泰信优质生活股票型证券投资基金 2010年年度报告摘要

2010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
报告送出日期:2011年3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2011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2010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
交易代码	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	2,104,558,848.15 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(原新华富时中国A600指数)+25%×富时中国国债指数(原新华富时中国国债指数)
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	唐国培	唐州徽
	联系电话	021-50372168	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		021-50372197	010-66594942

2.4 信息披露方式

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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010年	2009年	2008年
本期已实现收益	341,881,160.06	260,647,696.52	-1,555,848,891.46
本期利润	47,374,790.79	1,056,868,579.29	-2,227,682,450.00
加权平均基金份额本期利润	0.0234	0.4937	-0.9169
本期基金份额净值增长率	0.54%	65.11%	-55.01%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末	2008年末
期末可供分配基金份额利润	0.0140	-0.0558	-0.2697
期末基金资产净值	2,344,088,115.35	2,380,408,231.25	1,643,925,592.91
期末基金份额净值	1.1138	1.2058	0.7303

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期末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	2.48%	2.08%	4.92%	1.29%	-2.44%	0.79%
过去六个月	23.10%	1.86%	18.38%	1.14%	4.72%	0.72%
过去一年	0.54%	1.89%	-5.17%	1.17%	5.71%	0.72%
过去三年	-25.31%	2.07%	-25.83%	1.74%	0.52%	0.33%
自基金合同生效日起至今	70.66%	2.13%	61.74%	1.73%	8.92%	0.40%

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

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,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

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 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金合同生效日为2006年12月15日,2006年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010	1.0000	77,613,101.08	135,078,401.82	212,691,502.90	
2009	-	-	-	-	
2008	-	-	-	-	
合计	1.0000	77,613,101.08	135,078,401.82	212,691,502.90	

§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:王伟毅
发展沿革:

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

公司目前下设市场部、营销部(分华东、华北、华南三大营销中心和电子商务部)、客服中心、基金投资部、研究部、理财顾问部、清算会计部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部、北京分公司、深圳分公司。截止至2010年12月底,公司有正式员工116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。

截止至2010年12月31日,泰信基金管理有限公司旗下共有泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活股票、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、泰信发展主题股票等8只开放式基金。基金资产规模111.96亿元。

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		
刘强先生	基金投资副总监、本基金基金经理	2007年2月9日	-	8	工商管理硕士,上海复旦大学博士研究生在读。具有基金从业资格。2002年10月进入泰信基金管理有限公司,先后担任交易员、研究员、泰信先行策略基金经理助理,泰信优质生活基金经理助理。现同时担任基金投资副总监。
朱志权先生	投资副总监、本基金基金经理兼泰信优势增长混合基金基金经理	2008年6月28日	-	15	经济学学士。具有基金从业资格。曾任职于中信证券上海总部、长盛基金管理有限公司、富国基金管理有限公司、中海信托管理有限公司、银河基金管理有限公司。2008年6月加入泰信基金管理有限公司,担任本基金基金经理。自2010年1月16日起兼任泰信优势增长混合基金基金经理,2010年12月起同时担任投资副总监。

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、基金经理的任职日期以公司公告日为准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

公司旗下的泰信优质生活基金和泰信蓝筹精选基金同为股票型基金。泰信优质生活股票基金的净值增长率为0.54%,泰信蓝筹精选股票基金净值增长率为21.30%,两基金在本报告期内的净值增长率之差超过5%,主要原因是泰信优质生活股票基金在2010年内一直维持高仓位,未能规避两次大的市场下跌所带来的系统性风险;泰信蓝筹精选股票基金在2010年4月份、11月份两次大的市场下跌之前,及时对仓位进行了较大幅度的调整,有效规避了系统性风险,全年对银行、钢铁等行业保持了谨慎态度,波段性参与了煤炭、有色等周期类品种的反弹行情。二者并不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类似的基金,亦不存在利益输送行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

上证综指从年初的3277点跌至年底的2808点,跌幅-14.3%,年中最低见2320点,跌幅-29%)。但符合经济增长方式转变的结构性机会却引发2010年中国股市的结构性行情。上证综合指数全年的跌幅达到全球第三名,仅次于受金融危机影响较为严重的希腊和西班牙市场。

