泰信先行策略混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2010年第1号）

基金管理人：泰信基金管理有限公司
基金托管人：中国光大银行股份有限公司

重要提示

泰信先行策略开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）2004年5月10日经中国证监会证监基金字［2004］69号文批准公开发行。

本基金为契约型开放式，基金合同于2004年6月28日正式生效。基金管理人及注册登记机构为泰信基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。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，也不保证最低收益。投资有风险，投资人申购本基金时应认真阅读招募说明书。

本摘要根据本基金的基金合同编写，并已报中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《证券法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

说明：本摘要摘自《泰信先行策略开放式证券投资基金更新招募说明书（2010年第1号）》，本更新招募说明书所载内容截止日期为2009年12月28日，有关财务数据（未经审计）和净值表现及投资组合数据的截止日如未特别注明均为2009年12月31日。原招募说明书及其历次更新与本更新招募说明书不一致的，以本更新招募说明书为准。

投资者欲了解更详细的资料，请登录本基金管理人的网站（www.ftfund.com）查阅本更新招募说明书的全文。

二、基金管理人

（一）基本情况

基金管理人名称：泰信基金管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦42层
办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦42层
成立日期：2003年5月23日
法定代表人：孟凡利
总经理：高清海
办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦42层
电话：021-50372168
传真：021-50372197
联系人：高海鸥
发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co.,Ltd.）是原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。

（二）注册资本、股权结构

泰信基金管理有限公司注册资本2亿元人民币，股权结构如下：

股东单位名称	现金出资金额	股权比例
山东省国际信托有限公司	9000万元	45%
江苏省投资管理有限责任公司	6000万元	30%
青岛国信实业有限公司	5000万元	25%
合计	2亿元	100%

（三）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

①董事会成员

孟凡利先生，董事长，博士，教授；曾先后任山东经济学院财务会计系副主任、主任，山东省财政厅副厅长，山东省鲁信投资控股集团有限公司副董事长、总经理，现任山东省鲁信投资控股集团有限公司董事长、党委书记、总经理，兼山东省国际信托有限公司董事长。

黄东峰先生，副董事长，大学本科，经济师；曾任江苏省计划与经济委员会基建处科长、江苏省投资公司综合计划处主任，江苏省国际信托投资公司综合计划部经理、香港博鸿国际投资贸易有限公司总经理，现任江苏省国信资产管理集团有限公司副总经理，兼江苏省国际信托有限责任公司董事长。

李元成先生，董事，工商管理硕士；曾任青岛市财政局驻厂员处办事员、科员、副科，青岛市美国阳明项目办公室项目经理，青岛国际信托投资公司计划处副处长、处长，青岛国信实业有限公司计划会计部经理，青岛裕桥置业有限公司总经理，青岛国信实业有限公司副总经理，现任青岛国信发展（集团）有限责任公司副总经理、党委委员。

相开进先生，董事，法学学士，律师；曾任山东省计委培训中心教师、山东省计委固定资产投资计划处主任科员、山东省国际信托投资公司海外企业部职员、山东省国际信托投资公司法律事务部主任助理、山东省国际信托投资公司法律事务部副主任、山东省国际信托投资公司法律事务部经理、山东省国际信托投资有限公司总经理、现任山东省鲁信投资控股集团有限公司总经理助理兼山东省国际信托有限公司总经理。

俞二平先生，独立董事，经济法硕士；曾任西藏军区第二通信总站政治处主任，财政部人事教育司司长，中央汇金公司派任中国银行董事、董事会薪酬委员会主席，中国投资有限责任公司干部、中国投资有限责任公司董事、人力资源部总监、党委组织部部长、工会主席。

刘政庭先生，独立董事，行政管理大专，高级经济师；曾任湖北省教育厅基础教育处副处长，湖北省政府体改办综合处副处长、秘书处处长，湖北省黄冈地区行政公署副专员，湖北省体改委副主任，湖北省证券监督管理委员会负责人，中国证监会武汉证管办副主任，武汉稽查局副局长，中国证监会武汉证管办巡视员。

