

泰信中证 200 指数证券投资基金 2011 年年度报告 摘要

2011 年 12 月 31 日

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2012 年 3 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 2012 年 3 月 21 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 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰信中证 200 指数
基金主代码	290010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 6 月 9 日
基金管理人	泰信基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	135,913,517.61 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰信基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	唐国培	唐州徽
	联系电话	021-20899032	010-66594855
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-5988	95566
传真		021-20899008	010-66594942

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2011 年 6 月 9 日-2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-13,823,363.93
本期利润	-33,463,331.84
加权平均基金份额本期利润	-0.1999
本期基金份额净值增长率	-28.10%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2948
期末基金资产净值	95,852,288.75
期末基金份额净值	0.705

注：1、上述指标的计算时间的起始日为 2011 年 6 月 9 日（基金合同生效日），截至本报告期末不满一年。

2、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4、期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-13.81%	1.47%	-13.88%	1.49%	0.07%	-0.02%

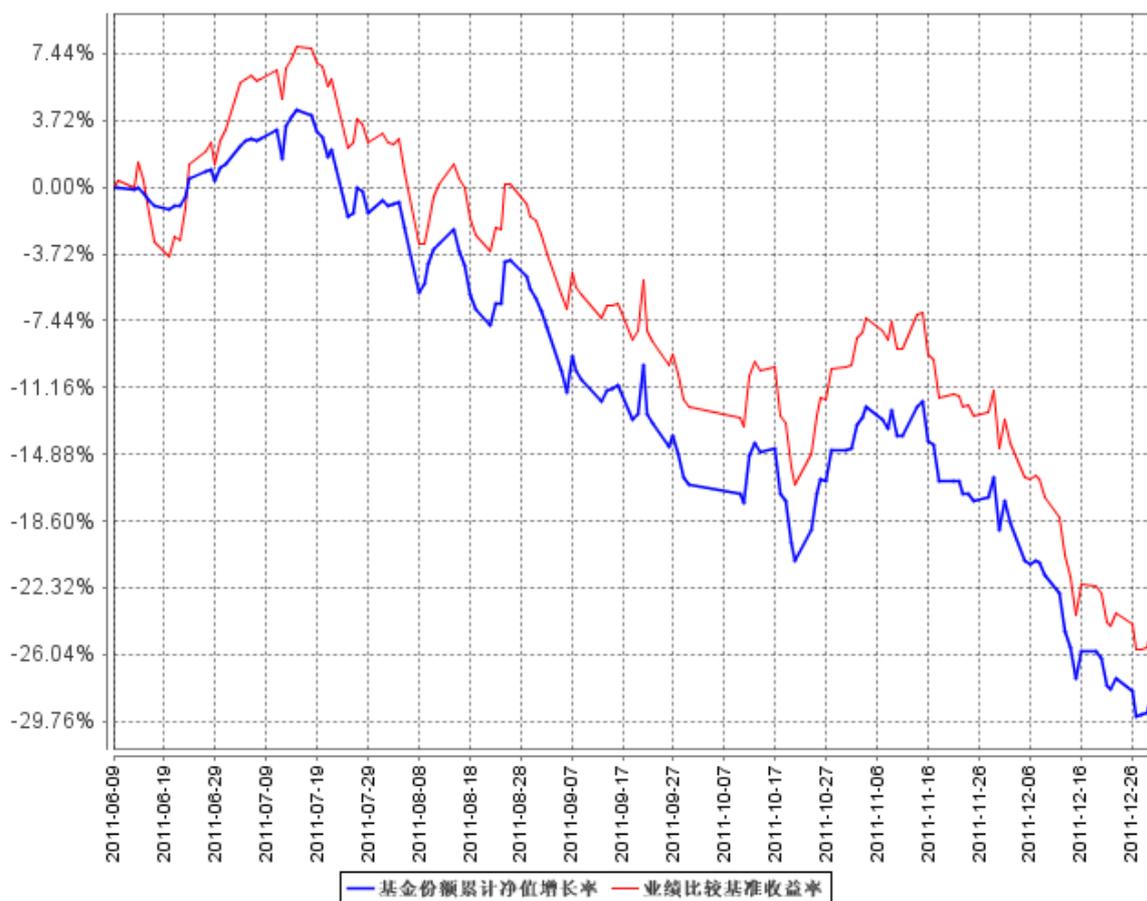
过去六个月	-28.88%	1.37%	-26.31%	1.41%	-2.57%	-0.04%
自基金合同 生效日起至 今	-28.10%	1.30%	-24.37%	1.39%	-3.73%	-0.09%

