泰信双息双利债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2018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：二〇一八年十二月七日

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。

本更新招募说明书所载有关财务数据（未经审计）和投资组合数据的截止日为2018年9月30日，净值表现数据的截止日期为2018年9月30日，其他内容截止日期为2018年10月30日。原招募说明书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：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路256号37层
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路256号 华夏银行大厦36、37层
成立日期：2003年5月23日
法定代表人：万众
总经理：葛航
电话：021-20899188
传真：021-20899008
联系人：姚慧
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股份有限公司）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。

公司目前下设上海锐懿资产管理有限公司、市场部、产品部、营销部（分华东、华北、华南三大营销中心）、理财顾问部、深圳分公司、北京分公司、电子商务部、客服中心、基金投资部、研究部、专户投资部、清算会计部、集中交易部、计划财务部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部。截至2018年10月底，公司有正式员工102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。

截至2018年10月30日，泰信基金管理有限公司旗下共有泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活混合、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选混合、泰信债券增强收益、泰信发展主题混合、泰信债券周期回报、泰信中证200指数、泰信中小盘精选混合、泰信行业精选混合、泰信中证基本面400指数分级、泰信现代服务业混合、泰信鑫益定期开放债券、泰信国策驱动混合、泰信鑫选混合、泰信互联网+混合、泰信智选成长混合、泰信鑫利混合、泰信竞争优选混合共21只开放式基金及9个特定客户资产管理计划。

（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。其中，山东省国际信托股份有限公司出资9000万元，占公司总股本的45%；江苏省投资管理有限责任公司出资6000万元，占公司总股本的30%；青岛国信实业有限公司出资5000万元，占公司总股本的25%。

（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

万众，董事长，高级经济师，硕士；曾任山东省国际信托有限公司副总经理，山东省鲁信实业集团有限公司副总经理，山东省鲁信实业集团有限公司董事长、总经理，现任山东省国际信托股份有限公司总经理。

葛航先生，董事，总经理，上海锐懿资产管理有限公司执行董事，学士；1989年7月加入山东省国际信托有限公司，曾任山东省国际信托有限公司租赁部高级业务经理、山东省国际信托有限公司自营业务部经理。

校登楼，董事，高级会计师，注册会计师，本科。曾任江苏省国际信托投资公司证券部副科长，江苏省国信集团审计部部长、项目经理、高级经理，现任江苏省投资管理有限公司财务部副总经理。

王静玉先生，董事，国际金融硕士，曾任青岛国信融资担保有限公司副总经理，青岛国信金融控股有限公司研究发展部副经理，青岛国信资本投资有限公司副总经理，青岛国信创新股权投资管理有限公司执行董事兼总经理，现任青岛国信金融控股有限公司副总经理，青岛久时投资管理有限公司执行董事兼法人，青岛国信资本投资有限公司总经理兼董事，青岛海洋创新产业投资基金有限公司总经理兼董事。

李华强先生，独立董事，经济学硕士，曾任中国有色金属工业总公司株洲冶炼厂总经理，深圳科技工业园总公司总经理助理，国信证券股份有限公司副总经理，浙江（方正）证券股份有限公司董事长、党委书记兼总裁，华西证券股份有限公司副总裁，华林证券股份有限公司总裁、党委副书记，中央汇金投资有限责任公司副董事长。

王川先生，独立董事，经济管理学大专，高级经济师；曾任山西省委政策研究室干部、省委办公厅秘书，中国农业银行办公室秘书，综合处副处长，人事教育部副主任，研究室副主任，信贷业务部主任，吉林分行行长兼党组书记，党组成员兼纪检组组长，副行长兼党组成员（党委委员），副行长兼党委副书记，中国光大（集团）总公司副董事长、党委副书记兼中国光大银行副董事长、行长，中国中信集团公司副董事长、党委委员，中信（金融）控股总裁。

郝亮，独立董事，本科。曾任中国建设银行青岛市支行副行长、分行办公室副主任，青岛市住房公积金管理中心副主任，深圳大通实业股份有限公司董事会秘书，深圳大通实业股份有限公司副董事长，兼董事会秘书。

（2）监事会成员

刘晓东先生，监事会主席，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；现任青岛国信胶州湾交通有限公司董事长。

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投资部经理；现任山东鲁信投资控股公司投资管理部高级业务经理。

