

泰信中证 200 指数证券投资基金 2012 年半年度报告

2012 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：2012 年 8 月 29 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 2012 年 8 月 27 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 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 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 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 10 |
| 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..... | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| §5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| 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..... | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表..... | 14 |
| 6.2 利润表..... | 15 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 16 |
| 6.4 报表附注..... | 17 |
| §7 投资组合报告 | 31 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 31 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 32 |
| 7.3 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..... | 33 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 38 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 40 |
| 7.6 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..... | 40 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细..... | 40 |
| 7.8 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..... | 40 |
| 7.9 投资组合报告附注..... | 40 |
| §8 基金份额持有人信息 | 41 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 41 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况..... | 41 |
| §9 开放式基金份额变动 | 41 |

| | |
|---------------------------------------|-----------|
| §10 重大事件揭示 | 42 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 42 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 42 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 43 |
| 10.8 其他重大事件..... | 44 |
| §11 备查文件目录 | 45 |
| 11.1 备查文件目录..... | 45 |
| 11.2 存放地点..... | 45 |
| 11.3 查阅方式..... | 45 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-------------------|
| 基金名称 | 泰信中证 200 指数证券投资基金 |
| 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 | 135,076,362.95 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 | 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%。 |
| 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。 |

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 |
| 注册地址 | | 上海市浦东新区浦东南路 256 号 37 层 | 北京西城区复兴门内大街 1 号 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区浦东南路 | 北京西城区复兴门内大街 1 号 |

| | | |
|-------|-------------------------|--------|
| | 256 号 华夏银行大厦 36-37 层 | |
| 邮政编码 | 200120 | 100818 |
| 法定代表人 | 孟凡利 | 肖钢 |

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》、《证券时报》 |
| 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 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|----------------------------------|
| 注册登记机构 | 泰信基金管理有限公司 | 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(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | -10,937,154.82 |
| 本期利润 | 1,592,137.52 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0117 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.57% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.70% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2012 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | -38,235,673.19 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2831 |
| 期末基金资产净值 | 96,840,689.76 |
| 期末基金份额净值 | 0.717 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2012 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | -26.88% |

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

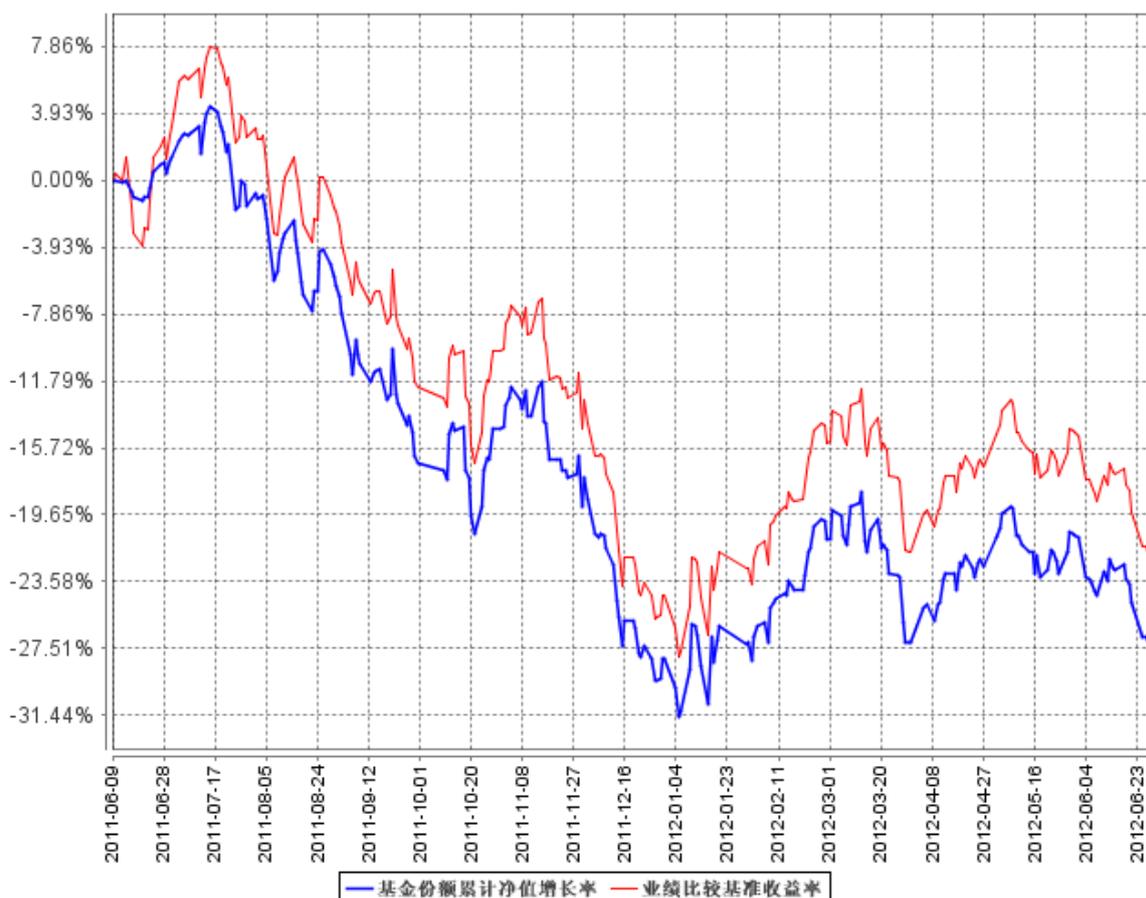
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-----------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | -7.60% | 1.15% | -8.01% | 1.17% | 0.41% | -0.02% |
| 过去三个月 | 0.42% | 1.17% | 0.16% | 1.18% | 0.26% | -0.01% |
| 过去六个月 | 1.70% | 1.47% | 3.57% | 1.48% | -1.87% | -0.01% |
| 过去一年 | -27.67% | 1.42% | -23.68% | 1.45% | -3.99% | -0.03% |
| 自基金合同生效日起至 今 | -26.88% | 1.38% | -21.67% | 1.44% | -5.21% | -0.06% |

