

# 泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）

## 基金产品资料概要（更新）

编制日期：2021 年 8 月 6 日

送出日期：2021 年 8 月 10 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

### 一、产品概况

基金简称	泰信基本面400	基金代码	162907
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
基金合同生效日	2020-11-24	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	契约型、上市开放式	开放频率	每个开放日开放申购、赎回
基金经理	董山青先生	开始担任本基金基金经理的日期	2021-08-05
		证券从业日期	2004-08-02
其他	其他自基金合同生效后的基金存续期内，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。		

注：泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金的基金份额持有人大会于2020年10月21日获得表决通过关于《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》，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》。本基金以2020年11月20日为基金份额转换基准日，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、泰信400B份额于2020年11月20日终止上市。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》于2020年11月24日生效。

### 二、基金投资与净值表现

#### （一）投资目标与投资策略

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。
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

监会允许基金投资的其他股票)、债券(含国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换公司债券等)、货币市场工具(含同业存单)、资产支持证券、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(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%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等,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,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

**主要投资策略** 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。

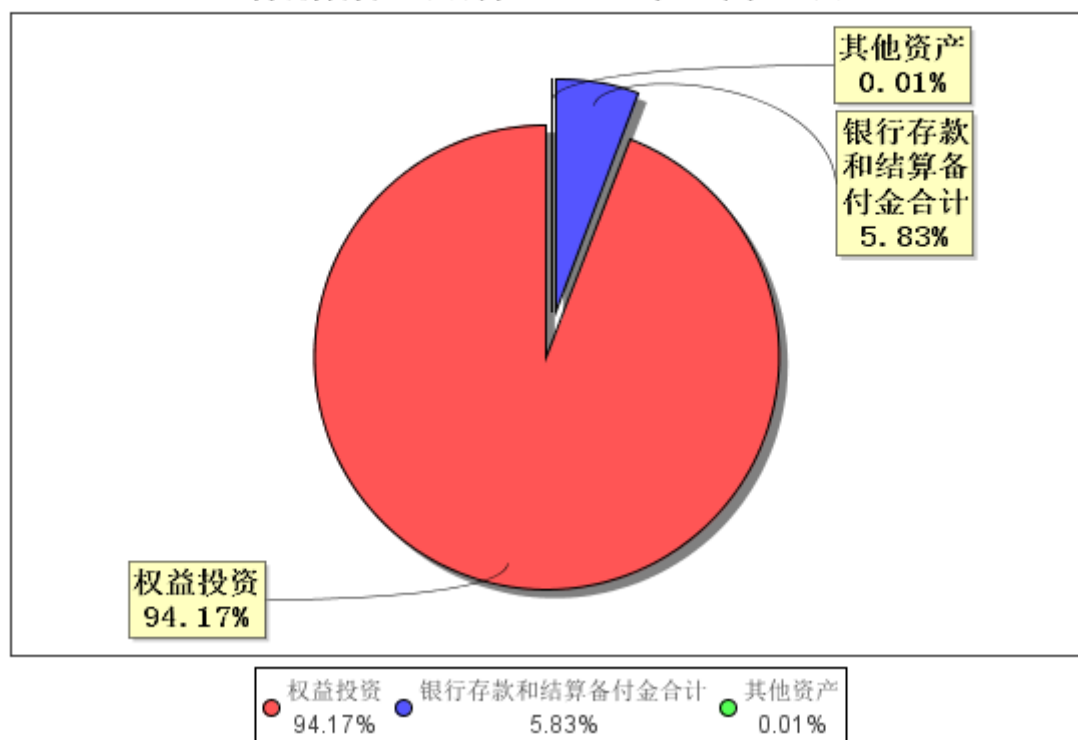
**业绩比较基准**  $95\% \times \text{中证锐联基本面400指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率(税后)}$

**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,其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

注:详见《泰信中证锐联基本面400指数证券投资基金招募说明书(LOF)》第九部分“基金的投资”。

## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

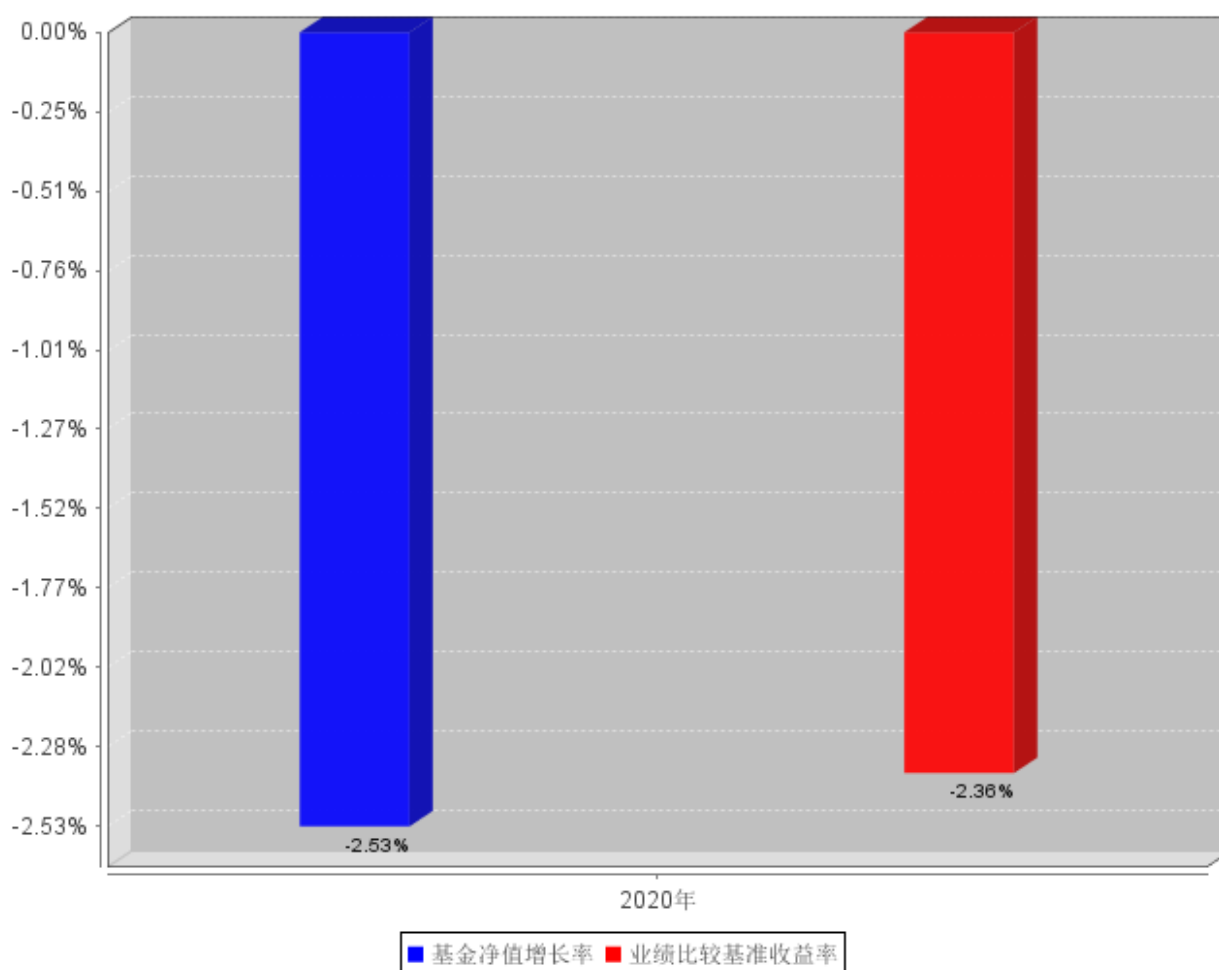
投资组合资产配置图表  
数据截止日期: 2020年12月31日



注:投资组合资产配置数据截止日期为2020年12月31日。

## (三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：业绩表现截止日期2020年12月31日。基金过往业绩不代表未来表现。泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金于2020年11月24日变更为泰信中证锐联基本面400指数证券投资基金 (LOF)。“2020年”实际时间段为2020年11月24日至2020年12月31日。

### 三、投资本基金涉及的费用

#### (一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
申购费 (前收费)	M < 500,000	1.2%	场外份额
	500,000 ≤ M < 2,000,000	0.8%	场外份额
	2,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.4%	场外份额
	M ≥ 5,000,000	每笔1000元	场外份额
	-	深圳证券交易所会员单位按照场外申购费率设定投资者的场内申购费率。	场内份额
赎回费	N < 7天	1.5%	场外份额

7天 $\leq$ N $<$ 365天	0.5%	场外份额
1年 $\leq$ N $<$ 2年	0.25%	场外份额
N $\geq$ 2年	0%	场外份额
N $<$ 7天	1.5%	场内份额
N $\geq$ 7天	0.5%	场内份额

## (二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

费用类别	收费方式/年费率
管理费	1.00%
托管费	0.22%
销售服务费	-
指数许可使用费	费用的计算方法及支付方式详见招募说明书及相关公告
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、律师费、审计费等,按照有关法规和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用

注:投资人重复申购,须按每次申购所对应的费率档次分别计费。

申购费用由投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

本基金交易证券、基金等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

## 四、风险揭示与重要提示

### (一) 风险揭示

#### (一) 市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动,将对本基金资产产生潜在风险,主要包括:

##### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响,导致市场价格波动,影响基金收益而产生风险。

##### 2、经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表,而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响,从而产生风险。

##### 3、利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动,同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于货币市场工具,收益水平会受到利率变化的影响。

##### 4、购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值,如果发生通货膨胀,基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消,从而影响基金资产的保值增值。

##### 5、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响,如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化,从而导致基金投资收益变化。

#### (二) 信用风险

指基金在交易过程发生交收违约,或者基金所投资的债券违约,导致基金资产损失。

#### (三) 流动性风险

1、流动性风险指基金资产不能迅速转变成现金,或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。

在开放式基金交易过程中,可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难,导致流动性风险,甚至影响基金份额净值。

## 2、本基金主要的流动性风险管理方法说明

(1) 在申购、赎回安排方面,本基金将加强对开放式基金申购环节的管理,合理控制基金份额持有人集中度,审慎确认大额申购申请,在当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人将采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施对基金规模予以控制,切实保护存量基金份额持有人的合法权益;当基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值不足支付当日净赎回申请所需资金时,将采取拒绝或暂停赎回或延缓支付赎回款项等措施。具体内容详见本招募说明书第八章。

(2) 本基金拟投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所,主要投资对象为具有良好流动性的金融工具(包括国内依法发行上市的股票、债券和货币市场工具等),同时本基金基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征,综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

(3) 在本基金出现巨额赎回情形下,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时,如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的,基金管理人有权对其采取延期办理部分或全部赎回申请的措施。具体内容详见本招募说明书第八章。

(4) 本基金可能实施备用的流动性风险管理工具,以更好地应对流动性风险。基金管理人经与基金托管人协商,在确保投资者得到公平对待的前提下,可依照法律法规及基金合同的约定,综合运用各类流动性风险管理工具,对赎回申请等进行适度调整,作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施,包括但不限于:1) 延期办理巨额赎回申请;2) 暂停接受赎回申请;3) 延缓支付赎回款项;4) 收取短期赎回费,本基金对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费;5) 暂停基金估值,当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商一致,本基金将暂停基金估值;6) 摆动定价。

### (四) 管理风险

在基金管理运作过程中,可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

### (五) 操作或技术风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中,因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险,例如,越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中,可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

### (六) 合规性风险

指基金管理或运作过程中,违反国家法律法规的规定,或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

### (七) 本基金特有的风险

#### 1、指数化投资的风险

(1) 本基金为股票型基金,重点投资于中证锐联基本面400指数成份股及其备选成份股。在具体投资管理中,本基金可能面临中证锐联基本面400指数成份股以及备选股所具有的特有风险,也可能由于股票投资比例较高而带来较高的系统性风险。

#### (2) 指数化投资风险

本基金采取指数化投资策略,被动跟踪标的指数。当指数下跌时,本基金面临基金净值和指数同步下跌的风险。

### (3) 投资替代风险

因特殊情况 (比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等) 导致本基金无法获得足够数量的股票时, 基金管理人将搭配使用其他合理方法 (如买入非成份股等) 进行适当的替代, 由此可能对基金产生不利影响。

### (4) 跟踪偏离风险

以下因素可能导致基金投资组合的收益率无法紧密跟踪标的指数的收益率:

- 1) 基金运作过程中发生的费用, 包括交易成本、市场冲击成本、管理费和托管费等;
- 2) 基金发生申购或赎回: 本基金在实际管理过程中由于投资者申购而增加的资金可能不能及时地转化为目标指数的成份股票、或在面临投资者赎回时无法将股票及时地转化为现金, 这些情况使得本基金在跟踪指数时存在一定的跟踪偏离风险;
- 3) 在指数化投资过程中, 管理人对指数基金的管理能力, 如跟踪技术手段、买入卖出的时机选择等都会对本基金的收益产生影响, 从而影响本基金对业绩比较基准的跟踪程度;
- 4) 当标的指数调整成份股构成, 或成份股公司发生配股、增发等行为导致该成份股在指数中的权重发生变化, 或标的指数变更编制方法时, 基金在相应的组合调整中可能暂时扩大与标的指数的构成差异, 而且会产生相应的交易成本, 导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。
- 5) 基金参与新股申购、成份股派发现金股息、法律法规限制等其他可能导致跟踪误差的情形。
- 6) 其他因素产生的跟踪误差。如因受到最低买入股数的限制, 基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同; 因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大; 因指数发布机构指数编制错误等产生的跟踪偏离度与跟踪误差。

### 2、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内, 年化跟踪误差控制在4%以内, 但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围, 本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

### 3、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护, 未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护, 本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案, 如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等, 并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决, 基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的, 基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前, 基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作, 该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异, 影响投资收益。

### 4、成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌, 发生成份股停牌时可能面临如下风险:

- 1) 基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。
- 2) 停牌成份股可能因其权重占比、市场复牌预期等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平。
- 3) 在极端情况下, 标的指数成份股可能大面积停牌, 基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的符合要求的赎回款项, 由此基金管理人可能采取暂停赎回的措施, 投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

### 5、基金运作的特有风险

本基金由泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金变更而来。基金合同生效后, 在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下, 基金管理人可以申请本基金份额上市交易。故本基金存在合同生效后暂时无法上市的风险。

本基金在深圳证券交易所挂牌上市，由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资者在停牌期间不能买卖本基金上市交易份额，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足而产生流动性风险；另外，当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时，本基金存在终止上市的可能。

#### 6、参与资产支持证券的风险

本基金投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的是基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

#### 7、参与中小企业私募债的风险

本基金投资中小企业私募债券，中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

#### （八）其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

金融市场危机、行业竞争、销售机构违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金持有人利益受损。

### （二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，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。

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。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

泰信中证锐联基本面400指数证券投资基金（LOF）由泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金变更而来。泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金经2019年2月20日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。2020年9月15日至2020年10月20日17:00，泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金的基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议通过了泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金的基金合同变更议案，将“泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金”转型为“泰信中证锐联基本面400指数证券投资基金（LOF）”，具体内容包括泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金变更基金名称、投资范围、投资策略、投资限制、估值方法、收益分配等。上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自2020年11月24日起，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》失效，《泰信中证锐联基本面400指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站

网址：<https://www.ftfund.com> 客服电话：400-888-5988，021-38784566

基金合同、托管协议、招募说明书

定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

基金份额净值  
基金销售机构及联系方式  
其他重要资料

## 六、其他情况说明

-