

# 泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金更

## 新招募说明书

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

### 重要提示

泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）已于 2014 年 12 月 25 日获中国证监会证监许可[2014]1416 号文注册，并于 2015 年 9 月 9 日获得中国证监会证券投资基金机构监管部关于泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金延期募集备案的回函（机构部函[2015]2515 号）。本基金合同于 2015 年 11 月 17 日生效。

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价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资者赎回时，所得或会高于或低于投资者先前所支付的金额。

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，投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、管理风险、合规风险、本基金的特定风险和其他风险等。本基金为特殊的混合型基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于绝对收益策略投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。

本基金优选数量化投资策略进行投资，可能存在因数量化投资策略模型或者交易系统缺陷使基金收益不能达到投资业绩目标的风险；同时，本基金运用股指期货对冲市场波动风险，由于股指期货交易采用保证金交易制度，保证金交易具有杠杆性，本基金存在杠杆性风险、到期日风险、变现损失风险、强行平仓风险、强行减仓风险、保证金流动性风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资者在认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责

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 2016 年 11 月 17 日，有关数据和净值表现截止日为 2016 年 9 月 30 日。财务数据未经审计。

## 一、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

成立日期：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：010-66577808

信息披露联系人：陈沛

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、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金、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、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利收益增强债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利养老收益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定期开放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、泰达宏利多元回报债券型证券投资基金、泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金、泰达宏利汇利债券型证券投资基金、泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金、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在内的四十多只证券投资基金。

## （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。

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。

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。

孙泉先生，董事。拥有天津南开大学经济学学士和经济学硕士学位及美国芝加哥罗斯福大学工商管理硕士学位。1988年任职于天津开发区信托投资公司，负责信贷和外汇管理工作；1989年任职于天津开发区管理委员会政策研究室，负责区域发展、国企改革、对外合作政策的研究和制定工作；1997年任职于天津经济技术开发区总公司企划部，负责企业发展战略研究和计划经营管理工作；2001年任职于天津泰达投资控股公司资产管理部，负责泰达控股重组并购、资源整合、上市筹备和金融类、实业类企业的经营管理工作。现任天津泰达投资控股公司资产管理部经理，渤海产业基金投资管理公司、恒安标准人寿保险公司和天津钢管集团股份有限公司董事等职。

何达德先生，董事。毕业于英国伦敦城市大学，取得精算学荣誉理学士学位。现为宏利行政副总裁及宏利人寿保险（国际）有限公司首席行政总监，宏利资产管理（香港）有限公司首席行政总监，负责宏利于香港的全线业务，包括个人保险、雇员福利及财富管理等业务。同时何先生分别为宏利人寿保险（国际）有限公司及宏利资产管理（香港）有限公司之董事。现为澳大利亚精算学会及美国精算学会会员，在寿险及退休顾问工作方面拥有三十多年的丰富经验，其间担任多个领导层要职。

任赛华女士，董事。毕业于加拿大滑铁卢大学（University of Waterloo），获得数学学士学位，加拿大安大略省会计师公会之特许会计师。任女士于2007年加盟宏利资产，曾任首席行政事务总监，现担任宏利资产亚洲区零售经销部主管。早年任女士曾任职于亚洲和加拿大的著名国际投资银行、会计事务所及省级退休金委员会，监管托管业务的销售及担任全球基金服务客户关系管理、新业务发展及会计等高级职务。2013年6月至2015年4月担任泰达宏利基金管理有限公司监事。

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息差产品的开发工作。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。

汪丁丁先生，独立董事，毕业于北京师范学院数学系，中国科学院数学力学部理学硕士学位，1990年获夏威夷大学经济学博士学位。1984年至1998年先后担任

中国科学院系统科学研究所助理研究员、美国东西方中心人口研究所访问学者、博士后研究员、香港大学经济与金融学院助理教授、德国杜伊斯堡大学经济系客座教授、北京大学中国经济研究中心副教授及美国夏威夷大学经济系访问教授。目前担任北京大学及浙江大学教授，自 2007 年至今，担任东北财经大学“社会与行为”跨学科教育中心学术委员会主席兼主任。

