收紧带来的风险。

投资策略上，我们将继续运用“反预期管理”的投资策略，关注重点从不断创新高的市场热点转换到被市场忽略的价值投资板块。我们还将坚持行业轮动的思路操作，对部分获利行业进行波段操作。

配置方面我们看好以下几个行业：4G 网络的推出为移动互联网行业的发展提供了更坚实的基础，而移动互联网行业的快速发展除了促进传统行业的快速转型，也将带动计算机、电子、通信等行业的更快发展；医疗服务作为现代服务业的重要组成部分越来越受到政府的重视，民间资本的参与为行业带来更大空间，我们看好医药行业尤其是医疗服务行业在 2014 年的表现；近期持续出现的雾霾天气和环境事件将促使环保工作成为新一届政府未来工作的重点之一，也将使环保行业成为未来很长一段时间的热点；出于对能源紧缺的补充和环保的压力，新能源行业得到了政府越来越多的支持，技术的进步将推动新能源更快的普及和更大范围的应用，我们认为新能源行业尤其是新能源汽车和风电行业将成为未来一段时间的投资热点；此外，国防投入的增加，以及体制的革新都将使军工行业在 2014 年迎来大的投资机会。

操作方面，本基金会把自上而下做好行业轮动和自下而上选择好个股相结合。

在个股的选择方面，我们将综合利用公司的股票价值评估系统和尽职调研评估系统，结合定量分析和定性分析，精选出技术、管理、资源和政策四个方面具有优势，成长具有持续性的公司进行投资。

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订及补充完善，促进了业务的合规开展。主要包括《开展投资、研究活动防控内幕交易管理制度》、《基金关联交易管理办法》、《公司高级管理人员和投资管理人员出国（境）管理规定》、《公司固有资金运用管理办法》及反洗钱相关内控制度等，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。

(1) 加强基金的日常投资交易进行监控, 及时提示相关风险。公司风险管理部负责基金日常投资行为的监控, 并与相关基金经理沟通, 提示相关风险。同时根据投委会的投资决议对风险指标设置进行调整, 不定期检查风险监控指标设置, 并根据新的需求对风险监控指标进行测试和更新。另外注意对监管机构处罚信息与市场负面信息搜集, 提示投研部门注意潜在风险。

(2) 做好日常股票及债券出入库工作。在保证时间及时性和工作准确度的前提下, 全年完成了股票批量出库及到期债券的批量出库工作, 维持公司基金备选库内的股票债券数量限制。

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, 新增了基金间同日同向交易、所有投资组合对单只股票成交量占其市场总成交异常等指标预警。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。根据年初拟定的专项稽核计划, 公司监察稽核部开展了专户业务相关环节、代表基金行使投票表决权、公募基金投资运作报告执行情况相关环节、营销费用管理、代销协议及上线流程管理、应用系统权限管理、公平交易及异常交易等 7 个专项稽核项目, 涉及公司投资、研究、交易、风险管理、市场、营销、清算会计、信息技术、计划财务等主要业务板块及核心业务, 较好了解掌握公司业务运作主要内控节点现状。监察稽核部根据经相关部门及公司领导审核确认的专项稽核报告, 按照监察稽核流程, 推进整改落实工作, 对于进一步优化制度流程、加强遵章守纪意识、健全内控体系有较大促进作用。

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，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。

4.8 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；选择红利再投资的，现金红利则按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、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，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

4、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，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

5、基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；

6、投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均保留到小数点后第 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产；

7、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

二、本报告期，本基金每 10 份分配 0.400 元，利润分配合计 4,846,838.75 元(其中, 现金形式发放 4,742,757.97 元, 再投资形式发放 104,080.78 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”）在对泰信中小盘精选股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本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 20719 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	泰信中小盘精选股票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中小盘精选股票型证券投资基金(以下简称“泰信中小盘基金”)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	<p>编制和公允列报财务报表是泰信中小盘基金的基金管理人 泰信基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括:</p> <p>(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;</p> <p>(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。</p>	
注册会计师的责任段	<p>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。</p> <p>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。</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,上述泰信中小盘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,公允反映了泰信中小盘基金 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：泰信中小盘精选股票型证券投资基金

