

**嘉实基金管理有限公司关于召开泰和证券投资基金  
基金份额持有人大会的公告**

**一、会议基本情况**

泰和证券投资基金（以下简称“本基金”）将于 2014 年 4 月 7 日到期，为消除基金到期及折价的影响，维护基金份额持有人利益，根据《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》”）、《泰和证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）等有关规定，嘉实基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与本基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，决定召开本基金的基金份额持有人大会，审议关于本基金转型的相关事宜。会议召开的具体安排如下：

- （一）会议召开时间：2014 年 2 月 27 日上午 9 时 30 分。
- （二）会议召开地点：北京国际饭店。
- （三）会议召开方式：现场方式。
- （四）会议登记办理时间：2014 年 2 月 27 日上午 8 时开始办理。

**二、会议审议事项**

本次基金份额持有人大会拟审议的事项为《关于泰和证券投资基金转型有关事项的议案》（见附件 1）。

**三、会议的议事程序和表决**

- （一）大会主持人宣布会议开始；
- （二）大会主持人宣布出席会议的基金份额持有人和基金份额持有人代理人人数及其所持有的基金份额总数、占权益登记日基金总份额的比例；
- （三）大会主持人宣布会议议事程序及注意事项；
- （四）大会主持人公布监票人、见证律师和公证机构及公证员姓名；
- （五）大会主持人宣读议案；
- （六）享有表决权的与会人员对议案进行审议，并以记名投票方式进行表决；
- （七）监票人在基金份额持有人或其代理人表决后立即进行清点，基金托管人的授权代表对计票过程进行监督，公证机关对计票过程予以公证；

- (八) 大会主持人当场公布计票结果；
- (九) 大会公证人发表公证词；
- (十) 大会见证律师就本次会议召开的程序以及基金份额持有人大会形成的决议的合法性、合规性发表见证意见。

#### **四、权益登记日**

本次基金份额持有人大会的权益登记日为 2014 年 1 月 24 日。

#### **五、会议出席对象**

- (一) 本基金权益登记日下午上海证券交易所正常交易结束后，在本基金登记结算机构登记在册的本基金全体基金份额持有人；
- (二) 基金管理人的授权代表；
- (三) 基金托管人的授权代表；
- (四) 基金管理人聘请的见证律师；
- (五) 公证机关公证人员。

#### **六、基金份额持有人出席会议需要提供的文件**

- (一) 个人基金份额持有人出席会议需要提供以下文件：
  - 1、个人基金份额持有人亲自出席会议的，需提交本人身份证明文件原件和正反面复印件；
  - 2、个人基金份额持有人授权委托他人出席会议并代理行使表决权的，应当按照“七、授权”的规定，提供相关文件。
- (二) 机构基金份额持有人出席会议需要提供以下文件：
  - 1、机构基金份额持有人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；
  - 2、由机构基金份额持有人填妥并加盖公章的授权委托书原件；如受托人为个人，需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，需提供受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

#### **七、授权**

为便于基金份额持有人有更多的机会参与本次大会，除直接参会表决外，基金份额持有人还可以授权委托他人出席会议并代其行使表决权。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权委托他人在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则：

#### （一）委托人

本基金的基金份额持有人可按下述“（三）授权方式”列明的方式授权委托他人代理出席本次基金份额持有人大会并行使表决权。投资者也可在买入本基金的同时签署授权委托书，待买入申请确认后，授权委托书自动生效。

基金份额持有人授权委托他人代理出席并行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的基金份额数计算，每一份基金份额享有一票表决权，如基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额，则授权无效。基金份额持有人在权益登记日是否持有本基金基金份额以及所持有的基金份额数额以本基金登记结算机构最终确认的数据为准。

#### （二）受托人

基金份额持有人可以授权委托本基金的基金管理人、销售机构以及其他符合规定的机构和个人，代理出席本次基金份额持有人大会并代其行使表决权。为便利基金份额持有人有效行使权利，建议基金份额持有人选择本基金的基金管理人或销售机构为受托人。

