泰信保本混合型证券投资基金

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：中信银行股份有限公司
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。

本基金的托管人中信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	泰信保本混合
交易代码	290012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年2月22日
报告期末基金份额总额	48,939,584.70份
投资目标	本基金通过运用优化的恒定比例组合保险方法（CPPI），在保证保本期到期本金安全的基础上，寻求资产的稳定增值。
投资策略	本基金以优化的恒定比例组合保险方法（CPPI）为基础来实现保本和增值，在保本周期中，通过严格的投资纪律约束和风险管理，对基金的资产配置进行优化动态调整，确保投资者的投资本金的安全性。同时，通过积极稳健的收益资产投资策略，谋取基金资产的增值。
业绩比较基准	三年期银行定期存款的税后收益率。
风险收益特征	本基金为保本基金，属于证券投资基金中的低风险品种。
基金管理人	泰信基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
基金保证人	山东省鲁信投资控股集团有限公司

§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	551,053.05
2.本期利润	-227,963.29
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0045
4.期末基金资产净值	49,845,801.09
5.期末基金份额净值	1.019

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	-0.39%	0.31%	1.09%	0.01%	-1.48%	0.30%

注：本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款的税后收益率。

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2012年2月22日正式生效。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满，本基金的投资组合比例为：股票、权证等收益资产占基金资产的0%-40%，其中，持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的 60%-100%，其中，基金持有现金以及到期日在1年以内的政府债券的比例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		
董山青 先生	投资部总监助理、本基金基金经理	2012年2月22日	-	9	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、研究部工作，曾任泰信优势增长基金经理助理。2010年9月至2012年10月担任研究总监助理职务。现同时担任投资部总监助理职务。

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 管理人对投资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》、《泰信保本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

国内A股市场在2013年三季度呈现上涨趋势，沪深300指数7月，8月和9月分别下跌0.35%，上涨5.51%，和上涨4.11%。泰信保本混合型证券投资基金运作期间，依次为上涨2.12%，上涨5.65%和上涨4.36%，比较基准同期表现依次为上涨1.93%，上涨5.62%和上涨4.61%。

报告期内，我们严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差，报告期内年化跟踪误差控制在0.96%。

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0.742元，本季度净值增长率为12.59%，业绩比较基准增长率为12.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，宏观经济增速动量将减弱，总体情况将较为平稳，9月份汇丰PMI指数上升至51.2，同时中采PMI回升乏力，为51.1，经济扩张性与波动性都在减弱。美国量化宽松的退出和债务上限问题在四季度会更加明朗，值得关注。在经济数据缺乏亮点，企业盈利增速无惊喜的情况下，A股市场的上升空间有限，但对中国新一轮改革的预期，新兴产业的战略地位提高，为市场营造了结构型行情的土壤。从行业配置的角度，可以关注三季报较好的环保、医药、食品和可能受益金融改革的行业，国家政策激励的信息行业等，同时关注可能存在的主题投资机会，比如国企改革，人口政策，土地流转和养老产业等相关行业。

本基金作为一只投资于中证200指数的被动指数基金产品，我们将坚持指数化投资理念，运用定量分析技术，减少各种因素对基金跟踪误差造成的冲击，把基金的跟踪误差控制在较低的水平，以维护投资者的利益。

§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	7,933,607.02	14.09
	其中：股票	7,933,607.02	14.09
2	固定收益投资	45,836,972.90	81.43
	其中：债券	45,836,972.90	81.43
	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	993,456.10	1.76
6	其他资产	1,528,149.72	2.71
7	合计	56,292,185.74	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	483,000.00	0.97
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,835,642.62	7.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	62,240.00	0.12
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	702,210.00	1.41
G	交通运输、仓储和邮政业	1,874,304.40	3.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	576,460.00	1.16
K	房地产业	-	-
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	202,500.00	0.41
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	197,250.00	0.40
S	综合	-	-
	合计	7,933,607.02	15.92

