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
送出日期:2013年3月29日

泰信优质生活股票型证券投资基金

【2012 年度报告摘要】

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2012年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰信优质生活股票
基金主代码	290004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年12月15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
报告期末基金份额总额	1,626,107,911.01份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国经济可持续发展过程中那些最能够 满足人们优质生活需求的上市公司的长期稳定增长，在严格控制投资风险的基础上，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的大类资产配置、以核心-卫星策略为基础的优质生活行业配置和“自下而上”的证券精选相结合的投资 策略。
业绩比较基准	75%×富时中国A600 指数+25%×富时中国国债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	唐国培	唐州徽
	联系电话	021-20899032	010-66594855
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-5988	95566
传真		021-20899008	010-66594942

2.4信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-496,725,550.87	-448,985,167.18	341,881,160.06
本期利润	-47,989,231.62	-764,405,238.23	47,374,790.79
加权平均基金份额本期利润	-0.0257	-0.3850	0.0234
本期基金份额净值增长率	-3.30%	-34.09%	0.54%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.4761	-0.2659	0.0140
期末基金资产净值	1,154,390,476.30	1,550,674,961.61	2,344,088,115.35
期末基金份额净值	0.7099	0.7341	1.1138

注:1、本基金合同于2006年12月15日正式生效。

2.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。

3.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。

4.期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

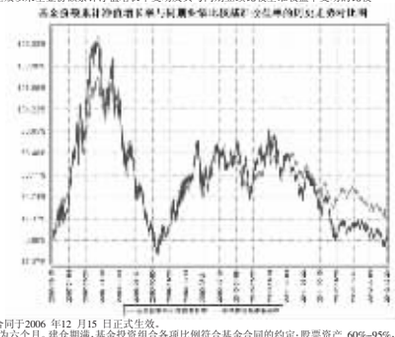
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.41%	1.04%	6.12%	0.97%	-2.71%	0.07%
过去六个月	-2.37%	1.17%	0.30%	0.95%	-2.67%	0.22%
过去一年	-3.30%	1.35%	4.99%	0.98%	-8.29%	0.37%
过去三年	-35.92%	1.57%	-20.93%	1.05%	-14.99%	0.52%
过去五年	-52.40%	1.83%	-38.16%	1.48%	-14.24%	0.35%
自基金合同生效日起至今	8.77%	1.92%	34.86%	1.52%	-26.09%	0.40%

注:本基金业绩比较基准为:75%×富时中国A600 指数+25%×富时中国国债指数

1.富时中国A600 指数是富时中国指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流通市值最大的 600 只股票并以流通股本加权的股票指数。

2.富时中国国债指数涵盖了在上海及深圳交易所交易的到期日至少在一年以上的纯定息债券,是目前中国证券市场中与本基金投资范围比较适配同时公信力较好的股票指数和债券指数。

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



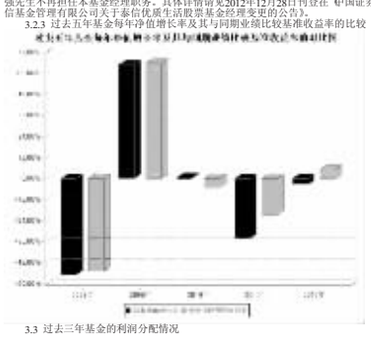
注:1.本基金基金合同于2006 年12 月15 日正式生效。

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;股票资产 60%-95%,,债券资产0%-35%,基金保留的现金以及投资于剩余期限在1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

3.经泰信基金管理有限公司董事会决议通过,决定新增戴宇虹女士担任泰信优质生活基金经理,与刘强先生共同管理本基金;朱志权先生不再担任泰信优质生活基金经理职务。具体详情见2012年3月1日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信优质生活股票基金经理变更的公告》。

4.经泰信基金管理有限公司董事会审议通过,由刘毅先生担任泰信优质生活股票基金经理职务,与戴宇虹女士共同管理该基金。刘强先生不再担任本基金经理职务。具体详情见2012年12月28日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信优质生活股票基金经理变更的公告》。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012	-	-	-	-	
2011	-	-	-	-	
2010	1.0000	77,613,101.08	135,078,401.82	212,691,502.90	
合计	1.0000	77,613,101.08	135,078,401.82	212,691,502.90	

注:2011年度、2012年度本基金未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人:泰信基金管理有限公司

注册地址:上海市浦东新区浦东南路256号37层

办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦36、37层

成立日期:2003 年 5 月 23日

法定代表人:孟凡利

总经理:戴新

电话:021-20899188

传真:021-20899008

联系人:王伟毅

发展沿革:

泰信基金管理有限公司 First-Trust Fund Management Co.,Ltd.)是山东省国际信托投资有限公司 现更名为山东省国际信托有限公司)联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司共同发起设立的基金管理公司,公司于2002 年9 月24 日经中国证券监督委员会批准正式筹建,2003 年5 月8 日获准开业,是以信托投资公司为主发起人而发起设立的基金管理公司。

公司目前下设市场部、营销部 分华东、华北、华南三大营销中心和电子商务部)、客服中心、基金投资部、研究部、专户投资部、理财顾问部、清算会计部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、计划财务部、综合管理部、北京分公司、深圳分公司。截至2012年12月底,公司有正式员工115人,多数具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

截至2012年12月,泰信基金管理有限公司旗下共有泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活股票、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、泰信发展主题股票、泰信货币周期回报、泰信中证200指数、泰信中小盘精选股票、泰信保本混合、泰信中证基本面400指数分级共13只开放式基金及泰信财富分级2号、泰信财富分级3号、泰信财富分级4号、泰信乐享分级1号、泰信信益高息债分级共5个资产管理计划。

4.1.2 基金经理 或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
刘毅 先生	研究部研究副总监兼首席策略分析师、本基金基金经理兼泰信发展主题股票基金、泰信中证200指数基金经理	2012年12月28日	-	9	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2010年12月15日至今担任泰信发展主题股票基金经理。自2012年12月28日兼任泰信中证200指数基金经理。同时担任研究部研究副总监兼首席策略分析师。
戴宇虹 女士	本基金基金经理	2012年3月1日	-	6	金融学硕士,具有基金从业资格。曾先后任职于国约投股有限公司、群益证券股份有限公司。2008年10月加入泰信基金管理有限公司,先后担任研究部高级研究员、泰信发展主题股票基金经理助理。
朱志权 先生	投资部投资总监、本基金基金经理兼信优势增长基金、泰信先行策略基金经理	2008年6月28日	2012年3月1日	17	经济学学士。具有基金从业资格。曾任职于中信证券上海总部、长盛基金管理有限公司、富国基金管理有限公司、中海信托管理有限公司、银河基金管理有限公司。2008年6月加入泰信基金管理有限公司,担任本基金基金经理。自2010年11月16日起担任泰信优势增长混合基金基金经理。自2012年3月1日起担任泰信先行策略基金经理,并于同日不再担任本基金经理职务。同时担任投资部投资总监。
刘强 先生	投资部投资副总监、本基金基金经理	2007年2月9日	2012年12月28日	10	工商管理硕士、上海复旦大学博士研究生在读。具有基金从业资格。2002年10月进入泰信基金管理有限公司,先后担任交易员、研究员、泰信先行策略基金经理助理,泰信优质生活基金经理助理,现担任投资部投资副总监。

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。

3.经泰信基金管理有限公司董事会审议通过,决定新增戴宇虹女士担任泰信优质生活基金经理,与刘强先生共同管理本基金,朱志权先生不再担任泰信优质生活基金经理职务。具体详情见2012年3月1日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信优质生活股票基金经理变更的公告》。

4.经泰信基金管理有限公司董事会审议通过,由刘毅先生担任泰信优质生活股票基金经理职务,与戴宇虹女士共同管理该基金。刘强先生不再担任本基金经理职务。具体详情见2012年12月28日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信优质生活股票基金经理变更的公告》。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司 以下称“本托管人”)在对泰信优质生活股票型证券投资基金 以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告 往;财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2013)第20053号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰信优质生活股票型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的《泰信优质生活股票型证券投资基金(以下简称“泰信优质生活基金”)的财务报表,包括2012年12月31日的资产负债表,2012年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是泰信优质生活基金的基金管理人泰信基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,上述泰信优质生活基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了泰信优质生活基金2012年12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	单峰 张晓艺
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6楼
审计报告日期	2013年3月26日

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:泰信优质生活股票型证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产:		
银行存款	94,936,655.53	82,504,475.53
结算备付金	2,468,663.61	2,298,578.00
存出保证金	3,500,000.00	3,241,895.33
交易性金融资产	1,040,568,446.77	1,460,617,393.54
其中:股票投资	1,040,568,446.77	1,460,617,393.54
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	24,704,912.68	-
应收利息	26,786.57	19,667.50
应收股利	-	-
应收申购款	40,789.67	15,597,618.89
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,166,246,254.83	1,564,279,628.79
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	3,628,235.07	6,759,018.40
应付赎回款	488,718.70	80,839.20
应付管理人报酬	1,364,811.51	2,048,388.74
应付托管费	227,468.60	341,398.13
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,137,446.80	870,509.80
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	4,009,097.85	3,504,512.91
负债合计	11,855,778.53	13,604,667.18
所有者权益:		
实收基金	1,626,107,911.01	2,112,350,155.25
未分配利润	-471,717,434.71	-561,675,193.64
所有者权益合计	1,154,390,476.30	1,550,674,961.61
负债和所有者权益总计	1,166,246,254.83	1,564,279,628.79

