

泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之

A 份额与 B 份额上市交易公告书

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

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2012 年 9 月 21 日

公告日期：2012 年 9 月 18 日

## 目 录

一、重要声明与提示.....	3
二、基金概览.....	3
三、基金的募集与上市交易.....	5
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	7
五、基金主要当事人简介.....	9
六、基金合同摘要.....	11
七、基金财务状况.....	11
八、基金投资组合.....	12
九、重大事件揭示.....	15
十、基金管理人承诺.....	15
十二、基金上市推荐人意见.....	16
十三、备查文件目录.....	16

## 一、重要声明与提示

泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 A 份额与 B 份额上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“基金法”)、《证券投资基金信息披露内容和格式准则第 1 号<上市交易公告书>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,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。

本基金托管人保证本报告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、证券交易所对泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 A 份额与 B 份额上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容,请投资者详细阅读刊登在 2012 年 8 月 2 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》上的《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》。

## 二、基金概览

1、基金名称:泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金

2、基金运作方式:契约型开放式

3、基金的份额结构:本基金的基金份额包括泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之基础份额(即“泰信基本面 400 份额”)、泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(即“泰信基本面 400A 份额”)与泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(即“泰信基本面 400B 份额”)。其中,泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比率不变。

4、泰信基本面 400 的申购和赎回:泰信基本面 400 份额的申购与赎回包括场内申购与赎回和场外申购与赎回两种方式。泰信基本面 400 份额的场外申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及基金场外代销机构的代销网点,泰信基本面 400 份额场内申购和赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位,具体销售网点和会员单位的名单将由基金管

理人在招募说明书或其他公告中列明;泰信基本面 400A、泰信基本面 400B 只上市交易, 不接受申购和赎回。

5、份额配对转换:指本基金的泰信基本面 400 份额与泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额之间的配对转换。包括分拆和合并。

(1) 分拆。基金份额持有人将其持有的每两份泰信基本面 400 份额的场内份额申请转换成一份泰信基本面 400A 份额与一份泰信基本面 400B 份额的行为。

(2) 合并。基金份额持有人将其持有的每一份泰信基本面 400A 份额与一份泰信基本面 400B 份额申请转换成两份泰信基本面 400 份额的场内份额的行为。

6、基金份额折算:本基金份额折算业务包括定期份额折算和不定期份额折算。

(1) 定期份额折算:在泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400 份额存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日,本基金将进行定期份额折算。

(2) 不定期份额折算:本基金将在两种情况下进行不定期份额折算,即:当泰信基本面 400 份额的基金份额净值达到 2.000 元;当泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元。

7、泰信基本面 400A 与泰信 400B 的终止运作:经基金份额持有人大会决议通过,泰信 400A 与泰信 400B 可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议需经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过,即须经参加大会的泰信 400 份额、泰信 400A 份额、泰信 400B 份额的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可有效。

8、基金份额的总额:截至 2012 年 9 月 14 日,本基金的基金份额总额为 300,843,720.90 份,其中泰信基本面 400 为 276,847,812.90 份,泰信基本面 400A 为 11,997,954.00 份,泰信基本面 400B 为 11,997,954.00 份。

9、基金份额净值:截至 2012 年 9 月 14 日,泰信基本面 400 基金份额净值为 1.000 元,泰信基本面 400A 的基金份额净值为 1.001 元,泰信基本面 400B 的基金份额净值为 0.999 元。

10、上市交易时间:2012 年 9 月 21 日

11、基金管理人:泰信基金管理有限公司

12、基金托管人:中国工商银行股份有限公司

13、本基金上市交易场所:深圳证券交易所

14、本基金上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司深圳分

公司

### 三、基金的募集与上市交易

(一) 本基金上市前基金募集情况：

- 1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证监会、证监许可[2012]252 号文
- 2、基金运作方式：契约型开放式
- 3、基金合同期限：不定期
- 4、发售日期：2012 年 8 月 6 日至 2012 年 8 月 31 日
- 5、发售价格：1.00 元人民币
- 6、发售期限：2012 年 8 月 6 日至 2012 年 8 月 31 日
- 7、发售方式：本基金将通过交易所（场内）和本公司网上直销、直销柜台及代理本基金销售业务机构（场外）两种方式公开发售。
- 8、发售机构：

