泰信发展主题股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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10月25日

§1 重要提示

本基金管理人的董事会及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责任。

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同已于2013年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为 2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信发展主题股票
交易代码	290008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月15日
报告期末基金份额总额	242,864,558.20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,通过主题配置和精选个股,分享中国经济社会在科学发展、和谐发展和可持续发展过程中的投资机遇。在严格控制投资风险的条件下,力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。
投资策略	本基金的股票资产采用以"核心主题投资为主,卫星主题投资和非主题类投资为辅"的投资策略,并考虑组合品种的估值风险和大类资产的系统风险,通过品种和仓位的动态调整降低资产的波动风险。
业绩比较基准	75%×沪深300指数+25%×中证全债指数
风险收益特征	作为发展主题股票型基金,主要通过发掘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,其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本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。
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

§3 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

主要财务指标	报告期(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	28,514,685.37
2.本期利润	19,604,564.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.0715
4.期末基金资产净值	238,488,946.95
5.期末基金份额净值	0.982

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。

3.2 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	6.51%	1.38%	6.85%	1.08%	-0.34%	0.30%

注:本基金的业绩比较基准为:75%×沪深300指数+25%×中证全债指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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2010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。本基金将基金资产的60%-95%投资于股票,基金资产的5%-40%投资于债券、现金类资产及权证、资产支持证券。其中,现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证不高于基金资产净值的3%,资产支持证券不高于基金资产净值的20%。其中投资于发展主题相关上市公司的比例不低于股票投资资产的80%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘毅先生	投资部副总监兼投资副总监、首席策略分析师、本基金基金经理兼泰信优质生活股票基金经理	2010年12月15日	-	10	管理学博士,具有基金从业资格。曾任中国建设银行程序员、业务经理;天安保险资产管理总部投资经理;2008年加入泰信基金管理有限公司,曾先后任理财顾问部投资经理、监事精选基金经理助理。自2011年6月9日至2012年12月28日担任泰信中证200指数基金经理。自2012年12月28日起担任泰信优质生活股票基金经理。现同时担任投资部副总监兼投资副总监、首席策略分析师。

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

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》、《泰信发展主题股票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规和基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(中国证监会公告[2011]18号),公司制定了《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。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放,基金经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令,所有投资指令在集中交易室集中执行,投资交易过程公平公正,投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内,投资交易监控与价差分析未发现本基金与其他基金之间存在利益输送行为,公平交易制度整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内,本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易,未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况,亦无其他异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾三季度,资金在6月底骤紧后得到缓解,同时政府出台了稳增长的微调措施,市场一路震荡上行,市场依然维持主题投资和成长股投资的风格,传统周期股依然没有太好的表现。本基金在三季度还是在围绕消费成长和新兴行业进行了布局和投资。值得总结的是有些板块的选择和主题切换节奏的把握得不是太好,影响了业绩表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金单位净值为0.982元,本季度净值增长率为6.51%,业绩比较基准增长率为6.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一段时间,我们判断四季度的经济还将保持平稳,流动性维持较为宽松的状况,只要经济还在政府设定的区间内运行还将会坚持改革和转型的政策取向,我们密切关注十八届三中全会的内容和政策导向。因此,我们认为四季度的市场将是以震荡为主,同时我们要警惕成长股的估值泡沫和业绩不达预期的风险。

本基金在未来一段时间将采取主题投资和价值投资相结合的策略,保持中性灵活的仓位,将主要仓位配置在转型中受益的"新经济"类和"新生活"类的子行业中真正具有持续成长潜力的公司。重点关注改革主题和转型主题中的受益和成长的公司,同时也关注景气上升细分子行业中的优质公司。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	190,275,923.83	74.56
	其中:股票	190,275,923.83	74.56
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	60,560,556.46	23.73
6	其他资产	4,356,281.28	1.71
7	合计	255,192,761.57	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、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	118,423,601.68	49.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,128,000.00	2.99
F	批发和零售业	10,504,048.67	4.40
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,320,444.48	9.78
J	金融业	17,010,000.00	7.13
K	房地产业	5,129,829.00	2.15
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	8,760,000.00	3.67
S	综合	-	-
	合计	190,275,923.83	79.78

