

# 泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券 投资基金 2013 年年度报告

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 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>5</b>  |
| 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         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>          | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 9         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 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             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 15        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 15        |
| 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 | 15        |
| 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      | 16        |
| <b>§6 审计报告</b>                          | <b>16</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 16        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 16        |
| <b>§7 年度财务报表</b>                        | <b>17</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 17        |
| 7.2 利润表                                 | 18        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 19        |
| 7.4 报表附注                                | 21        |
| <b>§8 投资组合报告</b>                        | <b>43</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 43        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合                      | 43        |
| 8.3 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       | 44        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 55        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 57        |
| 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      | 57        |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 57        |
| 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   | 57        |

|                                          |           |
|------------------------------------------|-----------|
| 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 ..... | 57        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....          | 57        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 57        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                      | 57        |
| <b>§9 基金份额持有人信息.....</b>                 | <b>58</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 58        |
| 9.2 期末上市基金前十名持有人 .....                   | 59        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 59        |
| <b>§10 开放式基金份额变动.....</b>                | <b>60</b> |
| <b>§11 重大事件揭示.....</b>                   | <b>60</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 60        |
| 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 .....   | 60        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 61        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                     | 61        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 61        |
| 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 .....      | 61        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 61        |
| 11.8 其他重大事件 .....                        | 62        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                   | <b>64</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 64        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 65        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 65        |

## § 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           |                |                 |
| 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     | 31,702,039.71 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 | 5,166,968.00 份           | 5,166,968.00 份 | 21,368,103.71 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%×中证锐联基本面 400 指数收益率+5%×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<br>256 号 37 层              | 北京市西城区复兴门内大街 55<br>号 |
| 办公地址   | 上海市浦东新区浦东南路<br>256 号 华夏银行大厦<br>36-37 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55<br>号 |
| 邮政编码   | 200120                                 | 100140               |
| 法定代表人  | 孟凡利                                    | 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》                             |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.ftfund.com">http://www.ftfund.com</a> |
| 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                              |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                   | 办公地址                          |
|--------|----------------------|-------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼 |
| 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、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 9 月 7 日(基金合同生效日)-2012 年 12 月 31 日 |
|---------------|---------------|------------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 6,123,369.24  | 470,859.76                               |
| 本期利润          | 3,200,852.71  | 5,948,646.69                             |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0880        | 0.0493                                   |
| 本期加权平均净值利润率   | 7.94%         | 4.90%                                    |
| 本期基金份额净值增长率   | 3.97%         | 8.40%                                    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2013 年末       | 2012 年末                                  |
| 期末可供分配利润      | 4,346,115.80  | 302,559.68                               |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1371        | 0.0044                                   |
| 期末基金资产净值      | 35,727,318.18 | 74,522,704.48                            |
| 期末基金份额净值      | 1.127         | 1.084                                    |

| 3.1.3 累计期末指标 | 2013 年末 | 2012 年末 |
|--------------|---------|---------|
| 基金份额累计净值增长率  | 12.70%  | 8.40%   |

注：1、本基金合同于 2012 年 9 月 7 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

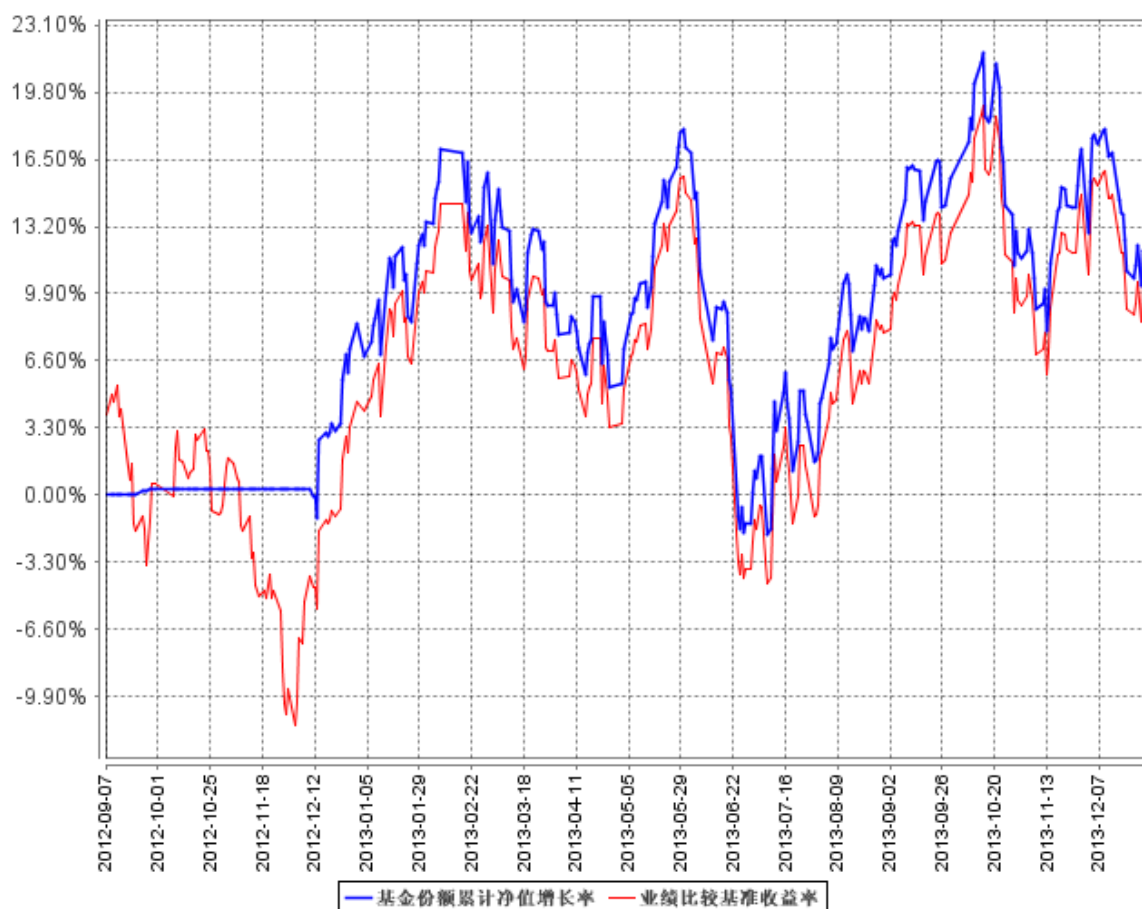
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | -2.51%   | 1.28%       | -1.76%     | 1.29%         | -0.75% | -0.01% |
| 过去六个月      | 14.30%   | 1.30%       | 15.08%     | 1.31%         | -0.78% | -0.01% |
| 过去一年       | 3.97%    | 1.35%       | 6.03%      | 1.35%         | -2.06% | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | 12.70%   | 1.20%       | 10.89%     | 1.37%         | 1.81%  | -0.17% |

注：本基金业绩比较基准为：95%×中证锐联基本面 400 指数收益率+5%×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，挑选基本面价值排列第 201 至第 600 家的上市公司作为样本，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



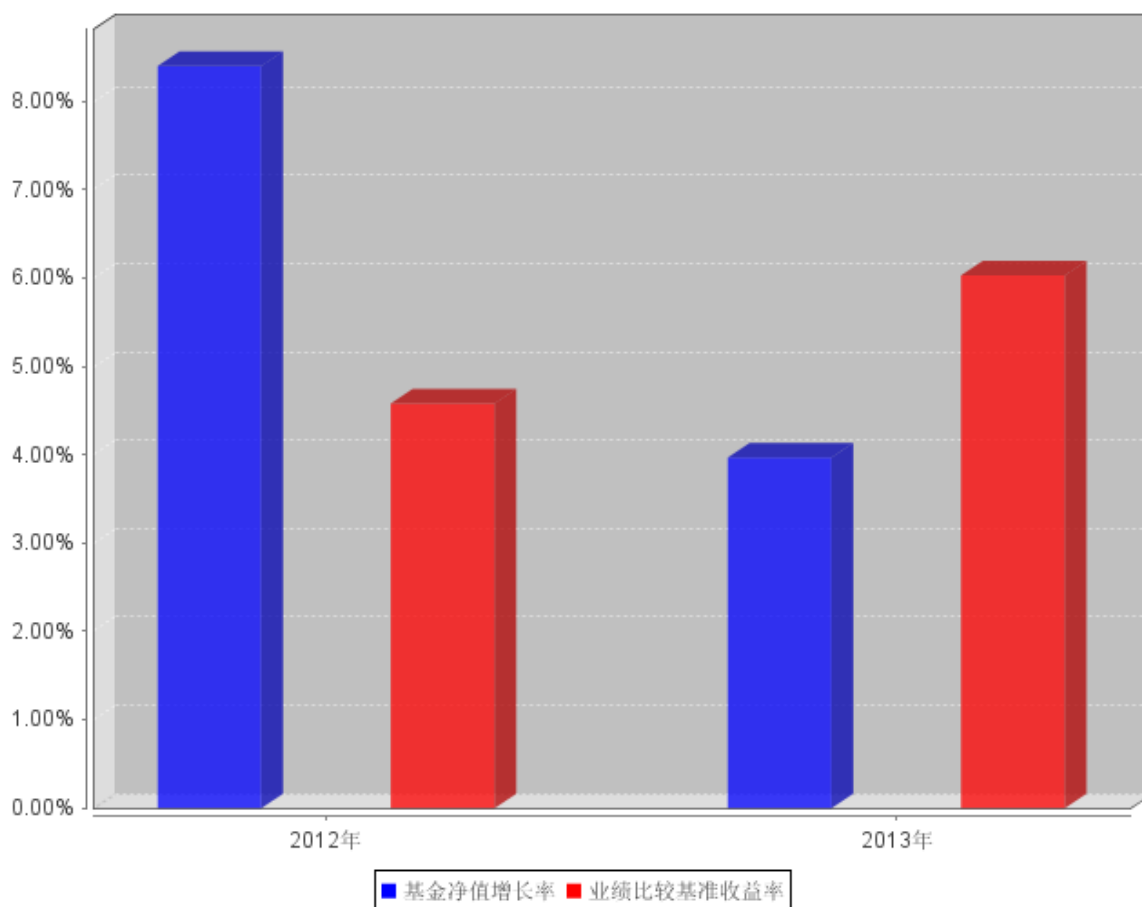
注：1、本基金基金合同于 2012 年 9 月 7 日正式生效。

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%。

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锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金经理职务, 陈大庆先生不再担任本基金基金经理职务, 具体详情请见 2013 年 7 月 5 日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级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