(1) 办理本基金场内认购的销售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位，具体包括：爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财通证券、长城证券、长江证券、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、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、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、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、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。（尚未取得基金代销资格，但属于深交所会员的其他机构，可在本基金上市交易后，代理投资者通过深交所交易系统参与本基金的买卖。具体名单以深圳证券交易所网站公布的为准。本基金管理人将不再就此

事项进行公告。)

(2) 本基金场外发售机构包括:

1) 直销机构包括: 泰信基金管理有限公司上海总部、北京分公司、深圳分公司。

2) 场外代销机构: 中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、大通证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、华龙证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、中航证券有限责任公司、中信证券(浙江)有限责任公司、山西证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、民生证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、长城证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、杭州数米基金销售有限公司。

9、验资机构名称: 普华永道中天会计师事务所有限公司

10、募集资金总额及入账情况: 本次募集的净认购金额为 300,797,873.45 元人民币, 募集期间认购资金产生的银行利息共计 45,847.45 元人民币。本次募集净认购金额已于 2012 年 9 月 6 日全额划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金托管专户, 相应的银行利息将由中登公司于本季度银行结息日(2012 年 9 月 20 日)后划付至泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金开立于中国证券登记结算公司的结算备付金账户及中国工商银行开立于中国证券登记结算公司深圳分公司的结算备付金账户。

11、基金的备案情况: 2012 年 9 月 6 日聘请普华永道中天会计师事务所验资, 随后向中国证监会提交了验资报告, 办理基金备案手续, 2012 年 9 月 7 日中国证监会予以书面确认, 本基金合同自该日起正式生效。

12、基金合同生效日: 2012 年 9 月 7 日

13、基金合同生效日的基金份额总额: 300,843,720.90 份

(二) 本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号: 深圳证券交易所深证上[2012]304 号

2、上市交易日期: 2012 年 9 月 21 日

- 3、上市交易所：深圳证券交易所
- 4、本基金上市交易份额简称：泰信 400A、泰信 400B
- 5、本基金上市交易场内代码：泰信 400A 为 150094 泰信 400B 为 150095
- 6、本次上市交易的基金总份额：泰信 400A 为 11,997,954.00 份；泰信 400B 为 11,997,954.00 份
- 7、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，持有人将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

#### 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

一、截至 2012 年 9 月 14 日的泰信 400A（基金代码：150094）基金份额持有情况：

泰信 400A 基金份额持有人户数：142 户，平均每户持有的基金份额：84,492.63 份。

泰信 400A 机构投资者持有的基金份额为 8,525,363 份，占泰信 400A 基金总份额的比例为 71.06%；泰信 400A 个人投资者持有的基金份额为 3,472,591 份，占泰信 400A 基金总份额的比例为 28.94%

泰信 400A 基金前十名持有人情况：

序号	持有人名称（全称）	持有泰信 400A 基金份额（份）	占泰信 400A 基金总份额的比例
1	中信证券股份有限公司	4,000,233.00	33.34%
2	宏源证券—建行—宏源 3 号红利成长集合资产管理计划	2,500,072.00	20.84%
3	华宝证券有限责任公司	2,000,058.00	16.67%
4	文传玲	47,502.00	0.40%
5	张永	25,002.00	0.21%
6	王安玉	25,002.00	0.21%
7	夏红	25,002.00	0.21%

8	赵淑芳	25,002.00	0.21%
9	韦桂玲	25,002.00	0.21%
10	李萍	25,001.00	0.21%
合计		10,647,954.00	88.89%

注：依据中国证券登记结算有限责任公司出具的关于泰信 400A 基金前十大持有人份额登记名册，本表中所列合计份额包括未列明的共计 79 位并列第 10 名持有人持有的份额数。

二、截至 2012 年 9 月 14 日泰信 400B（基金代码：150095）基金份额持有情况：

泰信 400B 基金份额持有人户数：142 户，平均每户持有的基金份额：84,492.63 份。

泰信 400B 机构投资者持有的基金份额为 8,525,365 份，占场内基金总份额的比例为 71.06%；泰信 400B 个人投资者持有的基金份额为 3,472,589 份，占场内基金总份额的比例为 28.94%

