泰信中小盘精选混合型证券投资基金

更新招募说明书

摘要

（2015 年 2 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

二〇一五年十二月三日

一、重要提示

本基金根据2011年7月20日中国证券监督管理委员会《关于核准泰信中小盘精选股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2011]1138号） 和2011年8月26日《关于泰信中小盘精选股票型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2011]682 号）的核准，进行募集。

根据2014年8月8日施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》(证监会令第104号）第三十条第一项的规定“股票基金的股票资产投资比例下限由60%上调至80%”。我公司经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自2015年8月7日起将泰信中小盘精选股票型证券投资基金变更为混合型证券投资基金，基金合同中的相关条款亦做相应修订。

本基金为契约型开放式，基金合同于2011年10月26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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

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，投资人认购或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2015年9月30日，净值表现数据的截止日期为2015年9月30日，其他内容截止日期为2015年10月26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：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：王小林

总经理：葛航

电话：（021）20899188

传真：（021）20899008

联系人：王斌

发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co.，Ltd.）是由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日经中国证监会批准筹建，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2015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2015年10月26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基金、泰信鑫益定期开放债券共15只开放式基金及泰信乐利5号、泰信至尊阿尔法3号、泰信至尊阿尔法5号、泰信至尊阿尔法6号、泰信道简阿尔法、泰信紫藤智慧金1号、泰信吉渊分级1号、泰信梭鱼安盈新股1号、泰信鲁信1号、泰信磐晟稳健1号、泰信磐晟定增1号共11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

王小林先生，董事长，硕士，高级经济师；历任山东省国际信托投资公司证券管理总部副总经理，山东省高新技术投资有限公司总经理助理，山东鲁信文化传媒投资有限公司副总经理，山东省鲁信投资控股集团有限公司办公室主任，山东省国际信托有限公司党委书记、总经理（拟任），中国银监会国际部副主任（挂职）；现任山东省鲁信投资控股集团有限公司副总经理。

徐宏强，副董事长，硕士，高级经济师；曾任江苏省国际信托投资公司租赁部项目经理，南京国际租赁有限公司业务部经理，江苏省国际信托投资公司综合计划部科长，江苏省国际集团综合计划部科长、副总经理，南京国际租赁有限公司总经理，江苏省国信集团发展规划部副总经理；现任江苏省投资管理有限责任公司综合财务部总经理。

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。

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；现任青岛国信集团副总经理。

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。

丁玮先生，独立董事，经济学学士；曾任世界银行华盛顿总部经济学家、项目经理、部门

主管，德意志银行中国区总裁，中国国际金融有限公司董事总经理、投行业务负责人，淡马锡投资控股高级董事总经理、中国区总裁。

（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。

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。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。

董山青先生，职工监事，工商管理硕士。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，现任基金投资部总监助理、泰信行业精选混合基金经理。

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

王小林先生，董事长，硕士，高级经济师；历任山东省国际信托投资公司证券管理总部副总经理，山东省高新技术投资有限公司总经理助理，山东鲁信文化传媒投资有限公司副总经理，山东省鲁信投资控股集团有限公司办公室主任，山东省国际信托有限公司党委书记、总经理（拟任），中国银监会国际部副主任（挂职）；现任山东省鲁信投资控股集团有限公司副总经理。

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。

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

刘杰先生，研究生硕士，证券从业经历 5 年。2009 年 7 月加入泰信基金管理有限公司，先后任研究部助理研究员、研究员、高级研究员兼专户投资部投资顾问。自 2015 年 3 月 17 日起担任本基金的基金经理。

姓名	管理本基金的时间
柳菁	2011 年 10 月 26 日至 2015 年 9 月 25 日

3、投资决策委员会成员名单

本基金采取集体投资决策制度，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。

三、基金托管人

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：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

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：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：王小林

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：崔佳权

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：深圳市福田区深南大道与民田路交界西南新华保险大厦 1310 室

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）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

（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：牛锡明

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：刘士余

传真：010-85109219

客服电话：95599

网址：www.95599.cn

（5）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：唐双宁

联系人：朱红

电话：010-63636153

传真：010-63639709

客服电话：95595

网址：www.cebbank.com

（6）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9号东方文化大厦

法定代表人：常振明

联系人：王媛

传真：010-85230059

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

（7）北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：闫冰竹

联系人：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。

（8）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

（9）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

(10)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

（11）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：周杨

电话：0755-82130833

传真：0755-82133302

客服电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

（12）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

（13）广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路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

