泰信优质生活股票型证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011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
送出日期：2012 年 3 月 26 日

§1 重要提示

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 2012 年 3 月 21 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 2011 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
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	2,112,350,155.25 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+25%×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	021-20899032	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		021-20899008	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	上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 37 层

§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	2011年	2010年	2009年
本期已实现收益	-448,985,167.18	341,881,160.06	260,647,696.52
本期利润	-764,405,238.23	47,374,790.79	1,056,868,579.29
加权平均基金份额本期利润	-0.3850	0.0234	0.4937
本期基金份额净值增长率	-34.09%	0.54%	65.11%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2659	0.0140	-0.0558
期末基金资产净值	1,550,674,961.61	2,344,088,115.35	2,380,408,231.25
期末基金份额净值	0.7341	1.1138	1.2058

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

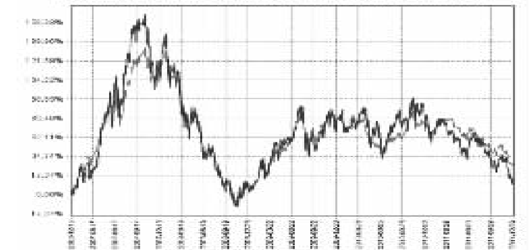
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-10.68%	1.49%	-6.91%	1.08%	-3.77%	0.41%
过去六个月	-21.75%	1.41%	-18.06%	1.04%	-3.69%	0.37%
过去一年	-34.09%	1.43%	-20.58%	0.99%	-13.51%	0.44%
过去三年	9.41%	1.82%	25.05%	1.25%	-15.64%	0.57%
过去五年	3.88%	2.02%	19.19%	1.62%	-15.31%	0.40%
自基金合同生效日起至今	12.48%	2.01%	28.45%	1.61%	-15.97%	0.40%

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

1、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。

2、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。

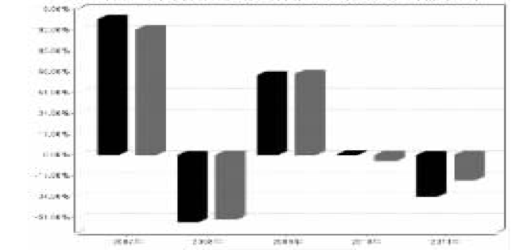
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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 过去五年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



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
2011	-	-	-	-	
2010	1.0000	77,613,101.08	135,078,401.82	212,691,502.90	
2009	-	-	-	-	
合计	1.0000	77,613,101.08	135,078,401.82	212,691,502.90	

注：本年度和 2009 年度本基金未进行利润分配。

§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：上海市浦东新区浦东南路 256 号 37 层
办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36、37 层
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：021-20899188
传真：021-20899008
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。截至 2011 年 12 月底，公司有正式员工 126 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。

截至 2011 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、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选股票共 11 只开放式基金。

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	基金投资部投资副总监、本基金基金经理	2007年 2 月 9 日	-	9	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部投资副总监。
朱志权先生	基金投资部投资总监、本基金经理兼泰信优势增长混合基金经理	2008年 6 月 28 日	-	16	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 日起担任泰信优势增长混合基金基金经理。自 2011 年 12 月 13 日起担任基金投资部投资总监。

注：1、以上日期均是指公司公告的日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对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

本报告期内，公司旗下的泰信优质生活基金、泰信蓝筹精选基金、泰信发展主题基金和泰信中小盘精选基金同为股票型基金。本报告期间，泰信优质生活基金净值增长率为-34.09%，泰信蓝筹精选基金净值增长率为-34.93%，泰信发展主题基金净值增长率为-21.48%，泰信中小盘精选基金建仓期尚未结束，业绩表现与上述三只基金无可比性。泰信优质生活基金与泰信发展主题基金的净值增长率之差大于 5%。其主要原因是泰信优质生活基金保持了较高的股票仓位，而泰信发展主题基金在 2011 年上半年处于建仓期，期间仓位相对较低，因此泰信优质生活基金与泰信发展主题基金相比，基金业绩下滑较大。四只股票型基金之间未发现利益输送情况。

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

本基金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

国内 A 股市场受流动性收缩以及国际市场动荡影响，跌宕起伏。上证综指连续两年出现下跌且今年跌幅高达-20.37%，深圳成指跌-28.41%，沪深 300 指数跌幅达-25.01%，创业板指也下跌了-35.42%，中小板综指结束 2010 年的上涨趋势并下挫了-34.08%。其中蓝筹股较为抗跌，中小市值股票损失惨重。

