

泰信保本混合型证券投资基金更新招募说明书 摘要

(2013年1号)

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

日期：二〇一三年四月三日

重要提示

本基金根据 2011 年 10 月 8 日中国证券监督管理委员会《关于核准泰信保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2011]1598 号）和 2011 年 12 月 29 日《关于泰信保本混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2011]1026 号）的核准，进行募集。

本基金为契约型开放式，基金合同于 2012 年 2 月 22 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，基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准，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。

本基金作为保本混合型基金，将会有部分基金资产投资于股票市场，基金份额净值会随股票市场的变化而上下波动。投资者投资于本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

在一个保本周期内，对于投资人认购并持有到期的基金份额，存在着仅能收回投资金额的可能性；对于投资人在日常申购的基金份额，存在着仅能部分收回本金的可能性。对于基金份额持有人未持有到期的基金份额，在赎回时不能获得保本保证，将承担市场波动的风险。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本基金的基金合同、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内容截止日期为 2013 年 2 月 22 日，有关财务数据（未经审计）和投资组合数据的截止日为 2012 年 12 月 31 日，净值表现数据的截止日期为 2012 年 12 月 31 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。

一、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：上海市浦东新区浦东南路 256 号 37 层

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 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：孟凡利

总经理：葛航

电话：(021) 20899188

传真：(021) 20899008

联系人：王伟毅

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、专户投资部、理财顾问部、清算会计部、信息技术部、风险管理部、计划财务部、监察稽核部、综合管理部、北京分公司、深圳分公司。截至 2013 年 2 月底, 公司有正式员工 116 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 2013 年 2 月, 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、泰信发展主题股票、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选股票、泰信保本混合、泰信中证基本面 400 指数分级共 13 只开放式基金及泰信财富分级 3 号、泰信财富分级 4 号、泰信乐享分级 1 号、泰信恒益高息债分级共 4 个资产管理计划。

(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

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。

李刚先生，副董事长，大学本科，高级经济师；曾任江苏省计经委农经处副科长、科长、副处长，江苏省农业投资公司副总经理，江苏省投资管理有限责任公司农业投资部副经理、经理，江苏省投资贸易公司总经理，江苏省投资管理有限责任公司副总经理兼省国信资产管理集团有限公司计划与投资部经理，江苏省国信资产管理集团有限公司总经理助理兼计划与投资部经理，江苏省国信高科技创业投资有限公司董事长、总经理，江苏省国信资产管理集团有限公司发展规划部经理，江苏省投资有限责任公司副总经理。现任江苏省投资有限责任公司总经理，兼江苏国信集团财务有限公司董事；江苏徐矿综合利用发电有限公司副董事长；江苏阙山发电有限公司副董事长；江苏徐塘发电有限公司副董事长；江苏射阳港发电有限公司副董事长；华能淮阴第二发电有限公司副董事长。

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副总经理兼山东省国际信托有限公司董事、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，

现任中央汇金公司派光大银行董事。

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、上海国际集团有限公司顾问。

王川先生，独立董事，经济学大专，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。

（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。

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。

唐光杰先生，职工监事，硕士，工程师，19年从业经验。2007年1月加入泰信基金管理有限公司，现任公司信息技术部总监、工会主席。

董山青先生，职工监事，工商管理硕士，7年证券从业经验；曾任中国银行上海分行对公业务业务经理；2004年8月加入泰信基金管理有限公司，现任投资部总监助理、泰信保本混合基金经理。

（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。

葛航先生，总经理，学士；1989年7月加入山东省国际信托有限公司，曾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。

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，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

董山青先生，香港大学工商管理硕士，CFA，证券从业经历7年。曾就职于中国银行上海分行；2004年加入泰信基金管理有限公司，先后在清算会计部、研究部、投资部任职，曾任泰信优势增长基金经理助理职务。现同时担任投资部总监助理。

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，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，公司总经理；

朱志权先生，投资部总监兼投资总监，泰信先行策略混合基金、泰信优势增长混合基金基金经理；

刘毅先生：投资部副总监兼投资副总监、首席策略分析师，泰信优质生活股票基金、泰信发展主题股票基金经理；

何俊春女士：投资部固定收益投资总监，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经理；

柳菁女士：研究部总监兼研究总监，泰信蓝筹精选股票基金、泰信中小盘精选股票基金经理；

梁剑先生，研究部副总监兼研究副总监；

另外，督察长、风险管理部负责人、监察稽核部负责人列席会议。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称：中信银行股份有限公司

注册地址：北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：田国立

成立日期：1987年4月

批准设立文号：国办函[1987]14号

注册资本：467.87亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2004】125号

联系电话：(010)65556899, 65556812

联系人：方韡

三、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：上海市浦东新区浦东南路 256 号 37 层

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36-37 层

法定代表人：孟凡利

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：王睿

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：王睿

(3) 泰信基金管理有限公司深圳分公司

地址：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

邮政编码：518000

电话：(0755) 33988759

传真：(0755) 33988757

联系人：史明伟

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) 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

(3) 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：蒋超良

传真：010-85109219

客服电话：95599

网址：www.95599.cn

(4) 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

(5) 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：田国立

联系人：朱义明、方韡

传真：010-65550827

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

(6) 国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：万建华

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

(7) 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

(8) 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 6 楼

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客服电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

(9) 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：王东明

联系人：陈忠

电话：010-84588888

传真：010-60838888

客服电话：95558

网址：www.cs.ecitic.com

(10) 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：陈有安

联系人：田薇

电话：010-66568888

传真：010-66568536

客服电话：400-8888-888

网址：www.chinastock.com.cn

(11) 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

(12) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

联系人：李清怡

电话：021-54033888

传真：021-54038844

客服电话：95523 或 4008895523

网址：www.sywg.com

(13) 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：95562 400-8888-123

网址：www.xyzq.com.cn

(14) 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：岳献春

联系人：赵明

电话：010-85127622

传真：010-85127917

客服电话：400-619-8888

网址：www.msza.com

(15) 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：王兆权

联系电话：022-28451861

传真：022-28451892

客户服务电话：400-6515-988

网址：www.bhzq.com

(16) 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

(17) 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：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

(18) 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：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

(19) 新时代证券有限责任公司

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：马金声

联系人：孙恺

电话：010-83561000

传真：010-83561001

客服电话：4006989898

网址：www.xsdzq.cn

(20) 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

网址：www.hazq.com.cn

(21) 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

(22) 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

(23) 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（213003）

办公地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19楼（213003）

法定代表人：朱科敏

联系人：李涛

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

客服电话：021-52574550、0519-88166222、0379-64902266、400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

