

# 泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资 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：招商银行股份有限公司

## 重要提示

本基金于 2017 年 3 月 6 日经中国证监会证监许可[2017]326 号文注册, 基金合同于 2017 年 9 月 6 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投资价值和市场前景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)基金时应认真阅读本招募说明书。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。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。

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, 投资者在投资本基金前, 需充分了解本基金的产品特性, 并承担基金投资中出现的 各类风险, 包括: 因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的 系统性风险; 个别证券特有的非系统性风险; 由于基金投资人连续大量赎回基金 产生的流动性风险; 基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险; 本 基金的特定风险等。

本基金为股票型基金, 具有较高预期风险、较高预期收益的特征, 其预期风 险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。基金的过往 业绩并不预示其未来表现。

投资者在进行投资决策前, 请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同等 信息披露文件, 自主判断基金的投资价值, 自主做出投资决策, 自行承担投资 风险。

本招募说明书所载内容截止日为 2018 年 3 月 6 日, 有关财务数据和净值表 现截止日为 2017 年 12 月 31 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

设立日期：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

信息披露联系人：袁静

联系电话：010-66577513

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、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利溢利债券型证券投资基金、泰达宏利恒利债券型证券投资基金、泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启迪灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启惠灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启明灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启泽灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利京天宝货币市场基金、泰达宏利启富灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金、泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金、泰达宏利全能优选混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利交利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金在内的五十多只证券投资基金。

## 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。

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。

刁锋先生，董事。拥有南开大学经济学学士、经济学硕士及经济学博士学位。曾担任天津北方国际信托股份有限公司交易员、信托经理，渤海财产保险股份有限公司资金运用部部门总助，天津泰达投资控股有限公司高级项目经理。现任天津市泰达国际控股（集团）有限公司财务部部长，渤海证券股份有限公司、渤海财产保险股份有限公司及天津信托有限责任公司董事等职。

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，期间担任多个领导层要职。

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。

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。2017年10月1日起担任新界妇女与青少年福利协会有限公司董事。

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。

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。

张建强先生，独立董事。二级律师，南开大学法学学士、国际经济法硕士。曾担任天津市高级人民法院法官。现任天津建嘉律师事务所主任，天津仲裁委员会仲裁员，天津市律师协会理事，担任天津市政府、河西区政府、北辰区政府，多家银行和非银行金融机构法律顾问，万达、招商、保利等房地产企业法律顾问，以及天津物产集团等大型国有企业的法律顾问等职。主要业务领域：

金融、房地产、公司、投资。

查卡拉·西索瓦先生，独立董事。拥有艾戴克高等商学院（北部）工商管理学士、法国金融分析学院财务分析学位、芝加哥商学院工商管理学硕士等学位。曾担任欧洲联合银行（巴黎）组合经理助理、组合经理，富达管理与研究有限公司（东京）高级分析师，NatWest Securities Asia亚洲运输研究负责人，Credit Lyonnais International Asset Management研究部主管、高级分析师，Comgest远东有限公司董事总经理、基金经理及董事。现任Jayu Ltd. 负责人。

樸睿波先生，独立董事。拥有美国西北大学经济学学士、美国西北大学凯洛格管理学院管理学硕士、美国西北大学凯洛格管理学院金融学博士等学位。曾担任联邦储备系统管理委员会金融经济师，芝加哥商业交易所高级金融经济师，Ennis Knupp & Associates合伙人、研究主管，Martingale资产管理公司（波士顿）董事，Commerz 国际资本管理（CICM）（德国）联合首席执行官/副执行董事，德国商业银行（英国）资产管理部门董事总经理。现任上海交通大学高级金融学院实践教授。

## 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。

廖仁勇先生，职工监事。人力资源管理在职研究生，曾在联想集团有限公司、中信国检信息技术有限公司从事人力资源管理工作；2007年6月加入泰达宏

利基金管理有限公司，曾任人力资源部招聘与培训主管、人力资源部总经理助理，自2014年10月起担任人力资源部副总经理，主持部门工作。

葛文娜女士，职工监事。文学学士，金融学在职研究生。2006年7月至2015年12月就职于中邮创业基金管理有限公司，历任渠道经理、机构主管、销售部门总经理助理；2016年1月加入泰达宏利基金管理有限公司，任销售管理部副总经理，主持部门工作。

