

泰信鑫利混合型证券投资基金招募说明书摘要（2018 年 1 号）

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

二〇一八年一月五日

一、重要提示

泰信鑫利混合型证券投资基金（以下简称本基金）经中国证监会 2016 年 12 月 21 日证监许可[2016]3135 号准予注册募集。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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。

证券投资基金（以下简称基金）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特有风险等等。本基金投资中小企业私募债券，中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

本基金为混合型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

本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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。

本基金管理人提醒投资者基金投资的买者自负原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

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 2017 年 9 月 30 日，净值表现数据的截止日期为 2017 年 9 月 30 日，其他内容截止日期为 2017 年 11 月 25 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

名称：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 号华夏银行大厦 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

设立日期：2003 年 5 月 23 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]68 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：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-TrustFundManagementCo., 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日经中国证券监督管理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2017年10月底，公司有正式员工103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2017年11月25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、泰信鑫利混合共20只开放式基金及23个特定客户资产管理计划。

（二）注册资本、股权结构

股权结构：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%。

股东单位名称 现金出资金额 股权比例

山东省国际信托股份有限公司 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、总经理及其他高级管理人员基本情况

（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。

徐国君先生，董事，经济学博士，教授、博士生导师；曾任北京林业管理干部学院助教，青岛大学副教授、教授，中国海洋大学教授、校长助理、青岛国信发展（集团）有限责任公司副总经理；现任青岛国信发展（集团）有限责任公司总经理。

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。

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副经理；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。

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。

胡囡女士，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。

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副总监，现任董监事工作部主任、综合管理部副总监、工会主席。

（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任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

何俊春女士，工商管理硕士，21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基金交易员、交易主管，泰信天天收益基金经理。自2008年10月起担任泰信双息双利债券基金基金经理；自2009年7月起担任泰信债券增强收益基金基金经理；自2012年10月起担任泰信债券周期回报基金基金经理。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。现同时担任投资部固定收益投资总监。

3、股票投资决策委员会

本基金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。

（四）基金管理人的职责

- 1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回、转换和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金资产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制中期和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值和基金份额累计净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金资产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、按照规定召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

（五）基金管理人的承诺

- 1、本基金管理人承诺严格遵守相关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反有关法律法规、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。
- 2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：
 - （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资；
 - （2）不公平地对待其管理的不同基金资产；
 - （3）利用基金资产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
 - （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
 - （5）侵占、挪用基金财产；
 - （6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
 - （7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
 - （8）法律、行政法规或中国证监会规定禁止的其他行为。
- 3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不得将基金资产用于以下投资或活动：
 - （1）承销证券；
 - （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
 - （3）从事承担无限责任的投资；
 - （4）向其基金管理人、基金托管人出资；
 - （5）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
 - （6）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述禁止行为的，本基金不受上述限制。

4、基金经理承诺

- （1）依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- （2）不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- （3）不违反现行有效的有关法律法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- （4）不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

（六）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

(1) 全面性原则。内部控制制度覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。

(2) 独立性原则。公司设立独立的督察长与监察稽核部门，并使它们保持高度的独立性与权威性。

(3) 相互制约原则。公司部门和岗位的设置权责分明、相互牵制，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

(4) 重要性原则。公司的发展必须建立在风险控制完善和稳固的基础上，内部风险控制与公司业务发展同等重要。

2、内部控制的主要内容

(1) 控制环境

公司董事会、监事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。本公司在董事会下设立有独立董事参加的审计、合规与风险控制委员会，负责评价与完善公司的内部控制体系；公司监事会负责审阅外部独立审计机构的审计报告，确保公司财务报告的真实性、可靠性，督促实施有关审计建议。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了总经理办公会、投资决策委员会等，负责公司经营、基金投资、风险管理的重大决策。

此外，公司设有督察长，负责组织指导公司监察稽核工作。督察长履行职责的范围，涵盖基金及公司运作的所有业务环节，对公司和基金运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，参与公司风险控制工作，发生重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

(2) 风险评估

公司风险管理部和内部监察稽核人员定期评估公司及基金的风险状况，包括所有能对经营目标、投资目标产生负面影响的内部和外部因素，对公司总体经营目标产生影响的可能性及影响程度，并将评估报告报总经理办公会。

