

泰信优质生活股票型证券投资基金 2014 年年度报告 摘要

2014 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：2015 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 2015 年 3 月 25 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 2014 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	泰信优质生活股票
基金主代码	290004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 12 月 15 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	1,048,240,054.24 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国经济可持续发展过程中那些最能够 满足人们优质生活需求的上市公司的长期稳定增长，在严格控制投资风险的基础上，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的大类资产配置、以核心-卫星策略为基础的优质生活行业配置和“自下而上”的证券精选相结合的投资 策略。
业绩比较基准	75%×富时中国 A600 指数+25%×富时中国国债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种，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。适合于能够承担一定股市风险，追求资本长期增值的个人和机构投资者。

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	基金管理人及基金托管人住所

§ 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	2014 年	2013 年	2012 年
本期已实现收益	188,859,252.68	136,536,308.56	-496,725,550.87
本期利润	219,473,424.36	187,591,926.92	-47,989,231.62
加权平均基金份额本期利润	0.1715	0.1222	-0.0257
本期基金份额净值增长率	24.93%	16.79%	-3.30%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2264	-0.3873	-0.4761
期末基金资产净值	1,085,811,975.46	1,231,024,709.59	1,154,390,476.30
期末基金份额净值	1.0358	0.8291	0.7099

注：1、本基金合同于 2006 年 12 月 15 日正式生效。

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

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

4、期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	19.65%	1.52%	25.43%	1.14%	-5.78%	0.38%
过去六个月	33.43%	1.27%	39.12%	0.92%	-5.69%	0.35%
过去一年	24.93%	1.32%	33.68%	0.87%	-8.75%	0.45%
过去三年	41.10%	1.36%	35.06%	0.96%	6.04%	0.40%

过去五年	-6.50%	1.49%	1.72%	1.01%	-8.22%	0.48%
自基金合同生效起至今	58.71%	1.80%	73.48%	1.41%	-14.77%	0.39%

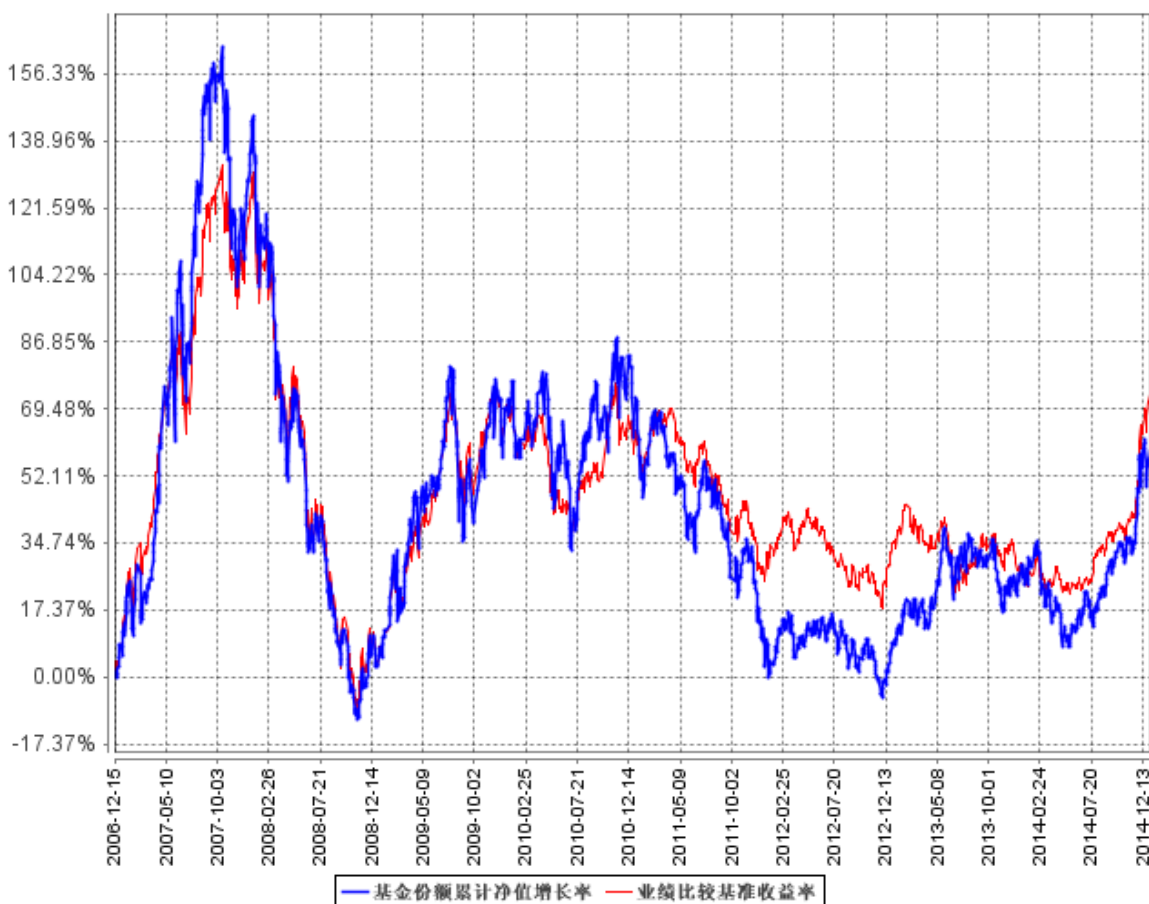
注：本基金业绩比较基准为：75%×富时中国 A600 指数+25%×富时中国国债指数

