# 泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金 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:中国工商银行股份有限公司**
**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。

基金托管人中国工商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 | 泰信优势增长混合 |
| 基金主代码 | 290005 |
| 交易代码 | 290005 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年 6 月 25 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 | 140,961,684.24 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 通过科学的投资管理和资产配置程序,结合主动的宏观、市场、行业、公司研究,选择具有可持续优势的成长型股票和收益率、流动性俱佳的债券,力争使投资者享受到可持续的财富增长。 |
| 投资策略 | 本基金在充分合理运用现代金融工程科学成果基础上,以 SAA(战略资产配置)策略为基础,结合对不同阶段市场特征的分析,动态配置基金资产在股票、债券和现金之间的配置比例。 |
| 业绩比较基准 | 55%* 沪深 300 指数 + 45%* 中证全债指数 |
| 风险收益特征 | 本基金的预期风险收益水平低于股票型基金,高于偏债型基金、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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 唐国培 | 赵会军 |
| | 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—66105798 |

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 | 6,330,325.79 | 58,681,187.00 | 1,685,516.70 |
| 本期利润 | 18,459,595.52 | 64,429,614.68 | -1,253,362.74 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1635 | 0.4604 | -0.0033 |
| 本期基金份额净值增长率 | 10.90% | 39.47% | -1.00% |
| 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 | 0.0105 | 0.2386 | -0.0096 |
| 期末基金资产净值 | 148,218,664.95 | 132,958,912.98 | 229,459,973.45 |
| 期末基金份额净值 | 1.051 | 1.239 | 0.990 |

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3、期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 10.19% | 1.45% | 2.74% | 0.99% | 7.45% | 0.46% |
| 过去六个月 | 29.26% | 1.21% | 11.45% | 0.86% | 17.81% | 0.35% |
| 过去一年 | 10.90% | 1.20% | -5.09% | 0.87% | 15.99% | 0.33% |
| 自基金合同生效日起至今 | 53.12% | 1.39% | 15.64% | 1.18% | 37.48% | 0.21% |

注:本基金业绩比较基准为:55%×沪深 300 指数+45%×中证全债指数。沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数,沪深 300 指数包括 300 只样本股,覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性的指数。中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成。

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 2008 年 6 月 25 日正式生效。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满,基金投资组合各项比例符合基金合同的约定:股票资产占基金资产 30-80%,债券资产占基金资产 0%-65%(其中包括可转债、资产支持证券等),权证 0-3%(按照相关法律规定)。

3、经泰信基金管理有限公司第三届董事会 2009 年第四次会议(通讯)审议通过,聘任朱志权为泰信优势增长混合基金基金经理;崔海鸿不再担任该基金基金经理。详细情况请见 2010 年 1 月 16 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调整泰信优势增长灵活配置型证券投资基金基金经理的临时公告》。

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:1、本基金合同生效日为 2008 年 6 月 25 日,2008 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

2、经泰信基金管理有限公司第三届董事会二 00 九年第四次会议(通讯)审议通过,决定聘任朱志权为泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理,总经理助理崔海鸿不再兼任该基金基金经理。详细情况请见 2010 年 1 月 16 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调整泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理的临时公告》。

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 | 3.1000 | 30,395,130.46 | 19,128,031.37 | 49,523,161.83 | |
| 2009 | 1.3000 | 9,615,374.68 | 6,670,076.39 | 16,285,451.07 | |
| 2008 | - | - | - | - | |
| 合计 | 4.4000 | 40,010,505.14 | 25,798,107.76 | 65,808,612.90 | |

