

泰信中小盘精选股票型证券投资基金

2014 年半年度报告

摘要

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 26 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰信中小盘精选股票
基金主代码	290011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 10 月 26 日
基金管理人	泰信基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	137,568,440.51 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰信基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡因	王永民
	联系电话	021-20899098	010-66594896
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-5988	95566
传真		021-20899008	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ftfund.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区浦东南路 256 号 华夏银行大厦 36-37 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,008,156.89
本期利润	12,743,217.49
加权平均基金份额本期利润	0.0949
本期基金份额净值增长率	8.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.2200
期末基金资产净值	167,834,409.51
期末基金份额净值	1.220

注：1、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。

2、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。

3、期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.36%	1.00%	1.79%	0.73%	2.57%	0.27%
过去三个月	7.49%	1.05%	1.93%	0.78%	5.56%	0.27%
过去六个月	8.25%	1.35%	-0.33%	0.95%	8.58%	0.40%

过去一年	23.20%	1.39%	10.52%	1.02%	12.68%	0.37%
自基金合同 生效日起至 今	28.09%	1.22%	-2.45%	1.13%	30.54%	0.09%

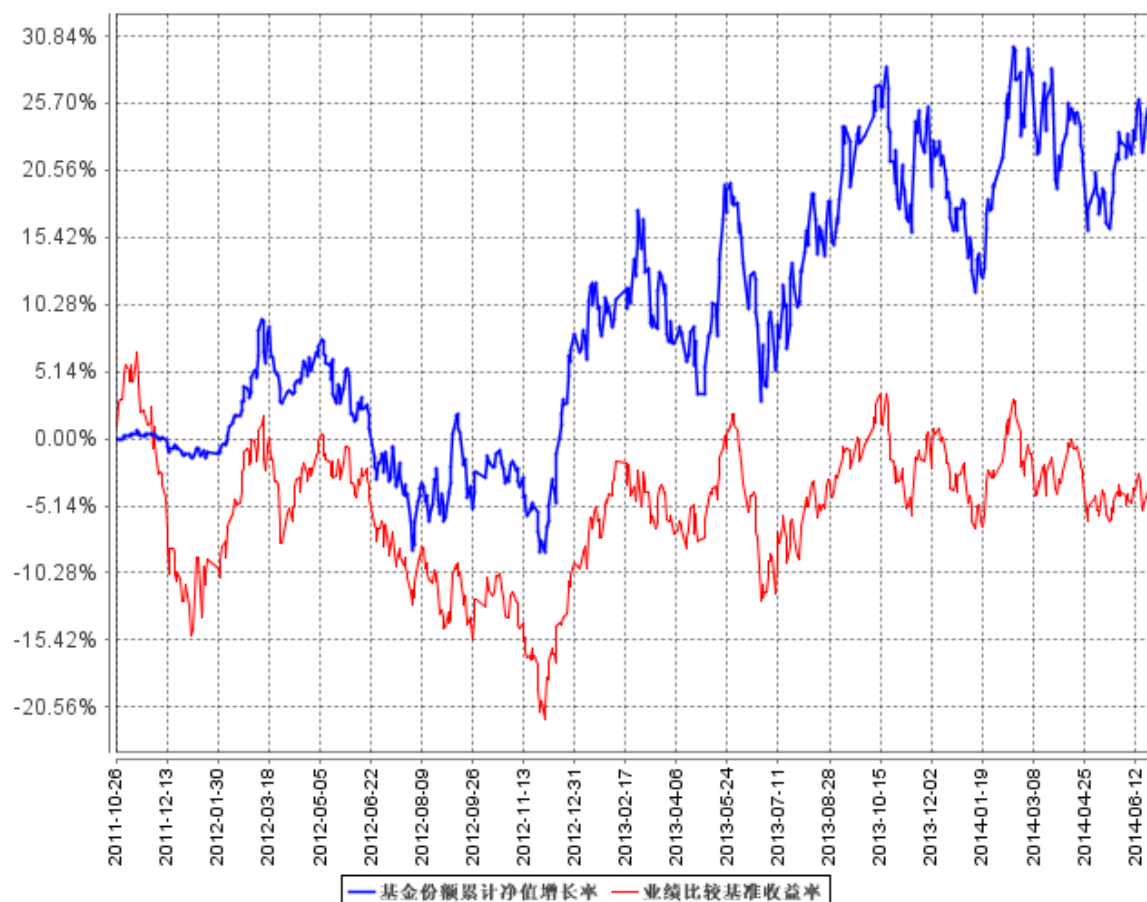
注：本基金业绩比较基准为：中证 700 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

