泰信双息双利债券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:中国工商银行股份有限公司

一、重要提示

原泰信中短期债券投资基金经中国证监会2006年4月10日证监基金字[2006]67号文件《关于同意泰信中短期债券投资基金募集的批复》批准募集、设立,基金合同于2006年6月15日正式生效。

经泰信中短期债券投资基金2007年9月27日基金份额持有人大会(通讯方式)表决通过,并经中国证监会2007年10月26日证监基金字[2007]293号文核准,泰信中短期债券投资基金变更为泰信双息双利债券型证券投资基金,自2007年10月31日起,由《泰信中短期债券投资基金基金合同》修订而成的《泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同》正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本更新招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征,充分考虑投资者自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险,包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资者作出投资决策后,基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

说明:本摘要摘自《泰信双息双利债券型证券投资基金更新招募说明书(2010年第1号)》,所载内容截止日期为2010年4月30日,有关财务数据和净值表现截止日为2010年3月31日。原招募说明书及其历次定期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。

二、基金管理人

(一)基金管理人概况

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
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。

公司目前下设市场部、营销部(分华东、华北、华南三大营销中心和电子商务部)、客服中心、基金投资部、研究部、理财顾问部、清算会计部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部、北京分公司、深圳分公司。截至2010年4月,公司有正式员工108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。

截止至2010年3月31日,基金管理人共管理泰信天天收益货币、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、泰信债券增强收益等7只开放式证券投资基金,基金资产规模119.29亿元。

(二)注册资本、股权结构

根据公司股东会二〇〇八年第一次(通讯)会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可[2008]564号《关于核准泰信基金管理有限公司变更注册资本的批复》,泰信基金管理有限公司注册资本从10000万元变更为20000万元人民币,其中,山东省国际信托有限公司增加出资4500万元人民币,江苏省投资管理有限责任公司增加出资3000万元人民币,青岛国信实业有限公司增加出资2500万元人民币。公司目前的股权结构如下:

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	2亿元人民币	100%

(三)主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、及其他高级管理人员的基本情况

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党委书记、董事长、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、香港博鹏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,青岛市美国照明项目办公室项目经理,青岛国际信托投资公司计划会计处副处长、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,EMBA,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。

俞二牛先生,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。

刘敢庭先生,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。

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。

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、法国巴黎鲁新公司副总经理,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。

李伟群先生,职工监事,经济学博士;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,现任市场发展总监、市场部负责人。

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党委书记、董事长、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。

桑维英女士,副总经理兼董事会秘书,硕士;2002年10月加入泰信基金管理有限公司,经历了公司的筹建及成立,历任监察稽核部负责人兼营销策划部负责人、行政总监、第一届暨第二届监事会职工监事、总经理助理。

韩波先生,副总经理,学士学位;2002年10月加入泰信基金管理有限公司,经历了公司的筹建及成立,历任公司财务负责人、总经理助理。

2、基金经理简介

何俊春女士,基金经理,工商管理硕士,12年证券从业经历,曾任职于上海鸿安投资咨询有限公司、齐鲁证券有限公司。2002年12月加入泰信基金管理有限公司,先后担任泰信天天收益货币基金交易员、交易主管,泰信天天收益货币基金基金经理助理,2007年2月至2009年4月担任泰信天天收益货币基金基金经理。2008年10月起任泰信双息双利债券基金基金经理,2009年7月29日起兼任泰信债券增强收益基金基金经理。

侯燕琳女士,管理学硕士、证券从业经验11年。曾在中国农村发展信托投资公司、中国华融信托投资公司、京华山一国际香港有限公司任职。自2006年6月进入泰信基金管理有限公司,先后担任研究部研究员、基金投资部基金经理助理。2009年4月起任泰信双息双利债券基金基金经理。

附:本基金历任基金经理情况:

姓名	管理本基金的时间
冯俊	2007年2月9日至2008年10月10日
王鹏	2006年6月15日至2008年3月20日
邱宏斌	2007年12月22日至2008年3月20日

