泰信发展主题股票型证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014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
送出日期：2015年3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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年3月20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。

普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰信发展主题股票
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	143,050,560.73份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡囡	蒋松云
	联系电话	021-20899098	010—66105799
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-5988	95588
传真		021-20899008	010—66105798

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	58,757,199.12	62,684,632.25	-47,721,594.99
本期利润	83,855,718.09	47,562,956.37	24,808,998.27
加权平均基金份额本期利润	0.4624	0.1626	0.0775
本期基金份额净值增长率	52.25%	15.60%	7.74%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.2779	-0.0692	-0.2727
期末基金资产净值	212,959,620.49	245,680,160.21	264,316,283.41
期末基金份额净值	1.489	0.978	0.846

注：1、本基金基金合同于2010年12月15日正式生效。

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、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。

4、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

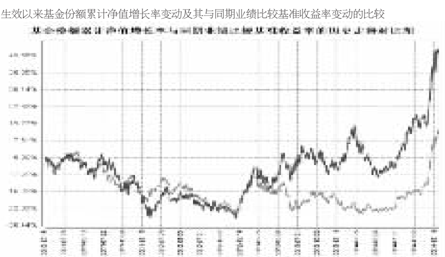
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	27.16%	1.64%	32.85%	1.24%	-5.69%	0.40%
过去六个月	55.27%	1.34%	46.44%	0.99%	8.83%	0.35%
过去一年	52.25%	1.33%	40.69%	0.91%	11.56%	0.42%
过去三年	92.13%	1.27%	41.97%	0.97%	50.16%	0.30%
自基金合同生效起至今	48.90%	1.21%	12.84%	0.98%	36.06%	0.23%

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

1、沪深300指数，编制合理和透明，运用广泛，对中国A股市场具有较强的代表性和权威性。

2、中证全债指数以银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券为样本，是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，具有良好的债券市场代表性，运用较为广泛。选择该业绩比较基准能够真实反映本基金长期动态的资产配置目标和风险收益特征。

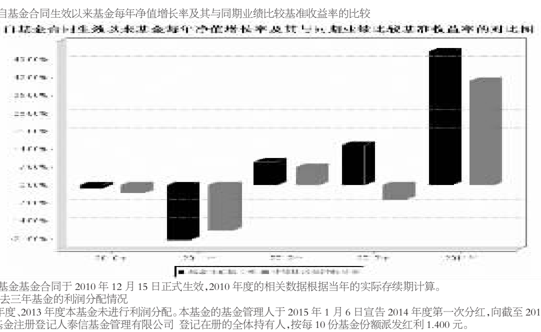
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同于2010年12月15日正式生效，2010年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

2012年度、2013年度本基金未进行利润分配。本基金的基金管理人于2015年1月6日宣告2014年度第一次分红，向截至2015年1月8日止在本基金注册登记人泰信基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每10份基金份额派发红利1.400元。

§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号华夏银行大厦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：王小林
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.）是原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，是国内第一家以信托投资公司为主发起人而发起设立的基金管理公司。

公司目前下设上海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12月底，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12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、泰信鑫益定期开放债券共15只开放式基金及泰信乐利分级1号、泰信乐利3号、泰信乐利分级4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、泰信道简阿尔法、泰信智慧紫藤金1号、泰信至尊阿尔法、泰信至尊阿尔法3号、泰信至尊阿尔法5号、泰信至尊阿尔法6号共12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		
车广路先生	本基金经理	2014年6月21日	-	7年	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。自2012年3月1日至2014年6月21日任泰信蓝筹精选股票基金经理。
刘毅先生	基金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	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2012年12月28日至2014年6月21日担任泰信优质生活股票基金经理，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。
王博强先生	本基金经理助理	2014年4月3日	-	5年	硕士，具有证券从业资格。2008年12月加入泰信基金管理有限公司，历任基金投资部行政助理、集中交易部交易员、研究部助理研究员、研究员、高级研究员。

