泰信现代服务业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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 3 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。

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 2 月 7 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰信现代服务业股票
基金主代码	290014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 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	50,655,945.00 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	充分把握中国经济可持续发展过程中现代服务业呈现出的投资机会，通过行业配置和精选个股，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中现代服务业的崛起所孕育的投资机遇。在严格控制投资风险的条件下，力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。
投资策略	本基金看好在我国加快转变经济发展方式的过程中现代服务业的发展前景，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，注重股票资产在其各相关行业的配置，并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波动的风险。
业绩比较基准	75%×沪深 300 指数+25%×中证全债指数
风险收益特征	本基金作为股票型基金，主要通过发掘在我国加快转变经济发展方式的过程中，推动现代服务业大发展带来的投资机会，实现基金资产增值，其风险和预期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

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 2 月 7 日(基金合同生效日)-2013 年 12 月 31 日
本期已实现收益	18,485,437.79
本期利润	19,618,570.62
加权平均基金份额本期利润	0.1557
本期基金份额净值增长率	3.10%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0212
期末基金资产净值	51,730,546.23
期末基金份额净值	1.021

注：1、上述指标的计算时间的起始日为 2013 年 2 月 7 日（基金合同生效日），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

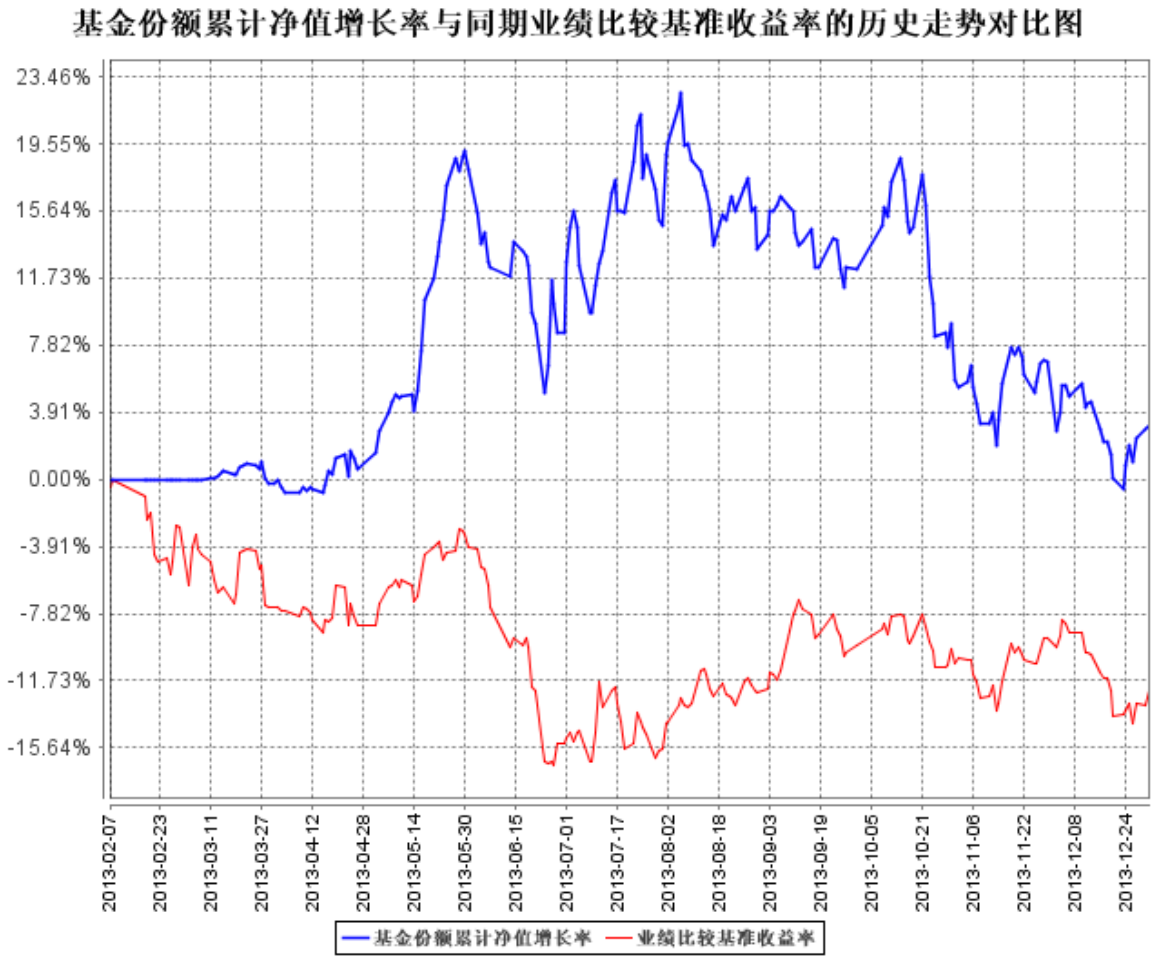
过去三个月	-8.19%	1.35%	-2.97%	0.85%	-5.22%	0.50%
过去六个月	-4.98%	1.38%	3.68%	0.97%	-8.66%	0.41%
自基金合同生效起至今	3.10%	1.25%	-12.33%	1.05%	15.43%	0.20%