(24) 齐鲁证券有限公司

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.qlzq.com.cn

(25) 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：张智河

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客服电话：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

(26) 中航证券有限责任公司

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：杜航

联系人：余雅娜

电话：0791-6768763

传真：0791-6789414

客服电话：400-8866-567

网址：www.avicsec.com

(27) 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-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：龙增来

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

(28) 西藏同信证券有限责任公司

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 24 号

法定代表人：贾绍君

联系人：王伟光

电话：021-36533016

传真：021-36533017

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

(29) 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：鞠瑾（代行）

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

(30) 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：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：张宏宇

电话：0451-82336863

传真：0451-82287211

客服电话：4006662288

网址：www.jhzq.com.cn

(31) 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：0755-83515567

客服电话：0755-33680000、400-6666-888

网址：www.cgws.com

(32) 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：陈康菲

电话：021-50122222

传真：021-50122200

客服电话：400-820-9898

网址：www.cnhbstock.com

(33) 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

(34) 中信证券（浙江）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

(35) 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：胡运钊

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

网址：www.95579.com

(36) 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：张智河

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

(37) 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：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

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：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

(38) 华龙证券有限责任公司

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

(39) 恒泰长财证券有限责任公司

注册地址：长春市长江路经济开发区人民大街280号科技城2层A-33段

办公地址：长春市宽城区珠江路439号

法定代表人：奚星华

联系人：吴德生

联系电话：0431-82951765

联系传真：0431-82946531

客服电话：0431-82951765

公司网址：<http://www.cczq.net>

(40) 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：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-089-1289

网址：www.erichfund.com

(41) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

(二) 注册登记机构

名称：泰信基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路256号37层

办公地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦36、37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) 20899188

传真：(021) 20899060

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1405室

负责人：廖海

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

经办律师：梁丽金、刘佳

联系人：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

联系人：沈兆杰

经办注册会计师：薛竞、张振波

四、基金的名称

基金名称：泰信保本混合型证券投资基金

基金简称：泰信保本混合

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

根据本基金的保证合同，本基金通过运用优化的恒定比例组合保险方法（CPPI），在保证保本到期本金安全的基础上，寻求资产的稳定增值。

七、基金的投资方向

投资于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（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证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（但需符合中国证监会的相关规定）。

本基金的投资组合比例为：股票、权证等收益资产占基金资产的 0%-40%，其中，持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的 60%-100%，其中，基金持有现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的保本

（一）担保人基本情况

为确保履行保本条款，保障基金份额持有人利益，本基金的第一个保本周期由山东省鲁信投资控股集团有限公司作为担保人。

山东省鲁信投资控股集团有限公司

住所：山东省济南市解放路 166 号

办公地址：山东省济南市解放路 166 号

法定代表人：孟凡利

成立日期：2002年1月31日

组织形式：有限责任公司（国有独资）

注册资本：30亿元人民币

经营范围：对外投资（不含法律法规限制行业）及管理，投资咨询（不含证券、期货的咨询），资产管理、托管经营，资本运营，担保，酒店管理，房屋出租，物业管理。

（二）担保人对外承担保证责任的情况

截至2011年2月底，鲁信集团对外担保的在保余额为11.7亿元人民币，未超过其净资产总额的25倍。无已担保的保本基金。

（三）保证合同

鉴于：《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）约定，基金管理人就泰信保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金份额持有人认购并持有到保本周期（如无特别指明，保本周期即为本基金第一个保本周期）到期日的基金份额承担保本义务（见基金合同）。为保护基金投资者合法权益，依照《中华人民共和国担保法》、《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《关于保本基金的指导意见》等法律法规及规范性文件的规定，基金管理人和保证人在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《泰信保本混合型证券投资基金保证合同》（以下简称“本合同”或“《保证合同》”）。

保证人就本基金的保本周期内基金管理人就基金份额持有人认购并持有到期的基金份额所承担保本义务的履行提供不可撤销的连带责任保证。保证人保证责任的承担以本《保证合同》为准。

《保证合同》的当事人包括基金管理人、保证人和基金份额持有人。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和《保证合同》的当事人，其购买基金份额的行为本身即表明其对《保证合同》的承认、接受和同意。

除非本《保证合同》另有约定，本《保证合同》所使用的词语或简称与其在基金合同中的释义部分具有相同含义。

1、保证的范围和最高限额

（1）本基金为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额提供的认购保本金额为：认购并持有到期的基金份额的净认购金额及募集期间的利息收入之和。

（2）保证人承担保证责任的金额即保证范围为：在保本周期到期日，基金份额持有人

认购并持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积（即“可赎回金额”）加上认购并持有到期的基金份额累计分红金额之和计算的总金额低于认购保本金额的差额部分。

（3）基金份额持有人申购，或在保本周期到期日前赎回或转换出的部分不在保证范围之内且保证人承担保证责任的最高限额不超过按基金合同生效之日确认的基金份额所计算的认购保本金额，且不超过本基金的募集上限9亿人民币（包括募集期利息）。

（4）保本周期到期日是指本基金保本周期届满的最后一日。本基金的保本周期为三年，自基金合同生效之日起至三个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日。

2、保证期间

保证期间为基金保本周期到期日起六个月。

3、保证的方式

在保证期间，保证人在保证范围内承担不可撤销的连带保证责任。

4、除外责任

下列任一情形发生时，保证人不承担保证责任：

（1）在保本周期到期日，按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额不低于本基金为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额提供的认购保本金额；

（2）基金份额持有人认购，但在基金保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换出本基金的基金份额；

（3）基金份额持有人在保本周期内申购或转换入（包括其发生的非交易过户情形）的基金份额；

（4）在保本周期内发生本基金合同规定的基金合同终止的情形；

（5）在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形，且保证人不同意继续承担保证责任；

（6）在保本周期到期日之后（不包括该日），基金份额发生的任何形式的净值减少；

（7）因不可抗力的原因导致基金投资亏损；或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或基金合同规定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的。

5、责任分担及清偿程序

(1) 如果保本周期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额与相应基金份额的累计分红金额之和低于认购保本金额,基金管理人未能按照基金合同的约定全额履行保本义务的,基金管理人应在保本周期到期日后5个工作日内,向保证人发出书面《履行保证责任通知书》(应当载明基金管理人应向基金份额持有人支付的本基金保本差额总额、基金管理人已自行偿付的金额、需保证人清偿的金额以及基金管理人在基金托管人处开立的指定账户信息)。