注:本基金基金合同于 2008 年 6 月 25 日正式生效。

## §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 42 F
办公地址:上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42 F
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 | | |
| 朱志权先生 | 投资副总监、本基金基金经理兼泰信优质生活基金基金经理 | 2010年 1 月 16 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,担任泰信优质生活基金经理。2010 年 12 月起同时担任投资副总监。 |
| 董山青先生 | 本基金基金经理助理 | 2009年 5 月 26 日 | - | 6 | 香港大学工商管理硕士,CFA。具有基金、期货从业资格。曾任职于中国银行上海分行。2004 年 8 月加入泰信基金管理有限公司,先后在清算会计部、研究部、投资部任职。2010 年 9 月开始同时担任研究总监助理职务。 |
| 崔海鸿先生 | 公司总经理助理、本基金基金经理 | 2008年 6 月 25 日 | 2010年 1 月 16 日 | - | 清华大学工学硕士。具有基金从业资格。曾任大鹏证券有限责任公司综合研究所 IT 组组长、高级分析师、金鹰基金管理有限公司研究部副经理、高级分析师,2005 年 10 月至 2006 年年末担任金鹰中小盘基金经理。2007 年初加入泰信基金管理有限公司,曾任泰信优质生活基金基金经理、总经理助理。已于 2010 年 4 月 23 日离职。 |

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基金合同生效日为准,基金经理的离职日期以公司公告日为准。

3、经泰信基金管理有限公司第三届董事会二 00 九年第四次会议(通讯)审议通过,决定聘任朱志权为泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理,总经理助理崔海鸿不再兼任该基金基金经理。详细情况请见 2010 年 1 月 16 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调整泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理的临时公告》。

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》、《泰信优势增长灵活配置混合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律法规和基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

《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

公司旗下的泰信优势增长基金和泰信先行策略基金同为混合型基金。本报告期间,泰信优势增长混合基金的净值增长率 10.90%,泰信先行策略混合基金净值增长率 -4.44%,两基金在报告期内的净值增长率之差超过 5%,其主要原因是泰信优势增长基金全年超配了大消费概念、生物医药、新能源、节能减排和 TMT 等新兴战略行业,在风格类资产上重点配置中小市值成长股,使得本基金在全年总体获得了较好表现;泰信先行策略混合基金的股票仓位比泰信优势增长混合基金高,在二、四季度对市场风险估计不充分,没有及时的减仓控制风险,另外对银行、地产的减持不够坚决。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,亦未发现异常交易行为。

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

2010 年市场总体趋势震荡,大盘股全年表现平淡,小盘股走出震荡盘升的行情。上半年以震荡下跌行情为主,期间大盘蓝筹股波澜不惊,而创业板和新兴产业板块机会层出不穷。4 月份,房地产宏观调控政策和国际金融市场的动荡引发了市场新一轮的分化与下跌。初期周期类股票领跌,而创业板和中小盘很多个股却走出了独立上涨行情,但随着大小盘股票估值差距的不断拉大,终于在 6 月中旬小盘股开始了全面补跌。第三季度市场走出恢复性上涨行情,创业板和中小板股票再次引领全市场上涨,而大盘股依旧波澜不惊,大小盘股票估值差距持续拉大。随着新兴战略产业的政策推出告一段落,市场预期 11 月创业板首批小非解禁抛售,因此从 9 月中旬开始,创业板带动小盘股下跌,但是上证指数却在国庆节后开始快速上涨,周期性股票和部分大盘股走出红色 10 月行情,而消费类和新兴产业的中小盘股票则大部分处于盘整状态。但是周期股行情仅持续一个月,11 月份小盘股又一次出现复苏行情,直到 12 月中旬大小盘股票齐齐下跌,市场交投清淡。

今年以来,本基金延续了去年看好消费和医药的投资机会,同时增加了对新兴产业的行业配置,全年超配大消费概念、生物医药、新能源、节能减排和 TMT 等新兴战略行业,在风格类资产上重点配置中小市值成长股,使得本基金在全年总体获得了较好表现。

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 1.051 元,净值增长率为 10.90%,同期比较基准净值增长率为 -5.09%。

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 2011 年,发达经济体经济将继续好转,伊斯兰国家的动荡或许引发国际商品价格走高,国内以及发达国家的需求转暖也将对大宗商品价格有正面的支撑作用,同时海外需求回暖或引发贸易顺差上行,对流动性产生正面的贡献。通胀态势仍将持续,管理层继续使用量化紧缩对抗海外量化宽松,同时适度升值以缓解海外压力。流动性的继续收紧和股票供给的持续增加,将成为 2011 年的常态。新股、增发和配股将继续加大力度,像新三板、国际板等制度改革也有可能提上日程。针对房地产的调控政策不会放松,很可能继续加息和提高存款准备金率。