注：本基金业绩比较基准为：75%×沪深 300 指数+25%×中证全债指数

1、沪深 300 指数，编制合理和透明，运用广泛，对中国 A 股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

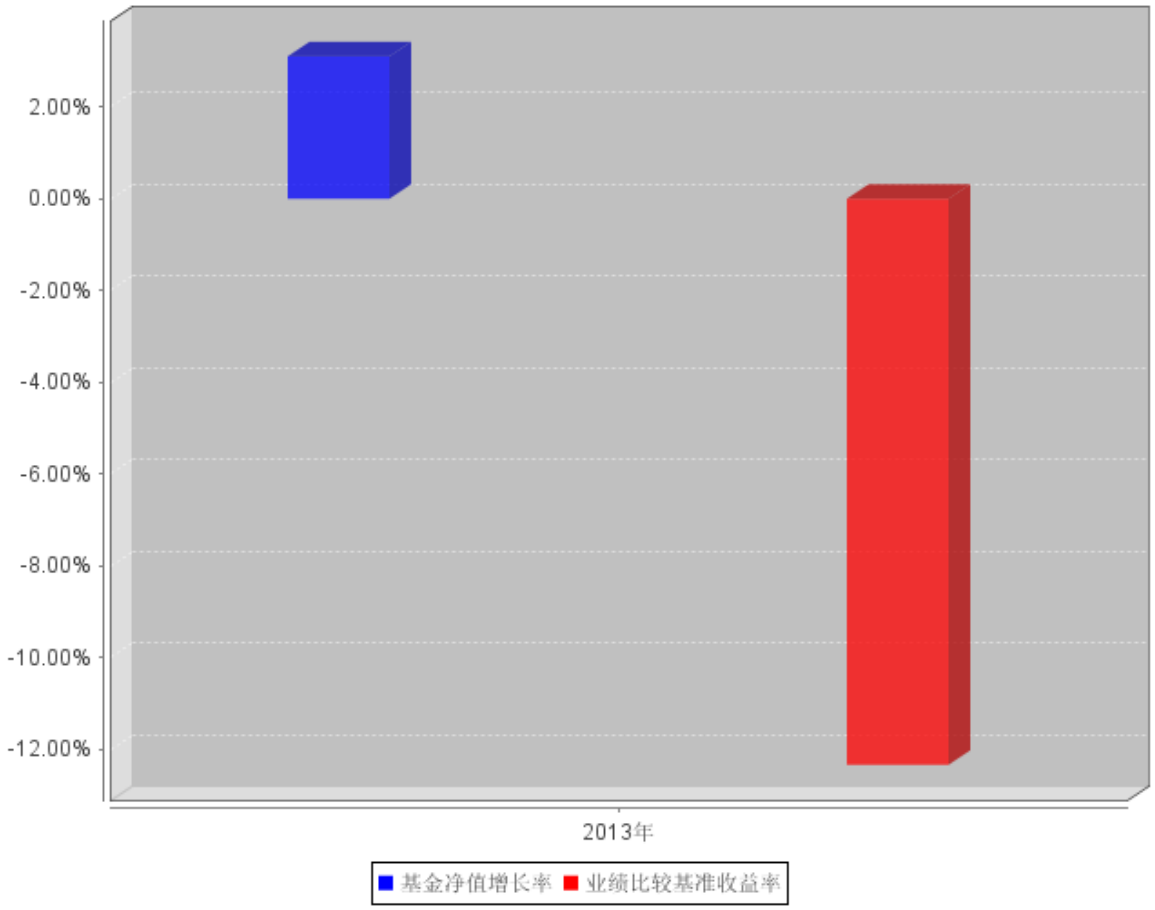


注：1、本基金合同于 2013 年 2 月 7 日正式生效，截至报告期末不满一年。

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。本基金将基金资产的 60%-95%投资于股票，固定收益类证券投资比例为基金资产的 0%-35%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%。本基金投资于现代服务业相关上市公司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 2013 年 2 月 7 日正式生效，本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	0.100	370,117.25	129,285.90	499,403.15	
合计	0.100	370,117.25	129,285.90	499,403.15	

注：本基金合同于 2013 年 2 月 7 日正式生效。

§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		
戴宇虹女士	本基金经理兼泰信优质生活股票基金经理	2013 年 2 月 7 日	-	7	金融学硕士。具有基金从业资格。曾先后任职于国药控股有限公司、群益证券股份有限公司。2008 年 10 月加入泰信基金

					管理有限公司，先后担任研究部高级研究、泰信发展主题股票基金经理助理。自 2012 年 3 月 1 日起担任泰信优质生活股票基金经理。

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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《泰信现代服务业股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金的投资运作符合有关法规和基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

1、建立统一的研究平台，所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放。

2、建立全公司投资对象备选库和各投资组合的投资对象备选库。

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

