

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
送出日期:2013年3月29日

\$ 1 提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金托管人的高级管理人员在履行职责时不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。本年度报告已公告在百分之以上独立董事签字同意,并经公司董事会审核通过。
基金托管人中信银行股份有限公司根据基金合同的约定,对基金的投资运作、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未来表现。投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书及其摘要。

本年度报告摘要摘要年度报告正文,投资者应当仔细阅读,内容年度报告正文。

本报告期自2012年2月22日(基金合同生效日)起至2012年12月31日止。

2.2 基金简介

基金简称 泰信保本混合

基金代码 290012

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2012年2月22日

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

报告期末基金份额总额 57,760,911.49份

基金合同存续期 不定期

2.2 基金产品说明

根据本基金的合同保证,本基金通过运用优化的恒定比例组合保险方法(CPPI),在保证本期到期前基金安全的基础上,寻求资产的稳定增值。

本基金以优化的恒定比例组合保险方法(Constant Proportion Portfolio Insurance,CPPI)为基础来实现保本和增值,在保本周期内,通过优化的投资纪律和风险管理,对基金的资产配置进行动态调整,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投资策略,谋取基金的增值。

业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为:三年期银行定期存款的税后收益率。

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。

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 中信银行股份有限公司

姓名 唐国培 朱文明

信息披露负责人 陈雷 陈雷

联系电话 021-20899032 010-65556899

电子邮箱 xxpt@ftfund.com zhuyiming@cticib.com.cn

客户服务电话 400-888-5988 95558

传真 021-20899008 010-65550832

2.4 信息披露方式

披露基金年度报告正文的管理人互联网网址 http://www.ftfund.com

网址

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

6.3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

3.1 期间数据和指标 2012年2月22日(基金合同生效日)~2012年12月31日

本期已实现收益 4,695,819.03

本期利润 6,948,538.93

加权平均基金份额本期利润 0.0557

本期基金份额净值增长率 4.92%

3.1.2 期末数据和指标 2012年末

期末可供基金份额利润 0.0290

期末基金份额净值 60,008,850.91

1.039

3.1.3 基本数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.2.1 期间数据和指标 2012年2月22日(基金合同生效日)~2012年12月31日

本期已实现收益 4,695,819.03

本期利润 6,948,538.93

加权平均基金份额本期利润 0.0557

本期基金份额净值增长率 4.92%

3.2.2 期末数据和指标 2012年末

期末可供基金份额利润 0.0290

期末基金份额净值 60,008,850.91

1.039

3.2.3 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 1.86% 0.15% 1.09% 0.01% 0.77% 0.14%

过去六个月 1.96% 0.14% 2.20% 0.01% -0.24% 0.13%

自基金合同生效日起至 4.92% 0.12% 4.04% 0.01% 0.88% 0.11%

注:1.本基金合同于2012年2月22日正式生效,截至本报告期末不满一年。
2.所列基金业绩数据不包括对基金份额持有人申购和赎回交易的费用,例如,开放式基金的申购赎回费,货币市场基金的申购赎回费,基金转换费等。
3.本期已实现收益指基金本期利息收入,减去必要的费用,并扣除公允价值变动收益)相除相关费用后的余额。
4.本期可供分配利润指本报告期末至资产负债表上本期利润之和。
5.本期基金份额净值增长率=基金净值增长率-同期银行定期存款基准收益率的差额。

3.2.4 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 1.86% 0.15% 1.09% 0.01% 0.77% 0.14%

过去六个月 1.96% 0.14% 2.20% 0.01% -0.24% 0.13%

自基金合同生效日起至 4.92% 0.12% 4.04% 0.01% 0.88% 0.11%

注:1.本基金合同于2012年2月22日正式生效,截至本报告期末不满一年。
2.所列基金业绩数据不包括对基金份额持有人申购和赎回交易的费用,例如,开放式基金的申购赎回费,货币市场基金的申购赎回费,基金转换费等。
3.本期已实现收益指基金本期利息收入,减去必要的费用,并扣除公允价值变动收益)相除相关费用后的余额。
4.本期可供分配利润指本报告期末至资产负债表上本期利润之和。
5.本期基金份额净值增长率=基金净值增长率-同期银行定期存款基准收益率的差额。

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

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 1.86% 0.15% 1.09% 0.01% 0.77% 0.14%

过去六个月 1.96% 0.14% 2.20% 0.01% -0.24% 0.13%

自基金合同生效日起至 4.92% 0.12% 4.04% 0.01% 0.88% 0.11%

注:1.本基金合同于2012年2月22日正式生效,截至本报告期末不满一年。
2.所列基金业绩数据不包括对基金份额持有人申购和赎回交易的费用,例如,开放式基金的申购赎回费,货币市场基金的申购赎回费,基金转换费等。
3.本期已实现收益指基金本期利息收入,减去必要的费用,并扣除公允价值变动收益)相除相关费用后的余额。
4.本期可供分配利润指本报告期末至资产负债表上本期利润之和。
5.本期基金份额净值增长率=基金净值增长率-同期银行定期存款基准收益率的差额。

3.2.6 本基金合同生效以来基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度 每10份基金份额 现金形式发放总额 再投资形式发放总额 年度利润分配总额 备注

2012 0.1000 585,280.23 - 585,280.23

合计 0.1000 585,280.23 - 585,280.23

3.3 管理人报告

4.1 基金管理人基本情况

4.1.1 基金管理人及其主要人员情况

基金管理人:泰信基金管理有限公司

法定代表人:陈雷

总经理:唐国培

副总经理:葛凡利

财务总监:葛凡利

督察长:葛凡利

基金经理:陈雷、唐国培、朱文明、陈雷、葛凡利、唐国培、朱文明

基金经理助理:陈雷、唐国培、朱文明、陈雷、葛凡利、唐国培、朱文明

基金经理:陈雷、唐国培、朱文明、陈雷、葛凡利、唐国培、朱文明

基金经理:陈雷、唐国培、朱