

泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金

(原泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金)

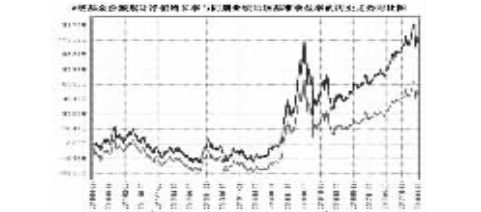
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	⑤-③	⑤-④
2018.1.1-2018.3.15	128%	1.12%	1.71%	1.16%	-0.43%	-0.04%
2017.7.1-2018.3.15	12.75%	0.79%	9.93%	0.80%	2.82%	-0.02%
2017.7.1-2018.3.15	29.70%	0.70%	18.68%	0.72%	6.24%	-0.02%

注:1.本基金业绩比较基准:95%×中证财富大盘指数收益率+5%×同业存款利率。

本基金股票资产的跟踪标的指数为中证财富大盘指数,中证财富大盘指数是由中证指数有限公司编制并开办的中国A股市场指数。该指数按照上市公司创造财富能力的大小进行选择,挑选最具创造财富能力的300家A股上市公司作为样本;此外该指数在加权方式上亦有所创新,不同于一般的市值加权指数,该指数样本个股的权重配置与其创造财富能力的大小相适应,从而打破市值指数中价格与权重过于紧密的联系,预防个股权重由于价格的非理性波动而大起大落,提高了个股权重配置的稳定性,指数的表现综合反映了中国经济增长过程中核心企业真实的财富变化情况。

2.本基金A类份额成立于2010年4月23日,C类份额成立于2017年2月9日。

3.2.2 本基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较



注:本基金A类份额成立于2010年4月23日,C类份额成立于2017年2月9日。本基金在建仓结束时期及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

4.1 基金管理人及基金基本情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财基金基金管理有限公司,成立于2002年6月,是中国首批合资基金管理公司之一。截至报告期末本公司股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司:51%;宏利资产管理(香港)有限公司:49%。

目前公司管理包括泰达宏利价值化型系统基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)、泰达宏利普选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基金、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金、泰达宏利沪深300指数增强型证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利中证500指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利宏达灵活配置型证券投资基金、泰达宏利瀚利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利活力朋友货币市场基金、泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利汇利债券型证券投资基金、泰达宏利量化增强股票型证券投资基金、泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利定宏混合型证券投资基金、泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利亚洲价值型证券投资基金、泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利人民币货币市场基金、泰达宏利红利领先型证券投资基金、泰达宏利恒利债券型证券投资基金、泰达宏利普选稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利航天宝货币市场基金、泰达宏利富实灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金、泰达宏利金鹰固定收益股票型证券投资基金、泰达宏利金鹰固定收益基金中基金中基金(FOF)、泰达宏利季3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利利季3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利领先增长灵活配置混合型证券投资基金在内的十多只证券投资基金。

本公司采用内部投资决策方式,即通过整个投资团队全体人员的共同努力,力求实现基金资产的投资增值。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金基金经理助理简介(转型后)

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

4.2 基金经理(或基金经理小组)及基金基金经理助理简介(转型前)

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

4.3 基金管理人报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定,本基金运作整体合规合法,没有发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行制度和流程,并严格执行制度的规定

在投资管理活动中,本基金管理人公平对待不同投资组合,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议及投资决策方面享有平等机会,严格执行投资管理职能与交易执行职能的隔离,在交易环节实行集中交易控制,并确保公平交易可操作、可评估、可稽核,持续、有效地执行交易系统,并符合公平交易并能按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令,对于部分估值、证券市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,交易部按申购优先,比例分配的原则对交易结果进行分配,确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部针对本报告期的公平交易执行情况进行数量统计,分析,在本报告期内,未发现利益输送,不公平对待不同投资组合的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控,风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估,向公司风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。本报告期内,本基金管理人旗下所有投资组合的同一反向交易成交较少的单边交易量均不超过该证券当日成交量的5%。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

4.4 基金管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年完成产品转型后,依照新产品合同及相关投资约束积极构建组合,通过量化策略对业绩比较基准进行增强操作。运作期间整体市场环境不断震荡,市场上半年热点在医药、消费股和人工智能等主题之间频繁切换,其他板块均有不同程度的下跌,市场分化依然巨大,同时“去杠杆”期间面临经济增速下行的困扰下,整体系统性估值持续收缩,本基金恪守安全仓位,积极构建风险模型和Alpha因子,在承担相对于业绩比较基准之外有限的风险前提下,积极构建Alpha因子暴露,同时严格控制交易方式,降低申购赎回和组合调整带来的冲击,为持有人创造了一定超额收益。

4.4.2 报告期内基金的投资表现

截至本报告期末泰达宏利沪深300A基金份额净值为1.3266元,本报告期基金份额净值增长率为-11.74%;截至本报告期末泰达宏利沪深300C基金份额净值为1.3325元,本报告期基金份额净值增长率为-11.78%,同期业绩比较基准收益率为-13.59%。

4.5 基金管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年宏观经济,在杠杆收缩的时间窗口中,经济政策或将平衡经济增速和去杠杆的节奏和结构,使得市场流动性或将缓解收紧,而财政政策或也将随着三季度有所作为,向上或将对市场提供阶段性机会,更长周期,市场依然在寻找中国经济的新增长点,以及是否有相应的政策刺激匹配,市场整体估值仍将围绕该逻辑不断平衡。

4.6 基金管理人报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人依照相关法律法规规定,设有估值委员会,并制定了相关制度及流程,估值委员会主要负责估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值按照托管银行执行复核,公司估值委员会由主管基金运营的副总经理担任主任,成员包括但不限于不限于基金、主管投资的副总经理兼投资总监、基金

投资部、研究部、金融工程部、固定收益部、合规风控部门、基金运营部的主要负责人;委员会秘书由基金运营部负责人担任。所有人员均具有丰富的专业工作经历,具备良好的专业经验和职业胜任能力。

基金经理参与估值委员会对相关停牌品种估值的讨论,发表相关意见和建议,但涉及停牌品种的基础数据不参与最终的股票表决。

本报告期内,本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高原则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同及基金的实际运作情况,本基金于本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对于本基金持有人人数或基金资产净值预警情况的说明

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情况。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人信情况

本报告期内,中国银行银行股份有限公司(以下简称“本托管人”)在泰达宏利沪深300指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

创业板及其他经中国证监会核准上市股票、债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债券、可交换债券、可转债及分离交易可转债及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、资产支持证券、股指期货、货币市场工具、权证、同业存单及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中投资于股票组合的比例不低于基金资产的80%,投资组合中投资于沪深300指数成份股的资产不低于非现金基金资产的80%。

每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,基金保留的现金或现金等价物在一年以内的政府债券的比例合计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。本基金投资股指期货、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相关规定;本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+同业存款利率×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司于2018年8月27日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利沪深3