### 3、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

杨超先生, 英国南威尔士大学数学与金融计算硕士; 2010年5月加入建信基金管理有限责任公司, 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12月27日至今担任泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2017年9月6日至今担任本基金基金经理; 2017年12月19日至今担任泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具备8年证券基金从业经验, 8年证券投资管理经验, 具有基金从业资格。

#### 5、投资决策委员会成员名单

投资决策委员会成员包括公司总经理刘建、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、金融工程部总监戴洁、资深基金经理兼首席策略分析师庄腾飞。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、庄腾飞表决。
- (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。

### 三、基金管理人的职责

1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会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、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照规定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、有关法律、行政法规和中国证监会规定的其他职责。

### 四、基金管理人承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》（以下简称“《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) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (5) 从事可能使基金财产承担无限责任的投资；
- (6) 法律、行政法规和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，不按照规定履行职责；
- (7) 违反法律法规的规定，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，或泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (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或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(4) 不得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）基金托管人概况

#### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

#### 2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2017年9月30日，本集团总资产

61,692.39亿元人民币，高级法下资本充足率15.01%，权重法下资本充足率12.26%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室，现有员工76人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获奖项国内托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7月荣膺2016年中国资产管理【金贝奖】“最佳资产托管银行”；2017年6月再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，“全功能网上托管银行2.0”荣获《银行家》2017中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8月荣膺国际财经权威媒

体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”，进一步扩大我行托管业务在国际资管和托管业界的影响力。

## （二）主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

王良先生，本行副行长，货币银行学硕士，高级经济师。1991年至1995年，在中国科技国际信托投资公司工作；1995年6月至2001年10月，历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理；2001年10月至2006年3月，历任北京分行行长助理、副行长；2006年3月至2008年6月，任北京分行党委书记、副行长（主持工作）；2008年6月至2012年6月，任北京分行行长、党委书记；2012年6月至2013年11月，任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记；2013年11月至2014年12月，任招商银行总行行长助理；2015年1月起担任本行副行长；2016年11月起兼任本行董事会秘书。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银

行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有 20 余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

### （三）基金托管业务经营情况

截至 2017 年 9 月 30 日，招商银行股份有限公司累计托管 316 只开放式基金。

### （四）托管人的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

#### 2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在总行层面对风险进行预防和控制。

二级防范是总行资产托管部设立稽核监察室，负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下，独立于部门内其他业务室和托管分部、分行资产托管业务主管部门，对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督，及时发现内部控制缺陷，提出整改方案，跟踪整改情况。

三级风险防范是总行资产托管部在专业岗位设置时，必须遵循内控制衡原则，监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

## 1、内部控制原则

(1) 全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位，并由全部人员参与。

(2) 审慎性原则。内部控制的核心是有效防范各种风险，托管组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点，应当体现“内控优先”的要求。

(3) 独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于内部控制的建立和执行部门，稽核监察室应保持高度的独立性和权威性，负责对部门内部控制工作进行评价和检查。

(4) 有效性原则。内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权利，内部控制存在的问题应当能够得到及时的反馈和纠正。

(5) 适应性原则。内部控制应适应我行托管业务风险管理的需要，并能随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。内部控制应随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修订和完善。

(6) 防火墙原则。业务营运、稽核监察等相关室，应当在制度上和人员上适当分离，办公网和业务网分离，部门业务网和全行业务网分离，以达到风险防范的目的。

(7) 重要性原则。内部控制应当在全面控制的基础上，关注重要托管业务事项和高风险领域。

(8) 制衡性原则。内部控制应当在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

(9) 成本效益原则。内部控制应当权衡托管业务的实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制。

## 2、内部控制措施

(1) 完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务管理办法》、《招商银行资产托管业务内控管理办法》、《招商银行基金托管业务操作规程》和等一系列规章制度，从资产托管业务操作流程、会计核算、岗位管理、档案管理、保密管理和信息管理等方面，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。为保障托管资产安全和托管业务正常运作，切实维护托管业务各当事人的利益，避免托管业务危机事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理，招商银行还制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》，并建立了灾难备份中心，各种业务数据能及时在灾难备份中心进行备份，确保灾难发生时，托管业务能迅速恢复和不间断运行。

(2) 经营风险控制。招商银行资产托管部托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理、差错处理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中的风险。

(3) 业务信息风险控制。招商银行资产托管部采用加密方式传输数据。数据执行异地同步灾备，同时，每日实时对托管业务数据库进行备份，托管业务数据每日进行备份，所有的业务信息须经过严格的授权才能进行访问。

