

泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金 更新招募说明书 摘要 (2017 年 1 号)

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

二〇一七年四月十四日

重要提示

本基金根据 2012 年 2 月 27 日中国证券监督管理委员会《关于核准泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可[2012]252 号）和 2012 年 7 月 19 日《关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2012]602 号）的核准，进行募集。

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。

投资者通过场内办理泰信基本面 400 份额申购时，每笔申购金额不得低于 50,000 元，追加申购每笔最低 50,000 元人民币；通过场外办理泰信基本面 400 份额申购，单笔申购最低金额为 500 元人民币（含申购费）。

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，投资者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 2016 年 12 月 31 日，净值表现数据的截止日期为 2016 年 12 月 31 日，其他内容截止日期为 2017 年 3 月 7 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：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36-37 层

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：葛航

总经理：葛航

电话：（021）20899188

传真：（021）20899008

联系人：徐磊

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 2017 年 2 月底，公司有正式员工 106 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 2017 年 3 月 7 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、泰信国策驱动混合、泰信鑫选混合、泰信互联网+混合、泰信智选成长混合共 19 只开放式基金及泰信乐利 5 号、泰信鲁信 1 号、泰信磐晟稳健 1 号、泰信价值 1 号、泰信添盈债券分级 1 号、泰信添盈债券分级 2 号、泰信中行新时代 6 号、泰信财达

添利 1 号、泰信财达添利 2 号、泰信-合信一号、泰信合信三号、泰信融昇保本 1 号、泰信融昇保本 2 号、泰信融昇 3 号保本、泰信融昇 4 号保本、泰信融嘉 1 号保本、泰信融嘉 2 号保本、泰信中融景诚旭诚一期、泰信洛肯 1 号、泰信洛肯 2 号、泰信易享一号、泰信融鑫 2 号、泰信中融景诚旭诚固收 1 号、泰信融昇 5 号、泰信财达添利 3 号、泰信联泰 1 号、泰信联裕 1 号共 27 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

葛航先生，代理董事长，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。

万众，董事，高级经济师，硕士；曾任山东省国际信托有限公司副总经理、山东省鲁信实业集团有限公司副总经理，山东省鲁信实业集团有限公司董事长、总经理，现任山东省国际信托股份有限公司总经理。

校登楼，董事，高级会计师，注册会计师，本科。曾任江苏省国际信托投资公司证券部副科长，江苏省国信集团审计部部长、项目经理、高级经理，现任江苏省投资管理有限公司财务部副总经理。

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、青岛国信发展（集团）有限责任公司副总经理；现任青岛国信发展（集团）有限责任公司总经理。

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。

郝亮，独立董事，本科。曾任中国建设银行青岛市支行副行长、分行办公室副主任，青岛市住房公积金管理中心副主任，深圳大通实业股份有限公司董事会秘书，深圳大通实业股份有限公司副董事长，兼董事会秘书。

（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；现任青岛国信胶州湾交通有限公司董事长。

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。

李小明，监事，助理经济师，本科。曾任江苏省投资贸易公司办公室副主任、主任，江苏省投资贸易公司业务二部经理，江苏省投资贸易公司综合投资部经理、高级经理。江苏省投资贸易公司综合投资部副总经理。

张萍历女士，职工监事，硕士。2007 年 7 月加入泰信基金管理有限公司，现任公司集中交易部总监。

唐国培先生，职工监事，硕士。2003 年加入泰信基金管理有限公司，先后担任监察稽核部副总监、监察稽核部总监，现任风险管理部总监。

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

葛航先生，代理董事长，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。经历了泰信基金管理有限公司的筹建及成立，并担任公司督察长至今。

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。

3、基金经理

张彦先生，硕士，证券从业经历 12 年。曾任职于国金证券研究所、上海从容投资管理有限公司、万家基金管理有限公司。2011 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，担任高级研究员。自 2011 年 10 月至 2014 年 5 月任泰信中小盘精选基金经理助理。2012 年 4 月至 2015 年 1 月任泰信优势增长混合基金经理助理。自 2015 年 1 月 6 日起担任本基金和泰信中证 200 指数基金的基金经理。

附：本基金历任基金经理情况：

姓名	管理本基金的时间
冯张鹏	2013 年 7 月 5 日至 2015 年 1 月 6 日
陈大庆	2012 年 9 月 7 日至 2013 年 7 月 5 日

4、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。

二、基金托管人

名称：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

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 349,018,545,827 元

联系电话：010-66105799

联系人：洪渊

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：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36、37 层