周小明先生，独立董事。毕业于浙江大学法学院，持有中国政法大学法学硕士学位、民商法法学博士学位。1990 年起先后任职于浙江大学、中国人民银行非银行金融机构监管司、君泽君律师事务所、安信信托投资股份有限公司。曾担任全国人大常委会财经委员会《中华人民共和国信托法》、《基金法》起草小组成员、安信信托投资股份有限公司总裁。目前担任中国人民大学信托与基金研究所所长、君泽君律师事务所合伙人、清华大学法学院联合法律硕士导师、中国信托业协会培训与资格办公室副主任、《中国信托业发展报告》主编。

杜英华女士，独立董事，任期始于 2014 年 6 月 20 日。毕业于南开大学法律系，获得法学学士和法学硕士学位。1992 年 10 月，与其他合伙人共同发起设立天津津华律师事务所，现任该律所副主任，正高级律师，具有 22 年法律实务经验。同时担任天津第五届律师协会理事、天津第六届律师协会监事。

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。

## 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。

陈景涛先生，监事。拥有澳大利亚麦考瑞大学商学学士、麦考瑞大学应用金融学硕士和南澳大学金融学博士学位。1998 年先后就职于渣打银行、巴克莱资本、Baron Asset Management；2005 年加入宏利资产，曾担任固定收益高级投资经理，现担任北亚投资负责人。

王泉先生，职工监事。管理学学士、经济学硕士。2002 年 3 月加入泰达宏利基金管理有限公司工作至今，历任基金运营部基金会计、基金运营部副总经理、基金运营部总经理、运营副总监兼基金运营部总经理，自 2014 年 10 月起担任运营总

监。

邓艺颖女士，职工监事。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。

### 3、总经理及其他高级管理人员

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。

张萍女士，督察长。毕业于中国人民大学和中国科学院，管理学和理学双硕士。先后任职于中信公司、毕马威国际会计师事务所等公司，从事财务管理和企业管理咨询工作。2002年起在嘉实基金管理有限公司工作，任监察稽核部副总监。

2005年10月起任泰达宏利基金管理有限公司风险管理部总监。2006年11月起任泰达宏利基金管理有限公司督察长。

### 4、基金经理

刘欣先生，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。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

任本基金基金经理；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多元回报债券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。具备9年基金从业经验，9年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

杨超先生，数学与金融计算硕士；2010年5月加入建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；2014年10月13日至今担任泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金经理；2014年10月13日至今担任泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金经理；2015年11月20日至今担任泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理；2016年8月30日至今担任泰达宏利量化增强股票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集利债券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收益增强债券型证券投资基金基金经理。具备6年证券基金从业经验，6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、金融工程部门负责人戴洁、研究部总监陈伯祯、资深基金经理兼首席策略分析师庄腾飞组成。督察长张萍列席会议。

投资决策委员会根据决策事项，可分为固定收益类事项、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、陈伯祯、庄腾飞表决。
- 3) 其它事项由全体成员参与表决。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

#### （三）基金管理人的职责

- 1、依法申请并募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理本基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收

益；

- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表本基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

#### （四）基金管理人承诺

- 1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；
- 2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：
  - （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资；
  - （2）不公平地对待其管理的不同基金资产；
  - （3）承销证券；
  - （4）将基金财产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；
  - （5）从事可能使基金财产承担无限责任的投资；
  - （6）依照法律、行政法规的有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。
- 3、基金管理人承诺不从事证券法规规定禁止从事的其他行为。
- 4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规、规章及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：
  - （1）越权或违规经营；
  - （2）违反基金合同或托管协议；
  - （3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
  - （4）在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；
  - （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
  - （6）玩忽职守、滥用职权；
  - （7）泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；



- (8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
- (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、对倒、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (11) 贬损同行，以提高自己；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

#### 5、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着勤勉谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；
- (3) 不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### (五) 基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制的原则

- (1) 全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；
- (2) 独立性原则：设立独立的监察稽核与风险管理部，监察稽核与风险管理部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查；
- (3) 相互制约原则：各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系；
- (4) 定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

