

泰信增强收益债券型证券投资基金

2011 第四季度 报告

2011年12月31日

■ 2012年12月31日，华泰证券融资融券总资金余额为6.9703亿元，本季度新增融资规模为1.17%，同期环比融资规模同比增长率为2.70%；华泰证券净融资金额达3.85亿元，新增净融资金额为0.9647亿元，本季度净融资同比增长率为1.08%，同期环比净融资同比增长率为2.70%。

▲ 5. 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012年，对于中国资本市场和经济前景投资者普遍预期更为悲观。2012年一季度经济可能会继续回落，但不应因此对经济的转好过于谨慎。首先应关注通胀但其未来存在可控的隐患；其次由于2011年是资产荒年，明年的投资选择将不会太单一于债市，虽然长期资产价格面临走低，但短期可预期的货币和利率是宽松的。总体来看，市场仍处在可控的范围之内。在宏观政策上，我们看好稳增长和调结构并重的思路，认为稳增长是前提，调结构是手段，稳增长是目的。在货币政策上，我们认为央行会保持稳健中性的态度，在流动性充裕的情况下，利率市场化改革将是必然趋势。在财政政策上，我们判断利率仍将作为调控工具使用，在利率市场化改革的过程中，利率的降低可能并不直接发生，因此目前部分资产的收益率可能存在着持续的压降压力。

1 报告期末基金资产组合情况		92 资产负债表	
序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	7,820,712.10	3.71
	其中:股票	7,820,712.10	3.71
2	固定收益投资	173,408,284.97	82.31
	其中:债券	173,408,284.97	82.31
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	银行承兑贴现的买入返售金融资产	-	-
6	银行承兑和贴现支付合计数	26,228,146.03	12.45
7	其他资产	2,229,723.66	1.13
8	合计	210,686,872.76	100.00
93 报告期末按行业分类的股票投资组合			
代码	行业名称	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农林牧渔	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	3,038,615.06	1.51

D0	食品、饮料	—	—
C1	纺织、服装、皮革	—	—
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	—	—
C5	橡胶	—	—
C6	金属、非金属	2,503,018.74	1.25
C7	机械、设备、仪表	535,596.32	0.27
C8	医药、生物制品	—	—
D09	其他制造业	—	—
D	电力、燃气及水的生产和供应业	1,788,000.00	0.89
E	建筑业	—	—
F	交通运输、仓储业	—	—
G	信息技术业	—	—
H	批发和零售业	11,000.00	0.01
I	金融、保险业	2,983,097.04	1.49
J	房地产业	—	—
K	社会服务业	—	—
L	传播业、文化产业	—	—
M	综合类	—	—
	合计	7,820,712.10	3.90



36 报告期内期末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

37 报告期内期末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

38 报告期内未兑付公允价值占基金资产净值比例大的前十名权证投资明细

本报告期内基金未持有权证。

39 投资组合报告附注

40 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。

41 本基金不直接投资于二级市场买入股票、权证等权益类资产,但可参与一级市场新股申购、增发新股、可转换债券转股后因转股所获得的权证;及因投资可分离债而产生的权证。

3.8.3 基金资产组合情况

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,559.88
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	12,315,668.93
5	应收申购款	12,200.85
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	13,780,729.66

5.8.5 报告期末前十名持有其有表决权股份的自然人持股明细				
序号	姓名或名称	股份名称	公允价值(元)	占期末净资产净值比例(%)
1	李洪明	普通股(无限售条件)	11,828,408.80	8.40
2	110003	新嘉坡创投	10,979,571.00	8.53
3	133002	上海证券	9,100.00	3.34
4	110012	新嘉坡创投	2,219,648.00	2.06
5	110011	新嘉坡创投	4,494,621.60	2.22
6	110078	新嘉坡创投	4,031,288.00	2.00
7	110015	新嘉坡创投	3,830,000.00	1.65
8	125731	美兰转债	1,863,612.00	0.93

5.8.5.5 报告期末前十名投票中存在受限股份的情况说明					
序号	姓名或名称	股份名称	受限股份的数量 (公允价值(元))	占期末净资产净值比例(%)	受限股份情况说明
1	601028	民生股份	2,363,018.74	1.25	质押融资
2	001515	兆丰股份	2,095,488.00	1.24	质押融资