我们预计 2011 年市场仍将以震荡行情为主,预期收益率类似 2010 年。从估值角度看,相对于目前较高的增速预期,A 股市场估值合理略有低估。本基金将根据基金合同规定,在行业和个股方面,重点跟踪各行业、各公司经济复苏的数据及盈利的变化,加大对上市公司的调研力度以及各行业经济数据的变化,深入挖掘优势企业,慎重地进行行业配置和个股投资,坚持合理的行业配置和深入的个股挖掘相结合,前瞻性地寻找并投资于具有可持续成长能力和比较优势的企业。大消费、新能源、节能减排和信息技术等新兴战略产业板块是未来经济发展的方向。我们看好机械装备、节能环保、高铁、LED、信息安全和生物制药等板块的主题投资机会,并将适度均衡化配置以抵御风险。我们将围绕确定性增长这个主基调寻找相对低估的优势企业,努力为基金持有人获取超额收益。

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。加强投管人员的资讯管理,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)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 10%,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、截至本报告期末,本基金每 10 份基金份额分配 3.1 元,年度利润分配合计 49,523,161.83 元(其中,现金形式发放 30,395,130.46 元,再投资形式发放 19,128,031.37 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

2010 年,本基金托管人在对泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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

2010 年,泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金的管理人——泰信基金管理有限公司在泰信优势增长灵活配置混合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严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了三次利润分配,分配金额为 49,523,161.83 元。

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优势增长灵活配置混合型证券投资基金 2010 年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
二〇一一年三月二十三日

## §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 20280 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 | 泰信优势增长灵活配置混合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势增长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"泰信优势增长灵活配置基金")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势增长灵活配置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。<br>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。<br>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势增长灵活配置基金 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 | 薛竟 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:泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日: 2010 年 12 月 31 日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期末<br>2010年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2009年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 资 产: | | |
| 银行存款 | 42,092,528.40 | 24,762,951.14 |
| 结算备付金 | 758,944.78 | 1,171,530.04 |
| 存出保证金 | 125,000.00 | 674,332.39 |
| 交易性金融资产 | 104,393,815.04 | 109,398,536.72 |
| 其中:股票投资 | 104,275,840.64 | 100,672,584.65 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 117,974.40 | 8,725,952.07 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 30,000,000.00 | - |
| 应收证券清算款 | 1,662,145.84 | - |
| 应收利息 | 5,805.58 | 7,282.08 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 329,074.35 | 21,083.88 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 179,367,313.99 | 136,035,716.25 |
| 负债和所有者权益 | 本期期末<br>2010年 12 月 31 日 | 上年度末<br>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 | 30,000,000.00 | 1,610,387.39 |
| 应付赎回款 | 91,480.84 | 125,224.22 |
| 应付管理人报酬 | 204,718.62 | 175,983.07 |
| 应付托管费 | 34,119.75 | 29,330.50 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 233,485.55 | 550,917.69 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 584,844.28 | 584,960.40 |
| 负债合计 | 31,148,649.04 | 3,076,803.27 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 140,961,684.24 | 107,348,888.87 |
| 未分配利润 | 7,256,980.71 | 25,610,024.11 |
| 所有者权益合计 | 148,218,664.95 | 132,958,912.98 |
| 负债和所有者权益总计 | 179,367,313.99 | 136,035,716.25 |

注:报告截止日 2010 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.051 元,基金份额总额 140,961,684.24 份。