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

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

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

例分配和轮侯方式处理。

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

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

回顾 2013 年，宏观经济运行较为平稳，资金面成为影响市场的重要因素，在经济转型预期的背景下，A 股市场走势呈现出明显的结构化特征，从主要市场指数来看，上证综指、深成指和沪深 300 指数分别下跌 6.76%、10.91%和 7.65%；而中小板和创业板指数大幅上涨 17.54%和 82.73%，以沪深 300 为代表的蓝筹股和创业板为代表的成长股演绎出冰火两重天的走势，TMT、医药等代表

经济转型方向的新兴行业表现出色，而传统周期性行业煤炭、有色、钢铁等不断下跌。本基金 2013 年 2 月初成立，3 月中旬开始建仓，成立初期以获取绝对收益的思路指导投资，择机逐步建仓，精选个股，总体上保持较低的仓位，选择的个股主要集中在医药、环保、TMT 等核心行业，上半年现代服务业投资操作较为成功。但进入下半年尤其是 8 月以后，由于对市场风格的转换判断失误，过早的看空了创业板为代表的成长股，转而增加了低估值的蓝筹股如金融、地产、汽车等行业的配置，给基金净值造成较大的损失，同时由于基金持续赎回规模缩水，持仓个股集中度大幅提升，在市场宽幅震荡中净值波动较大，投资操作较为被动，给投资业绩造成了不利的影响。2013 年值得总结的是我们对部分热点板块和行业以及对个股的研究需要更加的深入和细致。

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 1.021 元，净值增长率为 3.10%，业绩比较基准增长率为-12.33%。

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 2014 年，我们判断 2014 年将是改革和转型最为关键的一年，在政策维稳的背景下，宏观经济将比较平稳，资金面整体维持紧平衡的状态，市场将呈现震荡走势，结构性行情的演绎在 2014 年仍将延续。我们将重点投资在经济转型中受益的行业，包括医药生物、环保、TMT 等现代服务业的核心行业，重点关注改革带来的相关投资机会。我们将偏重于自下而上的投资策略，寻找真正的成长性行业和成长股。我们积极关注信用风险释放的风险以及 QE 退出资金外流的影响。