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%。

本基金的投资标的为中证 200 指数，且本基金现金以及到期日在一年之内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，因此本基金将业绩比较基准定为中证 200 指数收益率×95% + 商业银行活期存款利率(税后)×5%。

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。

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。

§ 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：高清海

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：王伟毅

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）、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 2012 年 6 月底，公司有正式员工 119 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 2012 年 6 月 30 日，泰信基金管理有限公司共管理泰信天天收益货币、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、泰信保本混合共 12 只开放式基金及泰信财富分级 1 号资产管理计划。

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 | | |
| 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 | - | 9 | 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 | - | 8 | 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 | - | 4 | 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 公平交易制度和控制方法

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

- 1、建立统一的研究平台，所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放。
- 2、建立全公司投资对象备选库和各投资组合的投资对象备选库。
- 3、投委会作为公司受托资产投资的最高决策机构，主要负责对公司所管理的受托资产进行投资决策。投资总监在其权限范围内审批超出投资组合经理权限的投资计划。投资组合经理在其权限范围内进行投资决策。
- 4、投资组合经理同时管理多个投资组合时，必须公平公正的对待管理的所有投资组合，除申

购赎回、个股投资比例超标等客观因素之外，同一交易日投资同一交易品种时，应尽可能使他们获得相同或相近的交易价格。

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

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

6、风险管理部通过交易系统监控指标设置，实时监控交易指令，禁止同一投资组合内部的两日反向交易，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

2012 年上半年 A 股市场可谓一波三折，在年初 1 月和 2 月经历了较大的上涨行情后，3 月份随着管理层下调 2012 年 GDP 增长目标以及对房地产的明确调控，A 股市场转为下跌，指数在 4 月份调整反弹后，尽管有央行降息和政府“稳增长”政策的推出，由于对经济基本面的担忧和外部环境的动荡，5、6 月份 A 股市场持续低迷。上半年上证指数上涨 1.18%，同期中证 200 指数上涨 3.67%。

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 0.717 元，净值增长率为 1.70%，同期比较基准净值增长率为 3.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济增速放缓将是一个长期趋势，短期来看，3 季度中国经济仍有可能继续下行，但同时见底的概率也在加大，国家的政策越来越明确的倾向于稳增长，流动性也将会更加宽松，近期 PMI 数据和地方各种具体稳增长政策的推出将有利于投资者乐观情绪的释放。下半年宏观经济形势会更加乐观，欧债危机和美国经济的形势也会更加明朗，将给 A 股市场带来较好和较为确定的投资机会。

我们将继续严格遵守合同，坚持指数化投资策略，积极应对成分股调整和基金申购赎回，严格控制基金的跟踪误差，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，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经理。

庞少华先生，硕士，会计师。2005 年 1 月加入泰信基金管理有限公司，现任公司清算会计部经理。

朱志权先生，经济学学士。2008 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，现任基金投资部投资总监兼泰信先行策略、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、本报告期利润分配情况的说明：

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：泰信中证 200 指数证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2012 年 6 月 30 日 | 上年度末 2011 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 5,993,871.45 | 4,851,420.38 |
| 结算备付金 | | 10,975.68 | 683,990.46 |
| 存出保证金 | | 31,177.49 | 52,710.09 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 89,207,854.85 | 90,766,675.53 |
| 其中：股票投资 | | 89,207,854.85 | 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 1,882,049.65 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 1,056.85 | 1,314.48 |
| 应收股利 | | 45,823.87 | - |
| 应收申购款 | | 1,980.98 | 2,036.45 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 97,174,790.82 | 96,358,147.39 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2012 年 6 月 30 日 | 上年度末 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 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 | | 57,907.45 | 60,112.90 |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付托管费 | | 12,408.72 | 12,881.33 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 124,970.85 | 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 | 6.4.7.8 | 138,814.04 | 220,077.53 |
| 负债合计 | | 334,101.06 | 505,858.64 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 135,076,362.95 | 135,913,517.61 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | -38,235,673.19 | -40,061,228.86 |
| 所有者权益合计 | | 96,840,689.76 | 95,852,288.75 |
| 负债和所有者权益总计 | | 97,174,790.82 | 96,358,147.39 |

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.717 元，基金份额总额 135,076,362.95 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信中证 200 指数证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2011 年 6 月 9 日（基金合 同摘要）至 2011 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|---|
| 一、收入 | | 2,727,637.78 | 4,027,783.88 |
| 1.利息收入 | | 23,069.49 | 224,444.96 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 23,069.49 | 90,278.32 |
| 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） | | -9,827,443.39 | 940,463.73 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -10,561,587.98 | 859,604.51 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 734,144.59 | 80,859.22 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 12,529,292.34 | 2,862,875.19 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 2,719.34 | - |

| | | | |
|----------------------------|----------|--------------|--------------|
| 列) | | | |
| 二、费用 | | 1,135,500.26 | 538,737.79 |
| 1. 管理人报酬 | | 353,023.31 | 127,348.77 |
| 2. 托管费 | | 75,647.83 | 27,289.01 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 556,683.08 | 353,656.12 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 150,146.04 | 30,443.89 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 1,592,137.52 | 3,489,046.09 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 1,592,137.52 | 3,489,046.09 |

6.3 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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） | 135,913,517.61 | -40,061,228.86 | 95,852,288.75 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 1,592,137.52 | 1,592,137.52 |
| 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） | -837,154.66 | 233,418.15 | -603,736.51 |
| 其中：1. 基金申购款 | 2,119,703.16 | -501,703.06 | 1,618,000.10 |
| 2. 基金赎回款 | -2,956,857.82 | 735,121.21 | -2,221,736.61 |
| 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） | 135,076,362.95 | -38,235,673.19 | 96,840,689.76 |
| 项目 | 上年度可比期间 2011 年 6 月 9 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日 | | |

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)。

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 2012 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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

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[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2012年6月30日 |
|----------------|-------------------|
| 活期存款 | 5,993,871.45 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 5,993,871.45 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2012年6月30日 | | |
|--------|-------------------|---------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 96,318,530.42 | 89,207,854.85 | -7,110,675.57 |
| 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 | 96,318,530.42 | 89,207,854.85 | -7,110,675.57 |
|----|---------------|---------------|---------------|

