

## 泰信基金管理有限公司

### 关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金

#### 实施转型的公告

泰信基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）于 2020 年 9 月 15 日至 2020 年 10 月 20 日 17:00 期间以通讯方式召开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”）的基金份额持有人大会，审议《关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》（以下简称“议案”）。本次大会议案于 2020 年 10 月 21 日获得表决通过，自该日起持有人大会决议生效，并已报中国证券监督管理委员会备案。本基金管理人已于 2020 年 10 月 22 日发布《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》（以下简称“《决议公告》”）。根据本次持有人大会的决议，现将实施转型的相关事项提示如下：

#### 一、关于基金合同等法律文件的修订情况

根据议案以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，本基金管理人已将《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》、《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金托管协议》修订为《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）托管协议》，并据此拟定了《泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》。

上述文件已经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]241号（《关于准予泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金变更注册的批复》）准予变更注册。《泰信中证锐联基本面400指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《泰信中证锐联基本面400指数证券投资基金（LOF）托管协议》将自2020年11月24日起生效，原《泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金基金合同》、《泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金托管协议》将自同一日起失效。

## 二、关于转型方案实施的安排

本基金转型实施前的转型选择期为2020年10月22日至2020年11月19日。

选择期期间，泰信基本面400份额（场内简称：泰信400，基金代码：162907）的申购赎回业务，以及泰信基本面400A份额（场内简称：泰信400A，基金代码：150094）、泰信基本面400B份额（场内简称：泰信400B，基金代码：150095）的交易、配对转换业务照常办理。原基金份额持有人可以选择卖出泰信基本面400A份额、泰信基本面400B份额或者赎回泰信基本面400份额。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的泰信基本面400份额、泰信基本面400A份额和泰信基本面400B份额将在份额转换基准日进行转换，最终转换为泰信中证锐联基本面400指数证券投资基金（LOF）基金份额。

在选择期期间选择赎回的，仍适用泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金的赎回费率和赎回费计入基金财产的比例。

本基金管理人可根据实际情况暂停申购、赎回或调整赎回方式。具体安排详见本基金管理人届时发布的相关公告。

### 三、关于本基金的终止上市交易和基金份额的转换

基金管理人已按照深圳证券交易所的业务规则和《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》等的有关规定向深圳证券交易所申请泰信 400A 份额与泰信 400B 份额的终止上市。具体安排详见基金管理人 2020 年 11 月 17 日发布的《泰信基金管理有限公司关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之泰信 400A 份额、泰信 400B 份额终止上市的公告》。

本基金的基金份额转换基准日为 2020 年 11 月 20 日。2020 年 11 月 20 日至 2020 年 11 月 23 日停止办理泰信基本面 400 份额的申购、赎回、定期定额投资和转托管等业务，自 2020 年 11 月 20 日起，将终止办理基金份额的拆分及合并业务。基金转型完毕后，泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）将于 2020 年 11 月 24 日开始办理申购、赎回、定期定额投资、转托管等业务。

本次基金份额的转换主要分成以下两个步骤进行：1、在份额转换基准日日终，将泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额转换成泰信基本面 400 份额的场内份额；2、更名后，泰信基本面 400 份额的场内份额和场外份额将分别自动转换成泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）基金份额的场内份额和场外份额。详细情况如下：

（1）在份额转换基准日 2020 年 11 月 20 日日终，以泰信基本面

400 份额的基金份额净值为基准，泰信 400A 份额、泰信 400B 份额按照各自的基金份额参考净值转换成泰信基本面 400 份额的场内份额。泰信 400A 份额（或泰信 400B 份额）基金份额持有人持有的转换后泰信基本面 400 份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人存在着基金资产净值减小的风险。对于持有份额数较少的泰信 400A 份额、泰信 400B 份额，存在着持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

份额折算计算公式：

泰信基本面 400A（或泰信基本面 400B）的折算比率 = 份额转换基准日泰信基本面 400A（或泰信基本面 400B）的基金份额净值 / 份额转换基准日泰信基本面 400 的基金份额净值

泰信基本面 400A（或泰信基本面 400B）基金份额持有人持有的折算后泰信基本面 400 的场内份额数 = 基金份额持有人持有的折算前泰信基本面 400A（或泰信基本面 400B）的份额数 × 泰信基本面 400A（或泰信基本面 400B）的折算比率

（2）自 2020 年 11 月 24 日起，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金变更为泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）。泰信基本面 400 份额的场内份额和场外份额将分别自动转换成泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）基金份额的场内份额和场外份额。

#### 四、重要提示

### 1、基金转型后风险收益特征或产品风险等级变化的提示

由于基金转型后运作方式等发生较大变化，影响基金的风险收益特征，转型前泰信基本面 400A 份额具有预期风险低，预期收益低的特征；泰信基本面 400B 份额由于利用杠杆投资，则具有预期风险高、预期收益高的特征。转型后基金的风险收益特征变化，泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，该基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中证锐联基本面 400 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。同时，不同的销售机构采用的风险评价方法也不同，因此存在基金变更前后风险等级不一致的可能。提示投资者关注。

### 2、基金转型期间投资组合比例限制条款豁免的提示

在选择期期间，由于泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金需应对赎回、转出等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整。并根据实际情况调整申购、赎回等安排，具体详见基金管理人届时发布的相关公告。

### 3、基金转型期间赎回费用的提示

在选择期期间选择赎回的，根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》要求，对持续持有期少于 7 日的投资者将收取

不低于 1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。对于持有期限不少于 7 日的基金份额持有人，仍适用泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金的赎回费率和赎回费计入基金财产的比例。

投资者可登录本基金管理人网站（[www.ftfund.com](http://www.ftfund.com)）或拨打本基金管理人客服电话 400-888-5988 或（021）38784566 了解相关信息。

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

特此公告。

泰信基金管理有限公司

2020 年 11 月 17 日