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：本基金基金合同于 2012 年 9 月 7 日正式生效，2012 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

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。

## § 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 |        |                                                                                                        |
| 冯张鹏先生 | 本基金基金经理兼泰信中证 200 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,泰信中证锐联基本面 400 指数分级基金经理助理职务。自 2013 年 7 月 5 日起同时担任泰信中证 200 指数基金经理。 |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------|

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锐联基本面 400 指数分级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》、《上海证券报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级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》、《泰信中证锐联基本面 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内日反向交易，严格控制不同投资组合之间的内日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的内日反向交易。

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内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内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内日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的内日反向交易。本报告期内，本基金参与的交易所公开竞价内日反向交易，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 年全年波动较为剧烈，创业板指数创出新高，各类主题投资也接连出现

并受到追捧。沪深 300 指数在 2013 年全年，下半年和四季度分别下跌 7.65%，上涨 5.88%，和下跌 3.28%。泰信基本面 400 基金同期表现依次为上涨 3.97%，上涨 14.30%和下跌 2.51%，比较基准同期表现依次为上涨 5.92%，上涨 15.07%和下跌 1.79%。

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，2013 全年年化跟踪误差控制在 1.092%。

#### **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 3.97%，业绩比较基准增长率为 6.03%。

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

2014 年中国宏观经济将依然负重前行，对诸如地方债务，房地产泡沫，金融风险，和产能过剩等问题的担忧仍未消退；经济增长方式的转型任重道远，经济内生动力仍然不足。但党的十八届三中全会已经开启未来十年的改革进程，将促进中国经济持续健康发展，通过观察 2013 年政府调控的策略和成效，2014 年中国经济回落不会失控，政府将会以保增长为主，经济硬着陆风险很小，经济增长速度将维持在 7.5%左右。股票市场在 2014 年面临的影响因素会更多更复杂，挑战和机遇并存，产能过剩问题，地方债务问题和企业盈利水平等因素将对国内 A 股市场带来一定的影响。

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，把握住投资的时机。

#### **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

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。

### 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中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金 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 20714 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      | 泰信中证锐联基本面 400 指数分级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锐联基本面 400 指数分级证券投资基金(以下简称“泰信基本面 400 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基本面 400 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:<br>(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;<br>(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。<br>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。<br>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，上述泰信基本面 400 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，公允反映了泰信基本面 400 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：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号     | 本期末<br>2013 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b> |         |                         |                          |
| 银行存款        | 7.4.7.1 | 2, 275, 804. 22         | 2, 859, 997. 93          |
| 结算备付金       |         | 190. 10                 | 7, 277, 272. 73          |
| 存出保证金       |         | 1, 566. 30              | 250, 000. 00             |
| 交易性金融资产     | 7.4.7.2 | 33, 910, 646. 53        | 62, 679, 700. 36         |
| 其中：股票投资     |         | 33, 910, 646. 53        | 62, 679, 700. 36         |
| 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      | 7.4.7.3 | -                       | -                        |
| 买入返售金融资产    | 7.4.7.4 | -                       | -                        |
| 应收证券清算款     |         | -                       | -                        |
| 应收利息        | 7.4.7.5 | 466. 37                 | 3, 581. 97               |
| 应收股利        |         | -                       | -                        |
| 应收申购款       |         | -                       | 2, 988, 047. 81          |

|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                          | -                           |
| 资产总计            |            | 36,188,673.52              | 76,058,600.80               |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2013年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2012年12月31日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                            |                             |
| 短期借款            |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债         |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                          | -                           |
| 应付证券清算款         |            | -                          | -                           |
| 应付赎回款           |            | 23,759.01                  | 1,092,471.36                |
| 应付管理人报酬         |            | 31,425.84                  | 61,077.36                   |
| 应付托管费           |            | 6,913.68                   | 13,436.99                   |
| 应付销售服务费         |            | -                          | -                           |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 5,829.91                   | 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            | 7.4.7.8    | 393,426.90                 | 308,380.52                  |
| 负债合计            |            | 461,355.34                 | 1,535,896.32                |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金            | 7.4.7.9    | 31,381,202.38              | 68,775,016.14               |
| 未分配利润           | 7.4.7.10   | 4,346,115.80               | 5,747,688.34                |
| 所有者权益合计         |            | 35,727,318.18              | 74,522,704.48               |
| 负债和所有者权益总计      |            | 36,188,673.52              | 76,058,600.80               |

注：1. 报告截止日 2013 年 12 月 31 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为 1.127 元，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 A 份额参考净值为 1.065 元，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 B 份额参考净值为 1.189 元；基金份额总额为 31,702,039.71 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为 21,368,103.71 份，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 A 份额为 5,166,968.00 份，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 B 份额为 5,166,968.00 份。

2. 比较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。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                        | 附注号        | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至<br>2013 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2012 年 9 月 7 日(基金合<br>同生效日)至 2012 年 12<br>月 31 日 |
|----------------------------|------------|-------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>                |            | 4,373,517.11                              | 6,855,406.09                                                |
| 1.利息收入                     |            | 24,483.17                                 | 794,630.70                                                  |
| 其中：存款利息收入                  | 7.4.7.11   | 24,483.17                                 | 91,366.94                                                   |
| 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                 |            | -                                         | 703,263.76                                                  |
| 其他利息收入                     |            | -                                         | -                                                           |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |            | 7,175,137.35                              | 286,346.30                                                  |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.12   | 6,697,273.14                              | 275,033.30                                                  |
| 基金投资收益                     |            | -                                         | -                                                           |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.13   | -                                         | -                                                           |
| 资产支持证券投资收益                 | 7.4.7.13.1 | -                                         | -                                                           |
| 贵金属投资收益                    |            |                                           |                                                             |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.14   | -                                         | -                                                           |
| 股利收益                       | 7.4.7.15   | 477,864.21                                | 11,313.00                                                   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 7.4.7.16   | -2,922,516.53                             | 5,477,786.93                                                |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |            | -                                         | -                                                           |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 7.4.7.17   | 96,413.12                                 | 296,642.16                                                  |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 1,172,664.40                              | 906,759.40                                                  |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 405,320.80                                | 379,328.16                                                  |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 89,170.60                                 | 83,452.18                                                   |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | -                                         | -                                                           |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.18   | 182,796.12                                | 74,325.02                                                   |
| 5. 利息支出                    |            | -                                         | -                                                           |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -                                         | -                                                           |
| 6. 其他费用                    | 7.4.7.19   | 495,376.88                                | 369,654.04                                                  |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 3,200,852.71                              | 5,948,646.69                                                |
| 减：所得税费用                    |            | -                                         | -                                                           |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 3,200,852.71                              | 5,948,646.69                                                |

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>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）                        | 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）               | -                                                    | 3,200,852.71  | 3,200,852.71    |
| 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）      | -37,393,813.76                                       | -4,602,425.25 | -41,996,239.01  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 31,496,002.08                                        | 3,729,540.29  | 35,225,542.37   |
| 2. 基金赎回款                               | -68,889,815.84                                       | -8,331,965.54 | -77,221,781.38  |
| 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）                        | 31,381,202.38                                        | 4,346,115.80  | 35,727,318.18   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2012 年 9 月 7 日（基金合同生效日）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）                        | -                                                    | -             | -               |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                                    | 5,948,646.69  | 5,948,646.69    |
| 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）      | 68,775,016.14                                        | -200,958.35   | 68,574,057.79   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 305,561,341.93                                       | 262,458.20    | 305,823,800.13  |
| 2. 基金赎回款                               | -236,786,325.79                                      | -463,416.55   | -237,249,742.34 |
| 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）                        | 68,775,016.14                                        | 5,747,688.34  | 74,522,704.48   |

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：

|           |           |            |
|-----------|-----------|------------|
| <u>葛航</u> | <u>韩波</u> | <u>蔡海成</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    |

7.4 报表附注

7.4.1 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。

根据《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》的规定，每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)的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。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。

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。投资者可在场内申购和赎回泰信基本面 400 份额，投资者可选择将其场内申购的泰信基本面 400 份额按 1:1 的比例分拆成泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额，投资者可按 1:1 的配比将其持有的泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额申请合并为泰信基本面 400 份额后赎回。投资者可在场外申购和赎回泰信基本面 400 份额。场外申购的泰信基本面 400 份额不进行分拆。投资者可将其持有的场外泰信基本面 400 份额跨系统转登记至场内并申请将其分拆成泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额后上市交易。投资者可按 1:1 的配比将其持有的泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额合并为泰信基本面 400 份额后赎回。

经深圳证券交易所深证上[2012]304 号文审核同意，本基金 11,997,954.00 份泰信基本面 400A 份额和 11,997,954.00 份泰信基本面 400B 份额于 2012 年 9 月 21 日在深圳证券交易所挂牌交易。未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

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

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》、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级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**

### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较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。

### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

#### **(1) 金融资产的分类**

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款

项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购、赎回以及配对转换引起的实收基金变动分别于基金申购确认日、基金赎回确认日及基金配对转换确认日认列。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则

按直线法计算。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

在存续期内，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)将不进行收益分配。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

### **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 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2013年12月31日 | 上年度末<br>2012年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款         | 2,275,804.22       | 2,859,997.93        |
| 定期存款         | -                  | -                   |
| 其中：存款期限1-3个月 | -                  | -                   |
| 其他存款         | -                  | -                   |
| 合计：          | 2,275,804.22       | 2,859,997.93        |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2013 年 12 月 31 日  |               |              |
|---------------|-------|--------------------------|---------------|--------------|
|               |       | 成本                       | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票            |       | 31,355,376.13            | 33,910,646.53 | 2,555,270.40 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       |                          |               |              |
| 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            |       | 31,355,376.13            | 33,910,646.53 | 2,555,270.40 |
| 项目            |       | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日 |               |              |
|               |       | 成本                       | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票            |       | 57,201,913.43            | 62,679,700.36 | 5,477,786.93 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       |                          |               |              |
| 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            |       | 57,201,913.43            | 62,679,700.36 | 5,477,786.93 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末及上年度末本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末及上年度末本基金未持有返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度可比期间本基金未持有买断式逆回购中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2013 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 465.57                  | 307.17                   |
| 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  | 0.80                    | 3,274.80                 |
| 应收债券利息     | -                       | -                        |
| 应收买入返售证券利息 | -                       | -                        |
| 应收申购款利息    | -                       | -                        |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                       | -                        |
| 其他         | -                       | -                        |
| 合计         | 466.37                  | 3,581.97                 |