1、富时中国 A600 指数是富时中国指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流通市值最大的 600 只股票并以流通股本加权的股票指数。

2、富时中国国债指数涵盖了在上海及深圳交易所交易的到期日至少在一年以上的纯定息债券，是目前中国证券市场中与本基金投资范围比较适配同时公信力较好的股票指数和债券指数。

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

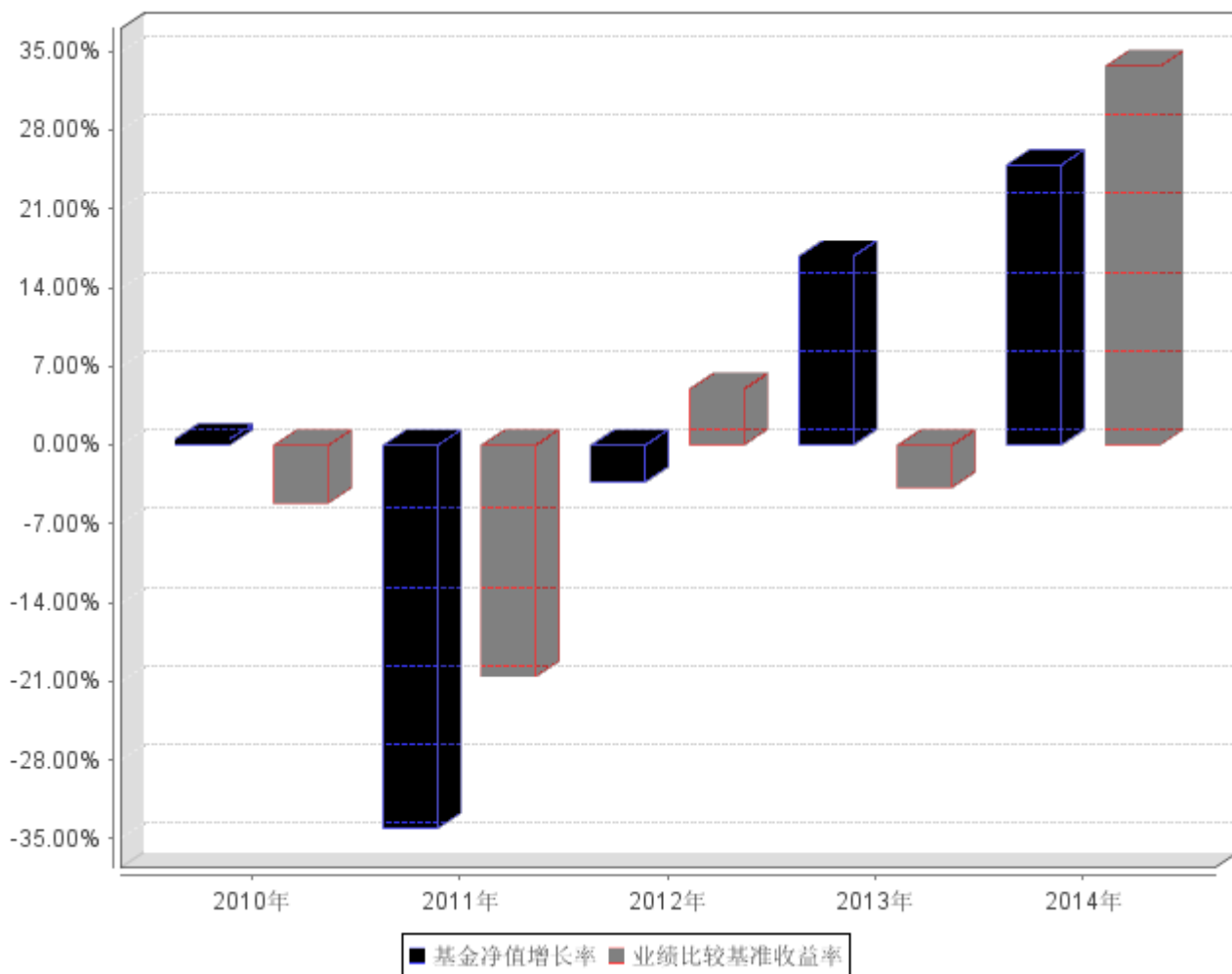


注：1、本基金基金合同于 2006 年 12 月 15 日正式生效。

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 60%-95%，债券资产 0%-35%，基金保留的现金以及投资于剩余期限在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

3.2.3 过去五年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

过去五年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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

过往三年本基金未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 37 层

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36-37 层

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：王小林

总经理：葛航

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：庄严

发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co., Ltd.）是原山东省国际信托投资有限公司（现更名为山东省国际信托有限公司）联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司共同发起设立的基金管理公司。公司于 2002 年 9 月 24 日经中国证券监督管理委员会批准正式筹建，2003 年 5 月 8 日获准开业，是国内第一家以信托投资公司为主发起人而发起设立的基金管理公司。

公司目前下设上海锐懿资产管理有限公司、市场部、营销部（分华东、华北、华南三大营销中心）、理财顾问部、深圳分公司、北京分公司、电子商务部、客服中心、基金投资部、研究部、专户投资部、清算会计部、集中交易部、计划财务部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部。截至 2014 年 12 月底，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 12 月，泰信基金管理有限公司旗下共有泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活股票、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、泰信发展主题股票、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选股票、泰信保本混合、泰信中证基本面 400 指数分级、泰信现代服务业股票、泰信鑫益定期开放债券共 15 只开放式基金及泰信乐利分级 1 号、泰信乐利 3 号、泰信乐利分级 4 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、泰信道简阿尔法、泰信智慧紫藤金 1 号、泰信至尊阿尔法、泰信至尊阿尔法 3 号、泰信至尊阿尔法 5 号、泰信至尊阿尔法 6 号共 12 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		