（14）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

（15）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

（16）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

（17）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。

（18）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

（19）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：林俊波

联系人：赵小明

电话：021-68634510-8620

传真：021-68865680

客服电话：400-888-1551

网址：www.xcsc.com

（20）万联证券有限责任公司

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

（21）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：余政

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

（22）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：王春峰

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

（23）华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

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：吴万善

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

传真：025-51863323（南京）、0755-82492962（深圳）

客服电话：95597

网址： www.htsc.com.cn

（24）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：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

（25）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：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

（26）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：刘汝军

联系人：孙恺

电话：010-83561000

传真：010-83561001

客服电话：4006989898

网址：www.xsdzq.cn

（27）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼

法定代表人：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

（28）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：96518、400-809-6518

网址：www.hazq.com.cn

（29）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

（30）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

（31）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：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：朱科敏

联系人：王一彦

电话：021-20333333

传真：021-50498825

客服电话：95531、400-888-8588

网址：www.longone.com.cn

（32）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.qlzq.com.cn

(33) 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：杨宝林

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

（34）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：戴蕾

电话：0791-86768681

传真：0791-86770178

客服电话：400-8866-567

网址：www.avicsec.com

（35）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：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

（36）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

（37）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：上海市闸北区永和路 118 弄 24 号

法定代表人：贾绍君

联系人：汪尚斌

电话：021-36537114

传真：021-36538467

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

（38）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：黄耀华

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

（39）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

（40）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

（41）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

（42）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

（43）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：李红光

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

（44）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

（45）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：020-961303

网址：www.gzs.com.cn

（46）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：高竹

客服电话：40018-40028

网址：www.wkzq.com.cn

（47）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：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

（48）杭州数米基金销售有限公司

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

（49）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物资控股置地大厦8楼

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn及www.jjmmw.com

（50）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

（51）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

（52）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

（53）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

（54）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

（55）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

（56）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：沈继伟

联系人：赵沛然

客服电话：400-067-6266

网址：www.leadbank.com.cn

（57）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

（58）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

（59）北京恒天明泽基金销售有限公司

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层 2302

法定代表人：梁越

客服电话：4008-980-618

网址：www.chtfund.com

（60）上海汇付金融服务有限公司

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

(61) 深圳富济财富管理有限公司

深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区高新南七道惠恒集团二期 418 室

法定代表人：齐小贺

联系人：陈勇军

客服电话：0755-83999913

网址：www.jinqianwo.cn

（二）注册登记机构

名称： 泰信基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路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：王小林

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：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：泰信中小盘精选混合型证券投资基金

基金简称：泰信中小盘精选混合

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，包括国内依法公开发行上市的各类股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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）。

本基金将基金资产的 60%-95%投资于股票，现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，债券、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规和监管机构的规定执行。本基金投资于中小盘股票的比例不低于股票投资资产的 80%。

