泰信双息双利债券型证券投资基金2009年年度报告摘要

2009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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2010年3月31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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

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2009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	泰信双息双利债券
基金主代码	290003
交易代码	290003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年10月31日 注:原泰信中短期债券投资基金为2006年6月15日
基金管理人	泰信基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	523,354,826.94
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标是在获取债券稳定收益的基础上,通过股票一级市场申购及适当的二级市场投资等手段谋求高于比较基准的收益。
投资策略	在本基金投资管理计划中,投资策略由自上而下的资产配置计划和自下而上的选股(或债券)计划组成,本基金根据对宏观经济形势、货币和财政政策变化、经济周期及利率走势、企业盈利和信用状况等等的动态分析,在限定投资范围内,决定债券类资产、股票类等资产的配置比例。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	本基金的业绩比较基准为上证国债指数。
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品种,预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	唐国培	蒋松云
	联系电话	021-50372168	010-66105799
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-5988	95588
传真		021-50372197	010-66106904

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ftfund.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路200号中银大厦42F

§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

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2009年	2008年	2007年
本期已实现收益	17,384,888.22	69,103,664.93	11,219,966.46
本期利润	9,461,231.65	65,534,918.58	32,736,627.49
加权平均基金份额本期利润	0.0151	0.0413	0.0912
本期加权平均净值利润率	1.46%	4.00%	9.06%
本期基金份额净值增长率	5.05%	7.11%	4.05%
3.1.2 期末数据和指标	2009年末	2008年末	2007年末
期末可供分配利润	2,097,459.06	31,016,106.59	56,778,082.64
期末可供分配基金份额利润	0.0040	0.0496	0.0279
期末基金资产净值	544,384,665.83	668,205,458.56	2,212,016,403.75
期末基金份额净值	1.0402	1.0680	1.0263
3.1.3 累计期末指标	2009年末	2008年末	2007年末
基金份额累计净值增长率	14.45%	12.62%	5.15%

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加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	5.98%	0.47%	0.52%	0.14%	5.46%	0.33%
过去六个月	2.23%	0.72%	0.84%	0.11%	1.39%	0.61%
过去一年	5.05%	0.57%	0.87%	0.09%	4.18%	0.48%
自基金合同生效起至今	14.45%	0.40%	11.30%	0.10%	3.15%	0.30%

注:本基金业绩比较基准为:上证国债指数。

上证国债指数以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本,按照国债发行量加权而成。上证国债指数的目的是反映我们债券市场整体变动状况,是我们债券市场价格变动的"指示器"。

3.2.2 自基金转型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、本基金建仓期为六个月。建仓期满各项投资比例符合基金合同关于投资组合的相关规定。

2、经泰信中短期债券投资基金2007年9月27日基金份额持有人大会(通讯方式)表决通过,并经中国证监会2007年10月26日证监基金字[2007]293号文核准,泰信中短期债券投资基金变更为泰信双息双利债券型证券投资基金,自2007年10月31日起,由《泰信中短期债券投资基金基金合同》修订而成的《泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同》正式生效。业绩比较基准由2年期银行定期存款利率(税后)"变更为"上证国债指数"。

3、因业务发展的需要,经公司第二届董事会2008年度会议审议通过,决定增聘侯燕琳女士担任泰信双息双利基金基金经理,与现任基金经理何俊春女士共同管理该基金。详细情况请见2009年4月25日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上的《泰信基金管理有限公司关于泰信先行策略、双息双利基金增聘基金经理的临时公告》。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金合同生效日为2007年10月31日,2007年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 自基金转型以来的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计
2009	0.800	28,183,741.89	18,270,553.42	46,454,295.31
2008	0.300	8,894,040.97	12,282,025.21	21,176,066.18
合计	1.100	37,077,782.86	30,552,578.63	67,630,361.49

§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:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦42F

办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦42F

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)50372168

传真:(021)50372197

联系人:高海鸥

发展沿革:

泰信基金管理有限公司(First-Trust Fund Management Co.,Ltd.)是山东省国际信托投资有限公司(现更名为山东省国际信托有限公司)联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司共同发起设立的基金管理公司。公司于2002年9月24日经中国证券监督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。