戴宇虹女士	本基金基金经理兼泰信现代服务业股票基金经理	2012 年 3 月 1 日	-	7 年	金融学硕士。具有基金从业资格。曾先后任职于国药控股有限公司、群益证券股份有限公司。2008 年 10 月加入泰信基金管理有限公司，先后担任研究部高级研究、泰信发展主题股票基金经理助

					理。自 2013 年 2 月 7 日起任泰信现代服务业股票基金经理。
刘毅先生	基金投资部副总监兼投资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股票基金经理	2012 年 12 月 28 日	2014 年 6 月 21 日	11 年	管理学博士，具有基金从业资格。曾任中国建设银行程序员、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 2011 年 6 月 9 日至 2012 年 12 月 28 日但任泰信中证 200 指数基金经理；自 2010 年 12 月 15 日至 2014 年 6 月 21 日担任泰信发展主题股票基金经理，并担任基金投资部副总监兼投资副总监、首席策略分析师。已于 2014 年 6 月 30 日离职。

注：1、经泰信基金管理有限公司总办会审议决定，刘毅先生不再担任本基金基金经理职务，具体详情请见 2014 年 6 月 21 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信优质生活股票型证券投资基金基金经理变更的公告》。

2、以上日期均是指公司公告的日期。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他有关法律法规、《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》的规定，本着“诚实信用、勤勉尽责，取信于市场、取信于投资者”的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法规及基金合同的约定，未发生损害基金持有人利益的行为。

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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2014 年，A 股市场走出了一轮波澜壮阔的行情，从主要市场指数来看，上证综指、沪深 300 指数和深成指分别大幅上涨 52.87%、51.66%和 35.62%，而中小板和创业板指数仅分别上涨 9.67%和 12.88%。市场走势再次呈现出明显的结构性特征，上半年市场风格偏向中小市值的成长股，各种主题投资机会十分活跃，下半年市场对新一届政府推动的改革充满期待，随着四中全会结束，改革红利不断释放，稳增长政策大力推出，尤其是 11 月底降息政策的推出，流动性持续宽松，增量资金大量入市，各低估值权重板块的估值修复行情交替演绎，推动指数不断创出新高。本基金 2014 年基本保持中性灵活的仓位，配置相对均衡，重点投资了医药生物、传媒、计算机、公用事业、金融，地产、消费等行业，参与了新能源汽车、国企改革、智能制造等主题投资。

