

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2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

本报告送出日期:二〇一〇年十二月十五日

投资组合报告等内容,保证其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

1. 基金名称:泰信双息双利债券型证券投资基金

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	36,221,915.40	11.29
	其中:股票	36,221,915.40	11.29
2	固定收益投资	264,898,960.80	82.54
	其中:债券	264,898,960.80	82.54
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	其他资产	2,859,014.33	0.89
	合计	323,939,370.96	100.00

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	5,331,869.00	1.20
B	采矿业	-	-
C	制造业	23,589,296.25	8.52
D	食品、饮料	2,266,000.00	0.82
C1	纺织、服装、皮毛	1,226,653.30	0.44
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	10,163,215.89	3.67
C6	金属、非金属	1,676,397.06	0.61
C7	机械、设备	4,064,230.00	1.47
C8	医药、生物制品	3,222,600.00	1.16
C9	其他制造业	970,140.00	0.35
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,334,982.27	1.21
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	5,965,827.88	2.16
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	36,221,915.40	13.09

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	002479	富春环保	129,313	3,334,982.27	1.21
2	002255	招商重工	70,500	2,915,880.00	1.05
3	300118	东方日升	61,622	2,858,028.36	1.03
4	000729	南京港	100,000	2,266,000.00	0.82
5	002414	高德红外	80,085	2,200,735.80	0.80
6	300102	乾照光电	27,039	2,048,745.03	0.74
7	600276	恒瑞医药	40,000	1,951,000.00	0.71
8	002477	雏鹰农牧	36,678	1,894,418.70	0.68
9	300101	国腾电子	25,504	1,820,475.52	0.66
10	300093	国海证券	79,601	1,676,397.06	0.61
	合计			264,898,960.80	95.73

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	148,155,000.00	53.54
2	央行票据	49,945,000.00	18.05
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	51,255,452.80	18.52
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	15,543,508.00	5.62
7	其他	-	-
	合计	264,898,960.80	95.73

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	020208	10国债02	1,500,000	148,155,000.00	53.54
2	1001060	10国债06	200,000	20,000,000.00	7.25
3	120501	10石化01	210,000	21,000,000.00	7.61
4	110008	王府转债	92,560	12,777,908.00	4.62
5	122957	09广汇1	120,280	12,448,280.00	4.39

6. 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有发行主体被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	2,544,183.44
5	其他应收款	64,830.89
6	待摊费用	-
7	其他	-
	合计	2,859,014.33

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	110008	王府转债	92,560	12,777,908.00	4.62

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002479	富春环保	3,334,982.27	1.21	新股锁定
2	300118	东方日升	2,266,000.00	0.82	新股锁定
3	002414	高德红外	2,200,735.80	0.80	新股锁定
4	300102	乾照光电	2,048,745.03	0.74	新股锁定
5	002477	雏鹰农牧	1,894,418.70	0.68	新股锁定
6	300101	国腾电子	1,820,475.52	0.66	新股锁定
7	300093	国海证券	1,676,397.06	0.61	新股锁定
	合计		2,859,014.33		

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	110008	王府转债	92,560	12,777,908.00	4.62

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002479	富春环保	3,334,982.27	1.21	新股锁定
2	300118	东方日升	2,266,000.00	0.82	新股锁定
3	002414	高德红外	2,200,735.80	0.80	新股锁定
4	300102	乾照光电	2,048,745.03	0.74	新股锁定
5	002477	雏鹰农牧	1,894,418.70	0.68	新股锁定
6	300101	国腾电子	1,820,475.52	0.66	新股锁定
7	300093	国海证券	1,676,397.06	0.61	新股锁定
	合计		2,859,014.33		

注:1. 本基金建仓期为六个月,建仓期间,本基金投资组合比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:2. 本基金投资于股票资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:3. 本基金投资于固定收益资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:4. 本基金投资于权证资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:5. 本基金投资于股指期货资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:6. 本基金投资于国债期货资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:7. 本基金投资于商品期货资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:8. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:9. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:10. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:11. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:12. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:13. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:14. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:15. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

原基金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,准予同意泰信基金

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

本报告送出日期:二〇一〇年十二月十五日

投资组合报告等内容,保证其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	36,221,915.40	11.29
	其中:股票	36,221,915.40	11.29
2	固定收益投资	264,898,960.80	82.54
	其中:债券	264,898,960.80	82.54
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	其他资产	2,859,014.33	0.89
	合计	323,939,370.96	100.00

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	5,331,869.00	1.20
B	采矿业	-	-
C	制造业	23,589,296.25	8.52
D	食品、饮料	2,266,000.00	0.82
C1	纺织、服装、皮毛	1,226,653.30	0.44
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	10,163,215.89	3.67
C6	金属、非金属	1,676,397.06	0.61
C7	机械、设备	4,064,230.00	1.47
C8	医药、生物制品	3,222,600.00	1.16
C9	其他制造业	970,140.00	0.35
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,334,982.27	1.21
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	5,965,827.88	2.16
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	36,221,915.40	13.09

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	002479	富春环保	129,313	3,334,982.27	1.21
2	002255	招商重工	70,500	2,915,880.00	1.05
3	300118	东方日升	61,622	2,858,028.36	1.03
4	000729	南京港	100,000	2,266,000.00	0.82
5	002414	高德红外	80,085	2,200,735.80	0.80
6	300102	乾照光电	27,039	2,048,745.03	0.74
7	600276	恒瑞医药	40,000	1,951,000.00	0.71
8	002477	雏鹰农牧	36,678	1,894,418.70	0.68
9	300101	国腾电子	25,504	1,820,475.52	0.66
10	300093	国海证券	79,601	1,676,397.06	0.61
	合计			264,898,960.80	95.73

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	148,155,000.00	53.54
2	央行票据	49,945,000.00	18.05
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	51,255,452.80	18.52
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	15,543,508.00	5.62
7	其他	-	-
	合计	264,898,960.80	95.73

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	020208	10国债02	1,500,000	148,155,000.00	53.54
2	1001060	10国债06	200,000	20,000,000.00	7.25
3	120501	10石化01	210,000	21,000,000.00	7.61
4	110008	王府转债	92,560	12,777,908.00	4.62
5	122957	09广汇1	120,280	12,448,280.00	4.39

6. 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有发行主体被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	2,544,183.44
5	其他应收款	64,830.89
6	待摊费用	-
7	其他	-
	合计	2,859,014.33

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	110008	王府转债	92,560	12,777,908.00	4.62

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002479	富春环保	3,334,982.27	1.21	新股锁定
2	300118	东方日升	2,266,000.00	0.82	新股锁定
3	002414	高德红外	2,200,735.80	0.80	新股锁定
4	300102	乾照光电	2,048,745.03	0.74	新股锁定
5	002477	雏鹰农牧	1,894,418.70	0.68	新股锁定
6	300101	国腾电子	1,820,475.52	0.66	新股锁定
7	300093	国海证券	1,676,397.06	0.61	新股锁定
	合计		2,859,014.33		

注:1. 本基金建仓期为六个月,建仓期间,本基金投资组合比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:2. 本基金投资于股票资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:3. 本基金投资于固定收益资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:4. 本基金投资于权证资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:5. 本基金投资于股指期货资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:6. 本基金投资于国债期货资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:7. 本基金投资于商品期货资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:8. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:9. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:10. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:11. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:12. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:13. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:14. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:15. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:16. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:17. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:18. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:19. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:20. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:21. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:22. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:23. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:24. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。

注:25. 本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例符合基金合同关于投资组合比例的相关规定。