本基金今年以来主要配置了医药、食品饮料、农业、餐饮旅游、信息服务、电子元器件、公用事业及节能减排和新能源等行业。在投资时点、行业配置、品种甄选方面有些不理想，教训深刻，投资业绩有待改善。

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 0.7341 元，基金净值增长率为-34.09%，同期业绩比较基准收益率为-20.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内宏观经济的偏紧局面已有改观，存款准备金率的下调，流动性释放，通胀的回落的以及股市估值吸引力显著提升，对证券市场有积极影响。但欧债危机的阴影尚在，美国经济复苏之路依旧波折，中国经济的转型也不会一番风顺。

展望 2012 年，随着信贷环境的改观与海外经济复苏，国内经济增长的韧性强，资源品、金融、地产等权重行业有估值优势，新兴产业、消费和服务类行业或有较好的表现。

从新任监管层倡导上市公司分红，鼓励养老金、地方社保资金、住房公积金入市等政策，投资的蓝筹股资产将注重分红率。我们看好经济转型、新兴产业以及食品饮料、医药、纺织服装、旅游、农业、文化传媒等行业的长期发展机遇值得期待。

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、调整充实内控人员、修订完善相关制度。公司对监察稽核部、风险管理部、集中交易室人员分工进行了补充、调整，重点加强了事中控制与事后检查的力量。结合监管部门新出台法律法规，公司修订了《基金关联交易管理办法》、《公平交易制度》，制定了《基金投资中期票据管理办法》及《离任审计、审查管理办法》，切实加强公司整体风险控制能力。

2、进一步规范基金投资管理工作流程，加强基金投资风险控制。公司对股票入库审查程序进行了调整，增加了投研联席会议纪要环节，避免了股票入库的个人行为，以规避潜在风险。公司继续执行《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主要高管减持、遭到公开谴责、监管处罚等情况进行日常跟踪，研究部、投资部、交易室在日常工作中协助风险管理部对上述信息进行跟踪、做好必要的提示。

3、规范投资交易行为，防范交易环节的操作风险，公司禁止基金内的同日反向交易，严格控制基金间的同日反向交易，新增了基金间同日同向交易、所有投资组合对单只股票成交量占其市场总成交异常等指标预警。对于日常的投资监控，公司实行的是事前控制、事中监督、事后检查的方法，在公平交易的各环节建立了责任追究制，实行各部门责任人、分管领导责任人负责制，以最大限度地监控并处置可能造成不公平交易或利益输送的行为。

4、做好投研交易等人员的合规培训，提高合规意识。公司组织投研人员开展内幕交易案例合规培训，就近年来发生的典型内幕交易案例作了分类汇报，并对目前市场上的疑似内幕交易、有争议的内幕交易案例进行了说明，要求投研人员遵守投资纪律，规范决策流程，从源头避免内幕交易事件的发生。另外，风险管理部、监察稽核部共同对投研人员就《公平交易制度》、《异常交易监控与报告制度》进行了专题培训，加强了相关人员的合规意识。

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，对投研人员的办公电脑安装截屏软件进行留痕处理，并对安装软件的权限进行严格限制。

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，副总经理，本科；曾先后任山东国投上海证券部财务经理，鲁信投资有限公司财务、投资管理部门经理，先后担任泰信基金管理有限公司财务负责人、总经理助理。

委员会成员：

唐国培先生，硕士，9 年基金从业经验。2002 年加入泰信基金管理有限公司，现任风险管理部经理。

庞少华先生，硕士，会计师，16 年证券从业经验。曾供职于天一证券有限责任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，现任清算会计部经理。

朱志权先生，经济学学士，16 年证券从业经验。曾任职于长盛基金管理有限公司、富国基金管理有限公司、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。自 2010 年 1 月 16 日起兼任泰信优势增长基金基金经理。自 2011 年 12 月 13 日起担任基金投资部投资总监。

梁剑先生，硕士，具有 13 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，先后担任金融工程部经理、研究部经理、泰信先行策略混合基金经理。现担任研究部研究副总监。