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

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2011 年 10 月 26 日正式生效。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满，本基金将基金资产的 60%-95%投资于股票，现金或到期

日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，债券、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规和监管机构的规定执行。本基金投资于中小盘股票的比例不低于股票投资资产的 80%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号 37 层

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36、37 层

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：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.）是山东省国际信托投资有限公司（现更名为山东省国际信托有限公司）联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司共同发起设立的基金管理公司。公司于 2002 年 9 月 24 日经中国证券监督管理委员会批准正式筹建，2003 年 5 月 8 日获准开业，是以信托投资公司为主发起人而发起设立的基金管理公司。

公司目前下设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 2014 年 6 月，公司有正式员工 103 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 2014 年 6 月，泰信基金管理有限公司旗下共有泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活股票、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、泰信发展主题股票、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选股票、泰信

保本混合、泰信中证基本面 400 指数分级、泰信现代服务业股票基金、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、泰信乐利分级 1 号、泰信乐利 2 号、泰信乐利 3 号、泰信量化对冲分级 1 号、泰信财富分级 6 号、泰信财富分级 7 号共 7 个资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳菁女士	研究部总监 兼研究总监、 本基金经理 兼泰信蓝筹 精选基金经 理	2011 年 10 月 26 日	—	20 年	工商管理硕士。具有基金从业资格。曾任天同证券有限责任公司资产管理部交易员、研究员、投资经理。2005 年加入泰信基金管理有限公司，先后任交易员、研究部高级研究员、泰信先行策略基金基金经理助理。自 2009 年 4 月 22 日起担任泰信蓝筹精选基金经理。现同时担任研究部总监兼研究总监。
张彦先生	本基金经理 助理兼泰信 优势增长基 金经理助理	2011 年 10 月 26 日	2014 年 5 月 9 日	9 年	经济学硕士。具备基金从业资格。曾任职于国金证券研究所、上海从容投资管理有限公司、万家基金管理有限公司。2011 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，担任高级研究员。自 2012 年 4 月 6 日起担任泰信优势增长基金经理助理职务。

注：1、以上日期均是指公司公告的日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司公平交易制度适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投

资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年市场风格出现了一定转换，创业板市场出现大幅震荡，主板市场开始活跃，同时，部分处于相对低位的小市值公司也表现出色。以新能源汽车产业链、医疗服务为代表的新兴产业以及国企改革等板块表现较好。

报告期内，本基金在一、二月份对仓位配置进行了较大幅度的调整，增加了新能源汽车产业链、医疗服务、国企改革以及可穿戴设备板块个股的配置，我们在上半年维持市场处于震荡市的判断，对持有的板块和个股进行了适度的波段操作，及时兑现了部分利润。

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 1.220 元，净值增长率为 8.25%，同期比较基准增长率为-0.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从今年以来公布的各项经济数据来看，我国宏观经济复苏依然不能过度乐观，未来几个月经济继续在底部的可能性较大。

在央行的最新货币政策执行过程中，我们已经看到政策微调的迹象，特别是针对中小企业的扶持力度明显加大。在保增长和促转型双重压力之下，政府虽然有动力的加大投资力度，保持经

济增速，但更多的是通过结构性的投资，防止经济失速，为实现产业转型提供良好的经济环境，在此期间，受到政策扶持的行业和新兴产业将呈现结构性机会。

综合以上判断，我们认为短期市场仍将以区间震荡为主，但由于政策预期的变化，对市场的态度谨慎乐观，结构性机会将持续出现。

配置方面，我们具体看好以下几个板块：

1、新能源汽车产业链将给汽车行业带来颠覆性的技术革命。新能源汽车是引领未来科技趋势，同时产业链还涉及上游有色和矿业、中游化工、汽车制造业、电子产业和下游消费业的巨大链条，在经济增长和转型大业中承担了巨大的作用，行业已经得到了越来越多的政策支持；