##### 2、内部控制的体系结构

公司的内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对内部控制负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察稽核部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

- (1) 董事会：负责制定公司的内部控制政策，对内部控制负完全的和最终的责任。

(2) 督察长：独立行使督察权利；直接对董事会负责；及时向董事会及/或董事会下设的相关专门委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告；

(3) 投资决策委员会：负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略；

(4) 风险控制委员会：负责对基金投资运作的风险进行测量和监控；

(5) 监察稽核部：负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；

(6) 业务部门：风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

### 3、内部控制的措施

(1) 建立、健全内控体系，完善内控制度：公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织授权，确保监察稽核工作是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新；

(2) 建立相互分离、相互制衡的内控机制：建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门，不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险；

(3) 建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险；

(4) 建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：分别建立了公司营运风险和投资风险控制委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作和投资有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策；

(5) 建立内部监控系统：建立了有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控；

(6) 使用数量化的风险管理手段：采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失；

(7) 提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

### 4、基金管理人关于内部控制制度的声明

- (1) 基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- (2) 基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部合规控制。

## 二、基金托管人

### (一) 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### (二) 基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### (三) 证券投资基金托管情况

截至2016年09月30日，中国银行已托管502只证券投资基金，其中境内基金471只，QDII基金31只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

## 三、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

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：010-66577619、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

交易系统网址：<https://etrade.mfcteda.com/etrading/>

支持基金管理人旗下网上直销的银行卡和第三方支付有：农行卡、建行卡、中国银行卡、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、广发银行卡和汇付天下“天天盈”、快钱支付账户。

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、和快钱支付账户。

客户服务电话：400-698-8888 或 010-66555662

客户服务信箱：irm@mfcteda.com

## 2、代销机构

### 1) 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：田国立

客服电话：95566

银行网站：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

### 2) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：傅育宁

客服电话：95555

联系人：邓炯鹏

公司网站：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

3) 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：孙建一

电话：021-38637673

传真：021-50979507

联系人：张莉

客户服务热线：95511-3

公司网站：[bank.pingan.com](http://bank.pingan.com)

4) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：（021）61618888

传真：（021）63604199

联系人：虞谷云

客户服务热线：95528

公司网站：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

5) 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

电话：022-58316666

传真：022-58316259

联系人：王宏

客户服务热线：95541

公司网站：[www.cbhb.com.cn](http://www.cbhb.com.cn)

6) 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：卢国峰

电话：0769-22119061

传真：0769-22117730

联系人：陈幸

客服电话：4001196228

公司网址：www.dongguanbank.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

电话：0574-89068340

传真：0574-87050024

联系人：胡技勋

客户服务热线：95574

公司网站：www.nbcb.com.cn

8) 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：林俊波

客服电话：400-888-1551

传真：021-68865680

公司网站：www.xcsc.com

9) 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：天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：胡天彤

电话：022-28451709

传真：022-28451892

电子邮箱：hutt@bhzq.com

客户服务电话：400-651-5988

网址：www.bhzq.com

10) 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 号国际企业大厦 C 座

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：陈有安

客服电话：4008-888-888

电话：010-66568450

联系人：宋明

公司网站：www.chinastock.com.cn

11) 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：广东省广州天河区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

12) 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

客服电话：400-888-8108

传真：010-65182261

公司网站：www.csc108.com

13) 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：400-8888-666/95521

联系人：芮敏祺

公司网站：www.gtja.com

14) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：吴琼

全国免费业务咨询电话：95511

传真：0755-82400862

网址：www.PINGAN.com

15) 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

联系电话：021-33389888

客服电话：95523 或 400-889-5523

网址：www.swhysc.com

16) 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：许建平

电话：010-88085858

联系人：李巍

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

17) 中泰证券股份有限公司



注册地址：济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

18) 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

传真：0755-82492962

联系人：庞晓芸

公司网站：www.htsc.com.cn

19) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

联系人：安岩岩

电话：0431-85096517

客户服务电话：400-600-0686

网址：www.nesc.cn

20) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨、李芳芳

客户服务电话：95525 400-888-8788 101-089-98

传真：021-22169134

公司网址：www.ebscn.com

21) 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：刘汝军

联系人：孙恺

客户服务电话：400-698-9898

公司网址：www.xsdzq.cn

#### 22) 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：宫少林

联系人：林生迎

联系电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

客户服务电话：95565, 400-888-8111

公司网址：www.newone.com.cn

#### 23) 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：黄耀华

联系人：刘阳

传真：0755-83515567

客户服务电话：0755-33680000 400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

#### 24) 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：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 20 层