3、投资决策委员会成员名单

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;

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;

陈友平先生:投资副总监,兼固定收益投资总监。

另外,相关基金经理、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

本基金之基金托管人为中国工商银行股份有限公司(简称"中国工商银行"),基本情况如下:

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
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:姜建清
注册资本:人民币334,018,850.026元
联系人:蒋松云
联系电话:010-66105799

四、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、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

2、代销机构

①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

②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
传真:010-66594942
客服电话:95566
网址:www.boc.cn

③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

④中国农业银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:项俊波
传真:010-85109219
客服电话:95599
网址:www.95599.cn

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:郭树清
传真:010-66275654
客服电话:95533
网址:www.ccb.com

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:倪东云
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:张青
电话:0755-82088888
传真:0755-82080714
客服电话:95501
网址:www.sdb.com.cn

⑩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

⑪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:董云巍 吴海鹏
电话:010-58351666
传真:010-83914283
客服电话:95568
网址:www.cmbc.com.cn

⑫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:王澜
电话:010-66223584
传真:010-66226073
客服电话:010-96169
网址:www.bankofbeijing.com.cn

⑬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

⑭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:张萍
电话:021-68475888
传真:021-68476111
客服电话:021-962888
网址:www.bankofshanghai.com

⑮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:黄立哲
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

⑯厦门银行股份有限公司
住所:宁波市江东区中山路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:胡扶勤
电话:021-63586210
传真:021-63586215
客服电话:96528、962528(上海地区)
网址:www.nbcb.com.cn

⑰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

⑱福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
联系人:周敏祺
电话:021-38676666
传真:021-38670666
客服电话:400-8888-666
网址:www.gtja.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:北京市东城区朝阳门内大街188号
法定代表人:张佑君
联系人:阚明
传真:010-65182261
客服电话:400-8888-108
网址:www.csc108.com

⑳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号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
联系人:齐晓燕
电话:0755-82130833
传真:0755-82133302
客服电话:95536
网址:www.guosen.com.cn

㉑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楼
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45楼
法定代表人:宫少林
联系人:黄健
电话:0755-82943511
传真:0755-82943100
客服电话:95565
网址:www.newone.com.cn

㉒广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河北路183号大都会广场43楼
办公地址:广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼
法定代表人:王志伟
联系人:黄岚
电话:020-87555888
传真:020-87555417
客服电话:95575
网址:www.gf.com.cn

㉓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
联系人:陈忠
电话:010-84588888
传真:010-84865560
网址:www.ecitic.com

㉔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
办公地址: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:顾伟国
联系人:李洋
电话:010-66568888
传真:010-66568116
客服电话:400-8888-888
网址:www.chinastock.com.cn

㉕海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
联系人:李笑鸣
电话:021-23219000
传真:021-23219100
客服电话:95553
网址:www.htsec.com

㉖华泰联合证券股份有限公司
注册地址:深圳市深南东路5047号发展银行大厦10、24、25层
办公地址:深圳市深南东路5047号发展银行大厦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

㉗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:黄维琳
电话:021-54033888
传真:021-54038844
客服电话:021-962505
网址:www.sw2000.com.cn

㉘友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
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼
法定代表人:牛冠兴
联系人:余江
电话:0755-82825555
传真:0755-82825550
客服电话:4008-001-001
网址:www.guosen.com.cn

㉙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
联系人:李梦诗
电话:021-68634518
传真:021-68865680
客服电话:400-8881-551
网址:www.xcsc.com www.eestart.com

㉚万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:李舫金
联系人:刘广
电话:020-87692648
传真:020-87692563
客服电话:400-8888-133
网址:www.wlzq.com.cn

㉛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
联系人:王睿
电话:0755-83007069
传真:0755-83007167
客服电话:0755-26982993
网址:www.ydsc.com.cn

㉜渤海证券有限责任公司
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

㉝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
联系人:张小波
电话:025-8445777-248
传真:025-84579763
客服电话:4008-888-168
网址:www.htsc.com.cn

