

泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金周期类行业混合型证券投资基金、稳定类行业混合型证券投资基金更新

招募说明书（摘要）

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

重要提示

泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金于 2003 年 2 月 13 日获中国证监会证监基金字【2003】21 号文批准募集，基金合同于 2003 年 4 月 25 日正式生效。

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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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。

投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示本基金的未来表现。

本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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其它有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本更新招募说明书已经本基金托管人交通银行股份有限公司复核，所载内容截止日为 2015 年 10 月 25 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2015 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

公司名称：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：1.8亿元人民币

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、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、泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金、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在内的三十多只证券投资基金。

（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。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。何先生毕业于英国伦敦城市大学，取得精算学荣誉理学学士学位，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。毕业于美国卡内基美隆大学，持有数学及管理科学理学学士学位，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，掌握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，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《信托法》、《证券投资基金法》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、研究部总监业务助理兼研究员、研究部副总监、基金经理，现任投资副总监兼研究部总监；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。

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。

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

(1) 泰达成长基金：

周琦凯先生，2010年7月加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于研究部，负责建筑建材、传媒互联网行业研究，曾先后担任助理研究员、研究员、高级研究员等职务；2015年5月14日至今担任本基金基金经理；5年证券从业经验，5年证券投资基金管理经验，具有基金从业资格。

邓艺颖女士，简历同上。2014年8月18日至今担任泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金基金经理；2015年4月3日至今担任泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金基金经理；2015年8月11日至今担任本基金基金经理。

该基金历任基金经理：自2003年4月至2005年4月由刘青山先生担任基金经理；自2005年4月起至2008年8月由梁辉先生担任基金经理；自2008年8月起至2010年1月由王勇先生担任基金经理；自2010年1月至2011年5月由李源女士担任基金经理。自2011年4月至2013年5月由梁辉先生担任基金经理；自2011年6月至2015年4月由邓艺颖女士担任基金经理；自2014年11月至2015年6月由陈炜先生担任基金经理。

(2) 泰达周期基金：

吕越超先生，泰达周期基金基金经理，金融学硕士。2010年7月至2010年12月就职于长江证券，担任机械行业分析师；2010年12月加盟泰达宏利基金管理有限公司，担任研究员；2014年11月21日起担任本基金基金经理；5年证券从业经验，具有基金从业资格。

该基金历任基金经理：自2003年4月至2004年7月由曾昭雄先生担任基金经理；自2004年7月至2005年2月由史博先生担任基金经理；自2005年2月至2007年4月由温震宇先生担任基金经理。自2007年3月20日至2008年8月5日，由魏延军先生担任基金经理；自2007年11月至2009年5月，由梁辉先生担任基金经理；自2009年3月至2011年3月，由吴俊峰先生担任基金经理。自2010年3月至2013年7月，由刘金玉先生担任基金经理；自2011年3月至2014年11月，由陈桥宁先生担任基金经理。

(3) 泰达稳定基金：

陈丹琳女士，泰达稳定基金经理，经济学硕士。2007年7月加入泰达宏利基金管理有限公司，曾担任研究员、研究主管等职务，现任研究部总经理助理一职；自

2014年1月6日起担任本基金基金经理；自2015年4月起担任泰达宏利行业精选股票型证券投资基金基金经理；7年证券从业经验，7年证券投资基金管理经验，具有基金从业资格。

该基金历任基金经理：自2003年4月至2005年4月由康赛波担任基金经理；自2005年4月至2005年9月由吴剑飞担任基金经理；自2005年9月至2009年6月由李泽刚担任基金经理；自2009年6月至2013年8月由胡涛担任基金经理；自2009年12月至2014年1月由焦云女士担任基金经理

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员包括公司总经理刘建，投资总监王彦杰，投资副总监兼研究部总监邓艺颖、金融工程部门负责人戴洁，固定收益部门负责人卓若伟，资深基金经理吴华组成。督察长张萍列席会议。

投资决策委员会根据决策事项，可分类固定收益类事项、权益类事项、其它事项：

- (1) 固定收益类事项由刘建、王彦杰、卓若伟表决。
- (2) 权益类事项由刘建、王彦杰、邓艺颖、戴洁、吴华表决。
- (3) 其它事项由全体成员参与表决。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

一、基金托管人基本情况

(一) 基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：牛锡明

住所：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

邮政编码：200120

注册时间：1987年3月30日

注册资本：742.62亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：汤嵩彦

电话：021-95559

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国发钞行

之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005年6月，交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2014年《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第19位，跻身全球银行20强；根据《财富》杂志发布的“世界500强公司”排行榜，交通银行位列第217位。2014年荣获《首席财务官》杂志评选的“最佳资产托管奖”。

截至2015年3月31日，交通银行资产总额达到人民币6.63万亿元，实现净利润人民币189.7亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

（二）主要人员情况

牛锡明先生，董事长、执行董事。

牛先生2013年10月至今任本行董事长、执行董事，2013年5月至2013年10月任本行董事长、执行董事、行长，2009年12月至2013年5月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生1983年毕业于中央财经大学金融系，获学士学位，1997年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业，获硕士学位，1999年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生，副董事长、执行董事、行长。

