关于泰信先行策略开放式证券投资基金
修改基金合同和托管协议的公告

根据2017年10月1日起施行的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《规定》”）第四十一条之规定，“对已经成立的开放式基金，原基金合同内容不符合本规定的，应当在本规定施行之日起6个月内，修改基金合同并公告”。根据《规定》等法律法规，经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，泰信基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对旗下泰信先行策略开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）的《泰信先行策略开放式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）相关条款进行修订，具体修改内容见对照表。

本次《基金合同》修订的内容系因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改，对基金份额持有人利益无实质性不利影响，且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化，不需召开基金份额持有人大会。本次《基金合同》修订已经本基金管理人与基金托管人协商一致并已报监管机构备案。本基金管理人经与基金托管人协商一致，已相应修改本基金的《泰信先行策略开放式证券投资基金托管协议》，本公司将于公告当日，将修订后的《基金合同》、《托管协议》登载于公司网站，并将在上述基金招募说明书（更新）中对相应内容进行修改。

同时，依据《规定》“基金管理人应当强化对投资者短期投资行为的管理，对除货币市场基金与交易型开放式指数基金以外的开放式基金，对持续持有期少于7 日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产”对本基金赎回费进行调整，调整后的赎回费收取方式如下：

持有期限	赎回费率
0-6 天	1.50%
7-90 天	0.50%
91-180 天	0.35%
181-365 天	0.18%
366-730 天	0.10%
731 天及以上	0

上述基金合同、托管协议的修订及赎回费相关规则调整等事宜自2018年3月31日生效。对于2018年3月30日15：00之前的赎回申请，适用调整前的赎回费规则；对于2018年3月30日15：00之后的赎回申请，适用调整后的赎回费规则。

投资者可访问泰信基金管理有限公司网站(http://www.ftfund.com/)或拨打全国免长途费的客户服务电话（400-888-5988）咨询相关情况。

特此公告。

泰信基金管理有限公司

二〇一八年三月二十四日

泰信先行策略开放式证券投资基金基金合同修改前后文对照表

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容
一、释义	无	《流动性风险管理规定》：指中国证监会公布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》；流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等；
二、前言	（一）订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《合同法》、《基金法》、《销售办法》、《运作办法》、《信息披露办法》及其他有关规定。	（一）订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《合同法》、《基金法》、《销售办法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》及其他有关规定。
六、基金份额的申购和赎回	（五）申购与赎回的金额 3、基金申购与赎回的数额限制 本基金申购与赎回的数额限制由基金管理人确定并在招募说明书或有关公告中规定。基金管理人可根据市场情况调整有关申购与赎回的程序和数额限制，但应最迟在调整生效前3个工作日在指定媒体公告。	（五）申购与赎回的金额 3、基金申购与赎回的数额限制 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益， 具体请参见招募说明书或相关公告。 本基金申购与赎回的数额限制由基金管理人确定并在招募说明书或有关公告中规定。基金管理人可根据市场情况调整有关申购与赎回的程序和数额限制，但应最迟在调整生效前3个工作日在指定媒体公告。
	（六）申购与赎回的价格、费用及其用途 3、基金的赎回费由赎回人承担，赎回费总额的 25％归入基金财产，75％用于销售代理费和注册登记费	（六）申购与赎回的价格、费用及其用途 3、基金的赎回费由赎回人承担。本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费，并将

	等相关手续费用。	上述赎回费全额计入基金财产；对其他投资者收取的赎回费总额的25％归入基金财产，75％用于销售代理费和注册登记费等相关手续费用。
	（八）拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式 1、除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请： （4）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；	（八）拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式 1、除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请： （4）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响的某笔申购； （5）基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避 50%集中度的情形时； （6）当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；
	3、除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停接受投资者的赎回申请： 无	3、除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停接受投资者的赎回申请： （4）当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；
	（九）巨额赎回的认定及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 ……	（九）巨额赎回的认定及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 …… （3）当发生巨额赎回且存在单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，基金管理人可以对该基金份额持有人超过前述约定比例的赎回申请进行延期办理，对于当日未延

