

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

基金合同生效日:2013年3月29日

基金类型:股票型

基金简称:泰信基本面400指数分级

基金主代码:162907

基金运作方式:上市契约型开放式(LOF)

基金合同生效日:2012年9月7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

报告期末基金份额总额:6,775,016.14份

基金合同存续期:不定期

基金份额上市的证券交易所:深圳证券交易所

上市日期:2012-09-21

基金简称:泰信基本面400

基金交易代码:150094

报告期末基金份额总额:6,124,685.00份

基金产品说明:泰信基本面400指数分级

投资目标:本基金采用量化投资策略,通过本基金的投资纪律和数量化的风险管理手段,追求对中证锐联基本面400指数的有效跟踪。

投资策略:本基金将完全复制法,即在中证锐联基本面400指数中的成份股的构成及其权重根据股票投资比例,即和跟踪中证锐联基本面400指数的收益表现,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:95%*中证锐联基本面400指数收益率+5%*商业银行人民币活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。

本基金的风险收益特征:低风险、收益相对稳定、高风险、高预期收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目: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

名称:泰信基金管理有限公司

姓名:唐国培

信息披露负责人:董事会秘书

联系电话:021-20890932

电子邮箱:xsp@tfund.com

客户服务电话:400-888-5988

传真:021-20890908

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.tifund.com>

基金年度报告备置地点:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6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9月7日(基金合同生效日)-2012年12月31日

本期已实现收益:470,859.76

本期利润:5,948,049.00

平均基金份额本期利润:0.0493

本期基金份额净值增长:8.40%

3.1.2 期末数据和指标:2012年末

期末可供分配基金份额利润:0.0044

期末基金份额净值:74,522,704.48

3.1.3 期末基金净值:1.084

注:1.本基金业绩比较基准为:95%*中证锐联基本面400指数收益率+5%*商业银行人民币活期存款利率(税后)。

2.本基金在基金合同期间内,基金合同投资组合比例符合基金合同的约定。本基金投资于中证锐联基本面400指数成份股及备选成份股的资产不低于基金净资产的90%;同时本基金在1年以内的基金净资产不高于基金资产净值的5%。

3.2.1 基金合同生效以来基金净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金业绩比较基准为:95%*中证锐联基本面400指数收益率+5%*商业银行人民币活期存款利率(税后)。

2.本基金在基金合同期间内,基金合同投资组合比例符合基金合同的约定。本基金投资于中证锐联基本面400指数成份股及备选成份股的资产不低于基金净资产的90%;同时本基金在1年以内的基金净资产不高于基金资产净值的5%。

3.3.2 基金合同生效以来基金净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同于2012年9月7日正式生效。截至报告期末不足半年,还在建仓期。

2.本基金在基金合同期间内,基金合同投资组合比例符合基金合同的约定。本基金投资于中证锐联基本面400指数成份股及备选成份股的资产不低于基金净资产的90%;同时本基金在1年以内的基金净资产不高于基金资产净值的5%。

3.2.3 基金合同生效以来基金净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同于2012年9月7日正式生效。截至报告期末不足半年,还在建仓期。

2.本基金在基金合同期间内,基金合同投资组合比例符合基金合同的约定。本基金投资于中证锐联基本面400指数成份股及备选成份股的资产不低于基金净资产的90%;同时本基金在1年以内的基金净资产不高于基金资产净值的5%。

3.3.3 基金合同生效以来基金净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同于2012年9月7日正式生效。截至报告期末不足半年,还在建仓期。

2.本基金在基金合同期间内,基金合同投资组合比例符合基金合同的约定。本基金投资于中证锐联基本面400指数成份股及备选成份股的资产不低于基金净资产的90%;同时本基金在1年以内的基金净资产不高于基金资产净值的5%。

3.4.1 基金管理人及基金经理情况

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

基金名称:泰信基本面400

基金类型:股票型

基金简称:泰信基本面400

基金交易代码:150094

基金产品说明:泰信基本面400指数分级

投资目标:本基金采用量化投资策略,通过本基金的投资纪律和数量化的风险管理手段,追求对中证锐联基本面400指数的有效跟踪。

投资策略:本基金将完全复制法,即在中证锐联基本面400指数中的成份股的构成及其权重根据股票投资比例,即和跟踪中证锐联基本面400指数的收益表现,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:95%*中证锐联基本面400指数收益率+5%*商业银行人民币活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。

本基金的风险收益特征:低风险、收益相对稳定、高风险、高预期收益。

2.4.1 基金管理人

基金名称:泰信基本面400

基金类型:股票型

基金简称:泰信基本面400

基金交易代码:150094

基金产品说明:泰信基本面400指数分级

投资目标:本基金采用量化投资策略,通过本基金的投资纪律和数量化的风险管理手段,追求对中证锐联基本面400指数的有效跟踪。

投资策略:本基金将完全复制法,即在中证锐联基本面400指数中的成份股的构成及其权重根据股票投资比例,即和跟踪中证锐联基本面400指数的收益表现,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:95%*中证锐联基本面400指数收益率+5%*商业银行人民币活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。