㉞山西证券有限公司公司
注册地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
办公地址: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
联系人:张治国
电话:0351-8686703
传真:0351-8686619
客服电话:400-666-1618
网址:www.i618.com.cn

㉟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:史浩民
联系人:刘光明
电话:0532-85022273
传真:0532-85022605
客服电话:0532-96577
网址:www.zxwt.com.cn

㊱江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
办公地址:江西省南昌市抚河北路291号
法定代表人:姚江涛
联系人:戴蕾
电话:0791-6768763
传真:0791-6789414
客服电话:0791-6768763
网址:www.scstock.com

㊲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22-29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼21-29层
法定代表人:王益民
联系人:吴宇
电话:021-63325888-3108
传真:021-63326173
客服电话:95503
网址:www.dfzq.com.cn

㊳长城证券有限责任公司
注册地址: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
联系人:匡婷
电话:0755-83516289
传真:0755-83516199
客服电话:0755-33680000、400-6666-888
网址:www.cc168.com.cn

㊴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
办公地址: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
客服电话:400-8888-788、10108998
网址:www.ebscn.com

㊵上海证券有限责任公司
注册地址:上海市西藏中路336号
办公地址: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:021-53519888
传真:021-53519888
客服电话:
网址:www.962518.com

㊶新时代证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区月坛北街2号月坛大厦1501室
办公地址:北京市西城区金融大街1号A座8层
法定代表人:马金声
联系人:戴荻
电话:010-83561000
传真:010-83561001
客服电话:4006989898
网址:www.xsdzq.cn

㊷平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼
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:周璐
电话:400-8866338
传真:0755-82400862
客服电话:400-8816-168
网址:www.pingan.com

㊸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、4008096518
网址:www.huaans.com.cn

㊹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楼
办公地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
法定代表人:周晖
联系人:郭磊
电话:0731-84403319
传真:0731-84403439
客服电话:0731-84403350
网址:www.cfzq.com

㊺国都证券有限责任公司
注册地址:北京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(100007)
法定代表人:王少华
联系人:黄静
电话:010-84183389
传真:010-84183273
客服电话:400-818-8118
网址:www.guodu.com

㊻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:贺绍君
联系人:刘宇
电话:021-65546079
传真:021-65526481
客服电话:400-8811-177或拨打各城市营业网点咨询电话
网址:http:/www.xzsec.com

㊼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
办公地址: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
客服电话:400-620-8888
网址:www.bocichina.com.cn

㊽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:韩璧
联系人:常向东
电话:0471-4913998
传真:0471-4930707
客服电话:0471-4961259
网址:www.cnht.com.cn

㊾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:400-800-0562
网址:www.hysec.com

㊿齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路20518号
办公地址:山东省济南市经十路20518号
法定代表人:李玮
联系人:傅咏梅
电话:0531-81283938
传真:0531-81283900
客服电话:95538或拨打各城市营业网点咨询电话
网址:www.qlzq.com.cn

51)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
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人:陆涛
联系人:金春
电话:0755-83025695
传真:0755-83025625
客服电话:400-8888-228
网址:www.jyzq.cn

52)财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:上海市福山路500号城建大厦26楼
法定代表人:方加春
联系人:罗芳
电话:021-68761616
传真:021-68767981
客服电话:400-8888-128
网址:www.tebon.com.cn

53)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座19楼
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A座19楼
法定代表人:杨小阳
联系人:刘权
电话:0755-82026688
传真:0755-82026590
客服电话:4006-008-008
网址:www.cjis.cn

54)江海证券经纪有限责任公司
注册地址: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
联系人:葛新
电话:0451-82269268
传真:0451-82269290
客服电话:4006662288
网址:www.jhzq.com.cn

55)华宝证券有限责任公司
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
联系人:楼斯佳
电话:021-50122222
传真:021-50122200
客服电话:400-820-9898
网址:www.cnhbstock.com

56)爱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
联系人:陈敏
电话:021-62171984
传真:021-62878783
客服电话:021-63340678
网址:www.ajzq.com