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	600009	上海机场	123,880	1,874,304.40	3.76
2	000063	中兴通讯	70,000	1,162,000.00	2.33
3	000423	东阿阿胶	22,982	928,702.62	1.86
4	600309	万华化学	51,000	828,750.00	1.66
5	600276	恒瑞医药	20,000	727,400.00	1.46
6	002477	雏鹰农牧	46,000	483,000.00	0.97
7	600824	益民集团	72,000	372,960.00	0.75
8	000963	华东医药	7,500	329,250.00	0.66
9	600705	中航投资	13,000	250,380.00	0.50
10	600837	海通证券	18,000	225,180.00	0.45

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	2,556,667.00	5.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	43,280,305.90	86.83
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	45,836,972.90	91.96

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	122702	12海安债	73,460	7,757,376.00	15.56
2	122132	12鹏博债	71,000	7,376,900.00	14.80
3	111047	08长兴债	55,000	5,830,000.00	11.70
4	122710	12济城建	53,010	5,465,331.00	10.96
5	122755	12潭城建	50,230	5,255,564.90	10.54

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

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

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	87,997.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,440,151.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,528,149.72

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

报告期末本基金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	52,222,102.57
报告期期基金总申购份额	80,337.84
减:报告期基金总赎回份额	3,362,855.71
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	48,939,584.70

§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保本混合型证券投资基金设立的文件

2、《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》

3、《泰信保本混合型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信保本混合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.fttfund.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

泰信中证200指数证券投资基金

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	泰信中证200指数
交易代码	290010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月9日
报告期末基金份额总额	121,438,183.55份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资方法，通过严格的投资流程约束和数量化风险管理手段，以实现对标的指数的有效跟踪。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，按照在中证200指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合和跟踪中证200的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	中证200指数收益率×95% + 商业银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金为指数型基金，具有较高风险和较高预期收益的特征，其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。其风险因素主要来自于市场风险和跟踪误差的风险。
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	-558,445.20
2.本期利润	10,283,639.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.0834
4.期末基金资产净值	90,118,568.92
5.期末基金份额净值	0.742

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	12.59%	1.34%	12.62%	1.34%	-0.03%	0.00%

注：本基金业绩比较基准为：中证200指数收益率×95% + 商业银行活期存款利率(税后)×5%。

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2011年6月9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90%-95%，投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于股票资产的90%。现金以及到期日在1年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

3、经泰信基金管理有限公司2013年第十二次总经理办公会议审议决定，冯张鹏先生担任泰信中证200指数证券投资基金经理职务，陈大庆先生不再担任本基金经理职务，具体详情请见2013年7月5日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信中证200指数证券投资基金经理变更的公告》。

§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		
冯张鹏 先生	本基金基金经理兼泰信中证200指数证券投资基金经理	2013年7月5日	-	5	工科博士。具备基金从业资格。曾在英国德意志银行担任分析师。2010年9月加入泰信基金管理有限公司担任风险管理部高级风险分析师，同时兼任研究部策略研究小组高级量化分析师。曾担任泰信中证200指数基金经理助理、泰信中证400指数基金经理助理职务。
陈大庆 先生	本基金基金经理兼泰信中证200指数证券投资基金经理	2011年6月9日	2013年7月5日	10	管理学硕士。具有基金从业资格。曾在中国建银投资证券有限责任公司、华林证券有限责任公司担任研究员。2008年2月加入泰信基金管理有限公司，先后担任研究员、优质生活基金经理助理。自2011年6月9日起担任泰信中证200指数基金经理至今。已于2013年7月5日离职。

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。

3、经泰信基金管理有限公司2013年第十二次总经理办公会议审议决定，冯张鹏先生担任泰信中证200指数证券投资基金经理职务，陈大庆先生不再担任本基金经理职务，具体详情请见2013年7月5日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信中证200指数证券投资基金经理变更的公告》。

4.2 管理人对投资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》、《泰信中证200指数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

国内A股市场在2013年三季度呈现上涨趋势，沪深300指数7月，8月和9月分别下跌0.35%，上涨5.51%，和上涨4.11%。泰信中证200指数基金同期表现依次为上涨2.12%，上涨5.65%和上涨4.36%，比较基准同期表现依次为上涨1.93%，上涨5.62%和上涨4.61%。

报告期内，我们严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差，报告期内年化跟踪误差控制在0.96%。