此外，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。

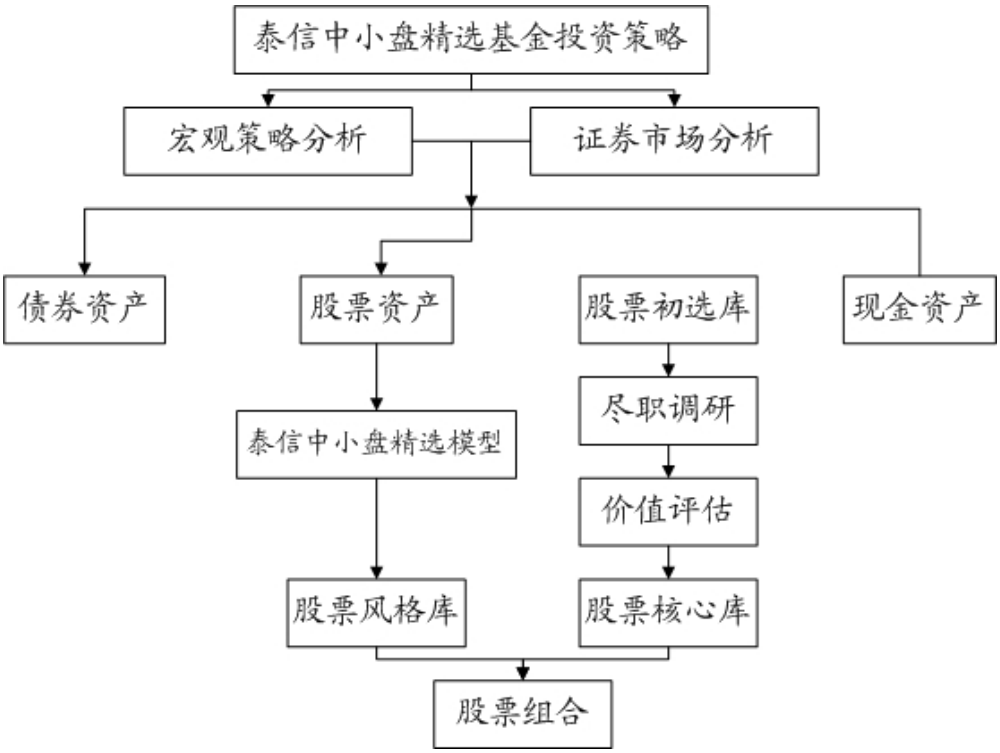
八、基金的投资目标

本基金通过投资具有高成长潜力的中小盘股票，追求基金资产的长期稳定增值。在严控风险的前提下，力争获取超越业绩基准的稳健收益。

九、基金的投资策略

本基金将结合“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”的个股精选策略，重点投资于萌芽期和成长期行业中具有持续成长潜力以及未来成长空间广阔的中小型上市公司，同时考虑组合品种的估值风险和大类资产的系统风险，通过品种和仓位的动态调整降低资产的波动风险。

图　泰信中小盘精选证券投资基金投资策略示意图



资料来源：泰信基金；

1、大类资产配置策略

本基金管理人通过自己开发的分析工具和模型来综合分析和动态跟踪影响各大类资产风险收益的因素，制定股票、债券和货币市场工具等大类资产的配置比例、调整原则和调整范围。主要的分析工具和模型包括基本面周期指数模型和均值反转模型等。

（1）基本面周期指数模型。我们参照国外的投资时钟模型，运用经济周期理论，对中国近十多年的经济周期进行了更为细致的划分和研究，从周期观点出发，构建基于不同周期阶段的基本面周期指数模型，同时根据周期不断重复运转的原理，应用周期时空映射方法，对基本面指数进行外推预测，从而起到对资本市场未来走势预判的实际效用。根据对我国经济周期的经验研究结果我们将经济周期划分为四个大阶段和六个子阶段（具体划分标准见下表）。本基金在投资时间中将参考模型的预测结果，优化资产配置。

表　经济周期和资产配置

周期	状态	经济增长状态	物价状态	流动性	最优资产
衰退	衰退初期	下降	下降/震荡	下降	债券
	衰退后期	上升	下降	下降/上升	股票
复苏	复苏前期	上升	震荡	上升/下降	股票/商品

繁荣	经济繁荣	上升	上升	上升	股票/商品
滞胀	滞涨前期	下降	震荡/上升	上升	债券/现金/商品
	滞涨后期	下降	上升	下降	债券

资料来源：泰信基金

（2）均值反转模型。实证研究发现我国证券市场存在显著的均值反转的现象，基于此我们开发了A股市市场的均值反转模型，根据A股市场的估值指标（PE和PB）的周期特征来判断市场的机会和风险。另外，利用“均值反转”的基本思想，对A股市场各行业的相对估值指标（如行业PB/市场PB，行业PE/市场PE，或称为行业估值溢/折价）进行统计，并以此作为寻找相对收益机会的依据。当某些行业的相对估值水平较过往历史已接近或达到极值状态(最高或最低)，往往存在“价值回归”型的投资机会；对于那些估值水平处于相对高位，而基本面或政策预期又可能出现不利变化的行业，则应及时回避风险。