57)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:张腾
客户热线:96326(福建省外请先拨0591)
网址:www.gfhfzq.com.cn

58)国金证券股份有限公司
注册地址:成都市东城根上街95号
办公地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
电话:028-86690126
传真:028-86690126
联系人:金喆
客户热线:4006-600109
网址:www.gjzq.com.cn

(二)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23日
电话:021-50372168
传真:021-58782437
联系人:韩波
网址:www.ftfund.com

(三)出具法律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 田卫红

(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:泰信双息双利债券型证券投资基金
基金简称:泰信双息双利债券

六、基金的类型

契约型开放式

七、基金的投资方向

本基金主要投资于债券类金融工具。债券类金融工具包括国债、央行票据、金融债、信用等级为投资级的企业债(包括可转债)、可分离性债券、短期融资券、资产支持证券等法律法规或中国证监会允许投资的固定收益品种。上述资产投资比例不低于基金资产的80%。其中,本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金可以参与一级市场新股申购、股票、权证的投资,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非债券类品种。非债券类金融工具的投资比例不超过基金资产的20%。

此外,如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。

八、基金的投资目标

本基金的投资目标是在获取债券稳定收益的基础上,通过股票一级市场中购及适当的二级市场投资等手段谋求高于投资基准的收益。

九、基金的投资策略

(一)资产配置

在本基金投资管理计划中,投资策略由自上而下的资产配置计划和自下而上的选股(或债券)计划组成,本基金根据对宏观经济形势、货币和财政政策变化、经济周期及利率走势、企业盈利和信用状况等等的动态分析,在限定投资范围内,决定债券类资产、股票类等工具的配置比例,并跟踪影响资产策略配置的各种因素的变化,定期对资产策略配置比例进行调整。

在进行债券类等资产的总体策略配置时,本基金将通过对宏观经济、市场利率、资金市场工具供求关系、资金市场发展状况、申购赎回现金流情况、季节性资金流动变化等因素的综合分析,决定债券类属资产等工具的配置比例;

本基金通过市场价值中枢研判系统,根据市场即时市盈率与市场价值中枢的偏离程度,调整股票类属资产配置比例。本基金的股票投资作为债券投资的辅助和补充,本基金以本金安全为最重要因素、审慎考察二级市场股票投资。在严格控制风险的情况下,提高基金的收益率,为投资者获得长期稳定的回报。

(二)债券类资产配置策略

①货币市场工具投资

在本基金的货币市场工具投资过程中,将以严谨的市场价值分析为基础,采用稳健的投资组合策略,通过对短期金融工具的组合操作,在保持资产流动性的同时,追求稳定的投资收益。具体来说:

① 在保证流动性的前提下,利用现代金融分析方法和工具,寻找价值被低估的投资品种和无风险套利机会;

② 根据各期限各品种的流动性、收益性以及信用水平来确定货币市场工具组合资产配置;

③ 根据市场资金供给情况对货币市场工具组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整。

②债券(可转债除外)投资

在本基金的债券(可转债除外)投资过程中,本基金管理人将采取积极主动的投资策略,以中长期利率趋势分析为基础,结合中长期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的债券组合投资收益。本基金所采取的主动式投资策略涉及债券组合构建的三个步骤:确定债券组合久期、确定债券组合期限结构配置和挑选个券。其中,每个步骤都采取特定的主动投资子策略,以尽可能地控制风险、提高基金投资收益。

① 确定组合久期。主动式投资策略通过积极主动地预测市场利率的变动趋势,相应调整债券组合的久期配置,以达到利用市场利率的波动和债券组合的久期特性提高债券组合收益率的目的。本基金在确定债券组合久期时,在进行债券市场发展趋势及市场利率波动预期的基础上,结合本基金债券组合的利率弹性特征,从而确定债券组合的久期配置。