(3) 操作控制

公司内部组织结构的设计方面，体现部门之间职责有分工，但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立，并且有独立的报告系统。各业务部门之间相互核对、相互牵制。各业务部门内部工作岗位分工合理、职责明确，形成相互检查、相互制约的关系，以减少舞弊或差错发生的风险，各工作岗位均制定有相应的书面管理制度。在明确的岗位责任制度基础上，设置科学、合理、标准化的业务操作流程，每项业务操作有清晰、书面化的操作手册，同时，规定完备的处理手续，保存完整的业务记录，制定严格的检查、复核标准。

(4) 信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

(5) 监督与内部稽核

本公司设立了独立于各业务部门的监察稽核部，履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，设置风险管理部，分析和监控公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。内部稽核人员和风险管理人员具有相对的独立性，内部稽核报告报董事长及中国证监会。

3、基金管理人关于内部控制的声明

(1) 本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；

(2) 上述关于内部控制的披露真实、准确；

(3) 本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

三、基金托管人

(一) 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称中国银行）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

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号华夏银行大厦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）20899060

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

地址：北京市西城区广成街4号院1号楼305、306室

邮政编码：100032

电话：（010）66215978

传真：（010）66215968

联系人：林洁

（3）泰信基金管理有限公司深圳分公司

地址：深圳市福田区福华一路98号卓越大厦1608室

邮政编码：518000

电话：（0755）33988759

传真：（0755）33988757

联系人：史明伟

2、销售机构

（1）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：田国立

传真：010-66594942

客服电话：95566

网址：www.boc.cn

（2）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：021-63604199

客服电话：95528

网址：www.spdb.com.cn

(3) 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.nbc.com.cn

(4) 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

(5) 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

(6) 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：林生迎

电话：0755-82960223

传真：0755-83734343

客服电话：95565

网址：www.newone.com.cn

(7) 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：4008-888-888 或 95551

网址：www.chinastock.com.cn

(8) 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：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

(9) 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。

(10) 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：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

联系人：谢高得

电话：021-38565785

传真：021-38565955

客服电话：95562400-8888-123

网址：www.xyzq.com.cn

(11) 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

(12) 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

（13）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

（14）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：江苏省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）

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

（15）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

（16）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

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

（17）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：龚德雄

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

(18) 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：谢永林

联系人：吴琼

电话：0755-22621866

传真：0755-82400862

客服电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

(19) 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：李工

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

(20) 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：常喆

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

(21) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 楼 (213003)

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

电话：021-20333333

传真：021-50498825

客服电话：95531、400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

(22) 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：钱卫

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

(23) 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

(24) 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：王宜四

联系人：史江蕊

电话：010-64818301/0791-86768681

传真：010-64818443/0791-86770178

客服电话：400-8866-567

网址：www.avicsec.com

(25) 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：姚文平

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

(26) 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：马贤清

电话：0755-83025022

传真：0755-83025625

客服电话：400-8888-228

网址: www.jyzq.cn

(27) 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

法定代表人: 陈宏

联系人: 周艳琼

电话: 021-021-36537945

传真: 021-36538467

客户服务电话: 400-9112-233

网址: www.xzsec.com

(28) 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: 李季

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

(29) 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: 钱华

联系人: 王薇

电话: 021-32229888

传真: 021-68728707

客服电话: 4001-962502

网址: www.ajzq.com

(30) 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

(31) 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

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.gjq.com.cn

(32) 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

(33) 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：杨泽柱

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

(34) 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

(35) 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：0931-4890515

联系人：李昕田

客户服务电话：0931-96668、4890208

网址：www.hlzqgs.com

(36) 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.gllsc.com.cn

(37) 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：邱三发

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

(38) 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：4001022011

网址：www.zszq.com

(39) 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

(40) 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：郭林

联系人：陈媛

客服电话：400-820-5999

网址：www.shhxzq.com

(41) 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

(42) 深圳众禄金融控股股份有限公司

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

(43) 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：陈柏青
客服电话：4000-766-123
网址：www.fund123.cn

(44) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
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