本基金管理人可以根据有关情况向基金份额持有人建议增加受托人名单，并另行公告。

#### （三）授权方式

本基金的基金份额持有人可通过纸面、电话、网络、短信以及法律法规和中国证监会认可的其他方式进行授权，授权方式及程序具体如下：

##### 1、纸面授权

##### （1）授权委托书样本

基金份额持有人通过纸面方式授权的，需填写授权委托书。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录本基金管理人网站（[www.jsfund.cn](http://www.jsfund.cn)）下载等方式获取授权委托书样本。

##### （2）纸面授权所需提供的文件

①个人基金份额持有人授权委托他人代理出席会议并代理行使表决权的，应由委托人填妥并签署授权委托书原件，并提供委托人个人身份证明文件复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）。

②机构基金份额持有人授权委托他人代理出席会议并代理行使表决权的，应由委托人填妥授权委托书原件并加盖委托人公章，同时提供委托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）；如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）。

### （3）纸面授权文件的送交

基金份额持有人授权基金管理人出席大会并行使表决权的，可选择直接送交、邮寄、柜台办理等方式送交纸面授权文件；基金份额持有人授权他人或机构出席大会并行使表决权的，由代理人携带授权文件出席大会。

基金份额持有人授权基金管理人出席大会并行使表决权的授权文件递交安排具体如下：

#### ①直接送交

基金份额持有人可将填妥的授权委托书和所需的相关文件直接送交至本基金管理人，具体地址和联系方式如下：

地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层嘉实基金管理有限公司

联系电话：400-600-8800（免长途话费）或 010-85712266

#### ②邮寄

基金份额持有人可将填妥的授权委托书和所需的相关文件邮寄至本基金管理人，具体地址及联系方式如下：

地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层嘉实基金授权项目组

邮编：100022；

联系人：赵虹；

联系电话：400-600-8800（免长途话费）或 010-85712266

### ③柜台办理

基金份额持有人也可在会议召开前到本基金管理人柜台办理授权，填写授权委托书，并提交相关身份证明文件。具体地址及联系方式如下：

地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层嘉实基金直销柜台

联系电话：400-600-8800（免长途话费）或 010-85712266。

### 2、电话授权（仅适用于个人基金份额持有人）

为方便个人基金份额持有人参与大会，基金份额持有人可拨打本基金管理人客户服务电话(400-600-8800 转人工，免收长途话费) 或 010-85712266 转人工，并按提示确认身份后进行授权。

本基金管理人和本基金主要销售机构的呼叫中心也可主动与基金份额持有人取得联系，在通话过程中以回答提问方式核实基金份额持有人身份后，由人工坐席根据基金份额持有人意愿进行授权记录并完成授权。为保护基金份额持有人利益，整个通话过程将被录音。

### 3、网络授权（仅适用于个人基金份额持有人）

为方便个人基金份额持有人参与大会，本基金管理人在网站([www.jsfund.cn](http://www.jsfund.cn)) 设立了授权专区，基金份额持有人可按提示操作进行授权。本基金各主要销售机构如提供网络授权系统的，基金份额持有人也可通过各主要销售机构的网络系统进行授权操作。

### 4、短信授权（仅适用于个人基金份额持有人）

为方便个人基金份额持有人参与大会，本基金管理人和本基金各主要销售机构可以通过短信平台向预留有效手机号码的基金份额持有人发送授权征集短信，基金份额持有人可回复短信表明授权意见。基金份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的，可选择其他方式进行授权。

## （四）授权效力确定规则

### 1、现场表决优先规则

如果基金份额持有人进行了授权委托，后又到现场参加会议直接表决，则以直接表决为有效表决，授权委托无效。

## 2、纸面优先规则

如果同一基金份额持有人通过纸面及其他方式均进行了有效授权，不论授权时间先后，均以有效的纸面授权为准。

## 3、最后授权优先规则

如果同一基金份额持有人在不同时间多次通过同一种方式或纸面以外的其他不同方式进行有效授权，无论授权意向是否相同，均以最后一次授权为准。

### （五）授权时间的确定

如基金份额持有人通过纸面方式授权，授权时间以本基金管理人或销售机构收到授权委托书的时间为准。如基金份额持有人通过非纸面方式进行授权，授权时间以系统记录时间为准。

如果授权时间相同但授权意见不一致，视为委托人授权受托人选择一种表决意见进行表决。

### （六）授权截止时间

本基金管理人接受基金份额持有人授权的截止时间为 2014 年 2 月 25 日 17:00。

## 八、基金份额持有人大会预登记

### （一）预登记时间

2014 年 1 月 21 日至 2014 年 2 月 25 日的每天上午 9:00—下午 5:00（周六、周日及法定节假日除外），本基金管理人为基金份额持有人或其代理人办理预登记。