#### 7.4.7.6 其他资产

本报告期末及上年度末本基金无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2013 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 5,829.91                | 60,530.09                |
| 银行间市场应付交易费用 | -                       | -                        |
| 合计          | 5,829.91                | 60,530.09                |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2013 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | 89.54                   | 4,117.34                 |
| 预提费用        | 384,500.00              | 284,500.00               |
| 应付指数使用费     | 8,837.36                | 19,763.18                |
| 合计          | 393,426.90              | 308,380.52               |

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 日 |                |
|               | 基金份额（份）                          | 账面金额           |
| 上年度末          | 56,525,646.14                    | 68,775,016.14  |
| 本期申购          | 32,500,729.32                    | 31,496,002.08  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -69,573,705.75                   | -68,889,815.84 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                | -              |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                                | -              |
| 本期申购          | -                                | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                | -              |
| 本期末           | 31,702,039.71                    | 31,381,202.38  |

注：1. 截至 2013 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 10,333,936.00 份（其中泰信基本面 400A 份额 5,166,968.00 份，泰信基本面 400B 份额 5,166,968.00 份），托管在场内未上市交易的基金份额为 113,064 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 21,255,039.71 份，均为泰信基本面 400 份额。场内的泰信基本面份额登记在证券登记结算系统，场外的泰信基本面份额登记在注册登记系统，可按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

2. 根据《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金合同》的相关规定和《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告》，本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司确定 2013 年 1 月 4 日为份额折算基准日，对泰信基本面 400 份额的场内、场外份额和泰信基本面 400A 份额实施定期份额折算。折算前，泰信基本面 400 场外和场内份额分别为 55,701,621.30 份和 328,603.00 份，根据基金份额折算公式，新增份额折算比例为 0.010145677，折算后泰信基本面 400 场外份额总额和场内份额总额分别为 56,266,751.95 份和 452,980.00 份，泰信基本面 400 份额净值为 1.068 元；折算前，泰信基本面 400A 份额总额为 5,965,345.00 份，根据基金份额折算公式，新增份额折算比例为 0.020291355，折算后泰信基本面 400A 份额总额为 5,965,345.00 份，份额净值为 1.001 元，经份额折算后产生新增的泰信基本面 400 场内份额。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述折算比例，对全体基金份额持有人持有的泰信基本面 400 份额和泰信基本面 400A 份额进行了折算，并于 2013 年 1 月 7 日进行了变更登记。

#### 7.4.7.10 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           | 6,123,369.24  | -2,922,516.53 | 3,200,852.71  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,381,923.60 | -3,220,501.65 | -4,602,425.25 |

|          |               |               |               |
|----------|---------------|---------------|---------------|
| 其中：基金申购款 | 2,851,749.16  | 877,791.13    | 3,729,540.29  |
| 基金赎回款    | -4,233,672.76 | -4,098,292.78 | -8,331,965.54 |
| 本期已分配利润  | -             | -             | -             |
| 本期末      | 5,044,005.32  | -697,889.52   | 4,346,115.80  |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2013年1月1日至2013年12月31日 | 上年度可比期间<br>2012年9月7日(基金合同生效日)<br>至2012年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|-----------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 18,000.19                   | 63,619.03                                     |
| 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 | 5,483.07                    | 27,747.91                                     |
| 其他        | 999.91                      | -                                             |
| 合计        | 24,483.17                   | 91,366.94                                     |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2013年1月1日至2013年12月31日 | 上年度可比期间<br>2012年9月7日(基金合同生效日)至2012年12月31日 |
|------------|-----------------------------|-------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 70,826,141.69               | 5,158,334.65                              |
| 减：卖出股票成本总额 | 64,128,868.55               | 4,883,301.35                              |
| 买卖股票差价收入   | 6,697,273.14                | 275,033.30                                |

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本报告期及上年度可比期间本基金无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本报告期末及上年度可比期间本基金无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本报告期末及上年度可比期间本基金无衍生工具投资收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日 |
|-------------|----------------------------------------|------------------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 477,864.21                             | 11,313.00                                            |
| 基金投资产生的股利收益 | -                                      | -                                                    |
| 合计          | 477,864.21                             | 11,313.00                                            |

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日 |
|------------|----------------------------------------|------------------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -2,922,516.53                          | 5,477,786.93                                         |
| ——股票投资     | -2,922,516.53                          | 5,477,786.93                                         |
| ——债券投资     | -                                      | -                                                    |
| ——资产支持证券投资 | -                                      | -                                                    |
| ——贵金属投资    |                                        |                                                      |
| 2. 衍生工具    | -                                      | -                                                    |
| ——权证投资     | -                                      | -                                                    |
| 3. 其他      | -                                      | -                                                    |
| 合计         | -2,922,516.53                          | 5,477,786.93                                         |

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日 |
|---------|----------------------------------------|------------------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 96,413.12                              | 296,565.59                                           |
| 其他      | -                                      | 76.57                                                |
| 合计      | 96,413.12                              | 296,642.16                                           |

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。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日 |
|----|----------------------------------------|------------------------------------------------------|
|    |                                        |                                                      |

|           |            |           |
|-----------|------------|-----------|
| 交易所市场交易费用 | 182,796.12 | 74,325.02 |
| 银行间市场交易费用 | -          | -         |
| 合计        | 182,796.12 | 74,325.02 |

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2013年1月1日至2013年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2012年9月7日(基金合同生<br>效日)至2012年12月31日 |
|------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|
| 审计费用             | 60,000.00                       | 50,000.00                                     |
| 信息披露费            | 320,000.00                      | 230,000.00                                    |
| 债券帐户维护费——<br>上清所 | 400.00                          | -                                             |
| 债券帐户维护费——<br>中债登 | 18,000.00                       | 4,500.00                                      |
| 指数使用费            | 36,478.88                       | 34,139.54                                     |
| 上市年费             | 60,000.00                       | 50,000.00                                     |
| 银行划款手续费          | 498.00                          | 114.50                                        |
| 其他               | -                               | 900.00                                        |
| 合计               | 495,376.88                      | 369,654.04                                    |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

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相关业务规定，本基金以2014年1月2日为份额折算基准日，对泰信基本面400的场内份额、场外份额和泰信基本面400A份额实施定期份额折算。

#### 7.4.9 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)有限责任公司(“青    | 基金管理人的股东     |

|       |  |
|-------|--|
| 岛国信”) |  |
|-------|--|

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2013年1月1日至2013年12月31日 | 上年度可比期间<br>2012年9月7日(基金合同生效日)至2012年12月31日 |
|-----------------|-----------------------------|-------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 405,320.80                  | 379,328.16                                |
| 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1.0%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。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2013年1月1日至2013年12月31日 | 上年度可比期间<br>2012年9月7日(基金合同生效日) |
|----|-----------------------------|-------------------------------|
|----|-----------------------------|-------------------------------|

|                | 月 31 日    | 至 2012 年 12 月 31 日 |
|----------------|-----------|--------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 89,170.60 | 83,452.18          |

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。

#### 7.4.10.2.3 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。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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<br>2013 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日 |                          |
|            | 持有的<br>基金份额             | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 |
| 山东国托       | 4,790,700.00            | 92.72%                   | 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<br>2013 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日 |                          |
|            | 持有的<br>基金份额             | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 |
| 山东国托       | 4,721,850.00            | 91.39%                   | 3,900,000.00             | 63.68%                   |

份额单位：份

| 泰信基本面 400 |                         |                          |                          |                          |
|-----------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 关联方名称     | 本期末<br>2013 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日 |                          |
|           | 持有的<br>基金份额             | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 |

|      |               |        |               |        |
|------|---------------|--------|---------------|--------|
| 山东国托 | 17,424,566.56 | 81.54% | 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。本基金除上述关联方之外的其他关联方于 2013 年 12 月 31 日未持有本基金份额。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。

#### 7.4.10.5 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<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |           | 上年度可比期间<br>2012 年 9 月 7 日(基金合同生效日)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    |
|        |                                        |           |                                                      |           |
| 中国工商银行 | 2,275,804.22                           | 18,000.19 | 2,859,997.93                                         | 63,619.03 |

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。

#### 7.4.10.6 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未在承销期内持有关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 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。

#### 7.4.12 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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。

##### 7.4.12.2 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 |
|--------|------|------------------|-------|--------|-----------------|--------|--------|------------|------------|----|
| 600686 | 金龙汽车 | 2013 年 11 月 18 日 | 非公开发行 | 8.73   | 2014 年 2 月 18 日 | 8.73   | 15,841 | 110,171.78 | 138,291.93 | -  |

|        |      |                        |                     |       |                    |       |        |            |           |   |
|--------|------|------------------------|---------------------|-------|--------------------|-------|--------|------------|-----------|---|
|        |      |                        | 份                   |       |                    |       |        |            |           |   |
| 001696 | 宗申动力 | 2013 年<br>12 月 9 日     | 重大<br>投资<br>事项      | 4.70  | 2014 年 1 月 9<br>日  | 4.41  | 18,094 | 94,512.69  | 85,041.80 | - |
| 600141 | 兴发集团 | 2013 年<br>12 月 20<br>日 | 重大<br>资产<br>重组      | 12.48 | 2014 年 1 月<br>27 日 | 13.28 | 6,786  | 101,843.04 | 84,689.28 | - |
| 600057 | 象屿股份 | 2013 年<br>12 月 10<br>日 | 非公<br>开发<br>行股<br>份 | 6.81  | 2014 年 1 月<br>16 日 | 7.02  | 11,786 | 43,782.18  | 80,262.66 | - |
| 000666 | 经纬纺机 | 2013 年<br>12 月 11<br>日 | 重大<br>事项<br>未公<br>告 | 9.76  | -                  | -     | 7,015  | 67,759.96  | 68,466.40 | - |
| 600639 | 浦东金桥 | 2013 年<br>12 月 5 日     | 非公<br>开发<br>行股<br>份 | 11.76 | 2014 年 2 月<br>26 日 | 10.58 | 4,851  | 36,992.71  | 57,047.76 | - |