李小明，监事，助理经济师，本科。曾任江苏省投资贸易公司办公室副主任、主任，江苏省投资贸易公司业务二部经理，江苏省投资贸易公司综合投资部经理、高级经理。江苏省投资管理有限公司综合投资部副总经理。

周向光先生，职工监事，本科。2002年12月加入泰信基金管理有限公司，先后担任综合管理部副经理，北京办事处主任，行政副总监兼理财顾问部业务总监，现任监事工作部主任、综合管理部副总监、工会主席。

张萍历女士，职工监事，硕士。2007年7月加入泰信基金管理有限公司，现任公司集中交易部总监。

胡因女士，职工监事，经济学硕士。2006年加入泰信基金管理有限公司，现任监察稽核部总监。

（3）公司高级管理人员

万众，董事长，高级经济师，硕士；曾任山东省国际信托有限公司副总经理，山东省鲁信实业集团有限公司副总经理，山东省鲁信实业集团有限公司董事长、总经理，现任山东省国际信托股份有限公司总经理。

葛航先生，董事，总经理，上海锐懿资产管理有限公司执行董事，学士；1989年7月加入山东省国际信托有限公司，曾任山东省国际信托有限公司租赁部高级业务经理、山东省国际信托有限公司自营业务部经理。

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。经历了泰信基金管理有限公司的筹建及成立，并担任公司督察长至今。

桑维英女士，副总经理兼董事会秘书，上海锐懿资产管理有限公司监事，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、第一届及第二届监事会职工监事、总经理助理。

韩波先生，副总经理，大学本科；曾先后任山东国投上海证券部财务经理，鲁信投资有限公司财务、投资管理部门经理。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，工商管理硕士，证券从业经历22年。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的基金经理助理，2007年2月至2009年4月担任泰信天天收益货币基金的基金经理。自2008年10月10日起担任泰信双息双利债券基金的基金经理；自2009年7月29日起担任泰信债券增强收益基金的基金经理；自2012年10月25日起担任泰信债券周期回报基金的基金经理；自2013年7月17日起担任泰信鑫益定期开放债券基金的基金经理；自2016年10月11日起担任泰信天天收益货币基金经理；自2017年5月25日起担任泰信鑫利混合基金经理。现同时担任投资部固定收益投资总监。

附：本基金历任基金经理情况：

姓名	管理本基金的时间
侯燕琳	2009年4月25日至2012年8月7日
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

本基金管理人采取集体投资决策制度，由分管投资的副总经理韩波先生担任投资决策委员会主任，投资决策委员会成员如下：

葛航先生，董事，总经理、上海锐懿资产管理有限公司执行董事；

韩波先生，副总经理；

朱志权先生，基金投资部总监兼投资总监，泰信优势增长混合、泰信智选成长混合基金的基金经理；

梁剑先生，研究部副总监兼研究副总监；

何俊春女士，基金投资部固定收益投资总监，泰信天天收益货币基金经理、泰信双息双利债券基金、泰信债券增强收益基金、泰信债券周期回报基金、泰信鑫益定期开放债券基金、泰信鑫利混合基金的基金经理；

另外，督察长、风险管理部负责人、监察稽核部负责人及相关基金经理列席会议。

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：
名称：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
成立时间：1984年1月1日
法定代表人：易会满
注册资本：人民币35,640,625.71万元
联系电话：010-66105799
联系人：郭明