2、以机器人和 3D 打印为代表的生产智能化，以移动互联网和可穿戴设备为代表的生活智能化革命也已经开始。科技的进步不断改变人类的生活方式，除了智能手机的更新换代之外，以可穿戴设备、智能家居、机器人为代表的智能产品正在进入人们的生活，这些产品的渗透率空间巨大。

3、以医疗改革为契机的医疗服务和以基因细胞治疗为代表的医药产业变革，也会给传统的医药行业选股带来颠覆性变化。首先，医疗服务是现代服务业的重要组成部分，具有足够大的发展空间，越来越受到政府的支持，也为行业的发展提供了保障，此外，新兴的医疗方法比如基因、细胞治疗领域随着技术的进步也越来越受到关注，部分领域已处于爆发前夜；我们同时还看好国企改革、能源改革、军队改革以及金融改革带来的投资机会。

投资策略上，我们将继续运用“反预期管理”的投资策略，关注重点从不断创新高的市场热点转换到被市场忽略的价值投资板块。我们还将坚持行业轮动的思路操作，针对今年的市场变化，及时对部分获利品种兑现利润。

操作方面，本基金主要是把自上而下做好行业轮动和自下而上选择好个股相结合。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、泰信基金管理有限公司估值程序等事项的说明

委员会主席

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

委员会成员：

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

蔡海成先生，硕士。2013 年加入泰信基金管理有限公司，现任公司清算会计部总监。

朱志权先生，学士。2008 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，现任基金投资部总监兼投资总监，泰信先行策略、泰信优势增长基金基金经理。

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

2、本基金基金经理不参与本基金估值。

3、参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、基金合同关于利润分配的约定：

1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；选择红利再投资的，现金红利则按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

4、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

5、基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；

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

7、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

二、本报告期, 本基金未进行利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰信中小盘精选股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰信中小盘精选股票型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	5,829,334.73	7,597,130.42
结算备付金	3,705,710.03	268,026.37
存出保证金	92,710.52	102,792.25

交易性金融资产	136,650,290.89	126,902,111.31
其中：股票投资	136,650,290.89	126,902,111.31
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	23,000,000.00	3,000,000.00
应收证券清算款	5,926,937.55	395,430.45
应收利息	2,662.84	2,266.12
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	175,207,646.56	138,267,756.92
负债和所有者权益	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	5,707,188.95	-
应付赎回款	218,449.09	22,968.34
应付管理人报酬	200,776.14	179,733.88
应付托管费	33,462.69	29,955.62
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,020,286.39	838,438.73
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	193,073.79	384,586.56
负债合计	7,733,237.05	1,455,683.13
所有者权益：		
实收基金	137,568,440.51	121,362,484.20
未分配利润	30,265,969.00	15,449,589.59
所有者权益合计	167,834,409.51	136,812,073.79
负债和所有者权益总计	175,207,646.56	138,267,756.92

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.220 元，基金份额总额 137,568,440.51 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信中小盘精选股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入	15,286,997.10	-3,410,553.11
1.利息收入	294,225.12	147,144.10
其中：存款利息收入	48,482.71	40,844.76
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	245,742.41	106,299.34
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	7,250,439.18	7,202,249.71
其中：股票投资收益	6,927,282.23	6,846,155.78
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	323,156.95	356,093.93
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7,735,060.60	-10,780,608.19
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7,272.20	20,661.27
减：二、费用	2,543,779.61	2,309,217.50
1.管理人报酬	1,158,222.10	801,114.52
2.托管费	193,037.06	133,519.11
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	988,398.85	1,189,253.68
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	204,121.60	185,330.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	12,743,217.49	-5,719,770.61
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	12,743,217.49	-5,719,770.61