(45) 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

(46) 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

(47) 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

(48) 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：admin.leadfund.com.cn

(49) 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

(50) 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：梁越
客服电话：4008-980-618
网址：www.chtfund.com

(51)深圳富济财富管理有限公司

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

客服电话:0755-83999913

网址:www.jinqianwo.cn

(52)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:胡伟

联系人:张婷婷

客服电话:400-068-1176

网址:www.hongdianfund.com

(53)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:袁顾明

联系人:何庭宇

客服电话:400-928-2266021-22267995

网址:www.dtfunds.com

(54)上海陆金所资产管理有限公司

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14楼

法定代表人:郭坚

联系人:宁博宇

客服电话:4008219031

网址:www.lufunds.com

(55)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.zengcaiwan.com

(56)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

(57)厦门市鑫鼎盛控股有限公司

办公地址:厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场15楼

法定代表人:陈洪生

联系人:梁云波

客服电话:400-918-0808

网址:www.xds.com.cn

(58) 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: 杨懿

联系人: 文雯

客服电话: 400-116-1188

网址: 8.jrj.com.cn

(59) 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

(60) 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

(61) 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

(62) 上海万得基金销售有限公司

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人: 王廷富

客服电话: 400-821-0203

网址: www.520fund.com.cn

(63) 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: 钱燕飞

客服电话: 95177

网址: www.snjjin.com

(64) 北京懒猫金融信息服务有限公司

注册地址: 北京市石景山区石景山路 31 号院盛景国际广场 3 号楼 1119

办公地址: 北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区 1111 号国投尚科 5 层

法定代表人: 许现良

客服电话: 4001-500-882

网址: www.lanmao.com

(65) 上海华夏财富投资管理有限公司

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: 李一梅

客服电话: 400-817-5666

网址: www.amcfortune.com

(66) 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

(67) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

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

(68) 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

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择符合要求的销售机构销售本基金，并及时公告。

(二) 登记机构

名称 泰信基金管理有限公司

住所 中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 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

联系人 韩波

电话 021-20899188

传真 021-20899060

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称 上海市源泰律师事务所

住所、办公地址 上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人 廖海 联系人 刘佳

电话 (021) 51150298 传真 (021) 51150398

经办律师 廖海、刘佳

(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 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址 上海市卢湾区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人 杨绍信 联系人 傅琛慧

电话 021-23238888 传真 021-23238800

经办注册会计师 单峰、傅琛慧

五、基金的名称

基金名称：泰信鑫利混合型证券投资基金

基金简称：泰信鑫利混合

六、基金的类型

契约型开放式

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货等金融工具，以及债券等金融工具（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例不超过 30%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。

八、基金的投资目标

采用多种投资策略，在严格管理风险和保障必要流动性的前提下，力争实现长期稳健增值。

九、基金的投资策略

1、大类资产配置策略

在大类资产配置中，本基金将主要考虑：（1）宏观经济指标，包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口数据变化等；（2）微观经济指标，包括各行业主要企业的盈利变化情况及盈利预期等；（3）市场指标，包括股票市场与债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金的供求关系及其变化等；（4）政策因素，包括财政政策、货币政策、产业政策及其它与证券市场密切相关的各种政策。

本基金管理人通过深入分析上述指标与因素，动态调整基金资产在股票、债券和货币市场工具等大类资产间的配置比例，控制市场风险，提高配置效率。

2、股票投资策略

本基金的股票投资将行业精选和个股精选相结合，在宏观策略研究的基础上优选特定经济周期阶段下的优势行业，在优势行业中发掘具备投资价值的优势个股。

1) 行业精选

本基金的行业配置从定性分析和定量分析两个角度进行考察，依据行业周期轮动特征以及行业相对投资价值评估结果，精选行业景气度趋于改善或者长期增长前景看好且具有良好的投资价值的行业进行重点配置。

定性分析方面，以宏观经济运行和经济景气周期监测为基础，结合对我国行业周期轮动特征的考察，从经济周期因素、行业发展政策因素、产业结构变化趋势因素以及行业自身景气周期因素等多个指标把握不同行业的景气度变化情况和业绩增长趋势。本基金重点关注行业景气度趋于改善或者长期增长前景良好的优势行业。