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：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路256号37层
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路256号 华夏银行大厦36、37层
法定代表人：万众
总经理：葛航
成立日期：2003年5 月23日
电话：021-20899188
传真：021-20899008
联系人：史明伟
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
传真：010-66215968
联系人：林洁
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：深圳市福田区福华一路98号卓越大厦1608室
电话：0755-33988759
传真：0755-33988757
联系人：史明伟
网址：www.ftfund.com
2、销售机构
（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：易会满
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：陈四清
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：彭纯
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：周慕冰
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：田国立
传真：010-66275654
客服电话：95533
网址：www.ccb.com
（6）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：北京市西城区太平桥大街25号光大中心
法定代表人：李晓鹏
联系人：朱红
电话：010-63636153
传真：010-63639709
客服电话：95595
网址：www.cebbank.com
（7）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：李建红
联系人：邓炯鹏
电话：0755-83198888
传真：0755-83195049
客服电话：95555
网址：www.cmbchina.com
（8）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：金煜
联系人：汤征程
电话：021-68475521
传真：021-68476497
客服电话：021-962888
网址：www.bankofshanghai.com
（9）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：高国富
联系人：倪苏云
电话：021-61618888
传真：021- 63604199
客服电话：95528
网址：www.spdb.com.cn
（10）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9号
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街9号
法定代表人：李庆萍
联系人：迟卓
传真：010-85230059
客服电话：95558
网址：bank.ecitic.com
（11）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：李民吉
客服电话：95577
网址：www.hxb.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：张东宁
联系人：谢小华
电话：010-66223587
传真：010-66226045
客户服务电话：95526
公司网站：www.bankofbeijing.com.cn
北京银行在北京、天津、上海、西安、深圳、杭州、长沙、南京、济南、南昌的各营业网点接受办理开户和认购业务。
（13）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：洪崎
联系人：董云巍 吴海鹏
客服电话：95568
网址：www.cmbc.com.cn
（14）平安银行股份有限公司
注册地址：广东省深圳市深南东路5047号
办公地址：广东省深圳市深南东路5047号
法定代表人：谢永林
联系人：张莉
电话：021-38637673
传真：021-50979507
客服电话：95511-3
网址：bank.pingan.com
（15）宁波银行股份有限公司
注册地址：宁波市江东区中山东路294号
办公地址：宁波市鄞州区宁南南路700号宁波银行24楼
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：胡升荣
联系人：翁俊
电话：025-84544021
传真：025-84544129
客户服务：40088-96400
网址：www.njcb.com.cn
（17）金华银行股份有限公司
注册地址：金华市金东区光南路668号
办公地址：金华市金东区光南路668号
法定代表人：徐雅清
联系人：李飒
电话：0579-82178322
传真：025-84544129
客服电话：400-7116668 0579-2178322
网址：www.jhccb.com
（18）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168 号上海银行大厦29 层
法定代表人：杨德红
联系人：芮敏祺
电话：021-38676666
传真：021-38670666
客服电话：400-8888-666
网址：www.gtja.com
(19)中信建投证券股份有限公司
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：王常青
联系人：权唐
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1010号国际信托大厦21楼
法定代表人：何如
联系人：周杨
电话：0755-82130833
传真：0755-82133952
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：霍达
联系人：林生迎
电话：0755-82960223
传真：0755-83734343
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：广州市天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）
办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41和42楼
法定代表人：孙树明
联系人：黄岚
客服电话：95575或致电各地营业网点
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
办公地址：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：张佑君
联系人：陈忠
电话：010-84588888
传真：010-60838888
客服电话：95558
网址：www.cs.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2-6层
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：陈共炎
联系人：田薇
电话：010-66568888
传真：010-66568990
客服电话：400-8888-888或95551
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
办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人：周杰
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）申万宏源证券有限公司
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人：李梅
联系人：黄莹
电话：021-33389888
传真：021-33388224
客服电话：95523或4008895523
网址：www.swhysc.com
注：鉴于申银万国证券股份有限公司和宏源证券股份有限公司的合并事宜，业务整合将会持续一定的时期，申购、赎回、转换、定投等业务暂时沿用各代销网点原有规则；后续若有更新，请以公示信息为准。
（27）安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35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层、28层A02单元
深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人：王连志