通过运用上述的工具和模型，研究部的策略小组将提供资产配置的建议，提交公司投资决策委员会讨论通过后交由基金经理执行。

2、股票投资策略

（1）中小盘股票的定义

基金管理人每半年末将对中国A 股市场中的股票按流通市值从小到大排序并相加，累计流通市值达到A 股总流通市值2/3的这部分股票称为中小盘股票。在此期间对于未被纳入最近一次排序范围的股票（如新股、恢复上市股票等），如果其流通市值（对未上市新股而言为本基金管理人预计的流通市值）可满足以上标准，也称为中小盘股票。

一般情况下，上述所称的流通市值指的是在国内证券交易所上市交易的股票的流通股本乘以收盘价。如果排序时股票暂停交易或停牌等原因造成计算修正的，本基金将根据市场情况，取停牌前收盘价或最能体现投资者利益最大化原则的公允价值计算流通市值。当权威的证券数据服务机构能够提供可供投资者在公开股票市场上买卖的自由流通股本数据时，本基金管理人可采取自由流通股本乘以收盘价计算流通市值。

基金因所持有股票价格的相对变化而导致中小盘股票投资比例低于基金合同规定的范围，本基金管理人将根据市场情况，本着投资者利益最大化的原则，适时予以调整，最长不超过 3个月。如果今后市场中出现更科学合理的中小盘股票界定及流通市值计算方式，本基金将予以相应调整，并提前公告变更后具体的计算方法。

（2）行业配置策略

行业特征从很大程度上决定了行业中上市公司的基本属性，在经济发展的不同阶段、不同的政策环境及市场环境下，各个行业的景气状态将有很大的区别，基金的行业配置对基金收益具备重要影响。本基金将采用自上而下的行业分析方法首先从行业层面进行筛选。

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投资价值的行业进行重点配置。

① 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。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。

② 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，上述三项指标的数值均大于 1 的行业将是本基金的投资重点。

中小企业由于经营策略灵活，专注细分市场，将充分受益于国家对新兴产业的发展扶持和对经济增长结构的调整。在行业精选过程中，本基金在投资中，将重点关注具备以下优势的中小盘上市公司：

① 在新兴产业中的领军企业

新兴产业通常企业规模相对较小，而中小盘股票也主要来自于新兴产业。新兴产业是指在原来的粗放的经济发展方式转变成为科学的可持续的发展方式过程中受益和诞生的新行业和新企业，其中蕴含了丰富的投资机会。本基金将紧密跟踪产业发展趋势，通过研究产业政策、结构和周期的变化，分析并预测新兴产业各子行业的基本面，同时考虑行业估值与轮动等因素，精选新兴行业的优质投资标的。

② 在传统产业转型中处于领先地位的企业

产业结构的调整和增长方式的转变，是一个提高自主创新能力、整合各类资源，促使传统产业向集约化、规模化、节能化发展的过程；也是运用新科学、新技术和新的经营模式使原有企业蜕变升华的过程。传统产业的成功转型能够提高社会资源配置的效率，促进国民经济协调持续的发展。本基金将关注产业结构调整的趋势和推动力，精选在传统产业转型中处于优势地位的优质投资标的。

（2）中小盘股票的投资

本基金将综合定性分析与定量分析手段，运用“泰信中小盘精选模型”，在对公司竞争优势、成长性和经营健康性进行尽职调研的基础上结合估值分析，精选中小盘优质个股，构建优化的股票投资组合。

① 公司竞争优势分析

由于中小市值上市公司所处市场的总体规模、自身的业务规模、投融资能力等因素有所限制的原因，对其公司基本面进行分析时，不仅需衡量当前及过往状况，更需着眼于未来，衡量其核心竞争力在企业未来成长过程中所带来的投资机会。

本基金将运用“泰信中小盘精选模型”对公司的竞争优势进行综合评分，模型对企业的竞争优势主要从四个方面进行考量：技术、管理、资源和政策。在具体的运用“泰信中小盘精选模型”的过程中，公司投研人员尤其注重定性指标所体现出的公司成长的持续性，模型四个方面的考察要点主要如下：

