泰信增强收益债券型证券投资基金 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	泰信债券增强收益	
基金主代码	290007	
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	
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	362,505,847.99 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	泰信债券增强收益 A	泰信债券增强收益 C
下属分级基金的交易代码:	290007	291007
报告期末下属分级基金的份额总额	312,396,321.33 份	50,109,526.66 份

2.2 基金产品说明

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,通过召开投资决策委员会,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。

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	
本期已实现收益	34,411,884.39	7,053,652.30	-12,641,731.82	-8,658,948.69
本期利润	28,485,826.74	7,876,752.45	-10,399,567.71	-5,719,754.66
加权平均基金份额本期利润	0.0616	0.0447	-0.0147	-0.0136
本期基金份额净值增长率	6.69%	6.29%	-1.13%	-1.31%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年		2009 年	
期末可供分配基金份额利润	0.0049	0.0030	-0.0176	-0.0193
期末基金资产净值	313,934,516.17	50,258,824.97	433,378,571.89	277,633,007.02
期末基金份额净值	1.0049	1.0030	0.9887	0.9869

注:1、本基金基金合同于 2009 年 7 月 29 日正式生效。

2、所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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

泰信债券增强收益 A

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	3.60%	0.42%	-0.29%	0.05%	3.89%	0.37%
过去六个月	8.25%	0.33%	1.15%	0.05%	7.10%	0.28%
过去一年	6.69%	0.28%	6.57%	0.06%	0.12%	0.22%
自基金合同生效日起至今	5.48%	0.34%	7.33%	0.06%	-1.85%	0.28%

泰信债券增强收益 C

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	3.51%	0.42%	-0.29%	0.05%	3.80%	0.37%
过去六个月	8.05%	0.33%	1.15%	0.05%	6.90%	0.28%
过去一年	6.29%	0.28%	6.57%	0.06%	-0.28%	0.22%
自基金合同生效日起至今	4.89%	0.34%	7.33%	0.06%	-2.44%	0.28%

注:本基金的业绩比较基准为:80%上证企业债指数+20%上证国债指数。

1、上证企业债指数,是按照科学客观的方法,从国内交易所上市企业债中挑选了满足一定条件的具有代表性的债券组成样本,按照债券发行量加权计算的指数,科学地反应了我国企业债券市场的变化。

2、上证国债指数是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,具有广泛的市场代表性。

3、上证企业债指数与上证国债指数很好地反映了我国债券市场的整体状况,具有较高的权威和市场代表性,投资人可以从上交所行情、中国货币网等处获得。

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 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。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%。

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 2009 年 7 月 29 日,2009 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

单位:人民币元

泰信债券增强收益 A					
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	0.5000	7,444,785.25	10,100,448.90	17,545,234.15	
2009	-	-	-	-	
合计	0.5000	7,444,785.25	10,100,448.90	17,545,234.15	

泰信债券增强收益 C					
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	0.4600	2,595,580.32	709,849.68	3,305,430.00	
2009	-	-	-	-	
合计	0.4600	2,595,580.32	709,849.68	3,305,430.00	

注:本基金基金合同于 2009 年 7 月 29 日正式生效,2009 年没有进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人:泰信基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路 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		
何俊春女士	本基金基金经理兼泰信双息双利债券基金基金经理	2009年 7 月 29 日	-	13	工商管理硕士。具有基金从业资格。曾任职于上海鸿安投资咨询有限公司、齐鲁证券上海斜土路营业部。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、泰信天天收益基金经理。自 2008 年 10 月 10 日起担任泰信双息双利基金基金经理。
马成先生	本基金基金经理兼泰信天天收益货币基金基金经理	2009年 7 月 29 日	-	8	经济学硕士。具有基金从业资格。2003 年 7 月加入泰信基金管理公司,先后担任理财顾问部高级经理、交易室交易主管、投资管理部经理助理、泰信双息双利基金经理助理。自 2008 年 10 月 10 日起担任泰信天天收益基金基金经理至今。

