泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2017年10月26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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月24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及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2017年7月1日至2017年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利红利先锋混合
交易代码	162212
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月3日
报告期末基金份额总额	150,464,377.02份
投资目标	力争实现基金资产的长期稳定增值和基金的持续稳定分红。
投资策略	1.资产配置策略 基金投资股票资产的最低比例为基金资产的60%，最高为95%，投资于债券资产的比例最高为40%，最低为0%。 2.股票投资策略 本基金兼顾投资于具有持续分红特征及潜力的红利股和具有成长潜力特征的上市公司，其中投资于红利股的比例不低于基金股票资产的80%。红利股应具备本基金对红利股定量筛选标准中的一项或多项特征。 3.债券投资策略 对债券的投资将作为控制投资组合整体风险的重要手段之一，通过采用积极主动的投资策略，结合宏观经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，运用久期调整、凸度挖掘、信用分析、波动性交易、品种互换、回购套利等策略，权衡到期收益率与市场流动性，精选个券并构建和调整债券组合，在追求债券资产投资收益的同时兼顾流动性和安全性。 4.权证投资策略 本基金在确保与基金投资目标相一致的前提下，本着谨慎可控的原则，进行权证投资。
业绩比较基准	75%×标普中国A股红利机会指数收益率+25%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，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债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
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（2017年7月1日 - 2017年9月30日）
1.本期已实现收益	8,460,551.57
2.本期利润	7,251,915.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.0476
4.期末基金资产净值	174,140,841.98
5.期末基金份额净值	1.157

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

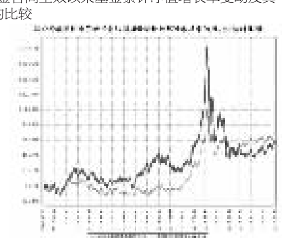
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.25%	0.99%	1.44%	0.43%	2.81%	0.56%

注：本基金的业绩比较基准：75%×标普中国A股红利机会指数收益率+25%×上证国债指数收益率。

标普中国A 股红利机会指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的具有高红利特征、营利能力和利润增长率稳定且具有一定规模及流动性的股票作为样本股，以股息率的最大化及覆盖个股与行业的多样化为标准，使用股息率作为加权指标构建的指数。它可以综合反映沪深证券市场中高股息股票的整体状况和走势，比较符合本基金的投资策略和投资方向。

上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成，具有良好的市场代表性。

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。

§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		
邓艺颖	本基金基金经理；投资副总监兼投资部总监	2015年4月3日	-	12	金融学硕士；2004年5月至2005年4月就职于中国工商银行广东省分行公司业务部；2005年4月加盟泰达宏利基金管理有限公司，先后担任交易部交易员、固定收益部研究员、研究部副总监、投资副总监兼研究部总监，现任投资副总监兼基金投资部总监；具备12年基金从业经验，12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 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 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。

4.3.2 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。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超过该证券当日成交量的5%的情况共出现了2次，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的处罚情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

在经历了2季度市场大幅调整后，3季度市场一路高歌猛进，指数突破3300，尤其是上证50和中证100指数表现优异。具体来看：6月-7月，上证指数出现较大的反弹，市场结构也从单一的白马蓝筹转向到周期板块，尤其是煤炭、钢铁、有色和造纸等低PB板块涨幅较大。8月市场表现仍然保持强势，在盈利趋势推动下，金融、周期、成长板块均有较大的涨幅。随着证金公司和养老金资金持股计划披露，创业板个股全面反弹，主要集中在互联网、人工智能、电子半导体、元器件等板块。