法定代表人：兰荣

联系人：黄英

联系电话：0591-38162212

客户服务电话：95562

公司网址: [www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

25) 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

客服电话: 95553, 400-8888-001

联系电话: 021-23219000

公司网站: [www.htsec.com](http://www.htsec.com)

26) 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: 020-961303

联系电话: 020-88836999

传真: 020-88836654

联系人: 林洁茹

网址: [www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

27) 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)

传真: 0591-87383610

联系人: 张宗锐

公司网站: [www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

28) 国信证券股份有限公司

注册地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人: 何如

客服电话: 95536

联系人：周杨

联系电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

公司网站：www.guosen.com.cn

29) 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：陆涛

客户服务电话：400-888-8228

传真：0755-83025625

联系人：马贤清

网站：www.jyzq.cn

30) 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

传真：021-68767981

联系人：朱磊

公司网站：www.tebon.com.cn

31) 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

联系电话：0755-82825551

网址：www.essence.com.cn

32) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 楼  
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  
电话：021-20333333  
传真：021-50498825  
公司网络地址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)  
客服电话：95531, 400-888-8588

33) 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）  
法定代表人：常喆  
客户服务电话：400-818-8118  
网址：[www.guodu.com](http://www.guodu.com)

34) 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  
联系电话：0731-84403319  
开放式基金业务传真：0731-84403439  
网址：[www.cfzq.com](http://www.cfzq.com)

35) 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  
法定代表人：胡运钊  
客户服务热线：95579 或 400-888-8999  
联系人：李良  
电话：027-65799999  
传真：027-85481900  
长江证券客户服务网站：[www.95579.com](http://www.95579.com)

36) 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

法定代表人：冉云

客服电话：95310

公司网址：www.gjq.com.cn

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系电话：028-86690057、028-86690058

传真号码：028-86690126

37) 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：王东明

公司网址：www.citics.com

客服热线：95548

38) 西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

办公地址：陕西省西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

公司网址：www.westsecu.com

客服热线：95582

39) 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大厦 7 层、8 层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7 层、8 层，深圳市华侨城深南大道 9010 号

法定代表人：吴永良

公司网址：www.zszq.com

客服热线：400-102-2011

40) 九州证券股份有限公司

注册地址：西宁市城中区西关大街 11 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：曲国辉  
公司网址：www.jzsec.com  
客服热线：400-654-3218

41) 江海证券有限公司

注册地址：黑龙江哈尔滨市香坊区赣水路 56 号  
办公地址：黑龙江哈尔滨市香坊区赣水路 56 号  
法定代表人：孙名扬  
联系人：周俊  
电话：0451-85863726  
传真：0451-82337279  
公司网址：www.jhzq.com.cn  
客服热线：400-666-2288

42) 万联证券有限责任公司

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 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层  
法定代表人：张建军  
公司网址：www.wlzq.com.cn  
客服热线：400-888-8133

43) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 20 层  
办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼第 20 层  
法定代表人：杨宝林  
公司网址：www.citicssd.com  
客服热线：95548

44) 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

公司网址: [www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

客服热线: 400-809-6096

45) 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

公司网址: [www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

客服电话: 400-990-8826

46) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

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](http://www.noah-fund.com)

客服热线: 400-821-5399

47) 深圳众禄金融控股股份有限公司

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](http://www.zlfund.cn); [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

客服热线: 4006-788-887

48) 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](http://www.ehowbuy.com)

客服热线: 400-700-9665

49) 杭州数米基金销售有限公司



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  
网址：<http://www.fund123.cn/>

50) 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  
网站：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

51) 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  
公司网站：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