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	7,597,130.42	3,664,156.90
结算备付金	268,026.37	1,870,761.88
存出保证金	102,792.25	-
交易性金融资产	126,902,111.31	62,737,475.41
其中：股票投资	126,902,111.31	62,737,475.41
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	3,000,000.00	10,000,000.00
应收证券清算款	395,430.45	814,803.46
应收利息	2,266.12	1,627.41
应收股利	-	-
应收申购款	-	4,940.71
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	138,267,756.92	79,093,765.77
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	22,968.34	72,260.84
应付管理人报酬	179,733.88	89,651.77
应付托管费	29,955.62	14,941.96
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	838,438.73	403,510.83

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	384,586.56	454,736.88
负债合计	1,455,683.13	1,035,102.28
所有者权益：		
实收基金	121,362,484.20	73,273,592.89
未分配利润	15,449,589.59	4,785,070.60
所有者权益合计	136,812,073.79	78,058,663.49
负债和所有者权益总计	138,267,756.92	79,093,765.77

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.127 元，基金份额总额 121,362,484.20 份。

7.2 利润表

会计主体：泰信中小盘精选股票型证券投资基金

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	14,863,679.23	16,031,994.11
1. 利息收入	368,058.70	695,246.71
其中：存款利息收入	81,025.57	131,058.43
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	287,033.13	564,188.28
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	25,383,361.56	7,600,106.95
其中：股票投资收益	24,983,642.48	7,282,122.80
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	399,719.08	317,984.15
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-10,923,400.95	7,557,971.24
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	35,659.92	178,669.21
减：二、费用	4,708,035.25	2,740,592.37
1. 管理人报酬	1,798,432.16	1,013,948.44

2. 托管费	299,738.80	168,991.36
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,218,591.45	1,077,684.88
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	391,272.84	479,967.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	10,155,643.98	13,291,401.74
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	10,155,643.98	13,291,401.74

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信中小盘精选股票型证券投资基金

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）	73,273,592.89	4,785,070.60	78,058,663.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	10,155,643.98	10,155,643.98
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）	48,088,891.31	5,355,713.76	53,444,605.07
其中：1. 基金申购款	74,963,649.14	8,797,329.33	83,760,978.47
2. 基金赎回款	-26,874,757.83	-3,441,615.57	-30,316,373.40
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）	-	-4,846,838.75	-4,846,838.75
五、期末所有者权益（基金净值）	121,362,484.20	15,449,589.59	136,812,073.79
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）	150,462,695.09	-1,669,026.64	148,793,668.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	13,291,401.74	13,291,401.74
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）	-77,189,102.20	-6,142,197.10	-83,331,299.30
其中：1. 基金申购款	61,519,475.49	-1,528,406.82	59,991,068.67
2. 基金赎回款	-138,708,577.69	-4,613,790.28	-143,322,367.97
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）	-	-695,107.40	-695,107.40
五、期末所有者权益（基金净值）	73,273,592.89	4,785,070.60	78,058,663.49

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

泰信中小盘精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 1138 号《关于核准泰信中小盘精选股票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《泰信中小盘精选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 262,307,424.58 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 408 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信中小盘精选股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 10 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 262,332,100.87 份基金份额,其中认购资金利息折合 24,676.29 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《泰信中小盘精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的各项

类股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证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。本基金将基金资产的 60%-95%投资于股票, 现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 债券、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规和监管机构的规定执行。本基金投资于中小盘股票的比例不低于股票投资资产的 80%。本基金的业绩比较基准为: $80\% \times \text{中证 700 指数收益率} + 20\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

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》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金 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 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、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	1,798,432.16	1,013,948.44
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.50% / 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	299,738.80	168,991.36

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
合计	-
获得销售服务费各关联方名称	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销售服务费
合计	-

