

# 泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金

## 【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:中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期:2014年7月21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法律责任。  
本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同已于2014年7月16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。投资者有风险,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。  
本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为 2014年4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

基金名称	泰信优势增长混合
交易代码	290005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月25日
报告期末基金份额总额	543,075,584.59份
投资目标	通过投资于优势股票和资产配置,综合主动的宏观、策略、行业、公司研究,选择具有可持续发展潜力的成长型股票和收益型、流动性良好的债券,力争使投资者享有受到可持续的财富增长。
投资策略	本基金实行主动管理,以价值投资理念为核心,坚持“自上而下”与“自下而上”相结合,通过基本面分析,精选具有良好成长性的股票,并配以流动性良好的债券,构建投资组合,追求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	50%×沪深300指数+45%×上证国债指数
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高风险品种,其预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,适合中等风险承受能力、追求资本增值的投资者。
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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	1,778,737.28	
2.本期利润	19,114,062.42	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0789	
4.期末基金资产净值	438,352,044.91	
5.期末基金份额净值	1.278	

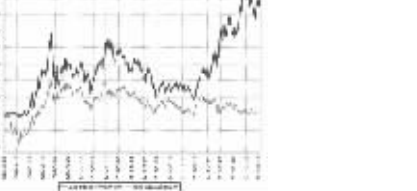
注:1.所述基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。  
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2.1 基金净值表现

3.2.1 报告期内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	业绩比较基准收益率	净值比较基准差	①-③	②-④
过去三个月	4.33%	1.06%	3.86%	0.48%	2.47%
过去一年	4.33%	1.06%	3.86%	0.48%	2.47%

注:1.本基金建仓期为2008年6月25日正式生效。  
2.本基金的建仓期为六个月。建仓期间,本基金投资组合各项比例符合基金合同的约定:股票资产占基金资产60%-90%,债券资产占基金资产0%-65%(其中包括可转债、资产支持证券等),权证0%-3%。



注:1.以上日期均是指公司公告的日期;  
2.证券从业人员的职业道德(《证券从业人员职业道德管理办法》)的相关规定;  
3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	278,399,781.05	63.06
	其中:股票	278,399,781.05	63.06
2	固定收益投资	--	--
	其中:债券	--	--
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	--	--
5	买入返售金融资产	110,000,000.00	24.92
	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	48,751,729.30	11.04
7	其他资产	4,300,838.57	0.97
8	合计	441,412,348.92	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	--	--
B	采矿业	--	--
C	制造业	124,286,949.69	28.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	--
E	建筑业	--	--
F	批发和零售业	4,291,896.00	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息技术、软件和信息技术服务业	104,131,396.65	23.76
J	金融业	--	--
K	房地产业	--	--
L	租赁和商务服务业	16,953,326.44	3.87
M	科学研究和技术服务业	2,834,000.00	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	1,329,000.00	0.30
O	居民服务、教育和其他服务业	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生和社会工作	2,916,126.72	0.67
R	文化、体育和娱乐业	21,617,785.55	4.93
S	合计	278,399,781.05	63.06

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600079	人福医药	578,899	17,282,821.65	3.74
2	600571	信诺达	849,772	16,562,026.18	3.59
3	002292	奥飞动漫	399,772	14,671,632.40	3.25
4	300253	汇川技术	299,492	13,773,432.64	3.00
5	300133	华谊兄弟	403,649	12,896,585.55	2.84
6	300315	宝通科技	699,958	12,501,249.88	2.85
7	300287	飞信信	349,958	9,721,833.24	2.22
8	002400	普华永道	365,013	8,972,019.54	2.05
9	002148	华彬集团	379,894	8,281,689.20	1.89
10	300075	数字政通	255,681	8,266,166.73	1.89

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资股指期货。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金本报告期末前十名证券中无有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

### 5.12 报告期内基金投资的前十名股票中无有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.12.1 其他资产明细

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	57,756.72
2	应收证券清算款	18,647.17
3	应收股利	--
4	应收利息	12,051.84
5	其他应收款	4,212,382.84
6	待摊费用	--
7	其他	--
8	合计	4,300,838.57

### 5.13 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	股票代码	股票名称	面值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300253	汇川技术	13,773,432.64	3.00	无重大限制

### 5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金截至2014年6月30日止报告期内以上公允价值前十名证券中无有重大影响和暂时停牌的股票,无其他报告期末本基金持仓股票停牌,经交易所批准复牌。

### 5.16 本报告涉及公允价值相关比例的,均以公允价值除以相关数据计算,而不是对不同比例进行合

计。

### §6 开放式基金份额变动

项目	单位:份
报告期初基金份额总额	170,662,316.37
报告期内基金总申购份额	241,970,253.23
报告期内基金总赎回份额	69,555,985.01
报告期内基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	343,076,584.59

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金基金份额变动情况

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.3 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.4 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.5 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.6 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.8 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.9 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.10 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.11 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.12 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.13 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.14 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.15 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.16 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

# 泰信优质生活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:中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期:2014年7月21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法律责任。  
本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同已于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。投资者有风险,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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为 2014年4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

基金名称	泰信优质生活股票
交易代码	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
报告期末基金份额总额	1,272,199,700.13份
投资目标	分享中国经济可持续发展过程中那些能够持续满足人们优质生活需求上市公司长期成长红利,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、卫星策略为资产配置思路,通过基本面分析,精选具有良好成长性的股票,并配以流动性良好的债券,构建投资组合,追求基金资产的长期增值。
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高风险品种,其预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,适合中等风险承受能力、追求资本增值的投资者。
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

### 3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-9,193,732.75	
2.本期利润	42,542,364.24	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0332	
4.期末基金资产净值	987,577,548.85	
5.期末基金份额净值	0.7763	

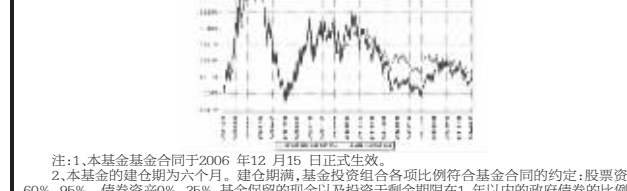
注:1.上述基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。  
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期末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	业绩比较基准收益率	净值比较基准差	①-③	②-④
过去三个月	4.28%	1.12%	3.16%	0.60%	3.30%

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  
3.2.2 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



注:1.本基金建仓期为2006年12月15日正式生效。  
2.本基金的建仓期为六个月。建仓期间,本基金投资组合各项比例符合基金合同的约定:股票资产占基金资产60%-95%,债券资产占基金资产0%-35%(其中包括可转债、资产支持证券等),权证0%-3%。

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

3.2.