法定代表人：葛航

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：王超

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：518026

电话：（0755）33988759

传真：（0755）33988757

联系人：史明伟

2、销售机构

(1) 场内销售机构：

办理本基金场内销售机构为具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位：

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、诚浩证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、中泰证券、日信证券、瑞银证券、山西证

券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）

（具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位名单以深圳证券交易所网站为准。）

（2）场外销售机构

（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：易会满

客服电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

（2）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

（3）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

(4) 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 9 号

办公地址: 北京东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人: 李庆萍

传真: 010-85230059

客服电话: 95558

网址: bank.ecitic.com

(5) 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

(6) 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

(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：周杨

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 2-6 层

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：陈共炎

联系人：田薇

电话：010-66568888

传真：010-66568990

客服电话：4008-888-888 或 95551

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。

（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：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.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：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.bhza.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：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

（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：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 8 楼

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

（19）新时代证券股份有限公司

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

（20）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：95318、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：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

（22）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

（23）东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

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：赵俊

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

（24）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

(25) 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

(26) 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：史江蕊

电话：010-64818301

传真：010-64818443

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）西藏东方财富证券股份有限公司

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：陈宏

联系人：周艳琼

电话：021-36537945

传真：021-36538467

客户服务电话：400-9112-233

网址：www.xzsec.com

（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：庞介民

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：哈尔滨市松北区创新三路 833 号 13 楼

法定代表人：孙名扬

联系人：周俊

电话：0451-85863726

传真：0451-82337279

客服电话：4006662288

网址：www.jhzq.com.cn

（31）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：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

（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

联系人：刘婧漪、贾鹏

电话：028-86690057、028-8669005

传 真：028-86690126

客户热线：95310

网址：www.gjzq.com.cn

（34）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：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

（35）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

（36）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：95321

公司网址：www.cindasc.com

（37）华龙证券股份有限公司

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

（38）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：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

（39）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

（40）蚂蚁（杭州）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

(41) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼 1 楼

法定代表人：汪静波

客服电话：400—821—5399

网址：www.noah-fund.com

(42) 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

(43) 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

(44) 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

(45) 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

（46）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：李兴春

联系人：赵沛然

客服电话：400-921-7755

网址：admin.leadfund.com.cn

（47）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

（48）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

（49）北京恒天明泽基金销售有限公司

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 39 号第一上海中心 C 座 6 层

法定代表人：梁越

客服电话：4008-980-618

网址：www.chtfund.com

（50）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

（51）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

（52）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：赵立功

客服电话：40018-40028

网址：www.wkzq.com.cn

（53）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：刘鹏宇

联系人：杨涛

客服电话：0755-83999913

网址：www.jinqianwo.cn

（54）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

（55）北京乐融多源投资咨询有限公司

办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层

法定代表人：董浩

联系人：张婷婷

客服电话：400-068-1176

网址：www.hongdianfund.com

（56）中国国际金融股份有限公司

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：丁学东

联系人：秦朗

客服电话：400-910-1166

网址：www.cicc.com

（57）大泰金石基金销售有限公司

办公地址：上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼

法定代表人：袁顾明

联系人：何庭宇

客服电话：400-928-2266 021-22267995

网址：www.dtfunds.com

（58）上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

客服电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

（59）北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

法定代表人：罗细安

联系人：李皓

客服电话：400-001-8811

网址：www.zengcaiwang.com

（60）北京钱景财富投资管理有限公司

办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：申泽灏

客服电话：400-893-6885

网址：www.qianjing.com

（61）厦门市鑫鼎盛控股有限公司

办公地址：厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场15楼

法定代表人：陈洪生

联系人：梁云波

客服电话：400-918-0808

网址：www.xds.com.cn

（62）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层

法定代表人：杨懿

联系人：文雯

客服电话：400-116-1188

网址：8.jrj.com.cn

（63）泰诚财富基金销售（大连）有限公司

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海公园3号

法定代表人：林卓

客服电话：400-6411-999

网址：www.taichengcaifu.com

（64）北京晟视天下投资管理有限公司

办公地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

法定代表人：蒋煜

客服电话：400-818-8866

网址：www.shengshiview.com

（65）武汉市伯嘉基金销售有限公司

办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号4号

法定代表人：陶捷

客服电话：400-027-9899

网址：www.buyfunds.cn

（66）华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路228号

办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962（深圳）

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

（67）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

（68）宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路294号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路700号宁波银行24楼