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。

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》、《泰信增强收益债券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

本报告期内,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

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 年初经济处于高位运行,各类资产价格攀升。在商业银行、保险公司的推动下,债券市场利率下行、信用产品普涨。但随着经济刺激政策的逐步退出和一系列遏制经济过热措施的出台,包括上调存款准备金比率、出台房地产政策等,以及欧洲主权债务危机的发生,二季度经济开始显著放缓,GDP 从年初的 11.9%回落到 10.3%,工业增加值则从 18.1%回落到 13.7%。资金方面则从 5 月中下旬开始逐步趋紧,3 个月和 1 年期央票发行利率交替上行,回购、SHIBOR 利率则在进入六月之后屡创新高。六月底至八月中旬,紧张的资金面曾得到暂时的缓和,债券收益率有所回落。2010 年 10 月,人民银行上调存贷款利率 25 个基点,这是时隔三年之后的首度加息,也标志着之前的宽松的货币政策告一段落,基准利率上调带动债券市场的收益率急速上行,长端上行幅度远超短端,收益率曲线陡峭化明显。11 月,央行连续上调商业银行存款准备金率,12 月,中央经济工作会议确定了 2011 年将实施稳健的货币政策,同时央行停发了三年期央票,存款准备金率再度上调了 50 个基点,月底又进行了一次加息,这一系列政策加上年底因素,资金面迅速紧张,回购利率飙升;短端收益率大幅上行,收益率曲线趋于平坦。总体来看,四季度债券市场收益率水平整体快速上行,中债指数大幅下跌,资金面迅速紧张。

增强收益基金上半年减持可转债品种,同时增加信用债配置,较好地规避了股市下跌带来的风险。下半年增加了权益类资产的配置,降低信用债配置比例。同时积极参与新股及可转债一级市场申购,为持有人创造了较好收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金 A 类单位净值为 1.0049 元,份额净值增长率为 6.69%,同期业绩比较基准增长率为 6.57%;C 类单位净值为 1.0030 元,份额净值增长率为 6.29%,同期业绩比较基准增长率为 6.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望新的一年,由于物价仍在上涨,货币紧缩的压力依然较大,我们预计基准利率及存款准备金率将进一步上调,未来国债等无风险利率在通胀及资金压力导致的系统性冲击下将继续缓慢上行。从企业债与国债所反映的信用利差来看,自 10 月中旬加息以后,信用利差明显上升,未来随着配置性需求的增加,信用利差下半年将趋势性下行。

基于宏观经济的分析,我们认为目前收益率曲线下行空间不大,考虑到信用债的票息收益较好,能一定程度上弥补信用利差上行带来的损失,逐步增加高收益信用产品配置。并积极参与可转债申购,把握利率产品的趋势性投资机会,适时拉长久期提高收益。

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、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。

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、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。

5、在本报告期内,本基金的投资运作过程中未出现异常交易、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)基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资两种。投资人可选择获取现金红利,或将分红资金按除权日该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金红利。

(2)由于基金费用的不同,不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同,基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案,同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