受流动性收缩影响以及宏观经济政策的不确定性作用,周期类板块在报告期内整体表现较差,与此形成鲜明对照的是中小市值类成长股,区域振兴股,低碳经济,主题投资类股票的阶段性表现较为出众。但在四季度中有些周期类股票在流动性改善时期表现出色,在风格急剧变化时,中小市值股票的回调幅度相对较大。

从本基金的资产配置上看,主要配置了医药、信息服务、电子元器件、新能源等行业。行业的配置主要集中于受益政策支持的非周期类行业,并获得一定的超额收益。

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1.1138元,基金净值增长率为0.54%,业绩比较基准增长率为-5.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内货币政策的调整已经由数量调控到以价格调控相结合的紧缩模式。随着国内通胀的压力加大和可能存在的输入性通胀,以及PPI向CPI传导的可能预期,都将对宏观政策的运行节奏造成一定的影响。

展望2011年,我们认为人民币升值的大背景下,资产价格存在上涨的基础,股市仍有投资机会。明年一季度随着信贷改善、“十二五”开局、海外经济复苏等,国内经济继续保持较高增长,这将拉动资源品、原材料需求,并可能使通胀走高或维持较高的水平。

由于经济转型时代的到来,银行、地产、钢铁、交通运输等权重行业可能有阶段性机会而中长期表现或将较差,机会主要集中于升级和通胀受益的板块。2011年经济转型还将深化,新兴产业、消费和技术升级等依然是看好的主题。

短期来看,市场将受到通胀、信贷额度的目标以及加息等预期的影响。但我们看好上游的有色和煤炭等资源型板块,节能减排目标影响的水泥价格上涨和保障性住房受益的投资品行业如建材,以及受政策从紧影响较小的科技类股票。从中期的角度依然关注景气度较高的投资品行业板块如机械、包括军工、核电以及高铁相关的板块;主题上把握新兴产业和消费类行业以及前期此类行业中超跌的品种。

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,公司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。主要工作情况如下:

1、全面梳理风险点,补充、完善相关制度。为了更好地辨识各项业务的风险,公司组织了一次全面梳理风险点的工作。此项工作通过反复的分析、讨论,公司及相关部门对各业务环节的风险点有了更为清晰的认识,对自身风险的认识水平和风控意识有了明显的提升。

2、进一步规范基金投资管理工作流程,适度控制投资品种的突发风险。公司制定了《投资灰名单制度(试行)》,由风险管理部指定专人负责对上市公司发生大股东或高管减持、遭到公开谴责等情况进行日常跟踪。经相关程序后纳入禁止投资池,在一定期限内不得再主动投资。自该办法试行至本报告期末,先后有192只个股被纳入禁止投资的范围。

2010年初,公司补充、完善了公平交易实施细则,并同时建立了债券投资异常交易报告制度。

3、严格规范投资交易行为。为切实贯彻《基金管理公司投资管理人员管理指导意见》的精神,规范投资交易行为,有效防范交易环节的操作风险,防止出现尾盘故意打压或者拉抬股价的行为发生,公司对交易员在盘中、尾盘的委托指令进行了适当的比例限制,对于超过限制的指令,系统将自动阻止。

4、通过检查加强学习、强化员工合规意识。根据监管机构的要求,公司成立了以总经理、督察长为领导的关于“坚守三条底线”执行情况自查自纠工作小组,对相关部门的落实、改进情况进行了认真的复查。并组织开展了全员参与的证券从业人员执业行为准则的方面的合规性教育活动和执业行为准则执行情况检查,以进一步加深员工对合规运作、勤勉尽责的认识。

为规范公司投资管理活动及投资管理人员的投资行为,公司组织了投研人员利用晨会的时间,集中学习了“内幕交易案例系列材料”的学习与讨论。重点介绍“内幕信息”、“内幕交易”的基本定义及其表现方式,并要求投研人员加强法规学习,提高合规意识。

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。加强投资管理人员的资讯管理,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,对办公电脑安装软件的权限进行严格限制。

6、在本报告期内,本基金的投资运作等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。今后公司将继续加强监察稽核人员的业务技能的培训提高,合理配置监察稽核工作力度,重点加强事前防范及动态跟踪,保证基金运作的合规性。