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信中小盘精选股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日 至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	121,362,484.20	15,449,589.59	136,812,073.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	12,743,217.49	12,743,217.49
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）	16,205,956.31	2,073,161.92	18,279,118.23
其中：1.基金申购款	22,113,160.72	3,118,100.65	25,231,261.37
2.基金赎回款	-5,907,204.41	-1,044,938.73	-6,952,143.14
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）	137,568,440.51	30,265,969.00	167,834,409.51
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	73,273,592.89	4,785,070.60	78,058,663.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-5,719,770.61	-5,719,770.61
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）	38,242,126.57	3,768,787.88	42,010,914.45
其中：1.基金申购款	58,709,857.76	5,984,890.50	64,694,748.26
2.基金赎回款	-20,467,731.19	-2,216,102.62	-22,683,833.81

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）	111,515,719.46	2,834,087.87	114,349,807.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>葛航</u>	<u>韩波</u>	<u>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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰信中小盘精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 1138 号《关于核准泰信中小盘精选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由泰信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信中小盘精选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 262,307,424.58 元,经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 408 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信中小盘精选股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 10 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 262,332,100.87 份基金份额,其中认购资金利息折合 24,676.29 份基金份额。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信中小盘精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的各类股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金将基金资产的 60%-95%投资于股票,现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,债券、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规和监管机构的规定执行。本基金投资于中小盘股票的比例不低于股票投资资产的 80%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38

项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金 基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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。

6.4.7 关联方关系

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

本基金新增上海锐懿资产管理有限公司为关联方。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
山东省国际信托有限公司（“山东国托”）	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信实业有限公司	基金管理人的股东
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

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。

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。

应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间本基金无应支付关联方佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,158,222.10	801,114.52
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人泰信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}$ 。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	193,037.06	133,519.11

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

6.4.8.2.3 销售服务费

本报告期及上年度可比期间本基金未发生销售服务费用。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
-------	------------------------	--------------------------

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
山东省国际信 托有限公司	94,843,090.56	68.9400%	94,843,090.56	78.1500%

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	5,829,334.73	35,049.74	5,785,015.88	28,040.62

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期末及上年度可比期间本基金在承销期内未参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

报告期末本基金未持有因认购新发/增发而持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量(股)	期末 成本总额	期末估值总额	备注
600346	大橡塑	2014 年 4 月 14 日	重大事项公告	7.73	2014 年 7 月 25 日	8.50	374,550	2,861,237.30	2,895,271.50	-
300137	先河环保	2014 年 6 月 16 日	重大事项公告	20.86	2014 年 8 月 15 日	-	135,000	2,762,656.66	2,816,100.00	-
002635	安洁科技	2014 年 6 月 30 日	重大事项公告	31.99	2014 年 8 月 5 日	35.19	67,973	2,479,702.63	2,174,456.27	-
600418	江淮	2014 年 4 月	重大	10.20	2014 年 7 月	11.22	200,000	1,820,109.75	2,040,000.00	-

	汽车	月 14 日	事项公告		月 11 日					
300088	长信科技	2014 年 3 月 13 日	重大事项公告	19.49	2014 年 7 月 1 日	18.00	90,500	1,976,955.50	1,763,845.00	-
300199	翰宇药业	2014 年 2 月 20 日	重大事项公告	26.63	-	-	23,000	561,254.92	612,490.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无其他需要说明有助于理解和分析会计报表事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	136,650,290.89	77.99
	其中：股票	136,650,290.89	77.99
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	23,000,000.00	13.13
	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	9,535,044.76	5.44
7	其他各项资产	6,022,310.91	3.44
8	合计	175,207,646.56	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,364,038.00	3.20
B	采矿业	—	—
C	制造业	106,094,174.89	63.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	123,000.00	0.07
F	批发和零售业	9,122,360.00	5.44
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,798,291.00	8.22
J	金融业	2,148,427.00	1.28
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	136,650,290.89	81.42

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002219	恒康医疗	419,861	9,228,544.78	5.50

2	002364	中恒电气	340,888	6,071,215.28	3.62
3	000592	平潭发展	640,100	5,364,038.00	3.20
4	600822	上海物贸	512,000	4,751,360.00	2.83
5	000919	金陵药业	297,000	4,134,240.00	2.46
6	000050	深天马 A	320,661	4,008,262.50	2.39
7	600765	中航重机	330,000	3,960,000.00	2.36
8	002475	立讯精密	120,400	3,946,712.00	2.35
9	300223	北京君正	120,000	3,939,600.00	2.35
10	600390	金瑞科技	297,000	3,917,430.00	2.33

