泰信周期回报债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2014年2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：二〇一四年九月十九日

一、重要提示

本基金根据2010年11月30日中国证券监督管理委员会《关于同意泰信周期回报债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2010]1739号）和2010年12月24日《关于同意泰信周期回报债券型证券投资基金募集时间安排的函》（基金部函[2010]791号）的核准，进行募集。

本基金为契约型开放式，基金合同于2011年2月9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。

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。

本更新招募说明书有关财务数据（未经审计）和投资组合数据的截止日为2014年6月30日，净值表现数据的截止日期为2014年6月30日，其他所载内容截止日期为2014年8月9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。

投资者欲了解更详细的资料，请登录本基金管理人的网站（www.ftfund.com）查阅本更新招募说明书的全文。

二、基金管理人

（一）基本情况

基金管理人名称：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
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：庄严

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。

公司目前下设锐懿资产管理有限公司、市场部、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2014年8月底，公司有正式员工101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2014年8月9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、泰信优质生活股票、泰信优势增长混合、泰信监筹精选股票、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、泰信现代服务业股票基金、泰信鑫益定期开放债券共15只开放式基金及泰信恒益高息债分级、泰信乐利分级1号、泰信量化对冲分级1号、泰信财富分级6号、泰信财富分级7号、泰信乐利3号、至尊阿尔法共7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、经理及其他高级管理人员基本情况

（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）；现任山东省鲁信投资控股集团有限公司副总经理、中国银监会国际部副主任（挂职）。

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；江苏阚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。

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，现任中央汇金公司派任光大银行董事。

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。

（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、工会主席。

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、泰信保本混合基金经理。

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。

（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）；现任山东省鲁信投资控股集团有限公司副总经理、中国银监会国际部副主任（挂职）。

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。

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，18年证券从业经历。曾任职于上海鸿安投资咨询有限公司、齐鲁证券有限责任公司。2002年12月加入泰信基金管理有限公司，曾任泰信天天收益基金基金经理。自2008年10月起至今担任泰信双息双利债券基金基金经理；自2009年7月29日起兼任泰信债券增强收益基金基金经理；自2012年10月25日起兼任本基金基金经理；自2013年7月17日起兼任泰信鑫益定期开放债券基金经理。现同时担任基金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
刘兴旺	2011年2月9日至2012年10月25日

3、投资决策委员会名单

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，泰信先行策略混合基金、泰信优势增长混合基金基金经理；
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经理、泰信鑫益定期开放债券基金基金经理；
刘毅先生，基金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：中信银行股份有限公司（简称“中信银行”）
住所：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：常振明
成立时间：1987年4月7日
组织形式：股份有限公司
注册资本：467.873亿元人民币
存续期间：持续经营
批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14号
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2004]125号
联系人：中信银行资产托管部
联系电话：010-65558812
传真：010-65550832
客服电话：95558
网址：bank.ecitic.com

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同行业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

四、相关服务机构

（一）直销机构

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：邵齐
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
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：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

（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：蒋超良
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：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人：唐双宁
联系人：李伟
电话：010-68098778
传真：010-68560661
客服电话：95595
网址：www.cebbank.com

（6）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

（7）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：常振明
联系人：朱义明、方臻
传真：010－65550827
客服电话：95558
网址：bank.ecitic.com

（8）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：吴建
客服电话：95577
网址：www.hxb.com.cn

（9）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。

（10）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：董文标
联系人：董云巍　吴海鹏
客服电话：95568
网址：www.cmbc.com.cn

（11）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

（12）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：陶敏琪
电话：021－38676666
传真：021－38676666
客服电话：400－8888－666
网址：www.gtja.com

(13)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

（14）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

（15）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

（16）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：林治海
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

（17）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

（18）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

（19）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

（20）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

（21）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：罗创斌
电话：020－37865070
传真：020－22373718－1013
客服电话：400－8888－133
网址：www.wlzq.com.cn

（22）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.mszq.com

（23）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

（24）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：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
联系人：万鸣
电话：025－83290979
传真：025－84579763
客服电话：95597
网址：www.htsc.com.cn

（25）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

（26）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22－29层
办公地址：上海市中山南路318号2号楼21－29层
法定代表人：潘鑫军
联系人：吴宇
电话：021－63325888－3108
传真：021－63326173
客服电话：95503
网址：www.dfzq.com.cn

（27）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：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

（28）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：张蓥
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

（29）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

（30）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：杨宇翔
联系人：周璐
电话：400－8866338
传真：0755－82400862
客服电话：400－8816－168
网址：www.pingan.com

