

泰信发展主题股票型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012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:2013年1月22日

重要提示
本基金管理人及基金托管人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责任。

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。

本报告期为2012年10月1日起至12月31日止。

基金产品概况
基金名称:泰信发展主题股票
代码:290008

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2010年12月21日

报告期末基金份额总额:312,278,306.09份

投资目标:充分把握中国经济可持续发展过程中的主题投资机会,通过主题跟踪和精选个股,分享中国经济在科学发展、和谐发展和可持续发展过程中的投资机遇。

投资策略:本基金的投资资产采用"核心+主题"投资策略,主题投资和非主题投资为辅的投资策略。

业绩比较基准:75%*沪深300指数+25%*中证红利指数

风险收益特征:作为发展主题股票型基金,主要通过跟踪中国经济和产业发展过程中带来的主题投资机会,实现基金资产增值。

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

主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要财务指标
单位:人民币元

1.本期已实现收益: -5,887,870.69
2.本期利润: 22,466,305.18

3.加权平均基金份额本期利润: 0.0782
4.期末基金资产净值: 224,316,283.41

5.期末基金份额净值: 0.846

注:1.本基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或交易的各项费用(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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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

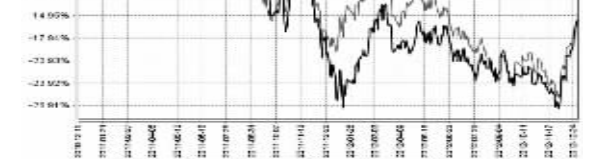
阶段 净值增长率① 净值增长率基准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益差④ ①-③ ②-④

过去三个月 9.44% 0.95% 7.68% 0.96% 1.76% -0.01%

注:1.本基金业绩比较基准为:75%*沪深300指数+25%*中证红利指数。

3.2.2 自基金合同生效以来本基金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

基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%



注:1.本基金基金合同于2010年12月21日生效。

2.本基金的建仓期为六个月,建仓期间,本基金投资组合资产配置比例符合基金合同的约定。

3.2.3 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.4 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.5 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.6 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.7 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.8 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.9 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.10 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.11 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.12 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.13 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.14 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.15 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.16 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.17 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.18 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.19 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.20 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.21 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.22 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.23 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.24 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.25 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.26 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.27 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.28 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.29 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.30 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.31 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.32 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.33 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.34 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.35 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.36 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.37 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.38 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.39 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.40 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.41 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.42 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.43 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.44 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.45 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.46 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.47 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.48 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.49 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.50 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.51 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.52 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.53 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.54 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.55 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.56 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

3.2.57 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证红利指数收益率*25%

中国等主题板块的投资机会,业绩增长出现向上拐点的成长股投资机会等。

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.1.1 权益投资
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 239,582,717.29 90.13
其中:股票 239,582,717.29 90.13

2 固定收益投资 -- --
其中:债券 -- --
资产支持证券 -- --

3 买入返售金融资产 -- --
4 买入返售金融资产 -- --

5 银行存款和结算备付金合计 6.61
6 其他资产 8,662,622.73 3.26

7 合计 266,826,500.32 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农林、牧、渔 -- --
B 采矿业 14,762,492.75 5.59

C 制造业 107,254,253.58 40.58
C0 食品、饮料 -- --

C1 纺织、服装、皮毛 -- --
C2 木材、家具 -- --

C3 造纸、印刷 -- --
C4 石油、化学、塑胶、塑料 23,665,000.00 8.95

C5 电子 12,828,593.90 4.88
C6 金属、非金属 18,767,056.00 7.10

C7 机械、设备、仪表 42,566,141.28 16.16
C8 医药、生物制品 9,357,462.40 3.34

C9 其他制造业 -- --
D 电力、煤气及水的生产和供应业 5,893,419.68 2.23

E 建筑业 5,684,709.38 2.15
F 交通运输、仓储业 -- --

G 信息技术业 24,859,763.57 9.41
H 批发和零售贸易 -- --

I 金融、保险 56,809,619.30 21.49
J 房地产业 9,111,000.00 3.41

K 社会服务业 13,721,745.00 5.19
L 传播与文化产业 1,585,714.53 0.60

M 综合类 29,582,717.29 90.64

5.3 报告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
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 300090 盛运股份 1,099,855 20,487,303.00 7.74

2 002587 奥拓电子 999,891 12,898,593.90 4.88

3 300074 华谊股份 451,450 11,873,135.00 4.49

4 002288 露笑电器 1,569,430 11,829,589.20 4.48

5 000019 华鲁恒升 1,499,966 11,249,745.00 4.26

6 000830 鲁西化工 2,500,000 10,000,000.00 3.78

7 600557 康强药业 449,878 9,357,462.40 3.54

8 600897 海通证券 900,000 9,225,000.00 3.49

9 600161 中远航运 303,070 8,844,075.00 3.25

10 401788 光大证券 660,000 8,460,000.00 3.20

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本报告期末本基金未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本报告期末本基金未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本报告期末本基金未持有权证。

5.8 其他资产构成情况
5.8.1 报告期末本基金投资的衍生品
本报告期末本基金投资的衍生品

5.8.2 报告期末本基金投资的衍生品
本报告期末本基金投资的衍生品

5.8.3 其他资产构成
5.8.3.1 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.3.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明

1 002298 鑫龙电器 7,530,000.00 2.85 非公开发行股票

5.8.4 报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券
5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明

1 002298 鑫龙电器 7,530,000.00 2.85 非公开发行股票

5.8.6 报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券
5.8.7 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.9 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.10 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.11 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.12 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.13 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.14 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.16 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.17 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.18 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.19 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.20 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.21 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.22 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.23 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.24 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.25 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.26 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.27 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.28 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.29 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.30 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.31 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.32 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.33 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.34 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.35 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.36 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.37 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.38 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.39 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.40 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.41 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.42 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.43 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.44 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.45 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.46 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.47 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.48 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.49 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.50 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

泰信增强收益债券型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012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:2013年1月22日

重要提示
本基金管理人及基金托管人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责任。

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。

本报告期为2012年10月1日起至12月31日止。

基金产品概况
基金名称:泰信增强收益债券
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

报告期末基金份额总额:118,562,505.01份

投资目标:在严格控制投资风险的基础上,通过跟踪一级市场中利率等投资目标高于比较基准收益。

投资策略:本基金根据对宏观经济形势、货币政策及财政政策变化、经济周期等因素,对企业盈利和利率走势进行综合研判,动态调整资产配置。

业绩比较基准:80%*上证国债指数+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,高于货币型基金。

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

主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要财务指标
单位:人民币元

1.本期已实现收益: 1,635,743.80 泰信债券增强收益C

2.本期利润: 2,066,312.53 786,774.63

3.加权平均基金份额本期利润: 0.0203 0.0247

4.期末基金资产净值: 81,917,874.28 38,126,007.18

5.期末基金份额净值: 1.0136 1.0100

注:1.本基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或交易的各项费用(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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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 净值增长率(1) 净值增长率基准差(2) 业绩比较基准收益率(3) 业绩比较基准收益差(4) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 2.62% 0.06% 1.35% 0.02% 1.27% 0.03%

注:1.本基金业绩比较基准为:80%*上证国债指数+20%*上证国债指数。

3.2.2 自基金合同生效以来本基金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