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2012年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,052.19 |
| 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 | 4.50 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | 0.16 |
| 其他 | - |
| 合计 | 1,056.85 |

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2012年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 124,970.85 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 124,970.85 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2012 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 预提费用 | 133,738.10 |
| 应付指数使用费 | 5,075.94 |
| 合计 | 138,814.04 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 135,913,517.61 | 135,913,517.61 |
| 本期申购 | 2,119,703.16 | 2,119,703.16 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -2,956,857.82 | -2,956,857.82 |
| 本期末 | 135,076,362.95 | 135,076,362.95 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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 | -17,582,354.49 | -22,478,874.37 | -40,061,228.86 |
| 本期利润 | -10,937,154.82 | 12,529,292.34 | 1,592,137.52 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 171,540.37 | 61,877.78 | 233,418.15 |
| 其中：基金申购款 | -436,960.63 | -64,742.43 | -501,703.06 |
| 基金赎回款 | 608,501.00 | 126,620.21 | 735,121.21 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -28,347,968.94 | -9,887,704.25 | -38,235,673.19 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 19,627.29 |
| 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 | 3,441.90 |
| 其他 | 0.30 |
| 合计 | 23,069.49 |

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 182,716,321.72 |
| 减：卖出股票成本总额 | 193,277,909.70 |
| 买卖股票差价收入 | -10,561,587.98 |

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 734,144.59 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 734,144.59 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 12,529,292.34 |
| ——股票投资 | 12,529,292.34 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| 2. 衍生工具 | - |

| | |
|--------|---------------|
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 合计 | 12,529,292.34 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 2,671.65 |
| 转换费收入 | 47.69 |
| 合计 | 2,719.34 |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 556,683.08 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 556,683.08 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 29,835.26 |
| 信息披露费 | 99,452.08 |
| 银行汇划费手续费 | 1,821.50 |
| 债券帐户维护费 | 8,950.76 |
| 指数使用费 | 10,086.44 |
| 合计 | 150,146.04 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 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**

无。

6.4.9.2 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、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 | 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 |

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**6.4.10.1.1 股票交易**

无。

6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2011 年 6 月 9 日(基金合同生效日) 至 2011 年 6 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 353,023.31 | 127,348.77 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 68,235.62 | 30,421.27 |

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的 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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2011 年 6 月 9 日(基金合同生效日) 至 2011 年 6 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 75,647.83 | 27,289.01 |

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：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2011 年 6 月 9 日(基金合同生效日) 至 2011 年 6 月 30 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 | 15,999,320.00 | - |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 15,999,320.00 | 15,999,320.00 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 11.84% | 5.05% |

6.4.10.4.2 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：人民币元

| 关联方名称 | 本期末 2012 年 6 月 30 日 | 上年度末 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 | 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 | 49,999,000.00 | 37.02% | 49,999,000.00 | 36.79% |

6.4.10.5 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 2012年1月1日至2012年6月30日 | | 上年度可比期间 2011年6月9日(基金合同生效日)至 2011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 | 5,993,871.45 | 19,627.29 | 157,857,335.04 | 90,278.32 |

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

报告期内本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 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 |
|----------|----------|----------------|------------|----------------|---------------|----------------|-----------|------------|------------|--------|
| 000059 | 辽通化 工 | 2012年6月 26日 | 重大事项 停牌 | 7.91 | 2012年7月 3日 | 8.15 | 35,000 | 350,919.53 | 276,850.00 | - |
| 002500 | 山西证 券 | 2012年5月 15日 | 重大事项 停牌 | 8.19 | - | - | 28,973 | 195,737.41 | 237,288.87 | - |

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型证券投资基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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。

6.4.13.2 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约责任，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。

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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金等，其余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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2012年6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|---------------------|---------------------|----------|----------|----------------------|----------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 5,993,871.45 | - | - | - | 5,993,871.45 |
| 结算备付金 | 10,975.68 | - | - | - | 10,975.68 |
| 存出保证金 | - | - | - | 31,177.49 | 31,177.49 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 89,207,854.85 | 89,207,854.85 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 1,882,049.65 | 1,882,049.65 |
| 应收利息 | - | - | - | 1,056.85 | 1,056.85 |
| 应收股利 | - | - | - | 45,823.87 | 45,823.87 |
| 应收申购款 | - | - | - | 1,980.98 | 1,980.98 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 6,004,847.13 | - | - | 91,169,943.69 | 97,174,790.82 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 57,907.45 | 57,907.45 |
| 应付托管费 | - | - | - | 12,408.72 | 12,408.72 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 124,970.85 | 124,970.85 |
| 其他负债 | - | - | - | 138,814.04 | 138,814.04 |
| 负债总计 | - | - | - | 334,101.06 | 334,101.06 |
| 利率敏感度缺口 | 6,004,847.13 | - | - | 90,835,842.63 | 96,840,689.76 |
| 上年度末 2011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 | 4,851,420.38 | - | - | - | 4,851,420.38 |
| 结算备付金 | 683,990.46 | - | - | - | 683,990.46 |
| 存出保证金 | - | - | - | 52,710.09 | 52,710.09 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 90,766,675.53 | 90,766,675.53 |
| 应收利息 | - | - | - | 1,314.48 | 1,314.48 |
| 应收申购款 | - | - | - | 2,036.45 | 2,036.45 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 5,535,410.84 | - | - | 90,822,736.55 | 96,358,147.39 |

| | | | | | |
|----------------|---------------------|---|---|----------------------|----------------------|
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,367.61 | 1,367.61 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 60,112.90 | 60,112.90 |
| 应付托管费 | - | - | - | 12,881.33 | 12,881.33 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 211,419.27 | 211,419.27 |
| 其他负债 | - | - | - | 220,077.53 | 220,077.53 |
| 负债总计 | - | - | - | 505,858.64 | 505,858.64 |
| 利率敏感度缺口 | 5,535,410.84 | - | - | 90,316,877.91 | 95,852,288.75 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2011 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（2011 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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和债券，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采取“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 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%。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2012 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2011 年 12 月 31 日 | |
|--------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资 产净值比 例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 89,207,854.85 | 92.12 | 90,766,675.53 | 94.69 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 89,207,854.85 | 92.12 | 90,766,675.53 | 94.69 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 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（2012 年 6 月 30 日） |
| | 业绩比较基准上升 5% | 6,002,041.91 |
| | 业绩比较基准下降 5% | -6,002,041.91 |