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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。力争将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控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内，实现基金资产的长期增值。

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。

#### **7.4.13.2 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同责任，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 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2012 年 12 月 31 日：同)。

#### **7.4.13.3 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%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

于 2013 年 12 月 31 日，本基金所承担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。

#### **7.4.13.4 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。

##### **7.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担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、结算备付金及存出保证金。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2013 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                     | 2,275,804.22  | -     | -     | -             | 2,275,804.22  |
| 结算备付金                    | 190.10        | -     | -     | -             | 190.10        |
| 存出保证金                    | 1,566.30      | -     | -     | -             | 1,566.30      |
| 交易性金融资产                  | -             | -     | -     | 33,910,646.53 | 33,910,646.53 |
| 应收利息                     | -             | -     | -     | 466.37        | 466.37        |
| 其他资产                     | -             | -     | -     | -             | -             |
| 资产总计                     | 2,277,560.62  | -     | -     | 33,911,112.90 | 36,188,673.52 |
| 负债                       |               |       |       |               |               |
| 应付赎回款                    | -             | -     | -     | 23,759.01     | 23,759.01     |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -     | 31,425.84     | 31,425.84     |
| 应付托管费                    | -             | -     | -     | 6,913.68      | 6,913.68      |
| 应付交易费用                   | -             | -     | -     | 5,829.91      | 5,829.91      |
| 其他负债                     | -             | -     | -     | 393,426.90    | 393,426.90    |
| 负债总计                     | -             | -     | -     | 461,355.34    | 461,355.34    |
| 利率敏感度缺口                  | 2,277,560.62  | -     | -     | 33,449,757.56 | 35,727,318.18 |
| 上年度末<br>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                     | 10,387,270.66 | -     | -     | 65,671,330.14 | 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                  | 10,387,270.66 | -     | -     | 64,135,433.82 | 74,522,704.48 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2013 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2012 年 12 月 31 日：同)，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)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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的股票，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，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，使跟踪误差控制在限定的范围之内。

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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2013 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日 |                       |
|--------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|              | 公允价值                    | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 33,910,646.53           | 94.92                    | 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 | —                       | —                        | —                        | —                     |

|               |               |       |               |       |
|---------------|---------------|-------|---------------|-------|
| 交易性金融资产—贵金属投资 |               |       |               |       |
| 衍生金融资产—权证投资   | -             | -     | -             | -     |
| 其他            | -             | -     | -             | -     |
| 合计            | 33,910,646.53 | 94.92 | 62,679,700.36 | 84.11 |

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除中证锐联基本面 400 指数外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
|----|-----------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动                   | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                             | 本期末（2013 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2012 年 12 月 31 日） |
|    | 中证锐联基本面 400 指数上升 5%         | 1,670,000.00                | -                      |
|    | 中证锐联基本面 400 指数下降 5%         | -1,670,000.00               | -                      |

注：截至上年度末，本基金成立尚未满一年，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。

#### 7.4.14 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的金融工具中属于第一层级的余额为 33,396,846.70 元，属于第二层级的余额为 513,799.83 元，无属于第三层级的余额。(2012 年 12

月 31 日：第一层级 61,900,563.36 元，第二层级 779,137.00 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              | 33,910,646.53 | 93.71         |
|    | 其中：股票             | 33,910,646.53 | 93.71         |
| 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      | 2,275,994.32  | 6.29          |
| 7  | 其他各项资产            | 2,032.67      | 0.01          |
| 8  | 合计                | 36,188,673.52 | 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         | 394,023.50    | 1.10          |
| B  | 采矿业              | 859,253.63    | 2.41          |
| C  | 制造业              | 19,582,562.54 | 54.81         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,286,362.99  | 3.60          |
| E  | 建筑业              | 506,586.72    | 1.42          |
| F  | 批发和零售业           | 3,865,025.70  | 10.82         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,251,738.87  | 3.50          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 994,157.98    | 2.78          |
| J  | 金融业              | 584,912.94    | 1.64          |
| K  | 房地产业             | 2,989,880.87  | 8.37          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 671,642.85    | 1.88          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -             |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 207,710.20    | 0.58          |
| 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        | 290,188.41    | 0.81          |
| S  | 综合               | 426,599.33    | 1.19          |
|    | 合计               | 33,910,646.53 | 94.92         |

### 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所有股票投资明细

#### 8.3.1 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  | 600739 | 辽宁成大  | 20,687 | 362,849.98 | 1.02 |
| 2  | 600352 | 浙江龙盛  | 21,217 | 280,488.74 | 0.79 |
| 3  | 000488 | 晨鸣纸业  | 59,175 | 278,122.50 | 0.78 |
| 4  | 600271 | 航天信息  | 13,081 | 263,843.77 | 0.74 |
| 5  | 000422 | 湖北宜化  | 41,803 | 262,104.81 | 0.73 |
| 6  | 600881 | 亚泰集团  | 65,962 | 258,571.04 | 0.72 |
| 7  | 600832 | 东方明珠  | 21,260 | 207,710.20 | 0.58 |
| 8  | 000623 | 吉林敖东  | 11,546 | 205,056.96 | 0.57 |
| 9  | 000829 | 天音控股  | 28,274 | 199,614.44 | 0.56 |
| 10 | 600655 | 豫园商城  | 25,301 | 196,335.76 | 0.55 |
| 11 | 600626 | 申达股份  | 21,610 | 193,409.50 | 0.54 |
| 12 | 600675 | 中华企业  | 26,519 | 183,246.29 | 0.51 |
| 13 | 600787 | 中储股份  | 17,812 | 183,107.36 | 0.51 |
| 14 | 600325 | 华发股份  | 24,229 | 180,506.05 | 0.51 |
| 15 | 000581 | 威孚高科  | 5,823  | 179,348.40 | 0.50 |
| 16 | 600138 | 中青旅   | 10,175 | 179,283.50 | 0.50 |
| 17 | 000550 | 江铃汽车  | 7,037  | 178,810.17 | 0.50 |
| 18 | 600600 | 青岛啤酒  | 3,596  | 176,024.20 | 0.49 |
| 19 | 600331 | 宏达股份  | 42,742 | 173,959.94 | 0.49 |
| 20 | 600718 | 东软集团  | 13,886 | 170,381.22 | 0.48 |
| 21 | 600143 | 金发科技  | 30,593 | 170,097.08 | 0.48 |
| 22 | 000759 | 中百集团  | 23,808 | 168,560.64 | 0.47 |
| 23 | 002001 | 新 和 成 | 8,694  | 167,794.20 | 0.47 |
| 24 | 000060 | 中金岭南  | 26,072 | 163,732.16 | 0.46 |
| 25 | 000012 | 南 玻 A | 19,849 | 161,570.86 | 0.45 |
| 26 | 600122 | 宏图高科  | 40,056 | 161,025.12 | 0.45 |
| 27 | 600216 | 浙江医药  | 15,059 | 157,366.55 | 0.44 |
| 28 | 000830 | 鲁西化工  | 37,776 | 156,014.88 | 0.44 |
| 29 | 600835 | 上海机电  | 8,817  | 155,620.05 | 0.44 |
| 30 | 600518 | 康美药业  | 8,609  | 154,962.00 | 0.43 |
| 31 | 000680 | 山推股份  | 48,322 | 153,663.96 | 0.43 |
| 32 | 000877 | 天山股份  | 25,152 | 152,924.16 | 0.43 |
| 33 | 000900 | 现代投资  | 21,845 | 152,915.00 | 0.43 |
| 34 | 000616 | 亿城股份  | 42,817 | 149,003.16 | 0.42 |
| 35 | 600635 | 大众公用  | 26,891 | 147,362.68 | 0.41 |
| 36 | 601377 | 兴业证券  | 15,561 | 147,207.06 | 0.41 |
| 37 | 600859 | 王府井   | 7,963  | 144,608.08 | 0.40 |
| 38 | 600598 | 北大荒   | 12,778 | 144,519.18 | 0.40 |
| 39 | 002092 | 中泰化学  | 27,083 | 143,539.90 | 0.40 |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 40 | 601118 | 海南橡胶 | 19,287 | 143,302.41 | 0.40 |
| 41 | 000768 | 中航飞机 | 15,003 | 143,128.62 | 0.40 |
| 42 | 600522 | 中天科技 | 13,078 | 142,811.76 | 0.40 |
| 43 | 000538 | 云南白药 | 1,400  | 142,786.00 | 0.40 |
| 44 | 600601 | 方正科技 | 51,358 | 142,775.24 | 0.40 |
| 45 | 600597 | 光明乳业 | 6,404  | 142,168.80 | 0.40 |
| 46 | 601717 | 郑煤机  | 22,596 | 141,225.00 | 0.40 |
| 47 | 600535 | 天士力  | 3,261  | 139,864.29 | 0.39 |
| 48 | 600686 | 金龙汽车 | 15,841 | 138,291.93 | 0.39 |
| 49 | 600581 | 八一钢铁 | 33,035 | 136,434.55 | 0.38 |
| 50 | 600308 | 华泰股份 | 47,901 | 135,559.83 | 0.38 |
| 51 | 600811 | 东方集团 | 21,539 | 135,480.31 | 0.38 |
| 52 | 600169 | 太原重工 | 44,054 | 133,483.62 | 0.37 |
| 53 | 000926 | 福星股份 | 18,692 | 133,087.04 | 0.37 |
| 54 | 000021 | 长城开发 | 25,067 | 132,353.76 | 0.37 |
| 55 | 600713 | 南京医药 | 24,994 | 131,968.32 | 0.37 |
| 56 | 002570 | 贝因美  | 4,278  | 131,334.60 | 0.37 |
| 57 | 600415 | 小商品城 | 22,324 | 131,041.88 | 0.37 |
| 58 | 000423 | 东阿阿胶 | 3,300  | 130,548.00 | 0.37 |
| 59 | 600805 | 悦达投资 | 11,868 | 130,191.96 | 0.36 |
| 60 | 600895 | 张江高科 | 17,300 | 129,923.00 | 0.36 |
| 61 | 000917 | 电广传媒 | 7,852  | 128,066.12 | 0.36 |
| 62 | 600426 | 华鲁恒升 | 18,740 | 126,869.80 | 0.36 |
| 63 | 600596 | 新安股份 | 11,968 | 126,741.12 | 0.35 |
| 64 | 000016 | 深康佳A | 32,546 | 125,627.56 | 0.35 |
| 65 | 002385 | 大北农  | 7,593  | 124,145.55 | 0.35 |
| 66 | 601555 | 东吴证券 | 14,402 | 123,857.20 | 0.35 |
| 67 | 000726 | 鲁 泰A | 11,716 | 123,369.48 | 0.35 |
| 68 | 002465 | 海格通信 | 5,924  | 123,100.72 | 0.34 |
| 69 | 000701 | 厦门信达 | 10,639 | 123,093.23 | 0.34 |
| 70 | 600428 | 中远航运 | 35,068 | 123,088.68 | 0.34 |
| 71 | 600648 | 外高桥  | 3,812  | 122,860.76 | 0.34 |
| 72 | 600388 | 龙净环保 | 3,649  | 122,314.48 | 0.34 |
| 73 | 000963 | 华东医药 | 2,655  | 122,130.00 | 0.34 |
| 74 | 600703 | 三安光电 | 4,917  | 121,892.43 | 0.34 |
| 75 | 600004 | 白云机场 | 17,435 | 121,173.25 | 0.34 |
| 76 | 600006 | 东风汽车 | 41,424 | 120,543.84 | 0.34 |
| 77 | 600761 | 安徽合力 | 9,964  | 120,464.76 | 0.34 |
| 78 | 000028 | 国药一致 | 2,566  | 118,805.80 | 0.33 |