彭先生2013年11月起任本行副董事长、执行董事，2013年10月起任本行行长；2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长；2004年9月至2005年8月任本行副行长；2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助理；2001年9月至2004年6月任本行行长助理；1994年至2001年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生1986年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

刘树军先生，资产托管业务中心总裁。

刘先生2014年4月至今任本行资产托管业务中心总裁，2012年5月至2014年4月任本行资产托管部总经理，2011年10月至2012年5月任本行资产托管部副总经理。2011年10月前历任中国农业银行长春分行办公室主任、农行总行办公室正处级秘书，农行总行信贷部工业信贷处处长，农行总行托管部及养老金中心

副总经理，本行内蒙古分行副行长。刘先生为管理学硕士，高级经济师。

（三）基金托管业务经营情况

截止 2015 年二季度末，交通银行共托管证券投资基金 132 只。此外，还托管了基金公司特定客户资产管理计划、银行理财产品、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、信托计划、养老保障管理基金、企业年金基金、金库宝资产保管、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产、QDLP 资金、证券公司客户资产管理计划、客户资金等产品。

三、相关服务机构

（一）直销机构

泰达宏利基金管理有限公司

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

邮编：100033

传真：010-66577760/61

客户服务电话：400-698-8888（免长话费）或 010-66555662

联系人：于贺

联系电话：010-66577619、010-66577617

网址：<http://www.mfcteda.com>

网上直销网址：<https://etrade.mfcteda.com/etrading/>

（二）代销机构

1) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

客服电话：95559

银行网址：www.bankcomm.com

2) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：中国北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客服电话：95588

银行网站：www.icbc.com.cn

3) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

客服电话：95533

银行网站：www.ccb.com

4) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

客服电话：95599

银行网站：www.abchina.com

5) 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

6) 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

7) 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

8) 中国邮政储蓄银行股份有限公司 (泰达成长基金)

注册地址: 北京市西城区金融大街 3 号

办公地址: 北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人: 李国华

联系人: 陈春林

传真: (010) 68858117

客服电话: 95580

网址: www.psbc.com

9) 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

10) 兴业银行股份有限公司

注册地址: 福州市湖东路 154 号

办公地址: 福州市五一中路 32 号元洪大厦

法定代表人: 高建平

客户服务电话: 95561

网站: www.cib.com.cn

11) 中信银行股份有限公司

注册地址: 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址: 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人: 孔丹

客服电话: 95558

网址: <http://bank.ecitic.com>

12) 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：卢国锋

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

13) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：范一飞

开放式基金咨询电话：021-962888

开放式基金业务传真：021-68476111

网址：www.bankofshanghai.com

14) 渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号

办公地址：天津市河西区马场道 201-205 号

法定代表人：刘宝凤

电话：022-58316666

传真：022-58316259

联系人：王宏

客户服务热线：400 888 8811

公司网站：www.cbhb.com.cn

15) 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：96528（上海地区 962528）

公司网站：www.nbcb.com.cn

16) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

17) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

客户服务电话：95526

公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

18) 温州银行股份有限公司

注册地址：温州市车站大道 196 号

办公地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

电话：0577-88990082

传真：0577-88995217

联系人：林波

客户服务热线：浙江省 96699，上海 962699，其他地区（0577）96699

公司网站：www.wzbank.cn

19) 天津银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区友谊路 15 号

办公地址：天津市河西区友谊路 15 号

法定代表人：王金龙

电话：022-28405330

传真：022-28405631

联系人：杨森

客户服务热线：4006-960296

公司网站：www.bank-of-tianjin.com

20) 花旗银行（中国）有限公司（泰达稳定基金）

注册地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦主楼 28 楼 01A 单元和

02A 单元、29 楼 02 单元、30 楼 01 单元、32 楼 01 单元和 01B 单元、33 楼 01 单元和 03 单元、34 楼 01 单元及 35 楼。

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦主楼 28 楼 01A 单元和 02A 单元、29 楼 02 单元、30 楼 01 单元、32 楼 01 单元和 01B 单元、33 楼 01 单元和 03 单元、34 楼 01 单元及 35 楼。

法定代表人：欧兆伦（AU SIU LUEN）

个人客户服务中心电话：800-830-1880

机构客户服务中心电话：800-820-1268

公司网站：www.citibank.com.cn

21) 大华银行（中国）有限公司（泰达成长基金）

注册地址：上海市浦东新区东园路 111 号 1 层 105 单元，2 层，3 层

办公地址：上海市浦东新区东园路 111 号 1 层 105 单元，2 层，3 层

法定代表人：黄一宗

客服电话：400-888-6826

银行网站：<http://www.uobchina.com.cn>

22) 星展银行（中国）有限公司（泰达成长基金）

注册地址：上海市上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号 1301、1801 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号 1301、1801 单元

法定代表人：葛甘牛

客服电话：400-820-8988

银行网站：www.dbs.com.cn

23) 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

24) 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@bhq.com

客户服务电话：4006515988

网址：www.bhq.com

25) 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

26) 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：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、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