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工作流程，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，本基金的投资运作等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、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 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

二、本报告期,本基金每 10 份分配 0.100 元,利润分配合计 499,403.15 元(其中,现金形式发放 370,117.25 元,再投资形式发放 129,285.90 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，本基金托管人在对泰信现代服务业股票型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，泰信现代服务业股票型证券投资基金的管理人——泰信基金管理有限公司在泰信现代服务业股票型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。本报告期内，泰信现代服务业股票型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 499,403.15 元。

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

本托管人依法对泰信基金管理有限公司编制和披露的泰信现代服务业股票型证券投资基金 2013 年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 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 20730 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	泰信现代服务业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现代服务业股票型证券投资基金(以下简称“泰信现代服务业基金”)的财务报表，包括 2013 年 12 月 31 日的资产负债表、2013 年 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日止期间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现代服务业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，上述泰信现代服务业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，公允反映了泰信现代服务业基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日止期间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：泰信现代服务业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
资 产：	
银行存款	2,875,815.35
结算备付金	256,333.90
存出保证金	92,131.98
交易性金融资产	39,317,329.90
其中：股票投资	39,317,329.90
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	10,009,583.34
应收利息	1,949.93
应收股利	-
应收申购款	116,554.16
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	52,669,698.56
负债和所有者权益	**本期末 2013 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	121,225.11
应付赎回款	151,160.25
应付管理人报酬	65,134.62
应付托管费	10,855.77
应付销售服务费	-
应付交易费用	125,706.88

应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	465,069.70
负债合计	939,152.33
所有者权益：	
实收基金	50,655,945.00
未分配利润	1,074,601.23
所有者权益合计	51,730,546.23
负债和所有者权益总计	52,669,698.56

注：1. 报告截止日 2013 年 12 月 31 日，泰信现代服务业股票型证券投资基金的基金份额总额为 50,655,945.00 份，基金份额净值为 1.021 元。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2013 年 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：泰信现代服务业股票型证券投资基金

本报告期： 2013 年 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2013 年 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
一、收入	23,304,893.85
1.利息收入	1,585,737.03
其中：存款利息收入	310,249.17
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	1,275,487.86
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	20,044,393.27
其中：股票投资收益	19,738,809.99
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	305,583.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,133,132.83
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	541,630.72

减：二、费用	3,686,323.23
1．管理人报酬	1,827,470.67
2．托管费	304,578.38
3．销售服务费	-
4．交易费用	1,079,436.68
5．利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6．其他费用	474,837.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	19,618,570.62
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	19,618,570.62

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信现代服务业股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 2 月 7 日(基金合同生效日)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）	358,406,733.77	-	358,406,733.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	19,618,570.62	19,618,570.62
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）	-307,750,788.77	-18,044,566.24	-325,795,355.01
其中：1.基金申购款	94,901,288.98	12,604,980.11	107,506,269.09
2.基金赎回款	-402,652,077.75	-30,649,546.35	-433,301,624.10
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）	-	-499,403.15	-499,403.15
五、期末所有者权益（基金净值）	50,655,945.00	1,074,601.23	51,730,546.23

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

泰信现代服务业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 2012]第 938 号《关于核准泰信现代服务业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《泰信现代服务业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 358,345,806.61 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(2013)第 070 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰信现代服务业股票型证券投资基金基金合同》于 2013 年 2 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 358,406,733.77 份，其中认购资金利息折合 60,927.16 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信现代服务业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，包括国内依法发行上市的各类股票、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。基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的 60%-95%，固定收益类证券投资占基金资产的 0-35%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，权证投资比例为基金资产净值的 0-3%。投资于现代服务业相关上市公司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：75%×沪深 300 指数+25%×中证全债指数。

本财务报表由本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司于 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》、《泰信现代服务业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 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日止期间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 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日止期间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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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

本报告期末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

本报告期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

本报告期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 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,827,470.67
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 1.5%的年费率计

提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.5% / 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 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	304,578.38

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 0.25%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×0.25% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

本报告期末及上年度末本基金未发生销售服务费。

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

本期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2013 年 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	2,875,815.35	230,034.93