|     |        |       |        |            |      |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 79  | 600503 | 华丽家族  | 28,234 | 117,735.78 | 0.33 |
| 80  | 600008 | 首创股份  | 17,156 | 115,974.56 | 0.32 |
| 81  | 002556 | 辉隆股份  | 11,464 | 115,327.84 | 0.32 |
| 82  | 600971 | 恒源煤电  | 16,099 | 114,785.87 | 0.32 |
| 83  | 002440 | 闰土股份  | 7,088  | 113,904.16 | 0.32 |
| 84  | 600183 | 生益科技  | 22,997 | 113,605.18 | 0.32 |
| 85  | 600588 | 用友软件  | 8,207  | 113,584.88 | 0.32 |
| 86  | 600729 | 重庆百货  | 5,202  | 113,299.56 | 0.32 |
| 87  | 600276 | 恒瑞医药  | 2,979  | 113,142.42 | 0.32 |
| 88  | 002083 | 孚日股份  | 26,473 | 113,039.71 | 0.32 |
| 89  | 600873 | 梅花集团  | 18,083 | 112,837.92 | 0.32 |
| 90  | 600742 | 一汽富维  | 6,292  | 112,689.72 | 0.32 |
| 91  | 000652 | 泰达股份  | 24,424 | 112,350.40 | 0.31 |
| 92  | 600062 | 华润双鹤  | 4,985  | 111,514.45 | 0.31 |
| 93  | 000731 | 四川美丰  | 11,206 | 110,827.34 | 0.31 |
| 94  | 600037 | 歌华有线  | 14,213 | 110,719.27 | 0.31 |
| 95  | 002415 | 海康威视  | 4,817  | 110,694.66 | 0.31 |
| 96  | 601933 | 永辉超市  | 8,324  | 110,625.96 | 0.31 |
| 97  | 600438 | 通威股份  | 12,163 | 108,858.85 | 0.30 |
| 98  | 600879 | 航天电子  | 11,621 | 108,772.56 | 0.30 |
| 99  | 600663 | 陆家嘴   | 6,344  | 107,784.56 | 0.30 |
| 100 | 600584 | 长电科技  | 16,795 | 107,488.00 | 0.30 |
| 101 | 600266 | 北京城建  | 11,097 | 107,418.96 | 0.30 |
| 102 | 000417 | 合肥百货  | 17,005 | 106,621.35 | 0.30 |
| 103 | 000572 | 海马汽车  | 27,902 | 106,027.60 | 0.30 |
| 104 | 600409 | 三友化工  | 22,766 | 105,861.90 | 0.30 |
| 105 | 000860 | 顺鑫农业  | 6,810  | 104,601.60 | 0.29 |
| 106 | 000501 | 鄂武商 A | 8,181  | 104,389.56 | 0.29 |
| 107 | 600582 | 天地科技  | 14,804 | 104,072.12 | 0.29 |
| 108 | 600017 | 日照港   | 40,849 | 103,756.46 | 0.29 |
| 109 | 000559 | 万向钱潮  | 19,433 | 103,189.23 | 0.29 |
| 110 | 000690 | 宝新能源  | 19,453 | 103,100.90 | 0.29 |
| 111 | 601588 | 北辰实业  | 38,268 | 102,940.92 | 0.29 |
| 112 | 600595 | 中孚实业  | 28,025 | 102,571.50 | 0.29 |
| 113 | 000626 | 如意集团  | 13,279 | 102,513.88 | 0.29 |
| 114 | 002416 | 爱施德   | 5,349  | 101,096.10 | 0.28 |
| 115 | 002008 | 大族激光  | 7,464  | 100,689.36 | 0.28 |
| 116 | 600497 | 驰宏锌锗  | 10,651 | 99,799.87  | 0.28 |
| 117 | 000531 | 穗恒运 A | 8,092  | 97,670.44  | 0.27 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 118 | 601101 | 昊华能源 | 13,464 | 97,075.44 | 0.27 |
| 119 | 600978 | 宜华木业 | 16,863 | 96,624.99 | 0.27 |
| 120 | 600801 | 华新水泥 | 7,911  | 96,039.54 | 0.27 |
| 121 | 600021 | 上海电力 | 20,665 | 95,885.60 | 0.27 |
| 122 | 600064 | 南京高科 | 8,486  | 93,515.72 | 0.26 |
| 123 | 600720 | 祁连山  | 13,912 | 93,071.28 | 0.26 |
| 124 | 600160 | 巨化股份 | 17,259 | 92,680.83 | 0.26 |
| 125 | 002191 | 劲嘉股份 | 6,693  | 92,497.26 | 0.26 |
| 126 | 600067 | 冠城大通 | 14,255 | 92,229.85 | 0.26 |
| 127 | 000659 | 珠海中富 | 33,160 | 92,184.80 | 0.26 |
| 128 | 000009 | 中国宝安 | 9,707  | 91,731.15 | 0.26 |
| 129 | 600270 | 外运发展 | 8,995  | 91,659.05 | 0.26 |
| 130 | 600575 | 芜湖港  | 28,245 | 91,513.80 | 0.26 |
| 131 | 600685 | 广船国际 | 5,406  | 91,415.46 | 0.26 |
| 132 | 600963 | 岳阳林纸 | 28,254 | 91,260.42 | 0.26 |
| 133 | 000939 | 凯迪电力 | 14,745 | 90,976.65 | 0.25 |
| 134 | 600231 | 凌钢股份 | 28,233 | 90,910.26 | 0.25 |
| 135 | 000521 | 美菱电器 | 18,259 | 90,016.87 | 0.25 |
| 136 | 600804 | 鹏博士  | 6,399  | 89,969.94 | 0.25 |
| 137 | 000683 | 远兴能源 | 22,306 | 89,000.94 | 0.25 |
| 138 | 600815 | 厦工股份 | 22,286 | 88,475.42 | 0.25 |
| 139 | 002048 | 宁波华翔 | 10,452 | 88,214.88 | 0.25 |
| 140 | 000400 | 许继电气 | 2,830  | 87,984.70 | 0.25 |
| 141 | 600322 | 天房发展 | 26,216 | 87,037.12 | 0.24 |
| 142 | 002429 | 兆驰股份 | 6,434  | 86,859.00 | 0.24 |
| 143 | 600267 | 海正药业 | 5,858  | 86,815.56 | 0.24 |
| 144 | 002673 | 西部证券 | 6,476  | 85,483.20 | 0.24 |
| 145 | 601888 | 中国国旅 | 2,447  | 85,400.30 | 0.24 |
| 146 | 600295 | 鄂尔多斯 | 9,583  | 85,288.70 | 0.24 |
| 147 | 000006 | 深振业A | 17,281 | 85,195.33 | 0.24 |
| 148 | 001696 | 宗申动力 | 18,094 | 85,041.80 | 0.24 |
| 149 | 002422 | 科伦药业 | 1,853  | 85,034.17 | 0.24 |
| 150 | 600869 | 远东电缆 | 11,882 | 84,956.30 | 0.24 |
| 151 | 000598 | 兴蓉投资 | 14,719 | 84,781.44 | 0.24 |
| 152 | 600141 | 兴发集团 | 6,786  | 84,689.28 | 0.24 |
| 153 | 000601 | 韶能股份 | 18,933 | 84,630.51 | 0.24 |
| 154 | 600406 | 国电南瑞 | 5,683  | 84,506.21 | 0.24 |
| 155 | 600125 | 铁龙物流 | 14,817 | 84,308.73 | 0.24 |
| 156 | 600611 | 大众交通 | 13,592 | 83,998.56 | 0.24 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 157 | 000698 | 沈阳化工 | 21,887 | 83,608.34 | 0.23 |
| 158 | 000541 | 佛山照明 | 12,123 | 83,527.47 | 0.23 |
| 159 | 000979 | 中弘股份 | 23,900 | 83,172.00 | 0.23 |
| 160 | 600550 | 天威保变 | 15,948 | 82,929.60 | 0.23 |
| 161 | 002277 | 友阿股份 | 7,173  | 82,919.88 | 0.23 |
| 162 | 600516 | 方大炭素 | 10,874 | 82,751.14 | 0.23 |
| 163 | 002146 | 荣盛发展 | 8,242  | 82,420.00 | 0.23 |
| 164 | 600120 | 浙江东方 | 6,552  | 82,227.60 | 0.23 |
| 165 | 000970 | 中科三环 | 6,370  | 81,790.80 | 0.23 |
| 166 | 000708 | 大冶特钢 | 14,222 | 81,776.50 | 0.23 |
| 167 | 600056 | 中国医药 | 3,724  | 81,220.44 | 0.23 |
| 168 | 600810 | 神马股份 | 12,811 | 81,093.63 | 0.23 |
| 169 | 000822 | 山东海化 | 24,298 | 80,912.34 | 0.23 |
| 170 | 600491 | 龙元建设 | 22,750 | 80,535.00 | 0.23 |
| 171 | 600057 | 象屿股份 | 11,786 | 80,262.66 | 0.22 |
| 172 | 000839 | 中信国安 | 12,805 | 80,031.25 | 0.22 |
| 173 | 600157 | 永泰能源 | 14,799 | 79,766.61 | 0.22 |
| 174 | 600507 | 方大特钢 | 21,731 | 79,752.77 | 0.22 |
| 175 | 002500 | 山西证券 | 11,555 | 79,729.50 | 0.22 |
| 176 | 601005 | 重庆钢铁 | 31,976 | 79,300.48 | 0.22 |
| 177 | 600085 | 同仁堂  | 3,697  | 79,115.80 | 0.22 |
| 178 | 600858 | 银座股份 | 10,403 | 78,646.68 | 0.22 |
| 179 | 600533 | 栖霞建设 | 23,426 | 78,477.10 | 0.22 |
| 180 | 600823 | 世茂股份 | 8,711  | 78,224.78 | 0.22 |
| 181 | 000589 | 黔轮胎A | 15,118 | 78,160.06 | 0.22 |
| 182 | 600416 | 湘电股份 | 11,373 | 78,132.51 | 0.22 |
| 183 | 600638 | 新黄浦  | 6,381  | 78,103.44 | 0.22 |
| 184 | 600481 | 双良节能 | 6,839  | 78,032.99 | 0.22 |
| 185 | 600303 | 曙光股份 | 18,345 | 77,966.25 | 0.22 |
| 186 | 600079 | 人福医药 | 2,748  | 77,905.80 | 0.22 |
| 187 | 601880 | 大连港  | 29,274 | 77,868.84 | 0.22 |
| 188 | 002152 | 广电运通 | 4,055  | 77,815.45 | 0.22 |
| 189 | 600812 | 华北制药 | 15,532 | 77,815.32 | 0.22 |
| 190 | 000758 | 中色股份 | 7,189  | 77,281.75 | 0.22 |
| 191 | 601098 | 中南传媒 | 7,032  | 77,281.68 | 0.22 |
| 192 | 600674 | 川投能源 | 6,891  | 76,903.56 | 0.22 |
| 193 | 000999 | 华润三九 | 3,069  | 76,387.41 | 0.21 |
| 194 | 000807 | 云铝股份 | 22,401 | 76,163.40 | 0.21 |
| 195 | 600327 | 大东方  | 15,184 | 76,071.84 | 0.21 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 196 | 600410 | 华胜天成 | 11,240 | 75,870.00 | 0.21 |
| 197 | 000793 | 华闻传媒 | 6,376  | 75,746.88 | 0.21 |
| 198 | 600117 | 西宁特钢 | 20,727 | 75,653.55 | 0.21 |
| 199 | 600469 | 风神股份 | 9,295  | 75,289.50 | 0.21 |
| 200 | 600567 | 山鹰纸业 | 35,668 | 75,259.48 | 0.21 |
| 201 | 600109 | 国金证券 | 4,422  | 75,041.34 | 0.21 |
| 202 | 600256 | 广汇能源 | 8,553  | 74,753.22 | 0.21 |
| 203 | 000612 | 焦作万方 | 12,765 | 74,419.95 | 0.21 |
| 204 | 600315 | 上海家化 | 1,760  | 74,324.80 | 0.21 |
| 205 | 600511 | 国药股份 | 3,932  | 74,196.84 | 0.21 |
| 206 | 600449 | 宁夏建材 | 9,477  | 73,825.83 | 0.21 |
| 207 | 000686 | 东北证券 | 4,652  | 73,594.64 | 0.21 |
| 208 | 002065 | 东华软件 | 2,174  | 73,481.20 | 0.21 |
| 209 | 601058 | 赛轮股份 | 5,233  | 73,366.66 | 0.21 |
| 210 | 600246 | 万通地产 | 25,095 | 73,277.40 | 0.21 |
| 211 | 002122 | 天马股份 | 17,250 | 72,795.00 | 0.20 |
| 212 | 600498 | 烽火通信 | 4,726  | 72,780.40 | 0.20 |
| 213 | 000418 | 小天鹅A | 7,200  | 72,576.00 | 0.20 |
| 214 | 000707 | 双环科技 | 18,250 | 71,722.50 | 0.20 |
| 215 | 000786 | 北新建材 | 4,098  | 71,715.00 | 0.20 |
| 216 | 600380 | 健康元  | 14,878 | 71,711.96 | 0.20 |
| 217 | 600480 | 凌云股份 | 10,206 | 71,442.00 | 0.20 |
| 218 | 002078 | 太阳纸业 | 11,983 | 71,418.68 | 0.20 |
| 219 | 000685 | 中山公用 | 6,255  | 71,056.80 | 0.20 |
| 220 | 002254 | 泰和新材 | 9,177  | 70,938.21 | 0.20 |
| 221 | 000031 | 中粮地产 | 18,964 | 70,356.44 | 0.20 |
| 222 | 600335 | 国机汽车 | 5,387  | 69,977.13 | 0.20 |
| 223 | 000789 | 江西水泥 | 7,391  | 69,918.86 | 0.20 |
| 224 | 000022 | 深赤湾A | 4,406  | 69,526.68 | 0.19 |
| 225 | 000667 | 名流置业 | 38,067 | 69,281.94 | 0.19 |
| 226 | 002028 | 思源电气 | 4,636  | 69,076.40 | 0.19 |
| 227 | 600973 | 宝胜股份 | 9,328  | 68,840.64 | 0.19 |
| 228 | 601000 | 唐山港  | 22,491 | 68,822.46 | 0.19 |
| 229 | 600893 | 航空动力 | 3,597  | 68,810.61 | 0.19 |
| 230 | 601678 | 滨化股份 | 8,898  | 68,781.54 | 0.19 |
| 231 | 600657 | 信达地产 | 21,284 | 68,747.32 | 0.19 |
| 232 | 002241 | 歌尔声学 | 1,957  | 68,651.56 | 0.19 |
| 233 | 000666 | 经纬纺机 | 7,015  | 68,466.40 | 0.19 |
| 234 | 600612 | 老凤祥  | 2,934  | 68,420.88 | 0.19 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 235 | 600867 | 通化东宝 | 4,460  | 68,282.60 | 0.19 |
| 236 | 600340 | 华夏幸福 | 3,368  | 68,134.64 | 0.19 |
| 237 | 600549 | 厦门钨业 | 2,819  | 67,768.76 | 0.19 |
| 238 | 600278 | 东方创业 | 5,998  | 67,717.42 | 0.19 |
| 239 | 601929 | 吉视传媒 | 8,051  | 67,547.89 | 0.19 |
| 240 | 600277 | 亿利能源 | 8,794  | 66,482.64 | 0.19 |
| 241 | 000930 | 中粮生化 | 15,422 | 65,851.94 | 0.18 |
| 242 | 600779 | 水井坊  | 6,428  | 65,501.32 | 0.18 |
| 243 | 600517 | 置信电气 | 4,395  | 65,046.00 | 0.18 |
| 244 | 600039 | 四川路桥 | 10,765 | 65,020.60 | 0.18 |
| 245 | 600425 | 青松建化 | 16,918 | 64,965.12 | 0.18 |
| 246 | 002081 | 金螳螂  | 2,950  | 64,841.00 | 0.18 |
| 247 | 600366 | 宁波韵升 | 4,697  | 64,630.72 | 0.18 |
| 248 | 600736 | 苏州高新 | 15,978 | 64,551.12 | 0.18 |
| 249 | 600496 | 精工钢构 | 9,180  | 64,260.00 | 0.18 |
| 250 | 002203 | 海亮股份 | 5,500  | 63,085.00 | 0.18 |
| 251 | 600884 | 杉杉股份 | 5,081  | 62,597.92 | 0.18 |
| 252 | 000960 | 锡业股份 | 5,852  | 62,499.36 | 0.17 |
| 253 | 000061 | 农产品  | 7,409  | 62,383.78 | 0.17 |
| 254 | 600096 | 云天化  | 6,955  | 61,899.50 | 0.17 |
| 255 | 000869 | 张裕A  | 2,291  | 61,857.00 | 0.17 |
| 256 | 000987 | 广州友谊 | 6,471  | 61,798.05 | 0.17 |
| 257 | 600748 | 上实发展 | 8,135  | 61,419.25 | 0.17 |
| 258 | 002574 | 明牌珠宝 | 3,117  | 61,186.71 | 0.17 |
| 259 | 002155 | 辰州矿业 | 7,742  | 61,084.38 | 0.17 |
| 260 | 600531 | 豫光金铅 | 6,578  | 61,043.84 | 0.17 |
| 261 | 600577 | 精达股份 | 15,798 | 60,822.30 | 0.17 |
| 262 | 601216 | 内蒙君正 | 5,193  | 60,550.38 | 0.17 |
| 263 | 000912 | 泸天化  | 13,225 | 60,306.00 | 0.17 |
| 264 | 600397 | 安源煤业 | 14,157 | 60,167.25 | 0.17 |
| 265 | 002003 | 伟星股份 | 5,815  | 59,720.05 | 0.17 |
| 266 | 002007 | 华兰生物 | 2,079  | 59,667.30 | 0.17 |
| 267 | 601566 | 九牧王  | 4,672  | 59,474.56 | 0.17 |
| 268 | 600641 | 万业企业 | 13,830 | 59,469.00 | 0.17 |
| 269 | 600785 | 新华百货 | 5,042  | 59,445.18 | 0.17 |
| 270 | 600487 | 亨通光电 | 2,804  | 59,248.52 | 0.17 |
| 271 | 600586 | 金晶科技 | 18,731 | 59,189.96 | 0.17 |
| 272 | 002393 | 力生制药 | 1,501  | 59,139.40 | 0.17 |
| 273 | 002029 | 七匹狼  | 7,609  | 59,045.84 | 0.17 |

