

泰达宏利绝对收益策略混合型发起式证券  
投资基金  
2018 年第 4 季度报告

2018 年 11 月 30 日

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

报告送出日期：2019 年 1 月 22 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 1 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为 2018 年 10 月 1 日至 2018 年 11 月 30 日（基金最后运作日）。

## §2 基金产品概况

转型后：

基金简称	泰达宏利绝对混合
交易代码	001896
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 10 月 24 日
报告期末基金份额总额	22,361,805.70 份
投资目标	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
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
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率+2%
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
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

转型前：

基金简称	泰达宏利绝对混合
交易代码	001896
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 11 月 17 日
报告期末基金份额总额	60,915,762.41 份
投资目标	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
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
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率+2%
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
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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018 年 10 月 24 日 — 2018 年 11 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-601,491.73
2. 本期利润	-27,038.21
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0007
4. 期末基金资产净值	21,569,562.92
5. 期末基金份额净值	0.965

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 本财务报表（转型后）的实际编制期间为 2018 年 10 月 24 日至 2018 年 11 月 30 日（基金最后

运作日)。

### 3.1 主要财务指标 (转型前)

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期 ( 2018 年 10 月 1 日 — 2018 年 10 月 23 日 )
1. 本期已实现收益	-707,817.15
2. 本期利润	-128,285.73
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0021
4. 期末基金资产净值	58,819,789.99
5. 期末基金份额净值	0.966

注: 1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入 (不含公允价值变动收益) 扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 本财务报表 (转型前) 的实际编制期间为 2018 年 10 月 1 日至 2018 年 10 月 23 日。

### 3.2 基金净值表现 (转型后)

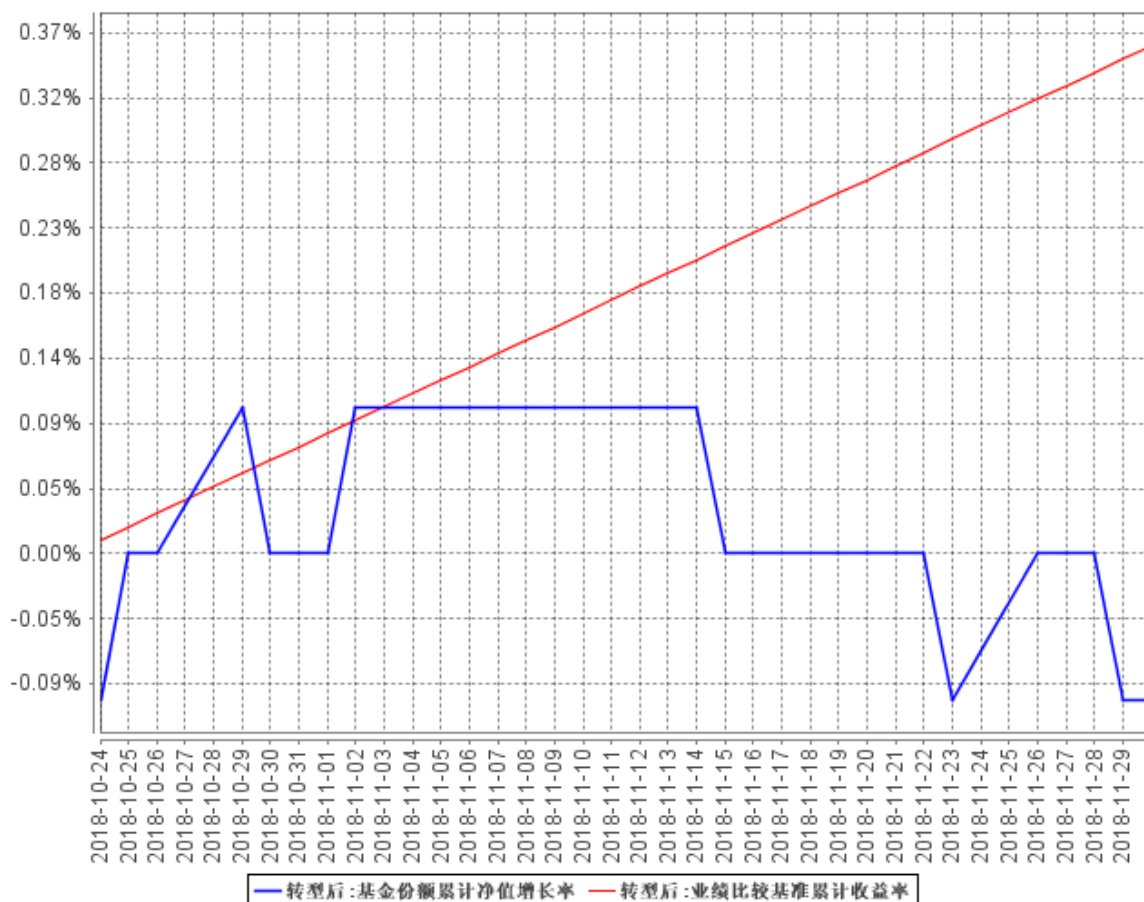
#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2018.10.24-2018.11.30	-0.10%	0.06%	0.36%	0.01%	-0.46%	0.05%

