

信息披露 Disclosure

泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金更新招募说明书摘要

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司 基金托管人:中国银行股份有限公司 重要提示: 本基金于2017年3月2日经中国证监会证监许可[2017]299号文注册。本基金合同于2017年5月17日生效。	人员的支持,同时配备操作专员,并定期更新; (2) 建立相互分离、相互制约的内控机制;建立、健全了各项制度,做到基金经理分权、投资决策分开;基金交易中,形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制,从制度上减少过失和道德风险; (3) 建立、健全风险控制责任制,建立了风险控制委员会,每个员工都明确自己的任务、职责,并及时将各自工作领域中的风险隐患上报,以防范和减少风险; (4) 建立风险分类、识别、评估、报告、监督程序;分别建立了公司营运风险和投资风险识别委员会,使用合适的程序、确认和评估与公司运作和投资有关的风险;公司建立了自上而下的风险	客户服务电话:953636 公司网址:www.njzq.com.cn 30) 兴证证券资产管理有限公司 客服电话:4008-9008-618 公司网址:www.xzind.com 70) 北京广源达信基金销售有限公司 注册地址:北京市西城区新街口外大街28号C座六层0605室	注册地址:北京市经济技术开发区荣成路10号15层122室 地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座20层2020# 法定代表人:李煜 客服电话:4008-9008-618 公司网址:www.chind.com 70) 北京广源达信基金销售有限公司 注册地址:北京市西城区新街口外大街28号C座六层0605室	<table border="1"> <thead> <tr> <th>行业类别</th><th>公允价值(元)</th><th>占基金资产净值比例(%)</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>A 基础材料</td><td>-</td><td>-</td></tr> <tr> <td>B 消费品及必需品</td><td>4,944,593.13</td><td>9.69</td></tr> <tr> <td>C 消费品及服务</td><td>-</td><td>-</td></tr> <tr> <td>D 能源</td><td>1,807,327.87</td><td>3.63</td></tr> </tbody> </table>	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	A 基础材料	-	-	B 消费品及必需品	4,944,593.13	9.69	C 消费品及服务	-	-	D 能源	1,807,327.87	3.63
行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)																	
A 基础材料	-	-																	
B 消费品及必需品	4,944,593.13	9.69																	
C 消费品及服务	-	-																	
D 能源	1,807,327.87	3.63																	

[illegible]

本基金的特有风险。 本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。属于较高风险、投资回报较高的基金品种，其净值波动较大，投资者投资于本基金，须了解并承担相应的投资风险。证券市场整体走势会影响本基金的资产净值表现，本基金将全面跟踪宏观经济、股票市场走势并调整投资组合以应对市场变化。 （一）基本情况 名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”） 住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号 首次注册登记日期：1983年10月31日 注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦37楼A01单元 注册地：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号 基金信息披露网址：中国证监基金官网【http://www.csrc.gov.cn/pub/disclosure】 托管人：中信证券股份有限公司 客服电话：95588（福建省外请加拨0661）	（二）基金管理人 基金管理人：招商局仁和基金管理有限责任公司 基金管理人住所：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧招商局金融中心主楼19楼20楼 法定代表人：王卫 办公地址：深圳市福田区益田路5033号平安金融中心B座27层 联系人：陈超 联系电话：020-89626966 公司网站：www.zqcm.com.cn 33）华福证券有限责任公司 注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层 办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层 法定代表人：黄金雄 客服电话：96326（福建省外请加拨0661）	72）海富通基金管理有限公司 注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号106室-3491 办公地址：上海市浦东新区世纪大道160号16楼 法定代表人：肖坚 客服电话：021-80666666 公司网站：www.hftfund.com 73）北京工银投资管理有限公司 办公地址：北京市朝阳区东三环北路11号院1号楼11层1108 办公地址：北京市西城区中关村大街11号院11层1108 法定代表人：王伟刚	注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。 3.报告期内期末公允价值占比高且公允价值变动比例大的前五名股票投资明细表 <table border="1"> <thead> <tr> <th>序号</th><th>股票代码</th><th>股票名称</th><th>数量(股)</th><th>公允价值(元)</th><th>占基金资产净值比例(%)</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>1</td><td>00700</td><td>腾讯控股</td><td>15,300</td><td>4,493,517.47</td><td>8.99</td></tr> <tr> <td>2</td><td>00006</td><td>中兴通讯</td><td>16,800</td><td>2,329,483.13</td><td>6.88</td></tr> <tr> <td>3</td><td>00039</td><td>建设银行</td><td>516,000</td><td>3,105,730.73</td><td>6.21</td></tr> <tr> <td>4</td><td>01798</td><td>工商银行</td><td>599,000</td><td>3,104,966.09</td><td>6.03</td></tr> </tbody> </table>	序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	1	00700	腾讯控股	15,300	4,493,517.47	8.99	2	00006	中兴通讯	16,800	2,329,483.13	6.88	3	00039	建设银行	516,000	3,105,730.73	6.21	4	01798	工商银行	599,000	3,104,966.09	6.03
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)																												
1	00700	腾讯控股	15,300	4,493,517.47	8.99																												
2	00006	中兴通讯	16,800	2,329,483.13	6.88																												
3	00039	建设银行	516,000	3,105,730.73	6.21																												
4	01798	工商银行	599,000	3,104,966.09	6.03																												

2019年度财务报表附注中所有金额单位均为人民币元,自2019年1月17日起,所有大额币种数和中间值金额均已调整为人民币千元列示。财务报表数据未经审计。									
(二) 基金托管人及主要人员情况									
一、基金管理人概况									
中国银行股份有限公司成立于1988年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托、期货经验,且具有海外工作经历,学习培训时间100%以上,大部分员工具有硕士以上学位或高级职称。为支持基金管理工作的开展,中国银行股份有限公司专门成立了基金托管部,配备了充足的相关人员。									
作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、货币资产管理、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行积极开展与各家证券金融机构的广泛合作,提供专业化托管服务。									
在国内,中国银行拥有国内最大的托管资产托管规模,为各类客户提供综合化托管服务。									
基金托管人主要人员情况									
基金托管部内设资产托管部,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托、期货经验,且具有海外工作经历,学习培训时间100%以上,大部分员工具有硕士以上学位或高级职称。为支持基金管理工作的开展,中国银行股份有限公司专门成立了基金托管部,配备了充足的相关人员。									
作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、货币资产管理、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行积极开展与各家证券金融机构的广泛合作,提供专业化托管服务。									
在国内,中国银行拥有国内最大的托管资产托管规模,为各类客户提供综合化托管服务。									
基金托管人主要人员情况									
基金托管部内设资产托管部,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托、期货经验,且具有海外工作经历,学习培训时间100%以上,大部分员工具有硕士以上学位或高级职称。为支持基金管理工作的开展,中国银行股份有限公司专门成立了基金托管部,配备了充足的相关人员。									
作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、货币资产管理、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行积极开展与各家证券金融机构的广泛合作,提供专业化托管服务。									
在国内,中国银行拥有国内最大的托管资产托管规模,为各类客户提供综合化托管服务。									
基金托管人主要人员情况									
基金托管部内设资产托管部,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托、期货经验,且具有海外工作经历,学习培训时间100%以上,大部分员工具有硕士以上学位或高级职称。为支持基金管理工作的开展,中国银行股份有限公司专门成立了基金托管部,配备了充足的相关人员。									
作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、货币资产管理、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行积极开展与各家证券金融机构的广泛合作,提供专业化托管服务。									
在国内,中国银行拥有国内最大的托管资产托管规模,为各类客户提供综合化托管服务。									
基金托管人主要人员情况									
基金托管部内设资产托管部,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托、期货经验,且具有海外工作经历,学习培训时间100%以上,大部分员工具有硕士以上学位或高级职称。为支持基金管理工作的开展,中国银行股份有限公司专门成立了基金托管部,配备了充足的相关人员。									
作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、货币资产管理、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行积极开展与各家证券金融机构的广泛合作,提供专业化托管服务。									
在国内,中国银行拥有国内最大的托管资产托管规模,为各类客户提供综合化托管服务。									
基金托管人主要人员情况									
基金托管部内设资产托管部,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托、期货经验,且具有海外工作经历,学习培训时间100%以上,大部分员工具有硕士以上学位或高级职称。为支持基金管理工作的开展,中国银行股份有限公司专门成立了基金托管部,配备了充足的相关人员。									
作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、货币资产管理、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行积极开展与各家证券金融机构的广泛合作,提供专业化托管服务。									
在国内,中国银行拥有国内最大的托管资产托管规模,为各类客户提供综合化托管服务。									
基金托管人主要人员情况									
基金托管部内设资产托管部,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托、期货经验,且具有海外工作经历,学习培训时间100%以上,大部分员工具有硕士以上学位或高级职称。为支持基金管理工作的开展,中国银行股份有限公司专门成立了基金托管部,配备了充足的相关人员。									
作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、货币资产管理、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行积极开展与各家证券金融机构的广泛合作,提供专业化托管服务。									
在国内,中国银行拥有国内最大的托管资产托管规模,为各类客户提供综合化托管服务。									

010-66577513 信息披露联系人：陈静	(三) 证券投资基金托管情况 截至2018年10月30日，中国银行已托管67只证券投资基金，其中境内基金64只，QDII基金3只。托管资产规模约人民币1.4万亿元。托管产品覆盖股票、债券、货币、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化投资理财需求，基金托管合规运营无异常。	办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17楼 法定代表人：王宇飞 客服电话：400-6788-828 联系人：马海婧 网站：www.jyazcm.com	法定代理人：王延吉 客服电话：400-8281-0203 公司网址：www.52fund.com.cn 70 上海爱建财富管理销售有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街二号楼四层 401-16 办公地址：北京亦庄经济开发区科创十街18号院A座17层 法定代表人：李博 客服电话：95618400—088—8816 公司网址：http://fund.fundic.com/	5 报告期内末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 本基金本报告期末未有债券投资。 6 报告期内末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细 本基金本报告期末未有资产支持证券投资。 7 报告期内末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 本基金本报告期末未有贵金属投资。 8 报告期内末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细 本基金本报告期末未有权证投资。 9 报告期内末本基金投资的股指期货和国债期货交易情况说明 9 报告期内未本基金投资的股指期货持仓损益说明	1 基金份额发售情况 注册地址：上海市四川北路1018号南汇新城 办公地址：上海市浦东新区川沙新镇周浦社区C2幢2楼 法定代表人：魏文平 客服电话：400-388-8128
------------------------------------	---	---	--	---	---

[illegible][illegible][illegible]

创投股权投资(天津)有限公司项目组成员。现任天津泰达股权投资(集团)有限公司董事兼财务部部长,负责泰达证券股权投资、渤海财产保险股份有限公司及天津泰达投资有限公司资产管理。 办公地址:北京市西城区西便门大街101号院1号楼 法定代表人:田国田 杜文斌先生,硕士,毕业于美国韦尔斯利大学,曾任花旗银行,现为美国(证券)交易委员会亚洲区主管及资产管理师(香港)有限公司董事,掌管亚瑟及日本的投资者,专责管理安利于区内不断壮大的资产,并确保公司的投资业务符合监管规定。出现职时,杜先生曾担任东亚(香港)外的投资者事务,2001年至2002年,负责东亚集团领导下的星展资产管理(香港)及于2001年任职时,曾担任集团副行政总裁。 伦敦及美国银行资产管理及资产管理事务的多年,管理21个多数的负责市场投资。 张女士女士,拥有美国密歇根大学经济学学士,美国哥伦比亚大学工商管理硕士学位。现任中安人寿保险有限公司首席执行官和总经理。出现职前,张女士曾担任花旗中国董事长。	办公地址:北京市西城区亮马桥48号404室西商务大厦 法定代表人:田国田 联系人:田国田 公司网站:www.assecurities.com 客服电话:95648 42 西藏证券股份(香港)有限公司 注册地址:香港中環皇后大道中219号18楼10000 办公地址:陕西省西安市东大街前街319号1幢10000 法定代表人:刘建武 联系人:梁秉华 办公地址:上海市浦东新区明锐路518号A1002室 法定代表人:王翔	办公地址:天津滨海新区大港投资增信有限公司 注册地址:北京北三环西路17号303室 办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座21层2820 联系人:王翔 客服电话:400-818-8866 公司网站:www.guanchu.com 办公地址:上海市静安区长兴镇南汇区1800号2号楼615室(上海浦东新区临港自贸区) 办公地址:上海市杨浦区昆明路518号A1002室 法定代表人:王翔
---	---	---

的薪酬与绩效考核。加入公司前，陈女士在北方信托担任副总经理，负责信托业务，拥有20余年信托经验。 陈女士先生，董事，拥有美国芝加哥拉比亚大学金融学硕士学位，现任弘利资产管理（香港）有限公司亚洲区股权投资业务主管，兼任北京弘利资产管理（香港）有限公司外。加入弘利前，陈女士先生曾先后任职于鼎泰基金有限公司、财信证券资产管理（深圳）有限公司、高信（深圳）资产管理、嘉源资产管理（深圳）有限公司等。陈女士拥有证券从业资格。 刘建先生，董事。先后毕业于中国政法大学、天津财经学院，获法学学士、经济学硕士学位。1980年至2001年在中国建设银行股份有限公司金融部从事信贷工作，2001年至2003年在中国银行担任中国工商银行金城中负责人，2003年至2010年在中国工商银行担任公司业务部副经理。2010年至2014年加盟泰达基金管理公司，2015年加入弘利资产管理，2015年8月担任弘利资产管理（香港）有限公司副董事长。		9010101 招商银行股份有限公司 注册地址：深圳市福田区深南大道7088号 办公地址：深圳市福田区深南大道7088号 法定代表人：李建义 客服电话：95565 9010102 中山证券股份有限公司 注册地址：深圳市南山区科技中一路华强高新发大楼7层,8层 办公地址：深圳市福田区深南大道7088号,8层,深圳市华侨城深南大道7088号,8层 法定代表人：黄科斌 联系人：罗士琳 公司网站：www.cmbchina.com 1) 上海浦东发展银行股份有限公司 注册地址：上海市山东路一零二号 44) 江苏证券有限公司		9010103 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010104 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010105 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010106 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010107 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010108 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010109 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010110 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010111 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010112 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010113 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010114 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010115 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010116 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010117 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010118 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010119 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010120 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010121 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010122 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010123 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010124 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010125 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010126 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010127 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010128 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010129 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		9010130 泰达宏利基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层 法定代表人：王德梅 联系人：石楠 联系电话：010-66577688 传真：010-46677570		901013
---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---	--	---------------

公司基本情况 何自力先生，独立董事，1962年毕业于南开大学，经济学博士。1976至1978年，于宁夏国营农场场长；1979-1981，1982年至1985年，分别任天津轻工业学院、天津商学院教授。 曾任南开大学、历任经济系系主任、经济学院副院长，担任教授、博士生导师；兼任中国经济发展研究会副会长和秘书长、天津市经济学会会长；2002年1月至7月在泰国利福尼亚大学访问并任教为同学。 张建设先生，独立董事，二级教授，南开大学法学学士，国际经济法硕士。曾任任天津市高级人民法院法官，现任天津嘉源律师事务所主任、天津仲裁委员会仲裁员、天津市律师协会会长，担任天津市、河南省政府、北京区政府、多家银行和大银行非金融机构法律顾问。主办、承办、调解等房地产企业法律顾问，以及天津产业集群等大型企业的法律顾问职务。主要执业领域：金融						
办公地址：上海市中山北一路12号 法定代表人：韩国瑞 联系人：王佳妮 客户服务热线：056228 E-mail: www.spdcm.cn 7) 渤海银行股份有限公司 注册地址：天津市滨海新区汉沽街道218号 办公地址：天津市滨海新区河东路218号 客服电话：400-466-2288 8) 万联证券股份有限公司 注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F楼8、10层 办公地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F楼8、10层 法定代表人：张建军 联系人：王宏						
注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路66号 办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路66号 联系人：王佳妮 名称：上海市通力律师事务所 住所：上海市浦东新区世纪大道100号时代金融中心19楼 办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼 负责人：俞卫锋 电话：021-31358666 传真：021-31358600 经办律师：黎明、陈颖华 联系人：陈颖华 国、境会计师事务所的合并财务报表 出具名称：信永中和会计师事务所(特殊普通合伙)						
2019.9.30	泰达利源担保投资C					
阶段	份额占比(%)	初始净利率	业绩比较基准收益率	实际收益率	①-③	②-④
2017.5/17-基金合同生效日：2017.12.21	19.13%	0.85%	11.17%	0.74%	7.96%	0.11%
2018.11-2019.9.30	-6.42%	1.47%	-2.04%	1.17%	-3.38%	0.303%

卡-西拉·西蒙先生，独立董事，拥有莫斯科高等商学院（北德）工商管理学士学位，金融国际分析学院商务分析学位，芝加哥大学工商管理硕士学位等学位。曾任欧洲联合银行（巴黎）组合经理助理、组合经理，Credit Lyonnais International Asset Management 投资组合经理，高级分析师等职。Comgest 资产管理公司（巴黎）基金经理人。Yutai Ltd 负责人。 楼晓波先生，独立董事，拥有美国西北大学经济学学士学位，美国西北大学凯洛格管理学院管理学硕士，美国西北大学凯洛格管理学院金融学博士学位。曾担任联邦储备系统管理委员会金融顾问，芝加哥商品交易所商品金融经济师。Daniel Knapp & Associates 合伙人，新兴市场，大宗商品和商品管理公司（波士顿）董事，Commodity（商品）基金经理人。 执行行政官/执行董事，德国商业银行（美国）资产管理部（董事）总经理。现任上海交通大学金融资产	公司网站：www.ctab.com.cn 客服电话：0431-888-8123 注册地址：宁波市江北区中山东路294号 办公地址：宁波市江北区中山东路294号 法定代表人：王洪涛 联系人：徐晓芳 客服电话：06548 公司网站：www.shiboh.com.cn 上海银行股份有限公司（SHIBOH）（上海）基金经理人 注册地址：上海市浦东新区银城中路168号	2017/5/1 基金合同生效日至2018/3/31 12.67% 1.21% 8.90% 0.09% 3.77% 0.22%	注：5. 基金的投资业绩比较基准：恒生指数收益率×经人民币汇率调整×95%+人民币国债利率×5%。 （二）基金自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图（2017年5月17日至2018年3月31日） 四、基金名称 泰达红利精选优选股票型证券投资基金 五、基金类型
--	--	--	--

办地址:上海市浦东新区福山路168号 2. 监事会议决 许宁先生, 管理学硕士, 毕业于南开大学, 经济学硕士, 1991年至2008年任职于天津市劳动和社会保障局; 2008年加入天津市泰达国际控股(集团)有限公司, 担任党委书记、董事会秘书、综合办公室主任。	注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号57层 法定代表人: 金煜 联系人: 高磊 客服电话: 95594 网址: www.bankofshanghai.com 10 包商银行股份有限公司 客服电话: 400-626-9586	办地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号57层 联系人: 高磊 联系人: 刘阳川 公司网址: www.cmbstock.com 客服电话: 400-626-9586 8 西南证券股份有限公司 办地址: 重庆市江北桥北路2号 法定代表人: 李钢 联系人: 张建雄	1. 基金运作方式 契约型开放式 2. 基金的投资目标 股票型基金 3. 基金存续期限 不定期。 六、基金的投资目标 在严格控制风险的前提下, 把握宏观经济后周期带来的政策带来的机会, 挖掘超跌及A股市场的优质公司, 力争为投资者获取超越业绩比较基准的超额收益。 七、基金的投资方向	
--	---	---	---	---

李强先生, 博士, 历任麦肯锡管理咨询公司、普华永道会计师事务所, 2010年1月加入泰达宏利资产管理公司, 历任资产管理部副经理、主管, 目前担任工作。 3. 高级管理人员 马晓旭女士, 董事长, 简历同上。 刘建先生, 总经理, 简历同上。 曹建先生, 副总经理, 毕业于南开大学和美国威斯康星大学, 获文学士和工商管理硕士学位, 北京大学国家发展研究院EMBA。1993年至2006年就职于中国国际信托投资公司, 从事信托业务管理工作, 期间曾任办公室主任、研发部经理、信托业务部总经理、董事会秘书, 以及公司副经理。2006年9月起泰达宏利资产管理公司财务总监。2007年1月起担任公司总经理兼首席投资官。 王彦先生, 副总经理, 毕业于台湾中山大学和浙江大学, 获企业管理学士和财务金融硕士学位。	11) 鹏华证券投资基金有限公司 注册地址: 湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11层 办公地址: 湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11层 法定代表人: 孙洪林 客服电话: 40081-0888 联系人: 李欣 公司网站: www.xhsx.com 12) 渤海证券股份有限公司 注册地址: 天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室 办公地址: 天津市南开区复东门外大街20号 5) 中信期货有限公司 联系人: 张璐 公司网站: www.citics.com 4) 上海华信证券有限责任公司 注册地址: 上海浦东新区世纪大道10号环贸金融中心9楼 办公地址: 上海浦东新区世纪大道10号环贸金融中心9楼 客服电话: 40082-2888 法定代表人: 郭林 客服电话: 4008-226-999 联系人: 李琳 公司网站: www.shhxzq.com	本基金的托管机构为具有良好资质的金融工具, 包括国内与香港股票市场交易互联互通机制“沪港通”的香港联合交易所上市股票(以下简称“港股通标的股票”)、国内依法发行上市的标准股票(包括创业板股票和科创板股票)、中小企业私募债券、公司债券、可转换债券、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具, 因投资港股通标的股票而产生的投资, 本基金将根据其具体情况做出投资决策。 本若法律法规或监管机构对基金通过港股通机制购买港股通标的股票的投资范围、香港联合交易所上市除股票以外的其他品种、本基金可参与港股通可投资品种及其他品种的标准, 其具体投资比例按照法律法规的有关规定和基金合同约定执行。 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, 可以将本基金投资范围。
---	---	--

自1990年8月加入华安，先后在國際證券、日商大和證券、元大投信担任分析師、2001年5月至2002年4月，任德信投信基金投資委員，2008年2月至2006年4月，調任于華安分析師，2006年4月至2008年1月，任德信投信基金投資委員，2008年1月至2010年1月，調任華安分析師，2010年1月至2015年10月，任華安基金投資委員，2015年10月加入嘉泰達利基金管理有限公司担任投資委員，2015年12月起任泰達利基金管理有限公司副總經理兼投資委員。 劉明輝女士，副總經理，毕业于河內大學，經濟學學士學位，2002年8月至2011年7月就讀于中國人民大學，任中國人民大學經濟學院2011級金融學碩士班導師，2011年12月起任中國人民大學經濟學院2011級金融學碩士班導師兼中國人民大學經濟學院金融學系副主任，2013年9月至2015年4月任泰達利基金管理有限公司公募專業市場部市場總監，2015年4月加入嘉泰達利基金管理有限公司，2015年8月至2018年7月任嘉泰達利基金有限公司副總經理，2018年8月加入泰達利基金管理有限公司，2018年8月起任泰達利基金管理有限公司	法定代表人：王維峰 經理人：蔡慶 辦公地址：上海市虹口區四川北路360號 電話：400-651-5989 網址：www.bhzq.com 13中國銀河證券股份有限公司 辦公地址：北京市西城區金融大街35號26-62 辦公地址：北京市西城區金融大街35號26-62 電話：400-800-8828 網址：www.chinastock.com 辦公地址：上海市上海路128號 辦公地址：上海市浦东新区龍陽路688號818樓 法定代表人：王維峰 經理人：蔡慶	基金的投资组合情况：本基金股票资产占基金资产的比例不低于80%（其中投资于沪港深三地股票资产占基金资产的比例70%-95%，投资于港股通标的股票资产占基金资产的比例为80%-95%）；基金合同到期日在一年以内的固定收益类资产占基金资产净值的0%。 八、基金的投资策略 一、基金投资的种类 1. 基金资产的配置； 2. 基金资产的配置； 3. 基金资产的配置； 4. 基金资产的配置； 5. 基金资产的配置； 6. 基金资产的配置； 7. 基金资产的配置； 8. 基金资产的配置； 9. 基金资产的配置； 10. 基金资产的配置； 11. 基金资产的配置； 12. 基金资产的配置； 13. 基金资产的配置； 14. 基金资产的配置； 15. 基金资产的配置； 16. 基金资产的配置； 17. 基金资产的配置； 18. 基金资产的配置； 19. 基金资产的配置； 20. 基金资产的配置； 21. 基金资产的配置； 22. 基金资产的配置； 23. 基金资产的配置； 24. 基金资产的配置； 25. 基金资产的配置； 26. 基金资产的配置； 27. 基金资产的配置； 28. 基金资产的配置； 29. 基金资产的配置； 30. 基金资产的配置； 31. 基金资产的配置； 32. 基金资产的配置； 33. 基金资产的配置； 34. 基金资产的配置； 35. 基金资产的配置； 36. 基金资产的配置； 37. 基金资产的配置； 38. 基金资产的配置； 39. 基金资产的配置； 40. 基金资产的配置； 41. 基金资产的配置； 42. 基金资产的配置； 43. 基金资产的配置； 44. 基金资产的配置； 45. 基金资产的配置； 46. 基金资产的配置； 47. 基金资产的配置； 48. 基金资产的配置； 49. 基金资产的配置； 50. 基金资产的配置； 51. 基金资产的配置； 52. 基金资产的配置； 53. 基金资产的配置； 54. 基金资产的配置； 55. 基金资产的配置； 56. 基金资产的配置； 57. 基金资产的配置； 58. 基金资产的配置； 59. 基金资产的配置； 60. 基金资产的配置； 61. 基金资产的配置； 62. 基金资产的配置； 63. 基金资产的配置； 64. 基金资产的配置； 65. 基金资产的配置； 66. 基金资产的配置； 67. 基金资产的配置； 68. 基金资产的配置； 69. 基金资产的配置； 70. 基金资产的配置； 71. 基金资产的配置； 72. 基金资产的配置； 73. 基金资产的配置； 74. 基金资产的配置； 75. 基金资产的配置； 76. 基金资产的配置； 77. 基金资产的配置； 78. 基金资产的配置； 79. 基金资产的配置； 80. 基金资产的配置； 81. 基金资产的配置； 82. 基金资产的配置； 83. 基金资产的配置； 84. 基金资产的配置； 85. 基金资产的配置； 86. 基金资产的配置； 87. 基金资产的配置； 88. 基金资产的配置； 89. 基金资产的配置； 90. 基金资产的配置； 91. 基金资产的配置； 92. 基金资产的配置； 93. 基金资产的配置； 94. 基金资产的配置； 95. 基金资产的配置； 96. 基金资产的配置； 97. 基金资产的配置； 98. 基金资产的配置； 99. 基金资产的配置； 100. 基金资产的配置； 101. 基金资产的配置； 102. 基金资产的配置； 103. 基金资产的配置； 104. 基金资产的配置； 105. 基金资产的配置； 106. 基金资产的配置； 107. 基金资产的配置； 108. 基金资产的配置； 109. 基金资产的配置； 110. 基金资产的配置； 111. 基金资产的配置； 112. 基金资产的配置； 113. 基金资产的配置； 114. 基金资产的配置； 115. 基金资产的配置； 116. 基金资产的配置； 117. 基金资产的配置； 118. 基金资产的配置； 119. 基金资产的配置； 120. 基金资产的配置； 121. 基金资产的配置； 122. 基金资产的配置； 123. 基金资产的配置； 124. 基金资产的配置； 125. 基金资产的配置； 126. 基金资产的配置； 127. 基金资产的配置； 128. 基金资产的配置； 129. 基金资产的配置； 130. 基金资产的配置； 131. 基金资产的配置； 132. 基金资产的配置； 133. 基金资产的配置； 134. 基金资产的配置； 135. 基金资产的配置； 136. 基金资产的配置； 137. 基金资产的配置； 138. 基金资产的配置； 139. 基金资产的配置； 140. 基金资产的配置； 141. 基金资产的配置； 142. 基金资产的配置； 143. 基金资产的配置； 144. 基金资产的配置； 145. 基金资产的配置； 146. 基金资产的配置； 147. 基金资产的配置； 148. 基金资产的配置； 149. 基金资产的配置； 150. 基金资产的配置； 151. 基金资产的配置； 152. 基金资产的配置； 153. 基金资产的配置； 154. 基金资产的配置； 155. 基金资产的配置； 156. 基金资产的配置； 157. 基金资产的配置； 158. 基金资产的配置； 159. 基金资产的配置； 160. 基金资产的配置； 161. 基金资产的配置； 162. 基金资产的配置； 163. 基金资产的配置； 164. 基金资产的配置； 165. 基金资产的配置； 166. 基金资产的配置； 167. 基金资产的配置； 168. 基金资产的配置； 169. 基金资产的配置； 170. 基金资产的配置； 171. 基金资产的配置； 172. 基金资产的配置； 173. 基金资产的配置； 174. 基金资产的配置； 175. 基金资产的配置； 176. 基金资产的配置； 177. 基金资产的配置； 178. 基金资产的配置； 179. 基金资产的配置； 180. 基金资产的配置； 181. 基金资产的配置； 182. 基金资产的配置； 183. 基金资产的配置； 184. 基金资产的配置； 185. 基金资产的配置； 186. 基金资产的配置； 187. 基金资产的配置； 188. 基金资产的配置； 189. 基金资产的配置； 190. 基金资产的配置； 191. 基金资产的配置； 192. 基金资产的配置； 193. 基金资产的配置； 194. 基金资产的配置； 195. 基金资产的配置； 196. 基金资产的配置； 197. 基金资产的配置； 198. 基金资产的配置； 199. 基金资产的配置； 200. 基金资产的配置； 201. 基金资产的配置； 202. 基金资产的配置； 203. 基金资产的配置； 204. 基金资产的配置； 205. 基金资产的配置； 206. 基金资产的配置； 207. 基金资产的配置； 208. 基金资产的配置； 209. 基金资产的配置； 210. 基金资产的配置； 211. 基金资产的配置； 212. 基金资产的配置； 213. 基金资产的配置； 214. 基金资产的配置； 215. 基金资产的配置； 216. 基金资产的配置； 217. 基金资产的配置； 218. 基金资产的配置； 219. 基金资产的配置； 220. 基金资产的配置； 221. 基金资产的配置； 222. 基金资产的配置； 223. 基金资产的配置； 224. 基金资产的配置； 225. 基金资产的配置； 226. 基金资产的配置； 227
---	--	---

[illegible]

有限公司，担任泰信新兴市场高成长股票证券投资基金、2016年2月担任泰达宏利基金管理有限公司国际业务部担任基金经理，自2016年10月14日起至今担任泰达宏利国际优势证券投资基金基金经理。自2017年12月17日至今担任泰达宏利稳健回报混合型证券投资基金基金经理，具有10年以上证券投资经验，具有基金从业资格。 傅晓斌先生，新加坡南洋理工大学管理学硕士，2010年9月至2017年8月任职于新加坡投资及资本市场下的独立业务，并于2016年7月至2015年6月担任新嘉坡金融交易局经理，负责领导全球各个主要资产类别的独立业务。自2015年6月起，担任新加坡政府投资公司（GIC）一级市场投资和全球大资产的资产配置管理职务。自2017年8月开始加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于国际业务部，先后担任基金助理助理、基金经理。自2017年12月26日起至今担任泰达宏利稳健回报混合型证券投资基金基金经理，具有8年以上证券投资管理经验，具有基金从业资格。	法定代表人：王常南 客服电话：(86) 400-888-1088 联系人：刘忠 公司网站：www.fund123.cn 54 杭州（中国）金丰银行股份有限公司 注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路121号1楼202室 办公地址：杭州市西湖区天目山路288号黄龙时代广场B座六楼支付中心八层 主要经营范围：人民币存款、贷款、银行卡、理财等。 客服电话：400-076-6123 公司网站：http://www.fun123.cn/ 55 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195号3号楼9楼 客服电话：95521 联系人：尹倩颖	法定代表人：杨文元 公司网站：www.wyway.com 客服电话：400-700-8685 56 杭州（中国）金丰银行股份有限公司 注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路121号1楼202室 办公地址：杭州市西湖区天目山路288号黄龙时代广场B座六楼支付中心八层 主要经营范围：人民币存款、贷款、银行卡、理财等。 客服电话：400-076-6123 公司网站：http://www.fun123.cn/ 55 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195号3号楼9楼 客服电话：95521 联系人：尹倩颖	本基金从定量及定性两方面对上市的证券进行分析筛选，并经过估值模型来挑选出具备持续增长确定性高及成长性潜力、且被低估的优质上市公司进行重点投资。 ①定义标准 本基金在选择个股时充分利用上市公司的财务数据和市场数据，从上市公司的盈利能力、成长性、运营能力、负债水平等多个方面进行量化测算。本基金运用的量化指标主要包括以下几类： - H+R > 0.2% + 当年天数 - H为每日以权益计的基金持仓收益 - R为前一日的基金净值 基金仓位调整后计算，该算法计算每月月末、按付支持，经基金管理人及基金托管人协商一致后，由基金托管人于次月首日起个工作日内从基金账户中一次性支付给基金基金管理人。若遇法定节假日、公休等，支付日期顺延。
--	--	---	--

[illegible]

1、依据募集资金、办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；	法定代表人：潘威 联系电话：400-820-8208-2999	本基金将在未来研究国内外宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，分析和判断利率走势与收益类金融资产变化趋势，综合考量各类投资品种的风险性、流动性及风险特征，对基金资产组合进行科学配置。	树友衡南管理有限公 司（以下简称“树友衡南”）根据《基金合同》及相关法律法规和相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。	
2、办理本基金备案事宜；	客服电话：0563-6583817 公司网址：www.eitcfund.com	(1)利率预期策略 本基金将首先采用“自上而下”的研究方法，综合研究主要经济变量指标，分析宏观经济情况，建立宏观经济、通货膨胀、利率、货币市场和债券市场分析的基础上，结合历史经验数据，确定当前资产的时间价值、通货膨胀、利率、货币市场等参数，得到当前宏观与流动性条件下均均衡收益率曲线。区分当前利率曲线是向上倾斜型、曲线平坦型或向下倾斜型，并分析利率曲线未来可能的变化趋势。区分当前利率曲线与均衡收益率曲线的对比，判断收益率曲线未来变化的程度和方向，并据此调整资产配置组合。	下列费用不列入基金费用 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；	4、基金管理人及基金托管人履行与基金运作有关的诉讼事项发生的费用；
3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；	联系人：胡娟娟 联系电话：www.wtjzq.com.cn	本基金管理人研究国内外宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，分析和判断利率走势与收益类金融资产变化趋势，综合考量各类投资品种的风险性、流动性及风险特征，对基金资产组合进行科学配置。	5、基金管理人及基金托管人履行与基金运作有关的诉讼事项发生的费用；	6、基金管理人及基金托管人履行与基金运作有关的诉讼事项发生的费用；
4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；	19世纪世纪资产管理有限公司 地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42层	本基金将首先采用“自上而下”的研究方法，综合研究主要经济变量指标，分析宏观经济情况，建立宏观经济、通货膨胀、利率、货币市场和债券市场分析的基础上，结合历史经验数据，确定当前资产的时间价值、通货膨胀、利率、货币市场等参数，得到当前宏观与流动性条件下均均衡收益率曲线。区分当前利率曲线是向上倾斜型、曲线平坦型或向下倾斜型，并分析利率曲线未来可能的变化趋势。区分当前利率曲线与均衡收益率曲线的对比，判断收益率曲线未来变化的程度和方向，并据此调整资产配置组合。	7、基金管理人及基金托管人履行与基金运作有关的诉讼事项发生的费用；	8、基金管理人及基金托管人履行与基金运作有关的诉讼事项发生的费用；
5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；	地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42层	本基金将首先采用“自上而下”的研究方法，综合研究主要经济变量指标，分析宏观经济情况，建立宏观经济、通货膨胀、利率、货币市场和债券市场分析的基础上，结合历史经验数据，确定当前资产的时间价值、通货膨胀、利率、货币市场等参数，得到当前宏观与流动性条件下均均衡收益率曲线。区分当前利率曲线是向上倾斜型、曲线平坦型或向下倾斜型，并分析利率曲线未来可能的变化趋势。区分当前利率曲线与均衡收益率曲线的对比，判断收益率曲线未来变化的程度和方向，并据此调整资产配置组合。	9、基金管理人及基金托管人履行与基金运作有关的诉讼事项发生的费用；	9、基金管理人及基金托管人履行与基金运作有关的诉讼事项发生的费用；
6、编制基金中期报告和年度报告；	办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42层	本基金将首先采用“自上而下”的研究方法，综合研究主要经济变量指标，分析宏观经济情况，建立宏观经济、通货膨胀、利率、货币市场和债券市场分析的基础上，结合历史经验数据，确定当前资产的时间价值、通货膨胀、利率、货币市场等参数，得到当前宏观与流动性条件下均均衡收益率曲线。区分当前利率曲线是向上倾斜型、曲线平坦型或向下倾斜型，并分析利率曲线未来可能的变化趋势。区分当前利率曲线与均衡收益率曲线的对比，判断收益率曲线未来变化的程度和方向，并据此调整资产配置组合。	10、基金管理人及基金托管人履行与基金运作有关的诉讼事项发生的费用；	10、基金管理人及基金托管人履行与基金运作有关的诉讼事项发生的费用；
7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；	办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42层	本基金将首先采用“自上而下”的研究方法，综合研究主要经济变量指标，分析宏观经济情况，建立宏观经济、通货膨胀、利率、货币市场和债券市场分析的基础上，结合历史经验数据，确定当前资产的时间价值、通货膨胀、利率、货币市场等参数，得到当前宏观与流动性条件下均均衡收益率曲线。区分当前利率曲线是向上倾斜型、曲线平坦型或向下倾斜型，并分析利率曲线未来可能的变化趋势。区分当前利率曲线与均衡收益率曲线的对比，判断收益率曲线未来变化的程度和方向，并据此调整资产配置组合。	11、基金管理人及基金托管人履行与基金运作有关的诉讼事项发生的费用；	11、基金管理人及基金托管人履行与基金运作有关的诉讼事项发生的费用；
8、受理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；	法定代表人：姜琳琳 联系人：王雯	本基金将首先采用“自上而下”的研究方法，综合研究主要经济变量指标，分析宏观经济情况，建立宏观经济、通货膨胀、利率、货币市场和债券市场分析的基础上，结合历史经验数据，确定当前资产的时间价值、通货膨胀、利率、货币市场等参数，得到当前宏观与流动性条件下均均衡收益率曲线。区分当前利率曲线是向上倾斜型、曲线平坦型或向下倾斜型，并分析利率曲线未来可能的变化趋势。区分当前利率曲线与均衡收益率曲线的对比，判断收益率曲线未来变化的程度和方向，并据此调整资产配置组合。	12、基金管理人及基金托管人履行与基金运作有关的诉讼事项发生的费用；	12、基金管理人及基金托管人履行与基金运作有关的诉讼事项发生的费用；
9、按照规定召集基金份额持有人大会；	客服电话：021-20365817 传真号码：021-20365888	本基金将首先采用“自上而下”的研究方法，综合研究主要经济变量指标，分析宏观经济情况，建立宏观经济、通货膨胀、利率、货币市场和债券市场分析的基础上，结合历史经验数据，确定当前资产的时间价值、通货膨胀、利率、货币市场等参数，得到当前宏观与流动性条件下均均衡收益率曲线。区分当前利率曲线是向上倾斜型、曲线平坦型或向下倾斜型，并分析利率曲线未来可能的变化趋势。区分当前利率曲线与均衡收益率曲线的对比，判断收益率曲线未来变化的程度和方向，并据此调整资产配置组合。	13、基金管理人及基金托管人履行与基金运作有关的诉讼事项发生的费用；	13、基金管理人及基金托管人履行与基金运作有关的诉讼事项发生的费用；

1. 以基金管理人名义、代表基金持有人利益进行诉讼、仲裁或行使其他法律法规行为；	公司网站: www.cscso.com.cn 21) 申万宏源基金销售有限公司 网站地址: shirichao.hxsfund.com
2. 有法律法规、行政法规和中国证监会规定的其它其他职责。	58) 北京展恒基金销售有限公司 网站地址: www.zhenhongen.com
3. 基金管理人承诺不以从事违反《中华人民共和国证券法》(以下简称“《证券法》”)的行为, 并承诺建立健全内部控制制度, 采取有效措施, 防止违反《证券法》行为的发生。	注册地址: 上海市浦东新区长浜路989号46层 办公地址: 北京市朝阳区东三环北路38号安联大厦15-16层中国电通大厦二二二层 法定代表人: 闫俊豪 联系人: 王瑞娟 客服电话: 0662-6260-0880-6661
4. 基金管理人承诺不以从事违反《基金法》的行为, 并承诺建立健全内部控制和风险管理制度, 采取有效措施, 防止以下行为的发生:	公司网站: www.myfund.com 5) 浙江浙商证券资产管理有限公司 网站地址: www.zjzq.com.cn
1) 承销和从事与承销业务有利益冲突的业务;	21) 申万宏源证券有限公司 网站地址: www.swhysc.com
2) 不得以不正当手段为其管理的不同基金资产;	注册地址: 浙江省杭州市文二西路1号1901室 办公地址: 浙江省杭州市余杭区五福街道康乐路1918号同恒大楼4层
3) 承销证券;	

[illegible]

(6) 如应遵守、运用期权, 不按照相关规定履行职务;	网站: www.zwtzcm.com	办公地址: 上海市中山南路100号金外滩国际广场10楼	制衡关系: 本基金的投资运作独立, 能够避免本基金与任何个人或机构因利益冲突而从事任何可能损害基金份额持有人利益的行为。	风险提示: 本基金投资于科创板股票, 科创板股票具有研发投入高、经营风险大、业绩不稳定、退市风险高等特点, 投资者需谨慎投资, 在投资科创板股票前应详细阅读《基金合同》等有关科创板投资的披露文件, 并充分考虑自身的风险承受能力, 谨慎做出投资决策。
(7) 遵守法律法规的规定, 披露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密, 尚未依法公开的基金投资运作、基金投资计划等信息, 或泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事证券交易;	23上海证券资产管理有限公司 注册地址: 南京市江东东路228号 办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴东路1333号14楼9单元	法定代表人: 冯鹤斌 客服电话: 400-820-2819 公司网站: www.shzq.com	制衡关系: 本基金的投资运作独立, 能够避免本基金与任何个人或机构因利益冲突而从事任何可能损害基金份额持有人利益的行为。	风险提示: 本基金投资于科创板股票, 科创板股票具有研发投入高、经营风险大、业绩不稳定、退市风险高等特点, 投资者需谨慎投资, 在投资科创板股票前应详细阅读《基金合同》等有关科创板投资的披露文件, 并充分考虑自身的风险承受能力, 谨慎做出投资决策。
(8) 按被公司书面指定履行计划职责, 直接或间接从事其他股权投资;	24上海陆金所基金销售有限公司 注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元	法定代表人: 王之光 客服电话: 95597 客户统一服务热线: 95597	制衡关系: 本基金的投资运作独立, 能够避免本基金与任何个人或机构因利益冲突而从事任何可能损害基金份额持有人利益的行为。	风险提示: 本基金投资于科创板股票, 科创板股票具有研发投入高、经营风险大、业绩不稳定、退市风险高等特点, 投资者需谨慎投资, 在投资科创板股票前应详细阅读《基金合同》等有关科创板投资的披露文件, 并充分考虑自身的风险承受能力, 谨慎做出投资决策。
(9) 协助、接受委托或以任何其他形式为其他组织或个人进行证券投资;	25申万宏源证券有限公司 注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼	法定代表人: 李伟 客服电话: 400-820-2819 公司网站: www.swhysc.com	制衡关系: 本基金的投资运作独立, 能够避免本基金与任何个人或机构因利益冲突而从事任何可能损害基金份额持有人利益的行为。	风险提示: 本基金投资于科创板股票, 科创板股票具有研发投入高、经营风险大、业绩不稳定、退市风险高等特点, 投资者需谨慎投资, 在投资科创板股票前应详细阅读《基金合同》等有关科创板投资的披露文件, 并充分考虑自身的风险承受能力, 谨慎做出投资决策。
(10) 遵守证券交易所业务规则, 利用对敲、对倒、盘中等手段操纵市场价格, 扰乱市场秩序;	26申万宏源证券有限公司 注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼	法定代表人: 李伟 客服电话: 400-820-2819 公司网站: www.swhysc.com	制衡关系: 本基金的投资运作独立, 能够避免本基金与任何个人或机构因利益冲突而从事任何可能损害基金份额持有人利益的行为。	风险提示: 本基金投资于科创板股票, 科创板股票具有研发投入高、经营风险大、业绩不稳定、退市风险高等特点, 投资者需谨慎投资, 在投资科创板股票前应详细阅读《基金合同》等有关科创板投资的披露文件, 并充分考虑自身的风险承受能力, 谨慎做出投资决策。
(11) 按照合同约定, 以擅自自己;	27申万宏源证券有限公司 注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼	法定代表人: 李伟 客服电话: 400-820-2819 公司网站: www.swhysc.com	制衡关系: 本基金的投资运作独立, 能够避免本基金与任何个人或机构因利益冲突而从事任何可能损害基金份额持有人利益的行为。	风险提示: 本基金投资于科创板股票, 科创板股票具有研发投入高、经营风险大、业绩不稳定、退市风险高等特点, 投资者需谨慎投资, 在投资科创板股票前应详细阅读《基金合同》等有关科创板投资的披露文件, 并充分考虑自身的风险承受能力, 谨慎做出投资决策。
(12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假记载、误导性陈述;	28申万宏源证券有限公司 注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼	法定代表人: 李伟 客服电话: 400-820-2819 公司网站: www.swhysc.com	制衡关系: 本基金的投资运作独立, 能够避免本基金与任何个人或机构因利益冲突而从事任何可能损害基金份额持有人利益的行为。	风险提示: 本基金投资于科创板股票, 科创板股票具有研发投入高、经营风险大、业绩不稳定、退市风险高等特点, 投资者需谨慎投资, 在投资科创板股票前应详细阅读《基金合同》等有关科创板投资的披露文件, 并充分考虑自身的风险承受能力, 谨慎做出投资决策。

(1) 以不正当手段谋求业务优势;	办公地址:上海市浦东新区由由路1130号	63) 大智基金金石资产管理(上海)有限公司	十一、基金投资组合报告(未经审计)	4 中信建投证券股份有限公司 www.cs108.com 06						
(14) 持社会公益、慈善事业证券投资基金形象;	办公地址:上海市浦东新区李春春街	63) 大智基金金石资产管理(上海)有限公司	1. 重要提示	5 兴业证券股份有限公司 www.xyzt.com.cn 9562						
(15) 其他法律法规及中国证监会禁止的行为。	办公地址:上海市浦东新区李春春街	63) 大智基金金石资产管理(上海)有限公司	基金管理人或董事承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对内容的真实性、准确性承担个别及连带法律责任。	6 国都证券股份有限公司 www.guodun.com 400-818-8118						
5、基金风险提示	客户服务电话:063600 网	63) 大智基金金石资产管理(上海)有限公司	本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年11月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。	7 国金证券股份有限公司 www.guojin.com 96310						
(1) 依照有关法律法规和基金合同的规定,本着勤勉谨慎的原则将基金份额持有人利益最大化;	办公地址:上海市浦东新区李春春街	63) 大智基金金石资产管理(上海)有限公司	本投资组合报告所载数据截至2018年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。	8 平安证券股份有限公司 stock.pingan.com 96511-8						
(2) 不得利用职务之便为自己、他人或任何第三人谋取利益;	办公地址:上海市静安区新闻路150号	63) 大智基金金石资产管理(上海)有限公司	1. 报告期末基金资产组合情况	9 万联证券股份有限公司 www.wljz.com 400-889-8133						
(3) 不得利用期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息利用该信息从事或明示、暗示他人从事相关的交易活动;	办公地址:上海市静安区新闻路150号	63) 大智基金金石资产管理(上海)有限公司	<table border="1"> <thead> <tr> <th>代码</th><th>名称</th><th>占基金总资产</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>05670</td><td>05670</td><td></td></tr> </tbody> </table>	代码	名称	占基金总资产	05670	05670		10 长城证券股份有限公司 www.cgws.com 0755-3360000
代码	名称	占基金总资产								
05670	05670									
(4) 不得以任何形式为其他组织或个人进行证券投资。	办公地址:上海市静安区新闻路150号	63) 大智基金金石资产管理(上海)有限公司		400-6666-888						

1.内部控制的原则		2.内部控制的目标		3.内部控制的范围		4.内部控制的要素		5.内部控制的缺陷		6.内部控制的改进		7.内部控制的监督		8.内部控制的报告		9.内部控制的披露		10.内部控制的培训		11.内部控制的考核		12.内部控制的激励		13.内部控制的问责		14.内部控制的持续改进		15.内部控制的总结		16.内部控制的归档		17.内部控制的更新		18.内部控制的废止		19.内部控制的修订		20.内部控制的废止		21.内部控制的修订		22.内部控制的废止		23.内部控制的修订		24.内部控制的废止		25.内部控制的修订		26.内部控制的废止		27.内部控制的修订		28.内部控制的废止		29.内部控制的修订		30.内部控制的废止		31.内部控制的修订		32.内部控制的废止		33.内部控制的修订		34.内部控制的废止		35.内部控制的修订		36.内部控制的废止		37.内部控制的修订		38.内部控制的废止		39.内部控制的修订		40.内部控制的废止		41.内部控制的修订		42.内部控制的废止		43.内部控制的修订		44.内部控制的废止		45.内部控制的修订		46.内部控制的废止		47.内部控制的修订		48.内部控制的废止		49.内部控制的修订		50.内部控制的废止		51.内部控制的修订		52.内部控制的废止		53.内部控制的修订		54.内部控制的废止		55.内部控制的修订		56.内部控制的废止		57.内部控制的修订		58.内部控制的废止		59.内部控制的修订		60.内部控制的废止		61.内部控制的修订		62.内部控制的废止		63.内部控制的修订		64.内部控制的废止		65.内部控制的修订		66.内部控制的废止		67.内部控制的修订		68.内部控制的废止		69.内部控制的修订		70.内部控制的废止		71.内部控制的修订		72.内部控制的废止		73.内部控制的修订		74.内部控制的废止		75.内部控制的修订		76.内部控制的废止		77.内部控制的修订		78.内部控制的废止		79.内部控制的修订		80.内部控制的废止		81.内部控制的修订		82.内部控制的废止		83.内部控制的修订		84.内部控制的废止		85.内部控制的修订		86.内部控制的废止		87.内部控制的修订		88.内部控制的废止		89.内部控制的修订		90.内部控制的废止		91.内部控制的修订		92.内部控制的废止		93.内部控制的修订		94.内部控制的废止		95.内部控制的修订		96.内部控制的废止		97.内部控制的修订		98.内部控制的废止		99.内部控制的修订		100.内部控制的废止		101.内部控制的修订		102.内部控制的废止		103.内部控制的修订		104.内部控制的废止		105.内部控制的修订		106.内部控制的废止		107.内部控制的修订		108.内部控制的废止		109.内部控制的修订		110.内部控制的废止		111.内部控制的修订		112.内部控制的废止		113.内部控制的修订		114.内部控制的废止		115.内部控制的修订		116.内部控制的废止		117.内部控制的修订		118.内部控制的废止		119.内部控制的修订		120.内部控制的废止		121.内部控制的修订		122.内部控制的废止		123.内部控制的修订		124.内部控制的废止		125.内部控制的修订		126.内部控制的废止		127.内部控制的修订		128.内部控制的废止		129.内部控制的修订		130.内部控制的废止		131.内部控制的修订		132.内部控制的废止		133.内部控制的修订		134.内部控制的废止		135.内部控制的修订		136.内部控制的废止		137.内部控制的修订		138.内部控制的废止		139.内部控制的修订	
-----------	--	-----------	--	-----------	--	-----------	--	-----------	--	-----------	--	-----------	--	-----------	--	-----------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	--------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--	-------------	--

公司的内部控制体系包括一个内部控制环境,相互牵制的组织结构,由最高管理层对内部控制制度的执行,各个部门和岗位的职责和权限,监督稽核和内部控制,监督稽核和内部控制公司的风险管理制度的执行。其基本内容,包括如下内容:		法定代理人:高斌 联系电话:400-046-6788 办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦36-46层 法定代表人:高斌 联系人:程静 网站: http://www.86money.com		5	金融衍生品投资	-	-	19	华信证券有限责任公司	www.hxsec.com	96328
(1) 董事会:负责制定公司的内部控制政策,对内部控制制度完备性和监督的有效性;		67) 北京康景金销售有限公司 办公地址:北京市昌平区阜康大街1号6号楼2单元21层22207 28 世纪证券有限责任公司 办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16、17层 法定代理人:李树斌 客服电话:4000-618-518 网站: www.21cf.com		其中:约定式回购的买入 资产估值金额 其中:约定式回购的买入 资产估值金额 其中:约定式回购的买入 资产估值金额		注:基金不存贷 自2019年1月3日起至发行募集结束之日止,投资者可通过上述销售机构办理本基金开户和认购业务。鉴于本基金尚在发行募集期间,本基金公司的认购、赎回等业务的办理时间将依据本基金的基金合同,按照申购的有关规定并公开本公司当日申购为限,敬请投资者注意。 投资者了解上述基金估值和估值调整,请仔细阅读本基金的基金合同、或就估值调整公告等相关文件,也可致电本公司客户服务电话:400-696-8888、010-65553322,或登陆本公司网站 www.mfchina.com 查询。		风险提示: 基金管理人承诺以恪尽职守、勤勉尽责的态度,按照法律法规及基金合同、基金招募说明书等基金法律文件的规定,为基金份额持有人谋求利益,基金管理人承诺以恪尽职守、勤勉尽责的态度,按照法律法规及基金合同、基金招募说明书等基金法律文件的规定,为基金份额持有人谋求利益,基金管理人承诺以恪尽职守、勤勉尽责的态度,按照法律法规及基金合同、基金招募说明书等基金法律文件的规定,为基金份额持有人谋求利益。			
(2) 督察长:独立行使监督稽核权;且对董事会负责;及时调查董事会及或董事会下设的相关子委员会负责有关公司内部控制和风险管理的工作内容;		8) 武汉市武昌区金都国际大厦16、17层 法定代理人:丁磊 联系人:金慧 网站: www.3699.com		6 买入衍生品投资		-	-	6	买入衍生品投资	-	-
(3) 投资决策委员会:负责制定基金投资的运作,确定基金的投资资产配置方案和基金的投资策略;		9 合计		50,204,026,626.42		10,000,100.00	10,000,100.00	10,000,100.00	10,000,100.00	10,000,100.00	10,000,100.00
(4) 风险控制委员会:负责对基金投资运作的风险进行测量和监督,并为每一个部门的投资决策提供必要的风险控制;											

(6) 业务部门：风险管理部是每一个业务部门的最直接的责任，履行风险管理职责，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。 3. 内部控制制度的编制 (七) 建立、健全内控体系，完善内控制度：公司建立、健全了内控机构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织和授权，确保监察稽核工作是独立的，并得到高管	公司网址: www.qfws.cn 29) 南京证券股份有限公司 注册地址: 江苏省南京市中环路8号 办公地址: 江苏省南京市江东南路389号	办公地址: 武汉市泛海国际SOH办公区B2301、2304 法定代表人: 海捷 公司网址: www.buyfunds.cn 客服电话: 400-027-9889 69) 北京恒天明泽基金销售有限公司	注: 1. 表决权投资中通过深港通交易机制投资的港股公允价值为46,228,027.07,占基金资产净值比例0.02%。 2. 表决权投资中通过沪深通交易机制投资的港股公允价值为46,228,027.07,占基金资产净值比例0.02%。 3. 表决权投资中通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为46,228,027.07,占基金资产净值比例0.02%。 特此公告。 泰达利基金管理有限公司 2018年12月20日
--	--	---	--