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。

4.8 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、本报告期内本基金未进行利润分配。

§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。

§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（2012）第 21358 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 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 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	编制和公允列报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）按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映； （2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行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中国注册会计师职业道德守则，计划和执行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，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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，上述泰信优质生活基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了泰信优质生活基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 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 张振波
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	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼 邮政编码 200021
审计报告日期	2012年 3 月 23 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：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2011年 12 月 31 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	82,504,475.53	134,336,840.49
结算备付金	2,298,578.00	14,739,666.53
存出保证金	3,241,895.33	3,899,212.54
交易性金融资产	1,460,617,393.54	2,217,708,592.62
其中：股票投资	1,460,617,393.54	2,217,708,592.62
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	-	-
应收利息	19,667.50	27,977.42
应收股利	-	-
应收申购款	15,597,618.89	6,839,455.53
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,564,279,628.79	2,377,551,745.13
负债和所有者权益	本期末 2011年 12 月 31 日	上年度末 2010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	6,759,018.40	21,954,242.80
应付赎回款	80,839.20	147,389.34
应付管理人报酬	2,048,388.74	3,138,216.55
应付托管费	341,398.13	523,036.08
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	870,509.80	4,296,006.03
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	3,504,512.91	3,404,738.98
负债合计	13,604,667.18	33,463,629.78
所有者权益：		
实收基金	2,112,350,155.25	2,104,558,848.15
未分配利润	-561,675,193.64	239,529,267.20
所有者权益合计	1,550,674,961.61	2,344,088,115.35
负债和所有者权益总计	1,564,279,628.79	2,377,551,745.13

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7341 元，基金份额总额 2,112,350,155.25 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：2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
一、收入	-721,005,996.90	112,444,404.36
1.利息收入	804,398.04	1,143,660.01
其中：存款利息收入	804,398.04	1,143,660.01
债券利息收入	-	-
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）	-406,757,349.59	404,970,003.29
其中：股票投资收益	-417,537,493.68	395,316,751.40
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	10,780,144.09	9,653,251.89
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-315,420,071.05	-294,506,369.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	367,025.70	837,110.33
减：二、费用	43,399,241.33	65,069,613.57
1.管理人报酬	28,201,129.57	35,248,037.22
2.托管费	4,700,188.29	5,874,672.79
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	10,067,525.32	23,522,204.04
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	430,398.15	424,699.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-764,405,238.23	47,374,790.79
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-764,405,238.23	47,374,790.79

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：2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 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）	2,104,558,848.15	239,529,267.20	2,344,088,115.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-764,405,238.23	-764,405,238.23
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）	7,791,307.10	-36,799,222.61	-29,007,915.51
其中：1.基金申购款	466,547,695.37	-37,260,386.92	429,287,308.45
2.基金赎回款	-458,756,388.27	461,164.31	-458,295,223.96
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）	2,112,350,155.25	-561,675,193.64	1,550,674,961.61
项目	上年度可比期间 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

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：

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

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 2012 年 3 月 23 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 2011 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 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

无。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

无。

7.4.8.1.2 权证交易

无。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

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 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	28,201,129.57	35,248,037.22
其中：支付销售机构的客户维护费	2,894,625.88	3,740,708.17

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 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,700,188.29	5,874,672.79

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 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	-	17,406,922.84
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	-	17,406,922.84
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	-	-

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 2011年 12 月 31 日		上年度末 2010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%

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 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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	82,504,475.53	751,023.13	134,336,840.49	1,045,967.41

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（2011 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

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

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

（i）金融工具公允价值计量的方法

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）。

（ii）各层次金融工具公允价值

于 2011 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 1,460,617,393.54 元，无属于第二层级和第三层级的余额（2010 年 12 月 31 日：第一层级 2,172,478,211.82 元，第二层级 45,230,380.80 元，无第三层级）。

（iii）公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

（iv）第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

（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	1,460,617,393.54	93.37
	其中：股票	1,460,617,393.54	93.37
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	84,803,053.53	5.42
6	其他各项资产	18,859,181.72	1.21
7	合计	1,564,279,628.79	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	55,722,787.00	3.59
B	采掘业	47,440,100.00	3.06
C	制造业	1,014,775,124.49	65.44
C0	食品、饮料	208,804,614.40	13.47
C1	纺织、服装、皮毛	14,652,640.00	0.94
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	502,600.00	0.03
C4	石油、化学、塑胶、塑料	22,278,900.00	1.44
C5	电子	37,109,550.00	2.39
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	341,666,594.63	22.03
C8	医药、生物制品	389,760,225.46	25.13
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,507,000.00	0.16
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	1,701,700.00	0.11
H	批发和零售贸易	130,094,102.15	8.39
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	204,195,096.40	13.17
L	传播与文化产业	4,181,483.50	0.27
M	综合类	-	-
	合计	1,460,617,393.54	94.19