公司目前下设市场营销团队(分华东、华北、华南三个业务团队)、营销策划及基金事务团队(分基金事务、客户服务、营销策划)、新业务团队(分理财顾问部、新业务销售)、基金投资部、研究部、风险管理部、清算会计部、信息技术部、监察稽核部、综合管理部。截至2009年12月31日,公司共管理泰信天天收益、泰信先行策略、泰信双息双利、泰信优质生活、泰信优势增长、泰信蓝筹精选、泰信增强收益等7只开放式基金,基金资产规模136.27亿元。

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		
何俊春女士	本基金基金经理兼任泰信债券增强收益基金基金经理。	20081010	-	12	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交易员、交易主管,泰信天天收益基金基金经理。
侯燕琳女士	本基金基金经理	20090425	-	11	管理学硕士。曾任职于中国农村发展新信托投资公司、中国华融信托投资公司、京华山一国际香港有限公司。2006年6月进入泰信基金管理有限公司,先后担任研究部研究员、投资部基金经理助理。

注:1、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

2、基金经理任职日期以公司公告日期为准。

4.2 管理人对报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》、《泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,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。

泰信双息双利债券基金在2009年7月30日参与"光大证券"新股发行网下申购的初步询价时,因操作失误,后未足额缴款,网下申购无效。经公司清算部门检查复核,此次操作失误给基金资产造成的利息损失为2280元。公司已对此进行了弥补,并将处理情况向监管机构做了报告。同时,对公司的新股投资流程进行了认真的梳理,针对潜在的风险点进行了相应的改进,强化了研究、投资、决策及交易各业务环节的复核责任制。

除此之外,本报告期内,本基金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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(中国证券监督管理委员会公告[2008]9号)自2008年3月20日起执行。公司相应地制定了《公平交易制度》,适用于所有投资品种,以及所有投资管理活动,涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各环节,从研究、投资、交易合规性监控,发现可疑交易立即报告,并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

4.3.2 本投资组合与其它投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本公司旗下其他基金不存在风格相似的情形。

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 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

09年我国经济经历了增速小幅下探随即企稳回升的历程,在适度宽松的货币政策和积极财政政策的共同作用下,投资与信贷投放的大幅增加使经济得到迅速的恢复,产业结构得到一定程度的优化,通货紧缩的趋势得以遏制,GDP逐渐呈现较快增长。在中国经济企稳回升的大背景下,09年中国债券市场行情也经历了较大起伏,中债指数呈现震荡下行的整体趋势。截止到12月30日中债综合指数(净价)为101.1203点,较年初下跌4.03点,跌幅为3.83%。双息双利基金09年初根据宏观经济形势及未来利率走势判断,一月大幅降低久期,规避债市下跌的风险,锁定收益,同时增加权益类资产配置,积极参与新股申购,分享股市上涨带来的收益,但在八月份的股市调整过程中未能及时降低权益类仓位,造成了净值较大波动及损失。四季度震荡行情中,基金投资加强仓位灵活性管理及板块轮动效应,为持有人创造稳健收益。

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1.0402元,净值增长率为5.05%,同期比较基准净值增长率为0.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

10年一季度经济增长将处于全年高点,预计GDP为11%左右。投资增速环比出现下降,但受新开工项目及城镇化建设需求,增速同比仍处于高位。进出口的形势在海外经济复苏及去年低基数效应带动下,同比及环比数据持续好转。受季节性因素及09年高增长的货币供应量对价格的刺激作用等因素影响,通货膨胀将出现明显上升态势,对通胀的预期会更加强烈。2010年一季度新增信贷预计在2.5-3万亿。出口好转,人民币升值预期增强导致海外热钱流入加速,通货膨胀上升提高居民储蓄搬家的积极性,这都将增加市场流动性。市场目前主要的风险来自政策的不确定性对投资者心理的影响,包括刺激政策退出的时间、通胀的预期引发货币政策的快速调整及融资规模偏大对市场流动性的压力等。一季度债市受通货膨胀及央行紧缩调控预期影响,收益率曲线短端将出现较大幅度上升,这也是对1年期央票一二级市场倒挂的有效修正。双息双利基金继续坚持稳健投资策略,以短久期规避债券价格下跌风险,把握中长期债券投资机会,增加信用债配置提高票息收入,新股申购将对上市公司进行优选,股票二级市场把握行业热点的和年报中超预期的个股的投资机会。

