

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  
报告送出日期:2013年1月22日

§1 重要提示

本基金经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。  
本基金的托管人中信银行股份有限公司已于2013年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。  
本报告期内为2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信混合
交易代码	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
报告期末基金份额总额	57,760,911.49份
投资目标	本基金通过运用优化的恒定比例组合保险方法(CPPI),在保证保本到期本金安全的基础上,寻求资产的稳定增值。
投资策略	本基金以优化的恒定比例组合保险方法(CPPI)为理论基础实现保本和增值,在保本周期中,通过严格的投资纪律约束和风险管理,对基金的资产配置进行优化动态调整,确保投资者的投资本金的安全性。同时,通过积极稳健的收益资产投资策略,谋求基金资产的增值。
业绩比较基准	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。
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
基金保证人	山东省鲁信投资控股集团有限公司

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	914,007.57
2.本期利润	1,120,399.35
3.加权平均基金份额本期利润	0.0182
4.期末基金资产净值	60,008,850.91
5.期末基金份额净值	1.039

注:1、所述基金业绩指标不包括基金的投资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),计入相关收益水平,低于下列标准:  
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。  
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	1.86%	0.15%	1.09%	0.01%	0.77%	0.14%

注:本基金业绩比较基准为:三年期银行定期存款税后收益率  
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

基金管理人:新华基金管理有限公司  
基金托管人:中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一三年一月二十二日

§1 重要提示

本基金经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。  
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。  
本报告期内为2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华中小市值优选股票
基金代码	519097
交易代码	519097
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月28日
报告期末基金份额总额	424,788,914.82份
投资目标	在有效控制风险的前提下,精选各行业中具有成长性且价格合理的中小市值股票进行投资,力求实现基金净值增长率持续地超越业绩比较基准。
投资策略	本基金以合理价格成长选股策略(GARP)为核心,精选各行业中具有成长性且价格合理的中小市值股票进行投资。
业绩比较基准	80%×中证700指数收益率+20%×上证国债指数收益率
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高风险收益品种,预期风险和收益均高于混合型基金和债券型基金。
基金管理人	新华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-1,661,664.93
2.本期利润	25,985,750.19
3.加权平均基金份额本期利润	0.0605
4.期末基金资产净值	369,724,898.18
5.期末基金份额净值	0.870

注:1、本基金业绩指标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;2、以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如基金申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。  
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	7.54%	1.05%	3.27%	1.10%	4.27%	-0.05%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

新华中小市值优选股票型证券投资基金  
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
2011/1/28至2012/12/31

基金管理人:新华基金管理有限公司  
基金托管人:中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一三年一月二十二日

§1 重要提示

本基金经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。  
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。  
本报告期内为2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华钻石品质企业股票
基金代码	519093
交易代码	519093
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月3日
报告期末基金份额总额	671,374,011.85份
投资目标	本基金通过对于上市公司基本面的深入研究,结合宏观经济周期和行业景气度分析,力求在有效控制风险和适度保持良好流动性的前提下,精选具有稳定价值和高质量成长性的钻石品质类的优质上市公司。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略,通过对经济周期、行业特征等宏观层面的信息进行全面分析,调整大类资产配置比例和行业配置比例;在每个券种的选择上采用自上而下的投资策略,核心是从企业价值的稳定性和成长性的高质量出发,筛选具有钻石品质的优质企业,并进行重点配置。钻石品质企业股票的配置比例不低于投资组合配置的80%。钻石品质企业是指具有稳定价值和高质量成长性的上市公司,它们具有安全、透明、稳定、创新等气质五大优秀品质。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×上证国债指数收益率
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高风险高收益品种,预期风险和收益均高于混合型基金、债券型基金和货币型基金。
基金管理人	新华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-24,471,833.63
2.本期利润	83,624,980.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.1222
4.期末基金资产净值	645,274,122.91
5.期末基金份额净值	0.961

注:1、本基金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;2、以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如基金申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。  
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	14.81%	1.26%	8.18%	1.02%	6.63%	0.24%

新华钻石品质企业股票型证券投资基金  
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
2010年2月3日至2012年12月31日