### （二）预登记方式

#### 1、现场方式预登记

基金份额持有人或其代理人选择现场方式预登记的，应在预登记时间内，按照“六、基金份额持有人出席会议需要提供的文件”及“七、授权”的规定提供相关文件。

现场预登记的具体地址及联系方式如下：

地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层；

联系人：赵虹；

联系电话：400-600-8800（免长途话费）或 010-85712266。

## 2、传真方式预登记

在预登记时间内，基金份额持有人或其代理人可将“六、基金份额持有人出席会议需要提供的文件”及“七、授权”规定的文件传真给本基金管理人进行预登记。

具体联系方式如下：

传真号码：010- 65182266；

确认电话：400-600-8800（免长途话费）或 010-85712266；

联系人：赵虹。

## 3、关于预登记的说明

本基金管理人可以通过预登记情况估计基金份额持有人或其代理人参会情况，以便为基金份额持有人大会召开进行相应准备。已办理预登记的基金份额持有人或其代理人在会议入场前仍需按照“六、基金份额持有人出席会议需要提供的文件”及“七、授权”的规定提供相应文件办理现场会议登记，请各基金份额持有人及代理人予以配合。

## 九、会议召开与决议生效的条件

（一）根据《基金法》、《运作办法》以及《基金合同》的约定，本次基金份额持有人大会的召开条件为：符合要求的基金份额持有人或其代理人所持基金份额占本基金在权益登记日基金总份额的 50% 以上（含 50%）。

（二）根据《基金法》、《运作办法》以及《基金合同》的约定，本次基金份额持有人大会审议事项通过的条件为：经出席基金份额持有人大会的享有表决权的基金份额持有人及基金份额持有人代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。本基金管理人自基金份额持有人大会决议通过之日起 5 日内将基金份额持有人大会决议报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议自完成备案手续之日起生效。

## 十、本次大会相关机构

（一）召集人：嘉实基金管理有限公司

基金份额持有人大会专线：400-600-8800

联系人：赵虹

联系电话：400-600-8800（免长途话费）或 010-85712266

传真：010- 65182266

网址：www.jsfund.cn

电子邮件：service@jsfund.cn

（二）公证机构：北京市方圆公证处

（三）见证律师：上海源泰律师事务所

## 十一、重要提示

（一）根据《基金法》及《基金合同》的规定，如本次基金份额持有人大会不能成功召开或不能做出有效决议，根据《基金法》及《基金合同》的有关规定，本基金可能会再次召开基金份额持有人大会或在《基金合同》到期后按照《基金合同》的规定进入清算流程。

（二）与会人员应当保持会议秩序，服从引导，除出席会议的基金份额持有人及代理人、会务人员、律师、公证人员、基金托管人代表及本基金管理人邀请的人员以外，大会召集人有权拒绝其他人士入场，对干扰基金份额持有人大会秩序、寻衅滋事和其他侵犯基金份额持有人合法权益的行为，召集人有权采取措施加以制止并及时报告有关部门进行查处。

（三）本基金管理人将向上海证券交易所申请本基金自 2014 年 1 月 27 日起开始持续停牌。本基金管理人将于基金份额持有人大会决议公告后向上海证券交易所申请复牌。

（四）投资者可登录本基金管理人网站（www.jsfund.cn）或拨打本基金管理人客户服务电话（400-600-8800）了解本次基金份额持有人大会相关事宜。

（五）本公告的有关内容由嘉实基金管理有限公司解释。

特此公告

嘉实基金管理有限公司

二〇一四年一月二十一日

附件 1：关于泰和证券投资基金转型有关事项的议案

附件 2：授权委托书样本



附件 1:

## 关于泰和证券投资基金转型有关事项的议案

泰和证券投资基金基金份额持有人:

泰和证券投资基金将于 2014 年 4 月 7 日到期,为消除基金到期及折价的影响,维护基金份额持有人利益,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《泰和证券投资基金基金合同》等有关规定,嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,提议对泰和证券投资基金实施转型,并召集、召开基金份额持有人大会。《泰和证券投资基金转型方案说明书》(以下简称“转型方案”)见本议案之附件。

转型方案如获得基金份额持有人大会审议通过,基金管理人将根据转型方案办理泰和证券投资基金转型的各项具体事宜,包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间等,并可以在不涉及基金合同当事人权利义务关系变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下对《泰和证券投资基金基金合同》进行其他必要的修改和补充。

以上议案,请予审议。

嘉实基金管理有限公司

二〇一四年一月二十一日

《关于泰和证券投资基金转型有关事项的议案》之附件：

## 泰和证券投资基金转型方案说明书

泰和证券投资基金将于 2014 年 4 月 7 日到期，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《泰和证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）等有关规定，嘉实基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，拟对泰和证券投资基金实施转型并修改《基金合同》的部分条款。

### 一、方案要点

#### （一）转换基金运作方式及更名

泰和证券投资基金由封闭式基金转型为开放式基金，在完成有关转型程序后，开放申购、赎回等业务。基金管理人拟将转型后的基金名称变更为“嘉实泰和混合型证券投资基金”（以下简称“本基金”）。

#### （二）调整基金存续期限

存续期调整为不定期。

#### （三）申请终止交易及份额变更登记

本次基金份额持有人大会决议生效后，基金管理人将根据市场情况确定转型的具体时间，并向上海证券交易所申请终止或提前终止基金的上市交易。基金终止上市交易后，基金注册登记机构由中国证券登记结算有限责任公司更换为嘉实基金管理有限公司，基金管理人将进行基金份额更名以及必要的信息变更，并将为投资者办理基金份额的初始登记。在基金开放赎回业务后，基金份额持有人可通过直销机构或代销机构办理基金份额的赎回（原泰和证券投资基金基金份额持有人需先办理确权，待确权成功后方可办理赎回）。如未来条件允许，基金管理人可根据相关规则向证券交易所申请本基金上市交易。

#### （四）基金投资调整

泰和证券投资基金转型后，投资目标、投资范围、投资策略等条款调整如下：

##### 1、投资目标

分享中国改革与发展成果，密切跟踪中国经济发展背景下产业转移、格局变迁、主题带动和企业成长的投资机会，谋求基金资产的长期稳定增值。

## 2、投资范围

本基金的投资范围为国内依法发行的股票（包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准发行的股票），债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，股指期货、权证，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。

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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的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%；股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

## 3、投资策略

### （1）资产配置策略

本基金主要参考公司投资决策委员会形成的大类资产配置建议，综合考虑宏观经济因素、资本市场因素、主要大类资产的相对估值等因素，在控制风险的前提下，合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。

### （2）股票投资策略

本基金股票投资将重点关注中观因素带来的投资线索并防范组合风险，精选具有可持续增长潜力的优势个股。基于中观因素与个股因素相结合的个股精选是本基金的主要投资策略。本基金将从持续性、有效性和市场认知程度三个方面综合分析判断中观因素转化为投资机会的可能性，并在此基础上深入挖掘个股投资价值。

#### ①中观因素主要可以归纳为以下四个方面的线索：

a、宏观经济结果：宏观经济变化会对中观层面产生深远影响，在不同的宏观环境下，各个行业的生命特征和表现不同。本基金将结合宏观经济数据（如通

胀水平、经济增长速度等), 政策导向和市场投资情绪对宏观经济周期进行前瞻性判断, 进而根据不同经济周期进行行业配置与调整。

b、产业变迁: 产业转移和技术发展是导致产业变迁的两大动力, 本基金通过深入研究国际国内产业转移路径以及技术发展升级带来的行业和区域性投资机会, 优选处于上升周期的产业。

c、行业格局: 长期来看, 行业的系统性周期变化将会对行业格局变化产生系统性影响, 而短期来看, 行业格局利益的重新分配将会对行业产生结构性影响和机会, 本基金通过紧密跟踪影响行业格局利益分配调整的驱动因素和事件, 提前捕捉行业格局变化带来的投资机会。

d、主题驱动: 本基金同时关注影响行业/区域的主题性投资机会, 通过综合考量主题驱动的上中下游行业机会, 以及行业/区域与主题的相关程度和反应速度, 提前布局主题受益行业/区域。