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

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

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

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



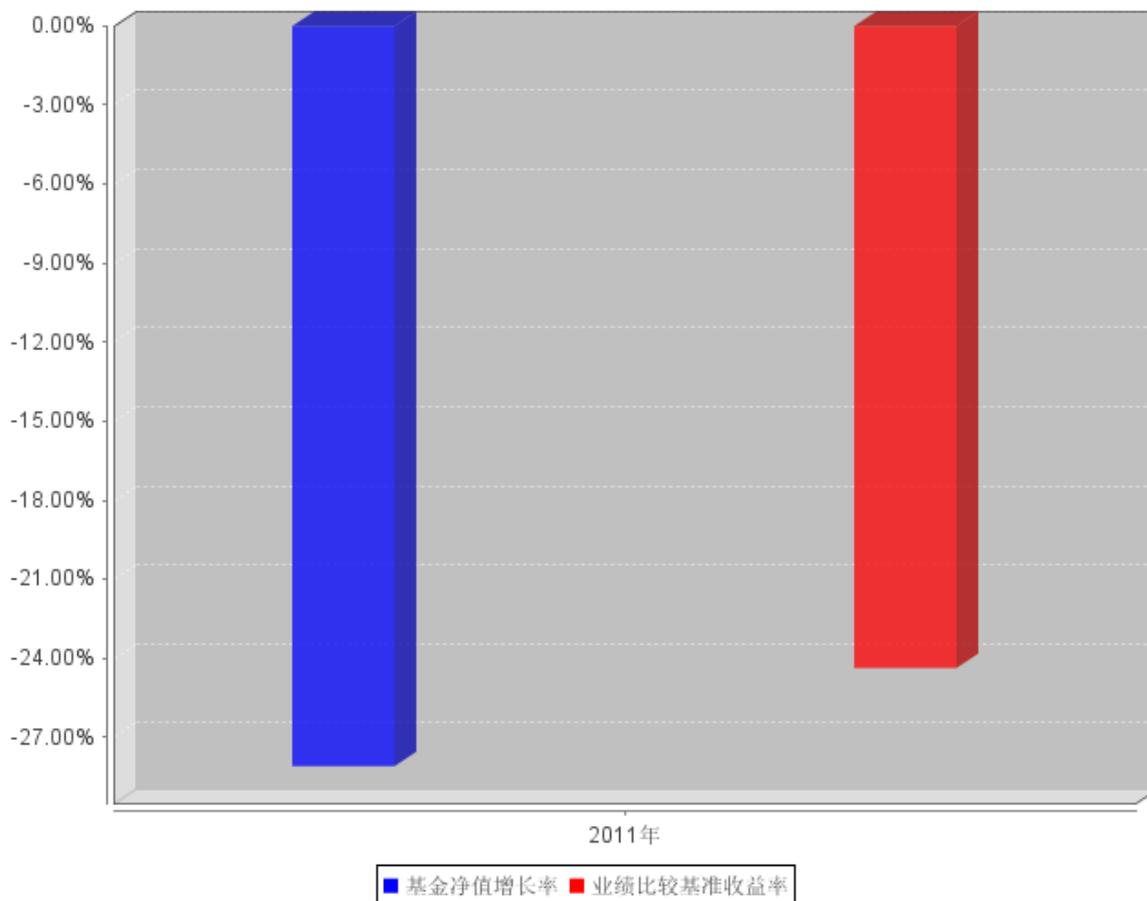
注：1、本基金基金合同于 2011 年 6 月 9 日正式生效，至本报告期末不满一年。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满，基金投资组合各项比例符合基金合同的约定：股票资产占基金资产 90%-95%，投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于股票资产的 90%。现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

3.2.3 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 2011 年 6 月 9 日正式生效，本年度相关数据根据实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2011	0.2000	2,768,716.48	38,994.87	2,807,711.35	
合计	0.2000	2,768,716.48	38,994.87	2,807,711.35	

注：本基金基金合同于 2011 年 6 月 9 日正式生效。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号 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：高清海

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：王伟毅

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。

公司目前下设市场部、营销部（分华东、华北、华南三大营销中心和电子商务部）、客服中心、基金投资部、研究部、理财顾问部、清算会计部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部、北京分公司、深圳分公司。截至 2011 年 12 月底，公司有正式员工 126 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 2011 年 12 月 31 日，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共 11 只开放式基金。