联系人：陈剑虹
电话：0755-82825551
传真：0755-82558355
统一客服电话：4008-001-001
网址：www.essence.com.cn
（28）湘财证券股份有限公司
注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
法定代表人：孙永祥
联系人：李欣
电话：021-38784580-8918
传真：021-68865680
客服电话：95351
网址：www.xcsc.com
（29）万联证券股份有限公司
注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
办公地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
法定代表人：张建军
联系人：王鑫
电话：020-38286651
传真：020-22373718-1013
客服电话：400-8888-133
网址：www.wlzq.com.cn
（30）民生证券股份有限公司
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：冯鹤年
联系人：赵明
电话：010-85127622
传真：010-85127917
客服电话：400-619-8888
网址：www.mszq.com
（31）渤海证券股份有限公司
注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
法定代表人：杜庆平
联系人：蔡霆
联系电话：022-28451991
传真：022-28451892
客户服务电话：400-6515-988
网址：www.bhzq.com
（32）华泰证券股份有限公司
注册地址：南京市江东中路228号
办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场
法定代表人：周易
联系人：庞晓芸
电话：0755-82492193
传真：0755-82492962（深圳）
客户服务电话：95597
网址：www.htsc.com.cn
（33）山西证券股份有限公司
注册地址：太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
办公地址：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：郭熠
电话：0351-8686659
传真：0351-8686619
客服电话：400-666-1618
网址：www.i618.com.cn
（34）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、23层、25层-29层
办公地址：上海市中山南路318号2号楼13层、21层-23层、25-29层、32 层、36 层、39 层、40 层
法定代表人：潘鑫军
联系人：孔亚楠
电话：021-63325888
传真：021-63326729
客服电话：95503
网址：www.dfzq.com.cn
（35）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：周健男
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
（36）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：上海市黄浦区四川中路213号久事商务大厦8楼
法定代表人：李俊杰
联系人：张瑾
电话：021-53519888
传真：021-53519888
客服电话：021-962518 全国客服热线4008918918
网址：www.962518.com
（37）新时代证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街1号A座8层
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：叶顺德
联系人：孙恺
电话：010-83561000
传真：010-83561001
客服电话：4006989898
网址：www.xsdzq.cn
（38）平安证券股份有限公司
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：何之江
联系人：吴琼
电话：0755-22621866
传真：0755-82400862
客服电话：95511-8
网址：stock.pingan.com
（39）华安证券股份有限公司
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：章宏韬
联系人：甘霖
电话：0551-5161821
传真：0551-5161672
客服电话：95318、400-809-6518
网址：www.hazq.com.cn
（40）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：蔡一兵
联系人：郭磊
电话：0731-84403319
传真：0731-84403439
客服电话：0731-84403350
网址：www.cfzq.com
（41）国都证券股份有限公司
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10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10层（100007）
法定代表人：王少华
联系人：黄静
电话：010-84183333
传真：010-84183311
客服电话：400-818-8118
网址：www.guodu.com
（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
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：宁敏
联系人：王炜哲
电话：021-68604866
传真：021-50372474
客服电话：400-620-8888
网址：www.bocichina.com.cn
（43）中泰证券股份有限公司
注册地址：山东省济南市经七路86号
办公地址：山东省济南市经七路86号
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
电话：0531-68889155
传真：0531-68889752
客服电话：95538或拨打各城市营业网点咨询电话
网址：www.zts.com.cn
（44）中信证券（山东）有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼2001
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层（266061）
法定代表人：姜晓林
联系人：吴忠超
电话：0532-85022326
传真：0532-85022605
客服电话：95548
网址：www.zxwt.com.cn
（45）中航证券有限公司
注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层
办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层
法定代表人：王晓峰
联系人：史江蕊
电话：010-64818301
传真：010-64818443
客服电话：400-8866-567
网址：www.avicsec.com
（46）中国中投证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人：高涛
联系人：刘毅
电话：0755-82023442
传真：0755-82026539
客服电话：400-600-8008
网址：www.china-invs.cn
（47）德邦证券股份有限公司
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：武晓春
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
（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
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：王作义
联系人：马贤清
电话：0755-83025022
传真：0755-83025625
客服电话：400-8888-228
网址：www.jyzq.cn
（49）西藏东方财富证券股份有限公司
注册地址：拉萨市北京中路101号
办公地址：上海市闸北区永和路118弄24号辉河路118号24号
法定代表人：陈宏
联系人：周艳琼
电话：021-36537945
传真：021-36538467
客户服务电话：400-9112-233
网址：www.xzsec.com
客户服务电话：400-88111-77或拨打各城市营业网点咨询电话
（50）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：庞介民
