泰达宏利印度机会股票型证券投资基金（QDII）

2019年第一季度报告

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4月19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，并对其内容的真实性、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本基金合同规定，于2019年4月17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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月30日（基金合同生效日）起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利印度股票（QDII）
基金主代码	006105
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年1月30日
报告期末基金份额总额	242,746,230.59份
投资目标	在严格控制风险的前提下，把握印度经济成长带来的机会，挖掘在印度发行上市的优质公司，力争为投资者获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将通过全球宏观经济发展态势、区域经济发展情况、微观经济运行环境等可能影响印度证券市场的重要因素的研究和预测，利用数量模型工具，分析和比较股票、货币市场工具等不同金融工具的风险收益特征，并以此为依据，对基金整体资产配置比例进行确定。同时，本基金将定期，或由于宏观经济重大变化不定期地进行资产配置比例调整，以保持基金资产配置的有效性。
业绩比较基准	MSCI印度指数收益率（经人民币汇率调整）×90%+人民币活期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金主要投资于境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。
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
境外投资顾问	英文名称：Manulife Asset Management (Hong Kong) Limited
	中文名称：宏利资产管理（香港）有限公司
	中文名称：香港上海汇丰银行有限公司

§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(2019年1月30日－2019年3月31日)
1.本期已实现收益	538,695.00
2.本期利润	538,695.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0017
4.期末基金资产净值	243,154,182.29
5.期末基金份额净值	1.0017

注：本基金合同生效日期为2019年01月30日。

2.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。

3.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

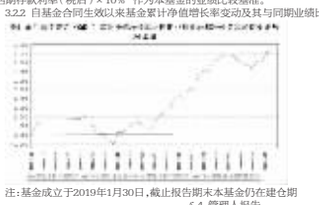
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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
自基金合同生效起至今	0.17%	0.01%	9.52%	0.69%	－9.35%	－0.68%

注：本基金业绩比较基准为：MSCI印度指数收益率经人民币汇率调整*90%+人民币活期存款利率(税后)*10%

MSCI印度指数由摩根士丹利资本国际公司编制推出，是对于全球投资者而言最为重要和通用的印度市场指数之一，采用自用流通加权方式，兼顾了印度市场的代表性和可投资性；MSCI印度指数主要代表了印度的大型和中型股市场，截止2017年10月31日，77只成分股共覆盖了约85%的印度股票体量。综合考虑本基金的投向与市场指数代表性等因素，选取“MSCI印度指数收益率（经人民币汇率调整）×90%+人民币活期存款利率（税后）×10%”作为本基金的业绩比较基准。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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：基金成立于2019年1月30日，截止报告期末本基金仍在建仓期

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
师靖	基金经理	2019年1月30日	－	9年	新加坡南洋理工大学理学硕士；2010年7月至2017年9月，任职于新加坡辉立资本集团旗下的辉立证券，其中2010年7月至2015年6月担任高级全球股票交易员，负责参与全球20个国家和地区的股票交易；2015年7月至2017年9月担任基金组合经理，主要负责中国香港地区以及亚洲二级市场的投资和全球大类资产的配置投资理工作；2017年9月加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于国际业务部，先后担任基金经理助理、基金经理等职；具有9年证券投资管理经验，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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
陈致洲	亚洲区（日本除外）股票投资部首席投资总监	25	英国Exeter大学会计硕士学位，特许金融分析师。陈致洲先生于2011年加入宏利资产管理，在此前曾供职于Pacific Eagle、Reliance、GCIS和霸菱等资产管理公司。目前担任宏利资产管理亚洲区（日本除外）股票投资部首席投资总监，拥有24年股票投资经验；工作于香港，负责管理宏利资产管理遍布亚洲10个国家及地区的股票团队。他的工作着重于提升公司各地区股票投资策略的业绩表现，并帮助促进亚洲各当地市场团队之间的信息分享，同时作为股点联系香港团队与北美、欧洲股票团队的合作。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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；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。

4.4.2 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。在本报告期内，本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管机构的处罚情况。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