(2) 保证人应在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后的5个工作日内,将《履行保证责任通知书》载明的清偿金额划入基金管理人在基金托管人处开立的指定账户中,由基金管理人将该差额支付给基金份额持有人。保证人将上述清偿款项全额划入基金管理人在基金托管人处开立的指定账户中后即为全部履行了保证责任,保证人无须对基金份额持有人逐一进行清偿。清偿金额的分配与支付由基金管理人负责,保证人对此不承担责任。

(3) 基金管理人最迟应在保本周期到期日后20个工作日(含第20个工作日)内将保本赔付差额支付给基金份额持有人。

(4) 如果保本周期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额与相应基金份额的累计分红金额之和低于认购保本金额,基金管理人及保证人未履行基金合同及本合同上述条款中约定的保本义务及保证责任的,自保本周期到期后第21个工作日起,基金份额持有人可以根据基金合同第二十一部分“争议的处理和适用的法律”约定,直接向基金管理人或保证人请求解决保本赔付差额支付事宜。

6、追偿权、追偿程序和还款方式

(1) 保证人履行了保证责任后,即有权要求基金管理人归还保证人为履行保证责任支付的全部款项(包括但不限于保证人按《履行保证责任通知书》所载金额支付的实际款项、基金份额持有人直接向保证人要求清偿的金额及保证人为履行保证责任支付的其他金额,前述款项重叠部分不重复计算)和自支付之日起的利息以及保证人的其他费用和损失,包括但不限于保证人为清偿及追偿产生的律师费、调查取证费、诉讼费、保全费、评估费、拍卖费、公证费、差旅费、抵押物或质押物的处置费等。

(2) 基金管理人应自保证人履行保证责任之日起一个月内,向保证人提交保证人认可的还款计划,在还款计划中载明还款时间、还款方式,并按保证人认可的还款计划归还保证人为履行保证责任支付的全部款项和自支付之日起的利息以及保证人的其他费用和损失,并支付至保证人指定的银行账户。基金管理人未能按本条约定提交保证人认可的还款计划,或未按还款计划履行还款义务的,保证人有权要求基金管理人立即支付上述款项和其他费用、

并对保证人的损失进行赔偿。

7、 担保费的收取

(1) 基金管理人应按本条规定向保证人支付担保费。

(2) 担保费收取方式：担保费从基金管理人收取的本基金管理费中列支，按本条第 3 款公式每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理人应于每月收到基金管理费之后的 5 个工作日内向保证人支付担保费。

(3) 每日担保费计算公式 = 担保费计提日前一日基金资产净值×2%×1/当年日历天数。

8、 适用法律及争议解决方式

本《保证合同》适用中华人民共和国法律。发生争议时，双方应通过协商解决；协商不成的，任何一方均可向中国国际经济贸易仲裁委员会北京分会提起仲裁，仲裁地点为北京，且仲裁裁决为终局，并对双方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

9、 其他条款

(1) 基金管理人应向本基金的基金份额持有人出示本《保证合同》。

(2) 本《保证合同》自基金管理人、保证人双方加盖公司公章或由基金管理人、保证人双方法定代表人（或其授权代理人）签字（或加盖人名章）并加盖公司公章后成立，自基金合同生效之日起生效。

(3) 本基金保本周期到期日后，基金管理人、保证人双方全面履行了本合同规定的义务，且基金管理人全面履行了其在基金合同项下的义务的，本合同终止。

(4) 保证人承诺继续对下一保本周期提供担保的，基金管理人、保证人另行签署合同。

(5) 本合同正本一式七份，基金管理人执二份，保证人执一份，其余报送相关监管部门备案。每份具有同等的法律效力。

（四） 保证费用的费率和支付方式

担保费由基金管理人从基金管理费收入中列支。

本基金担保费逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理人应于每月收到基金管理费之后的 5 个工作日内向保证人支付担保费。

担保费计算公式：

每日担保费 = 担保费计提日前一日基金资产净值×2%×1/当年日历天数。

(五) 保本

1、保本

在第一个保本周期内,本基金为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额提供的保本金额为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资金额,即基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的净认购金额及募集期间的利息收入之和。在第一个保本周期到期日,如按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额高于或等于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资金额,基金管理人将按可赎回金额支付给基金份额持有人;如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资金额,则基金管理人应补足该差额,并在保本周期到期日后二十个工作日内将该差额支付给基金份额持有人,保证人对此提供不可撤销的连带责任保证。

本基金第一个保本周期后各保本周期到期日,如基金份额持有人持有到期的基金份额的可赎回金额加上其持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和低于其过渡期申购并持有到期的基金份额的投资金额、或从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额的投资金额,由当期有效的基金合同、保证合同或风险买断合同约定的基金管理人、担保人或保本义务人将该差额支付给基金份额持有人。

对于基金持有人多次认购或申购、赎回的情况,以“后进先出”的原则确定持有到期的基金份额。

2、保本周期

本基金的第一个保本周期为3年。

本基金的第一个保本周期自基金合同生效之日起至三个公历年后对应日止。如果该对应日为非工作日,保本周期到期日顺延至下一个工作日。

第一个保本周期届满时,在符合保本基金存续条件下,本基金继续存续并进入下一保本周期,该保本周期的具体起讫日期以本基金管理人届时公告为准。

3、适用保本的情形

(1) 基金份额持有人认购、或过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额。

(2) 对于持有到期的份额,基金份额持有人无论选择赎回、转换到基金管理人管理的

其他基金、本基金转入下一保本周期或是转型为“泰信行业精选混合型证券投资基金”，都同样适用保本条款。

4、不适用保本的情形

(1) 在保本期到期日，按基金份额持有人持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额不低于基金份额持有人持有到期的基金份额的投资金额；

(2) 基金份额持有人认购、过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期，但在基金保本期到期日前（不包括该日）赎回或转换出的基金份额；

(3) 基金份额持有人在当期保本期开始后申购或转换入的基金份额；

(4) 在保本期内发生本基金合同规定的基金合同终止的情形；

(5) 在保本期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形，且担保人或保本义务人不同意继续承担保证责任；

(6) 在保本期到期日之后（不包括该日）基金份额发生的任何形式的净值减少；

(7) 未经担保人或保本义务人书面同意修改基金合同条款，可能加重担保人或保本义务人保本保障责任的，根据法律法规要求进行修改的除外；

(8) 因不可抗力的原因导致基金投资亏损；或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或基金合同规定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的。