52) 和讯信息科技有限公司  
注册地址：北京市朝阳区大街 22 号泛利大厦 10 层  
办公地址：北京市朝阳区大街 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  
全国统一客服热线：400-920-0022/021-20835588  
公司网址：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

53) 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

全国统一客服热线: 400-888-6661

公司网址: [www.myfund.com](http://www.myfund.com)

54) 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

客户服务热线: 4008-773-772

公司网址: [www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

55) 一路财富(北京)信息科技有限公司

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

全国统一客服热线: 400-001-1566

公司网址: [www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

56) 上海汇付金融服务有限公司

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

全国统一客服热线: 400-820-2819

公司网址: <https://tty.chinapnr.com>

57) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

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

客户服务热线: 400-821-9031

公司网址: [www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

58) 大泰金石投资管理有限公司

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

地址: 上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人: 袁顾明

客户服务热线: 400-928-2266

公司网址: <http://www.dtfortune.com>

59) 浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址: 浙江省杭州市拱墅区登云路 45 号 (锦昌大厦) 1 幢 10 楼 1001 室

地址: 浙江省杭州市拱墅区登云路 45 号 (锦昌大厦) 1 幢 10 楼 1001 室

法定代表人: 徐黎云

客户服务热线: 400-068-0058

公司网址: <http://www.jincheng-fund.com>

60) 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#

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

客户服务热线: 400-166-1188

公司网址: <http://money.jrj.com.cn>

61) 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

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

客户服务热线: 400-046-6788

公司网址: <http://www.66money.com>

62) 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

法定代表人: 钟斐斐

客服热线：4000-618-518

网址：www.ncfjj.com

63) 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：<http://www.buyfunds.cn>

客服热线：400-027-9899

64) 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

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

客户服务热线：4008-980-618

公司网址：[www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

65) 北京广源达信投资管理有限公司

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：<http://www.niuguwang.com>

客服热线：400-623-6060

66) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

法定代表人：蒋煜

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

公司网址：[www.gscaifu.com](http://www.gscaifu.com)

客服热线：400-818-8866

67) 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  
法定代表人：李昭琛  
客服电话：010-62675369  
公司网址：<http://www.xincai.com/>

68) 珠海盈米财富管理有限公司  
注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491  
法定代表人：肖雯  
客服电话：020-89629066  
公司网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

69) 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  
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  
电话：021-65370077-209  
公司网站：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

70) 北京汇成基金管理有限公司  
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  
网址：[www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

71) 上海云湾投资管理有限公司  
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  
法定代表人：戴新装  
企业类型：有限责任公司  
营业期限：持续经营  
客服电话：400-820-1515

网址: [www.zhengtongfunds.com](http://www.zhengtongfunds.com)

72) 上海万得投资顾问有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人: 王廷富

注册资本: 人民币 2000 万元

企业类型: 有限责任公司

电话: 021-51327185

传真: 021-50710161

73) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

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: 95518/400-888-8816

公司网址: <http://fund.jd.com>

74) 天津国美基金销售有限公司

注册地址: 天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层 202-124 室

办公地址: 天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层 202-124 室

法定代表人: 丁东华

公司网址: [www.gomefund.com](http://www.gomefund.com)

客服热线: 400-111-0889

75) 北京格上富信投资顾问有限公司

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

客户服务电话: 400-066-8586

公司网址: [www.igesafe.com](http://www.igesafe.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: 北京市天达共和律师事务所

注册地址: 北京市朝阳区麦子店街37号盛福大厦1930室

办公地址: 北京市朝阳区麦子店街37号盛福大厦1930室

负责人: 李东明

电话: 010-85276468

传真: 010-85275038

经办律师: 韩津生、张璇

联系人: 张璇

## (四) 审计基金财产的会计师事务所

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

经办注册会计师: 单峰、庞伊君

联系电话: (021) 23238888

传真: (021) 23238800

联系人: 庞伊君

## 四、基金的名称

泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式混合型证券投资基金

## 五、基金的类型

本基金类型：混合型发起式证券投资基金

本基金运作方式：契约型，本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式

本基金存续期：不定期

## 六、基金份额开放期与封闭期

### （一）基金的封闭期

本基金的首个封闭期为自基金合同生效日（包括基金合同生效日）起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务。