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)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、本报告期利润分配情况的说明:

截至本报告期末,本基金每10份分配1元,年度利润分配合计212,691,502.90元(其中现金形式发放77,613,101.08元,再投资形式发放135,078,401.82元)。符合基金合同的约定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对泰信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。

中国银行
2011年3月25日

§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(2011)第20279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2010年12月31日的资产负债表、2010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	按照企业会计准则和中国证券监督管理委员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)设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报;(2)选择和运用恰当的会计政策;(3)作出合理的会计估计。
注册会计师的责任段	我们的责任是在实施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职业道德规范,计划和实施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,我们考虑与财务报表编制相关的内部控制,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,上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,在所有重大方面公允反映了泰信优质生活基金2010年12月31日的财务状况以及2010年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛竞 陈熹
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2011年3月28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:2010年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资产:		
银行存款	134,336,840.49	117,119,229.34
结算备付金	14,739,666.53	6,509,655.28
存出保证金	3,899,212.54	5,192,851.33
交易性金融资产	2,217,708,592.62	2,235,743,515.24
其中:股票投资	2,217,708,592.62	2,235,743,515.24
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	29,362,838.76
应收利息	27,977.42	24,943.26
应收股利	-	-
应收申购款	6,839,455.53	417,566.67
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	13,482.77
资产总计	2,377,551,745.13	2,394,384,082.65
负债和所有者权益	本期期末 2010年12月31日	上年度末 2009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	21,954,242.80	-
应付赎回款	147,389.34	4,322,213.78
应付管理人报酬	3,138,216.55	3,028,810.19
应付托管费	523,036.08	504,801.71
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,296,006.03	2,461,294.07
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	3,404,738.98	3,658,731.65
负债合计	33,463,629.78	13,975,851.40
所有者权益:		
实收基金	2,104,558,848.15	1,974,175,323.46
未分配利润	239,529,267.20	406,232,907.79
所有者权益合计	2,344,088,115.35	2,380,408,231.25
负债和所有者权益总计	2,377,551,745.13	2,394,384,082.65

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值1.1138元,基金份额总额2,104,558,848.15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:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入	112,444,404.36	1,120,010,849.17
1.利息收入	1,143,660.01	4,124,457.71
其中:存款利息收入	1,143,660.01	898,771.52
债券利息收入	-	3,225,686.19
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	404,970,003.29	318,774,744.09
其中:股票投资收益	395,316,751.40	312,145,023.15
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-8,360,925.33
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	448,320.44
股利收益	9,653,251.89	14,542,325.83
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-294,506,369.27	796,220,882.77
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	837,110.33	890,764.60
减:二、费用	65,069,613.57	63,142,269.88
1.管理人报酬	35,248,037.22	33,215,733.57
2.托管费	5,874,672.79	5,535,955.65
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	23,522,204.04	23,970,114.79
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	424,699.52	420,465.87
三、利润总额	47,374,790.79	1,056,868,579.29
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	47,374,790.79	1,056,868,579.29

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:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010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)	1,974,175,323.46	406,232,907.79	2,380,408,231.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	47,374,790.79	47,374,790.79
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)	130,383,524.69	-1,386,928.48	128,996,596.21
其中:1.基金申购款	984,073,592.43	167,370,906.79	1,151,444,499.22
2.基金赎回款	-853,690,067.74	-168,757,835.27	-1,022,447,903.01
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)	-	-212,691,502.90	-212,691,502.90
五、期末所有者权益(基金净值)	2,104,558,848.15	239,529,267.20	2,344,088,115.35
项目	上年度可比期间 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)	2,250,963,443.66	-607,037,850.75	1,643,925,592.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,056,868,579.29	1,056,868,579.29
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)	-276,788,120.20	-43,597,820.75	-320,385,940.95
其中:1.基金申购款	764,851,018.12	49,144,654.70	813,995,672.82
2.基金赎回款	-1,041,639,138.32	-92,742,475.45	-1,134,381,613.77
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)	1,974,175,323.46	406,232,907.79	2,380,408,231.25

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%X富时中国A 600指数(原新华富时A600指数)+25%X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2011年3月28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2010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2010年12月31日的财务状况以及2010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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