法定代表人：陆华裕

联系人：胡技勋

电话：021-63586210

传真：021-63586215

客服电话：96528，962528（上海地区）

网址：www.nbcb.com.cn

（69）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：钱燕飞

客服电话：95177

网址: www.snjijin.com

（二）注册登记机构

名称: 中国证券登记结算有限责任公司

住所: 北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人: 金颖

联系人: 朱立元

办公地址: 北京市西城区太平桥大街 17 号

电话: 010-59378809

传真: 010-59378907

（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

经办注册会计师: 单峰、傅琛慧

四、基金的名称

基金名称：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金

基金简称：泰信基本面 400 指数分级

五、基金的类型

契约型开放式

六、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额的上市与交易

（一）上市交易的基金份额

基金合同生效后，基金管理人可以根据有关规定，申请泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额上市交易。泰信基本面 400A 份额与泰信基本面 400B 份额两类基金份额同时申请上市与交易，交易代码不同；投资者可以在二级市场单独交易泰信基本面 400A 份额或者泰信基本面 400B 份额；基金份额交易按照深圳证券交易所交易规则及相关规定执行。

（二）上市交易的地点

深圳证券交易所。

泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额上市后，登记在中国证券登记结算有限公司场内证券登记结算系统中的泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在场外中国证券登记结算有限公司注册登记系统中的泰信基本面 400 份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至场内证券登记结算系统，并且发起份额分离请求，泰信基本面 400 份额成功分离为泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额后，方可上市交易。

（三）上市交易的时间

泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额于基金合同生效后 6 个月内开始在深圳证券交易所上市交易；在确定上市交易的时间后，基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在至少

一种指定媒体上刊登上市交易公告书。

本基金于 2012 年 9 月 21 日在深圳证券交易所上市交易。

（四）上市交易的规则

1、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额上市首日的开盘参考价为前一交易日泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值；

2、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；

3、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额买入申报数量为 100 份或其整数倍；

4、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；

5、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等相关规定。

（五）上市交易的行情揭示

泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额前一交易日的基金份额参考净值。

（六）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》及深圳证券交易所的相关规定执行。

（七）上市交易的其他规定

相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加基金上市交易的新功能，本基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

七、基金的投资目标

本基金采用指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求

对中证锐联基本面 400 指数的有效跟踪。力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以分享中国经济的长期增长成果，实现基金资产的长期增值。

八、基金的投资方向

投资于具有良好流动性的金融工具，包括股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债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）。其中，中证锐联基本面 400 指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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。

九、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金主要采用完全复制法，按照在中证锐联基本面 400 指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合和跟踪中证锐联基本面 400 指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，使跟踪误差控制在限定的范围之内。

1、资产配置策略

本基金管理人主要按照中证锐联基本面 400 指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于中证锐联基本面 400 指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%；现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。基金管理人将综合考虑股票市场情况、基金资产

的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。在巨额申购赎回发生、成份股大比例分红等情况下，管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后，及时将股票配置比例调整至合理水平。

2、股票投资策略

（1）股票组合构建原则

本基金通过复制指数的方法，根据中证锐联基本面 400 指数成分股组成及其基准权重构建股票投资组合。当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证锐联基本面 400 指数的效果可能带来影响时，基金管理人将根据市场情况，采取合理措施控制基金的跟踪误差。

在特殊情况下，本基金将选择其他股票或股票组合对标的指数中的股票加以适当替换，这些情况包括但不限于以下情形：

- 1) 法律法规的限制；
- 2) 标的指数成份股流动性严重不足，或因受股票停牌的限制等其他市场因素，使基金管理人无法依指数权重购买某成份股；
- 3) 本基金资产规模过大导致本基金持有某些股票比例过高；
- 4) 成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼；
- 5) 预期标的指数的成份股即将调整。

为了减小跟踪误差，本基金按照主营业务相近、市值相近、相关性较高及 β 值相近等原则来选择替代股票。

（2）股票组合调整方法

本基金将采用完全复制法构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证锐联基本面 400 指数的收益表现。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发等因素的变化，对股票投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与中证锐联基本面 400 指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