从经济层面的情况来看，1）3季度经济增长好于预期，制造业投资和房地产销售是市场判断经济增长可能持续的主要因素，叠加海外市场需求复苏，人民币升值可期；2）去杠杆对市场总体流动性影响的冲击基本已经过去，短期利率进一步回归常态，总体融资条件大幅改善，提升了市场的风险偏好；3）周期板块在中报业绩的驱动下，有反弹的基本条件；从政策层面来看，各个行业新的制度框架开始初步显现出效应；其中，1）新的金融监管框架下银行、保险、证券、信托等传统业务扎实的公司逐步获得稳定的市场份额；2） 房地产行业逐步形成新的制度框架，租赁市场的发展、土地市场改革等也将逐步显露；3）环保政策落实力度大幅提升，供给侧改革在传统过剩产业中将持续推进，有利于整体行业竞争力的提升；4）国企改革、混合所有制改革的推行，尤其是中国联通即将复牌，将提升市场对国企改革的信心；5）雄安新区、粤港澳大湾区发展规划将进入实施阶段，通州新区也将开始新的政策职能，对区域经济增长将起到重要的拉动作用。

报告期内，本基金基本维持组合的配置，持有银行、保险、白酒、家电等防御性板块的龙头公司，关注部分估值合理、内生业务增长能力稳健，尤其是具备行业核心竞争力的公司。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.157元；本报告期基金份额净值增长率为4.25%，业绩比较基准收益率为1.44%。

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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	161,322,073.47	92.12
	其中：股票	161,322,073.47	92.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	183,600.00	0.10
	其中：债券	183,600.00	0.10
	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	11,707,950.06	6.69
8	其他资产	1,913,008.73	1.09
9	合计	175,126,632.26	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	4,321,357.60	2.48
C	制造业	109,464,511.88	62.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,311,502.44	2.48
E	建筑业	73,555.60	0.04
F	批发和零售业	2,684,369.45	1.54
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,133,901.03	2.37
J	金融业	27,991,957.00	16.07
K	房地产业	3,712,227.00	2.13
L	租赁和商务服务业	79,324.72	0.05
M	科学研究和技术服务业	81,588.27	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	3,758,549.08	2.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	639,656.99	0.37
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.03
S	综合	-	-
	合计	161,322,073.47	92.64

5.2.2 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。

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

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	000858	五粮液	103,218	5,912,327.04	3.40
2	600519	贵州茅台	10,894	5,639,170.16	3.24
3	600036	招商银行	220,500	5,633,775.00	3.24
4	600276	恒瑞医药	89,950	5,390,703.50	3.10
5	601688	华泰证券	228,800	5,175,456.00	2.97
6	300073	当升科技	157,600	5,125,152.00	2.94
7	002407	多氟多	169,400	4,453,526.00	2.56
8	002466	天齐锂业	60,483	4,251,350.07	2.44
9	002600	江粉磁材	509,304	4,201,758.00	2.41
10	002460	赣锋锂业	48,100	4,199,130.00	2.41

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	183,600.00	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	183,600.00	0.11

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	128016	雨虹转债	1,836	183,600.00	0.11

注：以上为本基金本报告期末持有的全部债券投资。

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。

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。

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。

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投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

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

本基金本报告期末未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

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（元）
1	存出保证金	95,838.20
2	应收证券清算款	1,596,346.17
3	应收股利	-
4	应收利息	2,537.70
5	应收申购款	218,286.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,913,008.73

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未存在流通受限情况。

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

报告期期初基金份额总额	154,076,636.15
报告期期间基金总申购份额	4,066,272.31
减：报告期期间基金总赎回份额	7,678,531.44
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	150,464,377.02

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金的管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

7.2 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新增投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金设立的文件；
2、《泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金基金合同》；
3、《泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金招募说明书》；
4、《泰达宏利红利先锋混合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。

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

8.3 查阅方式

基金投资者也可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）或登录本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
2017年10月26日

泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司
报告送出日期：2017年10月26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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月24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及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2017年7月1日至2017年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达睿选稳健混合
交易代码	004000
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年1月23日
报告期末基金份额总额	255,622,566.11份
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
投资策略	本基金将采取目标风险的投资策略，也就是通过优化投资过程，限制预期波动率，将风险维持在固定的低风险水平，从而实现风险约束下投资组合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
业绩比较基准	沪深300指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×65%
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
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§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（2017年7月1日 - 2017年9月30日）
1.本期已实现收益	12,563,065.49
2.本期利润	14,381,558.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.0489
4.期末基金资产净值	267,291,415.97
5.期末基金份额净值	1.0456

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

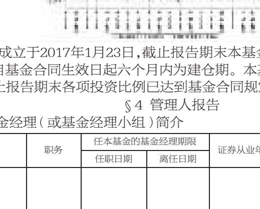
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.89%	0.47%	2.04%	0.20%	2.85%	0.27%

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

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。

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



本基金成立于2017年1月23日，截止报告期末本基金成立不满一年。按基金合同规定，自基金合同生效日起六个月内为建仓期。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。

§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		
刘欣	本基金基金经理；金融工程部总经理	2017年1月23日	-	10	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；具备10年基金从业经验，10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 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 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。

4.3.2 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。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超过该证券当日成交量的 5%的情况共出现了2次，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的处罚情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年三季度，A股市场基本呈现普涨格局。在经过前两个季度的“一九”行情之后，以创业板指为代表的成长型股票以及小盘股反弹较多，蓝筹股反弹较少，整体市场开始纠偏。但是我们依然认为业绩主导的逻辑会长期存在，以此为基础的慢牛格局已然开始。在当前政策环境下，我们认为未来相当长一段时间内，金融去杠杆、打击内幕交易与市场操纵等仍是市场的主旋律。A股市场的深层次改变仍在继续，在严厉监管、约束再融资、减持新规、加速IPO等因素叠加的背景下，过去数年的重组式投资逻辑正在被打破，中小盘中低盈利股票估值在持续压缩。另一方面，尽管我们看到短期中小盘股票估值出现压缩，但是从长远看，整治金融乱象对投资者保护起到了切实作用，规范引导了市场行为从融资转向投资，对于长期牛市存在提供了较好的支持基础。

本基金在操作中，采用目标波动率策略，控制产品整体波动风险。选股层面，投资风格兼顾成长确定、估值合理、景气度较高的成长性公司，和估值低、基本面稳健、存在改善预期的蓝筹股。从结构上分散由于市场风格大幅波动造成的风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0456元；本报告期基金份额净值增长率为4.89%，业绩比较基准收益率为2.04%。

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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	163,889,368.11	60.90
	其中：股票	163,889,368.11	60.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	99,479,337.20	36.96
	其中：债券	99,479,337.20	36.96
	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	3,734,012.32	1.39
8	其他资产	2,026,420.63	0.75
9	合计	269,129,138.26	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	1,531,234.00	0.57
B	采矿业	6,849,590.60	2.56
C	制造业	91,744,521.36	34.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	275,628.00	0.10
E	建筑业	8,243,009.00	3.08
F	批发和零售业	17,273,620.42	6.46
G	交通运输、仓储和邮政业	6,581,928.91	2.46
H	住宿和餐饮业	1,402,352.00	0.52
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,248,356.03	1.96
J	金融业	1,029,997.00	0.39
K	房地产业	14,425,489.30	5.40
L	租赁和商务服务业	4,524,370.00	1.69
M	科学研究和技术服务业	987,972.00	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	734,808.00	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,173,027.99	0.44
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.02
S	综合	1,819,464.00	0.68
	合计	163,889,368.11	61.31

5.2.2 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。

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

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	600887	伊利股份	72,500	1,993,750.00	0.75
2	002008	大族激光	45,000	1,962,000.00	0.73
3	603600	永艺股份	107,800	1,952,258.00	0.73
4	600410	华胜天成	174,500	1,945,675.00	0.73
5	000725	京东方A	439,300	1,932,920.00	0.72
6	300338	开元股份	77,000	1,921,150.00	0.72
7	600612	老凤祥	46,100	1,903,469.00	0.71
8	300007	汉威科技	103,200	1,883,400.00	0.70
9	300217	东方电热	514,300	1,882,338.00	0.70
10	600690	青岛海尔	124,497	1,878,659.73	0.70