印度市场在全球市场长期表现突出。去年在中美贸易战的大背景下，印度市场表现出自身的韧性，在全球股市下挫和人股下跌超过30%的情况下，印度市场全年保持平稳。2019年伊始，由于印巴边境和大选问题，印度市场在1月并未有所表现，但进入2月后期在地缘政治缓解和大选逐渐明朗化后，外国投资者FPI（Foreign Portfolio Investor）资金不断流入印度市场并创5年同期资金最大净流入。印度市场的底策红利将逐步释放，2014年莫迪政府上台后开展了一系列的结构性改革措施，包括GST（消费税）改革、房地产改革、正规经济推行改革，使印度市场保持持续的内生增长性。印度央行在去年加息2次后于2019年2月降息实施较为宽松的货币政策，下调基准利率25个基点至6.25%；同时，印度政府开展了积极的财政支持政策，提高信贷和增加农民收入。2月后各板块开始补涨，特别是业绩有支持的消费品板块和估值前期压制的金融板块。

泰达宏利印度股票基金由于涉及跨境交易和手续办理等状况投资有所延迟，一季度基金建仓于短期稳定投资标的并正积稳健推进相关投资准备工作，预计近期即将进入相关投资操作阶段。

截至本报告期末本基金份额净值为1.0017元；本报告期基金份额净值增长率为0.17%，业绩比较基准收益率为9.52%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	－	－
	其中：普通股	－	－
	优先股	－	－
	存托凭证	－	－
	房地产信托凭证	－	－
2	基金投资	－	－
3	固定收益投资	－	－
	其中：债券	－	－
	资产支持证券	－	－
4	金融衍生品投资	－	－
	其中：远期	－	－
	期货	－	－
	期权	－	－
	权证	－	－
5	买入返售金融资产	－	－
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	－	－
6	货币市场工具	70,000,000.00	27.30
7	银行存款和结算备付金合计	186,325,786.81	72.66
8	其他资产	113,640.01	0.04
9	合计	256,439,426.82	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证投资。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证投资。

5.4 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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证投资。

5.5 报告期末按债券品种等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.7 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投资。

5.8 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投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期末，本基金未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货交易明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期末国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内基金投资前十名证券的发行主体本出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	－
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	111,039.58
5	应收申购款	2,600.43
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	113,640.01

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中存在流通受限的情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年1月30日）持有的基金份额	376,350,769.64
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	829,514.65
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	134,434,053.70
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“－”填列）	－
报告期期末基金份额总额	242,746,230.59

注：本基金合同生效日期为2019年01月30日。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

本公司于2019年1月19日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，王彦杰先生不再担任公司副总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准泰达宏利印度机会股票型证券投资基金设立的文件；

2、《泰达宏利印度机会股票型证券投资基金基金合同》；

3、《泰达宏利印度机会股票型证券投资基金招募说明书》；

4、《泰达宏利印度机会股票型证券投资基金托管协议》；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资人可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》）或登录基金管理人互联网网址（http://www.mfcteda.com）查阅。

泰达宏利基金管理有限公司
2019年4月19日

中金MSCI中国A股国际低波动指数发起式证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人：中金基金管理有限公司
基金托管人：招商证券股份有限公司
报告送出日期：2019年4月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月18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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中金MSCI低波动
基金主代码	006343
交易代码	006343
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年10月17日
报告期末基金份额总额	12,636,191.26份
投资目标	本基金跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内，实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	MSCI中国A股国际低波动指数收益率*95%＋银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型证券投资基金和混合型证券投资基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
下属分级基金的基金简称	中金MSCI低波动A　中金MSCI低波动C
下属分级基金的交易代码	006343　006344
报告期末下属分级基金的份额总额	12,442,776.14份　193,415.12份

§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（2019年1月1日－2019年3月31日）	
	中金MSCI低波动A	中金MSCI低波动C
1. 本期已实现收益	203,753.86	4,160.32
2. 本期利润	2,347,258.67	27,603.21
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1895	0.1695
4. 期末基金资产净值	14,501,797.76	225,715.82
5. 期末基金份额净值	1.1655	1.1670

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.本报告所列示的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

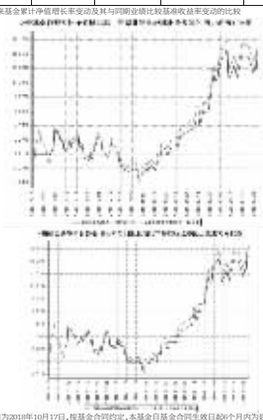
中金MSCI低波动A

阶段	净值增长率①	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	19.44%	1.21%	20.23%	1.21%	－0.79%	0.00%