1) 定期调整

根据中证锐联基本面 400 指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

2) 临时调整

- A. 当成份股发生增发、配股、分红等情况或其他原因而影响成份股在指数中权重的行

为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合。

B. 在标的指数成份股票调整周期内，若出现成份股票临时调整的情形，本基金将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。

C. 如果预期指数的成份股将会发生调整，本基金管理人将视情况对基金资产进行前瞻性的调整，以更好地跟踪基准指数。

D. 本基金将根据本基金的申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，对股票投资组合进行调整，从而有效地跟踪标的指数。

E. 如果因基准指数成份股停牌限制、交易量不足等市场流动性因素，使得基金管理人无法依照基准指数权重购买某成份股，本基金管理人将视当时市场情况，综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性股票。替代股票的选取综合考虑基准指数成份股和替代股票主营业务的相似性、规模相似性以及历史收益率的相关性。

F. 针对我国证券市场新股发行制度的特点，在不违反相关法律法规的前提下，本基金将参与一级市场新股认购，由此得到的非成份股将在其规定持有期之后的一定时间以内卖出。

（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、基金合同等的相关规定。
- （2）国家宏观经济运行态势、微观经济运行环境和证券市场走势。
- （3）标的指数的编制方法及其变更。
- （4）研究部研究员在独立研究基础上组撰写的研究报告。

2、投资准备程序

基金经理及研究员依托基金管理人整体研究平台，整合外部研究机构的研究成果，开展指数跟踪、成份股及备选成分股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

3、投资决策程序

（1）基金管理人主要采用复制成份股及其权重的方法确定目标组合。基金经理小组根据中证锐联基本面 400 指数系列成份股名单及权重，结合对成份股流动性、公司行为、基本面、交易成本等因素的分析，确定合理的建仓策略。

（2）在日常管理中，基金经理和研究员跟踪标的指数成份股公司行为信息，如股本变化、分红、停牌、复牌，以及成份股公司其它重大信息，分析这些信息对指数的影响，进

而确定组合调整策略。

（3）基金经理根据实际交易情况、申购赎回情况、对跟踪误差的监控结果、风险管理部风险监控和绩效评估报告，采用相应的投资策略、优化方法对投资组合进行动态调整；

（4）基金经理在目标指数成份股定期调整信息公开前一个月内，根据对调整方案的分析预测以及成份股调整对股价影响的分析，决定采取提前调整还是事后调整的策略，增持可能进入目标指数的股票，剔除可能被调整出目标指数的股票，并向投资决策委员会提交报告，经投资决策委员会批准后方可进行；

（5）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。

4、投资执行程序

交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

5、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。

（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）本基金投资于中证锐联基本面 400 指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%；

（2）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%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

（3）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。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 个月内予以全部卖出；

（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）现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于 5%；

（6）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%；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%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（7）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；

（8）一只基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之二；一只基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的百分之十；经基金管理人和基金托管人协商，可对以上比例进行调整；

（9）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；

（10）相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

基金托管人对本基金投资组合的监督自基金合同生效日起开始。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约定。

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）依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动；
- （9）法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

十、基金的业绩比较标准

$95\% \times \text{中证锐联基本面 400 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率（税后）}$

由于本基金投资标的指数为中证锐联基本面 400 指数，且投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，因此，本基金将业绩比较基准定为 $95\% \times \text{中证锐联基本面 400 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率（税后）}$ 。

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，本基金可以在基金管理人和基金托管人协商一致，履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告。

十一、风险收益特征

本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，泰信基本面 400A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；泰信基本面 400B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

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股份有限公司根据本基金合同的规定，已于 2017 年 3 月 30 日复核本投资组合报告的内容。

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	41,414,118.99	93.51

	其中：股票	41,414,118.99	93.51
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	2,869,437.62	6.48
8	其他资产	5,798.50	0.01
9	合计	44,289,355.11	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末指数投资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	114,695.56	0.26
B	采矿业	1,778,076.55	4.05
C	制造业	22,079,204.47	50.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,746,283.16	3.97
E	建筑业	1,430,947.53	3.26
F	批发和零售业	3,454,840.42	7.86
G	交通运输、仓储和邮政业	2,560,991.41	5.83
H	住宿和餐饮业	32,258.70	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,460,568.55	3.32
J	金融业	1,769,056.63	4.03
K	房地产业	2,724,828.51	6.20
L	租赁和商务服务业	835,052.46	1.90
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	269,061.06	0.61
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	790,979.95	1.80
S	综合	316,370.03	0.72
	合计	41,363,214.99	94.11

2.2 报告期末积极投资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	50,904.00	0.12
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	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
	合计	50,904.00	0.12