注：1、经泰信基金管理有限公司总办会审议决定，车广路先生担任泰信发展主题股票型证券投资基金经理职务，刘毅先生不再担任本基金经理职务，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发展主题股票型证券投资基金经理变更的公告》。

2、基金经理的任职日期以基金合同生效日为准。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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》、《公开募集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律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 公平交易制度和控制方法

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《泰信基金管理有限公司公平交易制度》，主要控制方法如下：

1、建立统一的研究平台，所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放。

2、建立全公司投资对象备选库和各投资组合的投资对象备选库。

3、投委会作为公司受托资产投资的最高决策机构，主要负责对公司所管理的受托资产进行投资决策。投资总监在其权限范围内审批超出投资组合经理权限的投资计划。投资组合经理在其权限范围内进行投资决策。

4、投资组合经理同时管理多个投资组合时，必须公平公正的对待管理的所有投资组合，除申购赎回、个股投资比例超标等客观因素之外，同一交易日投资同一交易品种时，应尽可能使他们获得相同或相近的交易价格。

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。

5、集中交易室负责所有投资指令的执行，必须确保所有同向指令的公平公正，平等对待所有投资组合。发现异常指令或者涉嫌利益输送的指令，交易室应立即停止执行指令，并向投资总监和风险管理部报告。对非竞争竞价指令，不同投资组合也必须公平对待，主要采取成交结果按比例分配和轮侯方式处理。

6、风险管理部通过交易系统监控指标设置，实时监控交易指令，禁止同一投资组合内部的同日反向交易，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。

7、公司在交易系统中设置强制公平委托参数，强制交易系统对符合要求的同一交易品种的同向指令执行公平委托。

8、风险管理部定期与不定期对交易指令的公平性和交易委托的公平性进行分析，对强制公平委托的执行过程与结果进行检查；对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，并完成定期分析报告。

4.3.2 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。

4.3.3 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。

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

回顾2014年，A股市场在流动性整体宽松和改革预期的推动下，呈现了全面上涨的走势，无论是成长股还是蓝筹股都阶段性有较好的表现。本基金通过自上而下和自下而上相结合的策略，积极进行行业轮动和波段操作，基本上把握住了市场的运行节奏。参与了新能源汽车、自贸区、军工、汽车后市场、互联网金融、一带一路等行情，也把握住了年底蓝筹股的估值修复机会。

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1.489元，净值增长率为52.25%，同期业绩比较基准收益率为40.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年的中国经济增速将继续下台阶，但这种下滑依然是可控的，失速下跌的风险不大。稳增长和促改革将是2015年政府工作的重点。改革将为中国经济提供新的发展动力，也将为资本市场提供巨大的红利。而稳增长则是促改革的保障，也将成为股市的稳定器。中央推进的以"一带一路"为代表的走出去政策，对国内的过剩产能去化和新基建投资的产生都有很大的促进作用，也为资本市场提供了更多的机会。货币环境相对宽松已经成为经济新常态的重要组成部分，加上企业及居民资产再配置的过程仍然在继续，所以资本市场未来仍然不缺少增量资金。加之世界各大经济体都相继推出了自己的量化宽松政策，全球流动性宽松的局面也基本形成。综上所述，改革的深化会为资本市场持续不断的带来红利，海外投资也会不断加速，社会资产再配置的过程短期内也不会停止，所以支撑本轮行情的核心逻辑并没有发生变化，因此我们看好2015年的A股市场的走势。

本基金仍将依据契约，继续坚持自上而下的把握市场走势，以主题投资的思路来寻找机会，采取灵活的操作策略，做好板块配置和行业轮动。我们重点看好五个投资方向：一，改革，包括国企改革、能源改革、军队科研院所改制等主题；二，转型和创新，包括互联网金融、节能环保、新能源汽车等；三，稳增长和拓展海外市场相关的行业，包括核电、高铁、工程机械、建筑、电力设备等；四，行业的景气上升或反转的周期性行业，包括券商、保险、有色金属等。五，稳定增长的低估值蓝筹股，包括银行、医药和食品饮料等。