联系人：荀航
电话：0471-4979545
传真：0471-4961259
客服电话：0471-4961259
网址：www.cnht.com.cn
（51）江海证券有限公司
注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址：哈尔滨市松北区创新三路833号13楼
法定代表人：赵洪波
联系人：周俊
电话：0451-85863726
传真：0451-82337279
客服电话：4006662288
网址：www.jhzq.com.cn
（52）长城证券股份有限公司
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：丁益
联系人：刘阳
电话：0755-83516289
传真：0755-83515567
客服电话：0755-33680000、400-6666-888
网址：www.cgws.com
（53）爱建证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道1600号1幢32楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号1幢32楼
法定代表人：祝健
联系人：王薇
电话：021-32229888
传真：021-68728707
客服电话：4001-962502
网址：www.ajzq.com
（54）华宝证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57层
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57层
法定代表人：陈林
联系人：刘闻川
电话：021-68778790
传真：021-68777992
客服电话：400-820-9898
网址：www.cnhbstock.com
（55）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：吴骏
联系人：吴尔晖
电话：0755-83007159
传真：0755-83007034
客服电话：4000-188-688
网址：www.ydsc.com.cn
（56）国金证券股份有限公司
注册地址：四川省成都市东城根上街95号
办公地址：四川省成都市东城根上街95号
法定代表人：冉云
联系人：刘婧漪、贾鹏
电话：028-86690057、028-86690058
传 真：028-86690126
客户热线：95310
网址：www.gjzq.com.cn
（57）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至10层
法定代表人：黄金琳
电话：0591-87383623
传真：0591-87383610
联系人：张腾
客户热线：96326（福建省外请先拨0591）
网址：www.hfzq.com.cn
（58）长江证券股份有限公司
注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：尤习贵
联系人：奚博宇
电话：027-65799999
传真：027-85481900
客户服务热线：95579或4008-888-999
网址：www.95579.com
（59）大通证券股份有限公司
注册地址：大连市中山区人民路24号
办公地址：大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦38-39层
法定代表人：赵玺
电话：0411-39673202
传真：0411-39673219
联系人：谢立军
客户服务电话：4008-169-169
网址：www.daton.com.cn
（60）信达证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址：北京市西城区宣武门西大街甲127号大成大厦6层
法定代表人：张志刚
联系人：唐静
联系电话：010-63081000
传真：010-63080978
客服电话：95321
公司网址：www.cindasc.com
（61）华龙证券股份有限公司
注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址：甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人：李晓安
电话：0931-8888088
传真：09131-4890515
联系人：李昕田
客户服务电话：0931-96668、4890208
网址：www.hlzqgs.com
（62）国联证券股份有限公司
注册地址：江苏省无锡市县前东街168号
办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街8 号国联金融大厦702
法定代表人：姚志勇
联系人：徐欣
联系电话：0510-82831662
联系传真：0510-82830162
客服电话：400-888-5288
公司网址：www.glsc.com.cn
（63）广州证券股份有限公司
注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
法定代表人：胡伏云
联系人：林洁茹
电话：020-88836999
传真：020-88836654
客服电话：95396
网址：www.gzs.com.cn
（64）五矿证券有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元
办公地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47-49楼
法定代表人：黄海洲
客服电话：40018-40028
网址：www.wkzq.com.cn
（65）上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人：张跃伟
客服电话：400-820-2899
网址：www.erichfund.com
（66）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：祖国明
客服电话：4000-766-123
网址：www.fund123.cn
（67）深圳众禄基金销售股份有限公司
办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼
法定代表人：薛峰
客服电话：4006-788-887
网址：www.zlfund.cn及www.jjmmw.com
（68）诺亚正行基金销售有限公司
办公地址：上海市杨浦区长阳路1687号2号楼1楼
法定代表人：汪静波
客服电话：400-821-5399
网址：www.noah-fund.com
（69）上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址：上海市徐汇区龙田路（近田东路）195号3C幢9楼
法定代表人：其实
客服电话：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn
（70）和讯信息科技有限公司
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
客服电话：400-920-0022
网址：licaike.hexun.com
（71）嘉实财富管理有限公司
办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期4606-10单元
法定代表人：赵学军
联系人：景琪
客服电话：400-021-8850
网址：www.harvestwm.cn
（72）中山证券有限责任公司
办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人：黄扬录
联系人：罗艺琳
电话：0755-82570586
传真：0755-82960582
客服电话：95329
网址：www.zszq.com
（73）上海联泰资产管理有限公司
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层
法定代表人：燕斌
联系人：凌秋艳
客服电话：4000-466-788
网址：www.66zichan.com
（74）上海利得基金销售有限公司
办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人：李兴春
联系人：赵沛然
客服电话：400-921-7755
网址：www.leadbank.com.cn
（75）中信期货有限公司
办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
法定代表人：张皓
联系人：洪诚
客服电话：400-990-8826
网址：www.citicsf.com
（76）上海好买基金销售有限公司
办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人：杨文斌
联系人：张茹
客服电话：400-700-9665
网址：www.ehowbuy.com
（77）北京恒天明泽基金销售有限公司