(4) 客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

(5) 信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房 24 小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护等，保证信息技术系统的安全。

(6) 人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯队队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源控制。

#### (五) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、基金份额净值计算、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定，应及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人限期改正，如基金管理人未能在通知期限内纠正的，基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人应配合和协助基金托管人依照法律法规基金合同和托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### 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

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

联系人：于贺

联系电话：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

(1) 网上交易系统网址：<https://etrade.mfcteda.com/etrading/>

支持基金管理人旗下基金网上交易系统的银行卡和第三方支付有：农业银

行卡、建设银行卡、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、中国银行卡、广发银行卡、上海银行卡、汇付天下支付和快钱支付等。

(2) 泰达宏利微信公众账号: mfcteda\_BJ

支持民生银行卡、招商银行卡、汇付天下支付和快钱支付。

客户服务电话: 400-698-8888或010-66555662

客户服务信箱: [irm@mfcteda.com](mailto:irm@mfcteda.com)

## 2、代销机构

### 1) 招商银行股份有限公司

注册地址: 深圳市深南大道7088 号招商银行大厦

办公地址: 深圳市深南大道7088 号招商银行大厦

法定代表人: 李建红

联系人: 邓炯鹏

客服电话: 95555

银行网站: [www.cmbchina.cn](http://www.cmbchina.cn)

### 2) 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: 陈四清

联系人：崔瑛

客服电话：95566

银行网站：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

3) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

联系人：肖武侠

客户服务热线：95528

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

4) 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2-6层

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：陈共炎

客服电话：4008-888-888

联系人：辛国政

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

**5) 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、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](http://www.gf.com.cn)

**6) 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：95521

联系人：芮敏祺

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

**7) 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

联系人：王叔胤

客服电话：95523或400-889-5523

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

#### 8) 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：韩志谦

联系人：王怀春

客户服务电话：400-800-0562

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

#### 9) 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：何耀

客户服务电话：95525

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

#### 10) 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：丁益

联系人：金夏

客户服务电话：0755-33680000 400-6666-888

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

#### 11) 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

联系人：金芸

客服电话：95553, 400-8888-001

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

#### 12) 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：95396

联系人：梁微

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

### 13) 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（福建省请先拨0591）

联系人：王虹

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

### 14) 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

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

**15) 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

**16) 深圳众禄金融销售股份有限公司**

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；www.jjmmw.com

客服热线：4006-788-887

**17) 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

**18) 蚂蚁（杭州）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

公司网址：<http://www.fund123.cn/>

**19) 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

公司网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

**20) 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)

**21) 上海陆金所基金销售有限公司**

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址：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)

## 22) 大泰金石基金销售有限公司

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

办公地址：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>

## 23) 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

办公地址：北京朝阳区阜通东大街1号院望京 sohoT2B 座 2507 层

法定代表人：钟斐斐

客服热线：4000-618-518

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

## 24) 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

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东路1号保利国际广场南塔1201-1203室

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

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

#### 25) 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：95518/400 088 8816

公司网址：<http://fund.jd.com>

#### 26) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海浦东新区东方路989号中达广场2楼

法定代表人：李兴春

客服电话：400-921-7755

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

**27) 济安财富（北京）资本管理有限公司**

注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层

法定代表人：杨健

客服电话：400-673-7010

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

**28) 天津万家财富资产管理有限公司**

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室

办公地址：北京市西城区太平桥大街丰盛胡同28号太平洋保险大厦A座5层

法定代表人：李修辞

客服电话：010-59013842

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

**29) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司**

注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809

办公地址：北京市朝阳区建国路88号楼soho现代城C座18层1809

法定代表人：戎兵

客服电话：400-6099-200

公司网址：<http://www.yixinfund.com>

基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时公告。

## 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：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、陈颖华

联系人：陈颖华

#### 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

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

泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金

#### 五、基金的类型

本基金运作方式：契约型开放式

本基金的类别：股票型证券投资基金

本基金存续期限：不定期

## 六、基金的投资目标

本基金为普通股票型基金，运用量化投资技术，在严格控制风险的前提下，力争为投资者获取超越业绩比较基准的收益。

## 七、基金的投资范围

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、公开发行的次级债券、可交换债券、可转债及分离交易可转债的纯债部分）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、资产支持证券、货币市场工具、同业存单、权证、股指期货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）。