本基金的风险收益特征:低风险、收益相对稳定、高风险、高预期收益。

2.4.2 基金管理人

基金名称:泰信基本面400

基金类型:股票型

基金简称:泰信基本面400

基金交易代码:150094

基金产品说明:泰信基本面400指数分级

投资目标:本基金采用量化投资策略,通过本基金的投资纪律和数量化的风险管理手段,追求对中证锐联基本面400指数的有效跟踪。

投资策略:本基金将完全复制法,即在中证锐联基本面400指数中的成份股的构成及其权重根据股票投资比例,即和跟踪中证锐联基本面400指数的收益表现,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:95%*中证锐联基本面400指数收益率+5%*商业银行人民币活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。

本基金的风险收益特征:低风险、收益相对稳定、高风险、高预期收益。

2.4.3 基金管理人

基金名称:泰信基本面400

基金类型:股票型

基金简称:泰信基本面400

基金交易代码:150094

基金产品说明:泰信基本面400指数分级

投资目标:本基金采用量化投资策略,通过本基金的投资纪律和数量化的风险管理手段,追求对中证锐联基本面400指数的有效跟踪。

投资策略:本基金将完全复制法,即在中证锐联基本面400指数中的成份股的构成及其权重根据股票投资比例,即和跟踪中证锐联基本面400指数的收益表现,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:95%*中证锐联基本面400指数收益率+5%*商业银行人民币活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。

本基金的风险收益特征:低风险、收益相对稳定、高风险、高预期收益。

2.4.4 基金管理人

基金名称:泰信基本面400

基金类型:股票型

基金简称:泰信基本面400

基金交易代码:150094

基金产品说明:泰信基本面400指数分级

投资目标:本基金采用量化投资策略,通过本基金的投资纪律和数量化的风险管理手段,追求对中证锐联基本面400指数的有效跟踪。

投资策略:本基金将完全复制法,即在中证锐联基本面400指数中的成份股的构成及其权重根据股票投资比例,即和跟踪中证锐联基本面400指数的收益表现,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:95%*中证锐联基本面400指数收益率+5%*商业银行人民币活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。

本基金的风险收益特征:低风险、收益相对稳定、高风险、高预期收益。

2.4.5 基金管理人

基金名称:泰信基本面400

基金类型:股票型

基金简称:泰信基本面400

基金交易代码:150094

基金产品说明:泰信基本面400指数分级

投资目标:本基金采用量化投资策略,通过本基金的投资纪律和数量化的风险管理手段,追求对中证锐联基本面400指数的有效跟踪。

投资策略:本基金将完全复制法,即在中证锐联基本面400指数中的成份股的构成及其权重根据股票投资比例,即和跟踪中证锐联基本面400指数的收益表现,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:95%*中证锐联基本面400指数收益率+5%*商业银行人民币活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。

本基金的风险收益特征:低风险、收益相对稳定、高风险、高预期收益。

2.4.6 基金管理人

基金名称:泰信基本面400

基金类型:股票型

基金简称:泰信基本面400

基金交易代码:150094

基金产品说明:泰信基本面400指数分级

投资目标:本基金采用量化投资策略,通过本基金的投资纪律和数量化的风险管理手段,追求对中证锐联基本面400指数的有效跟踪。

投资策略:本基金将完全复制法,即在中证锐联基本面400指数中的成份股的构成及其权重根据股票投资比例,即和跟踪中证锐联基本面400指数的收益表现,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:95%*中证锐联基本面400指数收益率+5%*商业银行人民币活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。

本基金的风险收益特征:低风险、收益相对稳定、高风险、高预期收益。

2.4.7 基金管理人

基金名称:泰信基本面400

基金类型:股票型

基金简称:泰信基本面400

基金交易代码:150094

基金产品说明:泰信基本面400指数分级

投资目标:本基金采用量化投资策略,通过本基金的投资纪律和数量化的风险管理手段,追求对中证锐联基本面400指数的有效跟踪。

投资策略:本基金将完全复制法,即在中证锐联基本面400指数中的成份股的构成及其权重根据股票投资比例,即和跟踪中证锐联基本面400指数的收益表现,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:95%*中证锐联基本面400指数收益率+5%*商业银行人民币活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。

本基金的风险收益特征:低风险、收益相对稳定、高风险、高预期收益。

2.4.8 基金管理人

基金名称:泰信基本面400

基金类型:股票型

基金简称:泰信基本面400

基金交易代码:150094

基金产品说明:泰信基本面400指数分级

投资目标:本基金采用量化投资策略,通过本基金的投资纪律和数量化的风险管理手段,追求对中证锐联基本面400指数的有效跟踪。

投资策略:本基金将完全复制法,即在