		期办理的赎回申请，基金管理人根据上述（1）或（2）处理。当日未获受理的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推；如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。
七、基金合同当事人及权利义务	（一）基金管理人与基金托管人 1、基金管理人：泰信基金管理有限公司 住所：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42 层 法定代表人：朱崇利 总经理：高清海 成立时间：2003 年 5 月 8 日 注册资本：1 亿元人民币 联系电话：021-50372168 2、基金托管人：中国光大银行 住所：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦 法定代表人：王明权 成立时间：1992 年 8 月 注册资本：82.17 亿元人民币	（一）基金管理人与基金托管人 1、基金管理人：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 37 层 法定代表人：万众 总经理：葛航 成立时间：2003 年 5 月 23 日 注册资本：2 亿元人民币 联系电话：021-20899188 2、基金托管人：中国光大银行股份有限公司 住所：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心 法定代表人：唐双宁 成立时间：1992 年 6 月 18 日 注册资本：466.79 亿元人民币
十三、基金的投资	（四）投资风格及业绩比较基准 本基金为混合型基金，灵活调整股票、债券和现金的投资比例。在正常市场情况下，本基金组合投资的基本范围为：股票资产 30%－95%，债券资产 0%－65%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%。其中，股票投资的重点为由本基金先行策略选股系统挑选出的，兼具价值成长特征和价值回归潜能的股票。	（四）投资风格及业绩比较基准 本基金为混合型基金，灵活调整股票、债券和现金的投资比例。在正常市场情况下，本基金组合投资的基本范围为：股票资产 30%－95%，债券资产 0%－65%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。其中，股票投资的重点为由本基金先行策略选股系统挑选出的，兼具价值成长特征和价值回归潜能的股票。
	（七）基金投资限制 ……	（七）基金投资限制 …… 2、保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债

	因基金规模或市场剧烈变化导致投资组合不符合上述规定时，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以符合上述规定。	券，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等； 7、本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%； 8、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； 9、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致； 除上述第 2、8、9 项外，因基金规模或市场剧烈变化导致投资组合不符合上述规定时，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以符合上述规定。
十五、基金资产估值	七、暂停估值的情形 3、中国证监会认定的其他情形。	七、暂停估值的情形 3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值； 4、法律法规、中国证监会认定的其他情形。
十九、基金的信息披露	（二）信息披露的种类、披露时间和披露形式 2、基金运作信息披露 （3）季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将	（二）信息披露的种类、披露时间和披露形式 2、基金运作信息披露 （3）季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将

	季度报告登载在指定媒体上。	季度报告登载在指定媒体上。 本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。 如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。
	3、基金临时信息披露 无	3、基金临时信息披露 (26) 本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
二十五、通知与送达	（二）上述通知应当送达至相关当事人的下述地址或号码： 2、基金管理人：泰信基金管理有限公司 地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42 层 传真：021-50372269 3、基金托管人： 中国光大银行 地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦，邮政编码 100045； 传真：010—68561260	（二）上述通知应当送达至相关当事人的下述地址或号码： 2、基金管理人：泰信基金管理有限公司 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 传真：021-20899008 3、基金托管人：中国光大银行股份有限公司 地址：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心，邮政编码 100033； 传真：（010） 63639132

泰信先行策略开放式证券投资基金托管协议修改前后文对照表

章节	原文条款 内容	修改后条款 内容
一、托管协议当事人	1.1 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42 层 法定代表人：朱崇利 注册资本： 1 亿元人民币 1.2 基金托管人（或简称"托管人"） 名称：中国光大银行 住所：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦 注册资本： 82.17 亿元人民币	1.1 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层 法定代表人：万众 注册资本： 2 亿元人民币 1.2 基金托管人（或简称"托管人"） 名称：中国光大银行股份有限公司 住所：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心 注册资本： 466.79 亿元人民币
二、订立托管协议的依据、目的和原则	2.1 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）及其他有关法律、法规与《泰信先行策略开放式证券投资基金基金合同》制订。	2.1 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律、法规与《泰信先行策略开放式证券投资基金基金合同》制订。
九、基金投资组合限制与监控	9.1 投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： （7）中国证监会规定的其他比例限制。	9.1 投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： （2）保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等； （9）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%； （10）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不

		符合本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （11）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致； （12）法律法规、中国证监会规定的其他比例限制。
	9.2 投资组合监控 本基金在成立后 6 个月内应达到上述规定的投资比例。因基金规模或市场变化、临近避险周期到期日等原因导致基金投资组合超过上述规定的比例不在限制之内，但基金管理人应在合理期限内进行调整，以达到上述标准。基金托管人根据上述原则对基金的投资进行监控。	9.2 投资组合监控 本基金在成立后 6 个月内应达到上述规定的投资比例。除上述第（2）、（10）、（11）项外，因基金规模或市场变化、临近避险周期到期日等原因导致基金投资组合超过上述规定的比例不在限制之内，但基金管理人应在合理期限内进行调整，以达到上述标准。基金托管人根据上述原则对基金的投资进行监控。