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	300115	长盈精密	358,900	13,587,954.00	5.70
2	300090	盛运股份	350,000	11,567,500.00	4.85
3	600572	康恩贝	799,975	10,975,657.00	4.60
4	002064	华峰氨纶	1,000,000	10,270,000.00	4.31
5	600703	三安光电	499,981	10,144,614.49	4.25
6	300025	华星创业	799,917	9,511,013.13	3.99
7	000001	平安银行	800,000	9,504,000.00	3.99
8	600880	博瑞传播	300,000	8,760,000.00	3.67
9	600557	康缘药业	299,970	8,744,125.50	3.67
10	000625	长安汽车	799,982	8,239,814.60	3.46

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名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名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名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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	478,903.30
2	应收证券清算款	3,866,384.53
3	应收股利	-
4	应收利息	10,204.68
5	应收申购款	788.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,356,281.28

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 本报告涉及合计数相关比例的,均以合计数除以相关数据计算,而不是对不同比例进行合计。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	295,756,268.45
报告期期间基金总申购份额	8,283,932.67
减:报告期期间基金总赎回份额	61,175,642.92
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	242,864,558.20

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰信发展主题股票型证券投资基金设立的文件

2、《泰信发展主题股票型证券投资基金基金合同》

3、《泰信发展主题股票型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信发展主题股票型证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

8.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的办公场所,供投资者免费查阅。在支付必要的工本费后,投资者可在有效的工作时间内取得本报告及上述备查文件的复制件或复印件。

8.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站(www.ftfund.com)查阅上述相关文件,或拨打客户服务中心电话(400-888-5988,021-38784566),和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司
2013年10月25日

泰信蓝筹精选股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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:2013年10月25日

§1 重要提示

本基金管理人的董事会及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责任。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据基金合同已于2013年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为 2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信蓝筹精选股票
交易代码	290006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年4月22日
报告期末基金份额总额	1,094,548,766.72份
投资目标	通过投资于在中国经济可持续发展过程中具有核心竞争优势、在其所属行业内占有领先地位、业绩持续增长、分红稳定的优质蓝筹公司,分享中国经济发展的成果。在严格控制投资风险的条件下,实现基金资产的稳健持续增长。
投资策略	本基金采取"自上而下"的大类资产配置和"自下而上"的精选证券相结合的投资策略。充分发挥投资管理人的研究优势,通过投资具有核心竞争优势、在其所属行业内占有领先地位、业绩持续增长、分红稳定的优质蓝筹公司,在严格控制投资风险的条件下实现基金资产的稳健持续增长。
业绩比较基准	75%*沪深300指数 + 25%*上证国债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,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。
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

§3 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

主要财务指标	报告期(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	95,869,890.93
2.本期利润	118,821,851.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.1158
4.期末基金资产净值	983,321,840.60
5.期末基金份额净值	0.8984

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。

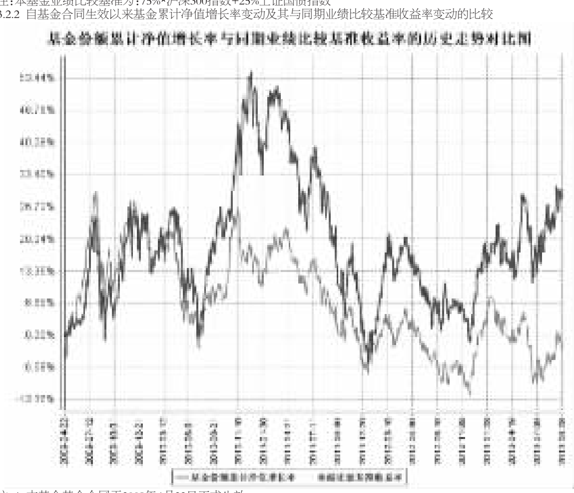
3.2 基金净值表现

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	15.09%	1.45%	7.26%	1.07%	7.83%	0.38%