7.2 利润表

会计主体:泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金
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<br>2010年 1 月 1 日至<br>010 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2009年 1 月 1 日至<br>2009 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 22,215,083.04 | 73,719,711.34 |
| 1.利息收入 | 264,970.52 | 626,878.37 |
| 其中:存款利息收入 | 255,628.89 | 158,979.11 |
| 债券利息收入 | 1,341.08 | 467,899.26 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 8,000.55 | - |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | 9,681,517.50 | 66,832,303.97 |
| 其中:股票投资收益 | 8,935,745.59 | 59,740,402.09 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 271,228.03 | 6,396,197.28 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 474,543.88 | 695,704.60 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | 12,129,269.73 | 5,748,427.68 |
| 4. 汇兑收益(损失以"—"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 139,325.29 | 512,101.32 |
| 减:二、费用 | 3,755,487.52 | 9,290,096.66 |
| 1. 管理人报酬 | 1,971,624.62 | 2,576,705.33 |
| 2. 托管费 | 328,604.02 | 429,450.83 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 1,106,096.00 | 5,934,773.00 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 349,162.88 | 349,167.50 |
| 三、利润总额 | 18,459,595.52 | 64,429,614.68 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | 18,459,595.52 | 64,429,614.68 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金
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<br>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) | 107,348,888.87 | 25,610,024.11 | 132,958,912.98 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 18,459,595.52 | 18,459,595.52 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列) | 33,612,795.37 | 12,710,522.91 | 46,323,318.28 |
| 其中:1.基金申购款 | 137,005,517.94 | 28,068,421.88 | 165,073,939.82 |
| 2.基金赎回款 | -103,392,722.57 | -15,357,898.97 | -118,750,621.54 |
| 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) | - | -49,523,161.83 | -49,523,161.83 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 140,961,684.24 | 7,256,980.71 | 148,218,664.95 |

| 项目 | 上年度可比期间<br>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) | 231,678,139.45 | -2,218,166.00 | 229,459,973.45 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 64,429,614.68 | 64,429,614.68 |
| 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) | -124,329,250.58 | -20,315,973.50 | -144,645,224.08 |
| 其中:1.基金申购款 | 215,555,235.14 | 57,525,335.51 | 273,080,570.65 |
| 2.基金赎回款 | -339,884,485.72 | -77,841,309.01 | -417,725,794.73 |
| 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) | - | -16,285,451.07 | -16,285,451.07 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 107,348,888.87 | 25,610,024.11 | 132,958,912.98 |

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

泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金(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")证监许可[2008]第 500 号《关于核准泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》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《泰信优势增长灵活配置混合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 496,788,778.94 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(2008)第 098 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2008 年 6 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 496,819,498.95 份基金份额,其中认购资金利息折合 30,720.01 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信优势增长灵活配置混合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国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 30-80%,债券资产占基金资产的比例为 0-65%(其中包括可转债、资产支持证券等),权证占基金资产的比例为 0-3%。基金保留的现金以及到期日在 1 年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:55%X 沪深 300 指数 +45%X 中证全债指数。

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》、《泰信优势增长灵活配置混合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。

7.4.8 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<br>2010年 1 月 1 日至<br>2010 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2009年 1 月 1 日至<br>2009 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,971,624.62 | 2,576,705.33 |
| 其中:支付给销售机构的客户维护费 | 312,896.44 | 428,096.34 |

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<br>2010年 1 月 1 日至<br>2010 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2009年 1 月 1 日至<br>2009 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 328,604.02 | 429,450.83 |

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 0.25%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<br>2010年 1 月 1 日至<br>2010 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2009年 1 月 1 日至<br>2009 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 期初持有的基金份额 | 20,001,400.00 | 20,001,400.00 |
| 期间申购 / 买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减:期间赎回 / 卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 20,001,400.00 | 20,001,400.00 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 14.19% | 18.63% |

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<br>2010年 12 月 31 日 | | 上年度末<br>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 | 29,085,544.36 | 20.63% | 22,296,336.87 | 20.77% |

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<br>2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间<br>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 |
| 中国工商银行 | 42,092,528.40 | 249,691.03 | 24,762,951.14 | 136,555.47 |