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路39号第一上海中心C座6层
法定代表人：周斌
客服电话：4008-980-618
网址：www.chtfund.com
（78）上海汇付基金销售有限公司
注册地址：上海市黄浦区100号19层
办公地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人：冯修敏
联系人：朱翔宇
客服电话：400-820-2819
(79) 深圳富济基金销售有限公司
注册地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04单位
办公地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04单位
法定代表人：刘鹏宇
联系人：刘勇
电话：0755-83999907-8814
客服电话：0755-83999907
网址：www.fujifund.cn
（80）北京虹点基金销售有限公司
办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层
法定代表人：郑毓栋
联系人：张婷婷
客服电话：400-068-1176
网址：www.hongdianfund.com
（81）中国国际金融股份有限公司
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：丁学东
联系人：秦朗
客服电话：400-910-1166
网址：www.cicc.com
（82）大泰金石基金销售有限公司
办公地址：上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼
法定代表人：姚杨
联系人：何庭宇
客服电话：400-928-2266 021-22267995
网址：www.dtfunds.com
（83）上海陆金所基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号
法定代表人：王之光
联系人：宁博宇
电话：021-20665952
传真：021-22066653
客服电话：4008219031
网址：www.lufunds.com
（84）兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
办公地址：上海市浦东新区长柳路36号
法定代表人：杨华辉
联系人：乔琳雪
电话：021-38565547
传真：021-38565955
客服电话：95562
网址：www.xyzq.com.cn
（85）北京增财基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
法定代表人：罗细安
联系人：李皓
客服电话：400-001-8811
网址：www.zengcaiwang.com
（86）北京钱景基金销售有限公司
办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人：赵荣春
联系人：申泽灏
客服电话：400-893-6885
网址：www.qianjing.com
（87）厦门市鑫鼎盛控股有限公司
注册地址：厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室
办公地址：厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室
法定代表人：陈洪生
联系人：陈承智
电话：0592-3122673
客服电话：400-918-0808
网址：www.xds.com.cn
（88）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层
法定代表人：马勇
联系人：文雯
客服电话：400-116-1188
网址：8.jrj.com.cn
（89）泰诚财富基金销售（大连）有限公司
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人：林卓
客服电话：400-6411-999
网址：www.taichengcaifu.com
（90）申万宏源西部证券有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室（邮编：830002）
法定代表人：李琦
联系人：唐岚
电话：010-88085858
传真：010-88085195
客户服务电话：400-800-0562
网址：www.hysec.com
（91）北京晟视天下投资管理有限公司
办公地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
法定代表人：蒋煜
客服电话：400-818-8866
网址：www.shengshiview.com
（92）武汉市伯嘉基金销售有限公司
办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号4号
法定代表人：陶捷
客服电话：400-027-9899
网址：www.buyfunds.cn
（93）上海万得基金销售有限公司
办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人：王廷富
客服电话：400-821-0203
网址：www.520fund.com.cn
（94）上海华信证券有限责任公司
注册地址：上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址：上海市黄浦区南京西路399号明天广场22楼
法定代表人：陈灿辉
联系人：陈媛
客服电话：400-820-5999
网址：www.shhxzq.com
（95）南京苏宁基金销售有限公司
注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人：王锋
客服电话：95177
网址：www.snjijin.com
（96）上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址：北京市西城区金融大街通泰大厦B座8层
法定代表人：毛淮平
客服电话：400-817-5666
网址：www.amcfortune.com
（97）北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
法定代表人：江卉
客服电话：95118
网址：jr.jd.com
（98）天津万家财富资产管理有限公司
注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层
法定代表人：李修辞
客服电话：010-59013895
网址：www.wanjiawealth.com
（99）珠海盈米基金销售有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔1201-1203室
法定代表人：肖雯
客服电话：020-89629066
网址：www.yingmi.cn
（100）世纪证券有限责任公司
办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层
法定代表人：姜昧军
客服电话：4008323000
网址：www.csco.com.cn
（101）上海基煜基金销售有限公司
注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人：王翔
客服电话：400-820-5369
网址：www.jiyufund.com.cn
（102）济安财富（北京）基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
法定代表人：杨健
客服电话：400-673-7010
网址：www.jianfortune.com
（103）天津国美基金销售有限公司
注册地址：天津经济技术开发区第一大街79号MSDC1-28层2801
办公地址：天津经济技术开发区第一大街79号MSDC1-28层2801
法定代表人：丁东华
客服电话：400-111-0889
网址：www.gomefund.com
（104）沈阳麟龙投资顾问有限公司
注册地址：辽宁省沈阳市东陵区白塔二南街18-2号B座601
办公地址：上海市虹口区青云路266号四楼
法定代表人：朱荣晖
客服电话：400-003-5811
网址：www.jinjiwo.com
（三）出具法律意见书的律师事务所
名称：通力律师事务所
地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：韩炯
电话：(021) 3135 8666
传真：(021) 3135 8600
经办律师：安冬、孙睿
（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：上海市卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
法定代表人：杨绍信
联系电话：021-23238888
传真：021-23238800
经办注册会计师：单峰、周祎