本基金在封闭期内采取封闭运作模式。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

### （二）基金的开放期

本基金每三个月开放一次，每次开放期不超过 5 个工作日，每个开放期所在月份为基金合同生效日所在月份后续每三个日历月中最后一个日历月，每个开放期的首日为当月沪深 300 股指期货交割日前五个工作日的第一个工作日。

如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日次日起，继续计算该开放期时间，直到满足开放期的时间要求。开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准，基金管理人最迟应于开放期开始前 2 日进行公告。

## 七、基金的投资

灵活运用多种绝对收益策略，对冲各类系统性风险，力争为投资者实现稳定的投资收益。

## 八、基金的投资范围

本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票），股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金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）。



本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%—120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。

开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。

开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。

本基金不受证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第（一）项、第（三）项、第（五）项及第（七）项的限制。

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。

## 九、基金的投资策略

本基金采用以市场中性投资策略为主以其他多种 Alpha 策略为辅构建多策略组合的多种绝对收益策略，通过利用股指期货和其他多种衍生品工具剥离系统性风险，力争实现稳定的绝对回报。

### 1、市场中性投资策略

本基金采用包含基本面、市场信息的多维量化选股模型构建多头股票组合，结合多种市场中性策略匹配合适的空头工具，剥离系统性风险。

#### （1）多头股票投资策略

本基金对公司基本面研究信息、财务信息、市场信息、投资者情绪信息等多方面数据进行处理和数量化研究，构建多种 alpha 信号，采用数量化风险模型对组合进行优化，构造与对冲标的风险结构类似的多头股票组合。

多种超额收益信息来源是获得稳定对冲收益的核心。通过数量模型方法分析上市公司的成长能力、估值、盈利能力、公司治理能力、流动性、动量等因素，结合市场情绪，构建多种低相关的超额收益来源，可以充分分散组合的超额收益波动风险，获取相对稳定的超额收益。

数量化风险模型是使超额收益稳定的必要工具。该基金管理通过分析市场风险结构，建立了以基本面数据为基础的风险模型以控制主动风险和个股预期波动率，

从估值, 成长, 波动性, 盈利质量等因素出发并结合细化的行业分类对风险要素进行分析, 结合对预期收益的分析和对冲工具的选择, 尽量对冲掉各类对基金业绩具有显著不确定性影响的风险因素, 在风险暴露允许的范围内采用量化模型优化组合, 最大化的体现 alpha 信息, 以确保组合在各种风格轮动的市场环境下均有较稳定的回报。同时, 本基金通过数量化风险模型估算组合暴露风险, 做合理的风险预算, 控制组合的下行风险。

在行业和市场风格层面, 该基金将通过对市场风格特征的监控, 对行业基本面变化的研究以及投资者对市场情绪的认识偏差的研究进行有限风险预算下的行业偏离和风格偏离, 通过超低配行业权重和风格偏离获取超额收益。

### (2) 空头工具投资策略

现阶段本基金将利用股指期货剥离多头股票部分的系统性风险。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。

### (3) 事件驱动策略

本基金将通过对中国宏观经济和上市公司的研究, 通过定量模型的监控, 提前发掘对行业或者个股具有明显驱动和定价作用的事件性因子, 通过因子的筛选和配比构建事件类策略的股票池并通过风险模型充分评估和考量个股对整体组合所带来风险的前提下构建最终的投资组合。

## 2、其他绝对收益策略

本基金采用股指期货套利的对冲策略寻找和发现市场中资产定价的偏差, 捕捉绝对收益机会。同时, 本基金根据市场情况的变化, 灵活运用其他绝对收益策略

(如统计套利策略、定向增发套利策略、大宗交易套利、并购套利策略等) 策略提高资本的利用率, 从而提高绝对收益, 达到投资策略的多元化以进一步降低本基金收益的波动。

### (1) 股指期货套利策略

股指期货套利策略是指积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系, 进行套利, 以获取绝对收益。股指期货套利包括以下两种方式:

#### ①期现套利

期现套利过程中, 由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动, 套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

#### ②跨期套利

跨期套利过程中，不同期货合约之间的价差不断变动，套利交易通过捕捉合约间价差进而获利。

#### （2）其他绝对收益策略

基金经理会实时关注市场的发展，前瞻性地运用其他绝对收益策略。

### 3、其他投资策略

#### （1）债券投资策略

本基金在债券投资方面，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

#### （2）衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、权证等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。

### （四）投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在80%—120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；

（2）开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%；

（3）开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制；

（4）本基金持有一家公司的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；

（5）本基金管理人管理的全部基金持有一家发行的证券，不超过该证券的10%；

（6）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（7）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

- (8) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- (9) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (10) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (11) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (12) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (13) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (14) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (15) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- (16) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%（封闭期内，本基金不受上述 140%的限制，但基金总资产不得超过基金净资产的 200%）；
- (17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。
- 因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。
- 基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定；在此期间内，基金的投资目的、投资范围、投资策略应当符合基金合同约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。
- 如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

法律法规或监管部门调整上述规定的，本基金的投资按照调整后的规定执行。

#### 十、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率+2%

如果相关法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经基金管理人与基金托管人协商，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，而无须召开基金份额持有人大会。

#### 十一、风险收益特征

本基金为特殊的混合型基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于绝对收益策略投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。

#### 十二、基金的投资组合报告（未经审计）

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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年11月30日复核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2016年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

##### 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 190,089,876.71 53.20

其中：股票 190,089,876.71 53.20

2 基金投资	--
3 固定收益投资	--
其中：债券	--
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	38,800,000.00 10.86
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	95,361,068.19 26.69
8 其他资产	33,089,294.70 9.26
9 合计	357,340,239.60 100.00

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

### (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	2,667,352.40	0.89
B	采矿业	9,850,862.00	3.27
C	制造业	102,194,526.37	33.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,301,538.00	1.76
E	建筑业	4,175,776.11	1.39
F	批发和零售业	8,185,245.56	2.72
G	交通运输、仓储和邮政业	5,390,553.40	1.79
H	住宿和餐饮业	--	
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,418,537.63	4.13
J	金融业	13,757,902.41	4.57
K	房地产业	16,017,896.70	5.32
L	租赁和商务服务业	3,073,454.00	1.02
M	科学研究和技术服务业	1,768,795.00	0.59
N	水利、环境和公共设施管理业	802,604.13	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	--	

R 文化、体育和娱乐业 2,589,533.00 0.86

S 综合 1,895,300.00 0.63

合计 190,089,876.71 63.16

(2) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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 002466 天齐锂业 66,440 2,528,042.00 0.84

2 600503 华丽家族 235,100 2,311,033.00 0.77

3 300253 卫宁健康 100,440 2,189,592.00 0.73

4 600736 苏州高新 226,800 2,156,868.00 0.72

5 002340 格林美 306,100 2,118,212.00 0.70

6 002190 成飞集成 60,600 2,117,970.00 0.70

7 601012 隆基股份 152,887 2,063,974.50 0.69

8 601009 南京银行 198,600 2,037,636.00 0.68

9 600138 中青旅 98,800 2,021,448.00 0.67

10 600547 山东黄金 52,500 2,004,975.00 0.67

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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。

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。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IC1611	中证 500 股指期货	IC1611 合约	-10 -12,470,800.00	-25,880.00	-
IF1612	中证 500 股指期货	IC1612 合约	-26 -32,018,480.00	-4,150,076.36	-
IC1703	中证 500 股指期货	IC1703 合约	-70 -82,807,200.00	-2,232,880.00	-
IF1612	沪深 300 股指期货	IF1612 合约	-10 -9,586,800.00	-922,788.00	-
IF1703	沪深 300 股指期货	IF1703 合约	-21 -19,703,800.00	-186,360.00	-
公允价值变动总额合计 (元)				-7,517,984.36	
股指期货投资本期收益 (元)				-3,631,386.31	
股指期货投资本期公允价值变动 (元)				-3,345,013.69	