李惠珍女士，独立董事，金融学大专，高级经济师；曾任中国人民银行上海分行静安区办党委书记、纪委书记，中国工商银行上海市分行组织处副处长，交通银行上海分行副行长，海通证券有限公司董事长、总经理，上海国际集团有限公司副总经理，上海国际信托投资公司总经理，现任上海国际集团有限公司顾问。董事，法学学士，律师；曾任山东省计委培训中心教师，山东省计委固定资产投资计划处主任科员，山东省国际信托投资公司海外企业部职员，山东省国际信托投资公司法律事务部主任助理，山东省国际信托投资公司法律事务部副主任，山东省国际信托投资公司法律事务部经理，山东省国际信托投资有限公司副总经理，现任山东省国际信托有限公司总经理。

②监事会成员

刘晓东先生，监事长，金融学学士，高级经济师；曾任中国工商银行青岛分行资金调度员、信贷员，青岛国际信托投资公司科长、副处长，青岛国信实业有限公司资产管理部经理，青岛国信发展（集团）有限责任公司资产管理部部长。牟东明先生，监事长，EMBA，高级经济师；曾任青岛国信实业公司研究发展部经理，青岛国信实业公司总经理助理兼青岛国信体育产业有限公司总经理。

张牧农先生，监事，工学硕士，高级经济师；曾任山东省国际信托投资公司投资部副经理、项目评审部副经理、青岛华和国际租赁公司副总经理、法国巴黎春新公司副总经理，山东省国际信托投资公司任投资部副经理，现任山东鲁信投资控股公司任投资管理部高级业务经理。

戴平先生，监事，大专文化，工程师；曾任江苏省投资公司科长、江苏省计划干部培训中心办公室副主任、中外合资东西方投资咨询公司副总经理、江苏省机电轻纺投资公司投资部经理、江苏省投资管理公司工业部副经理，江苏省投资管理有限责任公司综合投资部副经理，现任江苏省投资管理有限责任公司综合投资部总经理。

庞少华先生，职工监事，硕士，会计师，14年证券从业经验。2005年1月加入泰信基金管理有限公司，现任泰信基金管理有限公司清算会计部经理。

李佳群先生，职工监事，经济学博士，16年证券从业经验；曾任中国新技术创业投资公司经理助理；国家机械工业部交流中心财务及综合管理；特华投资控股有限公司总裁助理；2008年加入泰信基金管理有限公司，现任基金事务负责人、北京分公司负责人。

③公司高级管理人员

孟凡利先生，董事长，博士，教授；曾先后任山东经济学院财务会计系副主任、主任，山东省财政厅副厅长，山东省鲁信投资控股集团有限公司副董事长、总经理，现任山东省鲁信投资控股集团有限公司董事长、党委书记、总经理，兼山东省国际信托有限公司董事长

高清海先生，总经理，经济学博士；曾任新加坡鲁信（亚洲）投资公司董事、济南百灵信息科技有限公司董事、山东省国际信托公司投资银行业务部经理。

吴胜光先生，督察长，硕士，高级经济师；曾任南京大学城市与资源系副主任、江苏省国际信托投资公司投资银行部业务二部经理、信泰证券有限责任公司投资银行部副总经理。

2、基金经理

梁剑先生，金融学硕士，证券从业经验10年。曾在上海久联证券公司任研究员。自2004年6月进入泰信基金管理有限公司，先后担任公司金融工程部经理、研究部经理，2009年4月25日起担任本基金基金经理。

附：本基金历任基金经理情况：

姓名	管理本基金的时间
王鹏	2008年6月28日至2009年7月2日
董红波	2007年2月9日至2008年6月28日
林少立	2006年5月27日至2007年5月10日
张翎	2005年5月17日至2006年5月27日
郝兵	2005年5月17日至2005年12月31日
管文浩	2004年6月28日至2005年5月17日

3、投资决策委员会名单

本基金采取集体投资决策制度，投资决策委员会构成如下：

高清海先生，公司总经理，投资决策委员会主任；

崔海鸥先生，公司总经理助理；

梁剑先生，研究部副总监，兼泰信先行策略混合基金基金经理；

刘强先生：基金投资副总监，兼泰信优质生活股票基金基金经理；

另外，督察长、监察稽核部经理列席会议。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人

本基金的托管人为中国光大银行，基本概况如下：

名称：中国光大银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
办公地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人：唐双宁
成立时间：1992年8月18日
注册资本：282.1689亿元人民币
电 话：010-68560675
联 系 人：石立平