(4)在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年最多为 12 次。

(5)每次基金收益分配比例不低于期末可供分配利润的 50%。基金合同生效不满三个月,收益可不分配。

(6)基金红利发放日距离收益分配基准日(期末可供分配利润计算截至日)的时间不得超过 15 个工作日。

(7)法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

2、截至本报告期末,本基金 A 类每 10 份基金份额分配 0.50 元,年度利润分配合计 17,545,234.15 元(其中,现金形式发放 7,444,785.25 元,再投资形式发放 10,100,448.90 元);本基金 C 类每 10 份基金份额分配 0.46 元,年度利润分配合计 3,305,430.00 元(其中,现金形式发放 2,595,580.32 元,再投资形式发放 709,849.68 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”)在对泰信增强收益债券型证券投资基金(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 20282 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	泰信增强收益债券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增强收益债券型证券投资基金(以下简称“泰信增强收益基金”)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增强收益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增强收益基金 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:泰信增强收益债券型证券投资基金
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	37,709,311.83	445,454,172.38
结算备付金	3,175,944.15	445,404.44
存出保证金	83,370.82	82,175.14
交易性金融资产	364,277,044.61	271,905,326.61
其中:股票投资	48,146,425.60	84,175,267.75
基金投资	-	-
债券投资	316,130,619.01	187,730,058.86
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	-	-
应收利息	3,429,221.54	420,326.41
应收股利	-	-
应收申购款	47,958.81	19,999,600.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	408,722,851.76	738,307,004.98
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	40,000,000.00	-
应付证券清算款	3,115,511.44	-
应付赎回款	120,710.49	26,166,967.39
应付管理人报酬	190,370.20	491,083.55
应付托管费	63,456.74	163,694.51
应付销售服务费	17,868.47	105,976.37
应付交易费用	70,521.87	73,384.97
应交税费	586,747.00	-
应付利息	3,888.18	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	360,436.23	294,319.28
负债合计	44,529,510.62	27,295,426.07
所有者权益:		
实收基金	362,505,847.99	719,662,329.14
未分配利润	1,687,493.15	-8,650,750.23
所有者权益合计	364,193,341.14	711,011,578.91
负债和所有者权益总计	408,722,851.76	738,307,004.98

注:1. 报告截止日 2010 年 12 月 31 日,A 类基金份额净值 1.0049 元,C 类基金份额净值 1.0030 元,基金份额总额 362,505,847.99 份,其中 A 类基金份额 312,396,321.33 份,C 类基金份额 50,109,526.66 份。

2. 比较财务报表的实际编制期间为 2009 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体:泰信增强收益债券型证券投资基金
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 7 月 29 日至 2009 年 12 月 31 日
一、收入	45,442,181.15	-11,148,079.61
1.利息收入	14,099,449.86	3,187,480.54
其中:存款利息收入	814,634.13	2,085,093.23
债券利息收入	13,254,197.97	748,959.86
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	30,617.76	353,427.45
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	36,310,170.29	-19,688,490.07
其中:股票投资收益	28,311,501.22	-4,424,674.58
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7,956,925.27	-15,963,867.48
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	699,007.99
股利收益	41,743.80	1,044.00
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-5,102,957.50	5,181,358.14
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	135,518.50	171,571.78
减:二、费用	9,079,601.96	4,971,242.76
1.管理人报酬	3,812,357.91	2,807,434.71
2.托管费	1,270,785.94	935,811.52
3.销售服务费	700,318.85	696,794.08
4.交易费用	635,418.55	251,527.49
5.利息支出	2,258,447.43	-
其中:卖出回购金融资产支出	2,258,447.43	-
6.其他费用	402,273.28	279,674.96
三、利润总额	36,362,579.19	-16,119,322.37
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	36,362,579.19	-16,119,322.37

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰信增强收益债券型证券投资基金
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)	719,662,329.14	-8,650,750.23	711,011,578.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	36,362,579.19	36,362,579.19
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)	-357,156,481.15	-5,173,671.66	-362,330,152.81
其中:1.基金申购款	303,062,567.89	1,027,480.07	304,090,047.96
2.基金赎回款	-660,219,049.04	-6,201,151.73	-666,420,200.77
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)	-	-20,850,664.15	-20,850,664.15
五、期末所有者权益(基金净值)	362,505,847.99	1,687,493.15	364,193,341.14

项目	上年度可比期间 2009年 7 月 29 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)	1,175,986,774.72	-	1,175,986,774.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-16,119,322.37	-16,119,322.37
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)	-456,324,445.58	7,468,572.14	-448,855,873.44
其中:1.基金申购款	241,357,176.82	-3,933,720.74	237,423,456.08
2.基金赎回款	-697,681,622.40	11,402,292.88	-686,279,329.52
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)	719,662,329.14	-8,650,750.23	711,011,578.91