注：积极投资股票为被动持有非当前成分股，将逐步进行调整成分股。

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

3.1 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	000656	金科股份	75,455	395,384.20	0.90
2	000422	湖北宜化	47,700	379,215.00	0.86
3	600739	辽宁成大	15,938	286,246.48	0.65
4	000488	晨鸣纸业	25,953	268,873.08	0.61
5	000623	吉林敖东	8,587	266,111.13	0.61
6	002092	中泰化学	21,404	258,988.40	0.59
7	000423	东阿阿胶	4,678	252,003.86	0.57
8	600143	金发科技	31,900	248,182.00	0.56

9	600655	豫园商城	21,174	241,807.08	0.55
10	600039	四川路桥	47,643	225,827.82	0.51

3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	601005	重庆钢铁	20,200	50,904.00	0.12

注：积极投资股票为被动持有非当前成分股，将逐步进行调整成分股。

4、报告期末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、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

报告期末本基金未持有债券。

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序的前五名贵金属投资明细

报告期末本基金未投资贵金属。

8、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。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

截至报告期末本基金未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

截至报告期末本基金未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

11.1 本基金本期投资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。

11.2 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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,239.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	559.34
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	5,798.50

11.4 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处于转股期的可转换债券。

11.5 前十名股票中存在流通受限情况的说明

11.5.1 报告期末指数投资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	600655	豫园商城	241,807.08	0.55	重大事项

11.5.2 报告期末积极投资前五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	601005	重庆钢铁	50,904.00	0.12	重大事项

11.6 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。

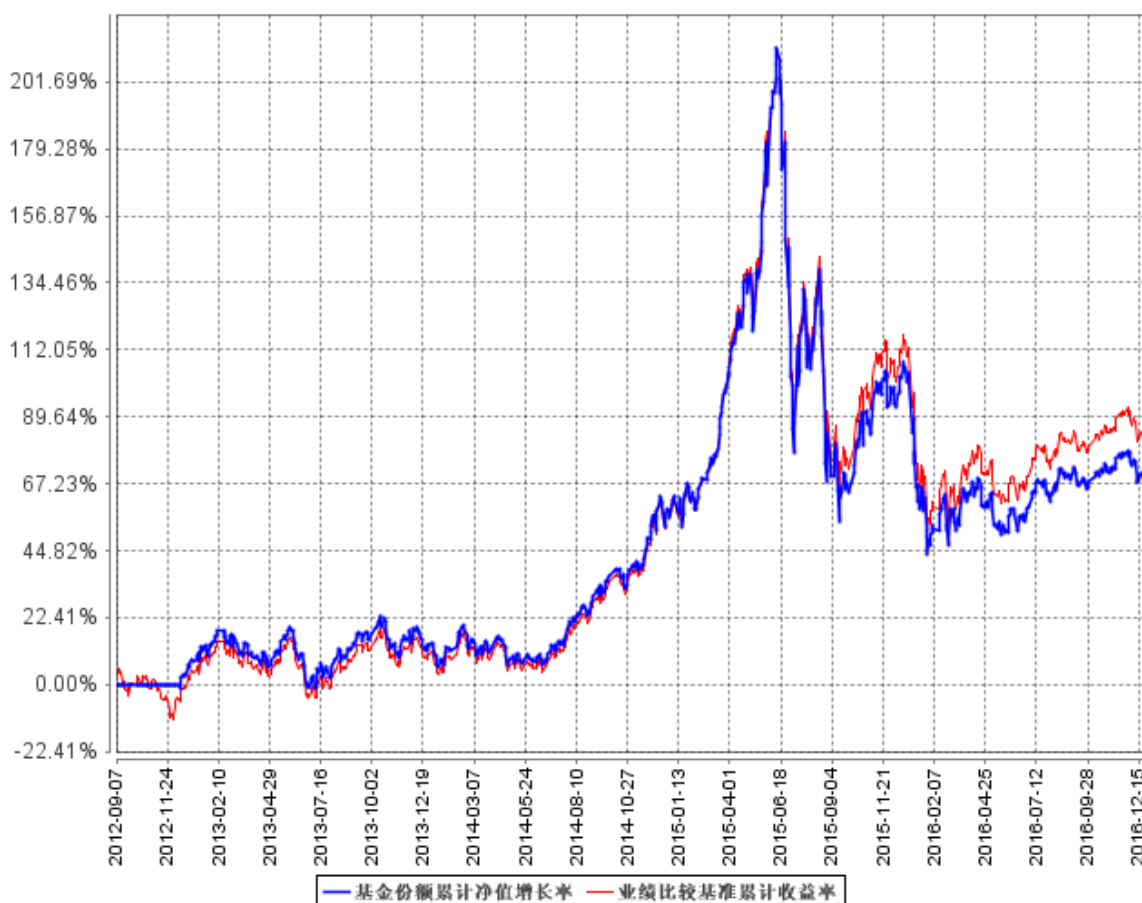
（一）本基金合同生效日为 2012 年 9 月 7 日。基金合同生效以来（截至 2016 年 12 月 31 日）的投资业绩与同期基准的比较如下表所示：