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		
刘毅先生	研究部研究副总监兼首席策略分析师、本基金基金经理兼泰信发展主题基金经理	2011 年 6 月 9 日	-	8	管理学博士。具有基金从业资格。曾任中国建设银行业务经理、天安保险资产管理总部投资经理。2008 年加入泰信基金管理有限公司，曾先后担任理财顾问部投资经理、蓝

					筹精选基金经理助理。自 2010 年 12 月 15 日起担任泰信发展主题股票基金经理。现同时担任研究部研究副总监、首席策略分析师。
陈大庆先生	本基金基金经理	2011 年 6 月 9 日	-	7	管理学硕士。具有基金从业资格。曾在中国建银投资证券有限责任公司、华林证券有限责任公司担任研究员。2008 年 2 月加入泰信基金管理有限公司，先后担任研究员、优质生活基金经理助理。
冯张鹏先生	本基金基金经理助理	2011 年 8 月 15 日	-	3	英国帝国理工大学工科博士。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。

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》、《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金的投资运作符合有关法律法规和基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（中国证券监督管理委员会公告[2008] 9 号）自 2008 年 3 月 20 日起执行。公司相应地制定了《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相

关的各环节，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。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本公司旗下管理的其他基金中不存在与本基金风格相似的情形，相互之间的业绩表现不具有可比性。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内本基金不存在异常交易行为。

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

2012 年，受国内外多重不利因素影响，A 股市场整体呈现单边下跌的走势，主要指数均出现较大的下跌，其中中证 200 指数全年跌幅 32.2%。

报告期内，我们严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差，报告期内跟踪误差较好地控制在了合同规定的范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金单位净值为 0.705 元，净值增长率为-28.10%，同期业绩比较基准收益率为-24.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2012 年，国内经济总体向好，但增速回落的趋势较为明显。中央经济工作会议提出“稳增长、控通胀”，继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策。我们判断，在换届之年，大规模新增基建投资的可能性并不大，信贷投放也难以出现较大幅度增长。不过随着通胀水平的逐季回落，货币政策的调整空间也在加大，预计年内将有几次下调存款准备金的机会，资金面紧张的状况将会有所改善。这对稳定证券市场估值水平有一定的正面作用。

经过 2011 年一年的下跌，A 股市场估值水平已经低于 2008 年低点。中证 200 指数成份股整体市盈率回落到 16.4 倍，市净率也只有 2.3 倍，我们认为这一估值水平已经基本体现了市场对上市公司未来业绩增速下降的预期。随着年报季报的逐步披露，投资者对上市公司下一阶段的业绩增长会有更明确的判断，估值水平有望向历史均值回归。

总体上看，业绩压力、融资压力还将制约 A 股市场的表现，阶段性的行情仍然需要较大力度

的流动性放松政策的配合。在相关政策出台之前，市场保持弱势震荡格局的概率较大。我们将继续严格遵守基金合同，坚持指数化投资策略，做好成份股研究工作，积极应对成份股调整和基金申购赎回，严格控制基金相对比较基准的跟踪误差，实现对中证 200 指数的有效跟踪，以维护投资者的利益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、泰信基金管理有限公司估值程序等事项的说明

委员会主席

韩波先生，副总经理，本科；曾先后任山东国投上海证券部财务经理，鲁信投资有限公司财务、投资管理部门经理，先后担任泰信基金管理有限公司财务负责人、总经理助理。

委员会成员：

唐国培先生，硕士，9 年基金从业经验。2002 年加入泰信基金管理有限公司，现任风险管理部经理。

庞少华先生，硕士，会计师，16 年证券从业经验。曾供职于天一证券有限责任公司稽核部内部稽核、营业部财务会计、总公司计划财务部。2005 年 1 月加入泰信基金管理有限公司，现任清算会计部经理。

朱志权先生，经济学学士，16 年证券从业经验。曾任职于长盛基金管理有限公司、富国基金管理有限公司、银河基金管理有限公司。2008 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，担任泰信优质生活基金经理。自 2010 年 1 月 16 日起兼任泰信优势增长基金基金经理。自 2011 年 12 月 13 日起担任基金投资部投资总监。

梁剑先生，硕士，具有 13 年证券从业经验，曾历任期货交易所研究员、券商研究员。2004 年 7 月加入泰信基金，先后担任金融工程部经理、研究部经理、泰信先行策略混合基金经理。现担任研究部研究副总监。