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。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，本基金管理人内部控制工作本着对基金份额持有人利益高度负责的精神，以独立于各业务部门的风险管理部、监察稽核部为主体，对基金销售、投资运作、后台保障等主要业务活动进行监督与控制，较好地保证了基金运作的合规性。

1、进一步完善制度建设，构建全面有效的内部控制体系

本基金管理人根据最新出台的相关法律法规，及时补充及完善了内部管理制度，同时对业务流程进一步梳理，严格按照监管要求进行风险控制评估，确保风险控制的有效性，不断提升内部控制水平。

2、进一步规范基金投资管理工作流程，加强基金投资风险控制。

（1）加强基金的日常投资交易进行监控，及时提示相关风险。公司风险管理部负责基金日常投资行为的监控，并与相关基金经理沟通，提示相关风险。同时根据投委会的投资决议对风险指标设置进行调整，不定期检查风险监控指标设置，并根据新的需求对风险监控指标进行测试和更新。另外注意对监管机构处罚信息与市场负面信息搜集，提示投研部门注意潜在风险。

（2）规范投资交易行为，防范交易环节的操作风险。公司禁止基金内的同日反向交易，严格控制旗下管理投资组合间的同日反向交易，新增了基金间同日同向交易、所有投资组合对单只股票成交量占其市场总成交异常等指标预警。对于日常的投资监控，公司实行的是事前控制、事中监督、事后检查的方法，在公平交易的各环节建立了责任追究制，实行各部门责任人、分管领导责任人负责制，以最大限度地监控并处置可能造成不公平交易或利益输送的行为。

3、日常监察与专项稽核相结合，深入开展各项监察稽核工作。包括对基金销售、宣传材料、客户服务、反洗钱工作、信息披露、应用系统权限管理、基金投资备选库管理、异常交易监控等方面进行专项稽核。通过日常监察与专项稽核的方式，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，强化了风险控制流程，提高了业务部门及人员的风险意识水平，从而较好地预防风险。

4、做好投研交易等人员的合规培训，提高合规意识。公司组织投研人员开展内幕交易案例合规培训，就近年来发生的典型内幕交易案例作了分类汇报，并对目前市场上的疑似内幕交易、有争议的内幕交易案例进行了说明，要求投研人员遵守投资纪律，规范决策流程，从源头避免内幕交易事件的发生，加强了投研人员的合规意识。

5、公司采用技术手段对网站、交易、行情等进行屏蔽，对其他非受控方式上网及即时通讯做出进一步规范。加强投研人员的资讯管理，对基金经理集中区域进行录像监控，对于证券公司的网站、网页委托进行了屏蔽，对投研人员的办公电脑安装截屏软件进行留痕处理，并对安装软件的权限进行严格限制。

在本报告期内，本基金的投资运作等各环节基本符合规定的要求，未出现异常交易、操纵市场、内幕交易等违法违规现象。今后公司将继续夯实内部控制和风险管理工作，保证基金运作的合规性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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）基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资两种。投资人可选择获取现金红利，或将分红资金按权益登记日该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金红利。

（2）每一基金份额享有同等分配权。

（3）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

（4）在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多为12次。

（5）每次基金收益分配比例不低于该次收益分配基准日可供分配利润的50%。基金合同生效不满三个月，收益可不分配。

（6）基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过15个工作日。

（7）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

2、本基金的基金管理人于2015年1月6日宣告2014年度第一次分红，向截至2015年1月8日止在本基金注册登记人泰信基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每10份基金份额派发红利1.400元。利润分配合计19,804,022.98元(其中，现金形式发放14,942,310.21元，再投资形式发放4,861,712.77元)。符合基金合同的约定。