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,7年基金从业经验,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。

高伟女士,本科,英国牛津大学Catalysts公司风险投资方向访问学者,高级会计师,11年金融业、7年其他行业从业经验,曾在大型商贸公司、证券公司、资产管理公司担任财务部门、业务部门负责人并兼任所属公司财务总监、监事等职务。现任公司监察稽核部副经理。

庞少华先生,硕士,会计师,14年证券从业经验。曾供职于天一证券有限责任总公司稽核部内部稽核、营业部财务会计、总公司计划财务部。2005年1月加入泰信基金管理有限公司,公司清算会计部经理。

刘强先生,工商管理硕士。2002年10月加入泰信基金管理有限公司,现任基金投资副总监兼泰信优质生活股票基金基金经理。

梁剑先生,硕士,具有11年证券从业经验,曾历任期货交易所研究员、券商研究员。2004年7月加入泰信基金,现任研究部副总监兼泰信先行策略混合基金基金经理。

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

1.基金合同关于利润分配的约定:

(1)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,全年分配比例不得低于年度可供分配收益的30%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

(2)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3)基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;

(4)基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配;

(5)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;

(6)每一基金份额享有同等分配权;

(7)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

2.报告期内已实施的利润分配情况:

本报告期期限内,本基金每10份分配0.800元,年度利润分配合计46,454,295.31元(其中,现金形式发放28,183,741.89元,再投资形式发放18,270,553.42元),占本年度可供分配利润48,551,754.37元的95.68%。符合基金合同的约定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2009年,本托管人在对泰信双息双利债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,不存在任何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

2009年,泰信双息双利债券型证券投资基金的管理人——泰信基金管理有限公司在泰信双息双利债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作基本按照有关法律法规、基金合同的规定进行。本报告期内,泰信双息双利债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了两次利润分配,分配金额为46,454,295.31元。

2009年,泰信双息双利债券型证券投资基金出现过新股申购无效的情况,我行及时向泰信基金管理公司发送提示函件,泰信基金管理公司在规定时间内及时对投资组合进行披露或调整,相关损失已足额补偿。

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

本托管人依法对泰信基金管理有限公司编制和披露的泰信双息双利债券型证券投资基金2009年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行

二○一○年三月二十二日

§6 审计报告

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。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:泰信双息双利债券型证券投资基金

报告截止日:2009年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	36,951,521.73	60,002,853.39
结算备付金		3,517,332.76	1,851,960.45
存出保证金		262,522.70	250,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	547,323,054.86	687,067,007.00
其中:股票投资		94,657,212.41	250,815.00
债券投资		452,665,842.45	686,816,192.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		5,305,933.93	-
应收利息	7.4.7.5	2,301,097.12	3,292,102.59
应收股利		-	-
应收申购款		30,900.00	6,783,982.31
其它资产	7.4.7.6	-	34.17
资产总计		595,692,363.10	759,247,939.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		50,000,000.00	89,999,665.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		6,364.46	-
应付管理人报酬		387,728.64	448,835.95
应付托管费		110,779.63	128,238.85
应付销售服务费		166,169.39	192,358.29
应付交易费用	7.4.7.7	195,149.59	33,422.06
应交税费		89,800.00	-
应付利息		1,805.56	5,461.20
应付利润		-	-
其它负债	7.4.7.8	349,900.00	234,500.00
负债合计		51,307,697.27	91,042,481.35
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	523,354,826.94	625,659,431.59
未分配利润	7.4.7.10	21,029,838.89	42,546,026.97
所有者权益合计		544,384,665.83	668,205,458.56
负债和所有者权益总计		595,692,363.10	759,247,939.91

