# 泰信中小盘精选股票型证券投资基金

## 【2014】半年度报告摘要

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:2014年8月26日

### §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。本半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2014年8月22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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

### §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 泰信中小盘精选股票 |
| 基金主代码 | 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 |
| 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 | 137,568,440.51份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 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稳定增值。在严控风险的前提下，力争获取超越业绩基准的稳健收益。 |
| 投资策略 | 本基金将结合“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”的个股精选策略，重点投资于萌芽期和成长期行业中具有持续成长潜力以及未来成长空间广阔的中小型上市公司，同时考虑组合品种的估值风险和大类资产的系统风险，通过品种和仓位的动态调整降低资产的波动风险。 |
| 业绩比较基准 | 本基金业绩比较基准为:中证700指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。 |
| 风险收益特征 | 本基金主要通过发掘具有高成长潜力的中小盘股票实现基金资产增值，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，理论上预期风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 |

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 | 胡图 | 王永民 |
| | 联系电话 | 021-20899098 | 010-66594896 |
| | 电子邮箱 | xxpl@ftfund.com | fcsd@bankofchina.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

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.ftfund.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 上海市浦东新区浦东南路256号 华夏银行大厦36-37层 |

### §3主要财务指标和基金净值表现

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 | 报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 5,008,156.89 |
| 本期利润 | 12,743,217.49 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0949 |
| 本期基金份额净值增长率 | 8.25% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2014年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2200 |
| 期末基金资产净值 | 167,834,409.51 |
| 期末基金份额净值 | 1.220 |

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、红利再投资、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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、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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 4.36% | 1.00% | 1.79% | 0.73% | 2.57% | 0.27% |
| 过去三个月 | 7.49% | 1.05% | 1.93% | 0.78% | 5.56% | 0.27% |
| 过去六个月 | 8.25% | 1.35% | -0.33% | 0.95% | 8.58% | 0.40% |
| 过去一年 | 23.20% | 1.39% | 10.52% | 1.02% | 12.68% | 0.37% |
| 自基金合同生效日起至今 | 28.09% | 1.22% | -2.45% | 1.13% | 30.54% | 0.09% |

注:本基金业绩比较基准为:中证700指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

1、中证700指数是中证指数有限公司以沪深300指数为基础编制的系列规模指数之一，其成分股由代表中盘特征的中证200指数的成分股和代表小盘特征的中证500指数的成分股共同构成，中证700指数编制合理、透明，运用广泛，能够综合反映沪深证券市场内中小市值公司的整体状况，对中国A股中小盘市场具有较强的代表性和权威性。

2、中证全债指数以银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券为样本，是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，具有良好的债券市场代表性，运用较为广泛。

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。建仓期满,本基金将基金资产的60%-95%投资于股票,现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的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低于股票投资资产的80%。

### §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:葛航

电话:021-20899188

传真:021-20899008

联系人:庄严

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。

公司目前下设锐懿资产管理有限公司、市场部、营销部(分华东、华北、华南三大营销中心)、理财顾问部、深圳分公司、北京分公司、电子商务部、客服中心、基金投资部、研究部、专户投资部、清算会计部、集中交易部、计划财务部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部。截至2014年6月,公司有正式员工103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2014年6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、泰信债券周期回报、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、泰信深证服务业股票基金、泰信鑫益定期开放债券共15只开放式基金及泰信恒益高息债分级、泰信乐利分级1号、泰信乐利2号、泰信乐利3号、泰信量化对冲分级1号、泰信财富分级6号、泰信财富分级7号共7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 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 柳菁女士 | 研究部总监兼研究总监、本基金经理兼泰信监筹精选基金经理 | 2011年10月26日 | - | 20年 | 工商管理硕士。具有基金从业资格。曾任天同证券有限责任公司资产管理部交易员、研究员、投资经理。2005年加入泰信基金管理有限公司,先后任交易员、研究部高级研究员、泰信先行策略基金基金经理助理。自2009年4月22日起担任泰信监筹精选基金经理。现同时担任研究部总监兼研究总监。 |
| 张彦先生 | 本基金经理助理兼泰信优势增长基金经理助理 | 2011年10月26日 | 2014年5月9日 | 9年 | 经济学硕士。具备基金从业资格。曾任职于国金证券研究所、上海从容投资管理有限公司、万家基金管理有限公司。2011年6月加入泰信基金管理有限公司,担任高级研究员。自2012年4月6日起担任泰信优势增长基金经理助理职务。 |