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 1.0358 元，基金净值增长率为 24.93%，同期业绩比较基准收益率为 33.68%。

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 2015 年，总体上我们认为面临较好的投资机遇，市场整体将以震荡走势为主，指数向上向下空间都较为有限，但结构性的投资机会将不断涌现。虽然宏观经济的复苏短期难言乐观，但政府稳增长政策仍将持续出台，流动性宽松趋势不改，我们更加关注各领域改革的进度。我们将维持中性灵活的仓位，认为结构比仓位更重要，在价值和成长中寻求平衡，注重自上而下和自下而上研究相结合，我们全年看好经济转型下的新兴行业和传统行业升级改造的投资机会，重点投资环保、智能制造、信息安全、医疗服务、移动互联网相关行业，我们也将重点关注深化改革和政策大力扶持行业的投资机会，另外低估值蓝筹股调整后的投资机会也将重视。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，本基金管理人内部控制工作本着对基金份额持有人利益高度负责的精神，以

独立于各业务部门的风险管理部、监察稽核部为主体，对基金销售、投资运作、后台保障等主要业务活动进行监督与控制，较好地保证了基金运作的合规性。

1、进一步完善制度建设，构建全面有效的内部控制体系

本基金管理人根据最新出台的相关法律法规，及时补充及完善了内部管理制度，同时对业务流程进一步梳理，严格按照监管要求进行风险控制评估，确保风险控制的有效性，不断提升内部控制水平。

2、进一步规范基金投资管理 workflow，加强基金投资风险控制。

(1) 加强基金的日常投资交易进行监控，及时提示相关风险。公司风险管理部负责基金日常投资行为的监控，并与相关基金经理沟通，提示相关风险。同时根据投委会的投资决议对风险指标设置进行调整，不定期检查风险监控指标设置，并根据新的需求对风险监控指标进行测试和更新。另外注意对监管机构处罚信息与市场负面信息搜集，提示投研部门注意潜在风险。

(2) 规范投资交易行为，防范交易环节的操作风险。公司禁止基金内的同日反向交易，严格控制旗下管理投资组合间的同日反向交易，新增了基金间同日同向交易、所有投资组合对单只股票成交量占其市场总成交异常等指标预警。对于日常的投资监控，公司实行的是事前控制、事中监督、事后检查的方法，在公平交易的各环节建立了责任追究制，实行各部门责任人、分管领导责任人负责制，以最大限度地监控并处置可能造成不公平交易或利益输送的行为。

3、日常监察与专项稽核相结合，深入开展各项监察稽核工作。包括对基金销售、宣传材料、客户服务、反洗钱工作、信息披露、应用系统权限管理、基金投资备选库管理、异常交易监控等方面进行专项稽核。通过日常监察与专项稽核的方式，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，强化了风险控制流程，提高了业务部门及人员的风险意识水平，从而较好地预防风险。

4、做好投研交易等人员的合规培训，提高合规意识。公司组织投研人员开展内幕交易案例合规培训，就近年来发生的典型内幕交易案例作了分类汇报，并对目前市场上的疑似内幕交易、有争议的内幕交易案例进行了说明，要求投研人员遵守投资纪律，规范决策流程，从源头避免内幕交易事件的发生，加强了投研人员的合规意识。

5、公司采用技术手段对网站、交易、行情等进行屏蔽，对其他非受控方式上网及即时通讯做出进一步规范。加强投研人员的资讯管理，对基金经理集中区域进行录像监控，对于证券公司的网站、网页委托进行了屏蔽，对投研人员的办公电脑安装截屏软件进行留痕处理，并对安装软件的权限进行严格限制。

在本报告期内，本基金的投资运作各环节基本符合规定的要求，未出现异常交易、操纵市场、内幕交易等违法违规现象。今后公司将继续夯实内部控制和风险管理工作，保证基金运作的

合规性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、泰信基金管理有限公司估值程序等事项的说明

委员会主席

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

委员会成员：

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

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

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

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

2、本基金基金经理不参与本基金估值。

3、参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、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，投资者可选择将获取的现金红利自动转为基金份额进行再投资； 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) 基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；

(4) 基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；

(5) 如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；

(6) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少 1 次；

(7) 全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 50%。基金合同生效不满三个月，收益可不分配；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

2、本报告期内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”）在对泰信优质生活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(2015)第 20714 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰信优质生活股票型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的 泰信优质生活股票型证券投资基金(以下简