注：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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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	94,843,090.56	78.15%	49,704,990.77	67.83%

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	7,597,130.42	53,756.46	3,664,156.90	83,433.95

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/增发而持有的流通受限证券。

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
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	980,100	6,005,673.00	6,076,620.00	-

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 120,825,491.31 元，属于第二层级的余额为 6,076,620.00 元，无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日，第一层级 58,739,275.41，第二层级 3,998,200.00 元，无属于

第三层级的余额)。

(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	126,902,111.31	91.78
	其中:股票	126,902,111.31	91.78
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	3,000,000.00	2.17
	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	7,865,156.79	5.69
7	其他各项资产	500,488.82	0.36
8	合计	138,267,756.92	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—

B	采矿业	-	-
C	制造业	61,741,268.69	45.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,206,798.00	5.27
E	建筑业	5,450,000.00	3.98
F	批发和零售业	7,714,500.00	5.64
G	交通运输、仓储和邮政业	11,205,160.00	8.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,439,450.00	5.44
J	金融业	24,173,720.00	17.67
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,971,214.62	1.44
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	126,902,111.31	92.76

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600000	浦发银行	950,000	8,958,500.00	6.55
2	600416	湘电股份	1,000,000	6,870,000.00	5.02
3	600196	复星医药	320,000	6,268,800.00	4.58
4	601901	方正证券	980,100	6,076,620.00	4.44
5	300197	铁汉生态	200,000	5,450,000.00	3.98
6	002368	太极股份	155,000	5,046,800.00	3.69

7	600292	中电远达	190,200	4,924,278.00	3.60
8	601318	中国平安	110,000	4,590,300.00	3.36
9	600018	上港集团	850,000	4,488,000.00	3.28
10	600597	光明乳业	200,000	4,440,000.00	3.25

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	000001	平安银行	14,927,073.08	19.12
2	600048	保利地产	12,694,797.57	16.26
3	000002	万科A	12,647,277.00	16.20
4	600018	上港集团	12,485,409.00	15.99
5	002529	海源机械	11,195,640.14	14.34
6	600000	浦发银行	10,980,900.00	14.07
7	600292	中电远达	10,926,137.40	14.00
8	000562	宏源证券	10,265,549.86	13.15
9	300027	华谊兄弟	10,080,908.30	12.91
10	600515	海岛建设	9,982,750.36	12.79
11	600765	中航重机	9,614,022.55	12.32
12	601118	海南橡胶	9,304,171.95	11.92
13	600416	湘电股份	8,477,303.43	10.86
14	600851	海欣股份	8,464,931.01	10.84
15	600562	国睿科技	8,153,430.80	10.45
16	300297	蓝盾股份	8,069,328.69	10.34
17	002338	奥普光电	7,574,854.35	9.70
18	300315	掌趣科技	7,533,428.98	9.65
19	300197	铁汉生态	7,511,779.80	9.62
20	002700	新疆浩源	7,146,018.20	9.15
21	600837	海通证券	6,988,033.00	8.95
22	002266	浙富控股	6,818,587.36	8.74
23	600196	复星医药	6,816,005.51	8.73
24	601166	兴业银行	6,727,180.00	8.62