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

泰信增强收益债券型证券投资基金(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[2009]480 号《关于核准泰信增强收益债券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《泰信增强收益债券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 1,175,877,200.51 元,折合为 1,175,877,200.51 份基金份额(其中 A 类份额 723,971,941.85 份,C 类份额 451,905,258.66 份),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(2009)第 128 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信增强收益债券型证券投资基金基金合同》于 2009 年 7 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,175,986,774.72 份基金份额,其中认购资金利息折合 109,574.21 份基金份额(其中 A 类份额 69,303.32 份,C 类份额 40,270.89 份)。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《泰信增强收益债券型证券投资基金基金合同》和《泰信增强收益债券型证券投资基金招募说明书》,本基金自募集期起根据申购费用及销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费的,称为 A 类;不收取认购/申购费,而从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信增强收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行上市的国债、金融债、央行票据、企业(公司)债、短期融资券、可转换债券、可分离债券、资产支持证券、次级债等;本基金也可投资于一级市场新股、增发新股、可转换债券转股和因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等。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%。本基金的业绩比较基准为:80%上证企业债指数+20%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 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》、《泰信增强收益债券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、基金销售机构、注册登记机构
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	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	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 7 月 29 日至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,812,357.91	2,807,434.71
其中:支付给销售机构的客户维护费	463,327.62	376,594.68

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 0.6%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 0.6% / 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 7 月 29 日至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,270,785.94	935,811.52

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 0.2%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 0.2% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰信债券增强收益 A	泰信债券增强收益 C	合计
泰信基金管理有限公司	-	1,002.60	1,002.60
中国银行	-	499,946.39	499,946.39
合计	-	500,948.99	500,948.99

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2009年 7 月 29 日至 2009 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰信债券增强收益 A	泰信债券增强收益 C	合计
泰信基金管理有限公司	-	105,179.86	105,179.86
中国银行	-	436,925.89	436,925.89
合计	-	542,105.75	542,105.75

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.4%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=C 类基金份额前一日基金资产净值 X 0.4% / 当年天数。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

单位:人民币元

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		
	泰信债券增强收益 A	泰信债券增强收益 C	合计
期初持有的基金份额	17,999,360.00	-	17,999,360.00
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	17,999,360.00	-	17,999,360.00
期末持有的基金份额	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-

项目	上年度可比期间 2009年 7 月 29 日至 2009 年 12 月 31 日		
	泰信债券增强收益 A	泰信债券增强收益 C	合计
基金合同生效日(2009 年 7 月 29 日)持有的基金份额	17,999,360.00	-	17,999,360.00
期初持有的基金份额	-	-	-
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	17,999,360.00	-	17,999,360.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.11%	-	2.50%

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,适用赎回费率为 0.05%。

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

无。

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 7 月 29 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	37,709,311.83	782,634.74	445,454,172.38	2,070,512.28