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	601888	中国国旅	3,700,000	97,051,000.00	6.26
2	600750	江中药业	3,160,000	91,640,000.00	5.91
3	000423	东阿阿胶	2,130,000	91,483,500.00	5.90
4	600993	马应龙	4,900,000	84,721,000.00	5.46
5	300070	碧水源	2,038,200	84,544,536.00	5.45
6	002073	软控股份	5,120,000	77,465,600.00	5.00
7	600519	贵州茅台	399,999	77,319,806.70	4.99
8	000639	西王食品	2,574,113	74,134,454.40	4.78
9	000541	佛山照明	7,370,000	71,857,500.00	4.63
10	002091	江苏国泰	5,569,800	70,625,064.00	4.55

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	600525	长园集团	124,785,466.78	5.32
2	002091	江苏国泰	113,130,070.84	4.83
3	000541	佛山照明	109,724,406.39	4.68
4	600750	江中药业	99,506,789.78	4.25
5	002073	软控股份	98,785,990.55	4.21
6	002158	汉钟精机	94,458,866.05	4.03
7	600339	天利高新	93,894,470.34	4.01
8	000639	西王食品	91,657,200.09	3.91
9	600519	贵州茅台	90,316,174.79	3.85
10	002456	欧菲光	88,921,602.41	3.79
11	000590	紫光古汉	84,734,088.82	3.61
12	002008	大族激光	82,552,576.45	3.52
13	000538	云南白药	71,795,375.41	3.06
14	000522	白云山 A	70,321,667.69	3.00
15	002106	莱宝高科	70,052,794.14	2.99
16	000727	华东科技	66,962,603.88	2.86
17	002086	东方海洋	66,395,151.64	2.83
18	000423	东阿阿胶	63,247,170.41	2.70
19	600993	马应龙	59,844,653.93	2.55
20	002155	辰州矿业	58,091,305.53	2.48
21	000823	超声电子	57,181,450.50	2.44
22	002079	苏州固锝	56,790,766.01	2.42
23	000551	创元科技	56,756,409.92	2.42
24	000063	中兴通讯	56,602,371.68	2.41
25	002223	鱼跃医疗	55,676,167.63	2.38
26	601888	中国国旅	52,250,551.74	2.23
27	600107	美尔雅	49,553,756.67	2.11
28	300005	探路者	47,074,853.58	2.01

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	000566	海南海药	129,121,616.93	5.51
2	600765	中航重机	116,069,774.40	4.95
3	600339	天利高新	114,151,484.19	4.87
4	002456	欧菲光	110,368,681.40	4.71
5	002315	焦点科技	110,308,272.44	4.71
6	600107	美尔雅	105,313,702.43	4.49
7	002079	苏州固锝	102,805,208.35	4.39
8	600403	大有能源	100,510,040.04	4.29
9	600525	长园集团	88,148,755.37	3.76
10	002106	莱宝高科	87,712,473.41	3.74
11	000823	超声电子	84,506,740.35	3.61
12	000559	万向钱潮	83,935,261.21	3.58
13	000012	南玻 A	79,672,943.97	3.40
14	002158	汉钟精机	78,467,539.31	3.35
15	600303	曙光股份	74,721,309.30	3.19
16	600038	哈飞股份	70,893,939.49	3.02
17	000969	安泰科技	66,988,442.42	2.86
18	000538	云南白药	65,111,562.78	2.78
19	600178	东安动力	64,523,053.25	2.75
20	600435	中兵光电	62,932,840.31	2.68
21	300059	东方财富	58,767,522.52	2.51
22	000541	佛山照明	57,527,466.85	2.45
23	600425	青松建化	56,114,443.91	2.39
24	002056	横店东磁	55,742,092.54	2.38
25	002091	江苏国泰	54,675,825.67	2.33
26	002050	三花股份	51,238,919.81	2.19
27	000522	白云山 A	50,384,197.41	2.15
28	000063	中兴通讯	49,911,755.30	2.13
29	002008	大族激光	47,034,091.39	2.01