27) 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

28) 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：上海市浦东新区银城中路 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

29) 平安证券有限责任公司

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

30) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-23 层、25 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

客服电话：95503

联系人：胡月茹

公司网站：www.dfzq.com.cn

31) 世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：姜昧军

联系人：袁媛

客服电话：0755-83199511

公司网站：www.csc.com.cn

32) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系电话：021-33389888

客服电话：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

33) 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
2005 室

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

34) 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

35) 中银国际证券有限责任公司

注册地址:上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址:上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 40 层

法定代表人:许刚

客服电话:4006208888

传真:021-50372474

联系人:王炜哲

公司网站:www.bocichina.com

36) 华泰证券股份有限公司

注册地址:江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址:江苏省南京市建邺区江东中路 228 号、深圳市福田区深南大道

4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人:吴万善

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

37) 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

38) 新时代证券有限责任公司

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

39) 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：95565，4008888111

公司网址：www.newone.com.cn

40) 长城证券有限责任公司

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

41) 南京证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

办公地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

法定代表人：张华东

联系人：潘月

联系电话：025-52310569

客户服务电话：400-828-5888

公司网址：www.njzq.com.cn

42) 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

43) 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

联系人：金芸、李笑鸣

联系电话：021-23219000

公司网站：www.htsec.com

44) 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 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

45) 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

46) 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

公司网站：www.guosen.com.cn

47) 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：4008-888-228

传真：0755-83025625

联系人：马贤清

网站：www.jyzq.cn

48) 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：4008888128

传真：021-68767981

联系人：朱磊

公司网站：www.tebon.com.cn

49) 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 层、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 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：王连志

客服电话：4008001001

联系人：陈剑虹

联系电话：0755-82825551

网址：www.essence.com.cn

50) 东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 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：刘化军

联系人：王一彦

电话：021-20333333

传真：021-50498825

公司网络地址：www.longone.com.cn

客服电话：95531，400-888-8588

51) 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

52) 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

53) 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 4008-888-999

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

54) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

公司地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

法定代表人：雷杰

客户服务热线：95571

网址：www.foundersc.com

55) 民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

法定代表人：余政

公司网址：www.msyzq.com

客服热线：4006198888

56) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

公司网址：www.gjzq.com.cn

客服热线：400-660-0109

57) 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：95558

58) 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发展大楼 7 层、8 层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 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：4001022011

59) 西藏同信证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市北京中路 101 号

办公地址：上海市永和路 118 弄 24 号楼

法定代表人：贾绍君

公司网址：www.xzsec.com

客服热线：400-881-1177

60) 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

61) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座

办公地址：北京市金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

客服电话：010-66045678

联系人：林爽

公司网址：www.txsec.com

62) 红塔证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

办公地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人：况雨林

公司网址：www.hongtastock.com

客服热线：400-871-8880

63) 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：余维佳

公司网址：www.swsc.com.cn

客服热线：400-809-6096

64) 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

客服热线: 400-821-5399

65) 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: 深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

法定代表人: 薛峰

公司网址: www.zlfund.cn; www.jjmmw.com

客服热线: 4006-788-887

66) 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

客服热线: 400-700-9665

67) 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海曙路东 2 号

办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人: 陈柏青

客服电话: 4000-766-123

网址: <http://www.fund123.cn/>

68) 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

69) 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：021-20691942

传真：021—20691861

客服电话：400-820-2899

公司网站： www.erichfund.com

70) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：耿杰

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

71) 北京展恒基金销售有限公司

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

72) 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：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

客户服务热线：4008-773-772

公司网址： www.5ifund.com

73) 中宏人寿保险有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 6 楼

办公地址：上海市虹口区西江湾路 388 号凯德龙之梦虹口广场 B 栋 11 楼

法定代表人：何达德 (Michael Edward Huddart)

公司网址: www.manulife-sinochem.com

客服热线: 4008188888

(三) 注册登记机构

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

电话: 010-66577769

传真: 010-66577750

(四) 律师事务所

名称: 上海源泰律师事务所

注册地址: 上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人: 廖海

电话: (021) 51150298

传真: (021) 51150398

经办律师: 廖海

(五) 会计师事务所

名称: 普华永道中天会计师事务所有限公司(特殊普通合伙)

住所: 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: 上海市卢湾区湖滨路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

联系电话: (021) 23238888

传真: (021) 23238800

经办注册会计师: 单峰、庞伊君

联系人: 庞伊君

四、基金的名称

泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金、周期类行业混合型证券投资基金、稳定类行业混合型证券投资基金。

五、基金的类型

契约型开放式。

六、基金的投资目标

泰达成长、泰达周期、泰达稳定分别主要投资于成长、周期、稳定三个行业类别中内在价值被相对低估，并与同行业类别上市公司相比具有更高增长潜力的上市公司。在有效控制投资组合风险的前提下，为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。