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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于80%；权证投资比例不超过基金资产净值的3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。

## 八、基金的投资策略

本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。

### 1、股票投资策略

该基金综合运用定量与定性技术相结合的方式，通过对企业盈利能力及质

量的综合评估，深入分析发掘当期在各行业或在细分领域，新兴产业中盈利能力较强，盈利处在加速，盈利质量处在改善和加速改善中的企业，并纳入投资范围。同时该基金也将结合产业上下游供需关系和产业发展趋势的研究成果，将预期盈利出现改善的公司和正处在业绩拐点的标的纳入投资范围。最终管理人将通过量化技术综合评估潜在投资标的在估值，成长性，盈利空间，盈利质量，产业优势，动量，规模，流动性等多因子上的暴露，运用多因子技术优化整体组合的预期收益和风险比产生最终的投资组合进行投资。

## 2、债券投资策略

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。

## 3、股指期货投资策略

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，将利用股指期货剥离多头股票资产部分的系统性风险或建立适当的股指期货多头头寸对冲市场向上风险。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。

## 4、资产支持证券投资策略

资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。

本基金将在债券市场宏观分析基础上，结合蒙特卡洛模拟等数量化方法，对资产支持证券进行定价，评估其内在价值进行投资。

## 5、现金管理

在现金管理上，本基金通过对未来现金流的预测进行现金预算管理，及时满足本基金运作的流动性需求。

## 九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率×90%+中证综合债券指数收益率×10%。

沪深300指数是由中证指数有限公司编制，从上海和深圳证券交易所中选取300只A股作为样本的综合性指数，具有良好的市场代表性。本基金运用大类资产配置策略，严控下行风险，以为投资者创造稳定的较高收益为投资目标，因此选取“沪深300指数收益率×90%+中证综合债券指数收益率×10%”作为本基金的业绩比较基准。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。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准。

如果今后法律法规发生变化，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时，本基金可以在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

## 十、风险收益特征

本基金为股票型基金，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高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 七、基金管理人代表基金行使股东权利和债权人权利的处理原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

4、有利于基金财产的安全与增值；

5、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## 十一、基金的投资组合报告（未经审计）

### 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。

本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 2018 年 3 月 16 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 2017 年 12 月 31 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	145,380,941.37	93.64
	其中：股票	145,380,941.37	93.64

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	-	-
	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	9,065,602.76	5.84
8	其他资产	811,520.49	0.52
9	合计	155,258,064.62	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	150,570.00	0.10
B	采矿业	4,323,855.00	2.80
C	制造业	56,674,475.43	36.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,068,523.20	3.29
E	建筑业	4,946,921.00	3.21
F	批发和零售业	2,526,200.00	1.64

G	交通运输、仓储和邮政业	4,681,734.00	3.04
H	住宿和餐饮业	4,564.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,524,865.00	3.58
J	金融业	48,584,489.74	31.50
K	房地产业	6,671,704.00	4.33
L	租赁和商务服务业	5,031,764.00	3.26
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,191,276.00	0.77
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	145,380,941.37	94.25

## (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。

## 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	601318	中国平安	128,213	8,972,345.74	5.82

2	600519	贵州茅台	9,100	6,347,159.00	4.11
3	000333	美的集团	91,300	5,060,759.00	3.28
4	601166	兴业银行	266,100	4,521,039.00	2.93
5	002415	海康威视	89,400	3,486,600.00	2.26
6	600276	恒瑞医药	48,900	3,373,122.00	2.19
7	601328	交通银行	516,000	3,204,360.00	2.08
8	601398	工商银行	516,000	3,199,200.00	2.07
9	000002	万科A	101,300	3,146,378.00	2.04
10	600887	伊利股份	96,600	3,109,554.00	2.02

#### 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投资。

#### 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投资。

#### 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

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

**(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。

**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	63,563.72
2	应收证券清算款	672,409.99
3	应收股利	-
4	应收利息	2,242.06
5	应收申购款	73,304.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	811,520.49

(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 2017 年 9 月 6 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 2017 年 12 月 31 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：

### 泰达宏利业绩驱动 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
基金合同生效以来至 2017.12.31	3.78%	0.62%	4.06%	0.64%	-0.28%	-0.02%