技术：包括核心技术的领先程度、持续的技术创新能力、专利等核心优势的排他性等优势；

管理：公司是否具有良好的治理结构、管理层是否具有良好的管理经验和能力、是否制定了合适的薪酬计划等。

资源：包括公司所拥有的排他性的有形资产和无形资产、在供应链中所具备的议价能力等；

政策：公司所处产业及所生产的产品是否符合政府产业政策导向、是否享受政府税收和补贴优惠、是否获得政策支持等；

虽然竞争优势分析不能如财务指标那样进行定量计算，但是我们会对同行业的公司的以上四方面进行排序打分，然后将上述四项的得分进行加权综合，其中，技术、管理、资源、政策的权重分别为 40%、30%、20%、10%。

一般来说，企业的可持续增长是指在可预见的 5 年以上盈利的持续增长，通常这种成长应该明显高于行业的平均增长水平和国民经济的增长速度。我们重视企业可持续的源泉，是否具有可持续和可复制的经营模式等。如果企业的可持续增长是来源于其不断进步的技术优势、可复制的经营策略、可持续的自身比较优势，那么我们认为这种增长将维持很长的时间，也是我们投资的重点。从以上各种竞争优势的权重可以看出，我们特别重视企业管理者包括全体员工通过主观能动性创造出来的研发和管理优势，这是决定企业核心竞争力和可持续成长的根本因素和长期因素。

② 成长性和经营健康性分析

本基金的综合成长性指标主要包括主营业务收入增长率和净利润增长率。在考虑成长性时，本基金并不仅考虑公司过去的成长性，更通过上市公司当前和过往的数据发掘其未来的成长性。主营业务收入增长率是企业成长性最重要的判断指标，较高的主营业务收入增长率隐含的是企业市场份额的扩大、未来盈利潜力的提高、盈利稳定性的增强；而净利润增长率则反映了公司的盈利能力和盈利增长情况，是衡量上市公司经营效益的重要指标。

本基金的经营健康性指标包括净资产收益率、资产负债率、总资产周转率、主营业务利润率。通过关注经营健康性指标，分析公司资产负债结构以及资产流动性状况，合理的负债结构和良好的流动性状况隐含的是公司未来进行扩大规模的能力、获取融资规模及降低融资成本的能力、抵御市场风险的能力，这些能力往往能够改变竞争格局，并为公司业绩的增长创造有利的环境。

③ 尽职调研

本基金的尽职调研评估系统主要通过实地调研和第三方佐证的信息来评估上市公司在公司治理、信息披露、运营管理、竞争力、诚信守法、风险管理等方面的能力和可信性。本基金将运用本公司开发的“上市公司调查四十问”方法，对股票组合的候选公司在资信、诚信、竞争力、意外风险等四大方面进行综合打分，以选出优质的成长型公司，尽最大努力为基金份额持有人增加财富。

④ 估值分析

本基金的股票估值分析在传统定价分析的基础之上，对备选的中小盘股票价值进行动态评估，判断其合理区间，挑选出被市场低估的公司。

本基金的股票估值分析的内容主要包括：

A 估值模型包括： PEG、PE、PB、DCF 等。

B 成长型公司的竞争性溢价：按照成熟市场上持续成长型公司的合理溢价水平，对公司股票赋予合理的溢价。

C 结合基本面分析、估值分析及市场整体估值水平，判断股票价格的合理区间及价格走势，筛选出市场价格低估或合理的上市公司股票。

3、债券投资策略

在本基金的债券投资过程中，本基金管理人将充分发挥在研究能力方面的优势，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。

4、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。

十、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：中证 700 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

我们认为选择该业绩比较基准能够真实反映本基金长期动态的资产配置目标和风险收益特征。

本基金采用该业绩比较基准，主要基于以下考虑：

1、中证 700 指数是中证指数有限公司以沪深 300 指数为基础编制的系列规模指数之一，全称为中证中小盘 700 指数（中 CSI Small&Midcap 700 index），上海行情代码为 000907，深圳行情代码为 399907。其成分股由代表中盘特征的中证 200 指数的成分股和代表小盘特征的中证 500 指数的成分股共同构成，中证 700 指数编制合理、透明，运用广泛，能够综合反映沪深证券市场内中小市值公司的整体状况，对中国 A 股中小盘市场具有较强的代表性和权威性。

2、中证全债指数以银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券为样本，是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，具有良好的债券市场代表性，运用较为广泛。