②个股因素主要可以归纳为以下几个方面的指标:

a、盈利模式: 通过综合考量企业利润来源、核心竞争力、渠道影响力、客户忠诚度、创新能力等分析判断企业是否具备稳健或领先的盈利模式。

b、管理层能力: 通过综合考量企业管理团队的稳定性、专业程度以及所倡导的企业文化等分析判断企业管理层是否具备带领企业积极健康发展的能力。

c、公司战略: 通过综合考量企业战略定位、发展规划、经营策略和执行力等分析判断企业是否具备清晰的发展目标和明确的实现手段。

d、财务报表健康程度: 通过综合考量企业资产负债情况、利润结构分解和现金流情况等分析判断企业财务状况是否与其战略发展相匹配。

e、体外或有资产: 通过综合考量企业的行业地位、兼并收购能力等分析判断企业扩大产能实现跳跃式发展的可能性。

③中观因素与个股因素相结合

本基金遵循“宏观推导中观, 中观指导微观”的动态投资逻辑, 通过结合中观因素与个股因素确定优势个股, 并根据组合风险特征、资产配置策略的变化等进行股票投资组合的构建与调整。

(3) 债券投资策略

本基金在债券投资方面, 通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化

趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

#### （4）衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、权证等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。

#### （5）风险管理策略

本基金将借鉴国外风险管理的成功经验如 Barra 多因子模型、风险预算模型等，并结合公司现有的风险管理流程，在各个投资环节中来识别、度量和控制投资风险，并通过调整投资组合的风险结构，来优化基金的风险收益匹配。

具体而言，在大类资产配置策略的风险控制上，由投资决策委员会及宏观策略研究小组进行监控；在行业配置策略的风险控制上，风险管理部除了监控本基金的行业偏离风险外，也会根据不同市场情况监控本基金的投资风格如大中小盘等的偏离风险并及时预警。在个股投资的风险控制上，本基金将严格遵守公司的内部规章制度，控制单一个股投资风险。

未来，根据市场情况，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

### 4、投资限制

#### （1）组合限制

基金的投资组合将遵循以下限制：

- ①本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%。
- ②本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%。
- ③本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。
- ④本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%。
- ⑤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%。
- ⑥本基金股票投资占基金资产的比例范围为 30%~95%。

⑦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%。

⑧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%。

⑨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%。

⑩本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%。

⑪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。

⑫基金资产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

⑬本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%。

⑭本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

⑮本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%。

⑯本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。

其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。

⑰本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%。

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等。

⑱本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值合计（轧差计算）

不得超过基金资产的 95%。

⑨本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%。

⑩本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。

⑪若本基金投资于法律法规或中国证监会允许基金投资的新品种的，相关比例参照基金合同及监管机构的有关规定执行。

⑫法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。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。

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有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

## （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违反规定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；
- ⑥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；
- ⑦依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其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，或者从事其

他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

法律法规或监管部门变更或取消上述限制，本基金按照调整后的规定执行。

## 5、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×70%+上证国债指数×30%。

### （五）基金的申购与赎回

#### 1、基金的集中申购

##### （1）集中申购期限

泰和证券投资基金终止上市后，基金管理人将根据市场情况确定发布转型后基金的招募说明书及集中申购期基金份额发售公告的具体时间，转型后基金的集中申购期限不超过 3 个月。

##### （2）销售方式

投资者可以使用开放式基金账户，通过直销机构和代销机构进行集中申购。

##### （3）集中申购价格

本基金集中申购申报价格为基金份额初始面值 1.00 元。

对于 T 日交易时间内受理的集中申购申请，注册登记机构将在 T+1 日就申请的有效性进行确认。但对申请有效性的确认仅代表确实接受了投资者的集中申购申请，集中申购的最终份额由注册登记机构在集中申购期结束后确认。