四、相关服务机构

（一）直销机构：

1、泰信基金管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦42层
办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦42层
法定代表人：孟凡利
总经理：高清海
成立日期：2003年5月23日
电话：021-50372168
传真：021-50372269
联系人：张德庆
网址：www.ftfund.com

2、泰信基金管理有限公司北京分公司
营业场所：北京市西城区广成街4号院1号楼305、306室
电话：010-66215978-506
传真：010-66215968
联系人：李伟群
网址：www.ftfund.com

3、泰信基金管理有限公司深圳分公司
营业场所：深圳市福田区深南大道与民田路交界西南新华保险大厦1308
电话：0755-33988759
传真：0755-33988757
联系人：史明伟
网址：www.ftfund.com

（二）代销机构

①中国光大银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
办公地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人：唐双宁
联系人：李伟
电话：010-68098778
传真：010-68560661
客服电话：95595
网址：www.cebbank.com

②中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
客服电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

③中国银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：肖钢
联系人：金融市场总部托管投资服务模块
传真：010-66594942
客服电话：95566
网址：www.boc.cn

④交通银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路188号
办公地址：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
联系人：曹榕
电话：021-58781234
传真：021-58408483
客服电话：95559
网址：www.bankcomm.com

⑤中国建设银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：郑树清
传真：010-66275654
客服电话：95533
网址：www.ccb.cn

⑥招商银行股份有限公司
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：秦晓
联系人：马强
电话：0755-83198888
传真：0755-83195049
客服电话：95555
网址：www.cmbchina.com

⑦中信银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人：孔丹
联系人：金蕾
电话：010-65557013
传真：010-65550827
客服电话：95558
网址：bank.ecitic.com

⑧上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址：上海市北京东路689号东银大厦17楼
法定代表人：吉晓辉
联系人：倪苏云
电话：021-61618888
传真：021-63602431
客服电话：95528
网址：www.spdb.com.cn

⑨深圳发展银行股份有限公司
注册地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人：法兰克纽曼
联系人：张背
电话：0755-82088888
传真：0755-82080714
客服电话：95501
网址：www.sdb.com.cn

⑩中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市复兴门内大街2号
办公地址：北京市复兴门内大街2号
法定代表人：董文标
联系人：崔云魏 吴海鹏
电话：010-58351666
传真：010-83914283
客服电话：95568
网址：www.cmbc.com.cn

⑪北京银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址：北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人：闫冰竹
联系人：王曦
电话：010-66223584
传真：010-66226073
客服电话：010-96169
网址：www.bankofbeijing.com.cn

⑫华夏银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦
办公地址：北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦
法定代表人：吴建
联系人：陈宇
电话：010-85238423
传真：010-85238680
客服电话：95577
网址：www.hxb.com.cn

⑬上海银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路168号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人：宁黎明
联系人：张蓓
电话：021-68475888
传真：021-68476111
客服电话：021-962888
网址：www.bankofshanghai.com

⑭平安银行股份有限公司
注册地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦
办公地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦
法定代表人：孙立哲
联系人：蔡宇洲
电话：0755-25859591
传真：0755-25878316
客服电话：40066-99999、0755）961202
网址：www.18ebank.com

⑮宁波银行股份有限公司
住所：宁波市江东区中山东路294号
办公地址：宁波市江东区中山东路294号
法定代表人：陆华裕
联系人：胡技勋
电话：021-63586210
传真：021-63586215
客服电话：96528，962528（上海地区）
网址：www.nbcb.com.cn

⑯南京银行股份有限公司
注册地址：中国江苏省南京市白下区淮海路50号
办公地址：中国江苏省南京市白下区淮海路50号
法定代表人：林复
联系人：贺坚
电话：025-84544135
传真：025-84544129
客户服务：025-96400 40088-96400
网址：www.njcb.com.cn