泰信 400B 基金前十名持有人情况：

序号	持有人名称（全称）	持有泰信 400B 基金份额（份）	占泰信 400B 基金总份额的比例
1	中信证券股份有限公司	4,000,233.00	33.34%
2	宏源证券—建行—宏源 3 号红利成长集合资产管理计划	2,500,073.00	20.84%
3	华宝证券有限责任公司	2,000,058.00	16.67%
4	文传玲	47,503.00	0.40%
5	郝斌	25,002.00	0.21%
6	李罕霞	25,002.00	0.21%
7	李萍	25,001.00	0.21%
8	栾鸾	25,001.00	0.21%
9	唐金根	25,001.00	0.21%
10	吴俊毅	25,001.00	0.21%

合计		10,672,954.00	89.10%
----	--	---------------	--------

注：依据中国证券登记结算有限责任公司出具的关于泰信 400B 基金前十大持有人份额登记名册，本表中所列合计份额包括未列明的共计 80 位并列第七名持有人持有的份额数。

## 五、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

- 1、名称：泰信基金管理有限公司
- 2、法定代表人：孟凡利
- 3、总经理：高清海
- 4、注册资本：人民币2亿元
- 5、注册地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦37层
- 6、设立批文号：证监基金字[2003]68号
- 7、法人营业执照文号：310115000763043
- 8、经营范围：基金设立、基金业务管理及中国证监会批准的其他业务
- 9、股东及出资比例：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%。
- 10、内部组织结构及职能：公司目前下设市场部、营销部（分华东、华北、华南三大营销中心和电子商务部）、客服中心、基金投资部、研究部、理财顾问部、清算会计部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部、北京分公司、深圳分公司。
- 11、人员情况：截至2012年9月14日，公司共有员工116人，多数具有硕士以上学历。
- 12、信息披露负责人及联系电话：唐国培 021-20899032
- 13、基金管理业务情况简介：截至公告日，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、泰信蓝筹精选股票、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、泰信中小盘股票、泰信保本混合共12只开放式基金和泰信财富分级1号、泰信财富分级2号、泰信乐享分级1号共3个资产管理计划。

14、本基金基金经理：陈大庆先生，硕士。曾在中国建银投资证券有限责任公司、华林证券有限责任公司担任研究员。2008年2月加入泰信基金管理有限公司，先后担任研究员、优质生活基金经理助理。2011年6月起至今担任泰信中证200指数基金基金经理。

## （二）基金托管人

1、名称：中国工商银行股份有限公司

2、法定代表人：姜建清

3、注册资本：人民币 349,018,545,827 元

4、注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

5、基金托管部门负责人及人员情况：中国工商银行资产托管部共有员工146人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

6、信息披露负责人及联系电话：赵会军 010—66105799

7、托管业务情况简介：作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2012年6月，中国工商银行共托管证券投资基金252只，其中封闭式7只，开放式245只。自2003年以来，中国工商银行连续八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的31项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

## （三）基金验资机构

1、名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

- 2、法定代表人：杨绍信
- 3、注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
- 4、经办注册会计师：薛竞、张振波
- 5、电话：021-23238888

## 六、基金合同摘要

详见本公告附件。

## 七、基金财务状况

深圳证券交易在本基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据招募说明书设定的费率或佣金比例收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告前 11 个工作日无重要财务事项发生。

泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金 2012 年 9 月 14 日的资产负债表如下：

单位：人民币元

项目	2012 年 9 月 14 日
<b>资产：</b>	
银行存款	15,821,128.17
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	285,000,000.00
应收证券清算款	124,656.40
应收利息	71,252.38
应收股利	-
应收申购款	
递延所得税资产	
其他资产	

资产总计	301,017,036.95
<b>负 债:</b>	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	57,544.99
应付托管费	12,659.90
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	27,937.53
负债合计	98,142.42
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	300,843,720.90
未分配利润	75,173.63
所有者权益合计	300,918,894.53
负债和所有者权益总计	301,017,036.95

## 八、基金投资组合

截至 2012 年 9 月 14 日，本基金投资组合如下：

### 1、基金资产组合情况

项目	金额（元）	占基金总资产比例（%）
股票		
债券		
权证		
银行存款及结算备付金	15,821,128.17	5.26%
其他资产	285,195,908.78	94.74%
合计	301,017,036.95	100.00%

### 2、按行业分类的股票投资组合

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
农、林、牧、渔业	-	-
采掘业	-	-
制造业	-	-
食品、饮料	-	-
纺织、服装、皮毛	-	-
木材、家具	-	-
造纸、印刷	-	-
石油、化学、塑胶、塑料	-	-
电子	-	-
金属、非金属	-	-
机械、设备、仪表	-	-
医药、生物制品	-	-
其他制造业	-	-
电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
建筑业	-	-
交通运输、仓储业	-	-
信息技术业	-	-
批发和零售贸易	-	-
金融、保险业	-	-
房地产业	-	-
社会服务业	-	-
传播与文化产业	-	-
综合类	-	-
合计	-	-