（六）保本基金到期的处理方案

1、保本周期到期后基金的存续形式

保本周期届满时，在符合法律法规有关担保人或保本义务人资质要求、并经基金管理人认可的担保人或保本义务人同意为下一个保本周期提供保本保障，与本基金管理人签订保证合同或风险买断合同，同时本基金满足法律法规和本合同规定的基金存续要求的情况下，本基金继续存续并进入下一保本周期，下一保本周期的具体起讫日期以本基金管理人届时公告为准。

如保本周期到期后，本基金未能符合上述保本基金存续条件，则本基金将按基金合同的约定，变更为“泰信行业精选混合型证券投资基金”。同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据基金合同的相关约定作相应修改。上述变更无须经基金份额持有人大会决议，在报中国证监会备案后，提前在临时公告或更新的基金招募说

说明书中予以说明。

如果本基金不符合法律法规和基金合同对基金的存续要求,则本基金将根据本基金合同的规定终止。

2、保本周期到期处理规则

(1) 本基金保本周期到期后,基金份额持有人可以做出如下选择,其保本权利都适用保本条款:

1) 保本周期到期后赎回基金份额;

2) 保本周期到期后将基金份额转换为基金管理人管理的其他基金;

3) 保本周期到期后,本基金符合保本基金存续条件,基金份额持有人持有的基金份额根据届时基金管理人的公告转入下一保本周期;

4) 保本周期到期后,本基金不符合保本基金存续条件,基金份额持有人继续持有变更后的“泰信行业精选混合型证券投资基金”的基金份额。

(2) 基金份额持有人可将其持有的所有基金份额选择上述四种处理方式之一,也可以部分选择赎回、转换出、转入下一保本周期或继续持有变更后基金的基金份额。

(3) 无论基金份额持有人采取何种方式作出到期选择,均无需就其持有到期的基金份额在保本周期到期日的赎回和转换支付赎回费用和转换费用等交易费用。转换为基金管理人管理的其他基金或转为“泰信行业精选混合型证券投资基金”后的其他费用,适用其所转入基金的费用、费率体系。

(4) 本基金保本周期到期后,如基金份额持有人没有作出到期选择,本基金符合保本基金存续条件,则基金管理人将默认基金份额持有人继续持有本基金基金份额;如基金份额持有人没有作出到期选择,本基金不符合保本基金存续条件,则基金管理人将默认基金份额持有人选择了继续持有变更后的“泰信行业精选混合型证券投资基金”的基金份额。

(5) 到期操作采取“未知价”原则,即:在到期操作期间,基金份额持有人赎回本基金基金份额或将本基金基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的,赎回金额或转出金额以基金份额持有人实际操作日的本基金基金份额净值为基准进行计算。

3、到期操作期间

(1) 本基金保本周期到期前,基金管理人将提前公告到期操作期间的具体起止时间,并提示基金份额持有人在此期间内作出到期选择。

本基金的到期操作期间为五个工作日(自保本周期到期日开始计算)。

(2) 在基金管理人指定的到期操作期间内,基金份额持有人可以做出如下选择:

- 1) 在到期操作期间内赎回持有到期的基金份额;
- 2) 在到期操作期间内将持有到期的基金份额转换为基金管理人管理的、已公告开放转换转入的其他基金;
- 3) 保本周期到期后, 本基金符合保本基金存续条件, 基金份额持有人持有到期的基金份额根据届时基金管理人的公告转入下一保本周期;
- 4) 保本周期到期后, 本基金不符合保本基金存续条件, 基金份额持有人继续持有变更后的“泰信行业精选混合型证券投资基金”的基金份额。
 - (3) 在到期操作期间, 基金份额持有人未就其持有的全部或部分基金份额进行到期操作的, 则基金管理人默认基金份额持有人继续持有该部分基金份额:
 - 1) 若本基金符合保本基金存续条件, 则基金管理人默认基金份额持有人继续持有该部分基金份额, 并进入下一保本周期;
 - 2) 若本基金不符合保本基金存续条件, 则基金管理人默认基金份额持有人就该部分基金份额选择继续持有变更后的“泰信行业精选混合型证券投资基金”基金份额。
 - (4) 在到期操作期间, 本基金将暂停日常申购和转换入业务。
 - (5) 在到期操作期间, 基金管理人应使基金财产保持为现金形式, 基金管理人和基金托管人免收该期间的基金管理费和基金托管费。

4、保本周期到期的保本条款

- (1) 持有到期的基金份额持有人, 无论选择赎回、转换到基金管理人管理的其他基金、还是转入下一保本周期或继续持有变更后的“泰信行业精选混合型证券投资基金”的基金份额, 其持有到期的基金份额都适用保本条款。
- (2) 若基金份额持有人选择在持有到期后赎回基金份额, 而可赎回金额加上其持有期间的累计分红金额低于其投资金额, 基金管理人应补足该差额, 以投资金额(扣除其持有期间的累计分红金额)支付给投资者, 保证人对此提供不可撤销的连带责任保证。
- (3) 若基金份额持有人选择在持有到期后进行基金转换, 而可赎回金额加上其持有期间的累计分红金额低于其投资金额, 基金管理人应补足该差额, 以投资金额(扣除其持有期间的累计分红金额)作为转出金额, 保证人对此提供不可撤销的连带责任保证。
- (4) 若基金份额持有人选择继续持有进入下一保本周期的基金份额或变更后的“泰信行业精选混合型证券投资基金”的基金份额, 而可赎回金额加上持有期间的累计分红金额低于投资金额, 基金管理人应补足该差额, 以投资金额(扣除其持有期间的累计分红金额)作为转入下一保本周期或转入变更后的“泰信行业精选混合型证券投资基金”的转入金额, 保

证人对此提供不可撤销的连带责任保证。

(5) 在到期操作期间, 认购本基金基金份额并持有到期的基金份额持有人进行到期操作或默认继续持有的, 可按相应基金份额在保本周期到期日的可赎回金额加上保本周期的累计分红金额低于投资金额的差额享有保本利益, 但对于保本周期到期日之后(不含保本周期到期日)至其实际操作日(含该日)的净值波动风险由基金份额持有人自行承担。

