

## 泰信双息双利债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,履行相应程序后可以

对业绩比较基准进行相应调整。

## 十二、基金的投资组合报告(未经审计)

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

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同已于2009年11月26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。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	107,129,818.97	17.11
	其中:股票	107,129,818.97	17.11
2	固定收益投资	502,918,262.43	80.31
	其中:债券	502,918,262.43	80.31
	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	3,197,513.56	0.51
6	其他资产	13,014,302.76	2.08
	合计	626,259,897.72	100.00

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	5,837,400.00	0.97
C	制造业	68,879,906.03	11.39
C0	食品、饮料	3,872,530.96	0.64
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	889,148.16	0.15
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,466,500.00	0.75
C5	电子	5,892,353.82	0.97
C6	金属、非金属	19,456,849.26	3.22
C7	机械、设备、仪表	24,316,769.00	4.02
C8	医药、生物制品	4,426,968.94	0.75
C9	其他制造业	4,569,794.80	0.75
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,634,464.06	1.26
F	交通运输、仓储业	669,219.68	0.11
G	信息技术业	1,174,350.86	0.19
H	批发和零售贸易	707,124.60	0.12
I	金融、保险业	12,326,500.00	2.04
J	房地产业	3,456,000.00	0.57
K	社会服务业	701,758.16	0.12
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	5,744,100.00	0.96
	合计	107,129,818.97	17.11

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	600000	浦发银行	350,000	6,877,500.00	1.14
2	601668	中国建筑	1,433,033	6,649,273.12	1.10
3	600184	新华光	250,000	5,560,000.00	0.92
4	600612	老凤祥	199,991	4,569,794.80	0.75
5	000043	中航地产	280,000	4,485,600.00	0.74
6	600036	招商银行	300,000	4,434,000.00	0.73
7	600660	福耀玻璃	375,235	3,831,149.35	0.63
8	600875	东方电气	80,000	3,769,200.00	0.62
9	600104	上汽集团	180,000	3,565,000.00	0.59
10	600619	贵州茅台	20,000	3,297,200.00	0.55

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	249,225,000.00	41.20
2	央行票据	49,835,000.00	8.24
3	金融债券	-	-
4	企业债券	75,096,723.70	12.42
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	128,761,538.73	21.29
7	其他	-	-
	合计	502,918,262.43	83.15

5、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	020015	09国债15	1,500,000	149,535,000.00	24.72
2	099915	09财国债15	1,000,000	99,690,000.00	16.48
3	125709	国债转债	466,701	53,600,609.85	8.86
4	0901041	09央票41	600,000	49,835,000.00	8.24
5	110003	新债转债	270,050	32,130,549.00	5.31

6、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。  
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五名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。  
8、投资组合报告附注  
8.1 本基金本报告期的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。  
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	125,000.00
2	应收证券清算款	10,656,333.98
3	应收利息	-
4	应收申购款	1,933,664.40
5	应付赎回款	297,304.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	13,014,302.76

8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	125709	国债转债	53,600,609.85	8.86
2	110003	新债转债	32,130,549.00	5.31
3	109608	大冠转债	22,843,441.80	3.78
4	110667	山鹰转债	13,137,070.00	2.17
5	110971	恒源转债	5,634,137.00	0.92
6	125900	福业转债	3,091,114.18	0.51

8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601668	中国建筑	6,649,273.12	1.10	网下申购锁定

8.6 报告期末本基金未投资控股大股东承销的证券,未从二级市场投资分离交易可转债附送的权证,投资流通受限证券未违反相关法规或本基金管理公司的规定。

十二、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。投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 基金管理人管理业绩及其与同期业绩比较基准收益率的比较:

阶段	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	①-③	②-④
20090101-20090930	-0.97%	0.60%	0.34%	0.08%	-1.21%	0.52%
20090101-20091231	7.11%	0.17%	9.40%	0.10%	-2.29%	0.07%
20071031-20091231	1.72%	0.13%	0.86%	0.06%	0.86%	0.07%
20071031-20090930	7.99%	0.39%	10.73%	0.09%	-2.74%	0.30%

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

(2007年10月31日至2009年9月30日)



十四、费用概览

(一) 与基金运作有关的费用

1. 基金管理费  
(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事务所费;

(7) 基金的销售及交易费用;

(8) 银行汇划费用;

(9) 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

2. 基金费用的费率、计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理费  
基金管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。计算方法如下:

H = E × 0.7% × 当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

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

(2) 基金托管费  
基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下:

H = E × 0.20% × 当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

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

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

目前,本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.30%的年费率计提。计算公式如下:

H = E × 0.30% × 当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日基金资产净值

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

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

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

(二) 与基金销售有关的费用

1. 基金认购费;

2. 基金申购费;

3. 基金赎回费;