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

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

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

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

7.4.7 关联方关系

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

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	35,248,037.22	33,215,733.57
其中:支付给销售机构的客户维护费	3,740,708.17	3,859,236.24

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1.5%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 1.5% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,874,672.79	5,535,955.65

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

无。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
期初持有的基金份额	17,406,922.84	6,041,839.87
期间申购/买入总份额	-	11,365,082.97
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	17,406,922.84	-
期末持有的基金份额	-	17,406,922.84
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.88%

注:基金管理人泰信基金管理有限公司在本年度赎回本基金的交易委托中国银行办理,适用手续费率与公告一致。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2010年12月31日		上年度末 2009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
青岛国信	29,412,396.70	1.40%	27,014,655.82	1.37%

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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009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	134,336,840.49	1,045,967.41	117,119,229.34	816,126.74

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2010年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000903	云内动力	10/12/08	公告重大事项	17.60	2011年1月7日	18.80	2,569,908	42,550,724.65	45,230,380.80	-
合计								42,550,724.65	45,230,380.80	

注:本基金截至2010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

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

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

(b)以公允价值计量的金融工具

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

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

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

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

于2010年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为2,172,478,211.82元,属于第二层级的余额为45,230,380.80元,无属于第三层级的余额(2009年12月31日:第一层级2,220,038,615.24元,第二层级15,704,900.00元,无属于第三层级的余额)。

对于持有的重大事项停牌股票,本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级,并于复牌后从第二层级转回第一层级(2009年度:同)。

(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	2,217,708,592.62	93.28
	其中:股票	2,217,708,592.62	93.28
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	149,076,507.02	6.27
6	其他各项资产	10,766,645.49	0.45
7	合计	2,377,551,745.13	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	8,870,900.00	0.38
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,572,077,621.98	67.07
C0	食品、饮料	58,454,622.20	2.49
C1	纺织、服装、皮毛	35,708,400.00	1.52
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	2,467,440.00	0.11
C4	石油、化学、塑胶、塑料	60,589,220.00	2.58
C5	电子	232,533,431.87	9.92
C6	金属、非金属	152,344,100.00	6.50
C7	机械、设备、仪表	603,200,417.82	25.73
C8	医药、生物制品	392,895,190.09	16.76
C99	其他制造业	33,884,800.00	1.45
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	812,000.00	0.03
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	363,374,810.40	15.50
H	批发和零售贸易	56,344,800.00	2.40
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	191,500,760.24	8.17
L	传播与文化产业	24,392,300.00	1.04
M	综合类	335,400.00	0.01
	合计	2,217,708,592.62	94.61

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	000566	海南海药	4,900,000	145,432,000.00	6.20
2	002315	焦点科技	1,620,000	124,659,000.00	5.32
3	600765	中航重机	6,270,000	118,753,800.00	5.07
4	000012	南 玻A	5,700,000	112,575,000.00	4.80
5	300070	碧水源	900,000	112,500,000.00	4.80
6	600403	欣网视讯	3,000,000	101,760,000.00	4.34
7	000538	云南白药	1,210,000	73,084,000.00	3.12
8	601888	中国国旅	2,337,000	72,376,890.00	3.09
9	000423	东阿阿胶	1,357,933	69,390,376.30	2.96
10	300059	东方财富	1,270,000	67,627,500.00	2.89