七、基金的投资方向

泰达成长、泰达周期、泰达稳定是三只相互独立的行业类别证券投资基金，共同构成本系列基金。本系列基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括投资于国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。泰达成长、泰达周期、泰达稳定的股票投资部分分别主要投资于成长、周期、稳定三个行业类别中依据市净率（P/B）和市盈率与每股预期收益增长率之比（PEG）所确定的具有增长潜力的价值型股票，即本系列基金所定义的价值优化型股票。在股票投资中严格遵循：（1）各行业类别基金投资于该基金类型所对应行业类别股票的比重不低于该基金股票净值的80%（一级市场认购股票除外）；（2）各只行业类别基金的股票投资以价值优化型股票为主要投资对象。

根据中国证监会公布的行业划分标准，及对各行业与宏观经济发展的相关性分析，本系列基金管理人将各行业分类如下：

成长类 周期类 稳定类

C39 计算机、通信和其他电子设备制造业 C17 纺织业 C13 农副食品加工业

C27 医药制造业 C18 纺织服装、服饰业 C14 食品制造业

I 信息传输、软件和信息技术服务业 C19 皮革、毛皮、羽毛及其制品和制鞋业

C15 酒、饮料及精制茶制造业

R 文化、体育和娱乐业 C22 造纸及纸制品业 C16 烟草制品业

C23 印刷和记录媒介复制业 C20 木材加工及木、竹、藤、棕、草制品业

C25 石油加工、炼焦及核燃料加工业 C21 家具制造业

C26 化学原料及化学制品制造业 C24 文教、工美、体育和娱乐用品制造业

C28 化学纤维制造业 C42 废弃资源综合利用业

C29 橡胶和塑料制品业 A 农、林、牧、渔业
C30 非金属矿物制品业 D 电力、热力、燃气及水的生产和供应业
C31 黑色金属冶炼及压延加工业 F 批发和零售业
G32 有色金属冶炼及压延加工业 G 交通运输、仓储和邮政业
C33 金属制品业 J 金融业
C34 通用设备制造业 L 租赁和商务服务业
C35 专用设备制造业 P 教育
C36 汽车制造业 Q 卫生和社会工作
C37 铁路、船舶、航空航天和其他运输设备制造业 H 住宿和餐饮业
C38 电气机械及器材制造业 N 水利、环境和公共设施管理业
C40 仪器仪表制造业 M73 研究和试验发展
C41 其他制造业 M74 专业技术服务业
C42 废弃资源综合利用业
C43 金属制品、机械和设备修理业
E 建筑业
K 房地产业
B 采矿业

注：1、表中代码为中国证监会行业指定代码。

2、国际上通常将行业划分为成长、周期、稳定及能源四个类别。由于能源类企业生产中间产品，为制造业及消费者提供最基本的生产资料，并且我国目前能源类上市公司数量较少、总体公司市值较低，因此将能源类行业一采掘业归入周期类。

泰达成长基金的投向除成长类所包括的 5 个行业外，还包括分布在其他行业类别中受国家产业政策重点支持和鼓励发展的高新技术行业，如新技术、新材料、高新农业及环境保护等。

综合类上市公司中，若其在某一行业类别中的业务收入占主营业务收入的 50%以上，则该上市公司归入相应行业类别基金投资范围。

基金管理人可以根据国家有关部门或权威机构行业划分标准，及各行业与宏观经济发展相关性的变化，对各行业类别基金所覆盖的相关行业进行适当调整，但须

及时予以披露。

除非主管部门或权威机构的行业划分规则发生改变，本系列基金管理人不会主动改变本系列基金的行业归类。

八、基金的投资策略

本系列基金每只行业类别基金采用“自上而下”的投资方法，具体体现在资产配置、行业配置和个股选择的全过程中。

本系列基金管理人根据对宏观经济变化、资本市场发展动态及行业结构调整的分析判断，确定本系列基金每只行业类别基金在股票、债券、现金和其它投资品种间的资产配置比例，并通过对国家产业政策、行业发展状况的分析研究，确定各行业类别基金的行业配置比例。

在资产配置、行业配置完成后，基金管理人主要通过 P/B、PEG 指标来确定价值优化型股票，在个股 PEG 值计算中，本系列基金管理人从以下几个方面评估上市公司的每股预期收益增长率 G：

？ 公司的商业模式

？ 所处行业发展前景

？ 产品市场前景分析，包括产品本身市场分析、主要竞争对手、上下游产品关联性及定价能力、替代产品分析等

？ 公司的核心竞争力分析，包括管理者素质、市场营销能力、技术创新能力、专有技术、特许权、品牌、重要客户等

？ 公司财务状况及财务管理能力，包括财务安全性指标，反映行业特性的主要财务指标、公司股权与债权融资能力与成本分析、公司再投资收益率分析等

？ 公司潜在风险及应对措施

以价值优化型股票为基础，结合考虑满足以下条件的相关股票，组成本系列基金股票备选库：

- i. 股票 P/B、PEG 某单项指标特优，另一项指标未能反映其真实状况。
- ii. 上市公司资产重组或生产经营管理方面发生重大改变，将可能会对公司经营业绩和未来发展前景产生重大和实质性影响。
- iii. 公司拥有未被市场认识的或被市场低估的资源，导致公司会计帐面值低于公司内在价值。
- iv. 研究部利用其它股票定价模型分析确定的投资价值被严重低估的股票。

