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

（2015年2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

二〇一五年十月十四日

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2015年6月30日，净值表现数据的截止日期为2015年6月30日，其他内容截止日期为2015年9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：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：王小林
总经理：葛航
电话：（021）20899188
传真：（021）20899008
联系人：王斌
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2015年8月底，公司有正式员工100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2015年9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共15只开放式基金及泰信乐利分级4号、泰信乐利5号、泰信至尊阿尔法3号、泰信至尊阿尔法5号、泰信至尊阿尔法6号、泰信道简阿尔法、泰信紫藤智慧金1号、泰信吉澜分级1号、泰信梭鱼安盈新股1号、泰信鲁信1号、泰信磐晟稳健1号共11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

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

徐宏强，副董事长，硕士，高级经济师；曾任江苏省国际信托投资公司租赁部项目经理，南京国际租赁有限公司业务部经理，江苏省国际信托投资公司综合计划部科长，江苏省国际集团综合计划部科长、副总经理，南京国际租赁有限公司总经理，江苏省国信集团发展规划部副总经理；现任江苏省投资管理有限责任公司综合财务部总经理。

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。

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。

丁玮先生，独立董事，经济学学士；曾任世界银行华盛顿总部经济学家、项目经理、部门主管，德意志银行中国区总裁，中国国际金融有限公司董事总经理、投行业务负责人，淡马锡投资控股高级董事总经理、中国区总裁。

（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、泰信行业精选混合基金经理。

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。

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

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。

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。

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。

2012年4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2014年12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；

柳茜女士，研究部总监兼研究总监，泰信蓝筹精选混合基金、泰信中小盘精选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：姜建清
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：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：王小林
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室
邮政编码：518026
电话：（0755）33988759
传真：（0755）33988757
联系人：史明伟

2、代销机构

（1）场内代销机构：

办理本基金场内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：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、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、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、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、申万宏源

（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）、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、中投证券、中天证券、中信建投、中信证券（浙江）、中信证券（山东）、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券、中山证券（排名不分先后）。

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

（2）场外代销机构

（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9号东方文化大厦
法定代表人：常振明
联系人：王嫚
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：010-66226587
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：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：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

（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.mszq.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.bhzq.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：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路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：上海市西藏中路336号
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：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：96518、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：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：朱科敏
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）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

(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：戴蕾
电话：0791-86768681
传真：0791-86770178
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
客户服务电话：400-88111-77或拨打各城市营业网点咨询电话
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：哈尔滨市香坊区赣水路56号
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：0755-83515667
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：刘一宏
电话：028-86690070
传真：028-86690126
客户热线：4006-600109
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：400-800-8899
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：400-820-2899
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）杭州数米基金销售有限公司
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

（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：沈继伟
联系人：赵沛然
客服电话：400-067-6266
网址：www.leadbank.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：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层2302
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：400018-40028
网址：www.wkzq.com.cn

（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、周祎@

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的成果，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