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,900,000.00	18.67
	其中：政策性金融债	49,900,000.00	18.67
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）	567,337.20	0.21
8	同业存单	49,012,000.00	18.34
9	其他	-	-
10	合计	99,479,337.20	37.22

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	170204	17国开04	300,000	29,940,000.00	11.20
2	170301	17进出01	200,000	19,960,000.00	7.47
3	111715270	17民生银行CD270	200,000	19,780,000.00	7.40
4	111797220	17广州农村商业银行CD078	200,000	19,540,000.00	7.31
5	111790596	17汉口银行CD008	100,000	9,692,000.00	3.63

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。

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。

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。

5.9.2 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。

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

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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

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（元）
1	存出保证金	60,597.13
2	应收证券清算款	236,020.88
3	应收股利	-
4	应收利息	1,726,763.32
5	应收申购款	3,039.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,026,420.63

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未存在流通受限情况。

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

报告期期初基金份额总额	324,246,617.22
报告期期间基金总申购份额	2,030,160.10
减：报告期期间基金总赎回份额	70,654,211.21
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	255,622,566.11

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金的管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

7.2 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 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170701-20170930	69,999,000.00	0.00	0.00	69,999,000.00	27.38%
	2	20170701-20170930	80,009,800.00	0.00	0.00	80,009,800.00	31.30%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情况，易发生巨额赎回的情况，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

注：报告期内，申购份额含红利再投资份额。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
2、《泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3、《泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
4、《泰达宏利睿选稳健灵活配置混合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（《证券时报》、《证券日报》）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
2017年10月26日

泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2017年10月26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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月24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及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2017年7月1日至2017年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达睿智稳健混合
交易代码	003501
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月23日
报告期末基金份额总额	528,944,774.59份
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。
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，从而实现风险约束下投资组合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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×65%
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。
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

§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（2017年7月1日 - 2017年9月30日）
1.本期已实现收益	22,967,124.43
2.本期利润	25,503,175.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.0365
4.期末基金资产净值	532,530,478.83
5.期末基金份额净值	1.0068

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

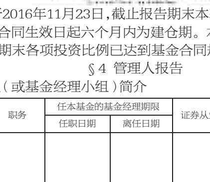
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.09%	0.46%	2.04%	0.20%	2.05%	0.26%

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

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。

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



本基金成立于2016年11月23日，截止报告期末本基金成立不满一年。按基金合同规定，自基金合同生效日起六个月内为建仓期。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。

§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		
刘欣	本基金基金经理；金融工程部总经理	2016年11月23日	-	10	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；具备10年基金从业经验，10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 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 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。

4.3.2 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。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超过该证券当日成交量的 5%的情况共出现了2次，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的处罚情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年三季度，A股市场基本呈现普涨格局。在经过前两个季度的“一九”行情之后，以创业板指为代表的成长型股票以及小盘股反弹较多，蓝筹股反弹较少，整体市场开始纠偏。但是我们依然认为业绩主导的逻辑会长期存在，以此为基础的慢牛格局已然开始。在当前政策环境下，我们认为未来相当长一段时间内，金融去杠杆、打击内幕交易与市场操纵等仍是市场的主旋律。A股市场的深层次改变仍在继续，在严厉监管、约束再融资、减持新规、加速IPO等因素叠加的背景下，过去数年的重组式投资逻辑正在被打破，中小盘中低盈利股票估值在持续压缩。另一方面，尽管我们看到短期中小盘股票估值出现压缩，但是从长远看，整治金融乱象对投资者保护起到了切实作用，规范引导了市场行为从融资转向投资，对于长期牛市存在提供了较好的支持基础。