2、本基金基金经理不参与本基金估值。

3、参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、基金合同关于利润分配的约定：

1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；

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

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

二、本报告期内，本基金每 10 份基金份额分配 0.20 元，年度利润分配合计 2,807,711.35 元（其中，现金形式发放 2,768,716.48 元，再投资形式发放 38,994.87 元）。符合基金合同的约定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰信中证 200 指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2012)第 20429 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰信中证 200 指数证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的泰信中证 200 指数证券投资基金(以下简称“泰信中证 200 基金”)的财务报表,包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年 6 月 9 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是泰信中证 200 基金的基金管理人泰信基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为,上述泰信中证 200 基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发

	布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了泰信中证 200 基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年 6 月 9 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛竞 张振波
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号，企业天地 2 号楼，普华永道中心 11 楼，邮政编码 200021
审计报告日期	2012 年 3 月 23 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泰信中证 200 指数证券投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2011 年 12 月 31 日
资产：	
银行存款	4,851,420.38
结算备付金	683,990.46
存出保证金	52,710.09
交易性金融资产	90,766,675.53
其中：股票投资	90,766,675.53
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	1,314.48
应收股利	-
应收申购款	2,036.45
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	96,358,147.39
负债和所有者权益	本期末 2011 年 12 月 31 日
负债：	

短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	1,367.61
应付管理人报酬	60,112.90
应付托管费	12,881.33
应付销售服务费	-
应付交易费用	211,419.27
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	220,077.53
负债合计	505,858.64
所有者权益：	
实收基金	135,913,517.61
未分配利润	-40,061,228.86
所有者权益合计	95,852,288.75
负债和所有者权益总计	96,358,147.39

注：1. 报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.705 元，基金份额总额 135,913,517.61 份。

2. 财务报表的实际编制期间为 2011 年 6 月 9 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：泰信中证 200 指数证券投资基金

本报告期：2011 年 6 月 9 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期
	2011 年 6 月 9 日至 2011 年 12 月 31 日
一、收入	-30,752,366.06
1.利息收入	285,115.28
其中：存款利息收入	150,948.64
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	134,166.64
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-11,656,339.14
其中：股票投资收益	-12,091,494.41

基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	435,155.27
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-19,639,967.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	258,825.71
二、费用	2,710,965.78
1. 管理人报酬	589,519.87
2. 托管费	126,325.66
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	1,751,976.81
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	243,143.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-33,463,331.84
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-33,463,331.84

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信中证 200 指数证券投资基金

本报告期：2011 年 6 月 9 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 6 月 9 日至 2011 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）	316,786,119.38	-	316,786,119.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-33,463,331.84	-33,463,331.84
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）	-180,872,601.77	-3,790,185.67	-184,662,787.44
其中：1. 基金申购款	24,096,920.35	-1,699,827.68	22,397,092.67
2. 基金赎回款	-204,969,522.12	-2,090,357.99	-207,059,880.11
四、本期向基金份额持有	-	-2,807,711.35	-2,807,711.35

人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	135,913,517.61	-40,061,228.86	95,852,288.75

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：

_____ 高清海	_____ 韩波	_____ 庞少华
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰信中证 200 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 534 号《关于核准泰信中证 200 指数证券投资基金募集的批复》核准,由泰信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 316,771,140.56 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 228 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 6 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 316,786,119.38 份基金份额,其中认购资金利息折合 14,978.82 份基金份额。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 90%-95%,投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于股票资产的 90%。现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%,其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为:本基金的业绩比较基准为:95% X 中证 200 指数收益率 + 5% X 商业银行活期存款利率(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 2012 年 3 月 23 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”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年 6 月 9 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年 6 月 9 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》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。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金

派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
山东省国际信托有限公司（“山东国投”）	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（“青岛国信”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

无。

7.4.8.1.2 权证交易

无。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2011年6月9日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	589,519.87
其中：支付销售机构的客户维护费	121,990.11

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2011年6月9日(基金合同生效日)至2011年12月

	31 日
当期发生的基金应支付的托管费	126,325.66

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}$ 。

7.4.8.2.3 销售服务费

无。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2011 年 6 月 9 日至 2011 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2011 年 6 月 9 日）持有的基金份额	15,999,320.00
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	15,999,320.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	11.77%

注：基金管理人 泰信基金管理有限公司 在本会计期间认购本基金的交易委托中国银行办理，适用招募说明书中规定的认购费率，认购费为 1,000.00 元。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：人民币元