定量分析方面，主要依据行业相对估值水平（行业估值/市场估值）、行业相对利润增长率（行业利润增长率/市场利润增长率）、行业 PEG（行业估值/行业利润增长率）三项指标进行筛选。

2) 个股选择

本基金重点关注优势行业中获益程度最高的优势个股。优势个股的评价标准包括：

公司主营业务鲜明，行业地位突出，具体的考察指标包括公司的主营业务收入不低于行业平均等。

公司财务状况良好，盈利能力较强且资产质量较好，具体的考察指标包括成长性指标（收入增长率、息税折旧前利润增长率等）、盈利指标（净资产收益率、投资回报率等）。

公司治理结构规范，管理水平较高，拥有市场自主品牌并具有较强的自主创新和市场拓展能力。

公司的预期股息回报率高于行业平均和预期动态市盈率低于行业平均。

3、债券投资策略

在本基金的债券投资过程中，基金管理人将充分发挥在研究方面的专业化优势，采取积极主动的投资管理，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。通过确定债券组合久期、确定债券组合期限结构配置和挑选个券等三个步骤构建债券组合，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波动和债券组合久期特性提高债券组合收益率的目的。本基金在进行债券市场发展趋势及市场利率波动预测的基础上，结合本基金债券组合的利率弹性特征，确定债券组合的久期配置。

(2) 确定债券组合的期限结构配置

在确定了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，寻求在一定时期内获取因收益率曲线形状变化导致债券价格变化而产生的超额收益。债券收益率曲线是市场对当前经济状况及对未来经济走势预测充分反应的结果。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券种的配置。

(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收益率基差的分析，预测其变动趋势，及时发现因基（利）差超出债券内在价值差异而产生的投资机会，发掘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。

(4) 可转换债券投资策略

可转换债券（含可分离转债）同时具有债券与权益类证券的双重特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将利用可转换债券定价模型进行估值分析，重点结合公司投资价值、可转换债券条款、可转换债券的转换价值溢价水平、债券价值溢价水平选择债性股性相对均衡的转债品种，获得一定超额回报。

(5) 中小企业私募债券投资策略

由于中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，并限制投资者数量上限，整体流动性相对较差。同时，受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中，应采取更为谨慎的投资策略。

投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并综合考虑信用风险、久期、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。作为开放式基金，本基金将严格控制该类债券占基金净资产的比例，对于有一定信用风险隐患的个券，基于流动性风险的考虑，本基金将及时减仓或卖出。

4、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据对证券市场 and 期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，由此获得股票组合产生的超额收益。本基金在运用股指期货时，将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，对冲系统性风险以及特殊情况下的流动性风险，以改善投资组合的风险收益特性。

5、权证投资策略

本基金权证投资的原则主要为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中以对应的标的证券的基本面为基础，结合权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价，主要运用的投资策略为：杠杆交易策略、对冲保底组合投资策略、保底套利组合投资策略、买入跨式投资策略、Delta 对冲策略等。

6、资产支持证券投资策略

本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

十、基金的业绩比较基准

沪深 300 指数收益率 30%+中证全债指数收益率 70%

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，综合反映了沪深证券市场内大中市值公司的整体状况。中证全债指数是由中证指数有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能客观合理地反映本基金风险收益特征。如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数，以及如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时，在法律法规和《基金合同》规定的范围内且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，本基金可以在与基金托管人协商一致的情况下，报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十一、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金。

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银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于 2017 年 12 月 13 日复核了本投资组合报告的内容。

1、截止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 3,522,508.00 3.00

其中：股票 3,522,508.00 3.00

2 基金投资 --

3 固定收益投资 62,328,080.00 53.12

其中：债券 62,328,080.00 53.12

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 40,000,000.00 34.09

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 10,243,743.21 8.73

8 其他资产 1,232,580.12 1.05

9 合计 117,326,911.33 100.00

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 2,316,348.00 1.98

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 1,206,160.00 1.03

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 3,522,508.00 3.01

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	002292	奥飞娱乐	60,000	890,400.00	0.76
2	002467	二六三	80,000	785,600.00	0.67
3	002456	欧菲光	30,000	635,700.00	0.54
4	300342	天银机电	40,000	612,800.00	0.52
5	300310	宜通世纪	30,040	420,560.00	0.36
6	300398	飞凯材料	8,200	177,448.00	0.15