5、本基金转入下一保本周期的方案

保本周期届满时, 基金管理人认可的其他符合条件的担保人或保本义务人为本基金下一保本周期提供保本保障, 与基金管理人就本基金下一保本周期签订保证合同或风险买断合同, 同时本基金满足法律法规和基金合同规定的基金存续要求的, 本基金继续存续并进入下一保本周期。

(1) 过渡期和过渡期申购

到期操作期间截止日起(不含该日)至下一保本周期开始日前一工作日的期间为过渡期; 过渡期最长不超过 20 个工作日。

投资者在过渡期内申请购买本基金基金份额的行为称为“过渡期申购”。在过渡期内, 投资者转换入本基金基金份额, 视同为过渡期申购。

1) 基金管理人将根据担保人或者保本义务人提供的下一保本周期保证额度或保本偿付额度确定并公告本基金过渡期申购规模上限以及规模控制的方法。

2) 过渡期申购采取“未知价”原则, 即过渡期申购价格以申请当日收市后计算的本基金基金份额净值为基准进行计算。

3) 投资者进行过渡期申购的, 其持有相应基金份额至过渡期最后一日(含该日)期间的净值波动风险由基金份额持有人自行承担。

4) 过渡期申购费率

过渡期申购费率最高不超过 5%, 具体费率在招募说明书中列示。

过渡期申购费用由过渡期申购的投资者承担, 不列入基金财产, 主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

5) 过渡期申购的日期、时间、场所、方式和程序等事宜由基金管理人确定并提前公告。

6) 过渡期内, 本基金将暂停办理日常赎回、转换出业务。

7) 过渡期内, 基金管理人应使基金财产保持为现金形式, 基金管理人和基金托管人免收该期间的基金管理费和基金托管费。

(2) 下一保本周期基金资产的形成

1) 持有到期的基金份额

如果保本期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其认购并持有到期的基金份额的累计分红款项之和低于其认购并持有到期的基金份额的投资金额,则转入下一保本周期的部分等于选择转入下一保本周期的基金份额的投资金额(扣除其持有期间的累计分红金额)。

对于投资者认购或者在保本周期内申购、转换入的基金份额,选择或默认选择转入下一保本周期的,转入下一保本周期的转入金额等于选择或默认选择转入下一保本周期的相应基金份额在下一保本周期开始前一工作日(即折算日)所对应的基金资产净值。

2) 过渡期申购的基金份额

对于投资者过渡期申购的基金份额,转入下一保本周期的转入金额等于相应基金份额在下一保本周期开始前一工作日(即折算日)所对应的基金资产净值。

(3) 基金份额折算

过渡期最后一个工作日(即下一保本周期开始日前一工作日)为基金份额折算日。在基金份额折算日,基金份额持有人所持有的基金份额(包括投资者过渡期申购的基金份额、保本周期结束后选择或默认选择转入下一个保本周期的基金份额持有人所持有的基金份额)在其持有的基金份额所代表的资产净值总额保持不变的前提下,变更登记为基金份额净值为1.00元的基金份额,基金份额数额按折算比例相应调整。

在基金份额持有人赎回基金份额时,持有期的计算仍以投资者认购、申购、转换入或者过渡期申购基金份额的实际操作日期计算,不受基金份额折算的影响。

(4) 开始下一保本周期运作

折算日的下一个工作日为下一保本周期开始日,本基金进入下一保本周期运作。

基金份额持有人在当期保本周期的到期操作期间选择或默认选择转入下一保本周期的基金份额以及过渡期申购的基金份额,经基金份额折算后,适用下一保本周期的保本条款。

本基金进入下一保本周期后,仍使用原名称和基金代码办理日常申购、赎回等业务。

自本基金下一保本周期开始后,本基金管理人将暂停本基金的日常申购、赎回、定期定额投资、基金转换等业务。暂停期限最长不超过3个月。

投资者在下一保本周期开始后的开放日申购或转换入本基金基金份额的,相应基金份额不适用下一保本周期的保本条款。

6、转为变更后的“泰信行业精选混合型证券投资基金”资产的形成

保本周期届满时,若不符合保本基金存续条件,本基金依据基金合同的规定从到期操作

期间截止日次日起变更为“泰信行业精选混合型证券投资基金”。

如果保本期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其认购并持有到期的基金份额的累计分红款项之和低于其认购并持有到期的基金份额的投资金额，基金管理人应补足该差额，以投资金额（扣除其持有期间的累计分红金额）作为转入变更后的“泰信行业精选混合型证券投资基金”的转入金额，保证人对此提供不可撤销的连带责任保证。

对于投资者在本基金募集期内认购的基金份额、保本周期内申购或转换入的基金份额，选择或默认选择转为变更后的“泰信行业精选混合型证券投资基金”的，转入金额等于选择或默认选择转为“泰信行业精选混合型证券投资基金”的基金份额在“泰信行业精选混合型证券投资基金”基金合同生效日前一个工作日所对应的基金资产净值。

7、保本周期到期的公告

(1) 保本周期届满时，若符合保本基金存续条件，本基金将继续存续。基金管理人应依照法律法规规定就本基金继续存续及为下一保本周期开放申购的相关事宜进行公告。

(2) 保本周期届满时，若不符合保本基金存续条件，本基金将变更为“泰信行业精选混合型证券投资基金”，基金管理人将在临时公告或《泰信行业精选混合型证券投资基金招募说明书》中公告相关规则。

(3) 在保本周期到期前，基金管理人将进行提示性公告。

8、保本周期到期的赔付

(1) 在发生保本赔付的情况下，基金管理人在保本周期到期日后二十个工作日内向基金份额持有人履行保本差额的支付义务；基金管理人不能全额履行保本差额支付义务的，基金管理人应于保本周期到期日后五个工作日内向保证人发出载明需保证人代偿金额的书面通知并同时通知基金托管人赔付款到账日期。保证人收到基金管理人发出的书面通知后五个工作日内，将需代偿的金额划入本基金在基金托管人处开立的账户中。

(2) 基金管理人应及时查收资金是否到账。如未按时到账，基金管理人应当履行催付职责。资金到账后，基金管理人应按照基金合同的约定进行分配和支付。

(3) 发生赔付的具体操作细则由基金管理人提前公告。

九、基金的投资策略

(一) 投资策略

本基金以优化的恒定比例组合保险方法 (Constant Proportion Portfolio Insurance, CPPI) 为基础来实现保本和增值, 在保本周期中, 通过严格的投资纪律约束和风险管理, 对基金的资产配置进行优化动态调整, 确保投资者的投资本金的安全性。同时, 通过积极稳健的收益资产投资策略, 谋取基金资产的增值。

