

## 泰信保本混合型证券投资基金2012年

## [2012] 第二季度报告

基金管理人:泰信基金管理有限公司  
基金托管人:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2012年7月19日

§ 1 重要提示

本基金管理人的董事及董事会成员所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担个别及连带责任。

本基金管理人和基金托管人声明:本基金合同已于2012年7月16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信息,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。

§ 2 基金概况

基金简称:泰信保本混合

交易代码:290012

运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2012年2月22日

报告期期末基金份额总额:133,464,802.84份

投资目标:本基金通过运用优化的恒定比例组合保险方法(CPPI),在保证本期到期本基金安全的基础上,寻求资产的稳定增值。

投资策略:本基金以优化的恒定比例组合保险方法(CPPI)为基础来实现保本和增长的投投资纪律,对本基金的资产配置进行优化动态调整,确保投资者的投资资金的安全性。同时,通过积极稳健的收益资产配置策略,谋取基金资产的增值。

业绩比较基准:三年定期银行存款利率后收益率。

风险收益特征:本基金为保本基金,属于证券投资基金中的低风险品种。

基金管理人:泰信基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

基金保证人:山东省鲁信投资控股集团有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年4月1日 - 2012年6月30日)

1.本期已实现收益 2,179,027.13

2.本期利润 4,377,409.37

3.加权平均基金份额本期利润 0.0239

4.期末基金份额净值 137,350,794.77

5.期末基金份额净值 1.029

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、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,本期利润总额即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.1 本基金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) 收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 0.29% 0.08% 1.25% 0.01% 1.04% 0.07%

注:本基金的业绩比较基准为三年定期银行存款利率后收益率。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图

3.2.3 本基金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) 收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 0.29% 0.08% 1.25% 0.01% 1.04% 0.07%

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、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,本期利润总额即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.4 本基金报告期基金份额净值 1.029

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、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,本期利润总额即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.5 本基金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) 收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 0.29% 0.08% 1.25% 0.01% 1.04% 0.07%

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、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,本期利润总额即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.6 本基金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) 收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 0.29% 0.08% 1.25% 0.01% 1.04% 0.07%

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、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,本期利润总额即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.7 本基金报告期基金份额净值 1.029

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、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,本期利润总额即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.8 本基金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) 收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 0.29% 0.08% 1.25% 0.01% 1.04% 0.07%

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、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,本期利润总额即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.9 本基金报告期基金份额净值 1.029

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、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,本期利润总额即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.10 本基金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) 收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 0.29% 0.08% 1.25% 0.01% 1.04% 0.07%

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、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,本期利润总额即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.11 本基金报告期基金份额净值 1.029

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、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,本期利润总额即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.12 本基金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) 收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 0.29% 0.08% 1.25% 0.01% 1.04% 0.07%

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、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,本期利润总额即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.13 本基金报告期基金份额净值 1.029

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、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,本期利润总额即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.14 本基金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) 收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 0.29% 0.08% 1.25% 0.01% 1.04% 0.07%

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、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,本期利润总额即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.15 本基金报告期基金份额净值 1.029

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、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,本期利润总额即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.16 本基金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) 收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 0.29% 0.08% 1.25% 0.01% 1.04% 0.07%

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、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,本期利润总额即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.17 本基金报告期基金份额净值 1.029

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、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,本期利润总额即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.18 本基金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) 收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 0.29% 0.08% 1.25% 0.01% 1.04% 0.07%

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、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,本期利润总额即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.19 本基金报告期基金份额净值 1.029

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、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,本期利润总额即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.20 本基金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) 收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 0.29% 0.08% 1.25% 0.01% 1.04% 0.07%

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、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,本期利润总额即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.21 本基金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) 收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 0.29% 0.08% 1.25% 0.01% 1.04% 0.07%

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、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,本期利润总额即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.22 本基金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) 收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 0.29% 0.08% 1.25% 0.01% 1.04% 0.07%

注:1.所列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,开放式基金的申购费用、红利再投资费用、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利息收入、投资收益、其他