② 决定债券组合的期限结构配置。在决定本基金债券组合的久期后,本基金主要采用收益率曲线分析策略决定组合的期限结构配置。所谓收益率曲线分析策略,即通过考察市场收益率曲线的动态变化及预期变化,寻求在一段时期内获取因收益率曲线形状变化而导致的债券价格变化所产生的超额收益的策略。债券收益率曲线是市场对当前经济状况的判断及对未来经济走势预期的结果。分析债券收益率曲线,不仅可以非常直观地了解当前债券市场整体状态,而且能通过收益率曲线隐含的远期利率,分析预测收益率曲线的变化趋势,从而把握债券市场的走向。

在本基金的组合构建过程中,收益率曲线分析策略将根据债券收益率曲线变动、各期限段品种收益率及收益率基差波动等因素分析,预测收益率曲线的变动趋势,并结合短期资金利率水平与变动趋势,形成具体的收益率曲线组合策略,从而确定本基金债券组合中不同期限结构的配置。

③ 选择个券,构建组合。在确定债券组合的期限结构后,本基金将主要运用收益率基差分析策略,通过对不同类别债券的收益率基差分析,预测其变动趋势,及时发现由于基(利)差超出债券内在价值所决定的差异而出现的价值被低估的债券品种,并结合税收差异和信用风险溢价等因素进行分析,综合评判个券的投资价值,以挑选风险收益特征最匹配的券种,建立具体的个券组合。在具体运用收益率基差分析策略中,本基金还将采用换券利差交易策略、凸性套利交易策略以及骑乘收益率曲线策略等交易策略。除以上常用策略外,在本基金债券投资过程中,基金管理人还将采用一级市场参与策略以及无风险套利策略等。

④可转债投资

对于本基金中可转债的投资,本基金管理人主要采用可转债相对价值分析策略。由于可转债兼具债性和股性,其投资风险和收益介于股票和债券之间,可转债相对价值分析策略通过分析不同市场环境下其股性和债性的相对价值,把握可转债的价值走向,选择相应券种,从而获取较高投资收益。其次,在进行可转债筛选时,本基金还对可转债自身的基本面要素进行综合分析。这些基本面要素包括股性特征、债性特征、流动性等。本基金还会充分借鉴基金管理人股票分析团队的研究成果,对可转债的基础股票的基本面进行分析,形成对基础股票的价值评估。将可转债自身的基本面评分和其基础股票的基本面评分结合在一起,最终确定投资的品种。

(三)股票投资策略

本基金的股票投资包括新股申购、股票增发等一级市场投资和股票二级市场投资。

①新股申购、股票增发等一级市场投资策略

在参与股票一级市场投资的过程中,本基金管理人将全面深入地把握上市公司基本面,运用泰信基金的研究平台和股票信值体系,深入发掘新股内在价值,结合市场估值水平和股市投资环境,充分发挥本基金作为机构投资者在新股询价发行过程中的对新股定价所起的积极作用,积极参与新股的申购、询价与配售,有效识别并防范风险,以获取较好收益。

②二级市场股票投资策略

①市场价值中枢研判系统。本基金二级市场股票投资策略和风险控制技术密切相关。通过市场价值中枢研判系统,结合对经济结构调整过程中政策、法规的变化地及时应变和灵活实施。通过对时间加权移动平均PE值、PE动量)、PB动量等指标的综合分析,合理评估市场价值中枢。根据市场即时市盈率与市场价值中枢的偏离程度,灵活调整大类资产配置比例。

②个股选择的方法。本基金股票资产将主要投资于那些具有良好的现金分红纪录、或具有现金分红潜力的各行业优质上市公司。同时本基金将依据证券市场和上市公司基本面的变化,将股票资产的部分投资于其他非现金分红特征、价值低估的上市公司股票。

(四)权证投资策略

①考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素,估计权证合理价值。

②根据权证合理价值与其市场价格间的差幅即"估值差价"(Value Price)"以及权证合理价值对定价参数的敏感性,结合标的股票合理价值考量,决策买入、持有或沽出权证。

在将来衍生工具市场得到发展的情况下,本基金