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002219	恒康医疗	8,956,392.63	6.55
2	000823	超声电子	6,920,932.84	5.06
3	600822	上海物贸	6,443,537.38	4.71
4	600028	中国石化	5,713,791.98	4.18
5	002325	洪涛股份	5,710,858.02	4.17
6	600406	国电南瑞	5,679,023.38	4.15
7	300049	福瑞股份	5,457,370.83	3.99
8	300223	北京君正	5,343,227.08	3.91
9	002364	中恒电气	5,196,100.60	3.80
10	300028	金亚科技	5,188,498.97	3.79
11	000592	平潭发展	5,184,607.00	3.79
12	600688	上海石化	5,066,870.00	3.70
13	002181	粤传媒	4,958,959.35	3.62
14	600187	国中水务	4,953,210.46	3.62
15	600770	综艺股份	4,826,045.93	3.53
16	600741	华域汽车	4,733,437.18	3.46
17	600699	均胜电子	4,656,128.38	3.40
18	600390	金瑞科技	4,589,031.84	3.35
19	601989	中国重工	4,469,000.00	3.27
20	603005	晶方科技	4,341,225.63	3.17

21	000050	深天马 A	4,320,073.23	3.16
22	000919	金陵药业	4,072,547.85	2.98
23	600525	长园集团	3,939,250.30	2.88
24	601318	中国平安	3,875,537.75	2.83
25	300327	中颖电子	3,693,837.90	2.70
26	600468	百利电气	3,590,618.63	2.62
27	002214	大立科技	3,394,259.99	2.48
28	002642	荣之联	3,324,222.70	2.43
29	600418	江淮汽车	3,270,671.05	2.39
30	002475	立讯精密	3,249,096.83	2.37
31	300073	当升科技	3,231,574.94	2.36
32	002070	众和股份	3,221,633.36	2.35
33	002048	宁波华翔	3,177,584.92	2.32
34	300337	银邦股份	3,149,572.06	2.30
35	002229	鸿博股份	3,135,020.00	2.29
36	600410	华胜天成	3,132,102.00	2.29
37	000559	万向钱潮	3,098,490.10	2.26
38	300007	汉威电子	2,952,728.12	2.16
39	300037	新宙邦	2,912,269.00	2.13
40	600549	厦门钨业	2,907,619.80	2.13
41	000541	佛山照明	2,868,944.10	2.10
42	600346	大橡塑	2,861,237.30	2.09
43	300038	梅泰诺	2,859,781.59	2.09
44	300352	北信源	2,857,906.17	2.09
45	601929	吉视传媒	2,857,210.84	2.09
46	000009	中国宝安	2,851,273.00	2.08
47	300250	初灵信息	2,764,310.73	2.02
48	002383	合众思壮	2,747,369.00	2.01

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600000	浦发银行	8,764,120.29	6.41

2	601318	中国平安	7,870,643.49	5.75
3	600416	湘电股份	7,691,163.52	5.62
4	000823	超声电子	7,524,810.59	5.50
5	600818	中路股份	7,395,453.25	5.41
6	600196	复星医药	6,839,674.53	5.00
7	601901	方正证券	5,995,816.96	4.38
8	600187	国中水务	5,826,940.07	4.26
9	600018	XD 上港集	5,826,199.88	4.26
10	600028	中国石化	5,790,617.99	4.23
11	002181	粤传媒	5,294,819.85	3.87
12	600688	上海石化	5,292,273.75	3.87
13	002325	洪涛股份	5,278,265.00	3.86
14	002368	太极股份	5,141,686.69	3.76
15	603005	晶方科技	5,128,273.82	3.75
16	600406	国电南瑞	5,009,741.44	3.66
17	300049	福瑞股份	4,588,123.24	3.35
18	002019	鑫富药业	4,501,702.08	3.29
19	600662	强生控股	4,494,320.86	3.29
20	600851	海欣股份	4,470,350.68	3.27
21	601989	中国重工	4,277,000.00	3.13
22	600292	中电远达	4,164,074.90	3.04
23	300197	铁汉生态	4,092,462.62	2.99
24	600597	光明乳业	4,063,177.46	2.97
25	600562	国睿科技	4,049,011.70	2.96
26	002214	大立科技	3,992,665.12	2.92
27	600741	华域汽车	3,740,128.31	2.73
28	600629	棱光实业	3,646,131.79	2.67
29	300073	当升科技	3,617,175.83	2.64
30	300337	银邦股份	3,454,383.17	2.52
31	002048	宁波华翔	3,386,712.03	2.48
32	300007	汉威电子	3,220,435.16	2.35
33	600109	国金证券	3,155,017.39	2.31
34	600549	厦门钨业	3,148,376.10	2.30
35	600388	XD 龙净环	3,080,265.49	2.25
36	002229	鸿博股份	3,032,873.60	2.22
37	000541	佛山照明	2,997,637.03	2.19
38	000009	中国宝安	2,961,943.18	2.16
39	600718	东软集团	2,955,705.00	2.16