	称“泰信优质生活基金”)的财务报表, 包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是泰信优质生活基金的基金管理人泰信基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表, 并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。 我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为, 上述泰信优质生活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, 公允反映了泰信优质生活基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	单峰 周祎
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
审计报告日期	2015 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 泰信优质生活股票型证券投资基金

报告截止日: 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	114,143,160.18	86,146,501.82
结算备付金	7,345,333.23	4,243,136.92
存出保证金	365,537.87	570,725.09
交易性金融资产	991,665,475.05	1,025,856,211.93
其中：股票投资	991,665,475.05	1,025,856,211.93
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	-	128,000,192.00
应收证券清算款	-	23,967,843.88
应收利息	30,499.49	56,725.83
应收股利	-	-
应收申购款	29,203.21	68,522.39
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,113,579,209.03	1,268,909,859.86
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2014 年 12 月 31 日	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	20,648,839.77	32,693,654.76
应付赎回款	1,615,929.44	337,227.40
应付管理人报酬	1,391,207.42	1,559,337.40
应付托管费	231,867.92	259,889.56
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,721,416.96	1,630,442.93
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,157,972.06	1,404,598.22
负债合计	27,767,233.57	37,885,150.27
所有者权益：		
实收基金	1,048,240,054.24	1,484,686,009.63

未分配利润	37,571,921.22	-253,661,300.04
所有者权益合计	1,085,811,975.46	1,231,024,709.59
负债和所有者权益总计	1,113,579,209.03	1,268,909,859.86

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0358 元，基金份额总额 1,048,240,054.24 份。

7.2 利润表

会计主体：泰信优质生活股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
一、收入	249,806,966.92	219,287,084.56
1. 利息收入	2,178,779.11	2,794,010.78
其中：存款利息收入	1,218,000.44	1,341,342.52
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	960,778.67	1,452,668.26
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	216,800,946.28	165,072,352.11
其中：股票投资收益	213,180,762.01	155,217,632.52
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	3,620,184.27	9,854,719.59
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	30,614,171.68	51,055,618.36
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	213,069.85	365,103.31
减：二、费用	30,333,542.56	31,695,157.64
1. 管理人报酬	15,763,025.57	18,696,018.32
2. 托管费	2,627,170.88	3,116,003.14
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	11,508,343.44	9,449,761.53
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	435,002.67	433,374.65

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	219,473,424.36	187,591,926.92
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	219,473,424.36	187,591,926.92

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信优质生活股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	1,484,686,009.63	-253,661,300.04	1,231,024,709.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	219,473,424.36	219,473,424.36
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）	-436,445,955.39	71,759,796.90	-364,686,158.49
其中：1. 基金申购款	76,054,936.06	-12,882,614.43	63,172,321.63
2. 基金赎回款	-512,500,891.45	84,642,411.33	-427,858,480.12
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）	1,048,240,054.24	37,571,921.22	1,085,811,975.46
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,626,107,911.01	-471,717,434.71	1,154,390,476.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	187,591,926.92	187,591,926.92
三、本期基金份额交易产	-141,421,901.38	30,464,207.75	-110,957,693.63

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	362,372,542.42	-73,796,387.36	288,576,155.06
2. 基金赎回款	-503,794,443.80	104,260,595.11	-399,533,848.69
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)	1,484,686,009.63	-253,661,300.04	1,231,024,709.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>葛航</u>	<u>韩波</u>	<u>蔡海成</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰信优质生活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”)证监基金字[2006]第 229 号《关于同意泰信优质生活股票型证券投资基金设立的批复》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《泰信优质生活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 1,591,255,543.43 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(2006)第 191 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》于 2006 年 12 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,591,662,103.09 份基金份额,其中认购资金利息折合 406,559.66 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《泰信优质生活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、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金组合投资的范围为:股票资产 60%-95%,债券资产 0-35%,基金保留的现金以及投资于剩余期限在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:75%×富时中国 A600 指数(原新华富时 A600 指数)+25%×富时中国国债指数(原新华富时国债指数)。

本财务报表由本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司于 2015 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 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 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外,其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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。基金买卖股票、债券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、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司	基金管理人、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(“青岛国信”)	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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本期末及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本期及上年度可比期间本基金无应支付关联方佣金余额。

7.4.8.2 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	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	15,763,025.57	18,696,018.32
其中：支付销售机构的客户维护费	1,905,795.78	2,199,035.67

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：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,627,170.88	3,116,003.14

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：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