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。

7.4.8.6 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

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(单位:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 300129 | 泰胜风能 | 10/10/12 | 11/01/19 | 新股网下申购 | 31.00 | 39.92 | 32,786 | 1,016,366.00 | 1,308,817.12 | - |
| 300132 | 青松股份 | 10/10/14 | 11/01/26 | 新股网下申购 | 23.00 | 35.66 | 32,986 | 758,678.00 | 1,176,280.76 | - |
| 002502 | 骅威股份 | 10/11/05 | 11/02/17 | 新股网下申购 | 29.00 | 30.30 | 22,380 | 649,020.00 | 678,114.00 | - |
| 002499 | 科林环保 | 10/10/29 | 11/02/09 | 新股网下申购 | 25.00 | 41.55 | 16,054 | 401,350.00 | 667,043.70 | - |
| 300127 | 银河磁体 | 10/09/27 | 11/01/13 | 新股网下申购 | 18.00 | 27.90 | 18,540 | 333,720.00 | 517,266.00 | - |
| 601098 | 中南传媒 | 10/10/22 | 11/01/28 | 新股网下申购 | 10.66 | 11.98 | 36,459 | 388,652.94 | 436,778.82 | - |
| 601777 | 力帆股份 | 10/11/17 | 11/02/25 | 新股网下申购 | 14.50 | 14.06 | 29,574 | 428,823.00 | 415,810.44 | - |
| 002486 | 嘉麟杰 | 10/09/29 | 11/01/17 | 新股网下申购 | 10.90 | 14.90 | 24,888 | 271,279.20 | 370,831.20 | - |
| 002504 | 东光微电 | 10/11/10 | 11/02/18 | 新股网下申购 | 16.00 | 26.85 | 12,808 | 204,928.00 | 343,894.80 | - |
| 600998 | 九州通 | 10/10/27 | 11/02/02 | 新股网下申购 | 13.00 | 14.55 | 17,807 | 231,491.00 | 259,091.85 | - |
| 601933 | 永辉超市 | 10/12/09 | 11/03/15 | 新股网下申购 | 23.98 | 31.24 | 7,419 | 177,907.62 | 231,769.56 | - |
| 601126 | 四方股份 | 10/12/28 | 11/03/31 | 新股网下申购 | 23.00 | 31.11 | 7,015 | 161,345.00 | 218,236.65 | - |
| 002537 | 海立美达 | 10/12/31 | 11/01/10 | 新股网上申购 | 40.00 | 40.00 | 500 | 20,000.00 | 20,000.00 | - |
| 002534 | 杭锅股份 | 10/12/31 | 11/01/10 | 新股网上申购 | 26.00 | 26.00 | 500 | 13,000.00 | 13,000.00 | - |
| 合计 | - | - | - | - | - | - | - | 5,056,560.76 | 6,656,934.90 | - |

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。

7.4.9.2 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 002439 | 启明星辰 | 10/12/29 | 公告重大事项 | 42.55 | 未知 | 未知 | 22,988 | 574,700.00 | 978,139.40 | - |
| 合计 | - | - | - | - | - | - | - | 574,700.00 | 978,139.40 | - |

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

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 103,415,675.64 元,属于第二层级的余额为 978,139.40 元,无属于第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日:第一层级 109,398,536.72 元,无第二层级和第三层级)。

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)。

## §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 | 104,275,840.64 | 58.14 |
| | 其中:股票 | 104,275,840.64 | 58.14 |
| 2 | 固定收益投资 | 117,974.40 | 0.07 |
| | 其中:债券 | 117,974.40 | 0.07 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 30,000,000.00 | 16.73 |
| | 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 | 42,851,473.18 | 23.89 |
| 6 | 其他各项资产 | 2,122,025.77 | 1.18 |
| | 合计 | 179,367,313.99 | 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 | 2,490,125.34 | 1.68 |
| B | 采掘业 | 6,399,955.50 | 4.32 |
| C | 制造业 | 68,311,304.45 | 46.09 |
| C0 | 食品、饮料 | 5,280,000.00 | 3.56 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 370,831.20 | 0.25 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | 678,114.00 | 0.46 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 3,848,280.76 | 2.60 |
| C5 | 电子 | 10,169,590.00 | 6.86 |
| C6 | 金属、非金属 | 1,542,134.20 | 1.04 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 18,826,244.29 | 12.70 |
| C8 | 医药、生物制品 | 27,223,980.00 | 18.37 |
| C99 | 其他制造业 | 372,130.00 | 0.25 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 2,173,448.00 | 1.47 |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| G | 信息技术业 | 13,318,324.12 | 8.99 |
| H | 批发和零售贸易 | 1,924,661.41 | 1.30 |
| I | 金融、保险业 | - | - |
| J | 房地产业 | - | - |
| K | 社会服务业 | 4,466,340.00 | 3.01 |
| L | 传播与文化产业 | 5,191,681.82 | 3.50 |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 104,275,840.64 | 70.35 |