注:本基金的银行存款均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

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
300132	青松股份	10/10/14	11/01/26	新股网下申购	23.00	35.66	80,110	1,842,530.00	2,856,722.60	-
300138	晨光生物	10/10/27	11/02/07	新股网下申购	30.00	34.44	82,932	2,487,960.00	2,856,178.08	-
002499	科林环保	10/10/29	11/02/09	新股网下申购	25.00	41.55	61,005	1,525,125.00	2,534,757.75	-
300127	银河磁体	10/09/27	11/01/13	新股网下申购	18.00	27.90	84,461	1,520,298.00	2,356,461.90	-
002495	佳隆股份	10/10/22	11/02/02	新股网下申购	32.00	31.57	72,670	2,325,440.00	2,294,191.90	-
300133	华策影视	10/10/14	11/01/26	新股网下申购	68.00	116.00	17,357	1,180,276.00	2,013,412.00	-
300128	锦富新材	10/09/27	11/01/24	新股网下申购	35.00	47.19	38,783	1,357,405.00	1,830,169.77	-
002486	嘉麟杰	10/09/29	11/01/17	新股网下申购	10.90	14.90	112,537	1,226,653.30	1,676,801.30	-
002502	骅威股份	10/11/05	11/02/17	新股网下申购	29.00	30.30	44,760	1,298,040.00	1,356,228.00	-
601118	海南橡胶	10/12/30	11/01/07	新股网上申购	5.99	5.99	5,000	29,950.00	29,950.00	-
300155	安居宝	10/12/29	11/01/07	新股网上申购	49.00	49.00	500	24,500.00	24,500.00	-
300158	振东制药	10/12/29	11/01/07	新股网上申购	38.80	38.80	500	19,400.00	19,400.00	-
合计								14,837,577.30	19,848,773.30	

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

无。

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

截至本报告期末 2010 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 40,000,000.00 元,于 2011 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。

7.4.10 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 236,808,589.01 元,第二层级的余额为 127,468,455.60 元,无属于第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日:第一层级 241,713,326.61 元,第二层级 30,192,000.00 元,无第三层级)。

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)。

(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	48,146,425.60	11.78
	其中:股票	48,146,425.60	11.78
2	固定收益投资	316,130,619.01	77.35
	其中:债券	316,130,619.01	77.35
	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	40,885,255.98	10.00
6	其他各项资产	3,560,551.17	0.87
	合计	408,722,851.76	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	29,950.00	0.01
B	采掘业	-	-
C	制造业	22,040,501.60	6.05
C0	食品、饮料	2,294,191.90	0.63
C1	纺织、服装、皮毛	1,676,801.30	0.46
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,356,228.00	0.37
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,856,722.60	0.78
C5	电子	6,811,221.97	1.87
C6	金属、非金属	1,635,000.00	0.45
C7	机械、设备、仪表	2,534,757.75	0.70
C8	医药、生物制品	2,875,578.08	0.79
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	12,240,000.00	3.36
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	9,376,962.00	2.57
G	信息技术业	2,445,600.00	0.67
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	2,013,412.00	0.55
M	综合类	-	-
	合计	48,146,425.60	13.22

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	600795	国电电力	4,000,000	12,240,000.00	3.36
2	601006	大秦铁路	1,199,100	9,376,962.00	2.57
3	300132	青松股份	80,110	2,856,722.60	0.78
4	300138	晨光生物	82,932	2,856,178.08	0.78
5	002499	科林环保	61,005	2,534,757.75	0.70
6	002465	海格通信	60,000	2,445,600.00	0.67
7	300127	银河磁体	84,461	2,356,461.90	0.65
8	002495	佳隆股份	72,670	2,294,191.90	0.63
9	300133	华策影视	17,357	2,013,412.00	0.55
10	300128	锦富新材	38,783	1,830,169.77	0.50

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	40,420,964.12	5.68
2	600859	王府井	17,525,214.74	2.46
3	600352	浙江龙盛	14,710,483.34	2.07
4	600815	厦工股份	14,280,736.86	2.01
5	600598	北大荒	14,067,264.60	1.98
6	600795	国电电力	12,760,000.00	1.79
7	601006	大秦铁路	11,706,930.00	1.65
8	000960	锡业股份	7,256,358.78	1.02
9	601179	中国西电	7,094,405.40	1.00
10	300118	东方日升	5,176,290.00	0.73
11	601268	二重重装	3,935,789.00	0.55
12	300102	乾照光电	3,589,470.00	0.50
13	002458	益生股份	3,572,424.00	0.50
14	002465	海格通信	3,454,542.00	0.49
15	002422	科伦药业	3,403,922.24	0.48
16	002479	富春环保	2,978,816.40	0.42
17	300059	东方财富	2,733,955.76	0.38
18	002375	亚厦股份	2,580,914.88	0.36
19	300138	晨光生物	2,487,960.00	0.35
20	300082	奥克股份	2,396,830.00	0.34

