泰信增强收益债券型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21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2014年1月17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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信债券增强收益	
交易代码	290007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年7月29日	
报告期末基金份额总额	33,828,845.37份	
投资目标	在获取债券稳定收益的基础上,通过股票一级市场申购等手段谋求高于比较基准的收益。	
投资策略	本基金根据对宏观经济形势、货币和财政政策变化、经济周期及利益走势、企业盈利和信用状况、基金流动性情况等的动态分析,通过召开投资决策委员会,确定基金中各类资产的配置比例范围,并跟踪影响资产策略配置的各种因素的变化,定期对资产策略配置比例进行调整。	
业绩比较基准	80%*上证企业债指数+20%*上证国债指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的低风险、低收益品种,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金,高于货币市场基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	泰信债券增强收益A	泰信债券增强收益C
下属两级基金的交易代码	290007	291007
报告期末下属两级基金的份额总额	15,284,247.44份	18,544,597.93份

§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10月1日-2013年12月31日)	
	泰信债券增强收益A	泰信债券增强收益C
1.本期已实现收益	375,292.25	522,517.44
2.本期利润	-505,992.61	-751,810.79
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0316	-0.0323
4.期末基金资产净值	15,418,829.53	18,655,543.00
5.期末基金份额净值	1.0088	1.0060

注:1、上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

泰信债券增强收益A

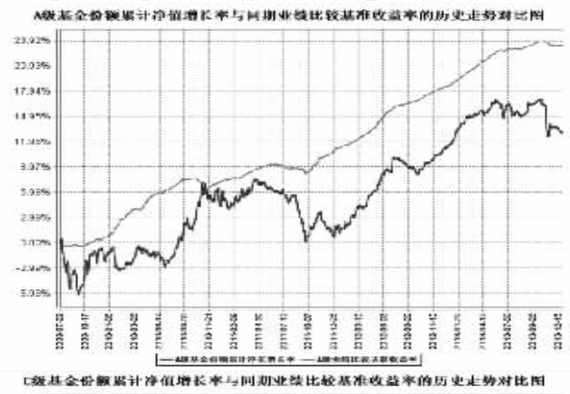
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.99%	0.35%	-0.12%	0.03%	-2.87%	0.32%

泰信债券增强收益C

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	-3.06%	0.35%	-0.12%	0.03%	-2.94%	0.32%

注:本基金的业绩比较基准为:80%上证企业债指数+20%上证国债指数。

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2009年7月29日正式生效。

2、本基金建仓期为六个月。建仓期满,本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的80%,投资于权益类资产的比例不高于基金资产的20%,现金或者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 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		
何俊春女士	投资部固定收益投资总监、本基金基金经理兼泰信双息双利基金、泰信债券周期回报基金、泰信鑫益定期开放债券基金经理	2009年7月29日	-	17	工商管理硕士。具有基金从业资格。曾任职于上海鸿安投资咨询有限公司、齐鲁证券上海斜土路营业部。2002年12月加入泰信基金管理有限公司,先后担任泰信天天收益基金交易员、交易主管,泰信天天收益基金经理。自2008年10月10日起担任泰信双息双利债券基金基金经理;自2012年10月25日起担任泰信债券周期回报基金经理;自2013年7月17日起担任泰信鑫益定期开放债券基金经理。现同时担任投资部固定收益投资总监。

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

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》、《泰信增强收益债券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

2013年四季度,先行指标PMI指数企稳回落,经济回升势头减弱。物价方面,CPI上行至3.2%的高点后开始下滑,一定程度上缓解了市场的通胀预期。四季度经济和通胀对债市的压力不大,影响市场的主要因素仍是资金面。虽然外汇占款好转,但央行整体仍保持中性偏紧的货币政策,资金利率水平比三季度有所抬升。四季度债券市场延续调整格局,10年国债收益率从4%上升至4.55%左右的水平,已经超过11年三季度的高点。收益率的上行压力也逐步从利率债波及至企业债,同时前期受到抑制的发行量于四季度开始释放,导致企业债收益率出现明显回升,一级市场7年AA城投债发行利率上行至8.5%以上。转债方面,受权益市场影响,转债指数出现明显下跌,除海直和复牌的东华转债外,其余转债多表现不佳。

四季度,由于赎回压力较大,增强收益基金通过减持部分企业债完成降杠杆进程,企业债持仓比例相比三季度有较大幅度下降,由于基金规模较小,下阶段在组合的进攻性与流动性之间选择较好的平衡点。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,泰信债券增强收益A基金份额净值为1.0088元,本季度份额净值增长率为-2.99%,同期业绩比较基准增长率为-0.12%;泰信债券增强收益C基金份额净值为1.0060元,本季度份额净值增长率为-3.06%,同期业绩比较基准增长率为-0.12%。

