泰达宏利沪深300指数增强型证券投资基金证券投资基金 2018年年度报告摘要

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
送出日期:2019年3月27日

§1 重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司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。本年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2019年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

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仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

泰达宏利沪深300指数增强型证券投资基金由原泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金转型而来。根据基金份额持有人大会决议,泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金于2018年3月16日转型成泰达宏利沪深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本报告期自2018年1月1日至2018年3月15日止,泰达宏利沪深300指数增强型证券投资基金本报告期自2018年3月16日至2018年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况(转型后)

基金简称	泰达宏利沪深300	
基金主代码	162213	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年3月16日	
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	
报告期末基金份额总额	156,502,536.11份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰达宏利沪深300A	泰达宏利沪深300C
下属分级基金的交易代码	162213	003548
报告期末下属分级基金的份额总额	149,330,311.10份	1,172,225.01份

2.1 基金基本情况(转型前)

基金简称	泰达宏利财富大盘指数	
基金主代码	162213	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年4月23日	
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	
报告期末基金份额总额	143,516,080.26份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰达宏利财富大盘指数A	泰达宏利财富大盘指数C
下属分级基金的交易代码	162213	003548
报告期末下属分级基金的份额总额	137,315,972.25份	6,200,108.01份

2.2 基金产品说明(转型后)

投资目标	本基金为股票型指数增强基金,在对沪深300指数进行有效跟踪的被动投资基础上,结合增强型的主动投资,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过7.75%,力争获取超越标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略,在控制与比较基准偏离风险的前提下,综合利用多种量化投资模型和指数增强技术,力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*95%+同业存款利率*5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金,其预期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。

2.2 基金产品说明(转型前)

投资目标	采用指数化投资策略,紧密跟踪中证财富大盘指数,力争获取与标的指数相似的投资收益,并力争将基金的日跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年化跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金采用指数完全复制方法,按照上证财富大盘指数成分股及权重构建基金的投资组合,并根据标的指数成分股及权重的变动进行相应的调整,以达到跟踪标的指数的目的。但如遇特殊情况(如市场流动性不足、成分股调整停牌等)致使基金无法按照足额股票的股票时,基金管理人将运用优用其他合理的方法进行替代,以使跟踪误差控制在限定范围内。
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。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,属于高风险、高收益的基金品种,其预期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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰达宏利基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	袁静	王永民
	联系电话	010-66577513	010-66594896
	电子邮箱	ann@mfcteda.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-698-8888	95566
传真		010-66577666	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.mfcteda.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年1月1日至2018年3月15日	
	泰达宏利沪深300A	泰达宏利沪深300C
本期已实现收益	-32,465,430.76	-472,842.58
本期利润	-49,819,815.19	-841,846.09
加权平均基金份额本期利润	-0.3529	-0.4948
本期基金份额净值增长率	-23.51%	-23.66%
3.1.2 期末数据和指标	2018年12月31日	
期末可供分配基金份额利润	0.1496	0.1531
期末基金资产净值	171,664,094.93	1,351,727.84
期末基金份额净值	1.1496	1.1531
-、累计期末指标	2018年12月31日	

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基金份额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.期末可供分配利润等于期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.1主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年1月1日至2018年3月15日	2017年			2016年	
	泰达宏利财富大盘指数A	泰达宏利财富大盘指数C	泰达宏利财富大盘指数A	泰达宏利财富大盘指数C	泰达宏利财富大盘指数A	泰达宏利财富大盘指数C
本期已实现收益	511,609.99	-11,865.31	36,525,819.48	180,602.20	1,708,705.43	-
本期利润	-6,531,176.91	-527,251.10	43,120,908.82	114,297.16	-2,350,014.97	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0613	-0.1424	0.3776	0.2274	-0.0290	-
本期基金份额净值增长率	1.26%	1.28%	27.33%	24.11%	-3.51%	-
3.1.2 期末数据和指标	2018年3月15日		2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	0.5030	0.5105	0.4843	0.4914	0.1637	-
期末基金资产净值	206,389,675.87	9,365,226.97	101,091,466.95	1,119,185.43	88,315,640.89	-
期末基金份额净值	1.5030	1.5105	1.4843	1.4914	1.1637	-
累计期末指标	2018年3月15日		2017年末		2016年末	

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基金份额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.期末可供分配利润等于期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4. 根据泰达宏利基金管理有限公司2017年2月7日发布的《关于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、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金与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修改基金合同及托管协议的公告》,泰达宏利基金管理有限公司决定自2017年2月9日起,对旗下泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金增加收取销售服务费的C类份额并相应修订基金合同和托管协议。

