

泰信中小盘精选股票型证券投资基金

[2014] 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

报告期起止日:2014年4月1日至2014年6月30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本基金合同于2014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,没有发现虚假记载、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。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期财务资料于2014年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:泰信中小盘精选股票

交易代码:290011

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2011年10月26日

报告期末基金的份额:137,568,403.01份

投资目标:本基金通过投资具有高成长潜力的中小盘股票,追求基金资产的长期资本增值。在严格的风险控制下,力争获取超越业绩基准的稳健收益。

投资策略:本基金将重点投资于具有高成长潜力的中小盘股票,追求基金资产的长期资本增值。在严格的风险控制下,力争获取超越业绩基准的稳健收益。

业绩比较基准:中证100指数收益率×80%+中证债券收益率×20%

风险收益特征:本基金主要通过投资具有高成长潜力的中小盘股票实现基金资产增值,属高风险、高收益的股票型基金。

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

§ 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(2014年4月1日-2014年6月30日)

1.本期已实现收益 4,805,421.93

2.本期利润 11,541,405.36

3.加权平均基金份额本期利润 0.0830

4.期末基金资产净值 167,834,409.51

5.期末基金份额净值 1.20

注:1. 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、红利再投费、转换费等),只计算用于实际收益水平低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金利息收入、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,本期利润为期末收益加上本期公允价值变动收益。

3.基金净值增长率=基金份额净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较

3.21 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 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 7.49% 1.93% 0.78% 5.56% 0.27%

注:本基金业绩比较基准为:中证100指数收益率×80%+中证债券收益率×20%。

3.22 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

3.23 基金净值表现

3.24 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 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 7.49% 1.93% 0.78% 5.56% 0.27%

注:1. 本基金合同于2011年10月26日正式生效。

2. 本基金的建仓期为六个月。建仓期间,本基金将基金资产的60%~95%投资于股票,现金或到期日在1年以内且以货币形式存在的金融工具的比例不高于基金资产净值的5%,债券、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规和监管机构的规定执行。本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任期从 说明

柳青女士 研究部总监兼基金经理 2011年10月26日 - 20年

注:1. 以上日期为柳青女士向公司公告的日期;

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》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,本着勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.1 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循《证券从业人员资格管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,本着勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.2 管理人对报告期内基金投资运作遵规守信、廉洁从业情况的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.3 管理人对报告期内基金估值政策和会计政策的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.4 管理人对报告期内基金投资组合的比例的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.5 管理人对报告期内基金利润分配政策的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.6 管理人对报告期内基金信息披露事务管理的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.7 管理人对报告期内基金偏离日常估值的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.8 管理人对报告期内基金持有人数及持有人结构的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.9 管理人对报告期内基金持有人交易行为的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.10 管理人对报告期内基金投资组合的重大变动的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.11 管理人对报告期内基金投资策略的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.12 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.13 管理人对基金持有人数及持有人结构的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.14 管理人对报告期内基金估值政策的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.15 管理人对报告期内基金投资组合的重大变动的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.16 管理人对报告期内基金投资策略的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.17 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.18 管理人对报告期内基金估值政策的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.19 管理人对报告期内基金投资组合的重大变动的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.20 管理人对报告期内基金投资策略的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.21 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.22 管理人对报告期内基金估值政策的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.23 管理人对报告期内基金投资组合的重大变动的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.24 管理人对报告期内基金投资策略的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.25 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.26 管理人对报告期内基金估值政策的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.27 管理人对报告期内基金投资组合的重大变动的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.28 管理人对报告期内基金投资策略的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.29 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.30 管理人对报告期内基金估值政策的说明

本基金在报告期内不存在违反《证券投资基金法》、《证券从业人员资格管理办法》、《泰信中小盘精选股票型证券投资基金合同》和其相关法律法规的规定,勤勉尽责、诚信守信、取信于市场的原则,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人严格遵循基金合同的规定执行,本基金投资于中小盘股票的比例不高于股票投资资产的80%。

3.4.31 管理人对报告期内基金投资组合的重大变动的说明