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2014年一季度,中国经济增长相对平稳,通胀高位波动,基本面的变动暂时还不足以改变货币政策方向,同时美国去年末开始逐步退出QE,因此我们预期市场资金面仍会保持中性偏紧状态。若资金利率不出现明显下行,则收益率下行空间将会受到限制,债市不存在趋势性机会。但我们认为也无须过度悲观,债券市场经过半年多的调整,价值将逐步显现。首先,一季度利率债尤其是国债发行量将出现季节性下降,供给对收益率的冲击将会明显减弱。其次,若监管层出台限制非标资产的文件,资金回流的预期或许会使债市在在波段性机会。因此,一季度利率债收益率预计将会高位波动,但不排除存在波段性机会。信用债方面,前期企业债信用利差已有所修复,票息保护增强,当然我们后续仍需关注中低等级债的信用风险,其信用利差存在继续扩大的概率。另外,经历资金面的紧张之后,短融收益率也具有一定的吸引力。转债方面,经过四季度的下跌,转债市场的风险逐步释放,关注转债市场跌出来的投资机会以及博弈转股价下修的个券机会。

2014年一季度增强收益基金将继续保持较低的杠杆率,当前持仓品种主要以企业债为主,未来将择机对资产配置进行适度调整,关注如转债、短融及利率债等其他券种的投资机会。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	32,209,750.00	91.02
	其中:债券	32,209,750.00	91.02
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	600,000.00	1.70
	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	2,049,146.87	5.79
6	其他资产	528,132.30	1.49
7	合计	35,387,029.17	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末本基金未持有股票。

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

报告期末本基金未持有股票。

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	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	31,694,000.00	93.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	515,750.00	1.51
8	其他	-	-
9	合计	32,209,750.00	94.53

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	1280462	12大丰债	200,000	19,266,000.00	56.54
2	1380208	13溧水债	100,000	9,431,000.00	27.68
3	122988	09渝隆债	29,970	2,997,000.00	8.80
4	110018	国电转债	5,000	515,750.00	1.51

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国债期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	18,266.25
2	应收证券清算款	498.33
3	应收股利	-
4	应收利息	500,290.91
5	应收申购款	9,076.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	528,132.30

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110018	国电转债	515,750.00	1.51

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金未投资股票。

5.9.6 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

项目	泰信债券增强收益A	泰信债券增强收益C
报告期期初基金份额总额	16,888,050.91	28,857,375.34
报告期期间基金总申购份额	499,773.23	1,423,325.86
减:报告期期间基金总赎回份额	2,103,576.70	11,736,103.27
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	15,284,247.44	18,544,597.93

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金申购、赎回本基金。

§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增强收益债券型证券投资基金设立的文件

2、《泰信增强收益债券型证券投资基金基金合同》

3、《泰信增强收益债券型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信增强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.ftfund.com)免费查阅上述相关文件,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
2014年1月21日

泰信发展主题股票型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013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
报告送出日期:2014年1月21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2014年1月17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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信发展主题股票
交易代码	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
报告期末基金份额总额	251,091,275.93份
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。
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

§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10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-5,723,999.20
2.本期利润	-290,640.97
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0012
4.期末基金资产净值	245,680,160.21
5.期末基金份额净值	0.978

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。

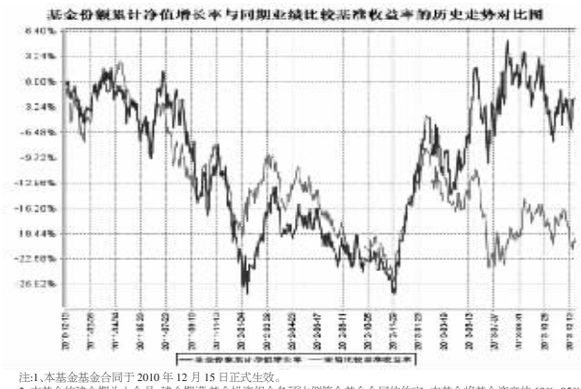
3.2 基金净值表现

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	-0.41%	1.31%	-2.97%	0.85%	2.56%	0.46%

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。

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%。

§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		
刘毅先生	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	-	10	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日起担任泰信优质生活股票基金经理。现同时担任投资部副总监兼投资副总监、首席策略分析师。