基金经理在股票备选库的范围内进行股票投资。

九、基金的业绩比较基准

泰达成长：65%×富时中国 A600 成长行业指数+35%×上证国债指数

泰达周期：65%×富时中国 A600 周期行业指数+35%×上证国债指数

泰达稳定：65%×富时中国 A600 稳定行业指数+35%×上证国债指数

十、基金的风险收益特征

本系列基金在证券投资基金中属于较高风险的基金品种。

十一、基金投资组合报告（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。

本基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 11 月 19 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。

本投资组合报告所载数据截止 2015 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

泰达成长基金

1、报告期末基金资产组合（单位：元）

序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益投资 703,576,238.18 70.41

其中：股票 703,576,238.18 70.41

2 基金投资 --

3 固定收益投资 201,810,000.00 20.20

其中：债券 201,810,000.00 20.20

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 64,706,092.08 6.48

8 其他资产 29,108,456.66 2.91

9 合计 999,200,786.92 100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合（单位：元）

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	407,002,712.19	43.17
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	62,042,413.44	6.58
G	交通运输、仓储和邮政业	45,600,994.47	4.84
H	住宿和餐饮业	--	
I	信息传输、软件和信息技术服务业	130,688,994.17	13.86
J	金融业	--	
K	房地产业	22,460,492.21	2.38
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	35,780,631.70	3.80
S	综合	--	
	合计	703,576,238.18	74.63

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明细（单位：元）

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	300207	欣旺达	2,812,178	70,248,206.44	7.45
2	002407	多氟多	1,370,800	50,102,740.00	5.31
3	002594	比亚迪	827,012	49,628,990.12	5.26

4	300016	北陆药业	1,736,600	46,454,050.00	4.93
5	002462	嘉事堂	1,265,208	46,407,829.44	4.92
6	300171	东富龙	2,272,055	45,872,790.45	4.87
7	600446	金证股份	1,644,411	41,784,483.51	4.43
8	000802	北京文化	1,562,473	35,780,631.70	3.80
9	000917	电广传媒	1,702,243	32,853,289.90	3.48
10	300101	振芯科技	1,490,800	32,350,360.00	3.43

4、报告期末按券种分类的债券投资组合（单位：元）

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	100,320,000.00	10.64
2	央行票据	--	
3	金融债券	101,490,000.00	10.77

其中：政策性金融债 101,490,000.00 10.77

4	企业债券	--	
5	企业短期融资券	--	
6	中期票据	--	
7	可转债	--	
8	同业存单	--	
9	其他	--	

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

（单位：元）

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	140347	14 进出 47	500,000	51,300,000.00	5.44
2	019506	15 国债 06	500,000	50,220,000.00	5.33
3	150202	15 国开 02	500,000	50,190,000.00	5.32
4	019509	15 国债 09	500,000	50,100,000.00	5.31

注：以上为本基金本报告期末持有的全部债券投资。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名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

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。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

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。

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。

11、报告附注

(1) 报告期内本基金投资的欣旺达(300207)于2015年7月14日发布《关于收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告》，该公司控股股东王明旺及一致行动人新余市欣明达投资有限公司涉嫌信息披露违规、控股股东王威因减持公司股份涉嫌信息披露违规，分别收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(深证调查通字15087、15088、15089号)。欣旺达于2015年8月21日发布《中国证监会依法严厉查处上市公司大股东及实际控制人违法减持案件》公告，中国证监会拟对该上市公司的实际控制人王明旺进行处罚。

基金管理人分析认为，欣旺达7月份被监管部门立案调查的原因是实际控制人涉嫌信息披露违规，体现了该公司此前在内部管理方面存在的漏洞与不足，但公司自查及改正的态度是端正的，后续处理的情况也基本明朗，该事件不会影响公司后续经营活动的正常开展。我们判断公司本身的经营趋势向好，收入和利润持续快速增长，公司在电子产业和新能源车方向都有快速的业务成长，在前沿业务储能方面也有业务储备，公司整体呈现良好的发展态势。与此同时，公司实际控制

人也在三季度持续进行了增持活动，体现了管理层对上市公司的信心。因此，基金管理人经审慎分析，在本报告期内继续保持对其的投资。

本基金投资的其余九名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(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（单位：元）

序号 名称 金额（元）

1	存出保证金	2,248,901.88
2	应收证券清算款	23,436,282.89
3	应收股利	-
4	应收利息	2,820,373.33
5	应收申购款	602,898.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,108,456.66