⑰招泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市银城中路168号上海银行大厦29层
法定代表人：祝幼一
电话：021-38676666
传真：021-38670666
客服电话：400-8888-666
联系人：芮敏祺
网址：www.gtja.com

⑱南通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路98号
法定代表人：王开国
电话：021-23219000
传真：021-23219100
联系人：金芸
客服电话：95533
网址：www.htsec.com

⑲中信建投证券有限责任公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：张佑君
传真：010-65182261
联系人：权唐
客服电话：400-8888-108
网址：www.csc108.com

⑳广发证券股份有限公司
注册地址：广东广州天河北路183号大都会广场43楼
办公地址：广东广州天河北路大都会广场36、38、41和42楼
法定代表人：王志伟
电话：020-87555888
传真：020-87555417
联系人：黄岚
客服电话：95575
网址：www.gf.com.cn

㉑兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路99号标力大厦
办公地址：浦东新区民生路1199弄证大·五道口广场1号楼21层
法定代表人：兰荣
电话：021-38565785
传真：021-38565783
联系人：扬德芳
客服电话：400-8888-123
网址：www.xyzq.com.cn

㉒东方证券股份有限公司
注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人：王益民
客服电话：95503
电话：021-63325888-3108
传真：021-63326173
联系人：吴宇
网址：www.dfzq.com.cn

㉓华泰证券股份有限公司
注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
电话：025-84457777-248
传真：025-84579763
客服电话：4008-888-168
联系人：张小波
网址：www.htsc.com.cn

㉔以唐证券有限责任公司
法定代表人：吴克龄
注册地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦24、25层
电话：0755-26936207
传真：0755-26936223
联系人：姚文强

特别说明：根据中国证监会基金部通知［2005］1号文《关于暂停闽发、汉唐证券公司基金代销业务资格的通知》要求，本基金管理人已于2005年1月27日暂停办理汉唐证券公司提交的申购业务。详情请见2005年1月27日登在《中国证券报》上的《泰信基金管理有限公司关于暂停办理汉唐证券公司提交的申购业务的公告》。

㉕湘财证券有限责任公司
注册地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人：林俊波
电话：021-68634518
传真：021-68865680
联系人：李梦诗
开放式基金客服电话：400-8881-551
网址：www.xcsc.com www.eestart.com

㉖中信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦A层
法定代表人：王东明
电话：010-84588888
传真：010-84865560
联系人：陈忠
网址：www.cs.ecitic.com

㉗中国银河证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：胡关金
联系电话：010-66568888
传真：010-66568116
联系人：李洋
网址：www.chinastock.com.cn
客服电话：400-8888-888

㉘民生证券有限责任公司
注册地址：北京市朝阳区朝阳门外大街16号中国人寿大厦1901室
法定代表人：岳献春
电话：010-85252656
传真：010-85252655
联系人：赵明
网址： www.mszq.com
客服电话：400-619-8888

㉙山西证券股份有限公司
注册地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人：侯巍
电话：0351-8686703
传真：0351-86686619
联系人：张治国
网址：www.i618.com.cn
客服电话：400-666-1618

㉚中信万通证券有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）
办公地址：青岛市东海西路28号
法定代表人：史洁民
联系电话：0532-85022026
传真：0532-85022026
联系人：丁韶燕
客服电话：0532-96577
网址：www.zxwt.com.cn

㉛华安证券有限责任公司
注册地址：安徽省合肥市长江中路357号
办公地址：安徽省合肥市阜南路166号
法定代表人：李工
联系人：甘霖
电话：0551-5161821
传真：0551-5161672
客服电话：96518 400-809-6518
公司网址：www.hazq.com.cn

㉜财时代证券有限责任公司
注册地址：北京市西城区月坛北街月坛大厦1501室层
法定代表人：马金声
电话：010-83561000
传真：010-83561001
联系人：戴荻
网址：www.xsdzq.cn
客服电话：400-698-9898

㉝财富证券有限责任公司
注册地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
法定代表人：周晖
电话：0731-84403319
传真：0731-84403439
联系人：郭磊
网址：www.cfzq.com