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	6,036,030.00	5.16
2	央行票据	--	--
3	金融债券	34,037,160.00	29.10
其中：政策性金融债 34,037,160.00 29.10			
4	企业债券	6,853,000.00	5.86
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	13,869,800.00	11.86
7	可转债(可交换债)	1,532,090.00	1.31
8	同业存单	--	--
9	其他	--	--
10	合计	62,328,080.00	53.28

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	150412	15 农发	12,100,000	9,954,000.00	8.51
2	150203	15 国开 03	100,000	9,893,000.00	8.46
3	160208	16 国开 08	100,000	9,799,000.00	8.38
4	101558050	15 陕天然气 MTN001	70,000	6,979,000.00	5.97
5	101654010	16 沪世博 MTN001	70,000	6,890,800.00	5.89

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序的前五名贵金属投资明细

报告期末本基金未投资贵金属。

9、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。

10、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

截至报告期末本基金未投资股指期货。

11、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

截至报告期末本基金未投资国债期货。

12、投资组合报告附注

12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

12.2 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。

12.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 7,988.97

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 1,224,591.15

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 1,232,580.12

12.4 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。

12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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 2017 年 5 月 25 日。基金合同生效以来(截至 2017 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(A类) 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 --

20170525-20170930 1.52% 0.04% 4.91% 0.19% -3.39% -0.15%

阶段(C类) 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 --

20170525-20170930 1.11% 0.03% 4.91% 0.19% -3.80% -0.16%

(二) 自基金合同生效以来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:

(2017 年 5 月 25 日至 2017 年 9 月 30 日)

十四、费用概览

一、与基金运作有关的费用

(一) 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、从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2% 年费率计提。基金管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \times \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。基金托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \times \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \times \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构转交给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

上述（一）基金费用的种类中第 4-10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

二、与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金基金份额前端申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体如下：

费率种类 认购金额（M，含认购费，元） 申购费率

A类基金份额 M<100万 1.2%

100万≤M<300万 0.8%

300万≤M<500万 0.6%

M≥500万 1000元/笔

C类基金份额 0

本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

2、本基金对A、C类基金份额收取赎回费，在投资者赎回基金份额时收取。基金份额的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金基金份额的赎回费率具体如下：

A类基金份额赎回费率：

持有期限（Y） 赎回费率

Y<7天 1.5%

7≤Y<30天 0.75%

30天≤Y<180天 0.5%

180天≤Y<365天 0.10%

365天≤Y<730天 0.05%

730天≤Y 0%

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担。对于A类基金份额，本基金对持续持有期少于30天的投资者收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于30天（含）但少于90天的投资者收取的赎回费，将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于90天（含）但少于180天的投资者收取的赎回费，将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于180天（含）的投资者收取的赎回费，将不低于赎回费总额的25%归入基金财产。未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

C类基金份额赎回费率：

持有时间（Y） 赎回费率

Y<30天 0.75%

Y≥30天 0%

对C类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低本基金的申购费率、基金赎回费率和销售服务费率。

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>》、《泰信鑫利混合型证券投资基金更新招募说明书基金合同》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2017年4月20日公告的《泰信鑫利混合型证券投资基金招募说明书》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，对公司注册地址和办公地址、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,对公司董事及投委会成员的任职情况进行了更新。

3、在四、基金托管人部分,对基金托管人的发展概况及托管业务经营情况进行了更新。

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,在(一)基金的转换中补充了截止2017年11月25日,泰信鑫利混合基金与本公司旗下其他基金之间的可转换情况;在(四)定期定额投资计划更新可办理本基金定期定额投资的销售机构名单。

6、在八、基金的投资部分,根据本基金2017年第3季度报告的相关内容,补充了(十一)基金投资组合报告的内容。

7、在九、基金的业绩部分,列示了本基金自合同生效以来的投资业绩,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,汇总了本报告期内已经披露的与本基金有关的重要公告信息。

泰信基金管理有限公司

2018年1月5日