关联方名称	本期末 2011 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
山东信托	49,999,000.00	36.79%

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 6 月 9 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	4,851,420.38	141,695.46

注：本基金的银行存款由基金托管人 中国银行 保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000768	西飞国际	2011 年 12 月 28 日	资产重组	7.26	2012 年 1 月 4 日	7.61	78,567	776,283.52	570,396.42	-
600132	重庆啤酒	2011 年 12 月 23 日	重大事项未公告	28.45	2012 年 1 月 10 日	25.61	12,585	746,958.72	358,043.25	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

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

价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2011 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 89,838,235.86 元，属于第二层级的余额为 928,439.67 元，无属于第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，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，本基金分别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不将相关股票和债券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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层次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	90,766,675.53	94.20
	其中：股票	90,766,675.53	94.20
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	5,535,410.84	5.74
6	其他各项资产	56,061.02	0.06
7	合计	96,358,147.39	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,157,104.08	1.21
B	采掘业	8,287,470.24	8.65
C	制造业	47,271,680.59	49.32
C0	食品、饮料	6,545,664.95	6.83
C1	纺织、服装、皮毛	1,031,937.02	1.08
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,737,150.91	2.86
C5	电子	2,910,088.00	3.04
C6	金属、非金属	11,098,125.55	11.58
C7	机械、设备、仪表	12,446,504.61	12.99
C8	医药、生物制品	10,502,209.55	10.96
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,899,061.92	3.02
E	建筑业	2,335,294.39	2.44
F	交通运输、仓储业	3,676,651.79	3.84
G	信息技术业	4,955,887.99	5.17
H	批发和零售贸易	5,648,182.89	5.89
I	金融、保险业	2,576,705.92	2.69
J	房地产业	6,053,872.13	6.32
K	社会服务业	970,379.90	1.01
L	传播与文化产业	627,384.55	0.65
M	综合类	4,306,999.14	4.49
	合计	90,766,675.53	94.69

8.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	101,996	2,083,778.28	2.17
2	000423	东阿阿胶	33,279	1,429,333.05	1.49
3	600383	金地集团	287,301	1,422,139.95	1.48
4	600406	国电南瑞	39,744	1,240,012.80	1.29
5	600518	康美药业	102,144	1,146,055.68	1.20
6	600739	辽宁成大	86,970	1,068,861.30	1.12
7	600276	恒瑞医药	36,122	1,063,431.68	1.11
8	600068	葛洲坝	132,916	1,023,453.20	1.07
9	000709	河北钢铁	339,497	970,961.42	1.01
10	000402	金融街	153,343	927,725.15	0.97

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

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601117	中国化学	18,416,449.49	19.21
2	600118	中国卫星	17,601,141.05	18.36
3	002310	东方园林	16,825,375.37	17.55
4	600125	铁龙物流	15,803,459.24	16.49
5	600208	新潮中宝	14,253,661.67	14.87
6	002073	软控股份	13,549,470.90	14.14
7	000933	神火股份	11,461,667.14	11.96

8	000012	南玻 A	11,005,259.43	11.48
9	600096	云天化	10,683,230.44	11.15
10	600739	辽宁成大	10,312,329.54	10.76
11	600516	方大炭素	10,218,882.89	10.66
12	600383	金地集团	8,866,495.99	9.25
13	000680	山推股份	8,792,160.00	9.17
14	600582	天地科技	8,426,570.13	8.79
15	600481	双良节能	7,989,390.46	8.34
16	600518	康美药业	7,806,141.38	8.14
17	600859	王府井	7,700,027.25	8.03
18	000423	东阿阿胶	7,513,932.96	7.84
19	000528	柳工	7,186,949.26	7.50
20	600600	青岛啤酒	7,113,688.95	7.42
21	000876	新希望	7,005,381.00	7.31
22	600703	三安光电	6,640,932.22	6.93
23	600276	恒瑞医药	6,577,085.68	6.86
24	000778	新兴铸管	6,541,271.48	6.82
25	600887	伊利股份	6,337,303.83	6.61
26	002106	莱宝高科	6,328,677.29	6.60
27	600718	东软集团	6,219,440.95	6.49
28	000758	中色股份	6,031,740.83	6.29
29	000024	招商地产	5,715,866.19	5.96
30	000768	西飞国际	5,402,293.21	5.64
31	000709	河北钢铁	5,217,670.00	5.44
32	600312	平高电气	5,079,276.78	5.30
33	000039	中集集团	4,978,526.93	5.19
34	000422	湖北宜化	4,926,661.62	5.14
35	601369	陕鼓动力	4,903,284.75	5.12
36	000999	华润三九	4,888,012.49	5.10
37	600068	葛洲坝	4,868,315.30	5.08
38	000728	国元证券	4,744,675.80	4.95
39	000969	安泰科技	4,670,825.79	4.87
40	600998	九州通	4,595,983.65	4.79
41	002385	大北农	4,587,418.55	4.79
42	600970	中材国际	4,385,355.07	4.58
43	600415	小商品城	4,201,497.32	4.38