㉞申银万国证券股份有限公司
注册地址：上海市常熟路171号
法定代表人：丁国荣
联系人：王序微
电话：021-54033888
传真：021-54038844
客服电话：021-962505
公司网址：www.sw2000.com.cn

㉟瑞福证券有限责任公司
注册地址：天津市经济技术开发区第一大街29号
办公地址：天津市南开区宾水西道8号
法定代表人：张志军
联系人：王兆权
电话：022-28451861
传真：022-28451892
客服电话：400-6515-988
网址：www.bhzq.com.cn

㊱招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人：宫少林
电话：0755-82943511
传真：0755-82943100
联系人：黄健
客服电话：95565
网址：http://www.newone.com.cn/

㊲国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16层-26层
法人代表人：何如
联系电话：0755-82130833
联系人：齐晓燕
传真：0755-82133302
网址：www.guosen.com.cn
客服电话：95536

㊳华泰联合证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
法定代表人：马昭明
联系人：盛宗凌
电话：0755-82492000
传真：0755-82493943
客服电话： 400-8888-555
网址：www.lhzq.com

㊴宏信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
法定代表人：牛冠兴
联系人：余江
电话：0755-82825555
传真：0755-82825550
网址：www.essences.com.cn
客服电话：400-8001-001

㊵东海证券有限责任公司
注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19楼
办公地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19楼
法定代表人：朱科敏
联系人：朱涛
电话：0519-88157761
传真：0519-88157761
网址：www.longone.com.cn
客户服务电话：400-8888-588、021-52574550、0519-88166222、0379-64902266

㊶万联证券有限责任公司
注册地址：广州市中山二路18号广东电信广场36-37层
办公地址：广州市中山二路18号广东电信广场36-37层
法定代表人：李舸金
电话：020-37865070
传真：020-37865030
联系人：罗剑斌
网址：www.wlzq.com.cn
客服电话：400-8888-133

㊷中银国际证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人：唐新宇
联系人：张静
电话：021-68604866
传真：021-50372474
网址：http://www.bocichina.com.cn
客服电话：400-620-8888

㊸平安证券有限责任公司
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼
法定代表人：杨宇翔
联系人：袁月
电话：400-8866-338
传真：0755-82433794
客服电话：400-8816-168
网址：www.pingan.com

㊹光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
联系人：刘晨
电话：021-22169999
传真：021-22169134
网址：www.ebscn.com
客服电话：10108998

㊺上海证券有限责任公司
注册地址：上海市西藏中路336号
法定代表人：郁忠民
联系人：王伟力
电话：021-51539888
传真：021-51539888
网址：www.962518.com
客服电话：962518

㊻国都证券有限责任公司
注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层
法定代表人：王少华
联系人：黄静
电话：010-84183389
传真：010-84183273
网址：www.guodu.com
客服电话：800-818-8118

㊼长南证券有限责任公司
注册地址：江西省南昌市抚河北路291号
法定代表人：姚江涛
电话：0791-6768763
传真：0791-6789414
联系人：歆蓉
网址：www.scstock.com

㊽金元证券股份有限公司
注册地址：海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
法定代表人：陆涛
电话：0755-83025695
传真：0755-83025625
客服电话：400-8888-228
联系人：金春
网址：www.jyzq.cn

㊾德邦证券有限责任公司
注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址：上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人：方加春
电话：021-68761616
传真：021-68767981
联系人：罗芳
客户服务电话：400-8888-128
网址：www.tebon.com.cn

㊿中国建银投资证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋19楼
办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋19楼
法定代表人：杨小阳
联系人：刘权
电话：0755-82026688
传真：0755-82026590
客户服务电话：400-6008-008
网址：www.cjis.cn

(51)西藏证券有限责任公司
注册地址：拉萨市北京中路101号
办公地址：上海市辉河路118号
法定代表人：贾绍君
联系人：刘宇
电话：021-65546079
传真：021-65526481
网址：www.xzsec.com
客服电话：400-88111-77 或拨打各城市营业网点咨询电话

(52)宏源证券股份有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：冯戎
联系人：李巍
电话：010-88085858
传真：010-88085344
客服电话：400-8000-562
网址：www.hysec.com