§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，本基金托管人在对泰信发展主题股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，泰信发展主题股票型证券投资基金的管理人——泰信基金管理有限公司在泰信发展主题股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，泰信发展主题股票型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配，分配金额为19,804,022.98元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对泰信基金管理有限公司编制和披露的泰信发展主题股票型证券投资基金2014年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2015)第20710号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	泰信发展主题股票型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的泰信发展主题股票型证券投资基金(以下简称"泰信发展主题股票基金")的财务报表，包括2014年12月31日的资产负债表、2014年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是泰信发展主题股票基金的基金管理人泰信基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"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财务报表，并使其实现公允反映； (2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，上述泰信发展主题股票基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的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，公允反映了泰信发展主题股票基金2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	单峰	周祎
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼	
审计报告日期	2015年3月26日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泰信发展主题股票型证券投资基金
报告截止日：2014年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产：		
银行存款	12,570,973.92	11,197,870.01
结算备付金	953,475.63	2,807,565.36
存出保证金	173,026.39	416,160.09
交易性金融资产	195,834,971.80	197,633,823.47
其中：股票投资	195,834,971.80	197,633,823.47
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	-	-
应收证券清算款	4,295,079.97	35,618,648.39
应收利息	3,423.19	9,355.95
应收股利	-	-
应收申购款	428,429.54	4,926.41
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	214,259,380.44	247,688,349.68
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31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	-	-
应付赎回款	61,030.42	171,733.44
应付管理人报酬	253,929.67	303,954.30
应付托管费	42,321.62	50,659.07
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	571,967.22	1,111,333.79
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	370,511.02	370,508.87
负债合计	1,299,759.95	2,008,189.47
所有者权益：		
实收基金	143,050,560.73	251,091,275.93
未分配利润	69,909,059.76	-5,411,115.72
所有者权益合计	212,959,620.49	245,680,160.21
负债和所有者权益总计	214,259,380.44	247,688,349.68

注：报告截止日2014年12月31日，基金份额净值1.489元，基金份额总额143,050,560.73份。

7.2 利润表

会计主体：泰信发展主题股票型证券投资基金
本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入	90,579,546.09	58,975,164.92
1.利息收入	397,803.50	536,538.50
其中：存款利息收入	225,472.27	392,137.54
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	172,331.23	144,400.96
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	65,010,282.62	73,446,887.63
其中：股票投资收益	64,165,063.58	71,238,535.59
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	845,219.04	2,208,352.04
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	25,098,518.97	-15,121,675.88
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	72,941.00	113,414.67
减：二、费用	6,723,828.00	11,412,208.55
1.管理人报酬	2,909,244.75	4,163,871.83
2.托管费	484,874.17	693,978.65
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	2,944,533.58	6,163,465.57
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	385,175.50	390,892.50
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	83,855,718.09	47,562,956.37
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	83,855,718.09	47,562,956.37

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信发展主题股票型证券投资基金
本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31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）	251,091,275.93	-5,411,115.72	245,680,160.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	83,855,718.09	83,855,718.09
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）	-108,040,715.20	-8,535,542.61	-116,576,257.81
其中：1.基金申购款	32,616,327.59	5,625,224.21	38,241,551.80
2.基金赎回款	-140,657,042.79	-14,160,766.82	-154,817,809.61
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）	143,050,560.73	69,909,059.76	212,959,620.49
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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）	312,278,306.87	-47,962,023.46	264,316,283.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	47,562,956.37	47,562,956.37
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）	-61,187,030.94	-5,012,048.63	-66,199,079.57
其中：1.基金申购款	142,105,227.58	-10,500,152.23	131,605,075.35
2.基金赎回款	-203,292,258.52	5,488,103.60	-197,804,154.92
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）	251,091,275.93	-5,411,115.72	245,680,160.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰信发展主题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")证监许可[2010]第1280号《关于核准泰信发展主题股票型证券投资基金募集的批复》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《泰信发展主题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707,154,077.00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(2010)第400号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰信发展主题股票型证券投资基金基金合同》于2010年12月15日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为707,192,791.05份基金份额，其中认购资金利息折合38,714.05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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信发展主题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%。本基金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%。本基金的业绩比较基准为：75%×沪深300指数＋25%×中证全债指数。

本财务报表由本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司于2015年3月26日批准报出。

7.4.2 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》、《泰信发展主题股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的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。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外，其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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，应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2014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。