注：截至 2011 年 12 月 31 日本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此无法对本基金资产净值对于其他价格风险的敏感性作定量分析。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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 | 89,207,854.85 | 91.80 |
| | 其中：股票 | 89,207,854.85 | 91.80 |
| 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 | 6,004,847.13 | 6.18 |
| 6 | 其他各项资产 | 1,962,088.84 | 2.02 |
| | 合计 | 97,174,790.82 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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 | 1,347,040.57 | 1.39 |
| B | 采掘业 | 7,753,345.10 | 8.01 |
| C | 制造业 | 45,587,757.95 | 47.08 |
| C0 | 食品、饮料 | 6,246,654.06 | 6.45 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 806,748.23 | 0.83 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 2,997,098.56 | 3.09 |
| C5 | 电子 | 2,412,224.91 | 2.49 |
| C6 | 金属、非金属 | 10,805,248.28 | 11.16 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 10,644,569.17 | 10.99 |
| C8 | 医药、生物制品 | 11,583,362.24 | 11.96 |
| C99 | 其他制造业 | 91,852.50 | 0.09 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 2,484,073.74 | 2.57 |
| E | 建筑业 | 2,556,915.07 | 2.64 |
| F | 交通运输、仓储业 | 2,375,519.74 | 2.45 |
| G | 信息技术业 | 4,715,544.90 | 4.87 |
| H | 批发和零售贸易 | 5,197,197.69 | 5.37 |
| I | 金融、保险业 | 5,042,894.08 | 5.21 |
| J | 房地产业 | 5,948,105.13 | 6.14 |
| K | 社会服务业 | 1,095,652.46 | 1.13 |
| L | 传播与文化产业 | 577,856.01 | 0.60 |
| M | 综合类 | 4,525,952.41 | 4.67 |
| | 合计 | 89,207,854.85 | 92.12 |