注: 本基金业绩比较基准: 一年期银行定期存款收益率 (税后) +2%。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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。

## 3.2 基金净值表现（转型前）

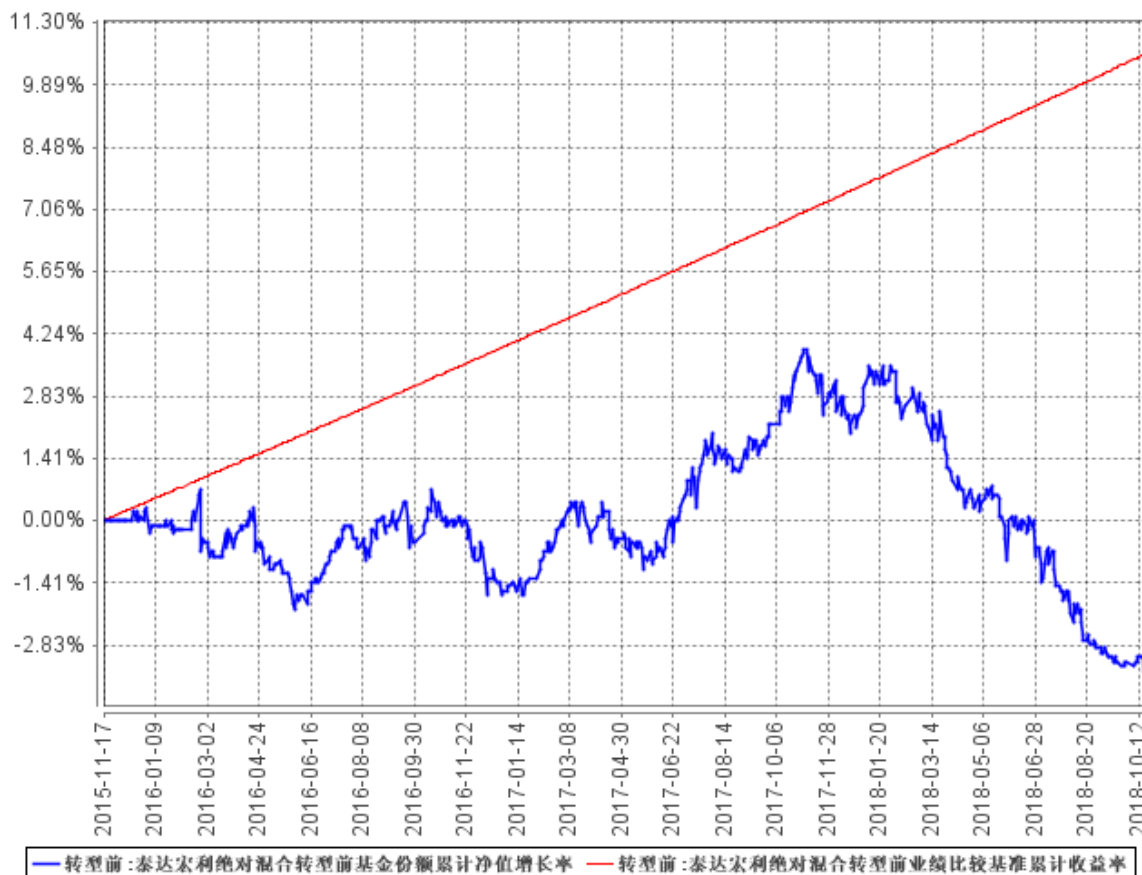
### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2018.10.1-2018.10.23	-0.21%	0.12%	0.22%	0.02%	-0.43%	0.10%