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	000969	安泰科技	45,249,294.96	6.36
2	600971	恒源煤电	19,844,809.53	2.79
3	600859	王府井	18,010,201.43	2.53
4	600598	北大荒	14,203,280.27	2.00
5	600815	厦工股份	13,918,656.34	1.96
6	600352	浙江龙盛	13,411,082.41	1.89
7	600219	南山铝业	12,653,537.50	1.78
8	601989	中国重工	8,574,558.50	1.21
9	300102	乾照光电	7,202,877.00	1.01
10	300118	东方日升	7,082,039.20	1.00
11	600567	山鹰纸业	6,090,147.67	0.86
12	000960	锡业股份	6,083,804.40	0.86
13	600999	招商证券	5,774,235.92	0.81
14	601299	中国北车	5,645,957.91	0.79
15	300039	上海凯宝	5,576,934.65	0.78
16	601179	中国西电	5,472,551.26	0.77
17	002458	益生股份	4,990,502.46	0.70
18	002422	科伦药业	4,610,155.20	0.65
19	601268	二重重装	4,288,174.89	0.60
20	300059	东方财富	3,893,228.84	0.55

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	221,562,372.38
卖出股票收入(成交)总额	283,755,287.73

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	21,739,654.80	5.97
2	央行票据	78,105,000.00	21.45
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	85,443,311.10	23.46
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	130,842,653.11	35.93
7	其他	-	-
8	合计	316,130,619.01	86.80

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	1001074	10央票 74	500,000	48,780,000.00	13.39
2	113002	工行转债	250,710	29,618,879.40	8.13
3	110003	新钢转债	202,020	23,278,764.60	6.39
4	122021	09广汇债	209,360	22,171,224.00	6.09
5	122939	09吉安债	202,000	22,007,900.00	6.04

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 本基金不从二级市场主动投资股票。

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	83,370.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,429,221.54
5	应收申购款	47,958.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,560,551.17

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	23,278,764.60	6.39
2	110007	博汇转债	17,868,428.80	4.91
3	125709	唐钢转债	12,594,800.00	3.46
4	125731	美丰转债	12,565,241.64	3.45
5	110009	双良转债	2,215,942.00	0.61

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	300132	青松股份	2,856,722.60	0.78	新股锁定
2	300138	晨光生物	2,856,178.08	0.78	新股锁定
3	002499	科林环保	2,534,757.75	0.70	新股锁定
4	300127	银河磁体	2,356,461.90	0.65	新股锁定
5	002495	佳隆股份	2,294,191.90	0.63	新股锁定
6	300133	华策影视	2,013,412.00	0.55	新股锁定
7	300128	锦富新材	1,830,169.77	0.50	新股锁定

8.9.6 报告期内本基金未投资控股股东主承销的证券,未从二级市场主动投资股票及权证,报告期内持有的权证是投资可分离债成本拆分而被动持有,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

份额级别	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
泰信债券增强收益 A	1,108	281,946.14	278,941,574.98	89.29%	33,454,746.35	10.71%
泰信债券增强收益 C	1,120	44,740.65	31,102.29	0.06%	50,078,424.37	99.94%
合计	2,228	162,704.60	278,972,677.27	76.96%	83,533,170.72	23.04%

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

截至本报告期末,基金管理人的从业人员未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	泰信债券增强收益 A	泰信债券增强收益 C
基金合同生效日(2009 年 7 月 29 日)基金份额总额	724,041,245.17	451,945,529.55
本报告期期初基金份额总额	438,344,530.17	281,317,798.97
本报告期基金总申购份额	271,120,308.48	31,942,259.41
减:本报告期基金总赎回份额	397,068,517.32	263,150,531.72
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	312,396,321.33	50,109,526.66