中金MSCI低波动C

阶段	净值增长率①	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	19.40%	1.21%	20.23%	1.21%	－0.83%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



本基金的基金合同生效日为2018年10月17日，按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，截至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱宝臣	本基金基金经理	2018年10月17日	－	12年	朱宝臣先生，理学硕士。历任中金公司资产管理部投资经理、量化投资总监，2017年10月加入公司，现任公司量化投资团队负责人。

注：1、上述基金经理任职日期为本基金基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.2 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金自2018年10月17日成立以来，截止2018年11月1日，顺利完成建仓。后续股票持仓96%左右的仓位，采用完全复制MSCI低波动SmartBeta指数的策略，余下资金买入一年内到期国债。我们将继续采用完全复制MSCI低波动SmartBeta指数的策略，力争更小的跟踪误差。

2018年，A股市场呈现震荡下跌的走势，沪深300指数2018年全年下跌25.31%，中证500指数2018年全年下跌33.32%。2019年一季度，A股市场有较大幅度的反弹，沪深300指数上涨28.62%，中证500指数上涨33.10%。这较快速上涨，除了2018年的下跌已经使多个指数的估值处于历史低位的原因以外，主要由于造成去年恶劣情绪的“贸易战”和“去杠杆”，在春节前后的预期都得到了很大的改善，同时受国内金融降准及其背后金融资改善等利好政策，及国际上MSCI宣布将提高A股在其指数体系中的权重等利好消息的共同作用。2019年1月在全球市场风险偏好普遍提升的环境下，A股市场开始回暖，扎实盈利质量、稳健盈利增长、合理估值的公司获取了超额收益。但是2月以来，伴随风险偏好回暖趋势更大范围蔓延，此前遭遇了较大回撤的中小市值公司出现了明显的超跌反弹，券商、通讯等题材股也受到追捧，涨幅巨大。3月份市场风格快速切换，上涨幅度和速度明显小了2月份，目前各大指数的估值已经得到了一定程度的修复，当前终估值回到正常水平，公司本身的质量将会成为投资者考虑的重点，未来，我们将更加关注基本面和政策面再负载。从基本面而言，盈利质量和增长都相好的优质龙头公司，拥有品牌、技术、效率等方面的优势，在中国经济加快向高质量发展模式转变的过程中，会逐渐胜出并进一步发展，拥有更强的确定性。从政策面而言，科创板作为金融服务实体经济的需要桥梁，在深化资本市场改革和推动我国产业结构升级两方面都有重要意义。随着科创板的落地越来越近，资金提前布局科创板相关行业的投票时其他板块更加明确。无庄政策重点支持的行业，从国家的改革发展战略中找到投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金MSCI低波动A基金份额净值为1.1655元，本报告期基金份额净值增长率为19.44%；截至本报告期末中金MSCI低波动C基金份额净值为1.1670元，本报告期基金份额净值增长率为19.40%，同期业绩比较基准收益率为20.23%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，截止本报告期末，本基金成立未满三年。《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于基金份额持有人数量及基金资产净值的限制性条款暂不适用于本基金。

§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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	14,020,591.90	93.68
	其中：股票	14,020,591.90	93.68
2	基金投资	－	－
3	固定收益投资	786,118.10	5.25
	其中：债券	786,118.10	5.25
	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	109,056.01	0.73
8	其他资产	50,274.13	0.34
9	合计	14,966,040.14	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按申万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	6,783.00	0.05
B	采矿业	675,919.00	4.59
C	制造业	5,817,468.60	39.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,117,883.00	7.59
E	建筑业	46,641.00	0.32
F	批发和零售业	359,660.00	2.44
G	交通运输、仓储和邮政业	636,234.00	4.32
H	住宿和餐饮业	10,990.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,867.00	0.31
J	金融业	4,166,076.30	28.29
K	房地产业	294,794.00	2.00
L	租赁和商务服务业	162,204.00	1.10
M	科学研究和技术服务业	－	－
N	水利、环境和公共设施管理业	－	－
O	居民服务、修理和其他服务业	－	－
P	教育	－	－
Q	卫生和社会工作	－	－
R	文化、体育和娱乐业	7,722.00	0.05
S	综合	30,464.00	0.21
	合计	13,378,705.90	90.84