注：本基金业绩比较基准：一年期银行定期存款收益率(税后)+2%。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

泰达宏利绝对混合转型前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：本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘欣	本基金基金经理；金融工程部总经理	2015年11月17日	2018年10月23日	11	清华大学理学硕士，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兼基金经理。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。
杨超	本基金基金经理	2015 年 11 月 20 日	2018 年 10 月 23 日	8	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。具备 8 年基金从业经验，8 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘欣	本基金基金经理；金融工程部总经理	2018 年 10 月 24 日	2018 年 11 月 30 日	11	清华大学理学硕士，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兼基金经理。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。
杨超	本基金基金经理	2018 年 10 月 24 日	2018 年 11 月 30 日	8	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。具备 8 年基金从业经验，8 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度和流程，并严格执行制度的规定。在投资管理活动中，本基金管理人公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会；严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离；在交易环节实行集中交易制度，并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数量统计、分析。在本报告期内，未发现利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。



### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控，风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估，向公司风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。在本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合的同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该证券当日成交量的 5%，在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

进入四季度以来, 市场呈现持续弱势, 成交量低迷, 市场对冲工具持续呈现较高的对冲成本, 股票多头方面难以获得显著的超额收益覆盖较高幅度贴水收敛带来的亏损, 故基金整体未进行对冲操作, 以现金管理为主。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

转型后

截至 2018 年 11 月 30 日, 本基金份额净值为 0.965 元; 2018 年 10 月 24 日至 2018 年 11 月 30 日基金份额净值增长率为-0.10%, 业绩比较基准收益率为 0.36%。

转型前

截至 2018 年 10 月 23 日, 本基金份额净值为 0.966 元; 2018 年 10 月 1 日至 2018 年 10 月 23 日基金份额净值增长率为-0.21%, 业绩比较基准收益率为 0.22%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

- 1、报告期内, 本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量低于 200 人的情形;
- 2、本基金从 2018 年 10 月 25 日至 2018 年 11 月 30 日出现连续超过 20 个工作日但不满 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。因已触发基金合同约定的终止情形, 本基金已于 2018 年 12 月 1 日进入清盘期。

## §5 投资组合报告

转型后:

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例
----	----	-------	-----------

			(%)
1	权益投资	261,201.60	1.09
	其中：股票	261,201.60	1.09
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	23,594,338.83	98.54
8	其他资产	88,441.58	0.37
9	合计	23,943,982.01	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	261,201.60	1.21
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	261,201.60	1.21

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300324	旋极信息	36,278	261,201.60	1.21

注：以上为本基金本报告期末持有的全部股票投资。

## 5.4 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。

## 5.5 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。

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**5.10.1 本期国债期货投资政策**

本基金在报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

**5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

**5.10.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期没有投资国债期货。

**5.11 投资组合报告附注**

**5.11.1**

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

**5.11.2**

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

**5.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	24,174.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	64,267.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	88,441.58

**5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

转型前：

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,865,481.38	3.16
	其中：股票	1,865,481.38	3.16
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	56,749,071.82	96.16
8	其他资产	398,448.42	0.68
9	合计	59,013,001.62	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	26,824.00	0.05
C	制造业	909,034.12	1.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,294.00	0.01
E	建筑业	66,568.00	0.11
F	批发和零售业	118,482.00	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	249,229.86	0.42
J	金融业	-	-
K	房地产业	394,150.00	0.67
L	租赁和商务服务业	30,003.40	0.05

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	67,896.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	1,865,481.38	3.17