|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 274 | 000968 | 煤 气 化 | 7,211  | 58,913.87 | 0.16 |
| 275 | 002419 | 天虹商场  | 5,727  | 58,873.56 | 0.16 |
| 276 | 002470 | 金正大   | 2,749  | 58,553.70 | 0.16 |
| 277 | 600316 | 洪都航空  | 3,289  | 57,162.82 | 0.16 |
| 278 | 600639 | 浦东金桥  | 4,851  | 57,047.76 | 0.16 |
| 279 | 600744 | 华银电力  | 17,134 | 56,884.88 | 0.16 |
| 280 | 000043 | 中航地产  | 9,366  | 56,851.62 | 0.16 |
| 281 | 600195 | 中牧股份  | 3,596  | 56,565.08 | 0.16 |
| 282 | 000919 | 金陵药业  | 6,122  | 56,322.40 | 0.16 |
| 283 | 000410 | 沈阳机床  | 9,652  | 56,078.12 | 0.16 |
| 284 | 002444 | 巨星科技  | 6,886  | 56,052.04 | 0.16 |
| 285 | 600176 | 中国玻纤  | 7,387  | 55,919.59 | 0.16 |
| 286 | 002050 | 三花股份  | 4,938  | 55,799.40 | 0.16 |
| 287 | 002585 | 双星新材  | 4,839  | 55,600.11 | 0.16 |
| 288 | 601311 | 骆驼股份  | 5,099  | 55,579.10 | 0.16 |
| 289 | 000718 | 苏宁环球  | 12,150 | 55,525.50 | 0.16 |
| 290 | 601515 | 东风股份  | 2,140  | 55,233.40 | 0.15 |
| 291 | 002648 | 卫星石化  | 1,895  | 54,917.10 | 0.15 |
| 292 | 601010 | 文峰股份  | 8,035  | 54,879.05 | 0.15 |
| 293 | 600551 | 时代出版  | 3,358  | 54,768.98 | 0.15 |
| 294 | 000969 | 安泰科技  | 7,368  | 54,744.24 | 0.15 |
| 295 | 600510 | 黑牡丹   | 8,986  | 54,724.74 | 0.15 |
| 296 | 000619 | 海螺型材  | 7,508  | 54,658.24 | 0.15 |
| 297 | 002408 | 齐翔腾达  | 3,814  | 54,540.20 | 0.15 |
| 298 | 002244 | 滨江集团  | 7,680  | 54,144.00 | 0.15 |
| 299 | 002293 | 罗莱家纺  | 2,265  | 53,929.65 | 0.15 |
| 300 | 000823 | 超声电子  | 6,558  | 53,906.76 | 0.15 |
| 301 | 601608 | 中信重工  | 15,995 | 53,903.15 | 0.15 |
| 302 | 002237 | 恒邦股份  | 3,923  | 53,902.02 | 0.15 |
| 303 | 600373 | 中文传媒  | 3,006  | 53,747.28 | 0.15 |
| 304 | 600121 | 郑州煤电  | 10,662 | 53,736.48 | 0.15 |
| 305 | 002233 | 塔牌集团  | 8,350  | 53,690.50 | 0.15 |
| 306 | 002299 | 圣农发展  | 5,571  | 53,648.73 | 0.15 |
| 307 | 002011 | 盾安环境  | 5,857  | 53,591.55 | 0.15 |
| 308 | 002249 | 大洋电机  | 5,076  | 53,145.72 | 0.15 |
| 309 | 600765 | 中航重机  | 4,227  | 52,922.04 | 0.15 |
| 310 | 601231 | 环旭电子  | 2,501  | 52,646.05 | 0.15 |
| 311 | 002069 | 獐 子 岛 | 3,602  | 52,553.18 | 0.15 |
| 312 | 002375 | 亚厦股份  | 2,027  | 52,296.60 | 0.15 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 313 | 600300 | 维维股份 | 10,913 | 52,164.14 | 0.15 |
| 314 | 000415 | 渤海租赁 | 6,562  | 51,905.42 | 0.15 |
| 315 | 000961 | 中南建设 | 7,307  | 51,368.21 | 0.14 |
| 316 | 000780 | 平庄能源 | 11,259 | 51,341.04 | 0.14 |
| 317 | 600723 | 首商股份 | 7,869  | 51,305.88 | 0.14 |
| 318 | 600310 | 桂东电力 | 4,624  | 51,280.16 | 0.14 |
| 319 | 600408 | 安泰集团 | 18,936 | 51,127.20 | 0.14 |
| 320 | 000850 | 华茂股份 | 10,786 | 51,125.64 | 0.14 |
| 321 | 000046 | 泛海建设 | 11,347 | 50,948.03 | 0.14 |
| 322 | 601339 | 百隆东方 | 4,864  | 49,272.32 | 0.14 |
| 323 | 000540 | 中天城投 | 8,434  | 48,917.20 | 0.14 |
| 324 | 600132 | 重庆啤酒 | 3,017  | 48,845.23 | 0.14 |
| 325 | 601011 | 宝泰隆  | 4,871  | 48,807.42 | 0.14 |
| 326 | 600456 | 宝钛股份 | 3,823  | 48,360.95 | 0.14 |
| 327 | 002489 | 浙江永强 | 4,734  | 48,286.80 | 0.14 |
| 328 | 002344 | 海宁皮城 | 2,286  | 47,503.08 | 0.13 |
| 329 | 002372 | 伟星新材 | 3,200  | 47,424.00 | 0.13 |
| 330 | 600578 | 京能电力 | 13,012 | 47,233.56 | 0.13 |
| 331 | 002157 | 正邦科技 | 5,907  | 45,956.46 | 0.13 |
| 332 | 002005 | 德豪润达 | 5,554  | 43,987.68 | 0.12 |
| 333 | 603366 | 日出东方 | 3,100  | 43,927.00 | 0.12 |
| 334 | 600750 | 江中药业 | 2,763  | 43,821.18 | 0.12 |
| 335 | 600776 | 东方通信 | 7,075  | 43,582.00 | 0.12 |
| 336 | 000927 | 一汽夏利 | 12,171 | 43,572.18 | 0.12 |
| 337 | 600673 | 东阳光铝 | 4,550  | 43,407.00 | 0.12 |
| 338 | 002311 | 海大集团 | 3,693  | 43,355.82 | 0.12 |
| 339 | 600780 | 通宝能源 | 8,458  | 43,304.96 | 0.12 |
| 340 | 600987 | 航民股份 | 7,581  | 42,832.65 | 0.12 |
| 341 | 600725 | 云维股份 | 11,421 | 42,828.75 | 0.12 |
| 342 | 002557 | 洽洽食品 | 1,719  | 41,496.66 | 0.12 |
| 343 | 603766 | 隆鑫通用 | 4,351  | 40,942.91 | 0.11 |
| 344 | 600199 | 金种子酒 | 4,002  | 40,580.28 | 0.11 |
| 345 | 000655 | 金岭矿业 | 5,368  | 40,528.40 | 0.11 |
| 346 | 002479 | 富春环保 | 4,831  | 39,952.37 | 0.11 |
| 347 | 601908 | 京运通  | 4,864  | 39,884.80 | 0.11 |
| 348 | 002042 | 华孚色纺 | 8,750  | 39,462.50 | 0.11 |
| 349 | 600509 | 天富热电 | 4,472  | 39,398.32 | 0.11 |
| 350 | 000671 | 阳光城  | 4,227  | 39,268.83 | 0.11 |
| 351 | 600724 | 宁波富达 | 9,329  | 39,088.51 | 0.11 |