7.2.2 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。

7.3 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

7.3.1 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 | 600887 | 伊利股份 | 92,651 | 1,906,757.58 | 1.97 |
| 2 | 600383 | 金地集团 | 259,008 | 1,678,371.84 | 1.73 |
| 3 | 600518 | 康美药业 | 89,189 | 1,375,294.38 | 1.42 |
| 4 | 600739 | 辽宁成大 | 81,878 | 1,277,296.80 | 1.32 |
| 5 | 000423 | 东阿阿胶 | 30,398 | 1,216,223.98 | 1.26 |
| 6 | 600690 | 青岛海尔 | 93,760 | 1,098,867.20 | 1.13 |
| 7 | 601009 | 南京银行 | 124,412 | 1,059,990.24 | 1.09 |
| 8 | 600276 | 恒瑞医药 | 35,892 | 1,030,459.32 | 1.06 |
| 9 | 600406 | 国电南瑞 | 54,738 | 1,023,053.22 | 1.06 |
| 10 | 000024 | 招商地产 | 39,836 | 977,177.08 | 1.01 |
| 11 | 000402 | 金融街 | 140,307 | 916,204.71 | 0.95 |
| 12 | 000783 | 长江证券 | 99,361 | 904,185.10 | 0.93 |
| 13 | 000709 | 河北钢铁 | 307,654 | 839,895.42 | 0.87 |
| 14 | 000100 | TCL 集团 | 394,835 | 801,515.05 | 0.83 |
| 15 | 000630 | 铜陵有色 | 41,143 | 794,059.90 | 0.82 |
| 16 | 600068 | 葛洲坝 | 121,122 | 790,926.66 | 0.82 |
| 17 | 600100 | 同方股份 | 92,059 | 775,136.78 | 0.80 |
| 18 | 600600 | 青岛啤酒 | 20,177 | 770,559.63 | 0.80 |
| 19 | 600642 | 申能股份 | 164,460 | 758,160.60 | 0.78 |
| 20 | 000623 | 吉林敖东 | 42,740 | 741,111.60 | 0.77 |
| 21 | 000878 | 云南铜业 | 41,134 | 736,298.60 | 0.76 |
| 22 | 600660 | 福耀玻璃 | 93,203 | 728,847.46 | 0.75 |
| 23 | 000060 | 中金岭南 | 83,926 | 723,442.12 | 0.75 |
| 24 | 600123 | 兰花科创 | 39,850 | 719,691.00 | 0.74 |
| 25 | 600009 | 上海机场 | 56,099 | 714,701.26 | 0.74 |
| 26 | 600549 | 厦门钨业 | 15,836 | 695,358.76 | 0.72 |
| 27 | 600583 | 海油工程 | 113,083 | 688,675.47 | 0.71 |
| 28 | 000012 | 南玻 A | 76,429 | 687,861.00 | 0.71 |
| 29 | 600196 | 复星医药 | 66,149 | 681,996.19 | 0.70 |
| 30 | 000039 | 中集集团 | 50,155 | 667,061.50 | 0.69 |
| 31 | 600085 | 同仁堂 | 37,958 | 662,367.10 | 0.68 |
| 32 | 600177 | 雅戈尔 | 77,671 | 659,426.79 | 0.68 |
| 33 | 601117 | 中国化学 | 114,266 | 659,314.82 | 0.68 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|---------|------------|------|
| 34 | 600535 | 天士力 | 14,995 | 655,581.40 | 0.68 |
| 35 | 002422 | 科伦药业 | 13,931 | 650,020.46 | 0.67 |
| 36 | 000728 | 国元证券 | 58,755 | 641,017.05 | 0.66 |
| 37 | 600143 | 金发科技 | 107,272 | 640,413.84 | 0.66 |
| 38 | 000009 | 中国宝安 | 63,435 | 634,350.00 | 0.66 |
| 39 | 600369 | 西南证券 | 55,928 | 632,545.68 | 0.65 |
| 40 | 000581 | 威孚高科 | 22,882 | 626,966.80 | 0.65 |
| 41 | 600066 | 宇通客车 | 27,534 | 618,413.64 | 0.64 |
| 42 | 600415 | 小商品城 | 79,203 | 617,783.40 | 0.64 |
| 43 | 600166 | 福田汽车 | 85,962 | 614,628.30 | 0.63 |
| 44 | 600881 | 亚泰集团 | 110,152 | 605,836.00 | 0.63 |
| 45 | 600271 | 航天信息 | 32,019 | 605,479.29 | 0.63 |
| 46 | 002155 | 辰州矿业 | 31,213 | 604,283.68 | 0.62 |
| 47 | 000562 | 宏源证券 | 34,997 | 578,850.38 | 0.60 |
| 48 | 600376 | 首开股份 | 43,585 | 577,065.40 | 0.60 |
| 49 | 600694 | 大商股份 | 17,035 | 569,820.75 | 0.59 |
| 50 | 000768 | 西飞国际 | 72,304 | 567,586.40 | 0.59 |
| 51 | 600809 | 山西汾酒 | 14,870 | 560,450.30 | 0.58 |
| 52 | 600153 | 建发股份 | 78,204 | 559,940.64 | 0.58 |
| 53 | 600252 | 中恒集团 | 50,993 | 558,883.28 | 0.58 |
| 54 | 600058 | 五矿发展 | 24,876 | 555,481.08 | 0.57 |
| 55 | 000401 | 冀东水泥 | 38,995 | 548,269.70 | 0.57 |
| 56 | 600741 | 华域汽车 | 60,123 | 539,303.31 | 0.56 |
| 57 | 600497 | XD 驰宏锌 | 38,194 | 537,389.58 | 0.55 |
| 58 | 000625 | 长安汽车 | 109,776 | 535,706.88 | 0.55 |
| 59 | 000729 | 燕京啤酒 | 73,354 | 535,484.20 | 0.55 |
| 60 | 000933 | 神火股份 | 58,665 | 535,024.80 | 0.55 |
| 61 | 600655 | 豫园商城 | 66,952 | 527,581.76 | 0.54 |
| 62 | 600395 | 盘江股份 | 19,283 | 518,327.04 | 0.54 |
| 63 | 000960 | 锡业股份 | 26,168 | 515,509.60 | 0.53 |
| 64 | 000800 | 一汽轿车 | 47,463 | 515,448.18 | 0.53 |
| 65 | 000422 | 湖北宜化 | 41,557 | 509,073.25 | 0.53 |
| 66 | 000758 | 中色股份 | 26,798 | 508,358.06 | 0.52 |
| 67 | 000999 | 华润三九 | 22,850 | 499,272.50 | 0.52 |
| 68 | 600832 | 东方明珠 | 92,690 | 497,745.30 | 0.51 |
| 69 | 002106 | 莱宝高科 | 24,339 | 488,483.73 | 0.50 |
| 70 | 000528 | 柳 工 | 39,097 | 485,193.77 | 0.50 |
| 71 | 601333 | 广深铁路 | 164,755 | 484,379.70 | 0.50 |
| 72 | 600649 | 城投控股 | 66,951 | 483,386.22 | 0.50 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 73 | 601106 | 中国一重 | 152,716 | 482,582.56 | 0.50 |
| 74 | 600779 | 水井坊 | 19,857 | 481,929.39 | 0.50 |
| 75 | 601717 | 郑煤机 | 40,828 | 473,604.80 | 0.49 |
| 76 | 600259 | 广晟有色 | 7,149 | 471,333.57 | 0.49 |
| 77 | 600804 | 鹏博士 | 78,082 | 463,807.08 | 0.48 |
| 78 | 600703 | 三安光电 | 33,419 | 454,832.59 | 0.47 |
| 79 | 600839 | 四川长虹 | 215,309 | 454,301.99 | 0.47 |
| 80 | 000876 | 新希望 | 30,264 | 453,354.72 | 0.47 |
| 81 | 002385 | 大北农 | 23,310 | 452,214.00 | 0.47 |
| 82 | 600125 | 铁龙物流 | 53,253 | 451,585.44 | 0.47 |
| 83 | 600208 | 新湖中宝 | 108,807 | 449,372.91 | 0.46 |
| 84 | 600219 | 南山铝业 | 66,918 | 448,350.60 | 0.46 |
| 85 | 002001 | 新和成 | 21,134 | 446,561.42 | 0.46 |
| 86 | 601888 | 中国国旅 | 15,462 | 436,337.64 | 0.45 |
| 87 | 600588 | 用友软件 | 28,518 | 435,184.68 | 0.45 |
| 88 | 600320 | 振华重工 | 102,739 | 433,558.58 | 0.45 |
| 89 | 002038 | 双鹭药业 | 13,325 | 429,065.00 | 0.44 |
| 90 | 601001 | 大同煤业 | 39,022 | 427,290.90 | 0.44 |
| 91 | 600811 | 东方集团 | 77,616 | 425,335.68 | 0.44 |
| 92 | 600267 | 海正药业 | 24,238 | 423,680.24 | 0.44 |
| 93 | 600372 | 中航电子 | 22,949 | 412,852.51 | 0.43 |
| 94 | 600893 | 航空动力 | 31,716 | 412,625.16 | 0.43 |
| 95 | 002092 | 中泰化学 | 53,692 | 410,743.80 | 0.42 |