3.2 基金净值表现(转型后)

3.2.1 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

泰达宏利沪深300A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-13.19%	1.58%	-11.83%	1.56%	-1.36%	0.02%
过去六个月	-13.34%	1.43%	-13.51%	1.42%	0.17%	0.01%
自基金合同生效起至今	-23.51%	1.32%	-25.27%	1.31%	1.76%	0.01%

泰达宏利沪深300C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-13.25%	1.58%	-11.83%	1.56%	-1.42%	0.02%
过去六个月	-13.46%	1.43%	-13.51%	1.42%	0.05%	0.01%
自基金合同生效起至今	-23.66%	1.32%	-25.27%	1.31%	1.61%	0.01%

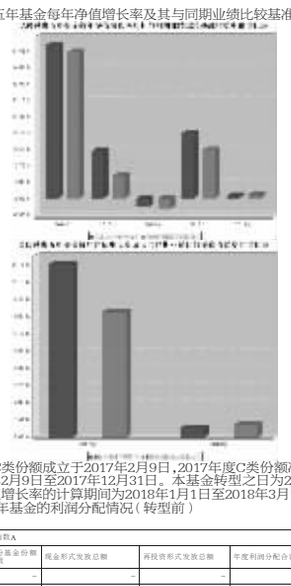
注:本基金业绩比较基准:95%×中证财富大盘指数收益率+5%×同业存款利率。

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发的中国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样,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将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增长情况。

3.2.2 自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率变动的比较

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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金C类份额成立于2017年2月9日,2017年度C类份额净值增长率的计算期间为2017年2月9日至2017年12月31日。本基金转型之日为2018年3月16日,2018年份额净值增长率的计算期间为2018年1月1日至2018年3月15日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况(转型前)

单位:人民币元

泰达宏利财富大盘指数A						
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注	
2018	-	-	-	-	-	
2017	-	-	-	-	-	
2016	4.2000	343,532,425.77	6,210,635.21	349,743,060.98		
合计	4.2000	343,532,425.77	6,210,635.21	349,743,060.98		

单位:人民币元

泰达宏利财富大盘指数C						
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注	
2018	-	-	-	-	-	
2017	-	-	-	-	-	
2016	-	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	-	

3.3过去三年基金的利润分配情况(转型后)

根据本基金合同及基金实际运作的情况,本基金自2018年3月16日(基金转型后首个运作日)至2018年12月31日未进行利润分配。目前无其他收益分配安排。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

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。截至报告期末本公司股东及持股比例分别为:天津市泰达国际控股(集团)有限公司:51%;宏利资产管理(香港)有限公司:49%。

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、泰达宏利宏观合型证券投资基金、泰达宏利创业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、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利京元宝货币市场基金、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。

本公司采用团队投资方式,即通过整个投资团队全体人员的共同努力,力求实现基金财产的持续增值。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介(转型后)

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨超	基金基金经理	2018年3月16日	-	8	美国南威尔士大学数学与金融计算硕士,2010年4月加入德信基金管理有限公司,从事金融工程等工作,历任投资管理部助理研究员、初级研究员、基金经理助理等职务,2014年6月加入泰达宏利基金管理有限公司,担任基金经理助理,现任基金经理,具备8年证券基金从业经验,8年证券投资管理经验,具有基金从业资格。
曹龙浩	基金基金经理助理	2018年3月16日	2018年4月26日	3	北京理工大学工学硕士,2007年4月至2015年9月就职于欧鹏(OpenTV)互动电视软件有限公司,2015年9月加盟泰达宏利基金管理有限公司,曾担任金融工程部研究员,基金经理助理等职,具备3年基金从业经验,具有基金从业资格。

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券业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。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介(转型前)

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨超	基金基金经理	2014年10月13日	2018年3月15日	8	美国南威尔士大学数学与金融计算硕士,2010年4月加入德信基金管理有限公司,从事金融工程等工作,历任投资管理部助理研究员、初级研究员、基金经理助理等职务,2014年6月加入泰达宏利基金管理有限公司,担任基金经理助理,现任基金经理,具备8年证券基金从业经验,8年证券投资管理经验,具有基金从业资格。
曹龙浩	基金基金经理助理	2017年4月21日	2018年3月15日	3	北京理工大学工学硕士,2007年4月至2015年9月就职于欧鹏(OpenTV)互动电视软件有限公司,2015年9月加盟泰达宏利基金管理有限公司,曾担任金融工程部研究员,现担任金融工程部基金经理助理,具备3年基金从业经验,具有基金从业资格。