本报告期本基金未发生销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期末及上年度可比期间本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	114,143,160.18	1,135,349.31	86,146,501.82	1,245,848.14

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

本报告期末及上年度可比期间本基金未在承销期内持有关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
002168	深圳惠程	2014年11月28日	重大事项公告	10.13	2015年1月28日	9.14	2,200,992	20,402,993.07	22,296,048.96	-
002170	芭田股份	2014年12月25日	重大事项公告	9.00	2015年1月5日	8.99	2,299,740	20,566,395.06	20,697,660.00	-
002157	正邦科技	2014年11月19日	重大事项公告	10.03	2015年3月16日	11.03	1,399,797	13,494,610.97	14,039,963.91	-
002645	华宏科技	2014年12月11日	重大事项公告	17.91	-	-	750,939	11,552,697.78	13,449,317.49	-
002009	天奇股份	2014年10月20日	重大事项公告	17.85	2015年1月28日	17.93	900,000	12,892,054.98	16,065,000.00	-

注：本基金截至 2014 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌
的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 843,492,312.79 元，属于第二层次的余额为 148,173,162.26 元，无属于第三层次的余额(2013 年 12 月 31 日：第一层次 901,274,615.66 元，第二层次：124,581,596.27 元，无第三层次)。

(ii) 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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；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次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具于 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公

允价值计量的金融资产(2013年12月31日：同)。

(d)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。

(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	991,665,475.05	89.05
	其中：股票	991,665,475.05	89.05
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	121,488,493.41	10.91
7	其他各项资产	425,240.57	0.04
8	合计	1,113,579,209.03	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	347,535,515.43	32.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	12,447,200.32	1.15
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	151,163,106.44	13.92
J	金融业	299,542,280.00	27.59
K	房地产业	149,283,265.38	13.75
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	31,694,107.48	2.92
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	991,665,475.05	91.33

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002184	海得控制	2,820,374	61,625,171.90	5.68
2	300059	东方财富	2,077,815	58,095,707.40	5.35
3	000002	万科A	4,000,000	55,600,000.00	5.12
4	600048	保利地产	4,999,947	54,099,426.54	4.98
5	601318	中国平安	700,000	52,297,000.00	4.82
6	600030	中信证券	1,500,000	50,850,000.00	4.68
7	600000	浦发银行	3,000,000	47,070,000.00	4.34
8	002568	百润股份	1,074,076	43,736,374.72	4.03
9	600837	海通证券	1,700,000	40,902,000.00	3.77
10	000024	招商地产	1,499,956	39,583,838.84	3.65

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600000	浦发银行	67,379,829.37	5.47
2	000559	万向钱潮	57,621,483.59	4.68
3	002334	英威腾	57,271,471.02	4.65
4	002008	大族激光	55,322,051.57	4.49
5	002184	海得控制	50,804,363.73	4.13
6	600030	中信证券	49,783,781.34	4.04
7	000002	万 科 A	48,650,624.05	3.95
8	002176	江特电机	46,950,255.59	3.81
9	600837	海通证券	44,526,895.42	3.62
10	002568	百润股份	43,856,258.15	3.56
11	300226	上海钢联	42,903,693.14	3.49
12	300254	仟源医药	42,416,210.06	3.45
13	002665	首航节能	42,223,428.96	3.43
14	600446	金证股份	42,089,900.16	3.42
15	002214	大立科技	41,433,875.64	3.37
16	002535	林州重机	40,527,978.22	3.29
17	000887	中鼎股份	39,378,071.43	3.20
18	000562	宏源证券	39,192,710.82	3.18
19	600048	保利地产	38,652,601.70	3.14
20	300016	北陆药业	38,588,411.09	3.13
21	600584	长电科技	38,308,575.71	3.11
22	600406	国电南瑞	38,044,956.67	3.09
23	300059	东方财富	37,668,151.03	3.06
24	600080	金花股份	37,609,002.42	3.06
25	600818	中路股份	37,328,560.99	3.03
26	601222	林洋电子	37,174,371.63	3.02
27	300049	福瑞股份	37,112,106.82	3.01
28	300030	阳普医疗	36,078,253.18	2.93
29	000069	华侨城 A	35,990,946.84	2.92
30	600388	龙净环保	35,900,245.86	2.92