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，通过股票一级市场申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。

（3） 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估值体系，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，本基金将使用衍生产品市场，控制风险，并把握获利机会。

十、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为上证国债指数。

上证国债指数是由上海证券交易所推出的中国国债指数。该指数覆盖了上海证券交易所上市的国债，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。

如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，履行相应程序后可以对业绩比较基准进行相应调整。

十一、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，属证券投资基金中的低风险品种，预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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工商银行股份有限公司根据本基金合同已于2018年11月22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	508,260.00	1.11
	其中：股票	508,260.00	1.11
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	37,941,665.80	82.83
	其中：债券	37,941,665.80	82.83
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	6,383,898.64	13.94
8	其他资产	971,751.70	2.12
9	合计	45,805,576.14	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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	415,000.00	0.91
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	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	93,260.00	0.21
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	508,260.00	1.12

3、报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
报告期末本基金未持有沪港通股票。
4、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	002241	歌尔股份	50,000	415,000.00	0.91
2	002912	中新赛克	1,000	93,260.00	0.21

5、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	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	35,295,560.00	77.72
	其中：政策性金融债	35,295,560.00	77.72
4	企业债券	715,995.80	1.58
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	1,930,110.00	4.25
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	37,941,665.80	83.55

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	180202	18国开02	200,000	20,298,000.00	44.70
2	018005	国开1701	115,000	11,569,000.00	25.48
3	018002	国开1302	34,000	3,428,560.00	7.55
4	132009	17中油EB	10,000	1,035,000.00	2.28
5	120001	16以岭EB	6,000	593,640.00	1.31

7、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
本报告期末本基金未持有资产支持证券。
8、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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期末本基金未投资股指期货。
10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期末本基金未投资国债期货。
11、投资组合报告附注

11.1 本基金本期投资的前十名证券中没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。

11.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,112.69
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	968,439.01
5	应收申购款	1,200.00
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	971,751.70

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。
11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
报告期末本基金持有的前十名股票中不存在流通受限的股票。
11.6 本报告涉及合计数相关比例的，均以合计数除以相关数据计算，而不是对不同比例进行合计。

十三、基金的业绩

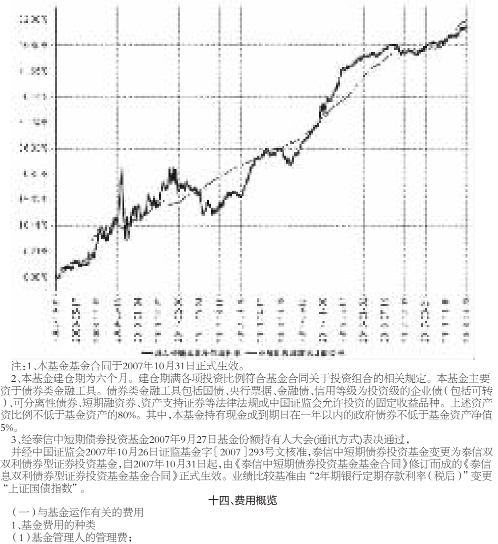
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）本基金合同生效日为2007年10月31日。基金合同生效以来（不含转型前的泰信中短债基金）截止至2018年9月30日的投资业绩与同期基准的比较如下表所示：

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
20180101-20180930	2.42%	0.06%	3.77%	0.03%	-1.35%	0.03%
20180101-20180630	1.38%	0.06%	2.86%	0.03%	-1.48%	0.03%
20170101-20171231	1.13%	0.04%	0.67%	0.04%	0.46%	0.01%
20160101-20161231	0.42%	0.05%	3.39%	0.04%	-2.97%	0.01%
20150101-20151231	7.31%	0.11%	6.09%	0.05%	1.22%	0.06%
20140101-20141231	9.11%	0.13%	4.42%	0.04%	4.69%	0.09%
20130101-20131231	1.36%	0.11%	2.75%	0.06%	-1.39%	0.05%
20120101-20121231	7.97%	0.14%	3.35%	0.02%	4.62%	0.12%
20110101-20111231	-6.55%	0.25%	4.05%	0.03%	-10.60%	0.22%
20100101-20101231	5.78%	0.33%	3.21%	0.09%	2.57%	0.24%
20090101-20091231	5.05%	0.57%	0.87%	0.09%	4.18%	0.48%
20080101-20081231	7.11%	0.17%	9.40%	0.10%	-2.29%	0.07%
20071031-20071231	1.72%	0.13%	0.86%	0.06%	0.86%	0.07%
20071031-20180930	50.76%	0.23%	51.85%	0.06%	-1.09%	0.17%