5.2.2 报告期末按港股通投资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	－	－
B	采矿业	－	－
C	制造业	259,469.00	1.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	－	－
E	建筑业	－	－
F	批发和零售业	－	－
G	交通运输、仓储和邮政业	32,480.00	0.22
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	－	－
J	金融业	349,937.00	2.38
K	房地产业	－	－
L	租赁和商务服务业	－	－
M	科学研究和技术服务业	－	－
N	水利、环境和公共设施管理业	－	－
O	居民服务、修理和其他服务业	－	－
P	教育	－	－
Q	卫生和社会工作	－	－
R	文化、体育和娱乐业	－	－
S	综合	－	－
	合计	641,886.00	4.36

5.3 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.3.1 报告期末按股票投资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	000876	新希望	37,900	504,070.00	3.42
2	600900	长江电力	25,100	423,437.00	2.88
3	601166	兴业银行	22,500	408,825.00	2.78
4	600016	民生银行	58,280	369,495.20	2.51
5	601169	北京银行	58,600	363,320.00	2.47
6	600886	国投电力	41,400	343,620.00	2.33
7	601328	交通银行	53,200	331,968.00	2.25
8	600000	浦发银行	26,100	294,408.00	2.00
9	600519	贵州茅台	300	256,197.00	1.74
10	600015	华夏银行	29,400	242,550.00	1.65

5.3.2 报告期末按港股通投资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	603288	海天味业	1,700	147,390.00	1.00
2	601229	上海银行	11,000	131,780.00	0.89
3	000333	美的集团	2,300	112,079.00	0.76
4	600919	江苏银行	12,000	85,560.00	0.58
5	601997	贵阳银行	6,400	83,520.00	0.57

5.4 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	208,062.40	1.41
2	央行票据	－	－
3	金融债券	557,055.70	3.78
	其中：政策性金融债	557,055.70	3.78
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）	21,000.00	0.14
8	同业存单	－	－
9	其他	－	－
10	合计	786,118.10	5.34

5.5 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	018005	国开1701	5,570	557,055.70	3.78
2	019544	16国债16	1,080	108,054.00	0.73
3	019611	19国债01	440	43,982.40	0.30
4	019537	16国债09	300	30,000.00	0.20
5	019592	18国债10	260	26,026.00	0.18

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期末，本基金未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货交易明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期末国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内基金投资前十名证券的发行主体本出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	13,497.41
2	应收证券清算款	11,105.07
3	应收股利	－
4	应收利息	24,177.61
5	应收申购款	1,494.04
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	50,274.13

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金股数投资的前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末股数投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金股数投资的前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年1月30日）持有的基金份额	376,350,769.64
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	829,514.65
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	134,434,053.70
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“－”填列）	－
报告期期末基金份额总额	242,746,230.59

注：本基金合同生效日期为2019年01月30日。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

本公司于2019年1月19日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，王彦杰先生不再担任公司副总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准泰达宏利印度机会股票型证券投资基金设立的文件；

2、《泰达宏利印度机会股票型证券投资基金基金合同》；

3、《泰达宏利印度机会股票型证券投资基金招募说明书》；

4、《泰达宏利印度机会股票型证券投资基金托管协议》；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资人可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》）或登录基金管理人互联网网址（http://www.mfcteda.com）查阅。

泰达宏利基金管理有限公司
2019年4月19日

中金新安灵活配置混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人：中金基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2019年4月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月18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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中金新安
基金主代码	004385
交易代码	004385
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月29日
报告期末基金份额总额	50,155,468.93份
投资目标	在风险可控的前提下，力争实现超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金将采用“自上而下”的分析方法，综合分析宏观经济周期与形势、货币政策、财政政策、利率走势、资金供求、流动性风险、信用风险等因素，分析比较债券市场、股票市场、及现金类资产的收益风险特征，动态调整各大类资产的投资比例，控制投资组合的系统性风险。具体策略包括固定收益资产投资策略、权益类资产投资策略和期货投资策略等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%＋中证全债指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型证券投资基金，高于债券型证券投资基金和货币市场基金。
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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（2019年1月1日－2019年3月31日）
1.本期已实现收益	3,349,111.02
2.本期利润	11,322,793.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.1817
4.期末基金资产净值	57,198,634.06
5.期末基金份额净值	1.140

1.本期