(53)恒泰证券股份有限公司
注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人：粘瑾
电话：0471-4913998
传真：0471-4930707
联系人：常向东
客服电话：0471-4961259
网址：www.cnht.com.cn

(54)长城证券有限责任公司
住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
电话：0755-83516289
传真：0755-83516199
联系人：匡婷
客服电话：0755-33680000 400-6666-888
网址：www.cc168.com.cn

(55)双建证券有限责任公司
注册地址：上海市南京西路758号23楼
办公地址：上海市南京西路758号20-25楼
法定代表人：张建华
电话：021-62171984
传 真：021-62878783
联系人：陈毓
客服热线：021-63340678
网址：www.ajzq.com

(56)太海证券有限公司
住所：哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
电话：0451-82336863
传真：0451-82287211
联系人：徐世旺
网址：www.jhzq.com.cn

(57)华宝证券经纪有限责任公司
注册地址：上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
办公地址：上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
法定代表人：陈林
电话：021-50122222
传 真：021-50122200
联系人：楼斯佳
客户热线：400-820-9898
网址：www.cnhhstock.com

(58)广发华福证券有限责任公司
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8、10层
法定代表人：黄金琳
电话：0591-87841160
传 真：0591-87841150
联系人：张鹏
客户热线：96326（福建省外请先拨0591）
网址：www.gfhfzq.com.cn

(59)英大证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人：赵文安
电话：0755-83007069
传 真：0755-83007167
联系人：王睿
客户热线：0755-26982993
网址：www.ydsc.com.cn

(60)中信金通证券有限责任公司
注册地址：杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
办公地址：杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
法定代表人：刘军
电话：0571-85783750
传 真：0571-85783771
联系人：俞会亮
客户热线：96598
网址：www.bigsun.com.cn

本基金管理人可根据有关法律法规规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并予以公告。

（二）基金注册登记机构

注册登记机构名称：泰信基金管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦42层
办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦42层
法定代表人：孟凡利
总经理：高清海
成立日期：2003年5月8日
电话：021-50372168
传真：021-50372269
联系人：韩波

（三）出具律师意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所
地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14层
负责人：廖海
电话：021-51150298、021-51150391
传真：021-51150398
经办律师：廖海 王道富

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人：杨绍信
联系电话：021-23238888
传真：021-23238800
联系人：徐振晨
经办注册会计师：薛竞、徐振晨

五、基金的名称

基金名称：泰信先行策略开放式证券投资基金
基金简称：泰信先行策略混合基金

六、基金的类型

契约型开放式

七、基金的投资目标

运用多层次先行策略，灵活配置各类资产，追求收益的长期稳定增长；提前发现和介入价值被市场低估的价值成长股票，在其价值回归过程中获取超额收益。

八、基金的投资方向

限于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股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中债券包括国债、金融债、企业（公司）债（包括可转债）等。

九、基金的投资策略

本基金区别于其他基金的主要特点，是先行策略的运用。先行策略，是对国际流行的均值反转策略在中国市场的改良应用，在投资操作中注意运用股价波动的均值反转规律，强调“先行价值发现、提前控制风险”，简单讲，就是在市场取得一致认识之前，超前发现和介入价值被低估的行业和个股，并在市场存在下跌风险时，通过资产配置比例的调整，提前控制下跌风险。