(1) 优化的恒定比例组合保险方法 (CPPI)

本基金以优化的恒定比例组合保险方法 (CPPI) 为基础来实现保本和增值。

该方法通过将基金资产分为用于保本的保本资产和用于增值的收益资产, 根据市场的波动调整、修正基金资产组合中保本资产与收益资产的比重, 在保本期到期日, 基金资产不低于保本金额的基础上, 达到对投资组合保本增值的目的。其原理公式如下:

$$A_t = m \times (V_t - V_T * e^{-r(T-t)})$$

其中:

A_t 为 t 时可供投资于收益资产的最大规模;

V_T 为基金资产在保本周期到期时需达到的目标规模;

V_t 为 t 时的基金资产;

r 为审慎预测的保本资产的合理收益率;

m 为安全垫放大倍数;

基金管理人通过审慎预测当期需用于保本投资的资产规模 $V_T * e^{-r(T-t)}$, 继而得到安全垫的规模 $(V_t - V_T * e^{-r(T-t)})$, 通过设定安全垫放大倍数 m, 控制基金投资于收益资产的规模, 在保本期到期实现保本目标的基础, 争取实现基金资产的增值。

(2) 资产配置策略

本基金的投资组合比例为: 股票、权证等收益资产占基金资产的 0%-40%, 其中, 持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%; 债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的 60%-100%, 其中, 基金持有现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

根据恒定比例组合保险方法,确定投资保本资产和收益资产的比例,并对两部分资产比例进行动态调整。

(3) 股票投资策略

本基金在构造股票投资组合时,采用自上而下的方法,定量与定性分析相结合。通过股票组合的构建有效的规避个股的非系统风险,通过行业的筛选选出具具备投资和估值优势的行业,通过公司分析鉴别出具具备成长和投资潜力的优质公司。

通过定性分析精选出主营业务分明、公司治理良好、管理优秀规范,具备核心竞争优势和较好成长能力的公司进行投资。

定量分析包括行业地位、资产负债结构、盈利能力、增长潜力、分红能力和市场估值六个方面,具体包括市值排名、净资产收益率、主营业务增长率、净利润增长率、资产负债率、分红稳定率等指标。

根据本基金的风险收益特征,在进行股票投资时,本基金将力求获取绝对收益,在控制投资组合风险的基础上获取稳健的收益。

(4) 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。

(5) 现金管理策略

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。

(二) 投资决策依据和决策程序

1、投资决策依据

- (1) 国家有关法律法规和基金合同的规定;
- (2) 宏观、微观经济运行环境和证券市场走势;
- (3) 国家财政、货币政策、产业政策、区域规划与发展政策;
- (4) 证券市场的发展水平和走势及基金业发展状况;

(5) 上市公司的行业发展状况、景气指数及竞争优势;

(6) 上市公司的持续盈利能力以及综合价值的评估;

2、投资操作程序

本基金参与投资决策和操作的机构和部门包括:投资决策委员会、基金投资部、研究部以及风险管理部,投资操作包括投资准备、投资决策、投资执行和投资评估等四个程序。

(1) 投资准备程序

① 债券备选库的建立与维护

研究员根据基金合同中的规定及市场状况,初选出符合本基金投资策略的债券,建立备选库,并定期进行维护。

② 债券核心库的建立与维护

研究部与投资部综合分析各类债券的信用状况、收益率水平、风险特征、流动性、久期、利息税务处理等因素,精选债券,建立债券核心库,并动态进行维护。

③ 股票库的建立与维护

研究员根据基金合同中的规定,初选出符合本基金投资策略的证券备选库。研究部与基金投资部确定具有良好投资回报预期的资产配置比例,并对个股深入调研,精选股票。

(2) 投资决策程序

① 基金经理构造投资组合计划;

② 风险管理部对投资组合计划进行风险收益分析,提出修正意见;研究部策略研究员通过宏观、中观分析,对投资组合的资产配置提出意见;

③ 投资决策委员会通过月度、季度、年度会议和不定期会议对基金配置的组合方案进行审议和确定。

(3) 投资执行程序

基金经理通过交易室对投资组合方案进行实施。

(4) 投资评估程序

① 风险管理部对投资组合进行跟踪评估,提出风险控制意见,按照风险大小,定期或随时向基金经理、投资总监、投资决策委员会报告。

② 评估和调整决策程序:投资决策委员会根据环境的变化和实际需要可以调整决策的程序,基金经理调整投资组合应按授权权限和批准程序进行。

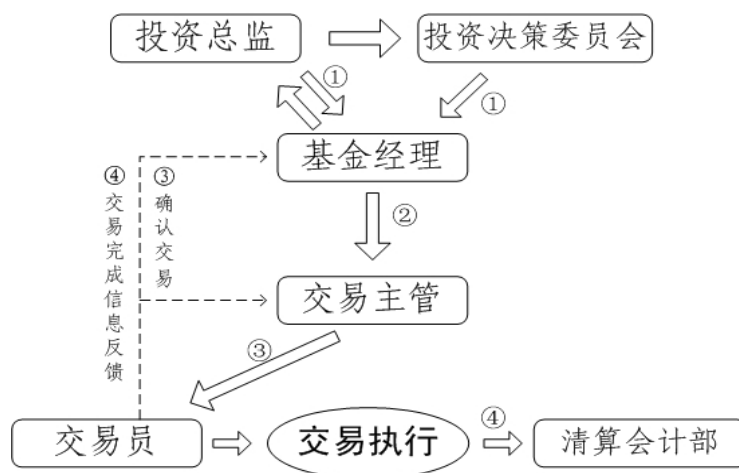
风险管理部的基金评估报告主要包括两大部分,即基金绩效归因报告和基金风险评估报

告。基金绩效归因报告分析指标包括大类资产配置贡献分析、基金收益风格分解、Brinson 行业归因分析模型和十大个股贡献分析。基金风险评估报告包括基金风险调整收益特征分析、组合 VAR 风险分析和个股流动性风险分析。

3、投资组合的贯彻实施

本公司建立了一整套完善的公司内部规章制度和相应的投资管理流程,确保投资组合方案的贯彻实施。投资组合方案的执行过程如下图所示:

图 基金投资组合方案执行流程图



资料来源：泰信基金；

① 基金投资组合方案执行实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，由基金经理根据授权具体承担执行。基金经理可配若干名基金经理助理协助其工作。