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
20160101-20161231	-16.23%	1.73%	-13.21%	1.73%	-3.02%	0.00%
20160101-20160630	-22.89%	2.38%	-19.22%	2.31%	-3.67%	0.07%
20150101-20151231	24.93%	2.82%	33.37%	2.78%	-8.44%	0.04%
20140101-20141231	34.87%	1.16%	42.39%	1.16%	-7.52%	0.00%
20130101-20131231	3.97%	1.35%	6.03%	1.35%	-2.06%	0.00%
20120907-20121231	8.40%	0.57%	4.58%	1.43%	3.82%	-0.86%
20120907-20150630	131.74%	1.42%	149.16%	1.50%	-17.42%	-0.08%
20120907-20161231	69.10%	1.81%	82.77%	1.84%	-13.67%	-0.02%

（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 9 月 7 日至 2016 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 9 月 7 日正式生效。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满，基金投资组合各项比例符合基金合同的约定。本基金投资于中证锐联基本面 400 指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%；现金以及到期日在 1 年以内的政府债券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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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。

3、基金合同生效后的标的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法每日计提指数许可使用费。其中，基金合同生效前的许可使用固定费是为获取使用指数开发基金的权利而支付的费用，不列入基金费用；基金合同生效后的指数许可使用费从基金财产中列支，按前一日基金资产净值及指数许可使用费率每日计提，逐

日累计。计算方法如下：

$$H = E \times I \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

I 为基金管理人与本基金的标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费年费率。

在本基金成立之后的前两个年度，指数许可使用费年费率为万分之九。从本基金成立的第三个年度起，如果本基金日均资产净值超过或等于人民币 40 亿元，指数许可使用费年费率为万分之九；如果本基金日均资产净值不足人民币 40 亿元，则指数许可使用费年费率为万分之十二。

基金管理人与指数许可方约定了每季指数许可使用费人民币拾伍万元（15 万元）的收取下限，则该下限超出当季累计指数使用费的部分（即：每季指数许可使用费收取下限减当季累计指数许可使用费）由基金管理人自行承担，不作为基金费用从基金财产中列支。标的指数许可使用费每日计算，逐日累计。

标的指数许可使用费的支付方式为每季支付一次，自《基金合同》生效日起，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次季初 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

在基金存续期内，如果基金管理人与指数授权机构中证指数有限公司签订的指数使用许可协议中关于“指数许可使用费”的内容有所修改的，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。

4、上述一、基金费用的种类中第 4—11 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，本基金泰信基本面 400 份额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：

场外 申购费率	申购金额（M）	申购费率
	M < 50 万	1.20%
	50 万 ≤ M < 200 万	0.80%
	200 万 ≤ M < 500 万	0.40%

	M ≥ 500 万	每笔 1000 元
场内 申购费率	深圳证券交易所会员单位应按照场外申购费率设定投资者的场内申购费率。	

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泰信基本面 400 份额时收取。赎回费率具体如下表所示：

场外赎回费	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%
场内赎回费	本基金的场内赎回费率为固定赎回费率 0.5%，不按份额持有时间分段设置赎回费率。	

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、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整申购费率和赎回费率或收费方式。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施 2 个工作日前在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求，履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、赎回费率和转换费率，并在调整实施 2 日前在至少一种中国证监会指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

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《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《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》的规定，结合泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）近半年的投资经营情况，对 2016 年 10 月 14 公告的《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金招募说明书》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、公司旗下基金及资产管理计划情况进行了更新。

（2）在“（三）主要人员情况”部分，对公司董事、监事的任职信息进行了更新。

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

5、第九节“基金的转换、非交易过户及转托管”部分，更新了截止 2017 年 3 月 7 日基金定期定额投资、基金转换业务办理情况。

6、第十一节“基金的投资”部分，根据本基金 2016 年第 4 季度报告的相关内容，重新调整了“（十一）基金投资组合报告”的内容（未经审计）。

7、第十二节“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。

8、第二十五节“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

2017 年 4 月 14 日