本基金在操作中，采用目标波动率策略，控制产品整体波动风险。选股层面，投资风格兼顾成长确定、估值合理、景气度较高的成长性公司，和估值低、基本面稳健、存在改善预期的蓝筹股。从结构上分散由于市场风格大幅波动造成的风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0068元；本报告期基金份额净值增长率为4.09%，业绩比较基准收益率为2.04%。

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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	352,345,953.33	65.86
	其中：股票	352,345,953.33	65.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	167,173,337.20	31.25
	其中：债券	167,173,337.20	31.25
	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	11,945,624.94	2.23
8	其他资产	3,561,629.21	0.67
9	合计	535,026,544.68	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	3,625,122.00	0.68
B	采矿业	14,523,119.60	2.73
C	制造业	197,618,674.94	37.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,139,626.44	0.21
E	建筑业	18,654,767.00	3.50
F	批发和零售业	37,951,065.68	7.13
G	交通运输、仓储和邮政业	12,307,631.91	2.31
H	住宿和餐饮业	2,353,948.00	0.44
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,385,355.03	2.33
J	金融业	6,262,624.00	1.18
K	房地产业	26,185,954.06	4.92
L	租赁和商务服务业	9,928,403.10	1.86
M	科学研究和技术服务业	1,929,892.08	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	1,590,429.00	0.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,893,132.99	0.36
R	文化、体育和娱乐业	337,923.50	0.06
S	综合	3,658,284.00	0.69
	合计	352,345,953.33	66.16

5.2.2 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。

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

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	600887	伊利股份	143,400	3,943,500.00	0.74
2	603600	永艺股份	215,350	3,899,988.50	0.73
3	600031	三一重工	509,200	3,895,380.00	0.73
4	600309	万华化学	92,300	3,890,445.00	0.73
5	002008	大族激光	88,300	3,849,880.00	0.72
6	600410	华胜天成	344,200	3,837,830.00	0.72
7	000725	京东方A	870,700	3,831,080.00	0.72
8	000525	红太阳	173,944	3,805,894.72	0.71
9	600690	青岛海尔	251,000	3,787,590.00	0.71
10	000960	锡业股份	241,100	3,785,270.00	0.71

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,030,000.00	5.64
	其中：政策性金融债	30,030,000.00	5.64
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,048,000.00	1.89
7	可转债（可交换债）	567,337.20	0.11
8	同业存单	126,528,000.00	23.76
9	其他	-	-
10	合计	167,173,337.20	31.39

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	111799723	17贵阳银行CD074	500,000	48,825,000.00	9.17
2	150201	15国开01	300,000	30,030,000.00	5.64
3	111797794	17四川天府银行CD081	300,000	29,283,000.00	5.50
4	111613135	16浙商CD135	300,000	29,100,000.00	5.46
5	111783893	17杭州银行CD179	200,000	19,320,000.00	3.63

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。

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。

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。

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投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

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

本基金本报告期末未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

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（元）
1	存出保证金	192,555.84
2	应收证券清算款	235,254.88
3	应收股利	-
4	应收利息	3,132,386.60
5	应收申购款	1,431.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,561,629.21

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未存在流通受限情况。

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

报告期期初基金份额总额	860,541,282.95
报告期期间基金总申购份额	702,605.41
减：报告期期间基金总赎回份额	332,299,113.77
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	528,944,774.59

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金的管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

7.2 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 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170701-20170930	202,325,746.08	0.00	0.00	202,325,746.08	38.25%
	2	20170701-20170814	200,047,500.00	0.00	200,047,500.00	0.00	0.00%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情况，易发生巨额赎回的情况，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

报告期内，申购份额含红利再投资份额。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
2、《泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3、《泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
4、《泰达宏利睿智稳健灵活配置混合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》、《证券时报》）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
2017年10月26日