44	000009	中国宝安	4,075,561.42	4.25
45	600655	豫园商城	4,052,775.49	4.23
46	002405	四维图新	3,950,416.68	4.12
47	600690	青岛海尔	3,903,235.78	4.07
48	600694	大商股份	3,882,221.00	4.05
49	600406	国电南瑞	3,837,929.06	4.00
50	600100	同方股份	3,764,686.11	3.93
51	600535	天士力	3,712,304.82	3.87
52	600588	用友软件	3,626,533.91	3.78
53	002007	华兰生物	3,454,776.89	3.60
54	600239	云南城投	3,430,638.28	3.58
55	600893	航空动力	3,382,176.24	3.53
56	600108	亚盛集团	3,267,003.16	3.41
57	000725	京东方 A	3,230,686.00	3.37
58	002128	露天煤业	3,149,931.81	3.29
59	600010	包钢股份	3,143,632.00	3.28
60	000060	中金岭南	3,061,128.33	3.19
61	000623	吉林敖东	3,048,564.18	3.18
62	601888	中国国旅	3,041,126.25	3.17
63	600123	兰花科创	3,024,045.85	3.15
64	600812	华北制药	2,999,736.31	3.13
65	600331	宏达股份	2,995,447.91	3.13
66	000061	农产品	2,961,356.48	3.09
67	600166	福田汽车	2,918,467.24	3.04
68	600895	张江高科	2,910,350.11	3.04
69	002092	中泰化学	2,778,047.00	2.90
70	000402	金融街	2,768,883.90	2.89
71	601001	大同煤业	2,762,700.64	2.88
72	000839	中信国安	2,736,314.53	2.85
73	600058	五矿发展	2,729,838.63	2.85
74	600177	雅戈尔	2,705,473.65	2.82
75	000937	冀中能源	2,690,389.00	2.81
76	600352	浙江龙盛	2,686,228.00	2.80
77	002498	汉缆股份	2,661,576.51	2.78
78	000729	燕京啤酒	2,618,072.84	2.73
79	600997	开滦股份	2,611,038.16	2.72