|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 352 | 002478 | 常宝股份  | 3,819  | 38,953.80 | 0.11 |
| 353 | 600332 | 白云山   | 1,408  | 38,945.28 | 0.11 |
| 354 | 002353 | 杰瑞股份  | 490    | 38,891.30 | 0.11 |
| 355 | 000543 | 皖能电力  | 5,418  | 38,684.52 | 0.11 |
| 356 | 601636 | 旗滨集团  | 4,801  | 38,263.97 | 0.11 |
| 357 | 600829 | 三精制药  | 5,694  | 37,751.22 | 0.11 |
| 358 | 600298 | 安琪酵母  | 2,179  | 37,631.33 | 0.11 |
| 359 | 601002 | 晋亿实业  | 4,379  | 37,571.82 | 0.11 |
| 360 | 600809 | 山西汾酒  | 1,940  | 37,442.00 | 0.10 |
| 361 | 002154 | 报喜鸟   | 6,292  | 37,437.40 | 0.10 |
| 362 | 601789 | 宁波建工  | 4,471  | 37,064.59 | 0.10 |
| 363 | 002430 | 杭氧股份  | 4,947  | 36,607.80 | 0.10 |
| 364 | 600743 | 华远地产  | 14,206 | 36,225.30 | 0.10 |
| 365 | 600874 | 创业环保  | 4,428  | 36,176.76 | 0.10 |
| 366 | 600401 | 海润光伏  | 4,590  | 35,985.60 | 0.10 |
| 367 | 002106 | 莱宝高科  | 3,111  | 35,932.05 | 0.10 |
| 368 | 000656 | 金科股份  | 4,434  | 35,826.72 | 0.10 |
| 369 | 002294 | 信立泰   | 1,033  | 35,535.20 | 0.10 |
| 370 | 600432 | 吉恩镍业  | 4,550  | 35,171.50 | 0.10 |
| 371 | 601038 | 一拖股份  | 3,727  | 35,033.80 | 0.10 |
| 372 | 002482 | 广田股份  | 1,781  | 34,907.60 | 0.10 |
| 373 | 601388 | 怡球资源  | 3,785  | 34,784.15 | 0.10 |
| 374 | 000042 | 深 长 城 | 1,340  | 34,304.00 | 0.10 |
| 375 | 002662 | 京威股份  | 4,648  | 34,162.80 | 0.10 |
| 376 | 002183 | 怡 亚 通 | 4,929  | 33,862.23 | 0.09 |
| 377 | 000536 | 华映科技  | 1,254  | 33,845.46 | 0.09 |
| 378 | 000525 | 红 太 阳 | 2,247  | 33,705.00 | 0.09 |
| 379 | 002275 | 桂林三金  | 2,157  | 32,980.53 | 0.09 |
| 380 | 600329 | 中新药业  | 2,589  | 32,673.18 | 0.09 |
| 381 | 601100 | 恒立油缸  | 2,665  | 32,219.85 | 0.09 |
| 382 | 600375 | 华菱星马  | 3,081  | 32,042.40 | 0.09 |
| 383 | 002498 | 汉缆股份  | 4,261  | 31,872.28 | 0.09 |
| 384 | 002051 | 中工国际  | 1,492  | 30,436.80 | 0.09 |
| 385 | 601677 | 明泰铝业  | 3,731  | 30,146.48 | 0.08 |
| 386 | 601139 | 深圳燃气  | 3,781  | 29,907.71 | 0.08 |
| 387 | 603001 | 奥康国际  | 1,970  | 29,274.20 | 0.08 |
| 388 | 002461 | 珠江啤酒  | 3,036  | 28,872.36 | 0.08 |
| 389 | 601801 | 皖新传媒  | 2,297  | 28,643.59 | 0.08 |
| 390 | 000620 | 新华联   | 4,909  | 26,999.50 | 0.08 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 391 | 002267 | 陕天然气 | 2,551 | 26,173.26 | 0.07 |
| 392 | 601886 | 江河创建 | 3,298 | 25,856.32 | 0.07 |
| 393 | 000596 | 古井贡酒 | 1,121 | 25,132.82 | 0.07 |
| 394 | 000631 | 顺发恒业 | 5,595 | 24,673.95 | 0.07 |
| 395 | 002603 | 以岭药业 | 716   | 23,484.80 | 0.07 |
| 396 | 002653 | 海思科  | 1,121 | 22,162.17 | 0.06 |
| 397 | 002534 | 杭锅股份 | 1,871 | 22,021.67 | 0.06 |
| 398 | 600372 | 中航电子 | 904   | 21,569.44 | 0.06 |
| 399 | 000603 | 盛达矿业 | 1,439 | 18,548.71 | 0.05 |
| 400 | 603993 | 洛阳钼业 | 2,182 | 14,161.18 | 0.04 |

