泰信蓝筹精选股票型证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年9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
报告送出日期:2009年10月27日

§1 重要提示

本基金管理人的董事会及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责任。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据基金合同已于2009年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为2009年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信蓝筹精选股票
交易代码	290006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年4月22日
报告期末基金份额总额	495,627,154.74份
投资目标	通过投资于在中国经济可持续发展过程中具有核心竞争优势、在其所属行业内占有领先地位、业绩持续增长、分红稳定的优质蓝筹公司,分享中国经济发展的成果。在严格控制投资风险的条件下,实现基金资产的稳健持续增长。
投资策略	本基金采取"自上而下"的大类资产配置和"自下而上"的精选证券相结合的投资策略。充分发挥投资管理人的研究优势,通过投资具有核心竞争优势、在其所属行业内占有领先地位、业绩持续增长、分红稳定的优质蓝筹公司,在严格控制投资风险的条件下实现基金资产的稳健持续增长。
业绩比较基准	75%*沪深300指数+25%*上证国债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,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。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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009年7月1日-2009年9月30日)
1.本期已实现收益	91,537,270.68
2.本期利润	35,053,933.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.0582
4.期末基金资产净值	494,482,804.40
5.期末基金份额净值	0.9977

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、以上所列数据截止到2009年9月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-1.88%	1.94%	-3.42%	1.82%	1.54%	0.12%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

注:

1、本基金基金合同于2009年4月22日正式生效。

2、本基金的建仓期为六个月。至报告期末不满一年,且尚处于建仓期。本基金将基金资产的60-95%投资于股票,基金资产的5-40%投资于债券、现金类资产及权证、资产支持证券(其中,现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证不高于基金资产净值的3%,资产支持证券不高于基金资产净值的20%)。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳菁女士	本基金基金经理	2009年4月22日	-	13	工商管理硕士。曾任天同证券有限责任公司资产管理部交易员、研究员、投资经理。2005年加入泰信基金管理有限公司,先后任交易员、研究部高级研究员,泰信先行策略基金的基金经理助理。2009年4月22日起担任本基金基金经理。

注:

1、以上日期均是指公司公告的日期;

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对投告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(中国证券监督管理委员会公告[2008]9号),公司制定了《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,并由金融工程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

公司旗下的泰信蓝筹精选基金与泰信优质生活基金同属于股票型基金。本报告期间,泰信蓝筹精选股票基金净值增长率-1.88%,而泰信优质生活股票基金同期的净值增长率为-8.04%,两基金在本报告期内的净值增长率之差超过5%,其主要原因是泰信蓝筹精选股票基金基金合同于2009年4月22日生效,截止至本报告期末仍处于建仓期,相对于泰信优质生活基金而言,泰信蓝筹精选股票基金持有相对较低的股票仓位,因此,在三季度市场整体下跌的过程中,其净值下跌幅度相对较小。另外,分析结果也未显示二者存在利益输送的情况。除此之外,公司旗下其他基金中不存在与本基金风格相似的基金,亦未发现异常交易行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金在报告期末不存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 本基金业绩表现

截至本报告期末,本基金单位净值为0.9977元,三季度净值增长率为-1.88%,同期比较基准净值增长率为-3.42%。

4.4.2 行情回顾与运作回顾

三季度市场呈现冲高回落的走势,A股市场7月份在宏观经济数据和高额信贷数据等因素的推动下创出了本轮反弹以来的新高。正如我们在2季报中所提到的随着股市上行,估值压力加大,市场风险不断加大。8月份随着市场对流动性预期的下降和估值压力显现,A股大幅下挫,最大跌幅达到了23%,周期性行业跌幅较深,而医药和消费类股票走强。在7月份,我们曾持了积极做多的策略,超配了煤炭、有色金属等行业,但是在8月初我们认为系统性风险在不断增大,果断降低了仓位,对强周期类行业进行了大比例减持,有效地控制了风险。随着市场的下跌和震荡,我们重点增持了业绩预期明确、估值水平处于历史低位的行业如银行、保险,以及三季度和四季度业绩超预期概率较大的行业公司,同时阶段性参与了节能减排等行业的投资机会。在配置上更加强调个股选择和业绩的可靠性。

4.4.3 市场展望与投资策略

我们判断未来流动性最充裕的时期已经过去,外来货币供应的动力更多来自于内生性的提高。三季度、四季度以及明年一季度的GDP同比增速仍将保持上升,同时企业盈利同比增速也将保持恢复的态势。但是要密切关注明年政府投资的持续性和私人投资能否启动,另外还要关注世界经济复苏的持续性对我国出口的影响。总体判断,四季度市场将呈现震荡反弹的走势,市场的主要驱动力从估值驱动转向业绩驱动。我们在注重仓位控制和行业配置的同时将更加注重个股选择,重点关注在经济复苏过程中受益的上、下游行业及金融行业,美元贬值过程中受益的大宗商品行业,同时配置四季度处于销售、结算旺季的消费类行业。在个股方面,将重点关注业绩趋势可能超过预期的公司,并参与节能减排等主题投资机会。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	351,865,590.07	68.52
	其中:股票	351,865,590.07	68.52
2	固定收益投资	218,457.42	0.04
	其中:债券	218,457.42	0.04
	资产支持证券	0	0.00
3	金融衍生品投资	0	0.00
4	买入返售金融资产	0	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	0	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	161,146,801.62	31.38
6	其他资产	327,586.91	0.06
	合计	513,558,436.02	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	0	0.00
B	采掘业	20,954,770.80	4.24
C	制造业	166,047,745.42	33.58
C0	食品、饮料	19,723,098.15	3.99
C1	纺织、服装、皮毛	0	0.00
C2	木材、家具	0	0.00
C3	造纸、印刷	0	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	12,073,156.00	2.44
C5	电子	1,066,000.00	0.22
C6	金属、非金属	16,917,108.95	3.42
C7	机械、设备、仪表	93,122,011.52	18.83
C8	医药、生物制品	16,576,870.80	3.35
C99	其他制造业	6,569,500.00	1.33
D	电力、煤气及水的生产和供应业	0	0.00
E	建筑业	13,875,276.45	2.81
F	交通运输、仓储业	9,587,900.00	1.94
G	信息技术业	5,716,167.00	1.16
H	批发和零售贸易	12,207,000.00	2.47
I	金融、保险业	94,780,730.40	19.17
J	房地产业	10,911,000.00	2.21
K	社会服务业	5,877,500.00	1.19
L	传播与文化产业	0	0.00
M	综合类	11,907,500.00	2.41
	合计	351,865,590.07	71.16

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601169	北京银行	1,000,000	17,230,000.00	3.48
2	600036	招商银行	980,000	14,484,400.00	2.93
3	600284	浦东建设	1,161,111	13,875,276.45	2.81
4	600016	民生银行	2,000,000	13,480,000.00	2.73
5	600030	中信证券	500,000	12,505,000.00	2.53
6	601009	南京银行	699,860	12,345,530.40	2.50
7	000893	广州冷机	559,950	12,038,925.00	2.43
8	601166	兴业银行	300,000	10,137,000.00	2.05
9	600031	三一重工	300,000	9,954,000.00	2.01
10	600622	嘉宝集团	1,000,000	9,810,000.00	1.98

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	0	0.00
2	央行票据	0	0.00
3	金融债券	0	0.00
	其中:政策性金融债	0	0.00
4	企业债券	0	0.00
5	企业短期融资券	0	0.00
6	可转债	218,457.42	0.04
7	其他	0	0.00
	合计	218,457.42	0.04

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	125969	安泰转债	1,699	218,457.42	0.04

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

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

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	0
2	应收证券清算款	0
3	应收股利	175,944.08
4	应收利息	23,899.63
5	应收申购款	127,743.20
6	其他应收款	0
7	待摊费用	0
8	其他	0
	合计	327,586.91

5.8.4 报告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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.6 报告期内本基金未投资股股东主承销的证券,未从二级市场投资股票及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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,111,637,788.50
报告期期间基金总申购份额	126,199,737.41
报告期期间基金总赎回份额	742,210,371.17
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	0
报告期期末基金份额总额	495,627,154.74

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰信蓝筹精选股票型证券投资基金设立的文件

2、《泰信蓝筹精选股票型证券投资基金基金合同》

3、《泰信蓝筹精选股票型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信蓝筹精选股票型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

7.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所,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。

7.3 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
2009年10月27日

泰信天天收益开放式证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年9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
报告送出日期:2009年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2009年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为2009年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信天天收益货币
交易代码	290001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年2月10日
报告期末基金份额总额	1,668,008,177.67份
投资目标	确保本金安全和资产的充分流动性,追求超过业绩比较基准的现金收益
投资策略	运用久期控制、类别配置和无风险套利等投资策略追求低风险稳定收益并保持基金资产的最佳流动性
业绩比较基准	半年期银行定期存款税后利率:(1-利息税率)*半年期银行定期存款利率
风险收益特征	属于风险较低、预期收益率较低、流动性较强的证券投资基金品种
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009年7月1日-2009年9月30日)
1. 本期已实现收益	6,316,309.38
2.本期利润	6,316,309.38
3.期末基金资产净值	1,668,008,177.67

注:

1、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和本期利润的金额相等。

2、上述基金业绩指标不包括持有人申购或交易基金的各项费用(例如基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本基金收益分配是按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.3628%	0.0063%	0.4991%	0.0000%	-0.1363%	0.0063%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:

1、按基金合同规定,本基金自基金合同生效起三个月内为建仓期。截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同的"七、基金的投资"部分中"四、投资对象与范围"和"八、投资组合"所规定的各项比例。

2、各种短期金融工具占基金财产总值的比重浮动范围分别为,短期债券20-60%,债券回购0-80%,央行票据0-70%,现金5-80%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马成	本基金基金经理、兼任泰信债券增强收益基金基金经理	2008年10月10日	-	6	经济学硕士,6年证券从业经历。2003年加入泰信基金管理有限公司,先后担任理财顾问部高级经理、投资管理部经理助理、集中交易室交易主管,2007年11月至2008年10月担任泰信双息双利基金基金经理助理,2008年10月至今担任本基金基金经理,2009年7月29日兼任泰信债券增强收益基金基金经理。

注:

1、以上日期均是指公司公告的日期;

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对投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循《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金管理暂行办法》、《泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同》以及其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为,本基金的投资运作符合有关法规的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(中国证券监督管理委员会公告[2008]9号),公司制定了《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,并由金融工程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

本基金在报告期内不存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 本基金业绩表现

截至报告期末,本报告期基金净值收益率为0.3628%,同期业绩比较基准收益率为0.4991%。

4.4.2 行情回顾及运作回顾

三季度,主要宏观经济数据显示国际、国内经济形势继续好转。虽然央行继续维持适度宽松的货币政策,但是7月份新增信贷规模出现明显拐点,由6月份新增15300亿,下降至3560亿,受此影响,A股市场出现近30%的调整,债券收益率在经历了7月份的上升后,随之企稳,并小幅下行,一年央票的发行利率也在8月11日企稳,达到1.76%。投资小组抓住有力时机,适当延长组合久期,有效提高了基金的收益水平。基准利率和存款准备金率没有调整市场流动性依然充裕,贸易数据仍然没有明显好转。国内CPI已经见底,随着石油等大宗商品价格的上涨,市场对通货膨胀的预期加大,澳大利亚已经开始加息,美元贬值预期加剧,商品价格继续上涨。

4.4.3 市场展望与投资策略

目前来看,虽然国内经济复苏已经得到确认,但是经济增长的基础还不牢固,市场对于明年经济增长是否会"二次探底"还在存分歧。可以确定的是,外需减弱具有中长期性,实现我国经济平稳较快发展根本上还是要加快以扩大消费内需为核心的改革和结构调整,转变经济发展方式。进一步放松投融资管制,启动民间投资。三季度以来,公司债、传统可转债的恢复发行以及创业板的密集推出,正是进一步放松投融资管制,启动民间投资的表现。未来中短期利率的波动性可能进一步加大,而且将出现逐步上行的趋势。适度宽松的货币政策仍将持续,但是,货币供应量增长已经远超央行17%的目标值,进一步释放流动性并没有太多的空间,相反,央行可能通过公开市场进行净回笼操作。

我们认为未来一段时间债券收益率曲线可能会逐步陡峭。泰信天天收益基金将继续坚持稳健投资策略,采取中短久期策略,以保证本基金良好的流动性、灵活性和安全性,积极把握各种交易机会,为持有人继续创造安全稳定的收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	882,493,789.04	52.83
	其中:债券	882,493,789.04	52.83
	资产支持证券	0	0.00
2	买入返售金融资产	650,000,000.00	38.91
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	0	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	134,920,954.78	8.08
4	其他资产	2,905,691.46	0.17
	合计	1,670,320,435.28	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	2,794,693,244.65	2.35
	其中:买断式回购融资	0	0.00
2	报告期末债券回购融资余额	0	0.00
	其中:买断式回购融资	0	0.00

注:

1、上表中报告期内债券回购融资余额为报告期内每个交易日的融资余额的合计数,报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

2、在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 期末基金组合剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	122
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	126
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	33

注:本报告期内无投资组合平均剩余期限超过180天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	53.05	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天(含)-60天	0.00	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60天(含)-90天	11.27	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.18	0.00
4	90天(含)-180天	2.39	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
5	180天(含)-397天(含)	33.25	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
合计		99.96	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	0	0.00
2	央行票据	444,130,986.38	26.63
3	金融债券	212,321,516.44	12.73
	其中:政策性金融债	80,632,517.19	4.83
4	企业债券	226,041,286.22	13.55
5	企业短期融资券	0	0.00
6	其他	0	0.00
7	合计	882,493,789.04	52.91
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	36,356,108.22	2.18

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0901042	09央票42	2,000,000	196,757,259.43	11.80
2	040705	04建行03浮	1,314,000	131,688,999.25	7.89
3	0801112	08央票112	1,000,000	99,961,555.45	5.99
4	0901038	09央票38	1,000,000	98,274,320.52	5.89
5	0981138	09连云港CP01	700,000	70,086,914.12	4.20
6	0981145	09华侨城CP01	500,000	50,052,608.50	3.00
7	0981088	09格力CP01	500,000	49,532,172.19	2.97
8	0901036	09央票36	500,000	49,137,850.98	2.95
9	070310	07进出10	400,000	40,726,200.55	2.44
10	090404	09农发04	400,000	39,906,316.64	2.39

5.6 影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	1
报告期内偏离度的最高值	0.2520%
报告期内偏离度的最低值	0.1201%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2029%

5.7 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明。

①本基金所持有的债券(包括票据)采用摊余成本法进行估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。

②本基金持有的回购以成本列示,按实际利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息;合同利率与实际利率差异较小的,也可采用合同利率计算确定利息收入。

③本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示,按相应利率逐日计提利息。

5.8.2 本报告期内无剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动债的摊余成本超过日基金资产净值20%的情况。

5.8.3 本基金本期末持有的前十名证券中没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 其他资产构成

序号	其他资产	金额(元)
1	存出保证金	0
2	应收证券清算款	0
3	应收利息	2,905,691.46
4	应收申购款	0
5	其他应收款	0
6	待摊费用	0
7	其他	0
	合计	2,905,691.46

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,423,452,594.08
报告期期间基金总申购份额	1,624,750,387.81
报告期期间基金总赎回份额	2,380,194,804.22
报告期期末基金份额总额	1,668,008,177.67

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰信天天收益开放式证券投资基金设立的文件

2、《泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同》

3、《泰信天天收益开放式证券投资基金招募说明书》

4、《泰信天天收益开放式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

7.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所,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。

7.3 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
2009年10月27日

泰信增强收益债券型证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年9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
报告送出日期:2009年10月27日

§1 重要提示

本基金管理人的董事会及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、完整性承担个人及连带责任。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据基金合同已于2009年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为2009年7月29日(基金合同生效日)起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称:	泰信债券增强收益
交易代码:	290007
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2009年7月29日
报告期末基金份额总额:	1,182,769,245.79份
投资目标:	在获取债券稳定收益的基础上,通过股票一级市场申购等手段谋求高于比较基准的收益。
投资策略:	本基金根据对宏观经济形势、货币和财政政策变化、经济周期及利益走势、企业盈利和信用状况、基金流动性情况等的动态分析,通过自下而上的投资决策委员会,确定基金中各类资产的配置比例范围,并跟踪影响资产策略配置的各种因素的变化,定期对资产策略配置比例进行调整。
业绩比较基准:	80%*上证企业债指数+20%*上证国债指数
风险收益特征:	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的低风险、低收益品种,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金,高于货币市场基金。
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
下属两级基金简称:	泰信债券增强收益A / 泰信债券增强收益C
下属两级交易代码:	290007 / 291007
下属两级基金报告期末份额总额:	727,663,674.29 / 455,105,571.50

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009年7月29日-2009年9月30日)	
	A类	C类
1.本期已实现收益	-7,457,959.07	-4,965,891.08
2.本期利润	-42,402,503.04	-26,805,266.54
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0584	-0.0591
4.期末基金资产净值	685,138,851.12	428,213,189.01
5.期末基金份额净值	0.9416	0.9409

注:

1、上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、以上所列数据截止到2009年9月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

分级A

阶段	净值增长率(1)	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	-5.84%	0.50%	-0.35%	0.09%	-5.49%	0.41%

分级C

阶段	净值增长率(1)	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	-5.91%	0.50%	-0.35%	0.09%	-5.56%	0.41%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

注:

1、本基金基金合同于2009年7月29日正式生效。

2、本基金建仓期为六个月。至报告期末不满一年,且尚处于建仓期。本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的80%,投资于权益类资产的比例不高于基金资产的20%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何俊春女士	本基金基金经理、泰信双息双利债券基金基金经理	2009年7月29日	-	11	工商管理硕士。曾任职于上海鸿安投资咨询有限公司、齐鲁证券有限责任公司。2002年12月加入泰信基金管理有限公司,先后担任泰信天天收益基金基金经理,2008年10月至今任泰信双息双利基金基金经理,2009年7月29日起兼任本基金基金经理。
马成先生	本基金基金经理、泰信天天收益货币基金基金经理	2009年7月29日	-	6年	经济学硕士。2003年加入泰信基金管理公司,先后担任理财顾问部高