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 | 600276 | 恒瑞医药 | 90,000 | 5,360,400.00 | 3.62 |
| 2 | 600079 | 人福医药 | 200,000 | 5,096,000.00 | 3.44 |
| 3 | 000566 | 海南海药 | 170,000 | 5,045,600.00 | 3.40 |
| 4 | 600880 | 博瑞传播 | 230,000 | 4,503,400.00 | 3.04 |
| 5 | 300010 | 立思辰 | 160,000 | 4,208,000.00 | 2.84 |
| 6 | 600547 | 山东黄金 | 70,000 | 3,689,700.00 | 2.49 |
| 7 | 002214 | 大立科技 | 85,059 | 3,470,407.20 | 2.34 |
| 8 | 002304 | 洋河股份 | 15,000 | 3,360,000.00 | 2.27 |
| 9 | 002368 | 太极股份 | 50,000 | 2,710,000.00 | 1.83 |
| 10 | 000983 | 西山煤电 | 100,000 | 2,669,000.00 | 1.80 |

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 | 600547 | 山东黄金 | 9,896,857.00 | 7.44 |
| 2 | 600866 | 星湖科技 | 6,585,509.28 | 4.95 |
| 3 | 600276 | 恒瑞医药 | 5,849,847.98 | 4.40 |
| 4 | 000887 | 中鼎股份 | 5,723,243.00 | 4.30 |
| 5 | 002140 | 东华科技 | 5,648,589.00 | 4.25 |
| 6 | 600880 | 博瑞传播 | 5,536,703.00 | 4.16 |
| 7 | 601607 | 上海医药 | 5,315,160.37 | 4.00 |
| 8 | 600079 | 人福医药 | 5,031,688.74 | 3.78 |
| 9 | 300058 | 蓝色光标 | 5,022,651.71 | 3.78 |
| 10 | 601168 | 西部矿业 | 4,510,424.10 | 3.39 |
| 11 | 600271 | 航天信息 | 4,403,765.43 | 3.31 |
| 12 | 600750 | 江中药业 | 4,397,102.96 | 3.31 |
| 13 | 002153 | 石基信息 | 4,314,107.90 | 3.24 |
| 14 | 000566 | 海南海药 | 4,232,765.77 | 3.18 |
| 15 | 600508 | 上海能源 | 4,128,284.70 | 3.10 |
| 16 | 002332 | 仙琚制药 | 4,076,605.24 | 3.07 |
| 17 | 600585 | 海螺水泥 | 3,946,004.74 | 2.97 |
| 18 | 600529 | 山东药玻 | 3,937,677.22 | 2.96 |
| 19 | 000021 | 长城开发 | 3,791,790.00 | 2.85 |
| 20 | 002304 | 洋河股份 | 3,502,663.25 | 2.63 |
| 21 | 002214 | 大立科技 | 3,490,029.00 | 2.62 |
| 22 | 600837 | 海通证券 | 3,436,634.89 | 2.58 |
| 23 | 002368 | 太极股份 | 3,428,504.72 | 2.58 |
| 24 | 600741 | 华域汽车 | 3,377,550.00 | 2.54 |
| 25 | 002152 | 广电运通 | 3,325,905.83 | 2.50 |
| 26 | 002022 | 科华生物 | 3,300,164.22 | 2.48 |
| 27 | 600141 | 兴发集团 | 3,217,321.00 | 2.42 |
| 28 | 600426 | 华鲁恒升 | 3,205,367.00 | 2.41 |
| 29 | 002424 | 贵州百灵 | 3,160,190.00 | 2.38 |
| 30 | 002050 | 三花股份 | 3,155,900.80 | 2.37 |
| 31 | 000612 | 焦作万方 | 3,104,470.00 | 2.33 |
| 32 | 300010 | 立思辰 | 3,094,465.60 | 2.33 |
| 33 | 002408 | 齐翔腾达 | 3,047,277.92 | 2.29 |
| 34 | 600097 | 开创国际 | 2,975,292.65 | 2.24 |
| 35 | 002249 | 大洋电机 | 2,959,754.00 | 2.23 |
| 36 | 601088 | 中国神华 | 2,949,990.00 | 2.22 |
| 37 | 300047 | 天源迪科 | 2,940,441.90 | 2.21 |
| 38 | 600415 | 小商品城 | 2,940,395.38 | 2.21 |
| 39 | 600884 | 杉杉股份 | 2,902,608.00 | 2.18 |
| 40 | 300045 | 华力创通 | 2,881,904.96 | 2.17 |
| 41 | 000639 | 金德发展 | 2,749,872.00 | 2.07 |
| 42 | 000983 | 西山煤电 | 2,718,392.00 | 2.04 |
| 43 | 600496 | 精工钢构 | 2,688,276.37 | 2.02 |
| 44 | 600900 | 长江电力 | 2,682,000.00 | 2.02 |