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300324	旋极信息	36,278	249,229.86	0.42
2	600606	绿地控股	40,000	232,000.00	0.39
3	002450	康得新	14,400	184,896.00	0.31
4	000418	小天鹅 A	3,934	171,837.12	0.29
5	000031	中粮地产	34,500	162,150.00	0.28
6	600031	三一重工	20,000	158,600.00	0.27
7	300088	长信科技	32,800	149,240.00	0.25
8	600585	海螺水泥	3,900	128,817.00	0.22
9	600755	厦门国贸	18,600	118,482.00	0.20
10	000333	美的集团	2,500	94,575.00	0.16

### 5.4 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。

### 5.5 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。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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
IC1812	中证500股指期货 IC1812合约	-1	-836,000.00	-34,040.00	-
IF1812	沪深300股指期货 IF1812合约	-1	-955,440.00	-33,180.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-67,220.00
股指期货投资本期收益（元）					1,566,349.51
股指期货投资本期公允价值变动（元）					378,340.00

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金在报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

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

### 5.11.2

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	365,496.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	32,951.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	398,448.42

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	300324	旋极信息	249,229.86	0.42	重大事项
2	002450	康得新	184,896.00	0.31	重大事项
3	000418	小天鹅A	171,837.12	0.29	重大事项
4	000031	中粮地产	162,150.00	0.28	重大事项
5	300088	长信科技	149,240.00	0.25	重大事项
6	000333	美的集团	94,575.00	0.16	重大事项

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。



## §6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（ 2018 年 10 月 24 日 ）基金 份额总额	60,915,762.41
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份 额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回 份额	38,553,956.71
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动 份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	22,361,805.70

## §6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	60,915,762.41
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-
报告期期末基金份额总额	60,915,762.41

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

### 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

单位：份

基金合同生效日管理人持有的本基金份额	10,000,800.00
基金合同生效日起至报告期期末买入/申 购总份额	0.00
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎 回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,800.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份 额比例（%）	44.72

本基金的管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金新增投资本基金。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,800.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,800.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	16.42

本基金的管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金新增投资本基金。

## §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况（转型后）

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,800.00	44.72	10,000,800.00	44.72	三年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金经理等人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金管理人股东	0.00	0.00	0.00	0.00	-
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	-
合计	10,000,800.00	44.72	10,000,800.00	44.72	-

本基金的管理人及关联人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

## §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况（转型前）

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资	10,000,800.00	16.42	10,000,800.00	16.42	三年

金					
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金经理等人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金管理人股东	0.00	0.00	0.00	0.00	-
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	-
合计	10,000,800.00	16.42	10,000,800.00	16.42	-

本基金的管理人及关联人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况（转型前）

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20181001~20181023	19,999,000.00	0.00	0.00	19,999,000.00	32.83%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，易发生巨额赎回的情况，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

注：报告期内，申购份额含红利再投资份额。

### 9.2 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况（转型后）

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20181024	19,999,000.00	0.00	19,999,000.00	0.00	0.00%
	2	20181025~20181130	10,000,800.00	0.00	0.00	10,000,800.00	44.72%
产品特有风险							

报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，易发生巨额赎回的情况，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。

注：报告期内，申购份额含红利再投资份额。

### 9.3 影响投资者决策的其他重要信息

1、因触发基金合同的约定条款，本基金于 10 月 24 日起转换为开放式基金，详见《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触发基金合同情形转换为开放式基金的公告》。

2、本公司于 2018 年 11 月 10 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，聘任聂志刚先生为公司督察长。

3、因已触发基金合同约定的终止情形，本基金已于 2018 年 12 月 1 日进入清盘期，详见《关于泰达宏利绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金合同终止及财产清算的公告》。

4、本公司于 2018 年 12 月 22 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于股权变更的公告》，原公司中方股东北方国际信托股份有限公司将所持有的泰达宏利基金管理有限公司全部 51% 股权转让给天津市泰达国际控股（集团）有限公司。此次股权转让完成后，公司的注册资本保持不变，仍为人民币 1.8 亿元。

## §10 备查文件目录

### 备查文件目录

- 1、中国证监会批准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设立的文件；
- 2、《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合同》；
- 3、《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招募说明书》；
- 4、《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托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

## 10.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

## 10.3 查阅方式

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

泰达宏利基金管理有限公司  
2019 年 1 月 22 日