注:报告截止日2009年12月31日,基金份额净值1.0402元,基金份额总额523,354,826.94份。

7.2 利润表

会计主体:泰信双息双利债券型证券投资基金

本报告期:2009年01月01日至2009年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
一、收入		21,315,369.89	95,009,958.51
1.利息收入		12,696,456.21	47,231,047.98
其中:存款利息收入	7.4.7.11	597,499.52	2,916,824.87
债券利息收入		12,098,956.69	42,270,546.34
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	2,043,676.77
其它利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		16,415,831.84	51,205,802.79
其中:股票投资收益	7.4.7.12	2,058,124.65	21,590,274.13
债券投资收益	7.4.7.13	13,023,075.35	20,100,846.37
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	707,687.28	9,245,005.72
股利收益	7.4.7.15	626,944.56	269,676.57
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	-7,923,656.57	-3,568,746.35
4.其它收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	126,738.41	141,854.09
二、费用		11,854,138.24	29,475,039.93
1.管理人报酬		4,519,670.18	11,541,587.12
2.托管费		1,291,334.33	3,297,596.34
3.销售服务费		1,937,001.50	4,946,394.52
4.交易费用	7.4.7.18	2,077,231.26	997,881.71
5.利息支出		1,640,703.47	8,377,572.92
其中:卖出回购金融资产支出		1,640,703.47	8,377,572.92
6.其它费用	7.4.7.19	388,197.50	314,007.32
三、利润总额		9,461,231.65	65,534,918.58
四、净利润		9,461,231.65	65,534,918.58

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰信双息双利债券型证券投资基金

本报告期:2009年01月01日至2009年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009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)	625,659,431.59	42,546,026.97	668,205,458.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,461,231.65	9,461,231.65
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)	-102,304,604.65	15,476,875.58	-86,827,729.07
其中:1.基金申购款	1,492,995,523.21	76,488,469.99	1,569,483,993.20
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-1,595,300,127.86	-61,011,594.41	-1,656,311,722.27
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)	-	-46,454,295.31	-46,454,295.31
五、期末所有者权益(基金净值)	523,354,826.94	21,029,838.89	544,384,665.83
项目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008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)	2,155,238,321.11	56,778,082.64	2,212,016,403.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	65,534,918.58	65,534,918.58
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)	-1,529,578,889.52	-58,590,908.07	-1,588,169,797.59
其中:1.基金申购款	2,060,379,678.33	64,120,854.58	2,124,500,532.91
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-3,589,958,567.85	-122,711,762.65	-3,712,670,330.50
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)	-	-21,176,066.18	-21,176,066.18
五、期末所有者权益(基金净值)	625,659,431.59	42,546,026.97	668,205,458.56

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:

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰信双息双利债券型证券投资基金(以下简称"本基金")根据原泰信中短期债券投资基金(以下简称"原泰信中短债基金")基金份额持有人大会2007年9月27日审议通过的《关于泰信中短期债券投资基金转型为泰信双息双利债券型证券投资基金有关事项的议案》及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[2007]第293号《关于核准泰信中短期债券投资基金基金份额持有人大会有关变更基金类别决议的批复》批准,由原泰信中短债基金转型而来。

根据《泰信中短期债券投资基金转型方案说明书》以及相关法律法规的规定,经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致并经中国证监会核准,基金管理人泰信基金管理有限公司将《泰信中短期债券投资基金基金合同》修订为《泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同》。《泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同》自2007年10月31日起生效,原《泰信中短期债券投资基金基金合同》同日失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围变更为主要投资于债券类金融工具。债券类金融工具包括国债、央行票据、金融债、信用等级为投资级的企业债(包括可转债)、可分离性债券、短期融资券、资产支持证券等法律法规或中国证监会允许投资的固定收益品种。上述资产投资比例不低于基金资产的80%。其中,本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。此外,本基金可以参与一级市场新股申购、股票、权证的投资,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非债券类品种。非债券类金融工具的投资比例不超过基金资产的20%。本基金的业绩比较基准为上证国债指数。

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2010年3月29日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注7.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其它有关规定的声明

本基金2009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2009年12月31日的财务状况以及2009年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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相一致的说明

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相一致。

7.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

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

7.4.6 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
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金代销机构
山东省国际信托有限公司("山东国投")	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信实业有限公司("青岛国信")	基金管理人的股东

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

本基金本报告期末无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.7.1.2 权证交易

本基金本报告期末无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.7.1.3 应支付关联方的佣金

截止本报告期末2009年12月31日止,本基金无应支付关联方的佣金。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,519,670.18	11,541,587.12
其中:支付销售机构的客户维护费	639,839.22	1,069,566.44

注:支付基金管理人泰信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.70%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 0.70%/当年天数。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,291,334.33	3,297,596.34