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券业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 管理人对报告期内本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,本基金运作整体合法合规,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人建立了公平交易制度和内部控制流程,严格执行相关制度规定。在投资管理活动中,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;在交易环节实行集中交易制度,交易部运用交易系统中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,确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易,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。

基金管理人的风险管理部定期对基金管理人管理的不同投资组合的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)基金管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析, 并经公司管理层审核签署后存档备查。基金管理人的监察稽核部定期对公平交易制度的执行和控制工作进行稽核。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本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, 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、可持续;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,未发生任何利益输送的情况。

4.3.3 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, 风险管理部对可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控, 对异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析,定期对各投资组合的交易行为进行整体分析评估,定期向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。如发现疑似异常交易情况,相关投资组合经理对该交易情况进行合理性解释。 监察稽核部定期对异常交易制度的执行和控制工作进行稽核。

本报告期内,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,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%, 未发现异常。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构处罚的情况。

4.4 管理人对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

2018年,A股承受了内部去杠杆和外部贸易冲突的双重压力,企业盈利增速下降、流动性收紧、风险溢价抬升,导致市场风险偏好明显回落,是驱动A股估值不断降低的主要因素。影响市场风险偏好的变量中,内部矛盾从流动性的主动收紧逐渐转移到经济与企业盈利的下行,出现债务违约、股权质押、商誉减值等风险;而外部变量中全球经济复苏乏力、美联储持续加息、中美贸易摩擦反复不定、美股的剧烈震荡都对A股信心的恢复形成持续的压制。2018年A股市场整体下跌,代表大盘蓝筹的上证50、沪深300等指数下跌幅度稍小,而中小板、创业板、中证1000等中小股票回调幅度较大。市场风格上盈利质量较好、估值较低的银行、消费等板块占优,而估值较高,盈利能力欠缺或受贸易摩擦影响的板块如TMT等则处于较为不利的位置。市场延续蓝筹、龙头相对中小股票更强的风格,是在风险偏好降低,盈利与估值双双回落,部分企业出现流动性危机、业绩爆雷的环境下市场参与者追求确定性的选择。此外,市场增量资金的结构性变化,即个人投资者参与积极性降低,国外资金逐步加大A股配置也强化了这一趋势。

本基金在操作中恪守基金合同,采用指数增强策略,严格控制跟踪误差及其他风险属性。使用量化选股手段,挑选盈利质量高、盈利能力强、估值合理的大盘蓝筹股票,持仓结构分散以控制个股风险,仓位保持合理稳定。本报告期内,本基金增加了食品饮料、医药、电子元器件行业的配置,减少了银行、房地产、汽车行业的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

(转型后)截至本报告期末泰达宏利沪深300A基金份额净值为1.1496元;自转型以来(2018年3月16日至2018年12月31日)基金份额净值增长率为-23.51%;截至本报告期末泰达宏利沪深300C基金份额净值为1.1531元;自转型以来(2018年3月16日至2018年12月31日)基金份额净值增长率为-23.66%;业绩比较基准收益率为-25.27%。

(转型前)截至2018年3月15日泰达宏利中证财富大盘A基金份额净值为1.5030元;本报告期(2018年1月1日至2018年3月15日)基金份额净值增长率为1.26%;截至2018年3月15日泰达宏利中证财富大盘C基金份额净值为1.5105元;本报告期(2018年1月1日至2018年3月15日)基金份额净值增长率为1.28%;业绩比较基准收益率为1.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年,影响A股的政策与外部环境相对2018年或有更积极的变化。流动性与信用的边际改善以及向实体经济的传导路径在进一步疏通, 民营中小企业融资难问题在逐步得到缓解,更加积极的减税降费等财政政策有望得以实施,金融市场改革正在稳步推进。目前A股估值处于历史较低水平,在世界范围内权益市场的估值水平比较中也处于更有吸引力的位置。外资的长期资金在不断加大对A股的配置权重,国内社保与养老资金也在逐步布局权益市场。从中长期来看,我们对A股依然保持乐观的态度, 市场或在年内企稳回升, 交易情绪与估值有望得到修复。在市场风格上,我们继续看好受增量长期配置资金偏好的高盈利、低估值的蓝筹股,同时也看好具有真实的业绩成长性,符合政策导向与经济转型趋势的高端制造、新兴产业、服务消费等板块。目前市场的主要风险来源于经济与企业盈利增速的寻底节奏对市场情绪的压制,另外也需要关注中美贸易谈判的结果、美国经济增速放缓的可能性以及美股持续处于估值高位等不确定性因素带来的冲击。