| 96 | 002007 | 华兰生物 | 16,653 | 409,330.74 | 0.42 |
| 97 | 002310 | 东方园林 | 6,942 | 407,564.82 | 0.42 |
| 98 | 601179 | 中国西电 | 101,602 | 404,375.96 | 0.42 |
| 99 | 601101 | 昊华能源 | 23,356 | 399,854.72 | 0.41 |
| 100 | 600674 | 川投能源 | 57,708 | 399,339.36 | 0.41 |
| 101 | 601918 | 国投新集 | 32,395 | 395,542.95 | 0.41 |
| 102 | 600216 | 浙江医药 | 15,700 | 394,855.00 | 0.41 |
| 103 | 600266 | 北京城建 | 25,911 | 393,588.09 | 0.41 |
| 104 | 600108 | 亚盛集团 | 78,889 | 388,922.77 | 0.40 |
| 105 | 600895 | 张江高科 | 45,225 | 387,578.25 | 0.40 |
| 106 | 600331 | 宏达股份 | 48,088 | 386,627.52 | 0.40 |
| 107 | 000718 | 苏宁环球 | 47,718 | 386,515.80 | 0.40 |
| 108 | 600062 | 华润双鹤 | 19,976 | 381,142.08 | 0.39 |
| 109 | 600997 | 开滦股份 | 35,984 | 376,752.48 | 0.39 |
| 110 | 000061 | 农产品 | 64,517 | 374,198.60 | 0.39 |
| 111 | 000778 | 新兴铸管 | 55,805 | 373,335.45 | 0.39 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|---------|------------|------|
| 112 | 600718 | 东软集团 | 42,981 | 370,066.41 | 0.38 |
| 113 | 600664 | 哈药股份 | 55,938 | 368,631.42 | 0.38 |
| 114 | 000839 | 中信国安 | 54,837 | 368,504.64 | 0.38 |
| 115 | 600859 | 王府井 | 13,455 | 368,128.80 | 0.38 |
| 116 | 000969 | 安泰科技 | 30,082 | 367,902.86 | 0.38 |
| 117 | 600132 | 重庆啤酒 | 17,000 | 367,030.00 | 0.38 |
| 118 | 600863 | 内蒙华电 | 45,423 | 358,841.70 | 0.37 |
| 119 | 002146 | 荣盛发展 | 32,605 | 355,394.50 | 0.37 |
| 120 | 600550 | 天威保变 | 39,687 | 346,467.51 | 0.36 |
| 121 | 002069 | 獐子岛 | 16,415 | 342,252.75 | 0.35 |
| 122 | 600498 | 烽火通信 | 12,861 | 340,945.11 | 0.35 |
| 123 | 600352 | 浙江龙盛 | 59,437 | 340,574.01 | 0.35 |
| 124 | 600221 | 海南航空 | 68,905 | 336,256.40 | 0.35 |
| 125 | 600118 | 中国卫星 | 26,671 | 335,787.89 | 0.35 |
| 126 | 600160 | 巨化股份 | 32,760 | 330,876.00 | 0.34 |
| 127 | 000869 | 张裕A | 4,892 | 329,035.92 | 0.34 |
| 128 | 600316 | 洪都航空 | 25,072 | 326,688.16 | 0.34 |
| 129 | 600516 | 方大炭素 | 37,349 | 318,960.46 | 0.33 |
| 130 | 000807 | 云铝股份 | 53,919 | 317,582.91 | 0.33 |
| 131 | 600432 | 吉恩镍业 | 23,687 | 314,563.36 | 0.32 |
| 132 | 600008 | 首创股份 | 64,152 | 313,703.28 | 0.32 |
| 133 | 000680 | 山推股份 | 53,124 | 310,775.40 | 0.32 |
| 134 | 600598 | 北大荒 | 41,401 | 308,437.45 | 0.32 |
| 135 | 002299 | 圣农发展 | 21,290 | 307,427.60 | 0.32 |
| 136 | 600812 | 华北制药 | 48,090 | 305,852.40 | 0.32 |
| 137 | 600508 | 上海能源 | 16,795 | 304,493.35 | 0.31 |
| 138 | 002128 | 露天煤业 | 23,175 | 303,129.00 | 0.31 |
| 139 | 601098 | XD 中南传 | 31,143 | 298,349.94 | 0.31 |
| 140 | 600169 | 太原重工 | 84,826 | 297,739.26 | 0.31 |
| 141 | 600808 | 马钢股份 | 138,758 | 296,942.12 | 0.31 |
| 142 | 600970 | 中材国际 | 25,517 | 294,466.18 | 0.30 |
| 143 | 600770 | 综艺股份 | 25,533 | 293,118.84 | 0.30 |
| 144 | 600170 | 上海建工 | 40,458 | 292,106.76 | 0.30 |
| 145 | 002073 | 软控股份 | 34,613 | 290,056.94 | 0.30 |
| 146 | 600528 | 中铁二局 | 42,530 | 287,502.80 | 0.30 |
| 147 | 600418 | 江淮汽车 | 52,632 | 284,739.12 | 0.29 |
| 148 | 600500 | 中化国际 | 41,941 | 283,521.16 | 0.29 |
| 149 | 600037 | 歌华有线 | 37,119 | 279,506.07 | 0.29 |
| 150 | 601377 | 兴业证券 | 26,475 | 277,458.00 | 0.29 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 151 | 000059 | 辽通化工 | 35,000 | 276,850.00 | 0.29 |
| 152 | 000686 | 东北证券 | 15,345 | 263,013.30 | 0.27 |
| 153 | 600109 | 国金证券 | 18,134 | 260,948.26 | 0.27 |
| 154 | 601369 | 陕鼓动力 | 27,724 | 256,724.24 | 0.27 |
| 155 | 000961 | 中南建设 | 20,457 | 254,894.22 | 0.26 |
| 156 | 002344 | 海宁皮城 | 9,760 | 254,540.80 | 0.26 |
| 157 | 000780 | 平庄能源 | 23,829 | 249,727.92 | 0.26 |
| 158 | 600098 | 广州控股 | 36,077 | 249,652.84 | 0.26 |
| 159 | 600595 | 中孚实业 | 44,178 | 246,513.24 | 0.25 |
| 160 | 600971 | 恒源煤电 | 17,455 | 243,148.15 | 0.25 |
| 161 | 600546 | 山煤国际 | 11,554 | 241,709.68 | 0.25 |
| 162 | 601992 | 金隅股份 | 36,259 | 241,122.35 | 0.25 |
| 163 | 601933 | 永辉超市 | 8,867 | 240,295.70 | 0.25 |
| 164 | 002500 | 山西证券 | 28,973 | 237,288.87 | 0.25 |
| 165 | 600456 | 宝钛股份 | 12,478 | 234,212.06 | 0.24 |
| 166 | 000559 | 万向钱潮 | 46,541 | 234,101.23 | 0.24 |
| 167 | 002431 | 棕榈园林 | 8,897 | 229,453.63 | 0.24 |
| 168 | 000968 | 煤气化 | 14,991 | 228,612.75 | 0.24 |
| 169 | 002122 | 天马股份 | 34,700 | 224,162.00 | 0.23 |
| 170 | 600873 | 梅花集团 | 31,868 | 215,109.00 | 0.22 |
| 171 | 002244 | 滨江集团 | 23,640 | 214,414.80 | 0.22 |
| 172 | 600183 | 生益科技 | 41,377 | 213,091.55 | 0.22 |
| 173 | 601718 | 际华集团 | 67,188 | 212,314.08 | 0.22 |
| 174 | 000021 | 长城开发 | 38,444 | 206,828.72 | 0.21 |
| 175 | 600428 | 中远航运 | 49,707 | 202,307.49 | 0.21 |
| 176 | 002493 | 荣盛石化 | 12,996 | 199,228.68 | 0.21 |
| 177 | 601099 | 太平洋 | 27,188 | 187,597.20 | 0.19 |
| 178 | 601258 | 庞大集团 | 30,556 | 186,391.60 | 0.19 |
| 179 | 600026 | 中海发展 | 36,889 | 186,289.45 | 0.19 |
| 180 | 600096 | 云天化 | 13,960 | 185,109.60 | 0.19 |
| 181 | 002603 | 以岭药业 | 6,417 | 176,788.35 | 0.18 |
| 182 | 600380 | 健康元 | 36,042 | 176,245.38 | 0.18 |
| 183 | 600737 | 中粮屯河 | 29,317 | 174,729.32 | 0.18 |
| 184 | 600307 | 酒钢宏兴 | 47,557 | 165,022.79 | 0.17 |
| 185 | 002405 | 四维图新 | 13,338 | 159,255.72 | 0.16 |
| 186 | 002378 | 章源钨业 | 4,975 | 157,508.50 | 0.16 |
| 187 | 601233 | 桐昆股份 | 16,856 | 147,321.44 | 0.15 |
| 188 | 600481 | 双良节能 | 18,869 | 135,102.04 | 0.14 |
| 189 | 601268 | 二重重装 | 19,686 | 120,675.18 | 0.12 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 190 | 601216 | 内蒙君正 | 14,954 | 104,229.38 | 0.11 |
| 191 | 002594 | 比亚迪 | 4,625 | 91,852.50 | 0.09 |