本基金股票投资部分以先行策略为核心，实行自上而下三个层次的资产配置。债券投资部分采用久期调整、收益率曲线配置、类别配置、无风险套利、融资杠杆等策略。

（一）决策依据

1、国家有关法律、法规和《基金合同》的规定；

2、政治形势、政策趋势和宏观经济形势；

3、货币政策、利率趋势；

4、行业和上市公司基本面；

5、证券市场发展趋势。

（二）决策和操作程序

本基金参与投资决策和操作程序的机构和部门包括：投资决策委员会、基金投资部、研究部、金融工程部。具体程序如下：

1、金融工程部提出投资基准建议，经投资决策委员会批准后实施；

2、金融工程部借助于外部专业机构建立个股、债券历史数据库，并初选出符合投资基准的股票/债券，构建“证券备选库”；

3、研究部与基金投资部联合对个股、债券深入调研，精选股票/债券；

4、基金经理构造基金组合计划；

5、金融工程部对投资组合计划进行风险收益分析，提出修正意见；研究部策略分析师通过宏观、中观分析，对投资组合的资产配置提出意见；

6、投资决策委员会最后确定投资组合方案；

7、基金经理实施投资组合方案；

8、金融工程部对投资组合进行跟踪评估，定期或随时向基金经理、投资总监、投资决策委员会提供基金投资组合风险评估报告并提出风险控制建议；

9、基金经理根据市场环境的变化和实际需要调整投资组合，但调整投资组合应按授权权限和批准程序进行。

（三）投资组合管理的方法和标准

本基金为混合型基金，灵活调整股票、债券和现金的投资比例。在正常市场情况下，本基金组合投资的基本范围为：股票资产30%-95%，债券资产0%-65%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的5%。其中，股票投资的重点为由本基金先行策略选股系统挑选出的，兼具价值成长特征和价值回归潜能的股票。

十、基金的业绩比较标准

65%*新华富时A600指数 + 35%*新华富时中国国债指数

十一、基金的风险收益特征

本基金在证券投资基金中属于风险适度的基金品种，其长期平均的预期收益和风险高于债券基金，低于纯股票基金。

十二、基金的投资组合报告（未经审计）

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光大银行根据本基金合同已于2010年1月28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。

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	6,316,113,402.13	91.57
	其中：股票	6,316,113,402.13	91.57
2	固定收益投资	941,183.80	0.01
	其中：债券	941,183.80	0.01
	资产支持证券	0	0.00
3	金融衍生品投资	0	0.00
4	买入返售金融资产	0	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	550,312,505.11	7.98
6	其他资产	30,368,225.75	0.44
	合计	6,897,735,316.79	100.00

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	296,322,372.00	4.37
B	采掘业	739,408,808.05	10.91
C	制造业	2,256,209,650.79	33.29
C0	食品、饮料	27,680,660.00	0.41
C1	纺织、服装、皮毛	125,199,724.70	1.85
C2	木材、家具	0	0.00
C3	造纸、印刷	130,013,948.24	1.92
C4	石油、化学、塑胶、塑料	256,855,311.41	3.79
C5	电子	214,284,401.54	3.16
C6	金属、非金属	472,411,399.39	6.97
C7	机械、设备、仪表	710,980,230.37	10.49
C8	医药、生物制品	318,783,975.14	4.70
C99	其他制造业	0	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	34,247,609.28	0.51
E	建筑业	67,150,252.02	0.99
F	交通运输、仓储业	476,601,827.75	7.03
G	信息技术业	118,860,369.01	1.75
H	批发和零售贸易	397,444,991.17	5.86
I	金融、保险业	1,286,875,312.57	18.99
J	房地产业	525,723,944.52	7.76
K	社会服务业	18,940,252.10	0.28
L	传播与文化产业	1,098,012.87	0.02
M	综合类	97,230,000.00	1.43
	合计	6,316,113,402.13	93.20

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	000655	金岭矿业	8,841,768	166,932,579.84	2.46
2	600256	广汇股份	6,799,919	155,718,145.10	2.30
3	000016	深康佳A	18,692,893	143,748,347.17	2.12
4	601919	中国远洋	9,999,893	138,998,512.70	2.05
5	000002	万 科A	12,050,999	130,271,299.19	1.92
6	601601	中国太保	5,000,000	128,100,000.00	1.89
7	601666	平煤股份	3,976,000	127,232,000.00	1.88
8	600030	中信证券	4,000,000	127,080,000.00	1.88
9	600016	民生银行	16,000,000	126,560,000.00	1.87
10	600516	方大炭素	11,973,335	122,247,750.35	1.80

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	0	0.00
2	央行票据	0	0.00
3	金融债券	0	0.00
	其中：政策性金融债	0	0.00
4	企业债券	0	0.00
5	企业短期融资券	0	0.00
6	可转债	941,183.80	0.01
7	其他	0	0.00
	合计	941,183.80	0.01

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	125969	安泰转债	3,540	530,185.80	0.01
2	110007	博汇转债	3,100	410,998.00	0.01

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

报告期末本基金未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名