7.4.7 关联方关系

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
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	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("青岛国信")	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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本期及上年度可比期间本基金无应支付关联方佣金余额。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,909,244.75	4,163,871.83
其中：支付销售机构的客户维护费	653,733.82	1,219,554.76

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的1.5%年费率计提。基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。计算方法如下：每日应计提的基金管理费＝前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	484,874.17	693,978.65

注：支付基金托管人中国工商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 × 0.25% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

本报告期及上年度本基金未发生销售服务费。

7.4.8.3 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未发生与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
期初持有的基金份额	-	19,999,400.00
期间申购/买入总份额	-	0.00
期间因拆分变动份额	-	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	-	19,999,400.00
期末持有的基金份额	-	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.0000%

7.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2014年12月31日		上年度末 2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
山东国托	72,646,090.32	50.7800%	72,646,090.32	28.9300%

7.4.8.5 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12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	12,570,973.92	195,648.91	11,197,870.01	353,077.07

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

7.4.9.2 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
002645	华宏科技	2014年12月11日	重大事项公告	17.91	-	-	250,000	3,732,188.48	4,477,500.00	-
600399	抚顺特钢	2014年12月12日	重大事项公告	28.38	2015年1月26日	27.18	80,000	1,083,521.37	2,270,400.00	-
002168	深圳惠程	2014年11月28日	重大事项公告	10.13	2015年1月28日	9.14	150,000	1,484,721.00	1,519,500.00	-
002009	天奇股份	2014年10月20日	重大事项公告	17.85	2015年1月28日	17.93	150,000	2,124,298.31	2,677,500.00	-

注：本基金截至2014年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2014年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为184,890,071.80元，属于第二层次的余额为10,944,900.00元，无属于第三层次的余额(2013年12月31日：第一层次156,264,348.15元，第二层次为41,369,475.32元，无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	195,834,971.80	91.40
	其中：股票	195,834,971.80	91.40
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	13,524,449.55	6.31
7	其他各项资产	4,899,959.09	2.29
8	合计	214,259,380.44	100.00

8.2 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	2,877,600.00	1.35
B	采矿业	-	-
C	制造业	78,269,651.80	36.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,022,000.00	4.24
E	建筑业	21,065,000.00	9.89
F	批发和零售业	3,740,000.00	1.76
G	交通运输、仓储和邮政业	4,905,000.00	2.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,340,800.00	1.57
J	金融业	48,209,320.00	22.64
K	房地产业	21,345,600.00	10.02
L	租赁和商务服务业	3,060,000.00	1.44
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	195,834,971.80	91.96

8.3 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	000783	长江证券	600,000	10,092,000.00	4.74
2	600030	中信证券	200,000	6,780,000.00	3.18
3	600031	三一重工	650,000	6,487,000.00	3.05
4	000157	中联重科	800,000	5,648,000.00	2.65
5	601628	中国人寿	150,000	5,122,500.00	2.41
6	601099	太平洋	360,000	5,119,200.00	2.40
7	600316	洪都航空	180,000	5,034,600.00	2.36
8	600009	上海机场	250,000	4,905,000.00	2.30
9	600837	海通证券	200,000	4,812,000.00	2.26
10	600639	浦东金桥	200,000	4,758,000.00	2.23