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。

4.2 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《证券投资基金法》、《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基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为,本基金的投资运作符合有关法律法规和基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司公平交易制度适用于所有投资品种,以及所有投资管理活动,涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动各环节,从研究、投资、交易合规性监控,发现可疑交易立即报告,并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放,投资经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令,所有投资指令在集中交易室集中执行,投资交易过程公平公正,投资交易监控贯于整个投资过程。

本报告期内,投资交易监控与价差分析未发现基金之间存在利益输送行为,公平交易制度整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内,本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易,未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况,亦无其他异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年市场风格出现了一定转换,创业板市场出现大幅震荡,主板市场开始活跃,同时,部分处于相对低位的小市值公司也表现出色。以新能源汽车产业链、医疗服务为代表的新兴产业以及国企改革等板块表现较好。

报告期内,本基金在一、二月份对仓位配置进行了较大幅度的调整,增加了新能源汽车产业链、医疗服务、国企改革以及可穿戴设备板块个股的配置,我们在上半年维持市场处于震荡市的判断,对持有的板块和个股进行了适度的波段操作,及时兑现了部分利润。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金单位净值为1.220元,净值增长率为8.25%,同期比较基准增长率为-0.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从今年以来公布的各项经济数据来看,我国宏观经济复苏依然不能过度乐观,未来几个月经济继续在底部的可能性较大。

在央行的最新货币政策执行过程中,我们已经看到政策微调的迹象,特别是针对中小企业的扶持力度明显加大。在保增长和促转型双重压力之下,政府虽然有动力的加大投资力度,保持经济增速,但更多的是通过结构性的投资,防止经济失速,为实现产业转型提供良好的经济环境,在此期间,受到政策扶持的行业和新兴产业将呈现结构性机会。

综合以上判断,我们认为短期市场仍将以区间震荡为主,但由于政策预期的变化,对市场的态度谨慎乐观,结构性机会将持续出现。

配置方面,我们具体看好以下几个板块:

1、新能源汽车产业链将给汽车行业带来颠覆性的技术革命。新能源汽车是引领未来科技趋势,同时产业链还涉及上游有色和矿业、中游化工、汽车制造业、电子产业和下游消费业的巨大链条,在经济增长和转型大业中承担了巨大的作用,行业已经得到了越来越多的政策支持;

2、以机器人和3D打印为代表的生产智能化,以移动互联和可穿戴设备为代表的生活智能化革命也已经开始。科技的进步不断改变人类的生活方式,除了智能手机的更新换代之外,以可穿戴设备、智能家居、机器人为代表的智能产品正在进入人们的生活,这些产品的渗透率空间巨大。

3、以医疗改革为契机的医疗服务和以基因细胞治疗为代表的医药产业变革,也会给传统的医药行业选股带来颠覆性变化。首先,医疗服务是现代服务业的重要组成部分,具有足够大的发展空间,越来越受到政府的支持,也为行业的发展提供了保障,此外,新兴的医疗方法比如基因、细胞治疗领域随着技术的进步也越来越受到关注,部分领域已处于爆发前夜;我们同时还看好国企改革、能源改革、军队改革以及金融改革带来的投资机会。

投资策略上,我们将继续运用“反预期管理”的投资策略,关注重点从不断创新高的市场热点转换到被市场忽略的价值投资板块。我们还将坚持行业轮动的思路操作,针对今年的市场变化,及时对部分获利品种兑现利润。

操作方面,本基金主要是把自上而下做好行业轮动和自下而上选择好个股相结合。

在个股的选择方面,我们将综合利用公司的股票价值评估系统和尽职调研评估系统,结合定量分析和定性分析,精选出技术、管理、资源和政策四个方面具有优势,成长具有持续性的公司进行投资。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、泰信基金管理有限公司估值程序等事项的说明

委员会主席

韩波先生,本科学历。曾任职于山东省国际信托投资公司计财部、山东省国际信托投资公司上海证券部、鲁信香港投资有限公司。2002年加入泰信基金管理公司,现任公司副总经理。

委员会成员:

唐国琼先生,硕士。2002年加入泰信基金管理有限公司,现任公司风险管理部总监。

蔡海成先生,硕士。2013年加入泰信基金管理有限公司,现任公司清算会计部总监。

朱志权先生,学士。2008年6月加入泰信基金管理有限公司,现任基金投资部总监兼投资总监,泰信先行策略、泰信优势增长基金基金经理。

梁剑先生,硕士。2004年7月加入泰信基金管理有限公司,曾任泰信先行策略混合基金经理。现任研究部副总监兼研究副总监。

2、本基金基金经理不参与本基金估值。

3、参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、基金合同关于利润分配的约定:

1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式,基金份额持有人可自行选择收益分配方式;基金份额持有人事先未做出选择的,默认的分红方式为现金红利;选择红利再投资的,现金红利则按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同,基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准;

2、每一基金份额享有同等分配权;

3、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值,基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日;

4、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,全年分配比例不得低于年度可供分配收益的10%,若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;

5、基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过15个工作日;

6、投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位,小数点后第3位四舍五入,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产;

7、法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

二、本报告期,本基金未进行利润分配。

### §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”)在对泰信中小盘精选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 托管人对本半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(注: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半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:泰信中小盘精选股票型证券投资基金
报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期末 2014年6月30日 | 上年度末 2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产: | | |
| 银行存款 | 5,829,334.73 | 7,597,130.42 |
| 结算备付金 | 3,705,710.03 | 268,026.37 |
| 存出保证金 | 92,710.52 | 102,792.25 |
| 交易性金融资产 | 136,650,290.89 | 126,902,111.31 |
| 其中:股票投资 | 136,650,290.89 | 126,902,111.31 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | - | - |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 23,000,000.00 | 3,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | 5,926,937.55 | 395,430.45 |
| 应收利息 | 2,662.84 | 2,266.12 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 175,207,646.56 | 138,267,756.92 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2014年6月30日 | 上年度末 2013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 | 5,707,188.95 | - |
| 应付赎回款 | 218,449.09 | 22,968.34 |
| 应付管理人报酬 | 200,776.14 | 179,733.88 |
| 应付托管费 | 33,462.69 | 29,955.62 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 1,020,286.39 | 838,438.73 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 193,073.79 | 384,586.56 |
| 负债合计 | 7,373,237.05 | 1,455,683.13 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 137,568,440.51 | 121,362,484.20 |
| 未分配利润 | 30,265,969.00 | 15,449,589.59 |
| 所有者权益合计 | 167,834,409.51 | 136,812,073.79 |
| 负债和所有者权益总计 | 175,207,646.56 | 138,267,756.92 |

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.220元,基金份额总额137,568,440.51份。

6.2 利润表

会计主体:泰信中小盘精选股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 15,286,997.10 | -3,410,553.11 |
| 1.利息收入 | 294,225.12 | 147,144.10 |
| 其中:存款利息收入 | 48,482.71 | 40,844.76 |
| 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 | 245,742.41 | 106,299.34 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | 7,250,439.18 | 7,202,249.71 |
| 其中:股票投资收益 | 6,927,282.23 | 6,846,155.78 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 323,156.95 | 356,093.93 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 7,735,060.60 | -10,780,608.19 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | 7,272.20 | 20,661.27 |
| 减:二、费用 | 2,543,779.61 | 2,309,217.50 |
| 1.管理人报酬 | 1,158,222.10 | 801,114.52 |
| 2.托管费 | 193,037.06 | 133,519.11 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 988,398.85 | 1,189,253.68 |
| 5.利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6.其他费用 | 204,121.60 | 185,330.19 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | 12,743,217.49 | -5,719,770.61 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | 12,743,217.49 | -5,719,770.61 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰信中小盘精选股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日 至 2014年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 | | |
|---|---|---|---|
| | 2014年1月1日至2014年6月30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) | 121,362,484.20 | 15,449,589.59 | 136,812,073.79 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 12,743,217.49 | 12,743,217.49 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | 16,205,956.31 | 2,073,161.92 | 18,279,118.23 |
| (净值减少以“-”号填列) | | | |
| 其中:1.基金申购款 | 22,113,160.72 | 3,118,100.65 | 25,231,261.37 |
| 2.基金赎回款 | -5,907,204.41 | -1,044,938.73 | -6,952,143.14 |
| 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) | 137,568,440.51 | 30,265,969.00 | 167,834,409.51 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | |
| | 2013年1月1日至2013年6月30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) | 73,273,592.89 | 4,785,070.60 | 78,058,663.49 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | -5,719,770.61 | -5,719,770.61 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | 38,242,126.57 | 3,768,787.88 | 42,010,914.45 |
| (净值减少以“-”号填列) | | | |
| 其中:1.基金申购款 | 58,709,857.76 | 5,984,890.50 | 64,694,748.26 |
| 2.基金赎回款 | -20,467,731.19 | -2,216,102.62 | -22,683,833.81 |
| 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) | 111,515,719.46 | 2,834,087.87 | 114,349,807.33 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