注:本基金业绩比较基准为:75%*沪深300指数+25%上证国债指数

3.2.2 自基金合同生效以来基金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4月22日正式生效。

2、本基金的建仓期为六个月。本基金将基金资产的60%-95%投资于股票,基金资产的5%-40%投资于债券、现金类资产及权证、资产支持证券(其中,现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证不高于基金资产净值的3%,资产支持证券不高于基金资产净值的20%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳菁女士	研究部总监兼研究总监、本基金基金经理兼泰信中小盘精选股票基金经理	2009年4月22日	-	19	工商管理硕士。具有基金从业资格。曾任天同证券有限责任公司资产管理部交易员、研究员、投资经理。2005年加入泰信基金管理有限公司,先后任交易员、研究部高级研究员,曾任泰信先行策略基金基金经理助理。自2011年10月26日起兼任泰信中小盘股票基金经理。现同时担任研究部总监兼研究总监。
车广路先生	本基金基金经理	2012年3月1日	-	6	工商管理学硕士。具有基金从业资格。2007年6月进入泰信基金管理有限公司,历任研究部研究员、高级研究员、泰信蓝筹精选基金经理助理。

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

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》、《泰信蓝筹精选股票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规和基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(中国证监会公告[2011]18号),公司制定了《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。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放,基金经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令,所有投资指令在集中交易室集中执行,投资交易过程公平公正,投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内,投资交易监控与价差分析未发现本基金与其他基金之间存在利益输送行为,公平交易制度整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内,本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易,未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况,亦无其他异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,我们认为市场出现了可能出现风格切换的迹象,对持仓进行了较大幅度的调整,对创业板股票进行了大幅度的减持,增加了对天然气、电气设备、银行、信息服务、铁路等有估值优势的传统蓝筹公司的配置比例。9月,本基金及时参与了包括土地流转,自贸区等政策红利行情的投资,并通过波段操作实现了较好收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金单位净值为0.8984元,本季度净值增长率为15.09%,业绩比较基准增长率为7.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对四季度的市场总体走势持谨慎的态度,但认为市场存在一定的结构性机会。首先,目前市场对经济复苏的力度和即将到来的十一届三中全会带来的改革红利都预期过高,但从最近公布的一系列经济数据来看,经济仍然是弱复苏,而从上海自贸区的初步落实的政策来看,中央对改革的态度还是以稳健和循序渐进为主。其次,即将公布的三季报,很多所谓成长股的业绩可能会继续不达预期。最后,欧美等海外经济体的复苏和货币政策都存在一定的不确定性。

但同时,在经济转型的大背景下,国企改革和中央要求的盘活存量,将使部分传统行业的供需关系出现改善,部分能通过淘汰落后产能、提高劳动生产率、及可能成功实现转型的低估值大盘蓝筹股成为未来的市场亮点。

配置方面,估值合理、成长稳健的蓝筹股公司将是我们未来配置的重点。行业方面,在保增长和促转型双重压力之下,政府会结构性的加大对部分地区和行业的投资力度,我们重点关注环保、军工、新能源、金融改革、4G建设和电网升级改造、高铁建设等带来的投资机会以及传统消费类公司在四季度的机会。

在个股的选择方面,我们将综合利用公司的股票价值评估系统和尽职调研评估系统,结合定量分析和定性分析,精选出技术、管理、资源和政策四个方面有优势,成长具有持续性的公司进行投资。

本基金将继续采取谨慎的操作思路,保持灵活的操作风格,充分发挥行业配置和选股优势,以勤勉尽责的态度为基金持有人谋求长期、稳定的回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	710,452,552.97	71.78
	其中:股票	710,452,552.97	71.78
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	220,000,000.00	22.23
	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	54,137,523.79	5.47
6	其他资产	5,183,766.95	0.52
7	合计	989,773,843.71	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、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	328,350,205.01	33.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,288,276.42	3.28
E	建筑业	63,020,937.00	6.41
F	批发和零售业	2,459,800.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,591,313.00	4.94
J	金融业	216,700,335.34	22.04
K	房地产业	2,533,500.00	0.26
L	租赁和商务服务业	16,508,186.20	1.68
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	710,452,552.97	72.25