7.3.2 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。

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 | 601009 | 南京银行 | 4,856,640.82 | 5.07 |
| 2 | 601117 | 中国化学 | 3,628,952.20 | 3.79 |
| 3 | 000630 | 铜陵有色 | 3,465,976.29 | 3.62 |
| 4 | 600276 | 恒瑞医药 | 3,334,531.40 | 3.48 |
| 5 | 600143 | 金发科技 | 3,282,749.26 | 3.42 |
| 6 | 000581 | 威孚高科 | 3,163,554.15 | 3.30 |
| 7 | 600887 | 伊利股份 | 3,076,212.85 | 3.21 |
| 8 | 000623 | 吉林敖东 | 3,073,698.00 | 3.21 |
| 9 | 002038 | 双鹭药业 | 2,837,605.00 | 2.96 |
| 10 | 000869 | 张裕 A | 2,707,067.35 | 2.82 |
| 11 | 000528 | 柳工 | 2,659,333.05 | 2.77 |
| 12 | 002310 | 东方园林 | 2,480,013.42 | 2.59 |
| 13 | 600518 | 康美药业 | 2,441,255.02 | 2.55 |
| 14 | 600809 | 山西汾酒 | 2,421,297.26 | 2.53 |
| 15 | 601933 | 永辉超市 | 2,406,131.52 | 2.51 |
| 16 | 002007 | 华兰生物 | 2,330,461.95 | 2.43 |
| 17 | 600125 | 铁龙物流 | 2,327,708.14 | 2.43 |
| 18 | 600498 | 烽火通信 | 2,317,082.04 | 2.42 |
| 19 | 600550 | 天威保变 | 2,161,863.70 | 2.26 |
| 20 | 002244 | 滨江集团 | 2,153,808.30 | 2.25 |
| 21 | 600808 | 马钢股份 | 2,138,569.86 | 2.23 |
| 22 | 000012 | 南玻 A | 2,098,351.04 | 2.19 |
| 23 | 002155 | 辰州矿业 | 2,027,514.77 | 2.12 |
| 24 | 601258 | 庞大集团 | 2,013,465.41 | 2.10 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 25 | 000423 | 东阿阿胶 | 1,956,804.00 | 2.04 |
|----|--------|------|--------------|------|

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 | 601009 | 南京银行 | 3,649,827.69 | 3.81 |
| 2 | 601117 | 中国化学 | 3,590,690.59 | 3.75 |
| 3 | 000630 | 铜陵有色 | 3,538,006.78 | 3.69 |
| 4 | 600276 | 恒瑞医药 | 3,387,686.03 | 3.53 |
| 5 | 600887 | 伊利股份 | 3,289,000.75 | 3.43 |
| 6 | 000623 | 吉林敖东 | 3,170,316.29 | 3.31 |
| 7 | 600143 | 金发科技 | 3,158,550.00 | 3.30 |
| 8 | 000869 | 张裕A | 3,013,198.62 | 3.14 |
| 9 | 000528 | 柳工 | 2,685,009.20 | 2.80 |
| 10 | 600518 | 康美药业 | 2,594,911.59 | 2.71 |
| 11 | 002310 | 东方园林 | 2,516,090.76 | 2.62 |
| 12 | 600809 | 山西汾酒 | 2,488,474.26 | 2.60 |
| 13 | 002007 | 华兰生物 | 2,426,053.20 | 2.53 |
| 14 | 000581 | 威孚高科 | 2,393,295.89 | 2.50 |
| 15 | 600125 | 铁龙物流 | 2,350,707.54 | 2.45 |
| 16 | 601933 | 永辉超市 | 2,329,220.55 | 2.43 |
| 17 | 002244 | 滨江集团 | 2,310,550.11 | 2.41 |
| 18 | 002038 | 双鹭药业 | 2,260,151.44 | 2.36 |
| 19 | 600550 | 天威保变 | 2,210,480.82 | 2.31 |
| 20 | 000012 | 南玻A | 2,195,698.70 | 2.29 |
| 21 | 600808 | 马钢股份 | 2,170,581.43 | 2.26 |
| 22 | 000423 | 东阿阿胶 | 2,072,340.89 | 2.16 |
| 23 | 002155 | 辰州矿业 | 2,048,693.72 | 2.14 |
| 24 | 600498 | 烽火通信 | 1,966,665.91 | 2.05 |