（二）自基金合同生效以来（不含转型前的泰信中短债基金）基金份额净值的变动情况，及与同期业绩比较基准的变动进行比较：

（2007年10月31日至2018年9月30日）



注：1、本基金基金合同于2007年10月31日正式生效。

2、本基金建仓期为六个月。建仓期满各项投资比例符合基金合同关于投资组合的相关规定。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%。

3、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。业绩比较基准由"2年期银行定期存款利率（税后）"变更为"上证国债指数"。

十四、费用概览

（一）与基金运作有关的费用
1、基金费用的种类
（1）基金管理人的管理费；
（2）基金托管人的托管费；
（3）基金销售服务费；
（4）基金合同生效后的信息披露费用；
（5）基金份额持有人大会费用；
（6）基金合同生效后的会计师费和律师费；
（7）基金的证券交易费用；
（8）银行汇划费用；
（9）按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。
2、基金费用的费率、计提方法、计提标准和支付方式
（1）基金管理费
基金管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。计算方法如下：
H ＝ E ×0.7%÷当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

（2）基金托管费
基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下：
H ＝ E ×0.20 % ÷ 当年天数
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

（3）基金销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金营销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。本基金管理人将通过定期的审计和监察稽核监督基金销售服务费的支出和使用情况，确保其用于约定的用途。

目前，本基金的销售服务费按前一日的基金资产净值的0.30%的年费率计提。计算公式如下：
H ＝ E ×0.30 % ÷ 当年天数
H 为每日应计提的基金销售服务费
E 为前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，托管人复核后于次月前2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金销售机构。

（4）基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等相关费率。调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2个工作日在至少一家指定媒体公告并报中国证监会备案。

（5）上述"基金费用的种类"中第（4）到（9） 项费用由基金管理人和基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（二）与基金销售有关的费用
1、基金认购费：0。
2、基金申购费：0。
3、基金赎回费：

持有时间	赎回费率
7天以下	1.5%
7天以上（含7天）30天以下	0.1%
30天以上（含30天）	0%

4、 基金转换费：基金转换费由基金份额持有人承担，基金转换费率由基金管理人另行公告。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本更新招募说明书依据《基金法》、《基金运作办法》、《基金销售办法》、《信息披露办法》、《内容与格式准则第5号〈基金招募说明书的内容与格式〉》、《泰信双息双利债券型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的要求，结合本基金近半年的投资运作情况，对2018年6月5日公告的《泰信双息双利债券型证券投资基金更新招募说明书》的内容进行了必要的补充和更新。

具体情况说明如下：

1、在"重要提示"中明确了本次更新招募说明书更新内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2、"三、基金管理人"部分：

（1）在"（一）基金管理人概况"部分，对公司正式员工人数、公司旗下基金及资产管理计划情况进行了更新。

（2）在"（三）主要人员情况"部分，对公司董事、基金经理及投委会成员的任职信息进行了更新。

3、在"四、基金托管人"部分，对基金托管人的发展概况及主要业务经营等情况进行了更新。

4、在"五、相关服务机构"部分，对本基金代销机构的相关信息进行了更新。

5、在"七、基金的转换、非交易过户、及转托管"部分，补充了截至2018年10月30日，泰信双息双利基金与本公司旗下其他基金之间的可转换情况以及可办理泰信双息双利基金定投业务的机构情况。

6、在"八、基金的投资"部分，根据本基金2018年第3季度报告的相关内容，重新调整了"（十）基金投资组合报告"的内容。

7、在"九、基金的业绩"部分，修订了本基金自合同生效以来（不含转型前的泰信中短债基金）的投资业绩，该部分内容均按规定格式要求编制，并经基金托管人复核。

8、在"二十一、其他应披露事项"中，汇总了本报告期内已经披露的与本基金有关的主要公告信息。

泰信基金管理有限公司
2018年12月5日