泰信优质生活股票型证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014年6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
送出日期:2014 年 8 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。本半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 2014 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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	1,272,199,700.13 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	胡囡	王永民
	联系电话	021-20899098	010-66594896
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	fcid@bankofchina.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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ftfund.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36-37 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	19,442,210.89
本期利润	-77,744,949.21
加权平均基金份额本期利润	-0.0564
本期基金份额净值增长率	-6.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.3742
期末基金资产净值	987,577,545.85
期末基金份额净值	0.7763

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

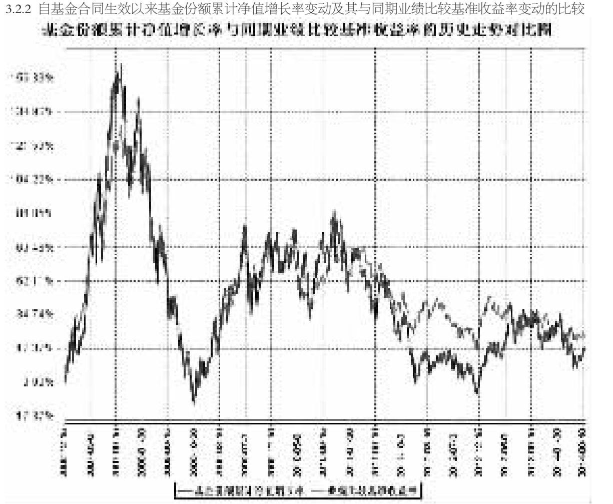
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	5.19%	0.90%	0.55%	0.59%	4.64%	0.31%
过去三个月	4.24%	1.12%	1.04%	0.66%	3.20%	0.46%
过去六个月	-6.37%	1.37%	-3.91%	0.79%	-2.46%	0.58%
过去一年	-5.02%	1.37%	0.81%	0.88%	-5.83%	0.49%
过去三年	-17.26%	1.38%	-20.45%	0.98%	3.19%	0.40%
自基金合同生效日起至今	18.95%	1.83%	24.70%	1.43%	-5.75%	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。

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,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、经泰信基金管理有限公司总办会审议决定 ,刘毅先生不再担任本基金经理职务,戴宇虹女士继续管理本基金。具体详情请见 2014 年 6 月 21 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信优质生活股票型证券投资基金经理变更的公告》。

§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:葛航
电话:021-20899188
传真:021-20899008
联系人:庄严
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。

公司目前下设锐懿资产管理有限公司、市场部、营销部(分华东、华北、华南三大营销中心)、理财顾问部、深圳分公司、北京分公司、电子商务部、客服中心、基金投资部、研究部、专户投资部、清算会计部、集中交易部、计划财务部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部。截至 2014 年 6 月,公司有正式员工 103 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 2014 年 6 月,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、泰信保本混合、泰信中证基本面 400 指数分级、泰信现代服务业股票基金、泰信鑫益定期开放债券共 15 只开放式基金及泰信恒益高息债分级、泰信乐利分级 1 号、泰信乐利 2 号、泰信乐利 3 号、泰信量化对冲分级 1 号、泰信财富分级 6 号、泰信财富分级 7 号共 7 个资产管理计划。

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		
戴宇虹女士	本基金基金经理兼泰信现代服务业股票基金经理	2012年 3 月 1 日	-	7年	金融学硕士。具有基金从业资格。曾先后任职于国药控股有限公司、群益证券股份有限公司。2008 年 10 月加入泰信基金管理有限公司,先后担任研究部高级研究、泰信发展主题股票基金经理助理。自 2013 年 2 月 7 日起任泰信现代服务业股票基金经理。
刘毅先生	基金投资部副总监兼投资副总监兼首席策略分析师、本基金基金经理兼泰信发展主题股票基金经理	2012年 12 月 28 日	2014年 6 月 21 日	11年	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,曾先后担任理财顾问部投资经理、蓝筹精选基金经理助理。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 2010 年 12 月 15 日至 2014 年 6 月 21 日担任泰信发展主题股票基金经理,并担任基金投资部副总监兼投资副总监、首席策略分析师。已于 2014 年 6 月 30 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总办会审议决定 ,刘毅先生不再担任本基金经理职务,戴宇虹女士继续管理本基金。具体详情请见 2014 年 6 月 21 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信优质生活股票型证券投资基金经理变更的公告》。

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》、《泰信优质生活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 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

公司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,投资经理严格遵守公平、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 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

2014 年上半年 A 股市场呈现窄幅震荡的走势,上证综指在 2000-2200 点区间运行,回顾上半年市场行情,政策博弈和资金博弈成为影响市场最为关键的因素。年初市场对经济的悲观预期随着政府一系列稳增长政策的出台得以修正,同时流动性的变化影响市场对风险的偏好,以创业板为代表的中小市值板块呈现出明显的波段性投资机会,符合经济转型方向的信息安全、医疗服务、新能源汽车、移动互联网等为代表的成长板块以及有政策支持的区域规划和国企改革等主题投资机会成为市场的投资热点。本基金上半年保持中性的仓位,重点投资医疗服务、电子、传媒、消费等行业,由于我们对市场热点把握不够,以及没有及时兑现盈利,导致上半年业绩不佳。

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 0.7763 元,基金净值增长率为 -6.37%,同期业绩比较基准增长率为 -3.91%。

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 14 年下半年,我们认为市场仍将呈现震荡的走势,难以有趋势性的投资机会,政策稳增长红利持续释放,宏观经济有所企稳,流动性适度宽松,考虑政府在稳增长和转型之间的平衡,我们认为宏观经济复苏会有反复,但政府改革的步伐正在加快,因此我们认为市场存在结构性的投资机会。我们总体上将维持中性灵活的仓位,强调自上而下和自下而上相结合,注重公司业绩的成长性、可靠性和持续性。我们将重点投资医药生物、TMT、消费等行业,也重点关注新能源汽车、国企改革、国防军工、并购重组等投资机会。

4.6 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,本科学历。曾任职于山东省国际信托投资公司计财部、山东省国际信托投资公司上海证券部、鲁信香港投资有限公司。2002 年加入泰信基金管理公司,现任公司副总经理。

委员会成员:

唐国培先生,硕士。2002 年加入泰信基金管理有限公司,现任公司风险管理部总监。

蔡海成先生,硕士。2013 年加入泰信基金管理有限公司,现任公司清算会计部总监。

朱志权先生,学士。2008 年 6 月加入泰信基金管理有限公司,现任基金投资部总监兼投资总监,泰信先行策略、泰信优势增长基金基金经理。

梁剑先生,硕士。2004 年 7 月加入泰信基金管理有限公司,曾任泰信先行策略混合基金经理。现任研究部副总监兼研究副总监。

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。

4.7 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、本报告期利润分配情况的说明:

本报告期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 托管人对本半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 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: 2014 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年 6 月 30 日	上年度末 2013年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	90,115,113.84	86,146,501.82
结算备付金	472,355.07	4,243,136.92
存出保证金	486,903.65	570,725.09
交易性金融资产	720,623,416.29	1,025,856,211.93
其中:股票投资	720,623,416.29	1,025,856,211.93
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	128,000,192.00
应收证券清算款	180,033,778.16	23,967,843.88
应收利息	42,076.02	56,725.83
应收股利	-	-
应收申购款	3,571.19	68,522.39
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	991,777,214.22	1,268,909,859.86
负债和所有者权益	本期末 2014年 6 月 30 日	上年度末 2013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	-	32,693,654.76
应付赎回款	441,188.97	337,227.40
应付管理人报酬	1,184,566.35	1,559,337.40
应付托管费	197,427.70	259,889.56
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,173,626.31	1,630,442.93
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,202,859.04	1,404,598.22
负债合计	4,199,668.37	37,885,150.27
所有者权益:		
实收基金	1,272,199,700.13	1,484,686,009.63
未分配利润	-284,622,154.28	-253,661,300.04
所有者权益合计	987,577,545.85	1,231,024,709.59
负债和所有者权益总计	991,777,214.22	1,268,909,859.86

注:报告截止日 2014 年 6 月 30 日,基金份额净值 0.7763 元,基金份额总额 1,272,199,700.13 份。

6.2 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: 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项 目	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入	-64,277,399.97	182,869,037.68
1.利息收入	1,027,857.42	1,488,282.25
其中:存款利息收入	688,399.23	582,025.73
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	339,458.19	906,256.52
其他利息收入	-	-
2.投资收益 (损失以“-”填列)	31,744,302.20	113,916,919.28
其中:股票投资收益	28,231,691.13	106,139,826.18
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	3,512,611.07	7,777,093.10
3.公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	-97,187,160.10	67,276,150.32
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入 (损失以“-”号填列)	137,600.51	187,685.83
减:二、费用	13,467,549.24	15,927,087.88
1.管理人报酬	8,069,300.75	8,954,536.27
2.托管费	1,344,883.39	1,492,422.78
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	3,840,212.88	5,265,030.05
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	213,152.22	215,098.78
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	-77,744,949.21	166,941,949.80
减:所得税费用	-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	-77,744,949.21	166,941,949.80

6.3 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:2014 年 1 月 1 日 至 2014 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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)	1,484,686,009.63	-253,661,300.04	1,231,024,709.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期净利润)	-	-77,744,949.21	-77,744,949.21
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)	-212,486,309.50	46,784,094.97	-165,702,214.53
其中:1.基金申购款	19,931,758.78	-4,046,381.93	15,885,376.85
2.基金赎回款	-232,418,068.28	50,830,476.90	-181,587,591.38
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)	1,272,199,700.13	-284,622,154.28	987,577,545.85
项目	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 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)	1,626,107,911.01	-471,717,434.71	1,154,390,476.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期净利润)	-	166,941,949.80	166,941,949.80
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)	-144,998,697.50	34,111,724.50	-110,886,973.00
其中:1.基金申购款	168,225,914.23	-38,927,019.51	129,298,894.72
2.基金赎回款	-313,224,611.73	73,038,744.01	-240,185,867.72
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)	1,481,109,213.51	-270,663,760.41	1,210,445,453.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

葛航	韩波	蔡海成
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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)。

6.4.2 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”)、中国证监会颁布的《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 >》、中国证券投资基金业协会颁布的《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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年半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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(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支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金新增上海锐懿资产管理有限公司为关联方。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金销售机构
山东省国际信托有限公司(“山东国托”)	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
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

本期末及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

权证交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间本基金无应支付关联方佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,069,300.75	8,954,536.27
其中:支付销售机构的客户维护费	-	1,076,213.28

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 1.5%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 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,344,883.39	1,492,422.78

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。

6.4.8.2.3 销售服务费

本报告期及上年度本基金未发生销售服务费用。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期末及上年度可比期间本基金与关联方未发生银行间同业市场债券(含回购)的交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

本期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 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 2014年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 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	90,115,113.84	667,237.58	81,439,957.80	533,255.92

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期末及上年度可比期间本基金未在承销期内持有关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2014 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发 / 增发证券而于期末持有的流通受限证券

报告期末本基金未持有因认购新发 / 增发而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600757	长江传媒	2014年 6 月 16 日	临时停牌	8.85	-	-	1,399,921	11,591,987.13	12,389,300.85	-
000547	闽福发 A	2014年 4 月 16 日	临时停牌	5.97	-	-	1,854,783	10,914,649.53	11,073,054.51	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无其他需要说明有助于理解和分析会计报表事项。

§7 投资组合报告

7.1 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	720,623,416.29	72.66
	其中:股票	720,623,416.29	72.66
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	90,587,468.91	9.13
7	其他各项资产	180,566,329.02	18.21
8	合计	991,777,214.22	100.00

7.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	544,467,812.47	55.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	15,093,750.00	1.53
G	交通运输、仓储和邮政业	16,910,586.64	1.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	131,761,966.33	13.34
J	金融业	-	-
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	-	-
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	12,389,300.85	1.25
S	综合	-	-
	合计	720,623,416.29	72.97

7.3 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	300115	长盈精密	3,050,000	67,161,000.00	6.80
2	300016	北陆药业	3,499,733	43,536,678.52	4.41
3	601222	林洋电子	1,800,000	40,662,000.00	4.12
4	300030	阳普医疗	3,179,776	39,588,211.20	4.01
5	600584	长电科技	4,379,949	38,674,949.67	3.92
6	300226	上海钢联	950,247	35,387,198.28	3.58
7	002152	广电运通	2,024,688	34,500,683.52	3.49
8	600571	信雅达	1,679,662	32,736,612.38	3.31
9	603000	人民网	819,552	32,118,242.88	3.25
10	300049	福瑞股份	1,099,812	31,674,585.60	3.21

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	002008	大族激光	55,322,051.57	4.49
2	300226	上海钢联	42,903,693.14	3.49
3	002214	大立科技	41,433,875.64	3.37
4	002535	林州重机	40,527,978.22	3.29
5	002184	海得控制	39,120,574.14	3.18
6	300016	北陆药业	38,588,411.09	3.13
7	600584	长电科技	38,308,575.71	3.11
8	601222	林洋电子	37,174,371.63	3.02
9	300049	福瑞股份	36,231,076.32	2.94
10	300090	盛运股份	35,419,537.06	2.88
11	300030	阳普医疗	34,909,253.18	2.84
12	600330	天通股份	33,483,539.38	2.72
13	603000	人民网	32,945,746.66	2.68
14	002152	广电运通	32,640,339.42	2.65
15	600571	信雅达	30,005,538.41	2.44
16	002475	立讯精密	28,551,820.76	2.32
17	002514	宝馨科技	28,074,597.83	2.28
18	600175	美都控股	25,429,891.17	2.07
19	002638	勤上光电	24,766,499.70	2.01
20	600522	中天科技	24,392,525.51	1.98

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。

7.4.2 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	002653	海思科	63,495,119.27	5.16
2	600180	瑞茂通	49,097,044.47	3.99
3	600572	康恩贝	44,422,572.88	3.61
4	600597	光明乳业	43,843,650.00	3.56
5	300090	盛运股份	42,790,288.01	3.48
6	002214	大立科技	42,759,272.84	3.47
7	600703	三安光电	42,615,359.53	3.46
8	002008	大族激光	39,206,052.17	3.18
9	002064	华峰氨纶	39,161,744.11	3.18
10	300070	碧水源	37,779,014.28	3.07
11	600649	城投控股	36,099,504.45	2.93
12	002429	兆驰股份	35,973,437.09	2.92
13	300149	量子高科	35,484,017.72	2.88
14	000581	威孚高科	33,143,996.02	2.69
15	000651	格力电器	33,062,656.70	2.69
16	002535	林州重机	31,639,662.31	2.57
17	002019	鑫富药业	29,174,550.54	2.37
18	600887	伊利股份	28,929,204.13	2.35
19	601117	中国化学	28,750,750.41	2.34
20	600261	阳光照明	27,449,259.05	2.23
21	002514	宝馨科技	26,807,865.64	2.18
22	600872	中炬高新	26,212,653.46	2.13
23	300074	华平股份	25,846,607.18	2.10
24	002550	千红制药	25,820,556.34	2.10

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。

7.4.3 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	1,122,237,764.12
卖出股票收入 (成交)总额	1,358,515,090.79

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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贵金属投资明细

报告期末本基金未投资贵金属。

7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的其他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。

7.12.2

本报告期内基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的股票备选库。

7.12.3 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	486,903.65
2	应收证券清算款	180,033,778.16
3	应收股利	-
4	应收利息	42,076.02
5	应收申购款	3,571.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	180,566,329.02

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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
57,394	22,166.07	7,024,053.60	0.55%	1,265,175,646.53	99.45%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	49,965.77	0.0039%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注:基金份额总量的数量区间为 0、0 至 10 万份(含)、10 万份至 50 万份(含)、50 万份至 100 万份(含)、100 万份以上。

§9 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	1,484,686,009.63
本报告期基金总申购份额	19,931,758.78
减:本报告期基金总赎回份额	232,418,068.28
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	1,272,199,700.13

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。

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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、2014 年 2 月 14 日中国银行股份有限公司公告,自 2014 年 2 月 13 日起,陈四清先生担任本行行长。

2、经泰信基金管理有限公司第四届董事会 2013 年第三次(通讯)会议审议通过,王小林先生担任董事长职务。具体详情参见 2014 年 4 月 9 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》上的《泰信基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》,公告同日起公司总经理葛航先生不再代任董事长职务。

3、经泰信基金管理有限公司总办会审议决定 ,刘毅先生不再担任本基金经理职务,戴宇虹女士继续管理本基金。具体详情请见 2014 年 6 月 21 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信优质生活股票型证券投资基金经理变更的公告》。 本公司上述人事变动已按相关规定向监管机构进行备案。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内,本基金未改聘会计师事务所,仍为普华永道中天会计师事务所有限公司。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
国金证券	2	889,580,693.40	35.86%	787,191.64	35.89%	-
海通证券	2	343,218,537.01	13.84%	303,713.86	13.85%	-
中信建投	2	311,094,523.83	12.54%	283,220.40	12.91%	-
中信证券	2	303,677,580.36	12.24%	276,467.51	12.60%	-
中国建银投资证券	2	159,044,100.87	6.41%	140,737.98	6.42%	-
安信证券	1	157,020,383.76	6.33%	142,950.65	6.52%	-
广发证券	2	128,247,090.42	5.17%	87,836.75	4.00%	-
申银万国	1	97,307,838.83	3.92%	88,587.71	4.04%	-
中银国际	2	67,422,659.36	2.72%	61,380.77	2.80%	-
招商证券	1	24,139,447.07	0.97%	21,360.91	0.97%	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券	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 指数基金、泰信中小盘股票基金共用交易单元。

10.7.2 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
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	360,000,000.00	31.86%	-	-
中国建银投资证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	220,000,000.00	19.47%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	550,000,000.00	48.67%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

泰信基金管理有限公司
2014 年 8 月 26 日