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	600000	浦发银行	7,335,020	74,010,351.80	7.53
2	600416	湘电股份	7,870,000	54,224,300.00	5.51
3	600837	海通证券	3,200,000	40,032,000.00	4.07
4	601901	方正证券	6,000,000	35,460,000.00	3.61
5	601186	中国铁建	7,100,000	34,790,000.00	3.54
6	002368	太极股份	780,200	31,800,952.00	3.23
7	600765	中航重机	2,100,000	29,610,000.00	3.01
8	600550	天威保变	4,510,000	28,593,400.00	2.91
9	000001	平安银行	2,400,000	28,512,000.00	2.90
10	600562	国睿科技	698,000	27,836,240.00	2.83

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名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名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名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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	522,227.34
2	应收证券清算款	4,308,025.02
3	应收股利	-
4	应收利息	16,033.59
5	应收申购款	337,481.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,183,766.95

5.10.4 报告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。

5.10.5 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	601901	方正证券	35,460,000.00	3.61	重大事项停牌

5.10.6 本报告涉及合计数相关比例的,均以合计数除以相关数据计算,而不是对不同比例进行合计。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	969,856,473.75
报告期期间基金总申购份额	253,925,153.18
减:报告期期间基金总赎回份额	129,232,860.21
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,094,548,766.72

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰信蓝筹精选股票型证券投资基金设立的文件

2、《泰信蓝筹精选股票型证券投资基金基金合同》

3、《泰信蓝筹精选股票型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信蓝筹精选股票型证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

8.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的办公场所,供投资者免费查阅。在支付必要的工本费后,投资者可在有效的工作时间内取得本报告及上述备查文件的复制件或复印件。

8.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站(www.ftfund.com)查阅上述相关文件,或拨打客户服务中心电话(400-888-5988,021-38784566),和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司
2013年10月25日

泰信增强收益债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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:2013年10月25日

§1 重要提示

本基金管理人的董事会及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责任。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据基金合同已于2013年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为 2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信债券增强收益	
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	
报告期末基金份额总额	45,745,426.25份	
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。	
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	
下属两级基金的基金简称	泰信债券增强收益A	泰信债券增强收益C
下属两级基金的交易代码	290007	291007
报告期末下属两级基金的份额总额	16,888,050.91份	28,857,375.34份

§3 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

主要财务指标	报告期(2013年7月1日 - 2013年9月30日)	
	泰信债券增强收益A	泰信债券增强收益C
1.本期已实现收益	-192,645.54	-415,529.38
2.本期利润	123,702.99	89,404.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.0040	0.0021
4.期末基金资产净值	17,873,809.84	30,363,529.50
5.期末基金份额净值	1.0584	1.0522

注:1、上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。

3.2 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

泰信债券增强收益A

阶段	净值增长率①	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	0.62%	0.15%	0.65%	0.02%	-0.03%	0.13%

泰信债券增强收益C

阶段	净值增长率①	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	0.53%	0.15%	0.65%	0.02%	-0.12%	0.13%

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。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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。建仓期满,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%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何俊春女士	投资部固定收益投资总监、本基金基金经理兼泰信双息双利基金、泰信债券周期回报基金、泰信鑫益定期开放债券基金经理	2009年7月29日	-	17	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债券基金基金经理;自2012年10月25日起担任泰信债券周期回报基金经理;自2013年7月17日起担任泰信鑫益定期开放债券基金经理。现同时担任投资部固定收益投资总监。