投资决策委员会对基金投资组合方案执行实行授权制，授权的具体权限由投资决策委员会根据每只基金的规模、风格具体确定，也可以在投资组合方案中临时确定、调整。

基金投资总监、基金经理分别在授权的范围内根据投资组合方案决定投资的具体执行。基金经理在授权范围内根据投资组合方案可以直接下达交易指令；超出基金经理授权权限但是在基金投资总监授权权限范围内的，经投资总监审批后，由基金经理下达交易指令；超出基金投资总监权限的，由投资决策委员会审批后，由基金经理下达交易指令。

② 基金经理下达的交易指令到达集中交易室交易主管后，交易主管再分配给各交易员。交易主管应尽量平均分配各交易员的工作量。

交易指令全部以电脑下单方式完成。在电脑发生故障等意外情况时，交易指令可以录音电话或书面方式下达，禁止以非录音或口头方式下达。

③ 交易员在确认指令无误后，根据指令的要求，结合自身的操作经验合理地完成交易。

- ④ 交易员应及时将交易情况反馈给交易主管、基金经理和清算会计部。

(三) 投资限制

1、投资比例限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1) 持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；
- (2) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- (3) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- (4) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；
- (5) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内全部卖出；
- (6) 现金或到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；
- (7) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%。
- (8) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (10) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (11) 本基金不得违反基金合同关于投资范围和投资比例的约定；
- (12) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，本基金不受上述限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券；
- (7) 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；
- (8) 当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

十、基金的业绩比较标准

本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款的税后收益率。

此业绩比较基准是在综合考虑本基金的投资策略、保本期限等特点的基础上制订的。本保本基金，保本期为三年，保本但不保证收益率。以三年期银行定期存款的税后收益率作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金的投资者理性判断基金产品的风险收益特征，合理的比较本基金的业绩表现，衡量保本条款的有效性。

十一、基金的风险收益特征

本基金为保本基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

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根据本基金合同已于2013年2月25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 | 6,199,192.10 | 6.93 |
| | 其中:股票 | 6,199,192.10 | 6.93 |
| 2 | 固定收益投资 | 76,881,745.60 | 85.90 |
| | 其中:债券 | 76,881,745.60 | 85.90 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,768,522.04 | 1.98 |
| 6 | 其他资产 | 4,649,041.66 | 5.19 |
| 7 | 合计 | 89,498,501.40 | 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 | 采掘业 | - | - |
| C | 制造业 | 3,621,768.10 | 6.04 |
| C0 | 食品、饮料 | 22,080.00 | 0.04 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 73,960.00 | 0.12 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 1,839,008.10 | 3.06 |
| C5 | 电子 | 95,640.00 | 0.16 |
| C6 | 金属、非金属 | 47,600.00 | 0.08 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 189,000.00 | 0.31 |
| C8 | 医药、生物制品 | 1,354,480.00 | 2.26 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |

| | | | |
|---|----------------|--------------|-------|
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 交通运输、仓储业 | 13,230.00 | 0.02 |
| G | 信息技术业 | 290,904.00 | 0.48 |
| H | 批发和零售贸易 | 2,195,010.00 | 3.66 |
| I | 金融、保险业 | - | - |
| J | 房地产业 | - | - |
| K | 社会服务业 | 64,720.00 | 0.11 |
| L | 传播与文化产业 | 13,560.00 | 0.02 |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 6,199,192.10 | 10.33 |

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 | 600056 | 中国医药 | 91,500 | 1,847,385.00 | 3.08 |
| 2 | 002108 | 沧州明珠 | 137,450 | 1,061,114.00 | 1.77 |
| 3 | 600079 | 人福医药 | 26,000 | 608,140.00 | 1.01 |
| 4 | 000423 | 东阿阿胶 | 14,000 | 565,740.00 | 0.94 |
| 5 | 002408 | 齐翔腾达 | 30,000 | 502,800.00 | 0.84 |
| 6 | 000861 | 海印股份 | 23,450 | 330,645.00 | 0.55 |
| 7 | 002405 | 四维图新 | 24,800 | 290,904.00 | 0.48 |
| 8 | 603001 | 奥康国际 | 9,900 | 202,158.00 | 0.34 |
| 9 | 002073 | 软控股份 | 25,000 | 189,000.00 | 0.31 |
| 10 | 600276 | 恒瑞医药 | 6,000 | 180,600.00 | 0.30 |

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 | 4,012,342.60 | 6.69 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 42,677,403.00 | 71.12 |
| 5 | 企业短期融资券 | 30,192,000.00 | 50.31 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |

| | | | |
|---|----|---------------|--------|
| 9 | 合计 | 76,881,745.60 | 128.12 |
|---|----|---------------|--------|

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 | 041254021 | 12 利港 CP001 | 200,000 | 20,104,000.00 | 33.50 |
| 2 | 122132 | 12 鹏博债 | 100,000 | 10,301,000.00 | 17.17 |
| 3 | 041253012 | 12 紫江 CP001 | 100,000 | 10,088,000.00 | 16.81 |
| 4 | 122702 | 12 海安债 | 80,000 | 8,408,000.00 | 14.01 |
| 5 | 122755 | 12 潭城建 | 50,000 | 5,250,000.00 | 8.75 |

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的前五名权证投资明细

报告期末本基金未持有权证。

8、 投资组合报告附注

8.1 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。

8.2 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。

8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,866,933.06 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,782,108.60 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,649,041.66 |