25	002368	太极股份	6,572,766.37	8.42
26	002646	青青稞酒	6,473,056.53	8.29
27	600990	四创电子	6,387,690.00	8.18
28	600016	民生银行	6,319,600.00	8.10
29	600818	中路股份	6,243,396.99	8.00
30	600111	包钢稀土	6,089,459.36	7.80
31	600420	现代制药	6,055,238.60	7.76
32	600428	中远航运	6,043,354.00	7.74
33	002259	升达林业	6,031,840.31	7.73
34	601901	方正证券	6,005,673.00	7.69
35	600549	厦门钨业	5,785,674.20	7.41
36	000970	中科三环	5,713,782.97	7.32
37	000996	中国中期	5,712,989.72	7.32
38	000024	招商地产	5,135,100.00	6.58
39	600206	有研硅股	5,089,268.00	6.52
40	600688	上海石化	5,087,604.13	6.52
41	002024	苏宁云商	5,080,736.20	6.51
42	601186	中国铁建	5,069,400.00	6.49
43	001696	宗申动力	5,058,000.86	6.48
44	600388	龙净环保	5,017,040.70	6.43
45	600523	贵航股份	4,899,794.72	6.28
46	600383	金地集团	4,862,581.16	6.23
47	000050	深天马 A	4,810,960.98	6.16
48	601318	中国平安	4,782,731.83	6.13
49	600597	光明乳业	4,716,282.11	6.04
50	300137	先河环保	4,709,221.83	6.03
51	002603	以岭药业	4,603,514.06	5.90
52	600475	华光股份	4,599,383.52	5.89
53	600289	亿阳信通	4,569,785.97	5.85
54	600429	三元股份	4,562,880.47	5.85
55	600550	天威保变	4,450,481.17	5.70
56	600559	老白干酒	4,445,795.00	5.70
57	600643	爱建股份	4,393,121.77	5.63
58	000156	华数传媒	4,297,555.99	5.51
59	600702	沱牌舍得	4,252,199.37	5.45
60	002317	众生药业	4,229,788.96	5.42

61	600495	晋西车轴	4,187,571.00	5.36
62	600267	海正药业	4,134,673.84	5.30
63	600149	廊坊发展	4,055,510.85	5.20
64	600284	浦东建设	4,024,373.68	5.16
65	601601	中国太保	3,922,306.00	5.02
66	300088	长信科技	3,905,917.66	5.00
67	002414	高德红外	3,873,129.98	4.96
68	000800	一汽轿车	3,808,093.46	4.88
69	300014	亿纬锂能	3,782,236.88	4.85
70	002400	省广股份	3,714,246.76	4.76
71	601607	上海医药	3,592,679.14	4.60
72	600158	中体产业	3,584,983.30	4.59
73	002526	山东矿机	3,509,010.16	4.50
74	300017	网宿科技	3,495,749.52	4.48
75	300252	金信诺	3,494,370.28	4.48
76	300223	北京君正	3,490,031.83	4.47
77	002309	中利科技	3,484,176.23	4.46
78	300034	钢研高纳	3,471,524.50	4.45
79	600073	上海梅林	3,471,416.73	4.45
80	002055	得润电子	3,446,192.72	4.41
81	600725	云维股份	3,442,333.00	4.41
82	000735	罗牛山	3,438,859.56	4.41
83	601928	凤凰传媒	3,427,021.50	4.39
84	600718	东软集团	3,390,280.00	4.34
85	603000	人民网	3,374,975.51	4.32
86	600832	东方明珠	3,332,400.00	4.27
87	600705	中航投资	3,319,012.65	4.25
88	600639	浦东金桥	3,303,716.40	4.23
89	300115	长盈精密	3,242,363.36	4.15
90	600871	仪征化纤	3,233,574.21	4.14
91	000581	威孚高科	3,229,264.49	4.14
92	600860	北人股份	3,209,579.01	4.11
93	300045	华力创通	3,202,207.40	4.10
94	600787	中储股份	3,199,515.63	4.10
95	600662	强生控股	3,193,454.00	4.09
96	600161	天坛生物	3,140,152.38	4.02