(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

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

流通受限情况说明

1	600446	金证股份	41,784,483.51	4.43	重大事项
2	000917	电广传媒	32,853,289.90	3.48	重大事项

(6) 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。

泰达周期基金

1、报告期末基金资产组合（单位：元）

序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益投资 166,536,270.09 73.03

其中：股票 166,536,270.09 73.03

2 基金投资	--
固定收益投资	50,789,000.00 22.27
其中：债券	50,789,000.00 22.27
3 资产支持证券	--
4 贵金属投资	--
5 金融衍生品投资	--
买入返售金融资产	--
6 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	9,635,689.47 4.23
8 其他资产	1,068,661.29 0.47
9 合计	228,029,620.85 100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合（单位：元）

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	138,317,120.16 64.43
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	2,785,450.00 1.30
H 住宿和餐饮业	2,061,600.00 0.96
I 信息传输、软件和信息技术服务业	5,914,062.00 2.75
J 金融业	--
K 房地产业	5,520,640.00 2.57
L 租赁和商务服务业	586,017.00 0.27
M 科学研究和技术服务业	--
N 水利、环境和公共设施管理业	3,264,212.13 1.52
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 8,087,168.80 3.77

S 综合 --

合计 166,536,270.09 77.57

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明细（单位：元）

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	002407	多氟多	534,733	19,544,491.15	9.10
2	300207	欣旺达	607,054	15,164,208.92	7.06
3	002594	比亚迪	204,874	12,294,488.74	5.73
4	300063	天龙集团	244,952	8,695,796.00	4.05
5	002425	凯撒股份	576,874	8,116,617.18	3.78
6	300336	新文化	322,970	8,087,168.80	3.77
7	300171	东富龙	361,800	7,304,742.00	3.40
8	000559	万向钱潮	311,500	6,036,870.00	2.81
9	002108	沧州明珠	398,055	5,946,941.70	2.77
10	300017	网宿科技	112,200	5,914,062.00	2.75

4、报告期末按券种分类的债券投资组合（单位：元）

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	10,011,000.00	4.66
2	央行票据	--	
3	金融债券	40,778,000.00	18.99
其中：政策性金融债 40,778,000.00 18.99			
4	企业债券	--	
5	企业短期融资券	--	
6	中期票据	--	
7	可转债	--	
8	同业存单	--	
9	其他	--	

10 合计 50,789,000.00 23.66

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

(单位:元)

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 110216 11国开16 300,000 30,711,000.00 14.31

2 150206 15国开06 100,000 10,067,000.00 4.69

3 019321 13国债21 100,000 10,011,000.00 4.66

注:上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名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

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期无股指期货持仓和损益明细。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

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。

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。

11、报告附注

(1) 报告期内本基金投资的欣旺达(300207)于2015年7月14日发布《关于收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告》，该公司控股股东王明旺及一致行动人新余市欣明达投资有限公司涉嫌信息披露违规、控股股东王威因减持公司股份涉嫌信息披露违规，分别收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(深证调查通字15087、15088、15089号)。欣旺达于2015年8月21日发布《中国证监会依法严厉查处上市公司大股东及实际控制人违法减持案件》公告，中国证监会拟对该上市公司的实际控制人王明旺进行处罚。

基金管理人分析认为，欣旺达7月份被监管部门立案调查的原因是实际控制人涉嫌信息披露违规，体现了该公司此前在内部管理方面存在的漏洞与不足，但公司自查及改正的态度是端正的，后续处理的情况也基本明朗，该事件不会影响公司后续经营活动的正常开展。我们判断公司本身的经营趋势向好，收入和利润持续快速增长，公司在电子产业和新能源车方向都有快速的业务成长，在前沿业务储能方面也有业务储备，公司整体呈现良好的发展态势。与此同时，公司实际控制人也在三季度持续进行了增持活动，体现了管理层对上市公司的信心。因此，基金管理人经审慎分析，在本报告期内继续保持对其的投资。

本基金投资的其余前九名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(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(单位:元)

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 396,076.50

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 573,831.29

5 应收申购款 98,753.50

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 1,068,661.29

(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) 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。

泰达稳定基金

1、报告期末基金资产组合（单位：元）

序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益投资 73,720,661.71 61.37

其中：股票 73,720,661.71 61.37

2 基金投资 --

3 固定收益投资 30,092,000.00 25.05

其中：债券 30,092,000.00 25.05

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 11,641,309.66 9.69

8 其他资产 4,668,392.87 3.89

9 合计 120,122,364.24 100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合（单位：元）

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 5,711,102.80 4.80

B 采矿业 --

C 制造业 11,823,505.17 9.93

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 18,709,492.10 15.71

G 交通运输、仓储和邮政业 14,855,116.44 12.48

H 住宿和餐饮业 6,848,424.00 5.75

I 信息传输、软件和信息技术服务业 2,264,724.00 1.90

J 金融业 2,840,974.16 2.39
 K 房地产业 --
 L 租赁和商务服务业 10,651,371.60 8.95
 M 科学研究和技术服务业 --
 N 水利、环境和公共设施管理业 15,951.44 0.01
 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 73,720,661.71 61.92

