

泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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:2014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法律责任...

2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金; 场内简称, 泰信400; 代码, 162507; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2012年9月17日; 报告期末基金份额总额, 22,431,642.87份; 投资目标, 本基金采用量化投资策略, 通过严谨的投资纪律和数量化的风险控制手段, 追求对中证锐联基本面400指数的有效跟踪...

3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年7月1日-2014年9月30日); 1.本期已实现收益, 1,781,080.19; 2.本期利润, 6,606,965.62; 3.加权平均基金份额本期利润, 0.2457; 4.期末基金资产净值, 29,472,324.52; 5.期末基金份额净值, 1.314

注:1.本基金采用收益法计提基金管理人报酬和投资人赎回费,其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,为本基金当期实现的可供基金份额持有人分配的利润...

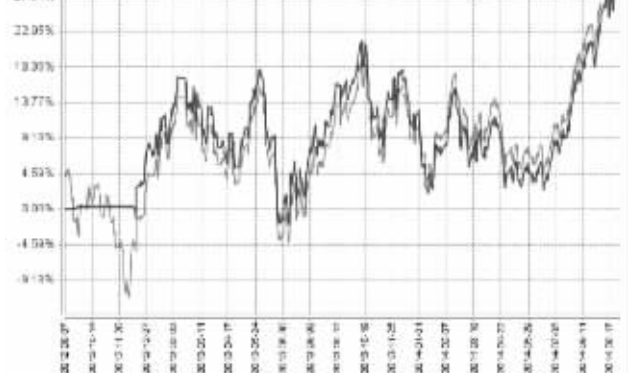
3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准②, 业绩比较基准收益率③, ①-③, ①-④; 过去三个月, 23.26%, 0.88%, 23.67%, 0.89%, -0.41%, -0.01%

注:1.本基金业绩比较基准为: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)

3.2.2 自基金合同生效以来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

基金合同生效以来基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



2. 本基金的投资期限为六个月,建仓期满,基金投资组合各项投资比例符合基金合同的约定。本基金投资于中证锐联基本面400指数的成份股资产不低于基金资产净值的90%;现金及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 基金管理人报告

4.1 基金管理人(或基金管理人小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期; 均浩, 基金经理, 2013年7月5日, -; 冯刚, 基金经理, 2013年7月5日, -

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

4.3 公平交易专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.11 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.13 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.14 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.15 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.16 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.17 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.18 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.19 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.20 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.21 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.22 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.23 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.24 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.25 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.26 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.27 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.28 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.29 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.30 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.31 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.32 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.33 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.34 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.35 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.36 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.37 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.38 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.39 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.40 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.41 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.42 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.43 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.44 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.45 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.46 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.47 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.48 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.49 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.50 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.51 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.52 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.53 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.54 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.55 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.56 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.57 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.58 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.59 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.60 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.61 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.62 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.63 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.64 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.65 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.66 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.67 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.68 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.69 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.70 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.71 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.72 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.73 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.74 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.75 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.76 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.77 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.78 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.79 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.80 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.81 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.82 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.83 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.84 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.85 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.86 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.87 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.88 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.89 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.90 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.91 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.92 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.93 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.94 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.95 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.96 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.97 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.98 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.99 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.100 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

泰信保本混合型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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:2014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法律责任...

2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 泰信保本混合型证券投资基金; 场内简称, 泰信保本; 代码, 162502; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2012年9月22日; 报告期末基金份额总额, 328,814,168.03份; 投资目标, 本基金通过运用优化的资产配置比例和方法(CPIPI)在保证保本的前提下,追求基金资产的长期增值...

3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年7月1日-2014年9月30日); 1.本期已实现收益, 4,195,051.16; 2.本期利润, 18,824,521.99; 3.加权平均基金份额本期利润, 0.0556; 4.期末基金资产净值, 351,523,960.60; 5.期末基金份额净值, 1.069

注:1.本基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或赎回的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费)和再投资费用(申购费),计入申购后净收益水平中低于申购费率;

3.2.1 本报告期末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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准②, 业绩比较基准收益率③, ①-③, ①-④; 过去三个月, 5.59%, 0.23%, 1.09%, 6.01%, 4.44%, 0.23%

注:1.本基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或赎回的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费)和再投资费用(申购费),计入申购后净收益水平中低于申购费率;

3.2.2 自基金合同生效以来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

基金合同生效以来基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:1.本基金合同于2012年9月22日正式生效; 2.本基金的投资范围为:国内依法发行并上市的股票、债券、权证等资产,占基金资产的60%-80%;其中,持有的全部权证市值不超过基金资产净值的3%;债券、货币工具等保本资产占基金资产的40%-100%;其中,持有的现金及到期日在1年以内的政府债券市值不低于基金资产净值的5%。

4.1 基金管理人(或基金管理人小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期; 董山青, 基金经理, 2012年7月22日, -; 董山青, 基金经理, 2012年7月22日, -

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

4.3 公平交易专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.11 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.13 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.14 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.15 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.16 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.17 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.18 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.19 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.20 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.21 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.22 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.23 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.24 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.25 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.26 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.27 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.28 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.29 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.30 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.31 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.32 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.33 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.34 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.35 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.36 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.37 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.38 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.39 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.40 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.41 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.42 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.43 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.44 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.45 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.46 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.47 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.48 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.49 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.50 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.51 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.52 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.53 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.54 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.55 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.56 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.57 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.58 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.59 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.60 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.61 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.62 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.63 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.64 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.65 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.66 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.67 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.68 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.69 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.70 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.71 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.72 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.73 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.74 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.75 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.76 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.77 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.78 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.79 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.80 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.81 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.82 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.83 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.84 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.85 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.86 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.87 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.88 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.89 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.90 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.91 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.92 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.93 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.94 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.95 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.96 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.97 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明</