### 泰达宏利业绩驱动 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
基金合同生效以来至 2017. 12. 31	3. 52%	0. 62%	4. 06%	0. 64%	-0. 54%	-0. 02%

注：本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×90%+中证综合债券指数收益率×10%。

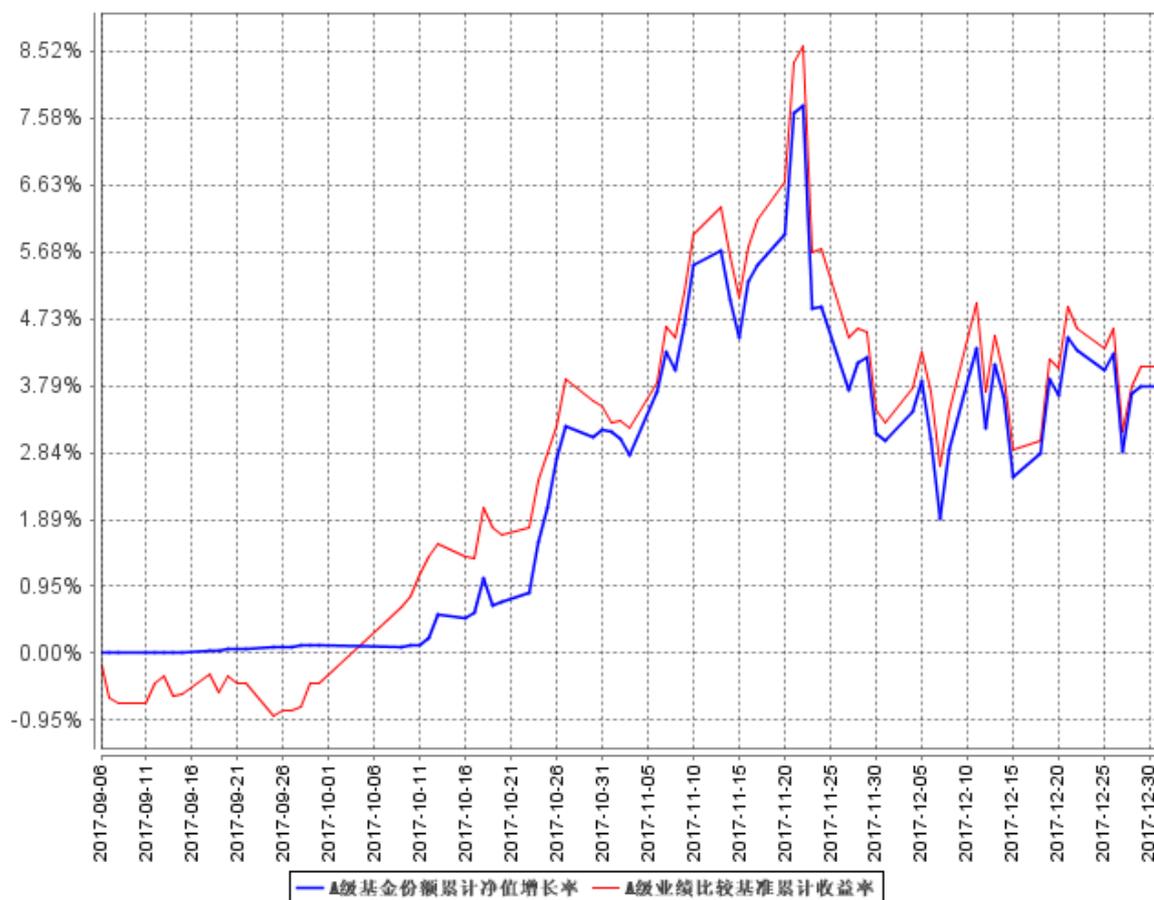
（二）自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动比较图