集中申购期结束后，基金管理人应在 10 日内聘请会计师事务所进行集中申购款项的验资。验资结束日，基金管理人将通过份额折算，使得原泰和证券投资基金基金份额净值为 1.000 元。

集中申购款项在集中申购期间存入专门账户，在集中申购期结束前任何人不得动用，期间产生的利息在集中申购期结束后折算为基金份额归投资者所有。

基金管理人将就集中申购的验资和份额确认情况进行公告。

#### 2、基金的日常申购赎回

##### （1）日常申购、赎回的开始时间

本基金的日常申购、赎回自集中申购期结束后不超过 3 个月的时间内开始办理。

##### （2）申购、赎回申请



本基金开放赎回业务后，基金份额持有人可通过直销机构或代销机构办理基金份额的赎回（原泰和证券投资基金份额持有人需先办理确权，待确权成功后方可办理赎回）。

#### （六）基金费率结构

##### 1、集中申购费率如下：

集中申购金额（含集中申购费）	集中申购费率
50 万元以下	1.2%
50 万元以上（含 50 万元）-200 万元以下	0.9%
200 万元以上（含 200 万元）-500 万元以下	0.6%
500 万元以上（含 500 万元）	每笔1000元

##### 2、日常申购费率如下：

申购金额（含申购费）	申购费率
50 万元以下	1.5%
50 万元以上（含 50 万元）-200 万元以下	1.2%
200 万元以上（含 200 万元）-500 万元以下	0.8%
500 万元以上（含 500 万元）	每笔1000元

##### 3、赎回费率如下：

持有期限（Y）	赎回费率
$Y < 7$ 天	1.5%
$7 \text{ 天} \leq Y < 30$ 天	0.75%
$30 \text{ 天} \leq Y < 365$ 天	0.5%
$365 \text{ 天} \leq Y < 730$ 天	0.25%
$Y \geq 730$ 天	0

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基金份额时收取。对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于 3 个月的投资人收取的赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人，将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产。上述未纳入基金财产的赎回费用于支付登记费、销售手续费等各项费用。

基金份额持有人在基金终止上市前持有的原泰和证券投资基金基金份额，持有期限自《嘉实泰和混合型证券投资基金基金合同》生效之日起计算；基金份额持有人通过集中申购和日常申购所得的基金份额，持有期限自注册登记机构确认登记之日起计算。

4、基金管理人的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。基金管理费每日计提，按月支付。

5、基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。基金托管费每日计提，按月支付。

6、账户开户费用及维护费、证券交易费用、基金财产划拨支付的银行费用、《基金合同》生效后的信息披露费用、基金份额持有人大会费用、《基金合同》生效后与基金有关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费以及法律法规或中国证监会允许在基金财产中列支的其他费用，根据法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

#### **（七）基金的收益分配**

1、本基金收益每年最多分配 12 次，每次每份基金份额基金收益分配比例不低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%。若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配。

2、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日（具体以届时的基金分红公告为准）的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

3、基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

4、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

#### **（八）基金的合并**

自 2013 年 6 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》第七十九条规定：“按照基金合同的约定或者基金份额持有人大会的决议，基金可以转换运作方式或者与其他基金合并”，本基金增加基金合并的相关内容如下，并相应

调整其它相关条款：

### 1、基金合并概述

本基金的存续期间，如发生下列情形之一的，基金管理人经与基金托管人协商一致，可以决定本基金与基金管理人管理的其他基金合并：

- (1) 连续 3 个月平均基金份额持有人数量不满 100 人的；
- (2) 连续 3 个月平均基金资产净值低于 5000 万元的。

基金合并的方式包括但不限于本基金吸收合并其他基金、本基金被其他基金吸收合并、本基金与其他基金合并为新的基金等方式。本基金吸收合并其他基金时，其他基金终止，本基金存续；本基金被其他基金吸收合并时，其他基金存续，本基金终止；本基金与其他基金合并为新的基金时，本基金与其他基金均终止。