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 9 万元。该审计机构从基金合同生效日(2009 年 7 月 29 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	
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	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	45,548,704.96	16.05%	37,008.77	15.72%	-
中信证券	2	41,732,240.06	14.71%	35,472.31	15.06%	-
申银万国	1	29,810,177.10	10.51%	25,338.52	10.76%	-
国泰君安	1	22,600,820.60	7.96%	18,363.27	7.80%	-
海通证券	2	17,086,414.03	6.02%	13,882.95	5.90%	-
江海证券	1	17,043,536.90	6.01%	13,847.98	5.88%	-
中航证券	1	16,715,650.01	5.89%	13,581.77	5.77%	-
华泰联合证券	1	15,111,935.82	5.33%	12,278.52	5.21%	-
国元证券	1	13,996,136.34	4.93%	11,897.05	5.05%	-
财富证券	1	13,973,489.16	4.92%	11,876.64	5.04%	-
万联证券	1	10,246,629.10	3.61%	8,709.67	3.70%	-
中金公司	1	9,479,415.19	3.34%	8,057.67	3.42%	-
华宝证券	1	8,000,793.27	2.82%	6,500.79	2.76%	-
东方证券	1	5,788,881.29	2.04%	4,703.50	2.00%	-
国联证券	1	5,472,551.26	1.93%	4,651.79	1.98%	-
大通证券	1	4,251,562.00	1.50%	3,613.77	1.53%	-
中银国际	2	3,946,733.72	1.39%	3,206.79	1.36%	-
安信证券	1	2,931,546.92	1.03%	2,491.75	1.06%	-
上海证券	1	18,070.00	0.01%	15.36	0.01%	-
中国建银投资证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
信泰证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	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。

2、本基金与公司旗下在中国银行托管的泰信优质生活基金、泰信蓝筹精选基金共用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
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	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	113,681,450.71	5.98%	-	-	-	-
中信证券	74,798,471.04	3.94%	324,000,000.00	7.55%	-	-
申银万国	169,501,562.76	8.92%	80,000,000.00	1.86%	-	-
国泰君安	34,970,660.38	1.84%	-	-	-	-
海通证券	26,275,025.58	1.38%	-	-	-	-
江海证券	73,624,092.69	3.87%	-	-	-	-
中航证券	27,924,862.44	1.47%	-	-	-	-
华泰联合证券	163,062,109.05	8.58%	-	-	-	-
国元证券	207,897,399.95	10.94%	508,000,000.00	11.84%	-	-
财富证券	182,432,566.78	9.60%	280,000,000.00	6.52%	-	-
万联证券	72,436,669.58	3.81%	300,000,000.00	6.99%	-	-
中金公司	121,475,722.83	6.39%	443,000,000.00	10.32%	-	-
华宝证券	86,262,605.03	4.54%	-	-	-	-
东方证券	61,283,428.95	3.22%	-	-	-	-
国联证券	32,277,497.59	1.70%	206,200,000.00	4.80%	-	-
大通证券	106,491,818.81	5.60%	1,152,600,000.00	26.86%	-	-
中银国际	101,525,174.95	5.34%	-	-	-	-
安信证券	32,702,225.81	1.72%	60,000,000.00	1.40%	-	-
上海证券	6,582,399.94	0.35%	115,000,000.00	2.68%	-	-
中国建银投资证券	31,977,089.02	1.68%	234,100,000.00	5.45%	-	-
金元证券	45,295,808.21	2.38%	120,000,000.00	2.80%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
信泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	49,244,328.14	2.59%	139,000,000.00	3.24%	-	-
五矿证券	38,384,572.92	2.02%	-	-	-	-
渤海证券	40,406,908.54	2.13%	330,000,000.00	7.69%	-	-

泰信基金管理有限公司
2011 年 3 月 29 日