8.4 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的处于转股期的可转换债券。

8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

8.6 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。

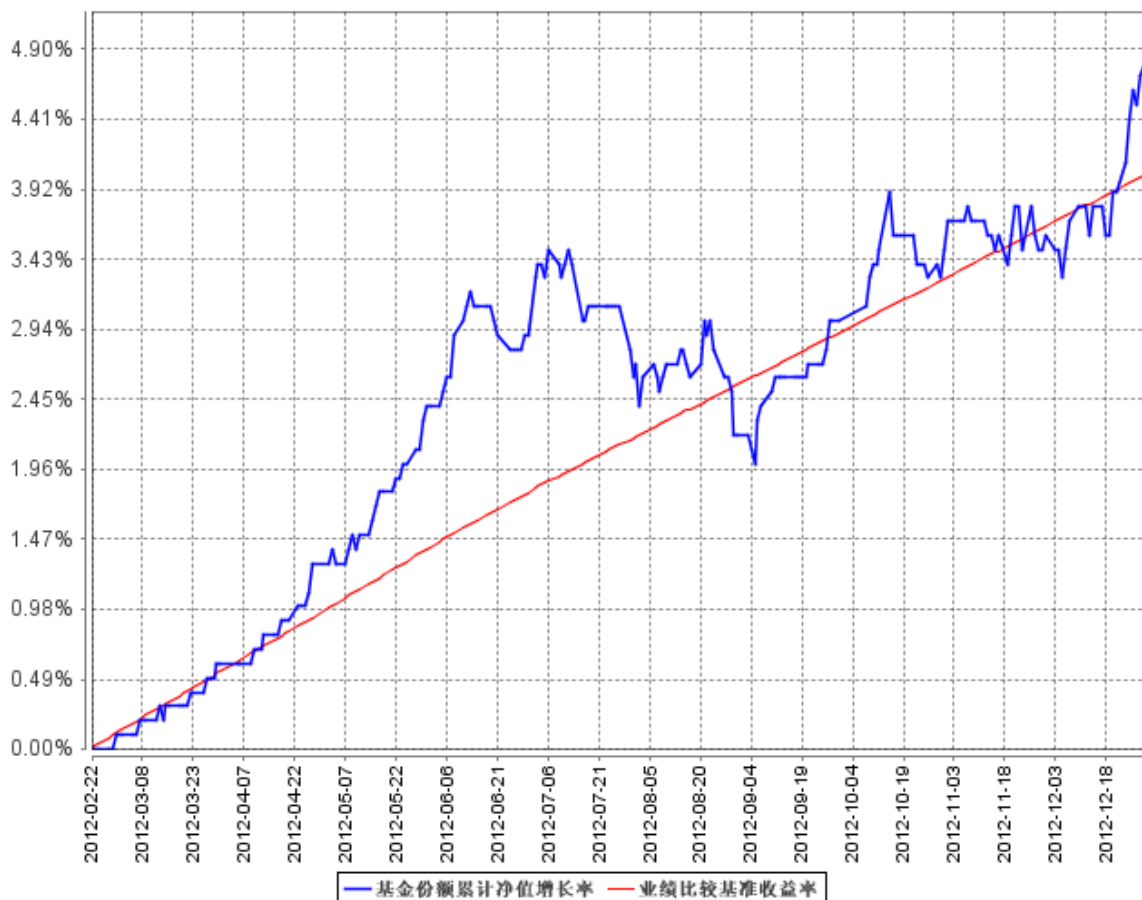
(一) 本基金合同生效日为2012年2月22日。基金合同生效以来(截至2012年12月31日)的投资业绩与同期基准的比较如下表所示:

| 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 |
|-------------------|---------|------------|-------------|----------------|-------|-------|
| 20120222-20120630 | 2.90% | 0.07% | 1.80% | 0.01% | 1.10% | 0.06% |
| 20120222-20121231 | 4.92% | 0.12% | 4.04% | 0.01% | 0.88% | 0.11% |

(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:

(2012年2月22日至2012年12月31日)

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2012 年 2 月 22 日正式生效。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满，本基金的投资组合比例为：股票、权证等收益资产占基金资产的 0%-40%，其中，持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的 60%-100%，其中，基金持有现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

十四、费用概览

(一) 与基金运作有关的费用

1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.2%的年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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前2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、公休假等,支付日期顺延。

其中,在基金保本周期内,本基金的保证费用从基金管理人的管理费收入中列支。

2、基金托管人的基金托管费

在通常情况下,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。

托管费的计算方法如下:

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

过渡期内本基金不计提管理费和托管费。

若保本周期到期后,本基金不符合保本基金存续条件,基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“泰信行业精选混合型证券投资基金”的基金份额,管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提,托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法同上。

3、上述(一)基金费用的种类中第3—7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。

(二) 与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金的申购费用按照《销售费用管理规定》收取,本基金基金份额采用前端收费模式收取基金申购费用。在申购时收取的申购费称为前端申购费。费率按申购金额递减,申购费率具体如下表所示:

| 申购金额 | 申购费率 |
|------------------|------|
| 100 万以下 | 1.2% |
| 100 万(含) - 500 万 | 1.0% |

| | |
|-----------|-------------|
| 500万(含)以上 | 收取固定费用1000元 |
|-----------|-------------|

若保本周期到期后,本基金不符合保本基金存续条件,转为变更后的“泰信行业精选混合型证券投资基金”,申购费率不高于基金申购金额的5%,具体费率以届时公告为准。

2、赎回费

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费率具体如下表所示:

| 持有时间 | 赎回费率 |
|------------|------|
| 1年以下 | 2.0% |
| 1年(含1年)-2年 | 1.6% |
| 2年(含2年)-3年 | 1.2% |
| 3年以上(含3年) | 0% |

本基金收取的赎回费中不低于25%的部分归入基金财产,其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

若保本周期到期后,本基金不符合保本基金存续条件,转为变更后的“泰信行业精选混合型证券投资基金”,赎回费率不高于基金赎回金额的5%,具体费率以届时公告为准。

3、基金管理人可以根据基金合同的相关约定调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在指定媒体公告。

(三) 其它与基金运作有关的费用

- (1) 基金信息披露费用;
- (2) 基金份额持有人大会费用;
- (3) 与基金相关的会计师费和律师费;
- (4) 证券交易费用;
- (5) 按照国家有关规定和本基金合同规定可以列入的其他费用。

法律法规另有规定时从其规定。

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《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格

式准则第5号《基金招募说明书的内容与格式》等有关法律法规及《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》的规定，结合泰信保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）近半年的投资经营情况，对2012年9月28日公告的《泰信保本混合型证券投资基金更新招募说明书》进行了必要的补充及更新

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、第三节“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及公司旗下基金情况进行了更新。

(2) 在“(三)主要人员情况”部分，对公司董事会、监事会成员人员变动情况及相关任职信息进行了更新；对公司高管、投委会成员变动情况进行了更新。

3、第五节“相关服务机构”代销机构部分，对本基金代销机构的信息进行了必要的更新。

4、第七节“基金的转换、非交易过户及转托管”部分，更新了截止2013年2月22日基金定期定额投资、基金转换业务办理情况。

5、第九节“基金的投资”部分，根据本基金2012年第4季度报告的相关内容，重新调整了“七、基金投资组合报告”的内容（未经审计）。

6、第十节“基金的业绩”部分，修订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。

7、第二十二节“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公告信息。

泰信基金管理有限公司

2013年4月3日