## (2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金采用股指期货套利的对冲策略寻找和发现市场中资产定价的偏差，捕捉绝对收益机会。股指期货套利策略是指积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系，进行套利，以获取绝对收益。股指期货套利包括以下两种方式：

### ①期现套利

期现套利过程中，由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动，套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

### ②跨期套利

跨期套利过程中，不同期货合约之间的价差不断变动，套利交易通过捕捉合约间价差进而获利。

## 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### (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。

### (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。

### (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。

## 11. 投资组合报告附注

(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，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

(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。



(3) 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 33,076,315.91

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 12,978.79

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 33,089,294.70

(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) 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。

(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。

### 十三、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2015年11月17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：

(一) 截止2016年9月30日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：

泰达宏利绝对收益混合

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

2015年11月17日至2015年12月31日 0.20% 0.09% 0.43% 0.01% -0.23%

0.08%

2016年1月1日至2016年9月30日 -0.70% 0.20% 2.62% 0.01% -3.32% 0.19%

本基金合同生效之日起至2016年9月30日 -0.50% 0.19% 3.05% 0.01% -3.55%

0.18%

本基金业绩比较基准：一年期银行定期存款收益率(税后)+2%

(二)自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动的比较

泰达宏利绝对收益混合基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2015年11月17日至2016年9月30日)

本基金成立于2015年11月17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。

#### 十四、基金的费用与税收

##### (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及维护费用;
- 7、基金的证券交易费用;
- 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

基金管理人的管理费为基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费之和。其中,基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费计提方法、计提标准和支付方式如下:

(1) 基金管理人的基本管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1 %年费率计提。基本管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金基本管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金基本管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(2) 基金管理人的附加管理费

1) 附加管理费是在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提；提取评价日是指每次基金封闭期的最后一个工作日；提取日是指符合附加管理费计提条件，基金管理人计提附加管理费的提取评价日；基金管理人须在同时满足以下条件的前提下，才可提取附加管理费：

1 符合基金收益分配条件；

2 提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值须大于上一提取日的基金份额累计净值  $\times (1+B)$ 。

B 为上一提取日（不含该日）到本提取评价日（含该日）期间内业绩比较基准的收益率，即：

，  
为上一提取日（不含该日）到本提取评价日（含该日）期间的第 i 个自然日时业绩比较基准的年化收益率，n 为上一提取日（不含该日）到本提取评价日（含该日）期间的自然日天数；

3 按照“新高法原则”提取超额收益的 10%作为附加管理费：即提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值必须超过以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和 1 的孰高者，管理人才能收取附加管理费，附加管理费按照下述公式计算并收取。

2) 附加管理费的计算方法和提取

在同时满足以上附加管理费提取条件的情况下，附加管理费的计算方法为：

附加管理费=

其中：

为本提取日提取附加管理费前的基金份额累计净值；

；

为上一提取日的基金份额累计净值，其中首次封闭期的为 1；

为本提取日的基金份额=本提取日基金总份额÷本提取日的折算因子；

特定日期的折算因子为相应日期（包括当日）之前所有折算系数的乘积；

折算系数=基金折算日除权前基金份额净值÷基金折算日除权后基金份额净值；

附加管理费在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 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，顺延至最近可支付日支付。

## 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：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

上述“一、基金费用的种类中第 3—10 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，酌情调低基金管理费率、基金托管费率或根据基金合同约定，删除本基金的附加管理费，无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率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 个工作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项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十五、对招募说明书更新部分的说明

（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“三、基金管理人”中，基金管理人概况、监事会成员、基金经理等部分进行更新。

（三）“四、基金托管人”部分进行了更新。

（四）“五、相关服务机构”中，更新直销机构、代销机构及补充第三方销售机构。

（五）“十、基金的投资”部分投资组合报告内容更新至2016年9月30日。

（六）“十一、基金的业绩”部分对基金业绩更新至2016年9月30日，并更新了历史走势对比图。

（七）更新了“二十三、其他应披露事项”部分内容。

泰达宏利基金管理有限公司

2016年12月30日