# 泰信保本混合型证券投资基金

## 【2012】第四季度报告

注:1、本基金基金合同于2012年2月22日正式生效。截至本报告期末不满一年。  
2、本基金建仓期为六个月。建仓期间,本基金的投资组合情况为:股票、权证等收益资产占基金资产的0%-40%,其中,持有的全部权证市值不超过基金资产净值的3%;债券、货币市场工具等保本基金资产的60%-100%;其中,基金持有现金以及到期日在1年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

§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	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
董山青先生	本基金基金经理	2012年2月22日	-	7	工商管理硕士,CFA。具有基金从业资格。曾任职于中国银行上海分行。2004年加入泰信基金管理有限公司,先后在清隆会计部、研究部、投资部任职,曾担任泰信优势增长基金经理助理。

注:1、以上日期均是公司公告的日期。  
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、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守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《泰信保本混合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约定。  
4.3 公平交易专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
根据《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》(中国证监会公告[2011]18号),公司制定了《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相关的各个环节。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。  
公司所有研究或投资对公司所管理的所有产品公平开放,基金经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令,所有投资指令在集中交易集中系统中执行,投资交易过程公平公正,投资交易监控贯穿于整个投资过程。  
本报告期内,投资交易监控与价差分析未发现本基金与其他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  
本公司严格执行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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内本基金投资策略和运作分析  
债券市场季末小幅上翘,资金面宽松,债券收益率小幅下跌。市场自9月1日回调持续小幅温和上涨,临近年末资金成本略有上升。  
股票市场先跌后涨,上证综指10月震荡,11月持续下跌,直到12月初触底后快速大幅反弹,一举逆转全年颓势,最终年终收阳。第四季度上证综指涨幅8.77%,中小板综指涨幅0.38%。  
本季度债券市场在前期货币政策宽松、流动性充裕、利率下行、信用利差收窄、股市震荡、股市反弹中提高收益权重并适当降低仓位,把握反弹机会提升收益,为今后年度的操作奠定了良好基础。  
4.4.2 报告期内本基金的投资表现  
截至2012年12月31日,本基金单位净值为1.039元,本季度净值增长率为1.86%,业绩比较基准增长率为1.09%。  
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望  
展望下季度,我们认为CPI可能企稳,在春节后CPI继续趋升,年初以来的货币政策大幅放松预期落空,央行将继续以宽松信贷为宽松信贷政策,债券市场未来以持有有票息收益为主。随着新一届领导人的走马上任,金融政策不断调整,投资者信心逐渐恢复,股市吸引力正在加强。信托、理财、信用债等固定收益类市场正在不断暴露,反映出经济增长放缓风险并未过去,去库存周期拐点或出现在明年一、二季度,经济见底论将面临挑战,因此未来一段时期股市或将震荡企稳。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

# 新华中小市值优选股票型证券投资基金

## 【2012】第四季度报告

注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§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	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
桂联强	本基金基金经理 新华优选股票基金基金经理 新华优选股票基金基金经理	2011-7-12	-	5	工学、金融学双硕士,历任中国石化化工研究所研究工程师。2009年加入新华基金管理有限公司,历任化工、有色、轻工、建材等行业分析员、策略分析师,新华优选成长股票基金基金经理助理,新华优选成长股票基金基金经理,现任新华优选股票基金基金经理助理,新华中小市值优选股票基金基金经理。

注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§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	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
桂联强	本基金基金经理 新华优选股票基金基金经理 新华优选股票基金基金经理	2010-2-3	-	15	经济学硕士,历任君安证券有限公司研究员,红塔证券股份有限公司资产管理部投资经理,再鼎信托投资公司资产管理部投资经理,再鼎信托投资公司资产管理部投资经理,新华优选成长股票基金基金经理,新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金经理。

注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§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	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
曹长名	本基金基金经理 新华优选股票基金基金经理 新华优选股票基金基金经理	2010-2-3	-	15	经济学硕士,历任君安证券有限公司研究员,红塔证券股份有限公司资产管理部投资经理,再鼎信托投资公司资产管理部投资经理,新华优选成长股票基金基金经理,新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金经理。