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	000969	安泰科技	202,238,085.76	8.50
2	002249	大洋电机	182,550,148.27	7.67
3	600884	杉杉股份	174,885,417.35	7.35
4	600765	中航重机	171,367,653.60	7.20
5	002315	焦点科技	171,027,736.62	7.18
6	000823	超声电子	170,639,492.51	7.17
7	002019	鑫富药业	167,814,929.35	7.05
8	002091	江苏国泰	166,494,037.67	6.99
9	002364	中恒电气	156,093,883.87	6.56
10	600303	曙光股份	155,549,915.92	6.53
11	000559	万向钱潮	152,565,142.53	6.41
12	600590	泰豪科技	150,268,210.38	6.31
13	300070	碧水源	143,452,407.44	6.03
14	000060	中金岭南	138,392,882.33	5.81
15	000826	桑德环境	135,015,096.60	5.67
16	600379	宝光股份	133,055,288.54	5.59
17	000012	南 玻A	132,583,278.48	5.57
18	002197	证通电子	126,957,118.61	5.33
19	000541	佛山照明	123,985,002.41	5.21
20	002340	格林美	123,192,419.44	5.18
21	000566	海南海药	120,738,706.85	5.07
22	000933	神火股份	118,205,800.13	4.97
23	002106	莱宝高科	114,089,859.46	4.79
24	600403	欣网视讯	110,433,946.19	4.64
25	600993	马应龙	110,038,765.82	4.62
26	000811	烟台冰轮	108,232,126.23	4.55
27	002320	海峡股份	98,385,955.73	4.13
28	600582	天地科技	97,916,636.45	4.11
29	002292	奥飞动漫	95,919,461.60	4.03
30	600519	贵州茅台	92,964,748.56	3.91
31	601888	中国国旅	88,849,348.16	3.73
32	300059	东方财富	86,752,601.42	3.64
33	002353	杰瑞股份	86,725,979.22	3.64
34	600146	大元股份	82,685,459.42	3.47
35	000423	东阿阿胶	80,274,990.82	3.37
36	002339	积成电子	79,921,602.34	3.36
37	000538	云南白药	79,793,454.45	3.35
38	600178	东安动力	77,580,932.97	3.26
39	600359	新农开发	71,709,666.99	3.01
40	600038	哈飞股份	71,220,678.39	2.99
41	600622	嘉宝集团	66,720,123.83	2.80
42	600435	中兵光电	66,419,870.25	2.79
43	600195	中牧股份	62,038,533.93	2.61
44	002318	久立特材	61,236,737.29	2.57
45	002179	中航光电	60,618,360.21	2.55
46	600107	美尔雅	58,788,616.96	2.47
47	000021	长城开发	58,247,764.52	2.45
48	600111	包钢稀土	57,703,662.21	2.42
49	000983	西山煤电	56,586,545.30	2.38
50	000937	冀中能源	55,040,691.93	2.31
51	002252	上海莱士	54,772,116.32	2.30
52	002456	欧菲光	50,562,191.01	2.12
53	600511	国药股份	49,292,624.47	2.07
54	600673	东阳光铝	48,923,830.27	2.06

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	600884	杉杉股份	212,547,832.47	8.93
2	002249	大洋电机	200,958,731.99	8.44
3	000933	神火股份	191,674,130.33	8.05
4	000969	安泰科技	190,158,994.92	7.99
5	600195	中牧股份	175,972,486.33	7.39
6	002179	中航光电	158,228,833.01	6.65
7	000826	桑德环境	146,591,341.40	6.16
8	600590	泰豪科技	146,566,467.08	6.16
9	002091	江苏国泰	145,187,489.52	6.10
10	000541	佛山照明	139,343,126.91	5.85
11	600380	健康元	137,762,664.64	5.79
12	002340	格林美	133,587,507.47	5.61
13	002364	中恒电气	127,754,581.09	5.37
14	002019	鑫富药业	127,490,911.81	5.36
15	000811	烟台冰轮	125,015,383.84	5.25
16	600582	天地科技	123,477,216.52	5.19
17	000060	中金岭南	122,569,816.93	5.15
18	600584	长电科技	117,593,906.43	4.94
19	600193	创兴置业	115,166,830.81	4.84
20	600379	宝光股份	112,336,725.92	4.72
21	000937	冀中能源	111,396,102.72	4.68
22	600467	好当家	109,846,815.94	4.61
23	000009	中国宝安	109,470,055.90	4.60
24	600622	嘉宝集团	106,831,495.52	4.49
25	000423	东阿阿胶	106,752,888.87	4.48
26	600354	敦煌种业	105,203,186.50	4.42
27	600655	豫园商城	105,076,001.15	4.41
28	000559	万向钱潮	103,713,814.98	4.36
29	002106	莱宝高科	102,772,546.35	4.32
30	000016	深康佳A	101,832,216.59	4.28
31	600303	曙光股份	101,702,007.94	4.27
32	000983	西山煤电	100,785,228.21	4.23
33	002320	海峡股份	98,966,629.54	4.16
34	000021	长城开发	95,512,389.38	4.01
35	002353	杰瑞股份	94,395,873.40	3.97
36	002292	奥飞动漫	94,321,931.25	3.96
37	002197	证通电子	93,351,333.42	3.92
38	600519	贵州茅台	88,126,544.01	3.70
39	000823	超声电子	87,877,265.08	3.69
40	600122	宏图高科	85,823,185.84	3.61
41	600359	新农开发	83,616,050.95	3.51
42	000651	格力电器	81,506,411.04	3.42
43	002155	辰州矿业	78,571,830.67	3.30
44	600511	国药股份	78,335,015.94	3.29
45	002252	上海莱士	77,079,889.53	3.24
46	002339	积成电子	74,424,213.55	3.13
47	600111	包钢稀土	72,759,354.52	3.06
48	000927	一汽夏利	71,974,744.20	3.02
49	000527	美的电器	63,466,411.62	2.67
50	002159	三特索道	63,405,364.51	2.66
51	600550	天威保变	58,513,420.84	2.46
52	002092	中泰化学	56,942,749.80	2.39
53	002318	久立特材	55,218,210.14	2.32
54	000762	西藏矿业	54,845,591.97	2.30
55	600993	马应龙	54,273,669.40	2.28
56	002315	焦点科技	53,851,719.11	2.26
57	600673	东阳光铝	51,899,214.51	2.18
58	300070	碧水源	51,730,780.90	2.17
59	600675	中华企业	50,966,163.93	2.14