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	3,318,048,403.43
卖出股票收入（成交）总额	3,342,182,037.78

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

报告期末本基金未持有债券。

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

报告期末本基金未持有债券。

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

报告期末本基金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

报告期末本基金未持有权证。

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	3,241,895.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,667.50
5	应收申购款	15,597,618.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,859,181.72

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金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

报告期末本基金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
72,462	29,151.14	492,743,008.22	23.33%	1,619,607,147.03	76.67%

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	105,446.12	0.0050%

§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	2,104,558,848.15
本报告期基金总申购份额	466,547,695.37
减：本报告期基金总赎回份额	458,756,388.27
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,112,350,155.25

注：总申购份额含红利再投资、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、本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理。因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理，刘慧军女士不再担任中国银行托管及投资者服务部副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2、本报告期内，基金管理人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

泰信基金管理有限公司（以下称“本公司”）于 2010 年 8 月 3 日通过法院拍卖竞得上海市浦东南路 256 号 36、37 层房产，其中该房产的 3604 室在拍卖时带租约，由拍卖被执行方即上海宏普实业投资有限公司（以下简称“宏普”）出租给华远星海运有限公司（以下简称“华远星”）。

2011 年 5 月，本公司与华远星就 3604 室房屋的使用书面约定双方租赁期间自 2010 年 9 月 21 日至 2011 年 5 月 31 日。本公司于 2011 年 7 月 6 日向华远星正式开具租金发票，金额 638,961.85 元。但华远星认为本公司应完全取代宏普并承担原租赁合同中的义务，因此在支付租金时抵扣其已向宏普缴纳的保证金 235,416.90 元。经过本公司多次追讨，仅向本公司支付了部分租金 403,544.95 元。

本公司于 2011 年 11 月就该房屋租赁纠纷向上海市浦东新区人民法院递交了诉讼状，请求法院判令华远星向本公司支付剩余租金 235,416.90 元，同时支付违约金 12,947.93 元（计至 2011 年 10 月 31 日），并于 2012 年 1 月 4 日首次开庭审理。目前，此案仍在审理当中。

本公司认为，上述案件不会对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响。

除此以外，无其他涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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	
招商证券	1	894,915,984.90	13.44%	727,125.32	13.22%	-
华泰联合证券	1	719,726,867.68	10.81%	584,781.65	10.63%	-
中银国际	2	666,144,340.03	10.00%	541,247.07	9.84%	-
海通证券	2	592,292,378.73	8.89%	483,788.88	8.80%	-
国泰君安	1	577,190,240.84	8.67%	468,971.23	8.53%	-
国联证券	1	382,334,025.41	5.74%	324,981.91	5.91%	-
财富证券	1	373,622,161.82	5.61%	317,579.03	5.78%	-
中航证券	1	356,857,501.11	5.36%	289,949.60	5.27%	-
东方证券	1	303,679,650.80	4.56%	246,741.12	4.49%	-
中信证券	2	259,028,704.11	3.89%	220,173.05	4.00%	-
安信证券	1	235,049,633.74	3.53%	199,790.32	3.63%	-
江海证券	1	229,329,884.93	3.44%	186,331.87	3.39%	-
中金公司	1	209,281,778.34	3.14%	177,889.89	3.23%	-
申银万国	1	192,597,858.45	2.89%	163,706.78	2.98%	-
光大证券	1	143,009,330.68	2.15%	121,558.05	2.21%	-
上海证券	1	124,391,593.33	1.87%	105,733.14	1.92%	-
第一创业	1	104,521,523.37	1.57%	88,843.46	1.62%	-
国元证券	1	98,158,571.53	1.47%	83,434.17	1.52%	-
金元证券	1	92,177,444.82	1.38%	78,350.88	1.42%	-
中国建银投资证券	1	50,089,778.40	0.75%	42,576.14	0.77%	-
方正证券	1	34,260,596.27	0.51%	27,836.95	0.51%	-
中信建投	1	12,127,778.74	0.18%	10,308.52	0.19%	-
万联证券	1	8,583,133.18	0.13%	7,295.41	0.13%	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
长财证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-

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、泰信中证 200 指数、泰信中小盘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
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
中国建银投资证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
长财证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

泰信基金管理有限公司
2012 年 3 月 26 日