持有时间 赎回费率

30天以下 0.1%

30天以上(含30天) 0%

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

十五、对招募说明书更新部分的说明

本更新招募说明书依据《基金法》、《基金运作办法》、《基金销售办法》、《信息披露办法》、《内容与格式准则第5号<基金招募说明书的内容与格式>》、《泰信双息双利债券型证券投资基金合同》以及其他有关法律法规的要求,结合本基金最近半年的投资运作情况,对2009年6月13日公告的《泰信双息双利债券型证券投资基金更新招募说明书(2009年第1号)》的内容进行了必要的补充和更新。

具体情况如下:

1、“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”中,对公司正式员工人数及公司旗下基金总规模情况进行了必要的更新;

2. 在“(三)主要人员情况”中,董事会成员中增加“季元成先生”、“俞二牛先生”、“刘敬庭先生”、“李惠珍女士”、“张中秋先生”、“刘学鹏先生”、“刘俊海先生”;监事会成员中增加“刘晓东先生”、“李伟群先生”,删除“牟东明先生”、“桑维英女士”;投资决策委员会成员中增加了“刘强先生”、“赵海东先生”,删除了“王鹏先生”,并对其其他成员的职务信息进行了更新。

3. 在“(四)基金管理人”部分,对基金托管人的主要管理人员及主要业务经营等情况进行了更新。

4. 在“(五)相关服务机构”部分,增加了南京银行、光大证券、华宝证券、爱建证券,删除了远东证券被新代证券有限责任公司吸收合并、信泰证券(被华泰证券股份有限公司吸收合并),并对其其他代销机构服务的情况进行了相应的更新。

5. 在“七、基金转换、非交易过户、及转托管”部分,补充了截止2009年10月31日,泰信双息双利基金与本公司旗下其他基金之间的可转换情况以及可办理泰信双息双利基金定投业务的机构情况。

6. 在“(八)基金的投资”部分,根据本基金2009年第3季度报告的相关内容,重新调整了“(十)基金投资组合报告”的内容。

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

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

泰信基金管理有限公司

2009年12月15日

证券代码:A股 600695 股票代码:600695 公告编号:2009-017  
B股 900919  
股票简称:A股 大江股份 B股 大江股份  
上海大江(集团)股份有限公司  
第六届董事会2009年第二次临时会议决议公告

本董事会及全体董事保证本公告内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

上海大江(集团)股份有限公司(以下简称“公司”)第六届董事会于2009年12月11日召开2009年第二次临时会议,会议以书面方式召开。本次会议决议事项于2009年12月17日以前,由电子邮件及电话方式发出,会议召开符合有关法律、法规和公司章程的规定。会议经审议通过了《关于调整公司下属部分子公司股权结构的议案》。

为适应公司业务管理需要,清晰资产与业务管理关系,公司决定以评估价格2300.25万元将公司持有的上海双瑞实业发展有限公司100%股权转让给全资子公司上海大江房地产有限公司;以评估价格1008.20万元将公司持有的上海江科置业发展有限公司100%股权转让给全资子公司上海大江房地产有限公司;以评估价格4717.52万元将公司持有的上海阳盈置业有限公司90%股权转让给全资子公司上海大江房地产有限公司。上述交易事项为集团公司内部的公司股权转让,因此对集团公司合并报表范围及损益不产生影响。

特此公告。

上海大江(集团)股份有限公司  
2009年12月15日

证券代码:600696 证券简称:多伦股份 编号:临2009-022  
上海多伦实业股份有限公司  
大股东股权质押及质押公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

日前,接公司第一大股东多伦股份(香港)有限公司的通知,2009年12月11日,该公司将原质押与新华信托股份有限公司的8300万股我司无限售流通股,在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理了股权质押解除手续。

同日,该股东持有的我司9700万股无限售流通股(含上述解除质押股份),再质押与新华信托股份有限公司(质押两年),并在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理了股权质押登记手续。

截至目前,多伦股份(香港)有限公司所持有的我司124314430股无限售流通股(占公司股份总数的36.50%),已质押12200万股。

特此公告。

上海多伦实业股份有限公司  
二〇〇九年十二月十四日

证券代码:600767 证券名称:运盛实业 编号:2009-030号  
运盛(上海)实业股份有限公司  
大股东股权质押及质押公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

接公司第一大股东上海九川投资有限公司通知,上海浦东发展银行股份有限公司江西支行中国证券投资基金有限公司上海分公司办理了3760万股限售流通股股权质押解除手续,中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于2009年12月11日出具了证券质押解除解除通知书。

上海九川投资有限公司以其持有的本公司3733万股限售流通股质押向中国国际信托有限公司贷款。上海九川投资有限公司向中国证券投资基金有限公司上海分公司办理了股权质押登记手续,中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于2009年12月11日出具了证券质押登记证明。