80	600161	天坛生物	2,599,594.87	2.71
81	600219	南山铝业	2,549,896.68	2.66
82	000630	铜陵有色	2,537,816.00	2.65
83	600062	双鹤药业	2,530,011.11	2.64
84	600598	北大荒	2,526,491.54	2.64
85	600143	金发科技	2,477,508.89	2.58
86	601333	广深铁路	2,435,620.00	2.54
87	600546	山煤国际	2,427,585.02	2.53
88	000718	苏宁环球	2,416,265.68	2.52
89	600271	航天信息	2,411,910.92	2.52
90	600316	洪都航空	2,409,681.28	2.51
91	000401	冀东水泥	2,378,725.00	2.48
92	600804	鹏博士	2,377,470.36	2.48
93	600881	亚泰集团	2,361,819.20	2.46
94	600809	山西汾酒	2,360,142.44	2.46
95	601101	昊华能源	2,357,644.74	2.46
96	600395	盘江股份	2,352,624.19	2.45
97	000869	张裕 A	2,318,392.76	2.42
98	000783	长江证券	2,299,073.50	2.40
99	600132	重庆啤酒	2,289,530.69	2.39
100	600971	恒源煤电	2,284,991.39	2.38
101	600085	同仁堂	2,277,222.23	2.38
102	600595	中孚实业	2,256,572.40	2.35
103	600497	驰宏锌锗	2,228,948.40	2.33
104	600009	上海机场	2,198,236.66	2.29
105	000100	TCL 集团	2,173,722.00	2.27
106	600153	建发股份	2,021,344.58	2.11
107	600583	海油工程	2,016,969.82	2.10
108	600196	复星医药	1,972,955.81	2.06
109	600307	酒钢宏兴	1,969,625.21	2.05
110	600642	申能股份	1,964,561.84	2.05
111	000562	宏源证券	1,960,661.66	2.05
112	000960	锡业股份	1,940,983.24	2.02
113	600549	厦门钨业	1,940,261.00	2.02
114	600839	四川长虹	1,929,227.00	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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601117	中国化学	16,707,268.70	17.43
2	600118	中国卫星	16,530,664.20	17.25
3	002310	东方园林	15,775,411.85	16.46
4	600125	铁龙物流	14,890,480.28	15.53
5	600208	新湖中宝	13,890,483.59	14.49
6	002073	软控股份	12,712,495.17	13.26
7	600096	云天化	10,379,104.58	10.83
8	000933	神火股份	10,263,019.25	10.71
9	600516	方大炭素	9,887,845.55	10.32
10	000012	南玻 A	9,648,367.81	10.07
11	600739	辽宁成大	8,860,832.73	9.24
12	000680	山推股份	8,182,615.14	8.54
13	600481	双良节能	7,817,842.29	8.16
14	600582	天地科技	7,761,294.48	8.10
15	600859	王府井	7,221,293.31	7.53
16	600383	金地集团	7,042,659.69	7.35
17	600518	康美药业	6,622,425.36	6.91
18	000423	东阿阿胶	6,337,782.40	6.61
19	600703	三安光电	6,304,296.18	6.58
20	600600	青岛啤酒	6,238,923.08	6.51
21	000528	柳工	6,151,453.91	6.42
22	000876	新希望	6,101,466.46	6.37
23	002106	莱宝高科	5,911,635.80	6.17
24	000778	新兴铸管	5,902,184.36	6.16
25	600718	东软集团	5,604,317.49	5.85
26	600276	恒瑞医药	5,598,016.54	5.84
27	000758	中色股份	5,115,387.87	5.34
28	000024	招商地产	4,810,107.54	5.02
29	000768	西飞国际	4,577,987.14	4.78
30	600312	平高电气	4,572,313.68	4.77
31	600887	伊利股份	4,464,932.56	4.66
32	002385	大北农	4,388,099.02	4.58

33	601369	陕鼓动力	4,382,257.85	4.57
34	000999	华润三九	4,317,483.71	4.50
35	600998	九州通	4,316,002.64	4.50
36	000422	湖北宜化	4,191,759.13	4.37
37	000728	国元证券	4,150,840.99	4.33
38	000969	安泰科技	4,087,263.61	4.26
39	000709	河北钢铁	3,924,311.89	4.09
40	000039	中集集团	3,922,324.29	4.09
41	600970	中材国际	3,749,342.56	3.91
42	002405	四维图新	3,698,237.63	3.86
43	600068	葛洲坝	3,478,989.19	3.63
44	600655	豫园商城	3,287,566.98	3.43
45	600588	用友软件	3,257,502.57	3.40
46	600415	小商品城	3,242,791.82	3.38
47	600694	大商股份	3,065,165.17	3.20
48	600893	航空动力	3,044,323.99	3.18
49	600535	天士力	3,017,929.50	3.15
50	600239	云南城投	2,991,578.40	3.12
51	000009	中国宝安	2,976,279.00	3.11
52	600100	同方股份	2,873,673.15	3.00
53	002007	华兰生物	2,790,828.87	2.91
54	600690	青岛海尔	2,788,109.10	2.91
55	600108	亚盛集团	2,698,975.28	2.82
56	601888	中国国旅	2,662,025.83	2.78
57	600406	国电南瑞	2,565,423.21	2.68
58	002128	露天煤业	2,482,806.00	2.59
59	000061	农产品	2,422,183.61	2.53
60	600895	张江高科	2,418,641.83	2.52
61	600812	华北制药	2,392,668.32	2.50
62	600331	宏达股份	2,355,765.13	2.46
63	600166	福田汽车	2,312,299.00	2.41
64	002498	汉缆股份	2,301,636.76	2.40
65	600161	天坛生物	2,243,172.49	2.34
66	002092	中泰化学	2,216,007.24	2.31
67	600123	兰花科创	2,179,148.93	2.27
68	000725	京东方 A	2,173,037.64	2.27
69	601001	大同煤业	2,107,288.52	2.20
70	000839	中信国安	2,047,868.59	2.14