注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§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	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
桂联强	本基金基金经理 新华优选股票基金基金经理 新华优选股票基金基金经理	2011-7-12	-	5	工学、金融学双硕士,历任中国石化化工研究所研究工程师。2009年加入新华基金管理有限公司,历任化工、有色、轻工、建材等行业分析员、策略分析师,新华优选成长股票基金基金经理助理,新华优选成长股票基金基金经理,现任新华优选股票基金基金经理助理,新华中小市值优选股票基金基金经理。

注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§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	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
桂联强	本基金基金经理 新华优选股票基金基金经理 新华优选股票基金基金经理	2011-7-12	-	5	工学、金融学双硕士,历任中国石化化工研究所研究工程师。2009年加入新华基金管理有限公司,历任化工、有色、轻工、建材等行业分析员、策略分析师,新华优选成长股票基金基金经理助理,新华优选成长股票基金基金经理,现任新华优选股票基金基金经理助理,新华中小市值优选股票基金基金经理。

注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§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	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
桂联强	本基金基金经理 新华优选股票基金基金经理 新华优选股票基金基金经理	2011-7-12	-	5	工学、金融学双硕士,历任中国石化化工研究所研究工程师。2009年加入新华基金管理有限公司,历任化工、有色、轻工、建材等行业分析员、策略分析师,新华优选成长股票基金基金经理助理,新华优选成长股票基金基金经理,现任新华优选股票基金基金经理助理,新华中小市值优选股票基金基金经理。

注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§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	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
桂联强	本基金基金经理 新华优选股票基金基金经理 新华优选股票基金基金经理	2011-7-12	-	5	工学、金融学双硕士,历任中国石化化工研究所研究工程师。2009年加入新华基金管理有限公司,历任化工、有色、轻工、建材等行业分析员、策略分析师,新华优选成长股票基金基金经理助理,新华优选成长股票基金基金经理,现任新华优选股票基金基金经理助理,新华中小市值优选股票基金基金经理。

注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§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	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
桂联强	本基金基金经理 新华优选股票基金基金经理 新华优选股票基金基金经理	2011-7-12	-	5	工学、金融学双硕士,历任中国石化化工研究所研究工程师。2009年加入新华基金管理有限公司,历任化工、有色、轻工、建材等行业分析员、策略分析师,新华优选成长股票基金基金经理助理,新华优选成长股票基金基金经理,现任新华优选股票基金基金经理助理,新华中小市值优选股票基金基金经理。

注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§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	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
桂联强	本基金基金经理 新华优选股票基金基金经理 新华优选股票基金基金经理	2011-7-12	-	5	工学、金融学双硕士,历任中国石化化工研究所研究工程师。2009年加入新华基金管理有限公司,历任化工、有色、轻工、建材等行业分析员、策略分析师,新华优选成长股票基金基金经理助理,新华优选成长股票基金基金经理,现任新华优选股票基金基金经理助理,新华中小市值优选股票基金基金经理。

注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§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	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
桂联强	本基金基金经理 新华优选股票基金基金经理 新华优选股票基金基金经理	2011-7-12	-	5	工学、金融学双硕士,历任中国石化化工研究所研究工程师。2009年加入新华基金管理有限公司,历任化工、有色、轻工、建材等行业分析员、策略分析师,新华优选成长股票基金基金经理助理,新华优选成长股票基金基金经理,现任新华优选股票基金基金经理助理,新华中小市值优选股票基金基金经理。

注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§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	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
桂联强	本基金基金经理 新华优选股票基金基金经理 新华优选股票基金基金经理	2011-7-12	-	5	工学、金融学双硕士,历任中国石化化工研究所研究工程师。2009年加入新华基金管理有限公司,历任化工、有色、轻工、建材等行业分析员、策略分析师,新华优选成长股票基金基金经理助理,新华优选成长股票基金基金经理,现任新华优选股票基金基金经理助理,新华中小市值优选股票基金基金经理。

注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§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	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
桂联强	本基金基金经理 新华优选股票基金基金经理 新华优选股票基金基金经理	2011-7-12	-	5	工学、金融学双硕士,历任中国石化化工研究所研究工程师。2009年加入新华基金管理有限公司,历任化工、有色、轻工、建材等行业分析员、策略分析师,新华优选成长股票基金基金经理助理,新华优选成长股票基金基金经理,现任新华优选股票基金基金经理助理,新华中小市值优选股票基金基金经理。