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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 0.20%/当年天数。

7.4.7.2.3 销售服务费

金额单位:人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
泰信基金管理有限公司	680,980.32
中国工商银行	598,396.67
合计	1,279,376.99
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
泰信基金管理有限公司	3,149,532.90
中国工商银行	853,407.91
合计	4,002,940.81

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给泰信基金管理有限公司,再由泰信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值X 0.30%/当年天数。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	399,253,125.93	349,718,146.16	-	-	-	-

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 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 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
期初持有的基金份额	29,705,911.48	29,705,911.48
期间申购总份额	18,001,800.18	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回总份额	-	-
期末持有的基金份额	47,707,711.66	29,705,911.48
期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.12%	4.75%

注:基金管理人泰信基金管理有限公司在本年度申购本基金的交易委托中国工商银行办理,无交易手续费。

7.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其它关联方投资本基金的情况

本报告期末,除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

7.4.7.5 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 2009年1月1日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008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
中国工商银行	36,951,521.73	552,576.17	60,002,853.39	2,705,566.05

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内,本基金未参与关联方承销证券的申购或分销。

7.4.8 期末(2009年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300029	天龙光电	2009-12-18	2010-3-25	新股网下申购	18.18	29.10	159,974	2,908,327.32	4,655,243.40	-
600999	招商证券	2009-11-12	2010-2-22	新股网下申购	31.00	29.39	95,590	2,963,290.00	2,809,390.10	-
300032	金龙机电	2009-12-18	2010-3-25	新股网下申购	19.00	29.80	73,547	1,397,393.00	2,191,700.60	-
601989	中国重工	2009-12-9	2010-3-16	新股网下申购	7.38	7.81	251,162	1,853,575.56	1,961,575.22	-
601139	深圳燃气	2009-12-15	2010-3-25	新股网下申购	6.95	16.78	113,609	789,582.55	1,906,359.02	-
300015	爱尔眼科	2009-10-15	2010-2-1	新股网下申购	28.00	48.80	38,568	1,079,904.00	1,882,118.40	-
002308	威创股份	2009-11-18	2010-2-27	新股网下申购	23.80	31.83	53,295	1,268,421.00	1,696,379.85	-
002303	美盈森	2009-10-22	2010-2-3	新股网下申购	25.36	31.50	51,415	1,303,884.40	1,619,572.50	-
002320	海峡股份	2009-12-9	2010-3-16	新股网下申购	33.60	51.18	26,597	893,659.20	1,361,234.46	-
601888	中国国旅	2009-9-25	2010-1-15	新股网下申购	11.78	20.94	59,572	701,758.16	1,247,437.68	-
002318	久立特材	2009-12-3	2010-3-11	新股网下申购	23.00	33.13	37,636	865,628.00	1,246,880.68	-
002316	键桥通讯	2009-12-1	2010-3-9	新股网下申购	18.80	31.13	35,953	675,916.40	1,119,216.89	-
300042	朗科科技	2009-12-28	2010-4-8	新股网下申购	39.00	39.00	28,306	1,103,934.00	1,103,934.00	-
002329	皇氏乳业	2009-12-25	2010-4-6	新股网下申购	20.10	20.10	47,253	949,785.30	949,785.30	-
002322	理工监测	2009-12-11	2010-3-18	新股网下申购	40.00	61.88	13,632	545,280.00	843,548.16	-
300027	华谊兄弟	2009-10-19	2010-2-1	新股网下申购	28.58	55.43	13,206	377,427.48	732,008.58	-
300014	亿纬锂能	2009-10-15	2010-2-1	新股网下申购	18.00	39.55	14,857	267,426.00	587,594.35	-
002315	焦点科技	2009-12-1	2010-3-9	新股网下申购	42.00	69.18	7,275	305,550.00	503,284.50	-
002306	湘鄂情	2009-11-5	2010-2-11	新股网下申购	18.90	33.36	9,327	176,280.30	311,148.72	-
合计								20,427,022.67	28,728,412.41	

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2009年12月31日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额50,000,000.00元,于2010年1月6日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其它事项