### 8.3.2 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

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  | 600518 | 康美药业 | 410,375.00 | 0.55           |
| 2  | 000422 | 湖北宜化 | 384,005.29 | 0.52           |
| 3  | 600739 | 辽宁成大 | 324,356.00 | 0.44           |
| 4  | 600881 | 亚泰集团 | 320,204.00 | 0.43           |
| 5  | 600596 | 新安股份 | 259,515.76 | 0.35           |
| 6  | 000012 | 南玻A  | 257,784.00 | 0.35           |
| 7  | 600352 | 浙江龙盛 | 250,616.00 | 0.34           |
| 8  | 000488 | 晨鸣纸业 | 250,485.00 | 0.34           |
| 9  | 600331 | 宏达股份 | 220,602.05 | 0.30           |
| 10 | 601901 | 方正证券 | 218,974.00 | 0.29           |
| 11 | 000623 | 吉林敖东 | 217,132.51 | 0.29           |
| 12 | 601377 | 兴业证券 | 208,323.80 | 0.28           |
| 13 | 600655 | 豫园商城 | 207,551.00 | 0.28           |
| 14 | 000680 | 山推股份 | 206,797.00 | 0.28           |
| 15 | 000060 | 中金岭南 | 203,594.93 | 0.27           |
| 16 | 600820 | 隧道股份 | 190,469.00 | 0.26           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 17 | 600271 | 航天信息 | 188,309.91 | 0.25 |
| 18 | 601717 | 郑煤机  | 182,244.35 | 0.24 |
| 19 | 000877 | 天山股份 | 181,213.00 | 0.24 |
| 20 | 600535 | 天士力  | 179,745.70 | 0.24 |

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  | 600596 | 新安股份   | 777,871.33 | 1.04           |
| 2  | 000012 | 南玻A    | 667,070.16 | 0.90           |
| 3  | 600820 | 隧道股份   | 583,406.20 | 0.78           |
| 4  | 600352 | 浙江龙盛   | 572,759.68 | 0.77           |
| 5  | 600881 | 亚泰集团   | 570,996.77 | 0.77           |
| 6  | 600210 | 紫江企业   | 541,010.46 | 0.73           |
| 7  | 600704 | 物产中大   | 536,489.21 | 0.72           |
| 8  | 000717 | *ST 韶钢 | 514,587.40 | 0.69           |
| 9  | 600535 | 天士力    | 501,361.84 | 0.67           |
| 10 | 601377 | 兴业证券   | 478,790.37 | 0.64           |
| 11 | 000623 | 吉林敖东   | 477,510.98 | 0.64           |
| 12 | 000422 | 湖北宜化   | 458,937.77 | 0.62           |
| 13 | 601901 | 方正证券   | 456,208.76 | 0.61           |
| 14 | 600686 | 金龙汽车   | 431,667.88 | 0.58           |
| 15 | 600655 | 豫园商城   | 415,193.22 | 0.56           |
| 16 | 600256 | 广汇能源   | 408,660.67 | 0.55           |
| 17 | 000538 | 云南白药   | 399,436.07 | 0.54           |
| 18 | 000768 | 中航飞机   | 378,640.07 | 0.51           |
| 19 | 600008 | 首创股份   | 373,992.15 | 0.50           |
| 20 | 600675 | 中华企业   | 359,472.49 | 0.48           |

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 | 38,282,331.25 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 70,826,141.69 |

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所有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   | 1,566.30 |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | -        |
| 4  | 应收利息    | 466.37   |
| 5  | 应收申购款   | -        |
| 6  | 其他应收款   | -        |
| 7  | 待摊费用    | -        |
| 8  | 其他      | -        |
| 9  | 合计      | 2,032.67 |

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

报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

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

| 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<br>400A | 38  | 135,972.84 | 4,790,700.00  | 92.72% | 376,268.00   | 7.28%  |
| 泰信基本面<br>400B | 53  | 97,489.96  | 4,721,850.00  | 91.39% | 445,118.00   | 8.61%  |
| 泰信基本面<br>400  | 42  | 508,764.37 | 17,424,566.56 | 81.54% | 3,943,537.15 | 18.46% |
| 合计            | 133 | 238,361.20 | 26,937,116.56 | 84.97% | 4,764,923.15 | 15.03% |

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

泰信基本面 400A

| 序号 | 持有人名称       | 持有份额（份）      | 占上市总份额<br>比例 |
|----|-------------|--------------|--------------|
| 1  | 山东省国际信托有限公司 | 4,790,700.00 | 92.72%       |
| 2  | 咸铨          | 214,900.00   | 4.16%        |
| 3  | 甘遵义         | 60,000.00    | 1.16%        |
| 4  | 俞正保         | 25,803.00    | 0.50%        |
| 5  | 于振芬         | 18,777.00    | 0.36%        |
| 6  | 唐妮娜         | 15,500.00    | 0.30%        |
| 7  | 赵献华         | 9,400.00     | 0.18%        |
| 8  | 邬月秀         | 8,000.00     | 0.15%        |
| 9  | 吴文娟         | 5,000.00     | 0.10%        |
| 10 | 黄晖          | 4,985.00     | 0.10%        |

泰信基本面 400B

| 序号 | 持有人名称       | 持有份额（份）      | 占上市总份额<br>比例 |
|----|-------------|--------------|--------------|
| 1  | 山东省国际信托有限公司 | 4,721,850.00 | 91.39%       |
| 2  | 梁小红         | 208,200.00   | 4.03%        |
| 3  | 赵晋闽         | 29,400.00    | 0.57%        |
| 4  | 俞正保         | 25,703.00    | 0.50%        |
| 5  | 韩笑龙         | 24,500.00    | 0.47%        |
| 6  | 王兴成         | 20,000.00    | 0.39%        |
| 7  | 陈金凤         | 18,800.00    | 0.36%        |
| 8  | 许玲玲         | 16,300.00    | 0.32%        |
| 9  | 于振芬         | 12,800.00    | 0.25%        |
| 10 | 钱海仙         | 9,205.00     | 0.18%        |

## 9.3 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<br>比例 |
|----|------|-----------|--------------|
|----|------|-----------|--------------|

|                      |            |            |         |
|----------------------|------------|------------|---------|
| 基金管理人所有从业人员<br>持有本基金 | 泰信基本面 400A | -          | -       |
|                      | 泰信基本面 400B | -          | -       |
|                      | 泰信基本面 400  | 100,068.97 | 0.4683% |
|                      | 合计         | 100,068.97 | 0.3157% |

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 万份

## § 10 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)<br>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                       | -            | -            | 31,811,221.67  |
| 减:本报告期基金总赎回份额                     | -            | -            | 69,573,705.75  |
| 本报告期基金拆分变动份额                      | -957,717.00  | -957,717.00  | 2,604,941.65   |
| 本报告期期末基金份额总额                      | 5,166,968.00 | 5,166,968.00 | 21,368,103.71  |

## § 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 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锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金经理职务,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》、《上海证券报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金经理变更的公告》。

3、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（2012 年 9 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

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 |    |
| 华创证券   | 2      | 65,674,729.71 | 60.19%       | 59,793.26 | 60.87%     | -  |
| 中国银河证券 | 1      | 43,433,743.23 | 39.81%       | 38,434.98 | 39.13%     | -  |
| 瑞银证券   | 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、泰信发展主题基金、泰信现代服务业股票基金共用交易单元。

### 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 |
| 华创证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中国银河证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 瑞银证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 高华证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 民生证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 齐鲁证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 宏源证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 广发证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东兴证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华泰证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |

### 11.8 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                          | 2013 年 1 月 7 日 |

|    |                           |                                                        |                 |
|----|---------------------------|--------------------------------------------------------|-----------------|
|    |                           | 券日报》及公司网站<br>(www.ftfund.com)                          |                 |
| 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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(www.ftfund.com) | 2014 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<br>(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                              | 2013 年 5 月 17 日 |

|    |                                     |                                                        |                  |
|----|-------------------------------------|--------------------------------------------------------|------------------|
|    |                                     | 券日报》及公司网站<br>(www.ftfund.com)                          |                  |
| 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<br>(www.ftfund.com) | 2013 年 6 月 25 日  |
| 15 | 基金经理变更公告                            | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站<br>(www.ftfund.com) | 2013 年 7 月 5 日   |
| 16 | 13 年 2 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<br>(www.ftfund.com) | 2013 年 7 月 17 日  |
| 17 | 13 年半年报                             | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站<br>(www.ftfund.com) | 2013 年 8 月 27 日  |
| 18 | 13 年 3 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<br>(www.ftfund.com) | 2013 年 10 月 25 日 |
| 19 | 定期折算提示性公告                           | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站<br>(www.ftfund.com) | 2013 年 12 月 25 日 |
| 20 | 定期折算业务公告、泰信 400A 份额折算后前收盘价调整风险提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站<br>(www.ftfund.com) | 2013 年 12 月 27 日 |

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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

### 12.2 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。

### 12.3 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](http://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

2014 年 3 月 27 日