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 | 179,189,796.68 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 182,716,321.72 |

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

本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名的前五名债券投资明细

本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名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

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。

7.9.2

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股票库之外的股票。

7.9.3 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 | 31,177.49 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,882,049.65 |
| 3 | 应收股利 | 45,823.87 |
| 4 | 应收利息 | 1,056.85 |
| 5 | 应收申购款 | 1,980.98 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| | 合计 | 1,962,088.84 |

7.9.4 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的处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.5.2 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。

7.9.6 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。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 |
| 1,068 | 126,476.00 | 87,548,966.55 | 64.81% | 47,527,396.40 | 35.19% |

8.2 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 | 147,209.53 | 0.11% |

注：1、本公司高级管理人员、投资部、研究部负责人持有该基金份额总量的数量区间：0 万

2、本基金基金经理持有该基金份额总量的数量区间：10 万份-50 万份（含）

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 135,913,517.61 |
| 本报告期基金总申购份额 | 2,119,703.16 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 2,956,857.82 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 135,076,362.95 |

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

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

我公司诉华远星海运有限公司房屋租赁合同纠纷一案经浦东新区法院 2011 年 11 月 28 日受理后，于 2012 年 1 月 4 日首次公开开庭进行了审理。法院依法追加了上海宏普实业投资有限公司作为第三人参加诉讼，并组成合议庭于 2012 年 6 月 19 日第二次公开开庭进行了审理，本案现已审理终结。法院支持我公司全部诉求，判决华远星海运有限公司向我公司支付剩余租金及其违约金。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。

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

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。

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 | |
| 浙商证券 | 1 | 60,080,613.62 | 16.61% | 51,068.87 | 16.89% | - |
| 申银万国 | 1 | 43,274,276.89 | 11.97% | 36,783.04 | 12.17% | - |
| 中银国际 | 2 | 34,607,261.09 | 9.57% | 28,118.43 | 9.30% | - |
| 国联证券 | 1 | 33,580,312.61 | 9.29% | 28,543.39 | 9.44% | - |
| 华泰联合 | 1 | 32,479,217.09 | 8.98% | 26,389.87 | 8.73% | - |
| 方正证券 | 1 | 27,680,993.28 | 7.65% | 22,490.70 | 7.44% | - |
| 第一创业 | 1 | 27,518,262.39 | 7.61% | 23,424.39 | 7.75% | - |
| 财富证券 | 1 | 24,045,335.73 | 6.65% | 20,438.45 | 6.76% | - |
| 东方证券 | 2 | 19,524,262.08 | 5.40% | 15,863.53 | 5.25% | - |
| 光大证券 | 1 | 17,260,886.84 | 4.77% | 14,671.78 | 4.85% | - |
| 上海证券 | 1 | 13,702,735.52 | 3.79% | 11,647.66 | 3.85% | - |
| 招商证券 | 1 | 9,838,255.86 | 2.72% | 7,993.55 | 2.64% | - |
| 中信证券 | 2 | 6,914,309.49 | 1.91% | 5,877.20 | 1.94% | - |
| 长江证券 | 1 | 4,749,467.88 | 1.31% | 3,858.95 | 1.28% | - |
| 国泰君安 | 1 | 2,805,183.64 | 0.78% | 2,279.29 | 0.75% | - |
| 海通证券 | 2 | 2,432,368.09 | 0.67% | 1,976.30 | 0.65% | - |
| 华宝证券 | 1 | 1,120,551.30 | 0.31% | 931.28 | 0.31% | - |
| 金元证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 五矿证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 南京证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 中投证券 | 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银行托管的泰信优质生活、泰信蓝筹精选、泰信增强收益、泰信中小盘精选基金共用交易单元。

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

无。

10.8 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 | 2011 年 4 季报 | 《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com） | 2012 年 1 月 20 日 |
| 2 | 新增中信证券（浙江）为代销机构 | 《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com） | 2012 年 2 月 10 日 |
| 3 | 2011 年年报 | 《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com） | 2012 年 3 月 26 日 |
| 4 | 在渤海证券、中航证券开通转换业务 | 《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com） | 2012 年 3 月 27 日 |
| 5 | 在中信证券、中信万通、中信证券（浙江）、国信证券、平安证券开通定投及转换业务 | 《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com） | 2012 年 3 月 27 日 |
| 6 | 在国都证券开通转换及费率优惠业务 | 《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com） | 2012 年 3 月 28 日 |
| 7 | 在海通证券、长城证券、华安证券、江海证券、信达证券、中信建投证券开通定投、转换及费率优惠业务 | 《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com） | 2012 年 3 月 28 日 |
| 8 | 参加工商银行费率优惠业务 | 《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com） | 2012 年 4 月 7 日 |
| 9 | 在华宝证券开通定投、转换、费率优惠业务的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com） | 2012 年 4 月 21 日 |
| 10 | 新增大通证券为代销机构 | 《中国证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com） | 2012 年 4 月 21 日 |

| | | | |
|----|------------------|--------------------------------------|-----------------|
| 11 | 2012 年 1 季度报告 | 《中国证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012 年 4 月 24 日 |
| 12 | 在上海证券开通转换、费率优惠业务 | 《中国证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012 年 6 月 13 日 |
| 13 | 参加中信银行费率优惠业务 | 《中国证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012 年 6 月 28 日 |

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰信中证 200 指数证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信中证 200 指数证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信中证 200 指数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

11.2 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。

11.3 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)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
2012 年 8 月 29 日