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.7099元,基金份额总额1,626,107,911.01份。

7.2 利润表

会计主体:泰信优质生活股票型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	-13,795,238.42	-721,005,996.90
1.利息收入	1,609,484.74	804,398.04
其中:存款利息收入	1,008,595.80	804,398.04
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	600,888.94	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-464,455,240.19	-406,757,349.59
其中:股票投资收益	-472,903,853.54	-417,537,493.68
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	8,448,613.35	10,780,144.09
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	448,736,319.25	-315,420,071.05
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	314,197.78	367,025.70
减:二、费用	34,193,993.20	43,399,241.33
1.管理人报酬	19,863,805.02	28,201,129.57
2.托管费	3,310,634.18	4,700,188.29
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	10,590,949.80	10,067,525.34
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	428,604.20	430,398.15
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-47,989,231.62	-764,405,238.23
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-47,989,231.62	-764,405,238.23

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰信优质生活股票型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,112,350,155.25	-561,675,193.64	1,550,674,961.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-47,989,231.62	-47,989,231.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-486,242,244.24	137,946,990.55	-348,295,253.69
其中:1.基金申购款	54,921,257.47	-16,037,986.27	38,883,271.20
2.基金赎回款	-541,163,501.71	153,984,976.82	-387,178,524.89
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,626,107,911.01	-471,717,434.71	1,154,390,476.30

项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,104,558,848.15	239,529,267.20	2,344,088,115.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-764,405,238.23	-764,405,238.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	7,791,307.10	-36,799,222.61	-29,007,915.51
其中:1.基金申购款	466,547,695.37	-37,260,386.92	429,287,308.45
2.基金赎回款	-458,756,388.27	461,164.31	-458,295,223.96
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,112,350,155.25	-561,675,193.64	1,550,674,961.61

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

韩焱 韩焱 废少华

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰信优质生活股票型证券投资基金 以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会 以下简称“中国证监会”)证监基金字 [2006]第229号 关于同意泰信优质生活股票型证券投资基金设立的批复核准,由泰信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,591,255,543.43元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第191号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》于2006年12月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,591,662,103.09份基金份额,其中认购资金利息折合406,559.66份基金份额。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的各类股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金组合投资的范围为:股票资产60%-95%,债券资产0%-35%,基金保留的现金以及投资于剩余期限在1年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:75%×富时中国A600指数+25%×富时中国国债指数 标新华富时国债指数)。

本财务报表由本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司于2013年3月26日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定 以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和半年度报告》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2012年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2012年12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号 关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2005]102号 关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号 关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号 关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税。

4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
山东省国际信托有限公司(“山东国投”)	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信实业有限公司(“青岛国信”)	基金管理人的股东

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本期末及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本期及上年度可比期间本基金无应支付关联方佣金余额。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	19,863,805.02	28,201,129.57
其中:支付销售机构的客户维护费	1,627,405.97	2,894,625.88

注:支付基金管理人泰信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,310,634.18	4,700,188.29

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25%/当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

本报告期本基金未发生销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期及上年度可比期间本基金未发生与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)的交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期末及上年度可比期间本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	94,936,655.53	939,673.60	82,504,475.53	751,023.13

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行间市场利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期末及上年度可比期间本基金未在承销期内持有关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.10.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002298	鑫龙电器	2012年7月18日	2013年7月19日	非公开发行	6.72	7.53	3,770,000	25,334,400.00	28,388,100.00	-
000826	桑德环境	2012年12月31日	2013年1月9日	定向增发	12.71	22.99	141,000	1,792,110.00	3,241,590.00	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	27,126,510.00	31,629,690.00	-

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会 证券公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科A	2012年12月26日	B股转H股	10.12	2013年1月21日	11.13	3,500,000	31,261,059.96	35,420,000.00	-

注:本基金截至2012年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1)公允价值

a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

b)以公允价值计量的金融工具

i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上 未经调整)的报价。

第二层级:直接 包括取自价格)或间接 包括根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值 不可观察输入值)。

ii)各层次金融工具公允价值

2012年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为973,518,756.77元,属于第二层级的余额为67,049,690.00元,无属于第三层级的余额 2011年12月31日:第一层级1,460,617,393.54元,无属于第二层级和第三层级的余额)。

iii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃 包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据信息调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

iv)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,040,568,446.77	89.22
	其中:股票	1,040,568,446.77	89.22
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	97,405,319.14	8.35
6	其他各项资产	28,272,488.92	2.42
7	合计	1,166,246,254.83	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	11,200,000.00	0.97
B	采掘业	6,805,366.31	0.59
C	制造业	497,462,777.44	43.09
C0	食品、饮料	102,944,629.00	8.92
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	53,275,172.16	4.62
C5	电子