（31）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

（32）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

（33）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

（34）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

（35）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

(36) 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

（37）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

（38）德邦证券有限责任公司
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：方加春
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

（39）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：金春
电话：0755－83025695
传真：0755－83025625
客服电话：400－8888－228
网址：www.jyzq.cn

（40）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

（41）宏源证券股份有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：冯茂
联系人：李巍
电话：010－88085858
传真：010－88085195
客服电话：400－800－0562
网址：www.hysec.com

（42）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

（43）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

（44）爱建证券有限责任公司
注册地址：上海市南京西路758号23楼
办公地址：上海市南京西路758号20－25楼
法定代表人：郭林
联系人：陈敏
电话：021－62171984
传真：021－62878783
客服电话：021－63340678
网址：www.ajzq.com

（45）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

（46）中信证券（浙江）有限责任公司
注册地址：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
办公地址：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
法定代表人：沈强
电话：0571－85783750
传 真：0571－85783771
联系人：俞会亮
客户热线：95548
网址：www.bigsun.com.cn

（47）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

（48）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

（49）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

（50）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

（51）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

（52）广州证券有限责任公司
注册地址：广州市越秀区先烈中路69号东山广场主楼17楼
办公地址：广州市越秀区先烈中路69号东山广场主楼17楼
法定代表人：吴志明
联系人：吴志明
电话：020－87322668
传真：020－87325036
客服电话：020－961303
网址：www.gzs.com.cn

（53）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

（54）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

（55）杭州数米基金销售有限公司
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：market.fund123.cn

（56）深圳众禄基金销售有限公司
办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦254楼I、J单元
法定代表人：薛峰
客服电话：4006－788－887
网址：www.zlfund.cn及www.jmmw.com

（57）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

（58）上海天天基金销售有限公司
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

（59）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

（60）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：牛冠兴
联系人：余江
电话：0755－82825551
传真：0755－82558355
统一客服电话：4008－001－001
网址：www.essence.com.cn

（61）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

（三）基金注册登记机构

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：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

（四）出具律师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

（五）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
经办注册会计师：单峰、傅琛慧

五、基金的名称

基金名称：泰信周期回报债券型证券投资基金
基金简称：泰信债券周期回报

六、基金的类型

契约型开放式

七、基金的投资目标

在控制风险和保持资产流动性的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

八、基金的投资方向

本基金主要投资于债券类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、地方政府债券、金融债、央行票据、企业（公司）债、短期融资券、可分离债券、资产支持证券、次级债、银行存款等。本基金可参与一级市场新股申购或公开增发的股票，也可参与可转债的一级市场申购，但不从二级市场主动买入股票和可转债。

九、基金的投资策略

（一）投资策略

1、资产配置策略

（1）战略性资产配置

本基金将根据基金的投资目标和投资理念，进行战略性资产配置，确定固定收益率类资产和现金类资产的投资比例，以构建最佳长期资产组合结构，同时运用基本面研究择机参与新股申购，以提高组合收益。

（2）战术性资产配置

在战略性资产配置的基础上，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、基金流动性情况等因素的动态分析，定期或不定期召开投资决策委员会会议，跟踪影响资产策略配置的各种因素的变化，战术性配置资产，进行投资时机选择和仓位控制，获取投资收益，降低投资风险。

（3）类别资产配置策略

在战术性资产配置策略下，根据各类债券资产的风险来源、收益率水平、利息税务处理以及市场流动性等因素，将市场细分为普通债券（含国债、地方债券、金融债、央行票据、企业债、短期融资券等）、附权债券、货币市场工具等子市场，采取积极投资策略，定期对投资组合各类别资产及其个券进行最优化配置和调整，同时运用基本面研究择机参与新股申购。

2、构建投资组合

（1）债券资产总体配置策略

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。

（2）信用债投资策略

根据国民经济运行周期阶段，分析企业债券发行人所处行业发展前景、业务发展状况、企业市场地位、财务状况、管理水平、债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险，并根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定企业债券的信用风险利差。在此基础上，积极寻求高投资收益率和可接受信用风险的优化组合，在具体实施上，有以下几个策略：

①信用策略

信用债收益率等于基准收益率加信用利差，信用利差收益率主要受两个方面的影响，一是对应该信用债信用水平的市场信用利差曲线走势；二是该信用债本身的信用变化。基于这两方面的因素，我们综合采用基于信用利差曲线变化的策略、基于信用债券信用变化的策略及互换策略等投资分析策略。

②息差策略

通过债券回购融入和滚动短期资金作为杠杆，投资于收益率高于融资成本的其它获利机会，从而获得杠杆放大收益。按照现行规定，本基金进入银行间同业市场进行债券