特此公告。

运盛(上海)实业股份有限公司  
董事会  
2009年12月14日

证券代码:600821 证券简称:津劝业 编号:2009-010  
天津劝业场(集团)股份有限公司  
2009年度第一次临时股东大会决议公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

天津劝业场(集团)股份有限公司2009年第一次临时股东大会于2009年12月14日上午9时30分在公司九楼九重天会议室召开,出席会议的9名股东代表股份9280192股,占公司股份总数的22.34%,符合《公司章程》及有关法律的规定。会议由公司董事长张立女士主持,会议审议了以下事项,并以记名投票方式对如下事项进行了表决:

审议通过《关于转让持有天津市华运商贸物业有限公司部分股权的议案》,同意92990192股,占出席会议有效表决权股份总数的100%。反对0股,弃权0股。

天津高志思源律师事务所律师出席了本次股东大会,认为本次股东大会的召集、召开程序、出席会议人员的资格、表决程序均合法有效。

特此公告。

天津劝业场(集团)股份有限公司  
董事会  
2009年12月14日

易方达基金管理有限公司关于易方达货币市场基金恢复办理大额申购业务的公告

为满足广大投资者的投资需求,根据有关法律法规及基金合同的规定,易方达基金管理有限公司(以下简称“公司”)决定自2009年12月21日起取消易方达货币市场基金大额申购限制,即取消单日单个基金账户累计申购易方达货币市场基金A级基金或B级基金金额不应超过1000万元的限制,恢复办理上述基金的大额申购业务。

如有疑问,请拨打本公司客户服务热线400 881 8088(免长途话费),或登陆本公司网站www.efunds.com.cn获取相关信息。

特此公告

易方达基金管理有限公司  
2009年12月15日

证券代码:600740 证券简称:山西焦化 编号:临2009-024号  
山西焦化股份有限公司  
聘请的年度审计机构名称变更公告

重要提示:本公司全体成员保证公告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

山西焦化股份有限公司近日接到公司聘请的年度审计机构“北京中天华会计师事务所有限责任公司”名称变更通知,经北京市工商行政管理局核准,该事务所名称变更为“京都天华会计师事务所有限公司”,其他未发生变更。

特此公告。

山西焦化股份有限公司董事会  
二〇〇九年十二月十四日

证券代码:600771 证券简称:ST东盛 编号:临2009-039  
东盛科技股份有限公司关于股东减持股份公告

特别提示  
本公司及董事会全体成员保证公告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

东盛科技股份有限公司(以下简称“公司”)于2009年12月14日接到本公司大股东钢铁集团(以下简称“钢铁集团”)通知,截至2009年12月11日,钢铁集团通过二级市场减持了本公司股份2,697,630股(占本公司总股本的1.10%)。截至2009年12月11日收盘,钢铁集团尚持有本公司股份16,617,736股,占本公司总股本的6.82%,仍为公司第三大股东。

特此公告。

东盛科技股份有限公司董事会  
二〇〇九年十二月十四日

证券代码:600791 编号:临2009-037号  
京能置业股份有限公司  
2009年第二次临时股东大会决议公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

重要提示:

- 1、本次会议无否决或修改提案的情况;
- 2、本次会议无新提案提交审议。

京能置业股份有限公司(以下简称“公司或本公司”)2009年第二次临时股东大会于2009年12月14日上午,在北京市海淀区彩和坊路8号中关村科技大厦12层西侧公司会议室召开。参加本次大会的股东及代表6人,代表股份211,585,249股,占公司总股本452,880,000股的46.72%。符合《公司法》及公司章程的规定。公司董事、监事及高级管理人员和律师出席了会议。

本次会议由董事、总经理谢建忠先生主持。经参会股东审议通过以下决议:

- 1、以211,585,249股占参会股东所持有效表决权股份的100%同意,0股反对,0股弃权,通过了公司关于控股子公司内蒙古京能抵押贷款1.5亿元并为其贷款提供连带保证责任的议案;
- 2、同意京能置业控股子公司内蒙古京能房地产开发有限公司将“蓝色理想”项目的土地使用权及部分在建工程(土地面积46033.2平方米;在建工程地上100539平方米,地下35600平方米)作抵押,向中国建设银行股份有限公司内蒙古自治区分行营业部贷款1.5亿元,期限两年,年利率5.4%。为了保证上述资金能够顺利获得,本公司同意内蒙古京能上述1.5亿元抵押贷款事项;并同意为上述1.5亿元贷款提供连带保证责任,保证期间为自债务履行期限届满之日后两年止。
- 3、在关联股东京能集团回避表决的情况下,以601,604股(占参会股东所持有效表决权股份的100%)同意,0股反对,0股弃权,通过了公司关于与京