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

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

回顾四季度,信用风险溢价逐渐上升使得资金利率和债券收益率高企,同时短期经济增速和企业盈利出现回落和下滑的趋势,这使得股票市场承压,但是十八届三中全会出台的改革力度和措施远超市场预期,使得短期市场情绪高涨,这些因素交织在一起使得市场出现了震荡走势。本基金在四季度还是围绕消费成长和新兴行业进行了布局和投资,同时对改革相关的主题也进行了参与。值得总结的是尽管对宏观经济和大盘的研判基本正确,但是行情分化的剧烈程度还是超出了我们的预期。

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0.978元,本季度净值增长率为-0.41%,业绩比较基准增长率为-2.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一段时间,我们认为经济将出现缓慢下行,企业盈利将会出现下滑,改革政策的落实和见效需要时间,同时信用风险释放的可能会超出市场预期,但是基于中长期我们认为改革将会降低交易成本,提高全社会的生产效率,对中长期市场的估值提供支撑。因此,我们认为2014年的市场将可能比2013年更为复杂,结构分化的特征还将延续且较2013年更为剧烈,部分伪成长股的泡沫将会被刺破。

本基金在未来一段时间将采取主题投资和价值投资相结合的策略,保持中性灵活的仓位,将主要仓位配置在经济转型和改革创新中受益的主题板块,投资消费成长和新兴产业中更具有可靠性和持续性的成长股,选股中我们将更加着重于自下而上来进行。

§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	197,633,823.47	79.79
	其中:股票	197,633,823.47	79.79
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	14,005,435.37	5.65
6	其他资产	36,049,090.84	14.55
7	合计	247,688,349.68	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	6,450,180.94	2.63
B	采矿业	-	-
C	制造业	141,632,646.68	57.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,600,000.00	2.28
F	批发和零售业	18,805,995.85	7.65
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,697,000.00	1.50
J	金融业	10,182,000.00	4.14
K	房地产业	11,266,000.00	4.59
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	197,633,823.47	80.44

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	300149	量子高科	1,132,614	19,594,222.20	7.98
2	002019	鑫富药业	649,841	13,581,676.90	5.53
3	300045	华力创通	500,000	12,450,000.00	5.07
4	002292	奥飞动漫	369,951	12,082,599.66	4.92
5	300090	盛运股份	345,081	11,970,859.89	4.87
6	300142	沃森生物	300,000	11,697,000.00	4.76
7	600261	阳光照明	799,939	11,111,152.71	4.52
8	002429	兆驰股份	807,021	10,894,783.50	4.43
9	600572	康恩贝	799,975	10,807,662.25	4.40
10	600109	国金证券	600,000	10,182,000.00	4.14

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

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	416,160.09
2	应收证券清算款	35,618,648.39
3	应收股利	-
4	应收利息	9,355.95
5	应收申购款	4,926.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,049,090.84

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

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	300149	量子高科	19,594,222.20	7.98	临时停牌
2	600572	康恩贝	10,807,662.25	4.40	临时停牌

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	242,864,558.20
报告期期间基金总申购份额	31,908,934.35
减:报告期期间基金总赎回份额	23,682,216.62
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	251,091,275.93

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金申购、赎回本基金。

§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发展主题股票型证券投资基金设立的文件

2、《泰信发展主题股票型证券投资基金基金合同》

3、《泰信发展主题股票型证券投资基金招募说明书》

4、《泰信发展主题股票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.ftfund.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
2014年1月21日

泰信中证200指数证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21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2014年1月17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10月1日起至12月31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	118,180,001.22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10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-179,261.23
2.本期利润	-2,011,528.34
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0169
4.期末基金资产净值	85,660,879.48
5.期末基金份额净值	0.725

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。

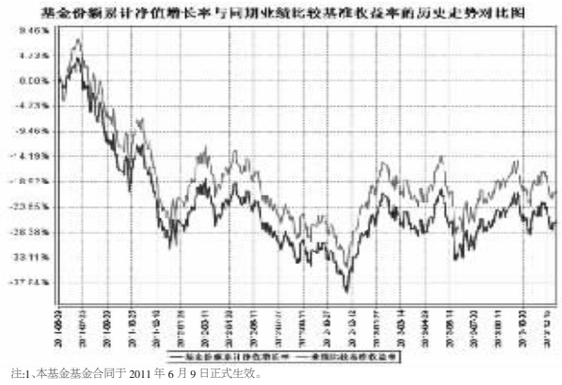
3.2 基金净值表现

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	-2.29%	1.21%	-1.97%	1.22%	-0.32%	-0.01%

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。

§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