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。

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

本基金本报告期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

本期末本基金未持有因认购新发持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

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

(b)

(c)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的金融工具中属于第一层级的余额为 39,317,329.90 元，无属于第二层级、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	39,317,329.90	74.65
	其中：股票	39,317,329.90	74.65
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	3,132,149.25	5.95
7	其他各项资产	10,220,219.41	19.40
8	合计	52,669,698.56	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	27,729,929.90	53.60

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,972,500.00	3.81
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,848,500.00	3.57
J	金融业	3,777,000.00	7.30
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,989,400.00	7.71
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	39,317,329.90	76.00

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	600196	复星医药	129,950	2,545,720.50	4.92
2	000826	桑德环境	70,000	2,436,000.00	4.71
3	300090	盛运股份	62,600	2,171,594.00	4.20
4	002019	鑫富药业	100,000	2,090,000.00	4.04
5	000783	长江证券	200,000	2,080,000.00	4.02
6	600388	龙净环保	60,500	2,027,960.00	3.92
7	300142	沃森生物	49,940	1,947,160.60	3.76
8	600637	百视通	50,000	1,848,500.00	3.57
9	002690	美亚光电	45,000	1,804,050.00	3.49

10	600597	光明乳业	80,000	1,776,000.00	3.43

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000423	东阿阿胶	14,188,825.72	27.43
2	600703	三安光电	13,993,572.74	27.05
3	000002	万　科A	12,941,387.48	25.02
4	002005	德豪润达	11,795,172.30	22.80
5	600048	保利地产	10,777,817.76	20.83
6	601117	中国化学	10,698,573.29	20.68
7	002653	海思科	10,499,265.02	20.30
8	002482	广田股份	10,469,570.53	20.24
9	300074	华平股份	9,750,221.97	18.85
10	002375	亚厦股份	9,674,635.57	18.70
11	600383	金地集团	9,660,822.92	18.68
12	300090	盛运股份	9,240,841.40	17.86
13	002055	得润电子	8,449,892.30	16.33
14	600728	佳都科技	8,432,581.07	16.30
15	600418	江淮汽车	7,562,645.44	14.62
16	600872	中炬高新	6,876,157.59	13.29
17	600016	民生银行	6,572,000.00	12.70
18	600416	湘电股份	6,329,903.01	12.24
19	601166	兴业银行	6,147,069.80	11.88
20	000407	胜利股份	5,988,802.00	11.58
21	600481	双良节能	5,256,197.05	10.16
22	300337	银邦股份	4,915,980.00	9.50
23	002550	千红制药	4,468,916.21	8.64
24	300136	信维通信	4,357,238.75	8.42
25	300273	和佳股份	4,172,192.60	8.07
26	300287	飞利信	4,029,962.33	7.79
27	300259	新天科技	3,948,888.18	7.63

28	300125	易世达	3,895,273.12	7.53
29	600108	亚盛集团	3,839,954.98	7.42
30	000581	威孚高科	3,712,964.00	7.18
31	300115	长盈精密	3,698,380.25	7.15
32	300168	万达信息	3,659,942.36	7.08
33	000816	江淮动力	3,419,332.56	6.61
34	300227	光韵达	3,412,936.40	6.60
35	300088	长信科技	3,378,064.00	6.53
36	600079	人福医药	3,334,090.38	6.45
37	002325	洪涛股份	3,270,432.58	6.32
38	600519	贵州茅台	3,162,503.90	6.11
39	002339	积成电子	2,896,923.81	5.60
40	601139	深圳燃气	2,824,625.63	5.46
41	600887	伊利股份	2,599,066.58	5.02
42	000826	桑德环境	2,569,240.00	4.97
43	600580	卧龙电气	2,563,039.06	4.95
44	300331	苏大维格	2,496,230.72	4.83
45	002252	上海莱士	2,452,990.00	4.74
46	600030	中信证券	2,391,279.00	4.62
47	600196	复星医药	2,373,857.00	4.59
48	600837	海通证券	2,333,714.00	4.51
49	000848	承德露露	2,329,378.50	4.50
50	000830	鲁西化工	2,313,151.00	4.47
51	002646	青青稞酒	2,297,242.00	4.44
52	600111	包钢稀土	2,285,358.54	4.42
53	600000	浦发银行	2,262,000.00	4.37
54	002648	卫星石化	2,187,767.00	4.23
55	000001	平安银行	2,153,784.20	4.16
56	000831	五矿稀土	2,093,009.06	4.05
57	300004	南风股份	2,091,342.00	4.04
58	600388	龙净环保	2,071,495.92	4.00
59	600597	光明乳业	2,047,727.61	3.96
60	300037	新宙邦	2,018,169.63	3.90
61	000783	长江证券	1,985,152.00	3.84
62	600637	百视通	1,873,530.00	3.62
63	600332	白云山	1,859,873.48	3.60

