

泰信蓝筹精选股票型证券投资基金

[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: 中国银行股份有限公司
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2012年7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项，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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 2012年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

泰信蓝筹精选股票

基金简称 290006
交易代码
基金运作方式 约型开放式
基金合同生效日 2009年4月22日
报告期末基金份额总额 1,101,703,213.40份

投资目标 通过投资于中国经济可持续发展过程中具有核心竞争力的行业内在领先地位，业绩持续增长，分红稳定的优质蓝筹公司进行投资。

我们认为，虽然目前国内经济低迷，外围环境动荡，但市场在持续下跌之后，对经济的悲观情绪已有

所释放，整个市场的估值水平已回归合理区间，而流动性有向好趋势，展望三季度，我们认为市场系统性风险不大，对市场持谨慎乐观的态度。在“稳增长”的基调下，经济将探底回升或带动股市带来机会。

在行业配置方面，我们看好前期调整充分、估值较低的食品饮料、医药、电子等行业，同时关注受益于一季报业绩超预期的金融、地产、公用事业等行业的投资机会。

在个股的选择方面，我们将结合利用公司的股票价值评估体系及尽职调查评估体系，结合定量分析和定性分析，精选出具有核心竞争力优势，在其所属行业内占有领先地位、业绩稳定增长、分红稳定的优质

蓝筹公司进行投资。

本基金将继续采取谨慎的操作思路，保持灵活的操作风格，充分发行业配置和选股优势，以勤勉

尽责的态度为基金份额持有人长期、稳定的回报。

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2012年7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项，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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 2012年4月1日起至6月30日止。

§ 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 -8,860,270.52

2.本期利润 -19,420,887.08

3.加权平均基金份额本期利润 0.0187

4.期末基金资产净值 840,234,076.94

5.期末基金份额净值 0.7627

注:本基金业绩比较基准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、赎回费用、基金转换费用等。

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

3.1 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) 业绩比较基准收益率(②) 业绩比较基准收益率差额(③=①-②) 净值增长率标准差(④)

过去三个月 -1.54% 0.93% 0.51% 0.84% -2.05% 0.09%

注:本基金业绩比较基准为:75%×沪深300指数+25%×富时中国国债指数。

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

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 601928 凤凰传媒 9,720,000 83,592,000.00 9.95

2 002049 普丽盛 2,130,000 46,263,600.00 5.51

3 000059 辽通化工 4,300,662 34,018,236.42 4.05

4 000797 中国武夷 6,117,536 29,241,822.08 3.48

5 002428 云南锗业 1,150,785 24,085,930.05 2.87

6 000961 桃李面包 1,938,700 19,076,800.00 2.27

7 000960 锡业股份 950,792 18,730,602.40 2.23

8 000667 名流置业 8,000,000 17,280,000.00 2.06

9 000937 冀中能源 1,107,524 16,911,891.48 2.01

10 000616 民生银行 2,800,519 16,775,108.81 2.00

5.4 报告期末按照行业分类的债券投资组合

本基金未持有债券品种的债券投资组合。

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十名债券投资明细

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

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十名权证投资明细

5.8 投资组合报告

报告期内本基金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 报告期内本基金投资的前十名股票没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10 其他资产构成

1 存出保证金 115,896.76

2 应收证券清算款 24,830,546.78

3 应收股利 41,208.10

4 应收利息 469,899.37

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 25,457,551.01

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 报告期末前十名股票中有流通受限情况的说明

5.8.6 报告期内本基金未投资控股股东所承销的证券，未从二级市场投资分离交易可转债附送的权证，投资流通受限证券未违反相关法规或本基金管理公司的规定。

5.8.7 报告期内基金拆分变动情况

5.8.8 报告期内基金拆分变动情况

5.8.9 报告期内基金拆分变动情况

5.8.10 报告期内基金拆分变动情况

5.8.11 报告期内基金拆分变动情况

5.8.12 报告期内基金拆分变动情况

5.8.13 报告期内基金拆分变动情况

5.8.14 报告期内基金拆分变动情况

5.8.15 报告期内基金拆分变动情况

5.8.16 报告期内基金拆分变动情况

5.8.17 报告期内基金拆分变动情况

5.8.18 报告期内基金拆分变动情况

5.8.19 报告期内基金拆分变动情况

5.8.20 报告期内基金拆分变动情况

5.8.21 报告期内基金拆分变动情况

5.8.22 报告期内基金拆分变动情况

5.8.23 报告期内基金拆分变动情况

5.8.24 报告期内基金拆分变动情况

5.8.25 报告期内基金拆分变动情况

5.8.26 报告期内基金拆分变动情况

5.8.27 报告期内基金拆分变动情况

5.8.28 报告期内基金拆分变动情况

5.8.29 报告期内基金拆分变动情况

5.8.30 报告期内基金拆分变动情况

5.8.31 报告期内基金拆分变动情况

5.8.32 报告期内基金拆分变动情况

5.8.33 报告期内基金拆分变动情况

5.8.34 报告期内基金拆分变动情况

5.8.35 报告期内基金拆分变动情况

5.8.36 报告期内基金拆分变动情况

5.8.37 报告期内基金拆分变动情况

5.8.38 报告期内基金拆分变动情况

5.8.39 报告期内基金拆分变动情况

5.8.40 报告期内基金拆分变动情况

5.8.41 报告期内基金拆分变动情况

5.8.42 报告期内基金拆分变动情况

5.8.43 报告期内基金拆分变动情况

5.8.44 报告期内基金拆分变动情况

5.8.45 报告期内基金拆分变动情况

5.8.46 报告期内基金拆分变动情况

5.8.47 报告期内基金拆分变动情况

5.8.48 报告期内基金拆分变动情况

5.8.49 报告期内基金拆分变动情况

5.8.50 报告期内基金拆分变动情况

5.8.51 报告期内基金拆分变动情况

5.8.52 报告期内基金拆分变动情况

5.8.53 报告期内基金拆分变动情况

5.8.54 报告期内基金拆分变动情况

5.8.55 报告期内基金拆分变动情况

5.8.56 报告期内基金拆分变动情况

5.8.57 报告期内基金拆分变动情况

5.8.58 报告期内基金拆分变动情况

5.8.59 报告期内基金拆分变动情况

5.8.60 报告期内基金拆分变动情况

5.8.61 报告期内基金拆分变动情况

5.8.62 报告期内基金拆分变动情况

5.8.63 报告期内基金拆分变动情况

5.8.64 报告期内基金拆分变动情况

5.8.65 报告期内基金拆分变动情况

5.8.66 报告期内基金拆分变动情况

5.8.67 报告期内基金拆分变动情况

5.8.68 报告期内基金拆分变动情况

5.8.69 报告期内基金拆分变动情况

5.8.70 报告期内基金拆分变动情况

5.8.71 报告期内基金拆分变动情况

5.8.72 报告期内基金拆分变动情况

5.8.73 报告期内基金拆分变动情况

5.8.74 报告期内基金拆分变动情况

5.8.75 报告期内基金拆分变动情况

5.8.76 报告期内基金拆分变动情况

5.8.77 报告期内基金拆分变动情况

5.8.78 报告期内基金拆分变动情况

5.8.79 报告期内基金拆分变动情况

5.8.80 报告期内基金拆分变动情况

5.8.81 报告期内基金拆分变动情况

5.8.82 报告期内基金拆分变动情况

5.8.83 报告期内基金拆分变动情况

5.8.84 报告期内基金拆分变动情况

5.8.85 报告期内基金拆分变动情况

5.8.86 报告期内基金拆分变动情况

5.8.87 报