3、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	-	-	-	-	-
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	-	-

#### 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

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	-	-	-	-	-
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-

#### 6、投资组合报告附注

（1）本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。

（2）本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。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	124,656.40
3	应收股利	-
4	应收利息	71,252.38
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	285,000,000.00
9	合计	285,195,908.78

- (4) 本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。
- (5) 本报告期本基金无权证投资。
- (6) 本报告期本基金无资产支持证券投资。
- (7) 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。

## 九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人较大影响的重大事件。

## 十、基金管理人承诺

- 1、严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
- 2、真实、准确、完整和及时的披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
- 3、在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

## 十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易之后履行托管人职责做出如下承诺：

- 1、严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。
- 2、根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬

的计提和支付等行为进行监督和核查。

3、基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,并在限期内,随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。

4、基金托管人发现基金管理人重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

## 十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

## 十三、备查文件目录

### (一) 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金募集的文件
- 2、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》
- 3、《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》
- 4、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照

(二) 存放地点：上海市浦东新区浦东南路 256 号 37 层

(三) 查阅方式：

- 1、书面查询：投资者可在我公司营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。
- 2、网站查询：[www.ftfund.com](http://www.ftfund.com)

泰信基金管理有限公司

2012 年 9 月 18 日

附件：泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金合同摘要

## 一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

### （一）基金管理人简况

名称：泰信基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 37 层

法定代表人：孟凡利

设立日期：2003 年 5 月 23 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]68 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：021-20899188

### （二）基金管理人的权利与义务

（1）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

（1）依法募集基金；

（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

（4）销售基金份额；

（5）召集基金份额持有人大会；

（6）依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；

（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务

- (10) 依据《基金合同》及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；
  - (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
  - (12) 在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下，制订和调整《业务规则》，决定和调整除调高管理费和托管费之外的基金相关费率结构和收费方式；
  - (13) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
  - (14) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
  - (15) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
  - (16) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
  - (17) 法律法规、中国证监会和《基金合同》规定的其他权利。
- (2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：
- (1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律的规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
  - (2) 办理基金备案手续；
  - (3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
  - (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
  - (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
  - (6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
  - (7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按法律法规规定的年限保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担因募集行为而产生的债务和费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金投资者；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；

法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### **(三) 基金托管人简况**

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

法定代表人：姜建清

成立时间：1984 年 1 月 1 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

注册资本：人民币 349,018,545,827 元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3 号

### **(四) 基金托管人的权利与义务**

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司

(5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

(6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；

(7) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(8) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 按照法律法规规定的年限保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人或基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### **(五) 基金份额持有人**

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自取得依据《基金合同》募集的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额持有人持有的每份基金份额按《基金合同》约定在其对应的份额级别内具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

(9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(1) 遵守《基金合同》；

(2) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(3) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

(4) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(5) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；

(6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人大会的审议事项应分别由泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

### (一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 终止《基金合同》；

(2) 更换基金管理人；

(3) 更换基金托管人；

(4) 转换基金运作方式；

(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬

- (6) 变更基金类别;
- (7) 本基金与其他基金的合并;
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略 (法律法规和中国证监会另有规定的除外);
- (9) 变更基金份额持有人大会程序;
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上 (含 10%) 基金份额的基金份额持有人 (以基金管理人收到提议当日的基金份额计算, 下同) 就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;
- (12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
- (13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改, 不需召开基金份额持有人大会:

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由本基金承担的费用;
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
- (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整泰信基本面 400 份额的申购费率、调低赎回费率;
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
- (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化;
- (6) 经中国证监会允许, 基金推出新业务或服务;
- (7) 经中国证监会允许, 基金管理人、基金注册登记机构、深圳证券交易所、基金代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金交易、非交易过户、转托管等业务规则;
- (8) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外, 基金份额持有人大会由基金管理人召集;

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

4、单独或合计代表泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计代表泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

5、单独或合计代表泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

### **（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式**

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 40 天，在至少一家指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点、方式和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限

- (5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- (6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见提交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### **(四) 基金份额持有人出席会议的方式**