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600016	民生银行	13,801,491.12	5.62
2	300226	上海钢联	13,069,035.14	5.32
3	002535	林州重机	11,219,959.60	4.57
4	600050	中国联通	11,096,820.00	4.52
5	300316	晶盛机电	11,071,325.03	4.51
6	002214	大立科技	11,043,034.43	4.49
7	002312	三泰电子	10,502,039.45	4.27
8	600206	有研新材	10,016,264.29	4.08
9	600153	建发股份	10,006,530.19	4.07
10	002638	勤上光电	9,914,837.33	4.04
11	002117	东港股份	9,583,012.52	3.90
12	600240	华业地产	9,312,250.41	3.79
13	300164	通源石油	9,076,512.90	3.69
14	600708	海博股份	9,007,233.03	3.67
15	000651	格力电器	8,980,070.68	3.66
16	600305	恒顺醋业	8,741,318.93	3.56
17	600187	国中水务	8,536,332.00	3.47
18	601288	农业银行	8,475,000.00	3.45
19	600030	中信证券	8,242,082.63	3.35
20	300265	通光线缆	8,204,457.68	3.34
21	600835	上海机电	7,985,185.68	3.25
22	600509	天富能源	7,912,075.36	3.22
23	601222	林洋电子	7,653,817.87	3.12
24	600887	伊利股份	7,467,081.70	3.04
25	000766	通化金马	7,447,728.94	3.03
26	002241	歌尔声学	7,311,872.78	2.98
27	600122	宏图高科	7,153,621.91	2.91
28	600651	飞乐音响	6,733,434.64	2.74
29	300212	易华录	6,558,630.65	2.67
30	002645	华宏科技	6,484,155.00	2.64
31	000851	高鸿股份	6,418,937.70	2.61
32	601231	环旭电子	6,123,674.02	2.49
33	600713	南京医药	6,076,646.80	2.47
34	601939	建设银行	6,000,000.00	2.44
35	300267	尔康制药	5,953,430.83	2.42
36	300024	机器人	5,940,218.84	2.42
37	300382	斯莱克	5,847,745.23	2.38
38	000592	平潭发展	5,704,871.73	2.32
39	600009	上海机场	5,665,390.87	2.31
40	002366	丹甫股份	5,630,216.54	2.29
41	002475	立讯精密	5,577,369.79	2.27
42	600315	上海家化	5,386,288.77	2.19
43	600406	国电南瑞	5,371,605.80	2.19
44	000783	长江证券	5,358,374.00	2.18
45	002544	杰赛科技	5,322,616.64	2.17
46	300137	先河环保	5,311,789.91	2.16
47	002005	德豪润达	5,133,823.93	2.09

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。

8.4.2 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	002312	三泰电子	18,960,726.47	7.72
2	300226	上海钢联	14,991,046.04	6.10
3	002019	亿帆鑫富	14,484,532.11	5.90
4	002292	奥飞动漫	13,663,707.01	5.56
5	300149	量子高科	12,974,881.06	5.28
6	600180	瑞茂通	12,808,678.94	5.21
7	300045	华力创通	12,580,567.86	5.12
8	600109	国金证券	12,577,057.00	5.12
9	002429	兆驰股份	12,074,153.74	4.91
10	600261	阳光照明	11,744,283.15	4.78
11	002214	大立科技	11,568,329.33	4.71
12	600050	中国联通	11,504,000.00	4.68
13	600572	康恩贝	11,465,737.83	4.67
14	300142	沃森生物	10,986,606.64	4.47
15	300316	晶盛机电	10,447,033.81	4.25
16	300164	通源石油	10,246,814.09	4.17
17	600305	恒顺醋业	9,858,415.72	4.01
18	600708	海博股份	9,827,576.10	4.00
19	002638	勤上光电	9,788,531.25	3.98
20	000963	华东医药	9,769,498.75	3.98
21	002535	林州重机	9,678,922.96	3.94
22	601222	林洋电子	9,636,249.35	3.92
23	300254	仟源医药	9,543,392.50	3.88
24	002117	东港股份	9,513,931.84	3.87
25	600016	民生银行	9,285,653.30	3.78
26	600153	建发股份	9,277,514.98	3.78
27	600206	有研新材	9,228,184.70	3.76
28	600187	国中水务	9,098,178.00	3.70
29	600208	新湖中宝	8,863,247.21	3.61
30	000651	格力电器	8,815,853.60	3.59
31	601288	农业银行	8,811,000.00	3.59
32	600240	华业地产	8,745,439.36	3.56
33	300090	盛运股份	8,520,327.78	3.47
34	002018	华信国际	8,394,975.08	3.42
35	600509	天富能源	8,037,901.50	3.27
36	000592	平潭发展	8,023,903.55	3.27
37	000851	高鸿股份	7,574,685.99	3.08
38	600835	上海机电	7,551,373.61	3.07
39	600122	宏图高科	7,470,086.91	3.04
40	002064	华峰氨纶	7,458,670.64	3.04
41	300267	尔康制药	7,396,970.07	3.01
42	600651	飞乐音响	7,330,154.74	2.98
43	000766	通化金马	7,216,881.42	2.94
44	300212	易华录	6,659,155.19	2.71
45	002241	歌尔声学	6,649,357.91	2.71
46	600713	南京医药	6,503,180.57	2.65
47	300087	荃银高科	6,307,531.41	2.57
48	600887	伊利股份	6,305,301.09	2.57
49	002689	博林特	6,204,081.15	2.53
50	601939	建设银行	6,163,742.47	2.51
51	300024	机器人	6,156,600.50	2.51
52	300137	先河环保	6,072,475.12	2.47
53	002475	立讯精密	6,016,947.69	2.45
54	600030	中信证券	5,898,507.10	2.40
55	300382	斯莱克	5,879,286.39	2.39
56	601231	环旭电子	5,670,380.80	2.31
57	002642	荣之联	5,455,546.80	2.22
58	002405	四维图新	5,294,033.78	2.15
59	002085	万丰奥威	5,226,939.14	2.13
60	600315	上海家化	5,025,376.00	2.05
61	601117	中国化学	4,933,129.30	2.01