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明细（单位：元）

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	002183	怡亚通	163,440	7,091,661.60	5.96
2	300186	大华农	186,550	6,454,630.00	5.42
3	601919	中国远洋	663,900	5,895,432.00	4.95
4	601333	广深铁路	1,182,300	5,001,129.00	4.20
5	600058	五矿发展	183,000	4,723,230.00	3.97
6	002589	瑞康医药	129,826	4,134,958.10	3.47
7	600428	中远航运	362,300	3,956,316.00	3.32
8	000524	岭南控股	199,800	3,736,260.00	3.14
9	601933	永辉超市	358,400	3,637,760.00	3.06
10	600138	中青旅	177,100	3,559,710.00	2.99

4、报告期末按券种分类的债券投资组合（单位：元）

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	10,020,000.00	8.42
2	央行票据	--	--

3	金融债券	20,072,000.00	16.86
	其中：政策性金融债	20,072,000.00	16.86
4	企业债券	--	
5	企业短期融资券	--	
6	中期票据	--	
7	可转债	--	
8	同业存单	--	
9	其他	--	
10	合计	30,092,000.00	25.27

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

(单位：元)

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	150301	15进出01	200,000	20,072,000.00	16.86
2	019509	15国债09	100,000	10,020,000.00	8.42

注：以上为本基金本报告期末持有的全部债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名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

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。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

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。

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。

11、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（单位：元）

序号 名称 金额（元）

1	存出保证金	287,886.91
2	应收证券清算款	3,756,246.53
3	应收股利	-
4	应收利息	612,200.79
5	应收申购款	12,058.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,668,392.87

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

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

流通受限情况说明

1	002183	怡亚通	7,091,661.60	5.96	重大事项
2	601919	中国远洋	5,895,432.00	4.95	重大事项
3	600058	五矿发展	4,723,230.00	3.97	重大事项
4	002589	瑞康医药	4,134,958.10	3.47	重大事项
5	600428	中远航运	3,956,316.00	3.32	重大事项

(6) 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。

十二、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 2003 年 4 月 25 日, 本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:

截止 2015 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:

泰达成长基金

阶段 净值增长率 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 ①-③ ②-④

① ② ③ ④

2003 年 4 月 25 日

-12 月 31 日 -1.41% 0.56% -7.34% 0.78% 5.93% -0.22%

2004 年 1 月 1 日

-12 月 31 日 17.09% 0.95% -8.54% 1.02% 25.63% -0.07%

2005 年 1 月 1 日

-12 月 31 日 11.42% 0.97% -7.13% 0.98% 18.55% -0.01%

2006 年 1 月 1 日

-12 月 31 日 81.74% 1.26% 54.13% 1.06% 27.61% 0.20%

2007 年 1 月 1 日

-12 月 31 日 110.40% 1.64% 81.63% 1.54% 28.77% 0.10%

2008 年 1 月 1 日

-12 月 31 日 -31.61% 1.83% -34.32% 1.92% 2.71% -0.09%

2009 年 1 月 1 日-12 月 31 日 52.12% 1.30% 51.26% 1.21% 0.86% 0.09%

2010 年 1 月 1 日至 12 月 31 日 22.32% 1.33% 9.02% 1.12% 13.30% 0.21%

2011年1月1日至12月31日 -27.17% 1.07% -22.51% 0.90% -4.66% 0.17%

2012年1月1日至12月31日 8.90% 1.15% 1.19% 0.88% 7.71% 0.27%

2013年1月1日至12月31日 30.78% 1.61% 22.45% 0.98% 8.33% 0.63%

2014年1月1日至12月31日 12.56% 1.36% 7.75% 0.73% 4.81% 0.63%

2015年1月1日至9月30日 18.47% 3.17% 12.70% 1.94% 5.77% 1.23%

基金合同生效以来至2015年9月30日 792.09% 1.50% 184.53% 1.22% 607.56%
0.28%

泰达周期基金

阶段 净值增长率 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 ①-③ ②-④

① ② ③ ④

2003年4月25日-12月31日 11.98% 0.69% -1.86% 0.64% 13.84% 0.05%

2004年1月1日-12月31日 3.12% 1.08% -14.31% 0.90% 17.43% 0.18%

2005年1月1日-12月31日 3.87% 1.07% -4.37% 0.99% 8.24% 0.08%

2006年1月1日-12月31日 137.80% 1.29% 70.60% 1.37% 67.20% -
0.08%

2007年1月1日
-12月31日 81.77% 1.82% 105.32% 1.63% -23.55% 0.19%

2008年1月1日
-12月31日 -40.52% 1.80% -49.54% 2.01% 9.02% -0.21%

2009年1月1日-12月31日 71.49% 1.80% 66.62% 1.52% 4.87% 0.28%

2010年1月1日至12月31日 9.51% 1.30% 1.50% 1.15% 8.01% 0.15%

2011年1月1日至12月31日 -28.59% 1.18% -21.52% 0.97% -7.07% 0.21%

2012年1月1日至12月31日 7.65% 1.09% 5.11% 0.99% 2.54% 0.10%

2013年1月1日至12月31日 12.64% 1.25% -8.33% 0.93% 20.97% 0.32%

2014年1月1日至12月31日 19.27% 1.19% 28.50% 0.80% -9.23% 0.39%

2015年1月1日至9月30日 -2.65% 3.08% 1.28% 2.00% -3.93% 1.08%

基金合同生效以来至2015年9月30日 482.17% 1.52% 136.55% 1.30% 345.62%
0.22%

泰达稳定基金

阶段 净值增长率 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 ①-③ ②-④

① ② ③ ④

2003年4月25日-12月31日 5.10% 0.55% -3.70% 0.71% 8.80% -0.16%

2004年1月1日

-12月31日 1.82% 0.90% -9.97% 0.84% 11.79% 0.06%

2005年1月1日

-12月31日 6.52% 0.97% -0.36% 0.86% 6.88% 0.11%

2006年1月1日

-12月31日 135.33% 1.19% 76.12% 1.11% 59.21% 0.08%

2007年1月1日

-12月31日 74.10% 1.61% 76.76% 1.45% -2.66% 0.16%

2008年1月1日

-12月31日 -46.00% 1.79% -43.98% 1.89% -2.02% -0.10%

2009年1月1日-12月31日 42.03% 1.51% 52.68% 1.27% -10.65% 0.24%

2010年1月1日至12月31日 5.99% 1.27% -11.15% 0.95% 17.14% 0.32%

2011年1月1日至12月31日 -17.00% 0.96% -9.58% 0.75% -7.42% 0.21%

2012年1月1日至12月31日 8.40% 1.03% 6.64% 0.75% 1.76% 0.28%

2013年1月1日至12月31日 12.90% 1.23% -0.73% 0.94% 13.63% 0.29%

2014年1月1日至12月31日 36.79% 1.16% 38.13% 1.34% -1.34% -0.18%

2015年1月1日至9月30日 -6.30% 2.44% -7.39% 1.69% 1.09% 0.75%

基金合同生效以来至2015年9月30日 394.29% 1.35% 150.26% 1.18% 244.03%

0.17%

十三、基金的费用与税收

(一) 本系列基金发生的费用按照公平原则经托管人认定后由各行业类别基金单独承担或由各行业类别基金分摊。

（二）基金运作费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金证券交易费用；
- 4、基金的信息披露费用；
- 5、基金的会计师费和律师费；
- 6、按照国家有关规定可以列支的其它费用。

各行业类别基金费用由基金托管人从该基金资产中支付。

（三）基金运作费用计提方法、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，在通常情况下，按前一日的各行业类别基金资产净值之和的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H：为每日应计提的本系列基金管理费；

E：为前一日各行业类别基金资产净值的和。

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从各行业类别基金资产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的托管费

基金托管人的托管费，在通常情况下，按前一日的各行业类别基金资产净值之和的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H：为每日应支付的本系列基金托管费；

E：为前一日的本系列基金各行业类别基金资产净值的和。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

3、上述（二）基金费用第 3—6 项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额，由基金托管人从本系列基金每只行业类别基金资产中支付。

4、经基金管理人与基金托管人协商一致，可以调低基金管理人的管理费及基金托管费，并报中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会通过。

（四）申购、赎回的费用

1、申购费

申购费率如下：

申购金额（M） 费率

M<50 万 1.50%

50 万≤M <250 万 1.20%

250 万≤M <500 万 0.75%

500 万≤M <1000 万 0.50%

M≥1000 万 每笔 1000 元

2、赎回费

赎回费率如下：

连续持有期限（日历日） 适用的赎回费率

1 天—365 天 0.5%

366 天（含）—730 天 0.25%

731 天（含）以上 0

说明：①认购期持有期限起始日为基金合同生效日；申购期持有期限起始日为基金申购的注册登记日。持有期限的截止日为基金赎回的注册登记日。

②投资人对本系列基金任意一子基金连续持有期限超过 365 天，赎回费率为 0.25%；连续持有期限超过 730 天，赎回费率为零。期间如进行基金转换，持有期限可以累计。

③赎回费的 25%划归基金资产。

（五）不列入基金费用的项目

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本系列基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

（六）基金税收

本系列基金每只行业类别基金及基金份额持有人应依据国家有关规定依法纳税。

十四、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“二、释义”中运作办法等部分进行变更。

- (三) 对“三、基金管理人”中，基金管理人概况、董事会成员、监事会成员、总经理及其他高级管理人员、基金经理等部分进行了变更及增加内容。
- (四) “四、基金托管人”部分进行了更新。
- (五) “五、相关服务机构”中，更新场外代销机构及对审计基金财产的会计师事务所法定代表人等相关人员进行了变更。
- (六) “七、基金的投资”部分投资组合报告内容更新至 2015 年 9 月 30 日及更新了业绩比较基准。
- (七) “八、基金的业绩”部分对基金业绩更新至 2015 年 9 月 30 日，并更新了历史走势对比图。
- (八) “十、基金资产的估值”对估值方法部分内容进行变更。
- (九) “十九、基金份额持有人的服务”中对网上开户与交易服务部分增加内容。
- (十) 更新了“二十、其他应披露事项”部分内容。

泰达宏利基金管理有限公司

2015 年 12 月 9 日