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	7,711,277,108.32
卖出股票收入(成交)总额	7,830,122,413.07

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细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 报告期内本基金投资的前十名证券的其他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。

8.9.2 本报告期内基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的股票备选库。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,899,212.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,977.42
5	应收申购款	6,839,455.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,766,645.49

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
76,224	27,610.19	382,834,690.76	18.19%	1,721,724,157.39	81.81%

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	94,160.76	0.0045%

§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	1,974,175,323.46
本报告期基金总申购份额	984,073,592.43
减:本报告期基金总赎回份额	853,690,067.74
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,104,558,848.15

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

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

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。

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、托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
新时代证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
长财证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券	1	2,706,666,487.78	17.42%	2,199,181.80	17.14%	-
招商证券	1	1,478,735,057.91	9.52%	1,201,481.36	9.36%	-
海通证券	2	1,089,326,994.91	7.01%	885,084.90	6.90%	-
中银国际	2	1,083,663,361.45	6.98%	880,483.57	6.86%	-
中信证券	2	910,366,944.44	5.86%	773,810.68	6.03%	-
中航证券	1	721,077,340.25	4.64%	585,880.13	4.56%	-
江海证券	1	707,859,624.10	4.56%	575,140.21	4.48%	-
国泰君安	1	633,871,312.81	4.08%	515,024.90	4.01%	-
东方证券	1	621,752,268.61	4.00%	505,178.05	3.94%	-
财富证券	1	592,807,439.76	3.82%	503,884.29	3.93%	-
申银万国	1	551,928,517.26	3.55%	469,137.12	3.66%	-
上海证券	1	534,070,605.06	3.44%	453,960.67	3.54%	-
国元证券	1	501,462,182.51	3.23%	426,241.43	3.32%	-
万联证券	1	437,261,934.80	2.81%	371,670.54	2.90%	-
光大证券	1	430,960,553.40	2.77%	366,314.50	2.85%	-
华宝证券	1	411,797,511.12	2.65%	334,587.74	2.61%	-
中金公司	1	404,809,670.47	2.61%	344,088.64	2.68%	-
五矿证券	1	395,226,428.36	2.54%	321,124.10	2.50%	-
安信证券	1	389,722,788.60	2.51%	331,262.98	2.58%	-
金元证券	1	267,158,687.94	1.72%	227,083.39	1.77%	-
大通证券	1	238,956,285.79	1.54%	203,111.98	1.58%	-
中国建银投资证券	1	226,289,989.46	1.46%	192,344.78	1.50%	-
渤海证券	1	103,279,022.86	0.66%	87,786.33	0.68%	-
国联证券	1	89,352,397.74	0.58%	75,949.11	0.59%	-
华泰证券	1	5,369,854.00	0.03%	4,362.95	0.03%	-
广发证券	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
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长财证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
中国建银投资证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

泰信基金管理有限公司
2011年3月29日