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 | 600271 | 航天信息 | 6,690,513.80 | 5.03 |
| 2 | 002140 | 东华科技 | 6,601,302.39 | 4.96 |
| 3 | 600866 | 星湖科技 | 6,317,444.00 | 4.75 |
| 4 | 000028 | 一致药业 | 5,750,051.00 | 4.32 |
| 5 | 300058 | 蓝色光标 | 5,741,147.85 | 4.32 |
| 6 | 600547 | 山东黄金 | 5,369,250.00 | 4.04 |
| 7 | 600690 | 青岛海尔 | 5,163,952.78 | 3.88 |
| 8 | 002153 | 石基信息 | 5,005,892.27 | 3.76 |
| 9 | 002332 | 仙琚制药 | 4,584,915.16 | 3.45 |
| 10 | 000069 | 华侨城 A | 4,509,259.49 | 3.39 |
| 11 | 000800 | 一汽轿车 | 4,499,416.31 | 3.38 |
| 12 | 600987 | 航民股份 | 4,373,874.96 | 3.29 |
| 13 | 600529 | 山东药玻 | 4,363,651.56 | 3.28 |
| 14 | 000021 | 长城开发 | 4,325,608.30 | 3.25 |
| 15 | 000887 | 中鼎股份 | 4,290,021.50 | 3.23 |
| 16 | 601168 | 西部矿业 | 4,259,590.00 | 3.20 |
| 17 | 000969 | 安泰科技 | 4,212,539.17 | 3.17 |
| 18 | 600016 | 民生银行 | 4,187,500.00 | 3.15 |
| 19 | 601607 | 上海医药 | 4,117,564.17 | 3.10 |
| 20 | 600184 | 光电股份 | 4,107,573.12 | 3.09 |
| 21 | 600585 | 海螺水泥 | 4,076,288.00 | 3.07 |
| 22 | 600546 | 山煤国际 | 4,057,021.74 | 3.05 |
| 23 | 002121 | 科陆电子 | 4,025,475.00 | 3.03 |
| 24 | 600479 | 千金药业 | 4,023,552.00 | 3.03 |
| 25 | 601328 | 交通银行 | 3,997,723.00 | 3.01 |
| 26 | 600426 | 华鲁恒升 | 3,975,697.37 | 2.99 |
| 27 | 000927 | 一汽夏利 | 3,964,716.00 | 2.98 |
| 28 | 002249 | 大洋电机 | 3,779,679.00 | 2.84 |
| 29 | 000895 | 双汇发展 | 3,762,586.70 | 2.83 |
| 30 | 601318 | 中国平安 | 3,584,835.00 | 2.70 |
| 31 | 002408 | 齐翔腾达 | 3,486,170.90 | 2.62 |
| 32 | 600741 | 华域汽车 | 3,454,806.04 | 2.60 |
| 33 | 002424 | 贵州百灵 | 3,435,647.25 | 2.58 |
| 34 | 600307 | 酒钢宏兴 | 3,420,735.92 | 2.57 |
| 35 | 600508 | 上海能源 | 3,408,527.06 | 2.56 |
| 36 | 600837 | 海通证券 | 3,404,025.00 | 2.56 |
| 37 | 600031 | 三一重工 | 3,285,828.74 | 2.47 |
| 38 | 600415 | 小商品城 | 3,270,192.00 | 2.46 |
| 39 | 000639 | 金德发展 | 3,251,191.00 | 2.45 |
| 40 | 002022 | 科华生物 | 3,207,690.00 | 2.41 |
| 41 | 300047 | 天源迪科 | 3,164,554.58 | 2.38 |
| 42 | 600809 | 山西汾酒 | 3,150,067.56 | 2.37 |
| 43 | 600380 | 健康元 | 3,146,914.59 | 2.37 |
| 44 | 600097 | 开创国际 | 3,071,861.97 | 2.31 |
| 45 | 600141 | 兴发集团 | 2,985,607.23 | 2.25 |
| 46 | 002059 | 云南旅游 | 2,968,600.00 | 2.23 |
| 47 | 300045 | 华力创通 | 2,940,981.58 | 2.21 |
| 48 | 600050 | 中国联通 | 2,912,000.00 | 2.19 |
| 49 | 600884 | 杉杉股份 | 2,896,146.00 | 2.18 |