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，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金可以在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，主要通过发掘具有高成长潜力的中小盘股票实现基金资产增值，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已于 2015 年 11 月 16 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、截至 2015 年 9 月 30 日基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	301,408,244.64	80.64
	其中：股票	301,408,244.64	80.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	71,550,057.02	19.14
8	其他资产	820,463.36	0.22
9	合计	373,778,765.02	100.00

2、截至 2015 年 9 月 30 日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	218,006,295.84	58.59
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	8,413,484.30	2.26
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	48,686,724.50	13.09
J	金融业	9,604,500.00	2.58
K	房地产业	11,285,240.00	3.03
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	5,412,000.00	1.45
	合计	301,408,244.64	81.01

3、截至 2015 年 9 月 30 日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	300142	沃森生物	792,700	21,941,936.00	5.90
2	000917	电广传媒	850,000	16,405,000.00	4.41
3	600581	八一钢铁	2,640,500	16,027,835.00	4.31
4	600990	四创电子	259,787	15,626,188.05	4.20
5	002228	合兴包装	869,301	13,222,068.21	3.55
6	300112	万讯自控	1,003,410	12,883,784.40	3.46
7	600198	大唐电信	680,000	12,437,200.00	3.34
8	600562	国睿科技	270,000	11,288,700.00	3.03
9	002208	合肥城建	910,100	11,285,240.00	3.03
10	600100	同方股份	780,000	11,216,400.00	3.01

4、截至 2015 年 9 月 30 日按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

5、截至 2015 年 9 月 30 日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

报告期末本基金未持有债券。

6、截至 2015 年 9 月 30 日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、截至 2015 年 9 月 30 日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、截至 2015 年 9 月 30 日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。

9、截至 2015 年 9 月 30 日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。

10、投资组合报告附注

10.1 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。

10.2 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。

10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	749,938.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,117.70
5	应收申购款	49,407.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	820,463.36