64	300142	沃森生物	1,825,882.68	3.53
65	300183	东软载波	1,789,688.38	3.46
66	600109	国金证券	1,776,281.52	3.43
67	002049	同方国芯	1,757,962.20	3.40
68	002019	鑫富药业	1,739,609.03	3.36
69	002138	顺络电子	1,705,233.96	3.30
70	601238	广汽集团	1,693,732.00	3.27
71	002690	美亚光电	1,686,450.00	3.26
72	600104	上汽集团	1,675,274.00	3.24
73	002317	众生药业	1,671,110.79	3.23
74	300246	宝莱特	1,666,666.00	3.22
75	000028	国药一致	1,646,638.00	3.18
76	600475	华光股份	1,612,819.00	3.12
77	600292	中电远达	1,600,627.36	3.09
78	600859	王府井	1,584,079.00	3.06
79	600323	瀚蓝环境	1,556,698.00	3.01
80	600073	上海梅林	1,547,066.24	2.99
81	601607	上海医药	1,526,199.99	2.95
82	002126	银轮股份	1,506,353.00	2.91
83	600761	安徽合力	1,434,479.00	2.77
84	300310	宜通世纪	1,434,100.00	2.77
85	300199	翰宇药业	1,370,337.00	2.65
86	600795	国电电力	1,306,000.00	2.52
87	300070	碧水源	1,268,915.50	2.45
88	002700	新疆浩源	1,215,272.67	2.35
89	002638	勤上光电	1,175,241.20	2.27
90	600329	中新药业	1,094,000.00	2.11
91	002470	金正大	1,073,665.72	2.08

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600703	三安光电	16,810,397.29	32.50

2	002653	海思科	15,779,449.51	30.50
3	000002	万　科A	13,403,346.55	25.91
4	000423	东阿阿胶	12,507,186.40	24.18
5	002482	广田股份	12,494,769.18	24.15
6	300090	盛运股份	12,416,313.29	24.00
7	002375	亚厦股份	11,982,130.91	23.16
8	300074	华平股份	11,899,149.55	23.00
9	601117	中国化学	11,543,548.12	22.31
10	002055	得润电子	11,410,119.18	22.06
11	002005	德豪润达	10,765,684.11	20.81
12	600048	保利地产	10,542,789.63	20.38
13	600728	佳都科技	10,101,979.44	19.53
14	600383	金地集团	9,584,583.23	18.53
15	600418	江淮汽车	8,990,012.85	17.38
16	600872	中炬高新	7,651,184.00	14.79
17	300287	飞利信	5,505,155.21	10.64
18	600016	民生银行	5,484,000.00	10.60
19	600416	湘电股份	5,438,140.01	10.51
20	600481	双良节能	5,413,913.24	10.47
21	601166	兴业银行	5,134,805.30	9.93
22	000407	胜利股份	5,050,055.99	9.76
23	300273	和佳股份	5,027,037.27	9.72
24	300337	银邦股份	4,917,705.90	9.51
25	300168	万达信息	4,681,398.65	9.05
26	300136	信维通信	4,499,833.63	8.70
27	300115	长盈精密	4,344,107.54	8.40
28	000581	威孚高科	4,163,082.50	8.05
29	002550	千红制药	4,034,109.89	7.80
30	300125	易世达	3,652,328.90	7.06
31	600108	亚盛集团	3,651,657.00	7.06
32	000816	江淮动力	3,514,926.38	6.79
33	300259	新天科技	3,204,385.95	6.19
34	300227	光韵达	3,125,795.36	6.04
35	002325	洪涛股份	3,051,880.37	5.90
36	600079	人福医药	3,015,685.47	5.83
37	601139	深圳燃气	2,968,405.80	5.74
38	300088	长信科技	2,910,352.61	5.63
39	002339	积成电子	2,709,667.49	5.24

