

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月22日

§ 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，并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人:中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定，于2019年1月18日对报告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、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证

本基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应当阅读基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期利润为2018年10月1日至2018年12月31日。

§ 2 基金产品概况

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2018年10月1日 - 2018年12月31日)

1.本期已实现收益 -40,099,766.32

2.本期利润 -40,111,189.06

3.期末可供分配基金份额余额 -1,036.00

4.期末基金资产净值 278,120,307.49

5.期末基金份额净值 0.9896

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -12.95% 1.78% -1.26% 1.40% -1.94% 0.26%

注:本基金的业绩比较基准:90%×恒生中国企业A200指数收益率+10%×恒生指数收益率。

风险收益特征

本基金为股票型基金,风险收益特征属较高风险、较高收益。

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2018年10月1日 - 2018年12月31日)

1.本期已实现收益 -40,099,766.32

2.本期利润 -40,111,189.06

3.期末可供分配基金份额余额 -1,036.00

4.期末基金资产净值 278,120,307.49

5.期末基金份额净值 0.9896

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -12.95% 1.78% -1.26% 1.40% -1.94% 0.26%

注:本基金的业绩比较基准:90%×恒生中国企业A200指数收益率+10%×恒生指数收益率。

风险收益特征

本基金为股票型基金,风险收益特征属较高风险、较高收益。

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理) 简介

姓名 职务 在本基金的基金管理期间 证券从业年限 说明

张勋 本基金基金经理,基金经理助理 2014年11月21日 - 12 说明

说明:张勋于2006年7月获得对外经济贸易大学管理学学士学位,2006年9月获得对外经济贸易大学金融学硕士学位,2006年9月加入泰达宏利基金管理有限公司,2014年11月21日起担任本基金基金经理,2018年6月12日起担任本基金基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守相关法律法规及基金合同的规定,没有出现损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

基金管理人建立了公平交易制度和流程,并严格执行制度的规定。在投资管理活动中,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、投资建议和投资决策方面享有平等机会;严格执行投资管理职能和交易执行职能部门的隔离;在交易环节实行集中交易制度,并确保公平交易可操作,可评估、可稽核,可追溯;交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令;对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,交易部按照价格优先、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。风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数据统计、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。

4.4 异常交易行为的专项说明

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交易异常报告和客户投诉组合的交易行为分析报告。

在本报告期内,基金管理人旗下所有投资组合的同日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禁机构的处罚情况。

4.5 报告期内基金投资组合报告

4.5.1 报告期末基金资产组合

序号 项目 金额(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 256,393,434.76 91.36

2 债券投资 256,393,434.76 91.36

3 固定收益证券 16,146,127.60 6.71

4 货币市场基金 - -

5 金融衍生品 - -

6 其他资产 - -

7 衍生工具 - -

8 银行存款和清算备付金合计 7,000,362.69 2.72

9 其他资产 578,890.29 0.20

9. 合计 282,818,791.33 100.00

注:本基金的资产配置比例为:90%×恒生中国企业A200指数收益率+10%×恒生指数收益率。

风险收益特征

本基金为股票型基金,风险收益特征属较高风险、较高收益。

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 256,393,434.76 91.36

2 债券投资 256,393,434.76 91.36

3 固定收益证券 16,146,127.60 6.71

4 货币市场基金 - -

5 金融衍生品 - -

6 其他资产 - -

7 衍生工具 - -

8 银行存款和清算备付金合计 7,000,362.69 2.72

9 其他资产 578,890.29 0.20

9. 合计 282,818,791.33 100.00

注:本基金的资产配置比例为:90%×恒生中国企业A200指数收益率+10%×恒生指数收益率。

风险收益特征

本基金为股票型基金,风险收益特征属较高风险、较高收益。

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

§ 6 开放式基金份额变动

6.1 开放式基金申购、赎回情况

6.1.1 申购情况

6.1.2 赎回情况

6.1.3 其他情况

6.2 期末基金余额

6.3 期末基金份额净值

6.4 期末基金份额总额

6.5 期末基金资产净值

6.6 期末基金可供分配基金份额余额

6.7 期末基金份额净值

6.8 期末基金份额总额

6.9 期末基金资产净值

6.10 期末基金份额净值

6.11 期末基金份额总额

6.12 期末基金资产净值

6.13 期末基金份额净值

6.14 期末基金份额总额

6.15 期末基金资产净值

6.16 期末基金份额净值

6.17 期末基金份额总额

6.18 期末基金资产净值

6.19 期末基金份额净值

6.20 期末基金份额总额

6.21 期末基金资产净值

6.22 期末基金份额净值

6.23 期末基金份额总额

6.24 期末基金资产净值

6.25 期末基金份额净值

6.26 期末基金份额总额

6.27 期末基金资产净值

6.28 期末基金份额净值

6.29 期末基金份额总额

6.30 期末基金资产净值

6.31 期末基金份额净值

6.32 期末基金份额总额

6.33 期末基金资产净值

6.34 期末基金份额净值

6.35 期末基金份额总额

6.36 期末基金资产净值

6.37 期末基金份额净值

6.38 期末基金份额总额

6.39 期末基金资产净值

6.40 期末基金份额净值

6.41 期末基金份额总额

6.42 期末基金资产净值

6.43 期末基金份额净值

6.44 期末基金份额总额

6.45 期末基金资产净值

6.46 期末基金份额净值

6.47 期末基金份额总额

6.48 期末基金资产净值

6.49 期末基金份额净值

6.50 期末基金份额总额

6.51 期末基金资产净值

6.52 期末基金份额净值

6.53 期末基金份额总额

</