97	600629	棱光实业	3,099,546.82	3.97
98	600816	安信信托	3,097,776.00	3.97
99	600893	航空动力	3,090,175.00	3.96
100	000988	华工科技	3,067,955.42	3.93
101	603002	宏昌电子	3,036,805.79	3.89
102	300055	万邦达	3,029,390.00	3.88
103	600278	东方创业	3,014,073.80	3.86
104	000063	中兴通讯	2,970,302.13	3.81
105	600101	明星电力	2,964,200.79	3.80
106	600748	上实发展	2,851,589.45	3.65
107	000831	五矿稀土	2,827,380.00	3.62
108	002151	北斗星通	2,795,999.10	3.58
109	300096	易联众	2,789,027.00	3.57
110	000920	南方汇通	2,771,830.20	3.55
111	600387	海越股份	2,765,708.00	3.54
112	002273	水晶光电	2,741,970.63	3.51
113	600109	国金证券	2,734,528.00	3.50
114	300012	华测检测	2,685,045.12	3.44
115	000551	创元科技	2,629,160.50	3.37
116	600036	招商银行	2,610,397.00	3.34
117	600395	盘江股份	2,554,374.17	3.27
118	300083	劲胜股份	2,550,984.10	3.27
119	600108	亚盛集团	2,519,100.00	3.23
120	600272	开开实业	2,476,781.00	3.17
121	600699	均胜电子	2,446,437.54	3.13
122	300148	天舟文化	2,428,475.13	3.11
123	600199	金种子酒	2,381,210.73	3.05
124	002501	利源精制	2,323,628.21	2.98
125	300104	乐视网	2,318,544.06	2.97
126	600021	上海电力	2,305,600.00	2.95
127	600895	张江高科	2,298,216.10	2.94
128	002618	丹邦科技	2,277,381.50	2.92
129	300044	赛为智能	2,255,488.00	2.89
130	600874	创业环保	2,254,038.71	2.89
131	600217	秦岭水泥	2,248,006.59	2.88
132	000561	烽火电子	2,226,742.47	2.85

133	000886	海南高速	2,187,755.92	2.80
134	600547	山东黄金	2,178,702.96	2.79
135	002482	广田股份	2,161,300.00	2.77
136	600008	首创股份	2,118,405.80	2.71
137	300072	三聚环保	2,113,666.82	2.71
138	002019	鑫富药业	2,093,275.00	2.68
139	300229	拓尔思	2,082,564.55	2.67
140	002499	科林环保	2,075,397.20	2.66
141	000061	农产品	2,056,096.41	2.63
142	600717	天津港	2,019,012.58	2.59
143	002230	科大讯飞	2,002,441.00	2.57
144	000333	美的集团	1,996,778.16	2.56
145	000069	华侨城A	1,920,000.00	2.46
146	600827	友谊股份	1,888,030.00	2.42
147	000651	格力电器	1,887,965.45	2.42
148	002524	光正集团	1,858,681.38	2.38
149	002415	海康威视	1,853,496.00	2.37
150	000527	美的电器	1,831,800.00	2.35
151	000573	粤宏远A	1,806,764.00	2.31
152	600118	中国卫星	1,804,901.16	2.31
153	000603	盛达矿业	1,799,209.80	2.30
154	600526	菲达环保	1,798,912.34	2.30
155	600323	瀚蓝环境	1,792,800.00	2.30
156	600636	三爱富	1,784,567.11	2.29
157	300288	朗玛信息	1,759,389.00	2.25
158	002438	江苏神通	1,751,210.00	2.24
159	300090	盛运股份	1,750,900.00	2.24
160	600339	天利高新	1,700,648.50	2.18
161	000793	华闻传媒	1,653,374.00	2.12
162	300133	华策影视	1,643,161.55	2.11
163	600340	华夏幸福	1,628,139.08	2.09
164	002436	兴森科技	1,612,391.90	2.07
165	002528	英飞拓	1,606,105.06	2.06
166	601866	中海集运	1,596,000.00	2.04
167	600528	中铁二局	1,582,052.62	2.03
168	300079	数码视讯	1,577,571.00	2.02