40	600519	贵州茅台	2,707,150.00	5.23
41	600580	卧龙电气	2,667,617.20	5.16
42	002648	卫星石化	2,633,400.00	5.09
43	002252	上海莱士	2,438,720.80	4.71
44	600111	包钢稀土	2,427,090.02	4.69
45	600030	中信证券	2,385,600.00	4.61
46	600887	伊利股份	2,325,018.09	4.49
47	600323	瀚蓝环境	2,260,264.70	4.37
48	600837	海通证券	2,189,400.00	4.23
49	000831	五矿稀土	2,156,374.14	4.17
50	002646	青青稞酒	2,083,175.00	4.03
51	000830	鲁西化工	2,071,600.00	4.00
52	600000	浦发银行	2,033,000.00	3.93
53	300004	南风股份	2,005,267.00	3.88
54	000848	承德露露	1,987,116.84	3.84
55	300331	苏大维格	1,963,005.78	3.79
56	000028	国药一致	1,929,863.17	3.73
57	300037	新宙邦	1,892,094.18	3.66
58	000001	平安银行	1,880,000.00	3.63
59	600332	白云山	1,783,879.14	3.45
60	300183	东软载波	1,755,245.60	3.39
61	002049	同方国芯	1,728,157.39	3.34
62	002317	众生药业	1,666,498.82	3.22
63	002138	顺络电子	1,568,643.60	3.03
64	300199	翰宇药业	1,494,044.84	2.89
65	300246	宝莱特	1,470,800.00	2.84
66	600859	王府井	1,339,621.37	2.59
67	300310	宜通世纪	1,288,955.82	2.49
68	300070	碧水源	1,228,613.13	2.38
69	600795	国电电力	1,175,000.00	2.27
70	002700	新疆浩源	1,147,587.20	2.22
71	002638	勤上光电	1,129,655.58	2.18
72	600329	中新药业	1,041,951.67	2.01

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	369,291,086.51

卖出股票收入（成交）总额	350,845,699.43

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

本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

本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股票库之外的股票。

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	92,131.98
2	应收证券清算款	10,009,583.34
3	应收股利	-
4	应收利息	1,949.93
5	应收申购款	116,554.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,220,219.41

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本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

本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）	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
601	84,286.10	0.00	0.00%	50,655,945.00	100.00%

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	9,885.62	0.0195%

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 万份

2、本基金基金经理持有该基金份额总量的数量区间：0 万份

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2013 年 2 月 7 日 ）基金份额总额	358,406,733.77
本报告期期初基金份额总额	-
本报告期基金总申购份额	94,901,288.98
减:本报告期基金总赎回份额	402,652,077.75
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	50,655,945.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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（2013 年 2 月 7 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	
广发证券	2	271,817,727.60	37.75%	242,785.05	37.66%	-
民生证券	1	199,701,689.82	27.73%	181,807.71	28.20%	-
中国银河证券	1	130,129,278.33	18.07%	115,151.77	17.86%	-
华创证券	2	118,488,090.19	16.45%	104,850.27	16.27%	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	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混合基金、泰信发展主题基金、泰信中证锐联基本面 400 指数分级基金共用交易单元。

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

广发证券	-	-	8,210,000,000.00	83.35%	-	-
民生证券	-	-	1,009,900,000.00	10.25%	-	-
中国银河证券	-	-	150,000,000.00	1.52%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	480,000,000.00	4.87%	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

泰信基金管理有限公司
2014 年 3 月 27 日