31	000988	华工科技	35,767,995.63	2.91
32	300090	盛运股份	35,419,537.06	2.88
33	601318	中国平安	35,377,275.02	2.87
34	601628	中国人寿	34,668,300.11	2.82
35	600900	长江电力	34,411,007.91	2.80
36	000402	金融街	33,629,405.97	2.73
37	002570	贝因美	33,621,774.05	2.73
38	600330	天通股份	33,483,539.38	2.72
39	002645	华宏科技	33,007,846.39	2.68
40	600588	用友软件	32,980,536.42	2.68
41	603000	人民网	32,945,746.66	2.68
42	600488	天药股份	32,771,425.33	2.66
43	002152	广电运通	32,640,339.42	2.65
44	000511	烯碳新材	30,954,297.95	2.51
45	300145	南方泵业	30,953,835.62	2.51
46	002104	恒宝股份	30,574,483.09	2.48
47	600999	招商证券	30,272,513.00	2.46
48	002318	久立特材	30,228,600.95	2.46
49	600571	信雅达	30,005,538.41	2.44
50	600418	江淮汽车	29,108,126.74	2.36
51	002475	立讯精密	28,551,820.76	2.32
52	002514	宝馨科技	28,074,597.83	2.28
53	002068	黑猫股份	27,934,958.01	2.27
54	002031	巨轮股份	27,154,653.50	2.21
55	600644	乐山电力	26,689,172.22	2.17
56	002170	芭田股份	26,379,294.26	2.14
57	002080	中材科技	26,084,688.08	2.12
58	000024	招商地产	26,084,018.23	2.12
59	300086	康芝药业	26,067,498.13	2.12
60	002278	神开股份	25,994,058.95	2.11
61	300072	三聚环保	25,446,947.94	2.07
62	600175	美都能源	25,429,891.17	2.07
63	002638	勤上光电	24,766,499.70	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	300115	长盈精密	71,085,685.52	5.77
2	002653	海思科	63,495,119.27	5.16
3	000559	万向钱潮	57,672,440.25	4.68
4	300090	盛运股份	56,637,346.43	4.60
5	002665	首航节能	52,807,083.64	4.29
6	000562	宏源证券	52,675,000.00	4.28
7	002550	千红制药	52,048,339.25	4.23
8	300016	北陆药业	52,047,269.85	4.23
9	600261	阳光照明	51,967,790.64	4.22
10	002008	大族激光	50,652,979.07	4.11
11	300254	仟源医药	50,526,287.46	4.10
12	601117	中国化学	49,687,639.05	4.04
13	000402	金融街	49,317,185.18	4.01
14	600180	瑞茂通	49,097,044.47	3.99
15	600584	长电科技	48,690,504.24	3.96
16	600080	金花股份	46,277,499.91	3.76
17	002176	江特电机	44,882,842.29	3.65
18	600572	康恩贝	44,422,572.88	3.61
19	600418	江淮汽车	44,186,594.22	3.59
20	600597	光明乳业	43,843,650.00	3.56
21	300226	上海钢联	43,175,209.45	3.51
22	300030	阳普医疗	43,117,710.64	3.50
23	002214	大立科技	42,759,272.84	3.47
24	600703	三安光电	42,615,359.53	3.46
25	600571	信雅达	42,178,564.57	3.43
26	601222	林洋电子	41,674,825.01	3.39
27	600818	中路股份	40,953,124.52	3.33
28	002064	华峰氨纶	39,161,744.11	3.18
29	600330	天通股份	39,089,495.18	3.18
30	600900	长江电力	38,847,119.53	3.16
31	000887	中鼎股份	38,628,196.80	3.14
32	002318	久立特材	38,236,808.54	3.11
33	300049	福瑞股份	37,846,858.50	3.07
34	300070	碧水源	37,779,014.28	3.07

35	600406	国电南瑞	36,926,600.64	3.00
36	002152	广电运通	36,614,759.51	2.97
37	600649	城投控股	36,099,504.45	2.93
38	002104	恒宝股份	36,098,379.21	2.93
39	002429	兆驰股份	35,973,437.09	2.92
40	300149	量子高科	35,484,017.72	2.88
41	600488	天药股份	34,099,241.56	2.77
42	000581	威孚高科	33,143,996.02	2.69
43	000651	格力电器	33,062,656.70	2.69
44	002535	林州重机	31,639,662.31	2.57
45	002068	黑猫股份	30,959,468.52	2.51
46	002570	贝因美	30,587,913.48	2.48
47	002019	亿帆鑫富	29,174,550.54	2.37
48	600000	浦发银行	29,041,936.00	2.36
49	600887	伊利股份	28,929,204.13	2.35
50	002475	立讯精密	27,380,515.67	2.22
51	002080	中材科技	26,993,348.30	2.19
52	603000	人民网	26,891,239.98	2.18
53	002514	宝馨科技	26,807,865.64	2.18
54	002278	神开股份	26,429,420.59	2.15
55	600872	中炬高新	26,212,653.46	2.13
56	300086	康芝药业	26,187,793.87	2.13
57	000511	烯碳新材	25,911,591.98	2.10
58	300074	华平股份	25,846,607.18	2.10
59	000547	闽福发 A	25,707,489.51	2.09
60	002031	巨轮股份	25,446,920.76	2.07