169	000045	深纺织 A	1,568,205.07	2.01
-----	--------	-------	--------------	------

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	000001	平安银行	14,907,935.68	19.10
2	300027	华谊兄弟	12,770,254.77	16.36
3	600048	保利地产	12,344,383.07	15.81
4	002529	海源机械	12,281,878.37	15.73
5	000002	万科 A	10,937,464.25	14.01
6	000562	宏源证券	10,791,518.44	13.82
7	601118	海南橡胶	10,774,545.33	13.80
8	600515	海岛建设	9,982,906.34	12.79
9	600018	上港集团	9,508,975.00	12.18
10	000970	中科三环	9,270,415.44	11.88
11	002259	升达林业	9,120,082.00	11.68
12	300315	掌趣科技	9,110,506.55	11.67
13	300297	蓝盾股份	8,697,942.19	11.14
14	002266	浙富控股	8,368,200.02	10.72
15	600111	包钢稀土	7,145,524.35	9.15
16	600428	中远航运	7,012,269.68	8.98
17	600990	四创电子	6,749,819.00	8.65
18	002338	奥普光电	6,625,892.40	8.49
19	600837	海通证券	6,504,982.85	8.33
20	600016	民生银行	6,439,700.00	8.25
21	002646	青青稞酒	6,398,987.55	8.20
22	600420	现代制药	6,263,647.02	8.02
23	600292	中电远达	6,223,594.28	7.97
24	600289	亿阳信通	6,133,727.03	7.86
25	600765	中航重机	5,862,252.98	7.51
26	600549	厦门钨业	5,564,477.89	7.13
27	002618	丹邦科技	5,528,269.13	7.08
28	000996	中国中期	5,349,337.73	6.85
29	002700	新疆浩源	5,326,444.91	6.82
30	600636	三爱富	5,238,180.41	6.71

31	600206	有研硅股	5,188,617.93	6.65
32	000050	深天马 A	5,051,272.36	6.47
33	600643	爱建股份	5,045,226.12	6.46
34	600688	上海石化	5,029,279.00	6.44
35	601186	中国铁建	4,988,000.00	6.39
36	000156	华数传媒	4,853,219.01	6.22
37	001696	宗申动力	4,800,858.56	6.15
38	601166	兴业银行	4,793,379.34	6.14
39	600851	海欣股份	4,637,516.49	5.94
40	600383	金地集团	4,449,132.44	5.70
41	600550	天威保变	4,440,552.14	5.69
42	600559	老白干酒	4,395,604.39	5.63
43	000024	招商地产	4,351,345.21	5.57
44	002317	众生药业	4,286,116.84	5.49
45	002433	太安堂	4,281,661.66	5.49
46	603002	宏昌电子	4,259,509.54	5.46
47	600284	浦东建设	4,243,247.61	5.44
48	002603	以岭药业	4,176,053.65	5.35
49	002414	高德红外	4,152,054.18	5.32
50	600495	晋西车轴	4,035,879.10	5.17
51	000800	一汽轿车	3,985,283.90	5.11
52	300068	南都电源	3,983,018.73	5.10
53	300223	北京君正	3,898,933.50	4.99
54	300017	网宿科技	3,859,617.24	4.94
55	601928	凤凰传媒	3,839,182.46	4.92
56	300090	盛运股份	3,826,675.06	4.90
57	300014	亿纬锂能	3,825,107.58	4.90
58	300018	中元华电	3,802,891.53	4.87
59	600658	电子城	3,795,370.58	4.86
60	600163	福建南纸	3,778,695.20	4.84
61	600267	海正药业	3,744,566.00	4.80
62	300252	金信诺	3,740,241.53	4.79
63	002291	星期六	3,730,329.34	4.78
64	002055	得润电子	3,720,650.35	4.77
65	600149	廊坊发展	3,716,917.90	4.76
66	600832	东方明珠	3,638,980.00	4.66
67	600639	浦东金桥	3,612,452.90	4.63
68	601607	上海医药	3,600,400.00	4.61