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 | 359,183,867.24 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 376,432,169.32 |

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

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 可转债 | 117,974.40 | 0.08 |
| 7 | 其他 | - | - |
| | 合计 | 117,974.40 | 0.08 |

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(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 110011 | 歌华转债 | 960 | 117,974.40 | 0.08 |

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 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股票库之外的股票。

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 | 125,000.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,662,145.84 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,805.58 |
| 5 | 应收申购款 | 329,074.35 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,122,025.77 |

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.9.6 本基金本报告期末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 |
| 3,686 | 38,242.45 | 90,040,184.48 | 63.88% | 50,921,499.76 | 36.12% |

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 | 177,933.42 | 0.1262% |

## §10 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日( 2008 年 6 月 25 日 )基金份额总额 | 496,819,498.95 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 107,348,888.87 |
| 本报告期基金总申购份额 | 137,005,517.94 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 103,392,722.57 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 140,961,684.24 |

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

1、经泰信基金管理有限公司第三届董事会二 OO 九年第四次会议(通讯)审议通过由朱志权同志担任优势增长基金经理,总经理助理崔海鸿同志不再担任优势增长基金经理职务。详细情况请见刊登在 2010 年 1 月 16 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调整泰信优势增长灵活配置型证券投资基金基金经理的临时公告》。

除此以外无其他重大人事变动。

2、经证监会审批,晏秋生任资产托管部副总经理。

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 5 万元。该审计机构从基金合同生效日(2008 年 6 月 25 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 | |
| 宏源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | 新增 |
| 英大证券 | 1 | - | - | - | - | 新增 |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | 新增 |
| 高华证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1 | 361,668,097.77 | 50.35% | 293,857.64 | 49.23% | 公司旗下所有基金通过中国银河证券的年交易佣金未超过旗下所有基金买卖证券交易佣金的 30% |
| 华泰联合 | 1 | 186,229,905.82 | 25.93% | 158,295.21 | 26.52% | - |
| 齐鲁证券 | 1 | 170,350,098.19 | 23.72% | 144,797.24 | 24.26% | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 9 | 718,248,101.78 | - | 596,950.09 | 100.00% | - |

注:根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位有关问题的通知》(证监基金字【2007】48 号)中关于"一家基金公司通过一家证券经营机构买卖证券的年交易佣金,不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金 30%"的要求,本基金管理人在选择租用交易单元时,注重所选证券公司的综合实力、市场声誉。对证券公司的研究能力,由公司研究人员对其提供的研究报告、研究成果的质量进行定期评估。公司将根据内部评估报告,对交易单元租用情况进行总体评价,决定是否对交易单元租用情况进行调整。

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 |
| 宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 英大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 9,005,302.12 | 99.02% | - | - | - | - |
| 华泰联合 | 89,058.20 | 0.98% | - | - | - | - |
| 齐鲁证券 | - | - | 75,500,000.00 | 100.00% | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 合计 | 9,094,360.32 | - | - | - | - | - |

**泰信基金管理有限公司**
**2011 年 3 月 29 日**