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。

8.4.3 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	912,392,012.24
卖出股票收入（成交）总额	1,003,454,446.46

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

8.6 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

报告期末本基金未持有债券。

8.7 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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 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

本报告期末本基金未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	173,026.39
2	应收证券清算款	4,295,079.97
3	应收股利	-
4	应收利息	3,423.19
5	应收申购款	428,429.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,899,959.09

8.12.4 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。

8.12.5 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的情况。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
1,770	80,819.53	87,344,925.33	61.06%	55,705,635.40	38.94%

9.3 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	112,754.17	0.0788%

9.4 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年12月15日）基金份额总额	707,192,791.05
本报告期期初基金份额总额	251,091,275.93
本报告期基金总申购份额	32,616,327.59
减：本报告期基金总赎回份额	140,657,042.79
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	143,050,560.73

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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、本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称"本行"）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

2、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过，自2014年4月2日起，王小林先生担任公司董事长职务，公司总经理葛航先生不再代理董事长职务。具体详情请见2014年4月9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基金行业高级管理人员变更的公告》。

3、经工商行政管理部门核准，泰信基金管理有限公司法定代表人变更为王小林先生。具体详情请见2014年9月13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变更法定代表人的公告》。

4、经泰信基金管理有限公司总办会审议决定，车广路先生担任泰信发展主题股票型证券投资基金经理职务，刘毅先生不再担任本基金经理职务，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发展主题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。除此以外无其他重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费为人民币6.6万元。该审计机构从基金合同生效日（2010年12月15日）开始为本基金提供审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
华创证券	2	594,097,217.03	31.01%	525,717.41	30.69%	-
东兴证券	1	314,362,451.79	16.41%	286,194.01	16.71%	-
中国银河证券	1	263,147,768.03	13.74%	232,859.53	13.59%	-
民生证券	1	232,317,041.00	12.13%	211,500.93	12.35%	-
广发证券	2	191,001,885.25	9.97%	169,018.38	9.87%	-
宏源证券	2	186,334,166.58	9.73%	169,638.23	9.90%	-
华泰证券	1	105,742,569.77	5.52%	96,267.24	5.62%	-
瑞银证券	1	17,493,046.33	0.91%	11,981.10	0.70%	-
新时代证券	1	11,287,322.92	0.59%	9,988.19	0.58%	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	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，对交易单元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工商银行托管的泰信优势增长基金、泰信中证400指数分级基金、泰信现代服务业股票基金共用交易单元。

11.7.2 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
华创证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	595,000,000.00	46.09%	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	105,000,000.00	8.13%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	426,000,000.00	33.00%	-	-
华泰证券	-	-	165,000,000.00	12.78%	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-

泰信基金管理有限公司
2015年3月26日