69	300127	银河磁体	3,599,547.26	4.61
70	002400	省广股份	3,586,890.67	4.60
71	600158	中体产业	3,559,950.30	4.56
72	600523	贵航股份	3,548,701.00	4.55
73	300052	中青宝	3,513,625.01	4.50
74	000735	罗牛山	3,463,700.00	4.44
75	600702	沱牌舍得	3,456,065.10	4.43
76	601601	中国太保	3,452,767.16	4.42
77	600562	国睿科技	3,431,627.15	4.40
78	002526	山东矿机	3,424,765.97	4.39
79	603000	人民网	3,396,469.11	4.35
80	300034	钢研高纳	3,375,877.36	4.32
81	300115	长盈精密	3,372,828.76	4.32
82	600705	中航投资	3,370,997.00	4.32
83	000920	南方汇通	3,368,237.90	4.32
84	300088	长信科技	3,269,404.19	4.19
85	000831	五矿稀土	3,253,499.53	4.17
86	600161	天坛生物	3,239,634.31	4.15
87	002273	水晶光电	3,214,198.14	4.12
88	300062	中能电气	3,193,536.40	4.09
89	600725	云维股份	3,154,397.50	4.04
90	000551	创元科技	3,116,357.00	3.99
91	300045	华力创通	3,011,871.07	3.86
92	600816	安信信托	2,988,873.01	3.83
93	000988	华工科技	2,972,745.00	3.81
94	000063	中兴通讯	2,951,530.98	3.78
95	600748	上实发展	2,886,448.50	3.70
96	002037	久联发展	2,875,723.53	3.68
97	600387	海越股份	2,848,131.80	3.65
98	600860	北人股份	2,839,209.16	3.64
99	600871	仪征化纤	2,838,641.49	3.64
100	300072	三聚环保	2,835,230.45	3.63
101	300012	华测检测	2,789,314.08	3.57
102	300104	乐视网	2,784,061.56	3.57
103	600323	瀚蓝环境	2,697,600.00	3.46
104	300044	赛为智能	2,677,117.09	3.43
105	000581	威孚高科	2,645,236.76	3.39
106	600101	明星电力	2,644,635.00	3.39

107	002151	北斗星通	2,631,531.00	3.37
108	300055	万邦达	2,614,901.00	3.35
109	002230	科大讯飞	2,593,628.54	3.32
110	600895	张江高科	2,557,447.00	3.28
111	600108	亚盛集团	2,551,010.00	3.27
112	300096	易联众	2,550,160.98	3.27
113	600547	山东黄金	2,538,358.01	3.25
114	600036	招商银行	2,531,977.00	3.24
115	600416	湘电股份	2,528,874.31	3.24
116	300148	天舟文化	2,495,263.96	3.20
117	000561	烽火电子	2,445,537.99	3.13
118	002501	利源精制	2,419,478.92	3.10
119	600699	均胜电子	2,353,907.00	3.02
120	600199	金种子酒	2,342,123.50	3.00
121	600874	创业环保	2,339,839.70	3.00
122	600272	开开实业	2,318,863.01	2.97
123	600395	盘江股份	2,308,236.00	2.96
124	600893	航空动力	2,279,908.81	2.92
125	600792	云煤能源	2,261,190.00	2.90
126	600217	秦岭水泥	2,199,379.83	2.82
127	002499	科林环保	2,196,812.45	2.81
128	300197	铁汉生态	2,164,307.75	2.77
129	002415	海康威视	2,138,868.19	2.74
130	300083	劲胜股份	2,122,944.29	2.72
131	000886	海南高速	2,095,538.27	2.68
132	600021	上海电力	2,062,000.00	2.64
133	600008	首创股份	2,025,534.00	2.59
134	600526	菲达环保	2,022,378.00	2.59
135	300133	华策影视	2,015,666.35	2.58
136	300229	拓尔思	2,005,396.55	2.57
137	000793	华闻传媒	1,996,355.74	2.56
138	000333	美的集团	1,966,034.22	2.52
139	002482	广田股份	1,945,347.45	2.49
140	300288	朗玛信息	1,929,261.60	2.47
141	600429	三元股份	1,920,059.50	2.46
142	000069	华侨城A	1,913,004.50	2.45
143	600388	龙净环保	1,899,926.15	2.43
144	600787	中储股份	1,852,990.00	2.37