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0.742元，本季度净值增长率为12.59%，业绩比较基准增长率为12.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，宏观经济增速动量将减弱，总体情况将较为平稳，9月份汇丰PMI指数上升至51.2，同时中采PMI回升乏力，为51.1，经济扩张性与波动性都在减弱。美国量化宽松的退出和债务上限问题在四季度会更加明朗，值得关注。在经济数据缺乏亮点，企业盈利增速无惊喜的情况下，A股市场的上升空间有限，但对中国新一轮改革的预期，新兴产业的战略地位提高，为市场营造了结构型行情的土壤。从行业配置的角度，可以关注三季报较好的环保、医药、食品和可能受益金融改革的行业，国家政策激励的信息行业等，同时关注可能存在的主题投资机会，比如国企改革，人口政策，土地流转和养老产业等相关行业。

本基金作为一只投资于中证200指数的被动指数基金产品，我们将坚持指数化投资理念，运用定量分析技术，减少各种因素对基金跟踪误差造成的冲击，把基金的跟踪误差控制在较低的水平，以维护投资者的利益。

§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	83,377,242.54	92.16
	其中：股票	83,377,242.54	92.16
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	7,090,556.54	7.84
6	其他资产	5,254.78	0.01
7	合计	90,473,053.86	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	1,773,478.71	1.97
B	采矿业	5,297,749.58	5.88
C	制造业	44,505,474.24	49.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,693,629.53	2.99
E	建筑业	2,682,700.89	2.98
F	批发和零售业	5,588,547.13	6.20
G	交通运输、仓储和邮政业	1,846,659.52	2.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,686,850.90	4.09
J	金融业	5,978,345.59	6.63
K	房地产业	4,921,934.48	5.46
L	租赁和商务服务业	1,795,996.68	1.99
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	776,408.02	0.86
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	927,673.93	1.03
S	综合	901,793.34	1.00
	合计	83,377,242.54	92.52

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	600089	特变电工	121,840	1,470,608.80	1.63
2	600637	百视通	25,748	1,347,907.80	1.50
3	600535	天士力	28,659	1,290,228.18	1.43
4	600383	金地集团	206,741	1,244,580.82	1.38
5	002241	歌尔声学	28,223	1,193,268.44	1.32
6	600804	鹏博士	63,926	1,185,188.04	1.32
7	600690	青岛海尔	77,364	1,030,488.48	1.14
8	600739	辽宁成大	64,823	1,007,349.42	1.12
9	000423	东阿阿胶	24,185	977,315.85	1.08
10	002236	大华股份	21,190	965,840.20	1.07

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

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

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。

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	4,057.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	999.38
5	应收申购款	198.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,254.78

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

5.10.5.1 报告期末指数投资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	600690	青岛海尔	1,030,488.48	1.14	重大事项停牌

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

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	124,520,049.01
报告期期间基金总申购份额	1,456,399.31
减:报告期期间基金总赎回份额	4,538,264.77
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	121,438,183.55

§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中证200指数证券投资基金设立的文件

2、《泰信中证200指数证券投资基金基金合同》

3、《泰信中证200指数证券投资基金招募说明书》

4、《泰信中证200指数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.fttfund.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

泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金

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	泰信基本面400指数分级		
交易代码	162907		
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）		
基金合同生效日	2012年9月7日		
报告期末基金份额总额	35,116,696.73份		
投资目标	本基金采用指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对中证锐联基本面400指数的有效跟踪。		
投资策略	本基金主要采用指数化投资策略，按照在中证锐联基本面400指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合和跟踪中证锐联基本面400指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。		
业绩比较基准	95%×中证锐联基本面400指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率（税后）		
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。		
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		
下属三级基金简称	泰信基本面400A	泰信基本面400B	泰信基本面400
场内简称	泰信400A	泰信400B	泰信400
下属三级基金交易代码	150094	150095	162907
下属三级基金报告期末基金份额总额	7,106,712.00份	7,106,712.00份	20,903,272.73份
下属三级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。	高风险、高预期收益。	较高风险、较高预期收益。

§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	351,692.00
2.本期利润	5,703,543.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.1659
4.期末基金资产净值	40,586,179.77
5.期末基金份额净值	1.156

注：1.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。

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。

3.2 基