3	602136	新济药业	487,390.56	0.24	新增锁定
4	002649	博彦科技	11,400.00	0.01	新增锁定
5	6.8.6	上海爱建信托投资有限公司委托资产管理计划	-	-	减持股票 限售期满未违反相关法规或基金资产管理公司约定。

§6 开放式基金份额变动

项目	安信债券增强型基金	安信债券稳利基金
本报告期期初基金份额总额	182,472,424.23	27,175,177.29
本报告期基金总申购份额	15,169,997.92	23,525,082.76
减：本报告期基金总赎回份额	16,153,042.04	25,558,989.18
本报告期基金净申购/赎回份额	-	-
本报告期末基金份额总额	181,889,379.39	25,141,270.91

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准华信增利收益债券型证券投资基金设立的文件

2、《华信增利收益债券型证券投资基金合同》

3、《华信增利收益债券型证券投资基金招募说明书》

4、《华信增利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复及营业执照

6、基金管理人业务资格批复和营业执照

7、办公地址

8、中国证监会核准基金管理人、基金托管人的住所，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时间内到指定目录及上述文件内容的复制或复印件。

7.2 查阅方式

投资者可免费查阅有关基金管理人网站(www.btfund.com)或免费查阅上述相关文件，或拨打客户服务中心电话 400-888-9983、021-78748566 和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司 基金管理人于2020年1月20日					
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	002298	鑫光鑫光	3,894,271	49,846,668.80	8.01
2	002049	晶源电子	2,011,139	37,306,628.45	6.00
3	600106	重庆路桥	3,800,000	26,448,000.00	4.25
4	601798	蓝卡高新	1,820,600	24,487,070.00	3.94
5	000002	万科A	3,000,000	22,410,000.00	3.60
6	600395	金江股份	980,946	20,256,534.90	3.26
7	600061	中国广核	1,019,023	20,188,211.62	3.25
8	600066	云天化	1,350,000	20,088,000.00	3.23
9	002179	高盟新材	1,150,002	18,860,032.80	3.02
10	600312	平安高电	2,220,808	18,543,746.80	2.98

本基金期末基金未持有债券。

5.8.3 报告期末公允价值占基金资产净值比例大于8%的前五名债券投资明细

本基金期末基金未持有债券。

5.8.4 报告期末公允价值占基金资产净值比例大于8%的前十名资产支持证券投资明细

本基金期末基金未持有资产支持证券。

5.8.5 报告期末公允价值占基金资产净值比例大于8%的前五名权证投资明细

本基金期末基金未持有权证。

5.8.6 报告期末公允价值

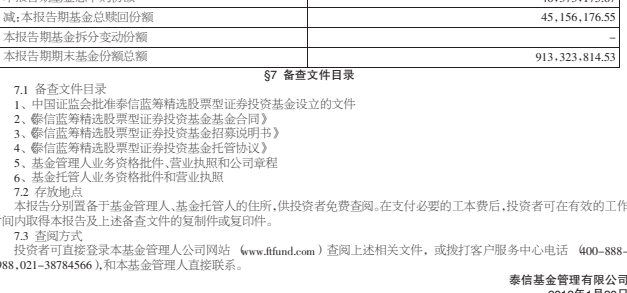
5.8.7 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本基金编制日前一年内受到公开谴责、处罚

5.8.8 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。

5.8.9 基金资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	168,281.14
2	应收证券清算款	4,908,319.79

3	应收股利	
4	应收利息	15,996.97
5	应收申购款	16,638,231.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,730,829.27
5.8.4	报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细	
5.8.5	报告期末本基金持有的买入国债期货合约明细	
5.8.6	报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明	
5.8.6	本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况	
5.8.6	本基金本报告期末未买入购回被禁止买入的证券,未从事二级市场投资分离交易可转债转股的权证,投资流通受限证券未违反相关法规或基金资产管理公司的规定。	
§6 开放式基金份额变动		单位:元
本报告期初基金份额总额	912,106,315.41	
本报告期基金份额申购总额	46,733,175.62	



2012年1月20日