### 2、基金合并的实施方案

#### (1) 基金合并公告

①基金管理人应就本基金合并事宜，依照相关法律法规的规定进行公告，向投资人披露合并后基金的法律文件，明确实施安排，说明对现有持有人的影响，并报中国证监会备案或更新基金申请材料。

②基金管理人应在合并实施前至少提前二十个工作日就基金合并相关事宜进行提示性公告。

③为了保障现有基金份额持有人的利益，基金管理人可在合并实施前的合理时间内暂停本基金的日常申购或转换转入业务。

#### (2) 基金合并业务的规则

①基金管理人应在有关基金合并的公告中，说明对现有基金份额的处理方式及基金合并操作的具体起止时间，并提示现有基金份额持有人在基金合并前的指定期限内（该期限不少于二十个工作日，具体期限在公告中列明，以下简称指定期限）可行使选择权。

②基金份额持有人在指定期限内可行使的选择权包括：

- a. 赎回其持有的本基金份额；
- b. 将其持有的本基金份额转换为基金管理人管理的、可接受转换转入的其他基金份额；
- c. 继续持有合并后的基金份额；

d.基金管理人届时公告的其他选择权。

③基金份额持有人可就其持有的本基金全部或部分基金份额选择行使上述任一项选择权。

④除以下⑤所述情形外，基金份额持有人在指定期限内因行使选择权而赎回或转换转出本基金份额的，基金管理人免除基金份额持有人赎回或转换时应支付的赎回费或转换费（包括转出基金的赎回费用和转入基金的申购费补差，下同）等交易费用。

⑤在指定期限内，本基金可以开放申购及/或转换转入业务，但对该等申购及/或转换转入的份额，如其在指定期限内再赎回或转换转出的，基金管理人有权不予免除相应的赎回费或转换费等交易费用。

⑥指定期限届满，基金份额持有人没有做出选择的，视为基金份额持有人选择继续持有基金合并后的基金份额。

3、基金合并导致本基金终止并清算时，由此产生的清算费用由本基金财产承担。

#### 4、基金合并后的投资管理

本基金吸收合并其他基金的，本基金的投资管理将按本基金合同约定保持不变。

本基金被其他基金吸收合并的，本基金的投资管理将按照其他基金基金合同的约定执行。

本基金与其他基金合并为新基金的，本基金的投资管理按照基金管理人、基金托管人协商一致的投资目标、投资策略、投资范围、投资限制、投资管理程序等执行。

5、基金管理人与基金托管人应就基金合并事宜协商一致，并按照本基金合同的约定具体实施，且无需经基金份额持有人大会审议批准。

6、本基金被其他基金吸收合并或本基金与其他基金合并为新基金引起本基金基金合同终止的，本基金财产应清理、估价，但可根据届时有效的相关规定，基金财产不予变现和分配。本基金的债权债务由合并后的基金享有和承担。本基金清算的其他事项按照《基金合同》的相关约定执行。

## 二、授权基金管理人修订《基金合同》

首先，除依据上述“一、方案要点”修改《基金合同》以外，基金管理人需要根据转型后的基金产品特征，修订《基金合同》的相关内容。

其次，考虑到自《基金合同》生效以来，《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》及其实施准则等法律法规相继颁布和实施，基金管理人需要根据法律法规要求修订《基金合同》的相关内容。

因此，基金管理人提请持有人大会授权基金管理人根据上述事项修订《基金合同》的内容，修订后的《基金合同》在经基金托管人审核同意后，报中国证监会备案。

### 三、基金管理人就方案相关事项的说明

#### （一）基金转换运作方式的必要性

##### 1、有利于保护基金份额持有人利益

###### （1）节省到期清算的成本

根据《基金合同》的规定，泰和证券投资基金存续期截至 2014 年 4 月 7 日为止。若到期后不进行转型延期，基金份额持有人将要承担清算费用以及清算期间的机会成本。根据有关法律法规，泰和证券投资基金转型为开放式基金后，可无限期存续。通过转换运作方式可以避免到期时基金清算产生的相关成本，更好地保护基金份额持有人利益。

###### （2）基金转型有利于消除折价

截至 2014 年 1 月 10 日，泰和证券投资基金份额净值为 1.3145 元，当日基金二级市场收盘价为 1.286 元，基金折价率为 2.17%。基金转型将消除基金折价，有利于更好地保护基金份额持有人利益。

##### 2、基金转型有利于基金份额持有人投资计划的延续

泰和证券投资基金自成立以来业绩表现良好，截至 2014 年 1 月 10 日，泰和证券投资基金累计净值 4.9635 元，成立以来累计净值增长率 954.94%，每份基金份额累计分红 3.6490 元，基金转型有利于基金份额持有人投资计划的延续。

#### （二）泰和证券投资基金终止上市的可行性

泰和证券投资基金终止上市后，基金注册登记机构由中国证券登记结算有限责任公司更换为嘉实基金管理有限公司。我司已与上海证券交易所、中国证券登

记结算有限责任公司及其上海分公司就份额转移事项进行了充分的准备，技术上具有可行性。在基金开放赎回业务后，基金份额持有人可通过直销机构或代销机构办理基金份额的赎回（原泰和证券投资基金份额持有人需先办理确权，待确权成功后方可办理赎回）。因此，基金退市不会导致投资者无法变现基金份额，对基金份额持有人利益无不良影响。

### （三）调整基金投资目标、投资范围和投资策略的可行性

泰和证券投资基金转型后，基金管理人可根据开放式基金的相关法规规定调整其投资目标、投资范围、比例限制等，并根据新的市场情况和特点进一步明确投资策略。

### （四）授权基金管理人修订《基金合同》的可行性

基金管理人将严格按照持有人大会决议以及法律法规的规定修订《基金合同》。修订后的《基金合同》需经基金管理人和基金托管人签字盖章，报中国证监会备案。

## 四、基金转型的主要风险及预备措施

### （一）转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

基金管理人面向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对转型方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

如果议案未获得持有人大会的通过，泰和证券投资基金到期后，将按照《基金合同》的相关条款进入清算流程。

### （二）基金转型开放后遭遇大规模赎回的风险

为避免基金转型开放后可能出现的大量赎回对基金正常运作产生的冲击，降低风险，基金将设置集中申购期，投资者可以使用开放式基金账户，通过直销机构和代销机构进行集中申购。

在集中申购期内，投资者可按 1 元面值提交申购申请。集中申购款项存入专门账户，不进入基金资产，在集中申购期结束后确认份额，利息折算份额归投资者所有。

## 五、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容有任何意见和建议，请通过以下方式联系

基金管理人。

联系人：赵虹

联系电话： 400-600-8800（免长途话费）或 010-85712266

传真：(010)65182266

网址： [www.jsfund.cn](http://www.jsfund.cn)

电子邮件： [service@jsfund.cn](mailto:service@jsfund.cn)

附件 2:

### 授 权 委 托 书

本人（或本机构）兹授权（请用“√”选择）

嘉实基金管理有限公司

\_\_\_\_\_证券公司

\_\_\_\_\_

代表本人/本机构出席将于 2014 年 2 月 27 日召开的泰和证券投资基金基金份额持有人大会，并按照以下表决意见对《关于泰和证券投资基金转型有关事项的议案》行使表决权。本人（或本机构）同意被授权人进行转授权。

本人（或本机构）的意见为（请在表决意见栏内划“√”）:

同意	反对	弃权

上述授权的有效期限至 2014 年 4 月 7 日止。

委托人（签字/盖章）: \_\_\_\_\_

委托人证件号码（填写）: \_\_\_\_\_

委托人联系电话（重要）: \_\_\_\_\_

委托日期:       年    月    日

#### 说明:

1、为保护基金份额持有人利益及公证工作的需要，请您务必详细、准确地填写联系电话。

2、委托人证件号码仅指基金份额持有人在开立持有泰和证券投资基金的证券账户时所使用的证件号码或该证件号码的更新。

3、此授权书剪报、复印或按以上格式或内容自制，在填写完整并签字/盖章后均为有效。

4、如委托人未在授权委托书中明确表决意见的，视为授权受托人按照受托人的意见行使表决权；如委托人在授权委托书中表达多种表决意见的，视为授权受托人选择一种表决意见进行表决。