泰达宏利业绩驱动 A 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

（2017 年 9 月 6 日至 2017 年 12 月 31 日）

A级基金份额累计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

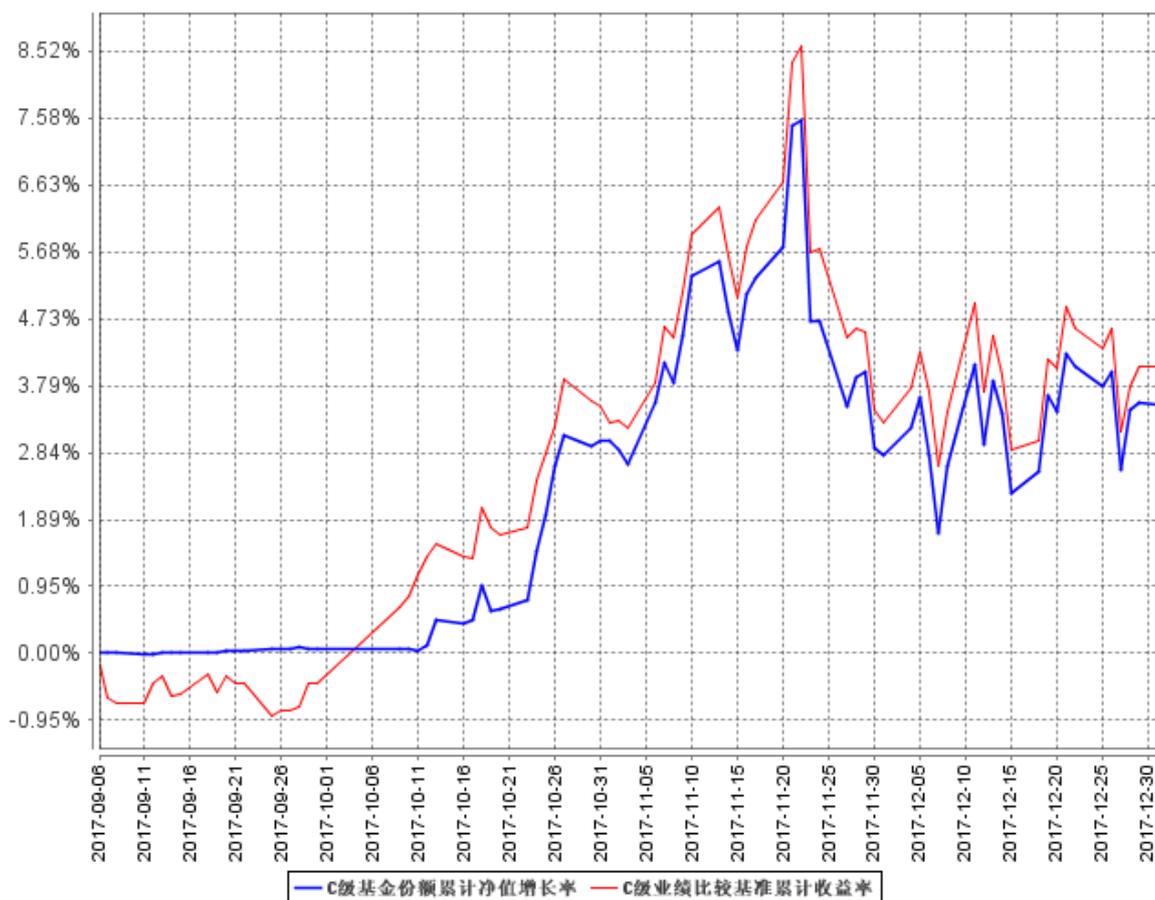


泰达宏利业绩驱动C 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的

历史走势对比图

(2017年9月6日至2017年12月31日)

C级基金份额累计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



注：本基金成立于2017年9月6日，截止报告期末本基金仍在建仓期。

### 十三、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、基金销售服务费：本基金从C类基金资产中计提的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金相关账户的开户费用及账户维护费用；
- 8、基金的证券、期货交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，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双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3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、公休假等，支付日期顺延至最近一个工作日。

### 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双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延至最近一个工作日。

### 3、C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.50%。本基金销售服务费将专门用于本基金C类基金份额的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，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双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延至最近一个工作日。

上述“一、基金费用的种类”中第4—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、销售服务费的调整

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，酌情调低销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。但调整基金管理费、基金托管费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“三、基金管理人”中，基金管理人概况、董事会成员、基金经理、投资决策委员会成员名单部分进行更新。

（三）“四、基金托管人”部分进行了更新。

(四) “五、相关服务机构”中，更新代销机构部分内容。

(五) “八、基金份额的申购与赎回”部分内容进行更新。

(六) “九、基金的投资”部分投资组合报告内容更新至 2017 年 12 月 31 日。

(七) “十、基金的业绩”部分对基金业绩更新至 2017 年 12 月 31 日，并更新了历史走势对比图。

(八) 更新了“二十二、其他应披露事项”部分内容。

泰达宏利基金管理有限公司

2018年4月19日