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开或法律法规和监管机关允许的其他方式。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金注册登记机构持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额的基金份额不少于在权益登记日各自基金总份额的 50%（含 50%）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基金管理人规定的其他方式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 会议召集人按《基金合同》规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 召集人按《基金合同》规定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额的基金份额不小于在权益登记日各自基金总份额的 50%（含 50%）；

(4) 上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符，并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者；表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

3、在法律法规或监管机关允许的情况下，本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式由基金份额持有人对其代表进行授权或召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会或通讯开会。

## **（五）议事内容与程序**

### **1、议事内容及提案权**

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金

合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额各自份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 天前提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 30 天前公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

（1）关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和《基金合同》规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

（2）程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权益登记日泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额各自份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定除外。

基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 2、议事程序

### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，

然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

## （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## （六）表决

泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应份额级别内有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见

的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## **(七) 计票**

### **1、现场开会**

(1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集,但是基金管理人或基金托管人未出席大会的,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的,不影响计票的效力。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑,可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点,重新清点以一次为限。重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证,基金管理人或基金托管人拒不出席大会的,不影响计票的效力。

### **2、通讯开会**

在通讯开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(若由基金托管人召集,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

## **(八) 生效与公告**

基金份额持有人大会的决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在至少一家指定媒体上公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机构、

公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

### 三、基金收益分配原则、执行方式

在存续期内，本基金（包括泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额）将不进行收益分配。

### 四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

#### （一）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、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金上市费及年费；
- 10、与基金相关的帐户开户费和账户维护费；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

#### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

- 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率。

在本基金成立之后的前两个年度，指数许可使用费费率为万分之九。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。

### **（三）不列入基金费用的项目**

下列费用不列入基金费用：

- 1、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费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### **（四）费用调整**

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开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费率等费率，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 日在至少一种指定媒体上公告。

### **（五）基金税收**

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 五、基金资产的投资方向和投资限制

### （一）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的成果，实现基金资产的长期增值。

### （二）投资范围

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。

### （三）标的指数

本基金的标的指数是中证锐联基本面 400 指数。

如果标的指数被停止编制及发布，或标的指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致标的指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当程序后，依法变更本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。由于上述原因变更标的指数，基金管理人在履行适当程序后变更本基金的标的指数，并在指定媒体上公告。

### （四）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和成份股发生配股、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 指数成份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  $\beta$  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

1) 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。

2) 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。

3) 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。

4) 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。

5) 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。

6) 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。

### （五）投资限制

#### 1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- （1） 承销证券；
- （2） 向他人贷款或提供担保；
- （3） 从事承担无限责任的投资；
- （4） 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- （5） 向基金管理人、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

(6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

(7) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

## 2、投资组合限制

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) 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；

(9) 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。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （一）基金资产净值的计算方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

4、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## **(二) 基金资产净值的公告方式**

1、《基金合同》生效后，在泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额开始上市交易或者泰信基本面 400 份额开始办理基金份额申购赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和泰信基本面 400 份额的基金份额净值、泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值。

2、在泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额上市交易期间或者泰信基本面 400 份额开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过指定媒体披露开放日的泰信基本面 400 份额的基金份额净值、泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值和基金份额累计净值。

3、基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和泰信基本面 400 份额的基金份额净值、泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、泰信基本面 400 份额的基金份额净值、泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

## 七、基金合同变更和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### （一）《基金合同》的变更

1、以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- （1）更换基金管理人；
- （2）更换基金托管人；
- （3）转换基金运作方式；
- （4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- （5）变更基金类别；
- （6）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金份额持有人大会召开程序；
- （9）终止《基金合同》；
- （10）其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案：

- （1）调低基金管理费、基金托管费；
- （2）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或调整收费方式；
- （4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- （5）（对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

(6) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自《基金合同》生效之日起在至少一家指定媒体公告。

## **(二) 《基金合同》的终止**

有下列情形之一的，在履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

## **(三) 基金财产的清算**

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止情形之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形发生后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。
- (7) 对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限按照法律法规的规定执行。

#### **（四）清算费用**

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

#### **（五）基金财产清算剩余资产的分配**

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额各自应计的分配比例，并在此基础上，按泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额各自的基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### **（六）基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于《基金合同》终止情形发生并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### **（七）基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人根据法律法规规定的年限保存。

### **八、争议的处理和适用的法律**

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

### **九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以《基金合同》正本为准。