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

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规和基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(中国证监会公告[2011]18号),公司制定了《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。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放,基金经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令,所有投资指令在集中交易室集中执行,投资交易过程公平公正,投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内,投资交易监控与价差分析未发现本基金与其他基金之间存在利益输送行为,公平交易制度整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内,本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易,未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况,亦无其他异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年三季度,中国经济企稳反弹。先行指标PMI指数大幅回升,显示需求有所好转,经济止住上半年持续滑落的颓势。通胀受到基期因素及食品价格波动影响有所上升,但仍属温和状态,未能成为市场关注的重点。影响三季度债券市场最重要的因素仍是资金面,7-8月份资金面偏紧且市场心态较为谨慎,至9月份才显现出宽松迹象,季末在央行逆回购的引导下,"钱荒"一幕并未重演。从债券市场的表现看,三季度债券市场主要分为两个阶段:7-9月上旬,在经济回升、资金偏紧的背景下,部分机构处于解杠杆状态,债券市场延续6月份以来的调整局面,10年国债收益率一度突破4.1%的水平,企业债收益率也持续上升。进入9月中下旬,资金利率上升但幅度明显低于预期,资金面宽松迹象显现,一级市场需求也开始回暖,利率债和信用债收益率双双企稳。转债方面,7-8月份转债行情较为平稳,9月份正股上涨推动转债市场出现波段性机会,复牌的重工转债波动剧烈,成为市场关注的焦点。

三季度增强收益基金受基金规模变动影响较大,减持流动性较高的国家债券、短融和可转债,主要持仓券种为企业债。至季末,债券投资比例额受赎回因素影响与二季度相比有明显提升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,泰信债券增强收益A基金份额净值为1.0584元,本季度份额净值增长率为0.62%,同期业绩比较基准增长率为0.65%;泰信债券增强收益C基金份额净值为1.0522元,本季度份额净值增长率为0.53%,同期业绩比较基准增长率为0.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

风险释放后,四季度债券市场投资价值上升。宏观经济在三季度出现企稳回升,但其持续性仍不确定,我们倾向于认为经济出现趋势性大幅回升的动力尚未形成,因此经济对债市收益率上行的压力将会减弱甚至消失。通胀方面,受基期因素影响,四季度CPI可能会小幅上升至3%左右,短期影响不大。资金方面,美国推迟退出QE,以及前期外管局政策对外汇占款的负面影响逐步减弱,同时考虑到央行通过逆回购维护资金平稳的态度,我们认为四季度资金面将会继续保持宽松状态。综合来看,债市基本面有所好转,收益率将稳中有降。从具体券种表现看,当前信用利差处于底部,一定程度上压缩了信用债收益率下降的空间,因此信用债主要依赖于票息收入。转债方面,基于权益市场区间震荡的判断,转债的个券交易价值比二季度末明显提高。

2013年四季度增强收益基金仍主配企业债,通过票息获取收益,并择机对目前资产配置进行适度调整。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	63,770,702.00	91.13
	其中:债券	63,770,702.00	91.13
	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	3,681,998.09	5.26
6	其他资产	2,524,529.13	3.61
7	合计	69,977,229.22	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末本基金未持有股票。

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

报告期末本基金未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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	63,770,702.00	132.20
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	63,770,702.00	132.20

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1280462	12大丰债	300,000	30,315,000.00	62.85
2	124088	12东台债	199,010	20,338,822.00	42.16
3	124292	13溧城建	100,000	10,000,000.00	20.73
4	122988	09渝隆债	29,970	3,116,880.00	6.46

5.6 报告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名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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.8.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.8.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.8.3 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

5.9.2

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,749.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,503,333.65
5	应收申购款	18,446.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,524,529.13

5.9.4 报告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。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金未投资股票。

5.9.6 本报告涉及合计数相关比例的,均以合计数除以相关数据计算,而不是对不同比例进行合计。

§6 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
报告期期初基金份额总额	76,489,447.57	54,457,496.82
报告期期间基金总申购份额	1,998,324.23	1,386,163.36
减:报告期期间基金总赎回份额	61,599,720.89	26,986,284.84
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	16,888,050.91	28,857,375.34

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰信增强收益债券型证券投资基金设立的文件

2、《泰信增强收益债券型证券投资基金基金合同》

3、《泰信增强收益债券型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信增强收益债券型证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

8.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的办公场所,供投资者免费查阅。在支付必要的工本费后,投资者可在有效的工作时间内取得本报告及上述备查文件的复制件或复印件。

8.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站(www.ftfund.com)免费查阅上述相关文件,或拨打客户服务中心电话(400-888-5988,021-38784566),和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司
2013年10月25日