10.4 截至 2015 年 9 月 30 日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。

10.5 截至 2015 年 9 月 30 日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。

10.6 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

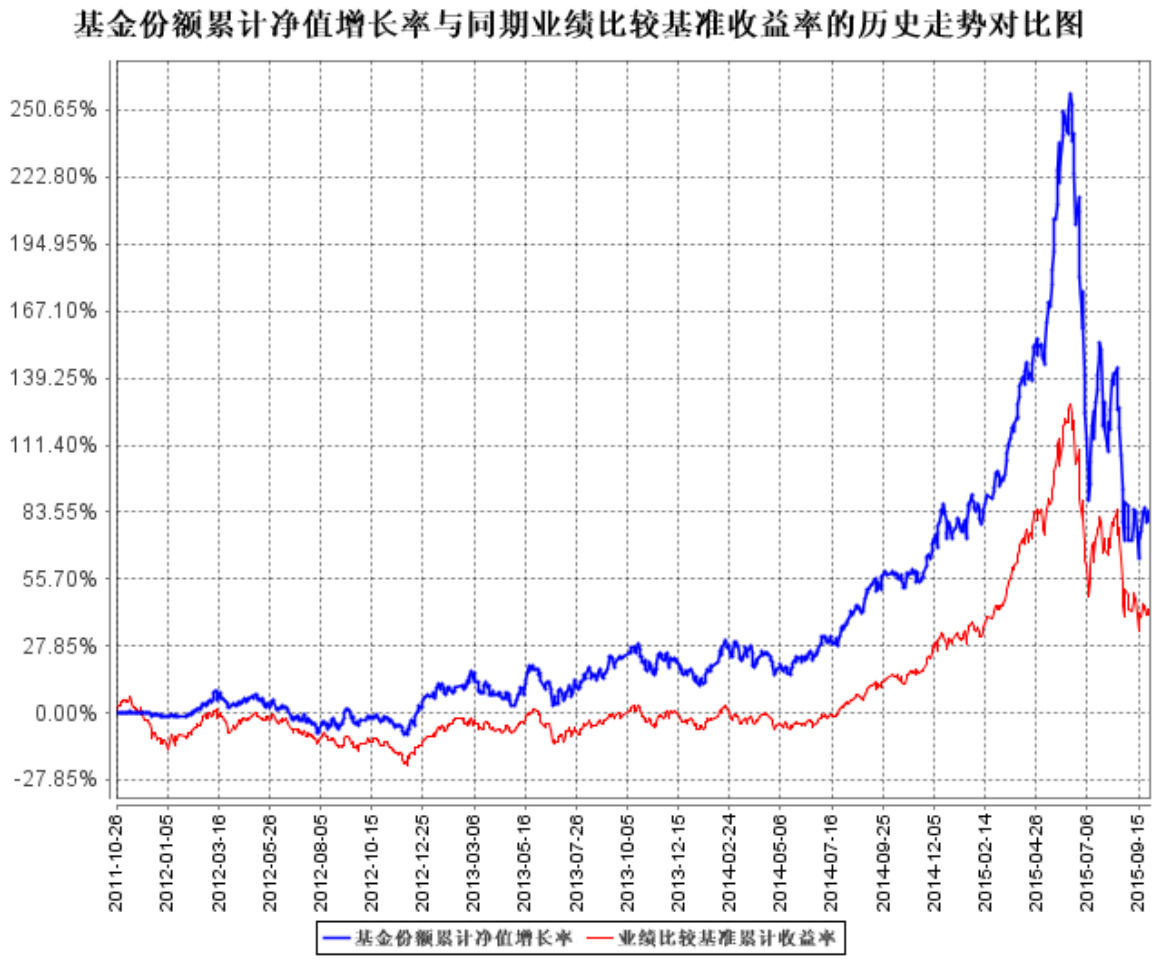
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）本基金合同生效日为 2011 年 10 月 26 日。基金合同生效以来（截至 2015 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
20150101-20150930	3.23%	3.10%	8.65%	2.40%	-5.42%	0.70%
20150101-20150630	57.00%	2.30%	44.75%	1.84%	12.25%	0.46%
20140101-20141231	47.91%	1.31%	32.79%	0.95%	15.12%	0.36%
20130101-20131231	9.53%	1.47%	8.17%	1.13%	1.36%	0.34%
20120101-20121231	9.23%	0.99%	1.86%	1.19%	7.37%	-0.20%
20111026-20111231	-1.10%	0.15%	-11.17%	1.22%	10.07%	-1.07%
20111026-20150930	80.68%	1.75%	41.21%	1.44%	39.47%	0.31%

（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：

（2011 年 10 月 26 日至 2015 年 9 月 30 日）



注：1、泰信中小盘精选股票基金基金合同于 2011 年 10 月 26 日正式生效。本基金自 2015 年 8 月 7 日起变更为混合型基金。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满，本基金将基金资产的 60%-95%投资于股票，现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，债券、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规和监管机构的规定执行。本基金投资于中小盘股票的比例不低于股票投资资产的 80%。

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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提。

管理费的计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷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，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

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0.25%的年费率计提。

托管费的计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷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，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、本部分第（一）条第 3 至第 8 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及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等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（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	1.5%
100 万（含）- 500 万	1.2%
500 万（含）以上	收取固定费用 1000 元

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	0.50%
1 年（含 1 年）- 2 年	0.25%
2 年以上（含 2 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。

3、基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告。

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>》、《泰信中小盘精选混合型证券投资

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 2015 年 6 月 3 日公告的《泰信中小盘精选股票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“（二）注册资本、股权结构”部分，根据股东山东省国际信托股份有限公司的更名公告，对相应内容进行了更新。

（3）在“（三）主要人员情况”部分，对公司董事的任职信息及基金经理的变动情况进行了更新。

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 2015 年 10 月 26 日，泰信中小盘精选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：

（1）本基金类型自 2015 年 8 月 7 日起股票型变更为混合型，据此对“（八）风险收益特征”的内容作相应调整。

（2）根据本基金2015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。

9、自2015年8月7日起旗下泰信优质生活股票型证券投资基金、泰信蓝筹精选股票型证券

投资基金、泰信发展主题股票型证券投资基金、泰信中小盘精选股票型证券投资基金及泰信现代服务业股票型证券投资基金共5只股票型证券投资基金变更为混合型证券投资基金，据此对以上5只基金的名称作相应调整。

泰信基金管理有限公司

2015 年 12 月 3 日