71	600352	浙江龙盛	2,031,513.76	2.12
72	600997	开滦股份	2,026,104.89	2.11
73	000718	苏宁环球	2,016,522.73	2.10
74	600546	山煤国际	2,010,059.20	2.10
75	000060	中金岭南	1,939,284.25	2.02

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	654,782,530.49
卖出股票收入（成交）总额	532,814,327.04

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

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

报告期末本基金未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

报告期末本基金未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选库之外的股票。

8.9.3 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	52,710.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,314.48
5	应收申购款	2,036.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	56,061.02

8.9.4 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。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.9.5.2 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。

8.9.6 报告期内本基金未投资控股股东主承销的证券，未从二级市场投资分离交易可转债附送的权证，投资流通受限证券未违反相关法规或本基金管理公司的规定。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,160	117,166.83	87,548,966.55	64.42%	48,364,551.06	35.58%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	133,821.69	0.0985%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年6月9日）基金份额总额	316,786,119.38
本报告期期初基金份额总额	-
本报告期基金总申购份额	24,096,920.35
减：本报告期基金总赎回份额	204,969,522.12
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	135,913,517.61

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理。因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理，刘慧军女士不再担任中国银行托管及投资者服务部副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2、本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

泰信基金管理有限公司（以下简称“本公司”）于 2010 年 8 月 3 日通过法院拍卖竞得上海市浦东新区 256 号 36、37 层房产，其中该房产的 3604 室在拍卖时带租约，由拍卖被执行方即上海宏普实业投资有限公司（以下简称“宏普”）出租给华远星海运有限公司（以下简称“华远星”）。

2011 年 5 月，本公司与华远星就 3604 室房屋的使用书面约定双方租赁期间自 2010 年 9 月 21 日至 2011 年 5 月 31 日。本公司于 2011 年 7 月 6 日向华远星正式开具租金发票，金额 638,961.85 元。但华远星认为本公司应完全取代宏普并承担原租赁合同中的义务，因此在支付租金时抵扣其已向宏普缴纳的保证金 235,416.90 元。经过本公司多次追讨，仅向本公司支付了部分租金 403,544.95 元。

本公司于 2011 年 11 月就该房屋租赁纠纷向上海市浦东新区人民法院递交了诉讼状，请求法院判令华远星向本公司支付剩余租金 235,416.90 元，同时支付违约金 12,947.93 元（计至 2011 年 10 月 31 日），并于 2012 年 1 月 4 日首次开庭审理。目前，此案仍在审理当中。

本公司认为，上述案件不会对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响。

除此以外，无其他涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费为人民币 6 万元。该审计

机构从基金合同生效日（2011 年 6 月 9 日）开始为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	1	234,810,771.92	19.78%	199,589.74	20.11%	-
第一创业	1	117,902,091.52	9.93%	100,216.03	10.10%	-
中航证券	1	108,791,171.79	9.16%	88,393.56	8.91%	-
上海证券	1	107,314,393.77	9.04%	91,216.81	9.19%	-
华泰联合证券	1	101,753,187.82	8.57%	82,675.41	8.33%	-
招商证券	1	85,603,429.42	7.21%	69,553.34	7.01%	-
中国建银投资证券	1	69,122,582.49	5.82%	58,754.84	5.92%	-
东方证券	2	63,160,332.46	5.32%	51,318.23	5.17%	-
万联证券	1	61,345,405.31	5.17%	52,143.73	5.25%	-
国元证券	1	54,792,162.98	4.62%	46,573.26	4.69%	-
中金公司	1	53,030,875.89	4.47%	45,076.20	4.54%	-
国泰君安	1	44,007,500.36	3.71%	35,756.01	3.60%	-
海通证券	2	29,848,404.98	2.51%	24,251.83	2.44%	-
中信建投	1	23,617,656.71	1.99%	20,074.74	2.02%	-
浙商证券	1	16,301,044.37	1.37%	13,855.90	1.40%	-
方正证券	1	9,053,440.03	0.76%	7,355.89	0.74%	-
金元证券	1	3,694,834.74	0.31%	3,140.81	0.32%	-
中银国际	2	2,917,636.57	0.25%	2,370.64	0.24%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

中信证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
长财证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
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银行托管的泰信优质生活基金、泰信蓝筹精选基金、泰信增强收益基金、泰信中小盘精选基金共用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证	-	-	-	-	-	-

券						
招商证券	-	-	-	-	-	-
中国建银投 资证券	-	-	150,000,000.00	100.00%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
长财证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

泰信基金管理有限公司
2012 年 3 月 26 日