145	600751	天津海运	1,843,006.79	2.36
146	300019	硅宝科技	1,827,359.08	2.34
147	600118	中国卫星	1,809,814.00	2.32
148	000651	格力电器	1,808,608.00	2.32
149	002379	鲁丰股份	1,791,410.22	2.29
150	002371	七星电子	1,782,349.97	2.28
151	002048	宁波华翔	1,762,532.36	2.26
152	000603	盛达矿业	1,755,881.54	2.25
153	600339	天利高新	1,754,315.62	2.25
154	002524	光正集团	1,747,963.60	2.24
155	000977	浪潮信息	1,734,996.00	2.22
156	000573	粤宏远 A	1,729,928.00	2.22
157	002438	江苏神通	1,684,804.11	2.16
158	300079	数码视讯	1,666,352.59	2.13
159	000045	深纺织 A	1,658,643.76	2.12
160	002298	鑫龙电器	1,649,469.58	2.11
161	600528	中铁二局	1,617,056.99	2.07
162	600818	中路股份	1,611,867.40	2.06
163	600784	鲁银投资	1,587,000.00	2.03
164	300137	先河环保	1,585,123.46	2.03
165	600340	华夏幸福	1,575,980.38	2.02

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	779,306,552.30
卖出股票收入（成交）总额	729,202,157.93

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

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

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	102,792.25
2	应收证券清算款	395,430.45
3	应收股利	—
4	应收利息	2,266.12
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	500,488.82

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

报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

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	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	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
375	323,633.29	108,773,730.57	89.63%	12,588,753.63	10.37%

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	14,740.03	0.0121%

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 10 月 26 日）基金份额总额	262,332,100.87
本报告期期初基金份额总额	73,273,592.89
本报告期基金总申购份额	74,963,649.14
减：本报告期基金总赎回份额	26,874,757.83
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	121,362,484.20

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》。本公司上述人事变动已按相关规定向监管机构进行备案。

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 10 月 26 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	
国信证券		1305,855,540.21	20.33%	278,451.07	21.19%	-

华泰证券	1	296,848,416.10	19.73%	262,681.37	19.99%	—
中信建投	2	276,313,082.44	18.37%	251,554.89	19.14%	—
广发证券	2	173,679,836.75	11.55%	118,953.79	9.05%	—
招商证券	1	164,825,077.32	10.96%	145,853.70	11.10%	—
光大证券	1	78,283,060.19	5.20%	71,269.14	5.42%	—
国泰君安	1	67,202,683.87	4.47%	59,467.79	4.53%	—
浙商证券	1	59,999,132.79	3.99%	53,422.80	4.07%	—
华宝证券	1	59,602,655.51	3.96%	52,742.70	4.01%	—
海通证券	2	21,750,343.73	1.45%	19,801.38	1.51%	—
国联证券	1	—	—	—	—	—
中银国际	2	—	—	—	—	—
第一创业	1	—	—	—	—	—
东方证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	1	—	—	—	—	—
华泰联合证 券	1	—	—	—	—	—
中航证券	1	—	—	—	—	—
财富证券	1	—	—	—	—	—
西南证券	1	—	—	—	—	—
南京证券	1	—	—	—	—	—
中信证券	2	—	—	—	—	—
安信证券	1	—	—	—	—	—
中国建银投 资证券	2	—	—	—	—	—
万联证券	1	—	—	—	—	—
申银万国	1	—	—	—	—	—
方正证券	1	—	—	—	—	—
国金证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	1	—	—	—	—	—
中金公司	1	—	—	—	—	—
上海证券	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基金、泰信蓝筹精选基金、泰信增强收益基金、泰信中证 200 指数基金共用交易单元。

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
国信证券	-	-	663,400,000.00	40.75%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	406,000,000.00	24.94%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	306,500,000.00	18.83%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	164,000,000.00	10.07%	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	88,000,000.00	5.41%	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中国建银投资证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-

泰信基金管理有限公司
2014 年 3 月 27 日