葛航 韩波 蔡海成
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰信中小盘精选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”)证监许可[2011]第1138号《关于核准泰信中小盘精选股票型证券投资基金募集的批复》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《泰信中小盘精选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。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262,307,424.58元,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(2011)第408号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰信中小盘精选股票型证券投资基金基金合同》于2011年10月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为262,332,100.87份基金份额。其中认购资金利息折合24,676.29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《泰信中小盘精选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(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金将基金资产的60%-95%投资于股票,现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的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低于股票投资资产的80%。

6.4.2 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”),中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《 泰信中小盘精选股票型证券投资基金 基金合同》和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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年半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2014年6月30日的财务状况以及2014年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。基金买卖股票的差价收入不予征收营业税。

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

(3)自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金新增上海锐懿资产管理有限公司为关联方。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 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、基金销售机构、注册登记机构 |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 山东省国际信托有限公司(“山东国托”) | 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 | 基金管理人的股东 |
| 上海锐懿资产管理有限公司 | 基金管理人的子公司 |

注:下还关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

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。

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。

应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间本基金无应支付关联方佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,158,222.10 | 801,114.52 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | - | - |

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 193,037.06 | 133,519.11 |

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。

6.4.8.2.3 销售服务费

本报告期及上年度可比期间本基金未发生销售服务费用。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期末及上年度可比期间本基金与关联方未发生银行间同业市场债券(含回购)的交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

份额单位:份

| 关联方名称 | 本期末 2014年6月30日 | | 上年度末 2013年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 山东省国际信托有限公司 | 94,843,090.56 | 68.9400% | 94,843,090.56 | 78.1500% |

6.4.8.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日 | | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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 | 5,829,334.73 | 35,049.74 | 5,785,015.88 | 28,040.62 |

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 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在承销期内未参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

报告期末本基金未持有因认购新发/增发而持有的流通受限证券。

6.4.9.2 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 600346 | 大橡塑 | 2014年4月14日 | 重大事项公告 | 7.73 | 2014年7月25日 | 8.50 | 374,550 | 2,861,237.30 | 2,895,271.50 | - |
| 300137 | 先河环保 | 2014年6月16日 | 重大事项公告 | 20.86 | 2014年8月15日 | - | 135,000 | 2,762,656.66 | 2,816,100.00 | - |
| 002635 | 安洁科技 | 2014年6月30日 | 重大事项公告 | 31.99 | 2014年8月5日 | 35.19 | 67,973 | 2,479,702.63 | 2,174,456.27 | - |
| 600418 | 江淮汽车 | 2014年4月14日 | 重大事项公告 | 10.20 | 2014年7月11日 | 11.22 | 200,000 | 1,820,109.75 | 2,040,000.00 | - |
| 300088 | 长信科技 | 2014年3月13日 | 重大事项公告 | 19.49 | 2014年7月1日 | 18.00 | 90,500 | 1,976,955.50 | 1,763,845.00 | - |
| 300199 | 翰宇药业 | 2014年2月20日 | 重大事项公告 | 26.63 | - | - | 23,000 | 561,254.92 | 612,490.00 | - |

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无其他需要说明有助于理解和分析会计报表事项。

### §7 投资组合报告

7.1 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 | 136,650,290.89 | 77.99 |
| | 其中:股票 | 136,650,290.89 | 77.99 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 23,000,000.00 | 13.13 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 9,535,044.76 | 5.44 |
| 7 | 其他各项资产 | 6,022,310.91 | 3.44 |
| 8 | 合计 | 175,207,646.56 | 100.00 |

7.2 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 | 5,364,038.00 | 3.20 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 106,094,174.89 | 63.21 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 123,000.00 | 0.07 |
| F | 批发和零售业 | 9,122,360.00 | 5.44 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 13,798,291.00 | 8.22 |
| J | 金融业 | 2,148,427.00 | 1.28 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - |