泰达宏利睿智稳健灵活配置混合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:中国工商银行股份有限公司

【重要提示】

本基金于2016年9月6日经中国证监会证监许可[2016]2043号文注册。基金合同于2016年11月23日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

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。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险等。

本基金为混合型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。

本更新招募说明书摘要摘自更新招募说明书正文,投资者欲了解详细内容,应阅读更新招募说明书正文。

本更新招募说明书所载内容截止日为2018年11月23日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30日。财务数据未经审计。

第1部分 基金管理人

一、基金管理人概况
名称:泰达宏利基金管理有限公司
设立日期:2002年6月6日
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:弓劲梅
组织形式:有限责任公司
联系电话:010-66577513
信息披露联系人:袁静
注册资本:一亿八千万元人民币
股权结构: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%

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司,成立于2002年6月,是中国首批合资基金管理公司之一。截至目前,公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、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)、泰达宏利首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、泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)、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、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利宏达混合型证券投资基金、泰达宏利淘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、泰达宏利活期友货币市场基金、泰达宏利绝对收益策略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、泰达宏利亚洲债券型证券投资基金、泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利京元宝货币市场基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利溢利债券型证券投资基金、泰达宏利恒利债券型证券投资基金、泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启富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、泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金、泰达宏利全能优选混合型基金中基金(FOF)、泰达宏利交利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利金利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利泽利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利泰和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)在内的五十多只证券投资基金。

二、主要人员情况
1、董事会成员

弓劲梅女士,董事长。拥有天津南开大学经济学博士学位。曾担任天津信托有限责任公司研究员,天弘基金管理有限公司高级研究员,天津泰达投资控股有限公司高级项目经理,天津市泰达国际控股(集团)有限公司融资与风险管理部副部长。现任天津市泰达国际控股(集团)有限公司资产管理部部长。

杨雪屏女士,董事。拥有天津大学工科学士和中国人民大学新闻学硕士学位。1995年至2003年曾在天津青年报社、经济观察报社、滨海时报社等报社担任记者及编辑;2003年至2012年就职于天津泰达投资控股有限公司办公室秘书科;自2012年至今就职于天津市泰达国际控股(集团)有限公司,曾担任资产管理部高级项目经理,现任综合办公室副主任。

刁锋先生,董事。拥有南开大学经济学学士、经济学硕士及经济学博士学位。曾担任天津北方国际信托股份有限公司交易员、信托经理,渤海财产保险股份有限公司资金运用部部门总助,天津泰达投资控股有限公司高级项目经理。现任天津市泰达国际控股(集团)有限公司财务部部长,渤海证券股份有限公司、渤海财产保险股份有限公司及天津信托有限责任公司董事。

陈展宇先生,董事,拥有美国宾夕法尼亚大学沃顿商学院经济学理学士学位,现任宏利资产管理(香港)有限公司亚洲区机构投资业务部主管,兼任北亚财富及资产管理部主管(日本除外)。加入宏利前,陈展宇先生曾先后任职于怡富基金有限公司、时佳达投资管理(亚洲)有限公司、高盛(亚洲)资产管理部、源富资产管理(亚洲)有限公司等。陈先生持有特许金融分析师执照。

杜汶高先生,董事。毕业于美国卡内基梅隆大学,持有数学及管理科学理学士学位,现为宏利资产管理(亚洲)总裁兼亚洲区主管及宏利资产管理(香港)有限公司董事,掌管亚洲及日本的投资事务,专责管理宏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。出任现职前,杜先生掌管宏利于亚洲区(香港除外)的投资事务。2001年至2004年,负责波士顿领导机构投资差产品的开发工作。杜先生于2001年加入宏利,之前任职于一家环球评级机构,曾获派驻纽约、伦敦及悉尼担任杠杆融资及资产担保证券等不同部门的主管,拥有二十多年的资本市场经验。

张凯女士,董事,拥有美国曼荷莲学院经济学学士、美国哥伦比亚大学工商管理硕士学位。现任中宏人寿保险有限公司首席执行官和总经理。出任现职前,张凯女士曾任花旗中国副行长、零售金融业务总裁。加入花旗前,张凯女士曾担任麦肯锡管理咨询公司顾问以及华信惠悦咨询公司的精算分析师。张凯女士在北美和亚洲金融业拥有20多年的经验。

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。1988年至2001年任中国建设银行股份有限公司金融机构部副处长;2001年至2003年任中信银行股份有限公司资金清算中心负责人;2003年至2014年任中银国际证券有限责任公司机构业务部董事总经理。2014年10月加盟泰达宏利基金管理有限公司,2015年4月任公司副总经理,2015年8月起任公司总经理。

何自力先生,独立董事,1982年毕业于南开大学,经济学博士。1975年至1978年,于宁夏国营农场和工厂务农和做工:1982年至1985年,于宁夏自治区党务从事教学和科研工作;1988年至今任职于南开大学,历任经济学系主任、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、天津经济学会副会长;2002年1月至7月在美国加利福尼亚大学伯克利分校作访问学者。

张建强先生,独立董事。二级律师,南开大学法学学士、国际经济法硕士。曾担任天津市高级人民法院法官。现任天津建嘉律师事务所主任,天津仲裁委员会仲裁员,天津市律师协会理事,担任天津市政府、河西区政府、北辰区政府,多家银行和非银行金融机构法律顾问,万达、招商、保利等房地产企业法律顾问,以及天津物产集团等大型国有企业的法律顾问等职。主要业务领域:金融、房地产、公司、投资。

查卡拉·西索瓦先生,独立董事。拥有艾戴克高等商学院(北部)工商管理学士、法国金融分析学院财务分析学位、芝加哥商学院工商管理学硕士等学位。曾担任欧洲联合银行 (巴黎)组合经理助理,组合经理,富达管理与研究有限公司(东京) 高级分析师,NatWest Securities Asia亚洲运输研究负责人,Credit Lyonnais International Asset Management研究部主管、高级分析师,Comgest远东有限公司董事总经理、基金经理及董事。现任Jayu Ltd.负责人。

樸睿波先生,独立董事。拥有美国西北大学经济学学士、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等学位。曾担任联邦储备系统管理委员会金融经济师, 芝加哥商业交易所高级金融经济师,Ennis Knupp & Associates合伙人、研究主管,Martingale资产管理公司(波士顿)董事,Commerz 国际资本管理 (CICM)(德国)联合首席执行官/副执行董事,德国商业银行 (英国)资产管理部门董事总经理。现任上海交通大学高级金融学院实践教授。

2、监事会成员

许宁先生,监事长。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,担任党委委员、董事会秘书、综合办公室主任。

廖仁勇先生,职工监事。人力资源管理在职研究生,曾在联想集团有限公司、中信国检信息技术有限公司从事人力资源管理工作;2007年6月加入泰达宏利基金管理有限公司,曾任人力资源部招聘与培训主管、人力资源部总经理助理,自2014年10月起担任人力资源部副总经理,主持部门工作。

葛文娜女士,职工监事。文学学士,金融学在职研究生。2006年7月至2015年12月就职于中邮创业基金管理有限公司,历任渠道经理、机构主管、销售部门总经理助理;2016年1月加入泰达宏利基金管理有限公司,任销售管理部副总经理,主持部门工作。

3、高级管理人员

弓劲梅女士,董事长。简历同上。

刘建先生,总经理。简历同上。

傅国庆先生,副总经理。毕业于南开大学和美国罗斯福大学,获文学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年就职于北方国际信托股份有限公司,从事信托业务管理工作,期间曾任办公室主任、研发部经理、信托业务总部总经理、董事会秘书、以及公司副总经理。2006年9月起任泰达宏利基金管理有限公司财务总监;2007年1月起任公司副总经理兼财务总监。

王彦杰先生,副总经理。毕业于台湾中山大学和淡江大学,获企业管理学士和财务金融硕士学位。1998年8月至2001年4月,先后在国际证券、日商大和证券、元大投信担任股票分析师;2001年5 月至 2008年2月, 任保德信投信股票投资主管;2008年2月至2008年8月,就职于复华投信香港资产管理公司,担任执行长;2008年8月至 2015年10月,就职于宏利资产管理有限公司,担任台湾地区投资主管;2015年10月加盟泰达宏利基金管理有限公司担任投资总监,2015年12月起任泰达宏利基金管理有限公司副总经理兼投资总监。

刘晓玲女士, 副总经理,2002年9月至2011年7月就职于博时基金管理有限公司,任零售业务部渠道总监;2011年7月至2013年9月任富国基金管理有限公司零售业务部负责人;2013年9月至2015年4月任泰康资产管理有限责任公司公募事业部市场总监;2015年4月加入融通基金管理有限公司,2015年9月至2018年7月任融通基金管理有限公司副总经理;2018年8月加入泰达宏利基金管理有限公司,2018年9月起任泰达宏利基金管理有限公司副总经理。

聂志刚先生,督察长。毕业于复旦大学,获经济学学士、法律硕士学位。2004年12月至2007年5 月就职于中国证监会上海监管局;2007年5月至2010年5月任中银基金管理有限公司法律合规部部门总经理;2010年5月至2011年5 月任富国基金管理有限公司监察稽核部部门总经理;2011年5月至2013年5月任中海基金管理有限公司风险管理部部门总经理兼风控总监;2013年5月至2015年9月任太平洋保险集团有限公司集团审计中心投资线首席审计师;2015年9月至2017年10月任银河期货有限公司首席风险官;2017年10月至2018年8月任天风期货股份有限公司首席风险官。2018年8月加入泰达宏利基金管理有限公司,2018年11月起任公司督察长。

4、基金经理

刘欣先生,清华大学理学硕士;2007年7月至2008年12月就职于工银瑞信基金管理有限公司;2008年12月至2011年7月就职于嘉实基金管理有限公司;2011年7月加盟泰达宏利基金管理有限公司,曾担任产品与金融工程部高级研究员、金融工程部副总经理,现担任金融工程部总经理兼基金经理;2014年1月3日至今担任泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金基金经理;2015年2月13日至今担任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基金经理; 2015年11月17日至今担任泰达宏利绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理; 2016年2月23日至今担任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基金经理;2016年9月26日至今担任泰达宏利风险预算混合型证券投资基金基金经理;2016年11月23日至今担任泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2017年1月23日至今担任泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2017年6月14日至今担任泰达宏利启富灵活配置混合型证券投资基金基金经理;具备11年基金从业经验,11年证券投资管理经验,具有基金从业资格。

5、投资决策委员会成员名单

投资决策委员会由公司总经理刘建、副总经理兼投资总监王彦杰、投资副总监兼基金投资部总监邓艺颖、金融工程部总监戴洁、资深基金经理兼首席策略分析师庄腾飞组成。

投资决策委员会根据决策事项,可分类固定收益类事项、权益类事项、其它事项。

1)固定收益类事项由刘建、王彦杰表决。
2)权益类事项由刘建、王彦杰、邓艺颖、戴洁、庄腾飞表决。
3)其它事项由全体成员参与表决。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

第2部分 基金托管人

(一)基金托管人基本情况
名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:易会满
注册资本:人民币35,640,625.71万元
联系电话:010-66105799
联系人:郭明

(二)主要人员情况

截至2018年6月, 中国工商银行资产托管部共有员工212人, 平均年龄33岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三)基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者, 中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承"诚实信用、勤勉尽责"的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务, 可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2018年6月,中国工商银行共托管证券投资基金874只。自2003 年以来,本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的61项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

第3部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构
1、直销机构
1)泰达宏利基金管理有限公司直销中心
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
联系人:于贺
联系电话:010-66577617
客服信箱:irm@mfcteda.com
客服电话:400-698-8888
传真:010-66577760/61
公司网站:http://www.mfcteda.com

2)泰达宏利基金网上直销系统
(1)网上交易系统网址:https://etrade.mfcteda.com/etrading/
支持基金管理人旗下基金网上直销的银行卡和第三方支付有:农业银行卡、建设银行卡、民生银行卡、招商银行卡、兴业银行卡、中信银行卡、光大银行卡、交通银行卡、浦发银行卡、中国银行卡、广发银行卡、上海银行卡、汇付天下"天天盈"和快钱支付等。
(2)泰达宏利微信公众账号:mfcteda_BJ
支持民生银行卡、招商银行卡、汇付天下"天天盈"账户和快钱账户。
客户服务电话:400-698-8888或010-66555662
客户服务信箱:irm@mfcteda.com

2、其他销售机构

1) 中国工商银行股份有限公司
注册地址:中国北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址:中国北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:易会满
联系人:杨菲
客服电话:95588
银行网站:www.icbc.com.cn

2) 中国银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:陈四清
客服电话:95566
联系人:崔瑛
银行网站:www.boc.cn

3) 上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东一路12号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:高国富
联系人:肖武侠
客户服务热线:95528
公司网站:www.spdb.com.cn

4) 平安银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南东路5047号
办公地址:深圳市深南东路5047号
法定代表人:谢永林
联系人:赵杨
客户服务热线:95511-3
公司网站:bank.pingan.com

5) 东莞银行股份有限公司
注册地址:广东省东莞市莞城区体育路21号
办公地址: 广东省东莞市莞城区体育路21号
法定代表人:卢国锋
联系人:吴兆群
客服电话:4001196228
公司网址:www.dongguanbank.cn

6) 渤海银行股份有限公司
注册地址:天津市河东区海河东路218号
办公地址:天津市河东区海河东路218号
法定代表人:李伏安
联系人:王宏
客户服务热线:95541
公司网站:www.cbhb.com.cn

7) 宁波银行股份有限公司
注册地址:宁波市江东区中山东路294号
办公地址:宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人:陆华裕
联系人:胡技勋
客户服务热线:95574
公司网站: www.nbcb.com.cn

8) 上海银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路168号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人:金煜
联系人:汤征程
客服电话:95594
网址:www.bankofshanghai.com

9) 包商银行股份有限公司
注册地址:包头市青山区钢铁大街6号
办公地址:包头市青山区钢铁大街6号
法定代表人:李镇西
联系人:张建鑫
客服电话:95352

10) 湘财证券股份有限公司
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:孙永祥
客服电话:95351
联系人:李欣
公司网站:www.xcsc.com

11) 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:天津市南开区宾水西道8号
法定代表人:王春峰
联系人:蔡霆
客户服务电话: 400-651-5988
网址:www.bhzq.com

12) 中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈共炎
客服电话:4008-888-888
联系人:辛国政
公司网站:www.chinastock.com.cn

13) 广发证券股份有限公司
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
客服电话:95575或致电各地营业网点
联系人:黄岚
公司网站:www.gf.com.cn

14) 中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市东城区朝内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:刘芸
客服电话:400-888-8108
公司网站: www.csc108.com

15) 国泰君安证券股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:杨德红
客服电话:95521
联系人:芮敏祺
公司网站:www.gtja.com

16) 平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人:何之江
联系人:周驰
全国免费业务咨询电话:95511-8
网址:stock.pingan.com

17) 世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42层
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42层
法定代表人:姜昧军
联系人:王雯
客服电话:4008323000
公司网站:www.csco.com.cn

18) 申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
联系人:王叔胤
客服电话:95523或400-889-5523
网址:www.swhysc.com

19) 申万宏源西部证券有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址: 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼
法定代表人:韩志谦
联系人:王怀春
客户服务电话:400-800-0562
网址:www.hysec.com

20) 中泰证券股份有限公司
注册地址:济南市市中区经七路86号
办公地址:上海市花园石桥路66号东亚银行金融大厦18层
法定代表人:李玮
联系人:许曼华
客服电话:95538
网址:www.zts.com.cn

21) 华泰证券股份有限公司
注册地址:南京市江东中路228号
办公地址:南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场
法定代表人:周易
客户服务电话:95597
联系人:庞晓芸
公司网站:www.htsc.com.cn

22) 光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
联系人:何耀
客户服务电话:95525
公司网址:www.ebscn.com

23) 新时代证券股份有限公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人:叶顺德
联系人:田芳芳
客户服务电话:400-698-9898
公司网址:www.xsdzq.cn

24) 招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层
法定代表人:霍达
联系人:黄婵君
客户服务电话:95565,400-888-8111
公司网址:www.newone.com.cn

25) 长城证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16、17层
办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:丁益
联系人:金夏
客户服务电话:0755-33680000 400-6666-888
公司网址:www.cgws.com

26) 兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号
办公地址:上海市浦东新区长柳路36号
法定代表人:杨华辉
联系人:乔琳雪
客户服务电话:95562
公司网址:www.xyzq.com.cn

27) 海通证券股份有限公司
注册地址:上海市广东路689号
办公地址:上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人:王开国
联系人:金芸
客服电话:95553,400-8888-001
公司网站:www.htsec.com

28) 广州证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19楼、20楼
办公地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19楼、20楼
法定代表人:邱三发
客服电话:95396
联系人:梁微
网址:www.gzs.com.cn

29) 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:黄金琳
客服电话:96326(福建省外请先拨0591)
联系人:王虹
公司网站:www.hfzq.com.cn

30) 金元证券股份有限公司
注册地址:海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
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:王作义
客户服务电话:400-888-8228
联系人:马贤清
网站:www.jyzq.cn

31) 德邦证券股份有限公司
注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人:姚文平
客服电话:400-888-8128
联系人:朱磊
公司网站:www.tebon.com.cn

32) 安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单元
法定代表人:王连志
客服电话:400-800-1001
联系人:陈剑虹
网址:www.essence.com.cn

33) 东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:赵俊
联系人:王一彦
客服电话:95531;400-8888-588
网址:www.longone.com.cn

34) 国都证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层(100007)
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层(100007)
联系人:黄静客户服务电话:400-818-8118
网址:www.guodu.com

35) 财富证券有限责任公司
注册地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼(410005)
办公地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼(410005)
法定代表人:蔡一兵
联系人:郭磊
客服电话:95317
网址:www.cfzq.com

36) 长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
客户服务热线:95579或400-888-8999
联系人:李良
长江证券客户服务网站:www.95579.com

37) 国金证券股份有限公司
办公地址:四川省成都市东城根上街95号
注册地址:四川省成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
客服电话:95310
公司网址:www.gjzq.com.cn
联系人:刘婧漪、贾鹏

38) 中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:张佑君
联系人:郑慧
公司网址:www.cs.ecitic.com
客服热线:95548

39) 西藏东方财富证券股份有限公司
注册地址:西藏自治区拉萨市北京中路101号
办公地址:上海市永和路118弄24号楼
法定代表人:陈宏
联系人:周艳琼
公司网址:www.xzsec.com
客服热线:95357

40) 西部证券股份有限公司
注册地址:陕西省西安市东新街319号八幢10000室
办公地址:陕西省西安市东新街319号八幢10000室
法定代表人:刘建武
联系人:梁承华
公司网址:www.westsecu.com
客服热线:95582

41) 中山证券有限责任公司
注册地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
办公地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层,深圳市华侨城深南大道9010号
法定代表人:黄扬录
联系人:罗艺琳
公司网址:www.zszq.com
客服热线:95329

42) 九州证券股份有限公司
注册地址:青海省西宁市南川工业园区创业路108号
办公地址:北京市朝阳区安立路30号仰山公园东一门2号楼
法定代表人:魏先锋
联系人:郭小璇
公司网址:www.jzsec.com
客服热线:95305

43) 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栋18、19层
办公地址:广州市天河区珠江东路13号高德置地广场E栋12层
法定代表人:张建军
联系人:甘蕾
公司网址:www.wlzq.com.cn
客服热线:400-888-8133

44) 中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
办公地址:青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层
法定代表人:姜晓林
联系人:刘晓明
公司网址:sd.citics.com
客服热线:95548

45) 西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦5楼
法定代表人:吴坚
联系人:张煜
公司网址:www.swsc.com.cn
客服热线:400-809-6096

46) 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100号环球金融中心9楼
办公地址:上海黄浦区南京西路399号明天广场22楼
法定代表人:郭林
客服电话:4008-205-999
联系人:李颖
公司网站: www.shhxzq.com

47) 中信期货有限公司
注册地址: 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场 (二期) 北座13层1301-1305室、14层
办公地址: 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场 (二期) 北座13层1301-1305室、14层
法定代表人:张皓
联系人:刘宏莹
公司网址:www.citicsf.com
客服电话:400-990-8826

48) 诺亚正行基金销售有限公司
注册地址:上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号8楼
法定代表人: 汪静波
公司网址:www.noah-fund.com
客服电话:400-821-5399

49) 深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801
办公地址:深圳市罗湖区梨园路1号物资控股置地大厦8楼
法定代表人:薛峰
公司网址:www.zlfund.cn;www.jjmmw.com
客服电话:4006-788-887

50) 上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼
法定代表人:杨文斌
公司网址:www.ehowbuy.com
客服电话:400-700-9665

51) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址:杭州市西湖区天目山路266号黄龙时代广场B座支付宝
法定代表人:陈柏青
客服电话:400-076-6123
公司网址:www.fund123.cn

52) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:浦东新区峨山路613号6幢551室
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C-9楼
法定代表人:其实
客服电话:400-1818-188
公司网址:www.1234567.com.cn

53) 上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
联系人:刘潇
电话:021-021-20691942
传真:021-20691861
客服电话:400-820-2899
公司网址: www.erichfund.com

54) 和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:刘洋
联系电话:021-20835817
传真号码:021-20835885
客服电话:400-920-0022/ 021-20835588
公司网址:licaike.hexun.com

55) 北京展恒基金销售股份有限公司
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦二层
法定代表人:闫振杰
客服电话:400-888-6661
公司网址:www.myfund.com

56) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼4层
法定代表人:凌顺平
客服电话:4008-773-772
公司网址:www.5ifund.com

57) 一路财富(北京)信息科技股份有限公司
注册地址: 北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702室
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴雪秀
客服电话:400-001-1566
公司网址: www.yilucaifu.com

58) 上海汇付基金销售有限公司
注册地址: 上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
办公地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人:冯修敏
客服电话:400-820-2819
公司网址:https://tty.chinapnr.com

59) 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
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:郭坚
客服电话:400-821-9031
公司网址: www.lufunds.com

60) 大泰金石基金销售有限公司
注册地址: 南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
办公地址:上海市浦东新区峨山璐505号东方纯一大厦15楼
法定代表人:袁顾明
客服电话:400-928-2266
公司网址:www.dtfortune.com

61) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座17层
法定代表人:杨懿
客服电话:400-166-1188
公司网址:money.jrj.com.cn

62) 上海联泰资产管理有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8座3层
法定代表人:燕斌
客服电话:400-046-6788
公司网址:www.66money.com

63) 北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京朝阳区阜通东大街1号院望京sohoT2B座2507层
法定代表人:钟斐斐
客服电话:4000-618-518
公司网址:www.ncfjj.com

64) 武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第七幢23层1号4号
办公地址:武汉市泛海国际SOHO城7栋2301、2304
法定代表人:陶捷
公司网址:www.buyfunds.cn
客服电话:400-027-9899

65) 北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址: 北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层2302#
法定代表人:李悦
客服电话:4008-980-618
公司网址:www.chtfund.com

66) 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605室
办公地址:北京市朝阳区宏泰东街浦项中心B座19层
法定代表人:齐剑辉
公司网址:www.niuguwang.com
客服电话:400-623-6060

67) 北京晟视天下基金销售有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座21-28层
法定代表人:蒋煜
公司网址:www.gscaifu.com
客服电话:400-818-8866

68) 北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址:北京市海淀区西北旺东路10号院西区8号楼新浪总部大厦
法定代表人:李昭琛
客服电话:010-62675369
公司网址:www.xincai.com

69) 珠海盈米基金销售有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东路1号保利国际广场南塔1201-1203室
法定代表人:肖雯
客服电话:020-89629066
公司网址:www.yingmi.cn

70) 上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法定代表人:王翔
客服电话:021-65370077-209
公司网址:www.jiyufund.com.cn

71) 北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人:王伟刚
客服电话:400-619-90595
公司网址:www.fundzone.cn

72) 上海云湾基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
办公地址:上海市浦东新区锦康路308号6号楼6楼
法定代表人:戴新装
客服电话:400-820-1515
公司网址:www.zhengtongfunds.com

73) 上海万得基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:中国(上海)浦东新区福山路33号9楼
法定代表人:王廷富
客服电话:400-821-0203
公司网址:www.520fund.com.cn

74) 北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区海淀东三街2号4层 401-15
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院 a 座 17 层
法定代表人:陈超
联系人:赵德赛
客服电话:95518/400 088 8816
公司网址:fund.jd.com

75) 北京格上富信基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法定代表人:李悦章
联系人:曹庆展
客服电话:400-066-8586
公司网址:www.igesafe.com

76) 泰诚财富基金销售(大连)有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:林卓
客服电话:400-6411-999
公司网址:www.taichengcaifu.com

77) 上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号陆家嘴软件园10号楼12楼
客服电话:400-921-7755
公司网址:www.leadfund.com.cn

78) 济安财富(北京)资本管理有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层
法定代表人:杨健
客服电话:400-673-7010
公司网站:www.jianfortune.com

79) 天津万家财富资产管理有限公司
注册地址: 天津自贸区 (中心商务区) 迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址:北京市西城区太平桥大街丰盛胡同28号太平洋保险大厦A座5层
法定代表人:李修辞
客服电话:010-59013842
公司网址:www.wanjiawealth.com

80) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号楼soho现代城C座18层1809
法定代表人:戎兵
客服电话:400-6099-200
公司网址:www.yixinfund.com

二、登记机构
名称: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:弓劲梅
联系人:石楠
联系电话:010-66577769
传真:010-66577750

三、出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
注册地址:上海市银城中路68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

四、审计基金财产的会计师事务所
法定名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
法定代表人:赵柏基
电话:021-23238888
传真:021-23238800
经办注册会计师:单峰、庞伊君
联系人:庞伊君

第4部分 基金的名称

泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金

第5部分 基金的类型

一、基金运作方式
契约型开放式。
二、基金的类别
混合型证券投资基金。
三、基金存续期限
不定期。

第6部分 基金的投资目标

通过现代风险模型技术进行基金风险预算,在严控本基金下行风险的前提下,灵活运用多种投资策略,力争实现基金资产的长期稳健增值。

第7部分 基金的投资方向

本基金的投资范围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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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、中期票据、次级债券、可交换债券、可转债及分离交易可转债)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货、同业存单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(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为0%-95%;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,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等,股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。

第8部分 基金的投资策略

本基金将采取目标风险和量化投资策略,也就是通过优化投资过程,限制预期波动率,将风险维持在某个固定水平,从而实现投资组合alpha的最大化,以便获得尽可能高回报。从长期来看,目标风险策略能够达到市场平均收益,在风控控制方面效果显著,从而提高风险调整后收益。

1、资产配置策略

本基金通过建立量化风险模型对各类证券的波动风险进行统计预测, 根据既定的风险预算目标对组合进行约束,获得匹配目标风险的最佳资产配置比例。

2、债券投资策略

(1)债券类属配置策略

本基金将根据对政府债券、信用债等不同债券板块之间的相对投资价值分析,确定债券类属配置策略,并根据市场变化及时进行调整,从而选择既能匹配目标久期、同时又能获得较高持有期收益的类属债券配置比例。

(2)久期管理策略

本基金将根据对利率水平的预期,在预期利率下降时,增加组合久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益,在预期利率上升时,减小组合久期,以规避债券价格下降的风险。

(3)收益率曲线策略

本基金资产组合中的长、中、短期债券主要根据收益率曲线形状的变化进行合理配置。本基金在确定固定收益资产组合平均久期的基础上,将结合收益率曲线变化的预测,适时采用跟踪收益率曲线的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的子弹、杠铃及梯形策略构造组合,并进行动态调整。

(4)信用债券投资策略

本基金将主要通过买入并持有信用风险可承担、期限与收益率相对合理的信用债券产品,获取票息收益。此外,本基金还将通过对内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断,主动采用信用利差投资策略,获取利差收益。

(5)可转换公司债券投资策略

在综合分析可转换公司债券的股性特征、债性特征、流动性、摊薄率等因素的基础上,本基金采用Black-Scholes期权定价模型和二叉树期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值,选择其中安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好,并且其基础股票基本面优良、具有较强盈利能力、成长前景好、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种,以合理价格买入并持有。根据内含收益率、折溢价比率、久期、凸性等因素构建可转换公司债券投资组合,获取稳健的投资回报。此外,本基金将通过分析不同市场环境下可转换公司债券股性和债性的相对价值, 通过对标的转债股性与债性的合理定价,力求选择被市场低估的品种。

3、资产支持证券投资策略

资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券 (ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等,其定价受多种因素影响,包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将在债券市场宏观分析基础上,结合蒙特卡洛模拟等数量化方法,对资产支持证券进行定价,评估其内在价值进行投资。

4、股票投资策略

本基金将在严格控制投资风险前提下适度参与股票资产投资。本基金将综合运用内部开发的量化选股模型分散化选取具有超额收益潜力的股票。具体而言,本基金的股票投资策略包括多因子选股模型和事件驱动选股模型等。

(1)多因子选股模型

本基金主要运用泰达宏利量化多因子选股模型,从上市公司的成长能力、盈利能力、运营能力以及相关股票的市场情绪、估值、波动等多个维度对股票进行量化分析,获得综合评分,选取其中基本面扎实估值合理的股票,根据投资组合的风险约束,进行分散化投资。

(2)事件驱动模型

本基金将深入分析高管增持、定向增发、并购重组等多类事件对上市公司基本面与股价的影响,在充分控制风险的前提下,批量选取具有潜在超额收益可能的股票,提高组合收益。

5、股指期货投资策略

本基金根据风险管理的原则,以套期保值为目的,将利用股指期货剥离多头股票资产部分的系统性风险或建立适当的股指期货多头头寸对冲市场向上风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素,计算需要用到的期货合约数量,对这个数量进行动态跟踪与测算,并进行适时灵活调整。同时,综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素,在各个月份期货合约之间进行动态配置,通过空头部分的优化创造额外收益。

6、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具,本基金可以主动投资于权证,其投资原则为有利于加强基金风险控制,有利于基金资产增值。本基金将利用权证达到控制下跌风险、增加收益的目的;同时,充分发掘权证与标的证券之间可能的套利机会,实现基金资产的增值。在权证投资中,本基金将对权证标的证券的基本面进行研究,综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度等多种因素,对权证进行定价。

第9部分 基金的业绩比较基准

1、本基金业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为: 沪深300指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×65%。

2、选择比较基准的理由

本基金选择市场认同度较高、行业分类标准和指数编制方法较为科学的沪深300指数作为本基金股票组合的业绩比较基准。沪深300指数由中证指数有限公司编制,是由沪深A股中规模大、流动股中规模大、流动性好的最具代表300只股票组成,可以综合反映沪深A股市场整体表现,适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数,其选样是在中证全债指数样本的基础上,增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债,旨在全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。该指数具有广泛的市场代表性,能够反映债券市场总体走势。本基金管理人认为,以沪深300指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×65%作为本基金的业绩比较基准,能够使本基金持有人理性判断本基金产品的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化, 或指数编制单位停止编制该指数、更改指数名称,或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,本基金管理人经与基金托管人协商一致, 本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会审议。

第10部分 基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

第11部分 基金投资组合报告(未经审计)

1、重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2018年12月4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。

本投资组合报告所载数据截止2018年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计

2、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	69,940,851.08	55.88
	其中:股票	69,940,851.08	55.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,590,838.00	8.46
	其中:债券	10,590,838.00	8.46
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	44,300,014.99	35.39
8	其他资产	337,719.50	0.27
9	合计	125,169,423.57	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

3.1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	15,615.00	0.01
B	采矿业	1,893,875.95	1.52
C	制造业	42,374,125.21	34.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,124,174.00	0.90
E	建筑业	1,691,299.20	1.36
F	批发和零售业	3,326,814.86	2.67
G	交通运输、仓储和邮政业	498,317.00	0.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,898,679.34	2.33
J	金融业	7,661,425.80	6.15
K	房地产业	4,808,752.40	3.86
L	租赁和商务服务业	2,804,964.32	2.25
M	科学研究和技术服务业	64,906.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	348,132.00	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	76,408.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	353,362.00	0.28
S	综合	-	-
	合计	69,940,851.08	56.14

3.2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

4、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601318	中国平安	39,600	2,712,600.00	2.18
2	601888	中国国旅	35,800	2,435,116.00	1.95
3	600352	浙江龙盛	245,200	2,393,152.00	1.92
4	600522	中天科技	187,922	1,614,249.98	1.30
5	000666	经纬纺机	105,600	1,550,208.00	1.24
6	600056	中国医药	91,200	1,533,984.00	1.23
7	600332	白云山	39,300	1,438,380.00	1.15
8	000002	万科A	57,838	1,405,463.40	1.13
9	600426	华鲁恒升	75,600	1,301,076.00	1.04
10	600036	招商银行	41,400	1,270,566.00	1.02

5、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,117,000.00	8.12
	其中:政策性金融债	10,117,000.00	8.12
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	473,838.00	0.38
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,590,838.00	8.50

6、报告期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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140209	14国开09	100,000	10,117,000.00	8.12
2	113013	国君转债	4,530	473,838.00	0.38

注:以上为本基金本报告期末持有的全部债券投资。

7、报告期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持有资产支持证券。

8、报告期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持有贵金属。

9、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

10、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

10.1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

10.2、本基金投资股指期货的投资政策

在报告期内,本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

11、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

11.1、本期国债期货投资政策

在报告期内,本基金未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

11.2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

11.3、本期国债期货投资评价

本报告期本基金没有投资国债期货。

12、投资组合报告附注

12.1

报告期内本基金投资的招商银行(600036)于2018年2月12日被银保监会做出行政处罚决定。招商银行因(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款;(三)同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保;(四)销售同业非保本理财产品时违规承诺保本;(五)违规将票据贴现资金直接转回出票人账户;(六)为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保;(七)未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目;(八)高管人员在获得任职资格核准前履职;(九)未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务;(十)未严格审查贸易背景真实性开立信用证;(十一)违规签订保本合同销售同业非保本理财产品;(十二) 非真实转让信贷资产;(十三) 违规向典当行发放贷款;(十四)违规向关系人发放信用贷款。罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。

基金管理人分析认为,我们判断两家公司发展战略清晰,公司整体呈现良好的发展态势。因此,基金管理人经审慎分析,在本报告期内继续保持对其的投资。

本基金投资的其余前九名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

12.2

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

12.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	18,559.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	269,189.05
5	应收申购款	49,971.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	337,719.50

12.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113013	国君转债	473,838.00	0.38

12.5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000666	经纬纺机	1,550,208.00	1.24	重大事项

12.6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第12部分 基金的业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

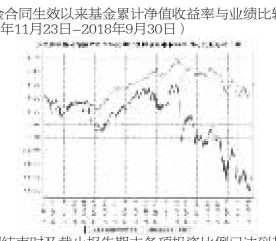
本基金合同生效日为2016年11月23日, 基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

1.历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	比较基准收益率③	比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
本基金合同生效起至2016年12月31日	-1.11%	0.35%	-2.48%	0.33%	1.37%	0.02%
2017年1月1日至2017年12月31日	0.23%	0.47%	7.46%	0.23%	-7.23%	0.24%
2018年1月1日至2018年9月30日	-15.49%	1.00%	-1.79%	0.43%	-13.70%	0.57%
自基金合同生效起至2018年9月30日	-16.23%	0.73%	2.91%	0.33%	-19.14%	0.40%

本基金业绩比较基准: 中证综合债券指数收益率*65%+沪深300指数收益率*35%

2. 本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(2016年11月23日-2018年9月30日)



本基金在建仓期结束时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。

第13部分 基金费用与税收

一、基金费用的种类
1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金相关账户的开户费用及账户维护费用;
7、基金的证券、期货交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E× 0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

上述"一、基金费用的种类"中第3-9项费用,根据有关法规及相应协议规定,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。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:
1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致并履行适当程序后,调整基金管理费率、基金托管费率。调整基金管理费、基金托管费需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人须最迟于新费率实施日2日前在指定媒介刊登公告。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第14部分 对招募说明书更新部分的说明书

(一)在"重要提示"中,更新了招募说明书所载内容、有关财务数据和净值表现的截止日期。
(二)对"第3部分、基金管理人"中,基金管理人概况、董事会成员、监事会成员、高级管理人员、基金经理等部分进行更新。
(三)更新了"第4部分、基金托管人"部分内容。
(四)"第5部分、相关服务机构"中,更新代销机构、第三方销售机构部分内容及删除第三方销售机构。
(五)"第9部分、基金的投资"部分投资组合报告内容更新至2018年9月30日。
(六)"第10部分、基金的业绩"部分对基金业绩更新至2018年9月30日,并更新了历史走势对比图。
(七)更新"第22部分、其他应披露事项"部分内容。

泰达宏利基金管理有限公司
2019年1月5日