基于基金合同与投资观点,本基金在选股策略上倾向于选择盈利质量高、盈利能力长期稳定、公司治理规范、估值合理的蓝筹股。在持仓上选择不过分暴露个股相对权重,分散投资以平衡组合风险。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内, 基金管理人为防范和化解经营风险, 确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益,基金管理人主要采取了如下监察稽核措施:本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度,督察长、监察稽核部、风险管理部定期与不定期的对基金的投资、交易、研发、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的监督检查。

同时,公司制定了具体严格的投资授权流程与权限;在证券投资交易前由研究部门建立可供投资的基础库并定期进行全面维护更新和适时对个股进行维护更新, 通过信息技术建立多级投资交易预警系统, 并把禁选股票排除在交易系统之外;设立专人负责信息披露工作,信息披露做到真实、准确、完整、及时;引入外方股东在风险控制方面的先进经验,完善公司风险管理指标及流程,监控公司各项业务的运作状况和风险程度;独立于各业务部门的内部监察人员日常对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查, 发现问题及时督促有关部门整改,并定期制作监察稽核报告公司董事会及外部监管部门。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按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基金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政策由托管银行进行复核。公司估值委员会主任由主管基金运营的副总经理担任,成员包括但不限于督察长、主管投研的副总经理或投资总监、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专业胜任能力。

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金经理不参与最终的投票表决。

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准则。

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。

4.8 管理人对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利润分配,目前无其他收益分配安排。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对泰达宏利沪深300指数增强型证券投资基 (转型前为泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金,以下称“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,对本基金管理人的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,未发现本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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告(转型后)

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第23408号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰达宏利沪深300指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人;
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了泰达宏利沪深300指数增强型证券投资基金(以下简称“泰达宏利沪深300指数基金”)的财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018年3月16日(基金转型日至个运作日)至2018年12月31日期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券投资基金信息披露编报规则第9号——净值披露(2014年修订)(证监会公告[2014]54号)(以下简称“中国证监会公告[2014]54号”)的规定编制,公允反映了泰达宏利沪深300指数基金2018年12月31日的财务状况以及2018年3月16日(基金转型日至个运作日)至2018年12月31日期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于泰达宏利沪深300指数基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
管理层和治理层对财务报表的责任	泰达宏利沪深300指数基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及中方的基金行业实务操作编制财务报表,使其不存在由于舞弊或错误所导致的重大错报。 在编制财务报表时,由基金管理人管理层负责评估泰达宏利沪深300指数基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算泰达宏利沪深300指数基金、终止运营或别无其他现实可选择的情况。 基金管理人治理层负责监督泰达宏利沪深300指数基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计总是一定发现存在的重大错报。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3)评估基金管理人管理层运用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对泰达宏利沪深300指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致泰达宏利沪深300指数基金不能持续经营。 (5)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括内部控制在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单琳 / 陶伊君
会计师事务所的地址	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
审计报告日期	2019年3月26日

§6 审计报告(转型前)

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第23383号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金全体基金份额持有人;
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金(以下简称“泰达宏利财富大盘指数基金”)的财务报表,包括2018年3月15日的资产负债表,2018年1月1日至2018年3月15日(基金转型前最后运作日)止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券投资基金信息披露编报规则第9号——净值披露(2014年修订)(证监会公告[2014]54号)(以下简称“中国证监会公告[2014]54号”)的规定编制,公允反映了泰达宏利财富大盘指数基金2018年1月1日至2018年3月15日(基金转型前最后运作日)止期间的财务状况以及2018年1月1日至2018年3月15日(基金转型前最后运作日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于泰达宏利财富大盘指数基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
管理层和治理层对财务报表的责任	泰达宏利财富大盘指数基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及中方的基金行业实务操作编制财务报表,使其不存在由于舞弊或错误所导致的重大错报。 在编制财务报表时,由基金管理人管理层负责评估泰达宏利财富大盘指数基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算泰达宏利财富大盘指数基金、终止运营或别无其他现实可选择的情况。 基金管理人治理层负责监督泰达宏利财富大盘指数基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计总是一定发现存在的重大错报。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准