40	002390	信邦制药	2,894,337.00	2.12
41	600429	三元股份	2,781,500.00	2.03
42	600073	上海梅林	2,763,220.46	2.02

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	324,150,516.66
卖出股票收入（成交）总额	329,064,679.91

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 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

报告期末本基金未投资贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

7.12.2

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	92,710.52

2	应收证券清算款	5,926,937.55
3	应收股利	-
4	应收利息	2,662.84
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,022,310.91

7.12.4 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的处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
404	340,515.94	118,006,417.55	85.78%	19,562,022.96	14.22%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	16,470.57	0.0120%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：基金份额总量的数量区间为 0、0 至 10 万份（含）、10 万份至 50 万份（含）、50 万份至 100 万份（含）、100 万份以上。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2011 年 10 月 26 日 ）基金份额总额	262,332,100.87
本报告期期初基金份额总额	121,362,484.20
本报告期基金总申购份额	22,113,160.72
减：本报告期基金总赎回份额	5,907,204.41
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	137,568,440.51

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2014 年 2 月 14 日中国银行股份有限公司公告，自 2014 年 2 月 13 日起，陈四清先生担任本行行长。

2、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，王小林先生担任董事长职务。具体详情参见 2014 年 4 月 9 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》，公告同日起公司总经理葛航先生不再代任董事长职务。本公司上述人事变动已按相关规定向监管

机构进行备案。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘会计师事务所，仍为普华永道中天会计师事务所有限公司。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况发生。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	261,815,958.84	40.08%	231,681.27	39.77%	—
浙商证券	1	168,581,650.22	25.81%	150,104.85	25.77%	—
方正证券	1	55,046,773.81	8.43%	48,710.96	8.36%	—
国联证券	1	47,512,407.37	7.27%	43,255.36	7.42%	—
国信证券	1	37,027,885.55	5.67%	33,710.06	5.79%	—
中信建投	2	36,720,937.57	5.62%	33,431.00	5.74%	—
国金证券	2	24,965,782.77	3.82%	22,092.37	3.79%	—
中银国际	2	21,533,870.44	3.30%	19,604.51	3.37%	—
申银万国	1	—	—	—	—	—

光大证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合证 券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中国建银投 资证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位有关问题的通知》（证监基金字【2007】48 号）中关于“一家基金公司通过一家证券经营机构买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金 30%”的要求，本基金管理人在选择租用交易单元时，注重所选证券公司的综合实力、市场声誉。对证券公司的研究能力，由公司研究人员对其提供的研究报告、研究成果的质量进行定期评估。公司将根据内部评估报告，对交易单元租用情况进行总体评价，决定是否对交易单元租用情况进行调整。

2、本基金与公司旗下在中国银行托管的泰信优质生活基金、泰信蓝筹精选基金、泰信增强收益基金、泰信中证 200 指数基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	92,200,000.00	4.93%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	1,046,000,000.00	55.97%	-	-
国信证券	-	-	196,000,000.00	10.49%	-	-
中信建投	-	-	113,000,000.00	6.05%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	421,500,000.00	22.56%	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中国建银投资 证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-

泰信基金管理有限公司
2014 年 8 月 26 日