无。

§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	94,657,212.41	15.89
	其中:股票	94,657,212.41	15.89
2	固定收益投资	452,665,842.45	75.99
	其中:债券	452,665,842.45	75.99
	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	40,468,854.49	6.79
6	其它各项资产	7,900,453.75	1.33
	合计	595,692,363.10	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	采掘业	8,751,500.00	1.61
C	制造业	42,358,800.21	7.78
C0	食品、饮料	2,511,385.30	0.46
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,619,572.50	0.30
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	2,779,294.95	0.51
C6	金属、非金属	14,395,480.68	2.64
C7	机械、设备、仪表	18,282,066.78	3.36
C8	医药、生物制品	2,771,000.00	0.51
C99	其它制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,906,359.02	0.35
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	1,361,234.46	0.25
G	信息技术业	4,422,815.24	0.81
H	批发和零售贸易	7,489,500.00	1.38
I	金融、保险业	19,314,290.10	3.55
J	房地产业	4,880,000.00	0.90
K	社会服务业	3,440,704.80	0.63
L	传播与文化产业	732,008.58	0.13
M	综合类	-	-
	合计	94,657,212.41	17.39

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	600511	国药股份	250,000	6,400,000.00	1.18
2	600036	招商银行	350,000	6,317,500.00	1.16
3	002142	宁波银行	310,000	5,421,900.00	1.00
4	600660	福耀玻璃	330,000	4,930,200.00	0.91
5	600348	国阳新能	100,000	4,837,000.00	0.89
6	600030	中信证券	150,000	4,765,500.00	0.88
7	300029	天龙光电	159,974	4,655,243.40	0.86
8	000060	中金岭南	140,000	3,906,000.00	0.72
9	600388	龙净环保	100,000	3,434,000.00	0.63
10	600048	保利地产	130,000	2,912,000.00	0.53

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.ftfund.com网站的年度报告正文。

8.4 报告期内权益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	600550	天威保变	34,812,292.22	5.21%
2	600036	招商银行	29,266,976.11	4.38%
3	600030	中信证券	27,069,073.54	4.05%
4	000969	安泰科技	25,030,743.62	3.75%
5	600000	浦发银行	20,834,790.82	3.12%
6	601318	中国平安	16,300,575.56	2.44%
7	000157	中联重科	12,947,711.42	1.94%
8	000060	中金岭南	12,678,590.60	1.90%
9	600019	宝钢股份	12,655,319.79	1.89%
10	600391	成发科技	12,216,950.75	1.83%
11	000425	徐工机械	11,771,922.40	1.76%
12	600517	置信电气	11,121,836.70	1.66%
13	600388	龙净环保	10,574,668.89	1.58%
14	002041	登海种业	10,155,872.51	1.52%
15	600997	开滦股份	9,519,809.46	1.42%
16	600582	天地科技	9,450,193.91	1.41%
17	600048	保利地产	9,262,229.70	1.39%
18	600893	航空动力	9,046,921.05	1.35%
19	601919	中国远洋	8,864,892.88	1.33%
20	600869	三普药业	8,849,790.07	1.32%

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	600550	天威保变	36,455,245.33	5.46%
2	000969	安泰科技	29,542,384.38	4.42%
3	600036	招商银行	22,613,646.72	3.38%
4	600000	浦发银行	20,347,912.78	3.05%
5	600030	中信证券	19,409,011.55	2.90%
6	601318	中国平安	15,756,890.65	2.36%
7	000425	徐工机械	13,541,401.61	2.03%
8	000157	中联重科	12,526,481.55	1.87%
9	600391	成发科技	11,815,515.51	1.77%
10	600517	置信电气	11,717,068.69	1.75%
11	600019	宝钢股份	11,295,440.80	1.69%
12	002041	登海种业	10,060,231.41	1.51%
13	600388	龙净环保	9,896,971.20	1.48%
14	600869	三普药业	9,738,591.70	1.46%
15	600997	开滦股份	9,723,024.40	1.46%
16	000060	中金岭南	9,431,550.60	1.41%
17	600582	天地科技	9,192,489.50	1.38%
18	601919	中国远洋	8,761,008.89	1.31%
19	600893	航空动力	8,544,916.61	1.28%
20	000768	西飞国际	7,806,154.06	1.17%

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	722,714,055.46
卖出股票收入(成交)总额	643,325,789.93

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	149,040,000.00	27.38
2	央行票据	149,505,000.00	27.46
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	76,890,320.70	14.12
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	77,230,521.75	14.19
7	其它	-	-
	合计	452,665,842.45	83.15

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	0901053	09央票53	1,500,000	149,505,000.00	27.46
2	020022	09贴债22	1,500,000	149,040,000.00	27.38
3	122960	09保利集	300,000	29,910,000.00	5.49
4	125969	安泰转债	172,259	25,799,230.43	4.74
5	126018	08江铜债	284,580	20,162,493.00	3.70

8.7 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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

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

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

8.9.3 期末其它各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	262,522.70
2	应收证券清算款	5,305,933.93
3	应收股利	-
4	应收利息	2,301,097.12
5	应收申购款	30,900.00
6	其它应收款	-
7	待摊费用	-
8	其它	-
	合计	7,900,453.75

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110003	新钢转债	7,498,110.00	1.38
2	110598	大荒转债	3,024,166.40	0.56
3	125709	唐钢转债	14,442,921.52	2.65

8.9.5 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	300029	天龙光电	4,655,243.40	0.86	网下申购锁定期

8.9.6 投资组合报告附注的其它文字描述部分

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

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
8,010	65,337.68	256,584,407.68	49.03%	266,770,419.26	50.97%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	59,361.47	0.01%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2007年10月31日)基金份额总额	382,550,774.21
本报告期期初基金份额总额	625,659,431.59
本报告期基金总申购份额	1,492,995,523.21
减:本报告期基金总赎回份额	1,595,300,127.86
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	523,354,826.94

注:总申购份额含红利再投、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

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、经泰信基金管理有限公司第二届董事会2008年度会议审议通过,决定聘任侯燕琳女士担任泰信双息双利基金经理,与现任基金经理何俊春女士共同管理该基金。详细情况请见刊登在2009年4月25日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上的《泰信基金管理有限公司关于泰信先行策略、双息双利基金增聘基金经理的临时公告》。

2、经泰信基金管理有限公司第二届董事会2009年半年度会议审议通过,决定聘任桑维英女士、韩波先生担任公司副总经理。桑维英女士、韩波先生的任职资格已获中国证监会核准。详细情况请见刊登在2009年12月31日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上的《泰信基金管理有限公司聘任副总经理的公告》。

3、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费用为人民币6.54万元。该审计机构从原泰信中短债基金合同生效日(2006年6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

1、上海证监局于2009年6月1日至6月5日对本基金管理人泰信基金管理有限公司对公司2005年以来的经营情况进行了现场检查。并于2009年9月29日向公司出具了《关于泰信基金管理有限公司现场检查的整改意见函》(以下简称《意见函》),认为公司副总经理长期缺位,不符合公司章程对管理层组织架构的规定,过去的部分基金投资中出现异常交叉交易情况,公司自有资金投资未能严格执行公司的自有资金投资管理规定,存在超范围投资于短期融资券的现象等。《意见函》对管理人在公司治理结构、投研管理、风险控制体系和监察稽核工作、人员资格管理等方面提出了整改意见,并对公司有关责任人采取了监管谈话、记入诚信档案和出具警示函等行政监管措施。

根据现场检查情况和《意见函》的要求,公司组成了以董事长为组长的工作领导小组,针对整改意见制定了详尽的整改计划及落实措施。通过全面认真整改,上述问题已基本得到解决,2010年初上海局已对管理人进行了整改验收。

通过本次整改和公司的一系列自我整固措施的逐步落实,公司运营的风控能力和基金管理能力均得到明显提高,使我们更有信心为广大基金投资人提供优质的服务。

2、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	937,628,083.90	70.40%	796,978.26	71.33%	1、此交易单元原为信泰证券所有,该公司后并入华泰证券。2、支付给华泰证券的年交易佣金未超过公司旗下所有基金证券交易佣金的30%。
中金公司	1	394,251,971.78	29.60%	320,332.24	28.67%	-

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工商银行托管的泰信优势增长基金共用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其它证券投资的情况

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
华泰证券	1,750,156,234.49	77.87%	4,558,400,000.00	100.00%	2,005,442.16	100.00%
中金公司	497,324,938.83	22.13%	-	-	-	-

泰信基金管理有限公司
2010年3月31日