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	3,634,422,975.80
卖出股票收入（成交）总额	3,912,408,646.37

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末本基金未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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 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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末本基金未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

8.12.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	365,537.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	30,499.49
5	应收申购款	29,203.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	425,240.57

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002184	海得控制	61,625,171.90	5.68	重大事项公告

8.12.6 本报告涉及合计数相关比例的，均以合计数除以相关数据计算，而不是对不同比例进行合计。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
49,011	21,387.85	6,875,553.60	0.66%	1,041,364,500.64	99.34%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	19,346.12	0.0018%

9.4 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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2006 年 12 月 15 日) 基金份额总额	1,591,662,103.09
本报告期期初基金份额总额	1,484,686,009.63
本报告期基金总申购份额	76,054,936.06
减:本报告期基金总赎回份额	512,500,891.45
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	1,048,240,054.24

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、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。报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

2、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过，自 2014 年 4 月 2 日起，王小林先生担任公司董事长职务，公司总经理葛航先生不再代理董事长职务。具体详情请见 2014 年 4 月 9 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站上的《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》。

3、经工商行政管理部门核准，泰信基金管理有限公司法定代表人变更为王小林先生。具体详情请见 2014 年 9 月 13 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于变更法定代表人的公告》。

4、经泰信基金管理有限公司总办会审议决定，刘毅先生不再担任本基金经理职务，具体详情请见 2014 年 6 月 21 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信优质生活股票型证券投资基金经理变更的公告》。本公司上述人事变动已按相关规定向监管机构进行备案。除此以外无其他重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费为人民币 10 万元。该审计机构从基金合同生效日（2006 年 12 月 15 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、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
国金证券	2	1,294,424,743.83	17.15%	1,145,439.95	17.05%	-
招商证券	1	723,503,038.22	9.59%	640,229.06	9.53%	-
东方证券	1	706,921,603.06	9.37%	625,556.47	9.31%	-
海通证券	2	674,168,322.95	8.93%	601,094.93	8.95%	-
中信证券	2	623,065,481.27	8.26%	567,236.87	8.44%	-
方正证券	1	618,596,143.54	8.20%	547,397.09	8.15%	-
中国建银投资 证券	2	526,281,421.19	6.97%	465,706.93	6.93%	-
国信证券	1	417,860,689.56	5.54%	380,417.42	5.66%	-
申银万国	1	318,808,948.47	4.22%	290,241.44	4.32%	-
中信建投	2	311,094,523.83	4.12%	283,220.40	4.22%	-
浙商证券	1	298,879,554.71	3.96%	266,121.38	3.96%	-
国联证券	1	257,571,167.48	3.41%	234,495.24	3.49%	-
广州证券	1	251,046,213.89	3.33%	227,530.57	3.39%	-
国海证券	1	171,866,596.63	2.28%	152,084.66	2.26%	-
安信证券	1	157,020,383.76	2.08%	142,950.65	2.13%	-
广发证券	2	128,247,090.42	1.70%	87,836.75	1.31%	-
中银国际	2	67,422,659.36	0.89%	61,380.77	0.91%	-

中航证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）中关于“一家基金公司通过一家证券经营机构买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金 30%”的要求，本基金管理人在选择租用交易单元时，注重所选证券公司的综合实力、市场声誉。对证券公司的研究能力，由公司研究人员对其提供的研究报告、研究成果的质量进行定期评估。公司将根据内部评估报告，对席位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蓝筹精选基金、泰信增强收益基金、泰信中证 200 指数、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
国金证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	60,000,000.00	1.35%	-	-
中信证券	-	-	360,000,000.00	8.13%	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-
中国建银投资 证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-2,620,000,000.00	59.14%	-	-
申银万国	-	-	-650,000,000.00	14.67%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-320,000,000.00	7.22%	-	-
国联证券	-	-	-200,000,000.00	4.51%	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-220,000,000.00	4.97%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由托管及投资者服务部更名为托管业务部。

泰信基金管理有限公司

2015 年 3 月 26 日