

# 泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金

## 更新招募说明书摘要

(2020年1月更新)

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

---

## 重要提示

泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2015年4月7日经中国证监会证监许可[2015]570号文注册。本基金的基金合同于2015年6月3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）基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策。

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等。

本基金为混合型基金，风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金和货币型基金。

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及基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日为2020年1月15日，有关数据和净值表现截止日为2019年03月31日。财务数据未经审计。

本基金约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

---

## 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

住所：北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元

办公地址：北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元

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：聂志刚

联系电话：010-66577678

注册资本：一亿八千万元人民币

股权结构：天津市泰达国际控股（集团）有限公司：51%；宏利投资管理（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、泰达宏利沪深300指数增强型证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）、泰达宏利中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利宏达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、泰达宏利汇利债券型证券投资基金、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、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、泰达宏利金利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利泽利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利泰和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利印度机会股票型证券投资基金（QDII）、泰达宏利年年添利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利鑫利半年定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利永利债券型证券投资基金、泰达宏利品牌升级混合型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、董事会成员基本情况

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。

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学士学位，现为宏利投资管理（亚洲）总裁兼亚洲区主管及宏利投资管理（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。

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。

陈展宇先生，董事，拥有美国宾夕法尼亚大学沃顿商学院经济学理学士学位，现任宏利投资管理（香港）有限公司亚洲区机构投资业务部主管，兼任北亚区财富及资产管理部主管（日本除外）。加入宏利前，陈展宇先生曾先后任职于怡富基金有限公司、时佳达投资管理（亚洲）有限公司、高盛（亚洲）资产管理部、源富资产管理（亚洲）有限公司等。陈先生持有特许金融分析师执照。

张凯女士，董事，拥有美国曼荷莲学院经济学学士、美国哥伦比亚大学工商管理硕士学位。现任中宏人寿保险有限公司首席执行官和总经理。出任现职前，张凯女士曾担任花旗中国副行长、零售金融业务总裁。加入花旗前，张凯女士曾担任麦肯锡管理咨询公司顾问以及华信惠悦咨询公司的精算分析师。张凯女士在北美和亚洲金融业拥有20多年的经验。

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、监事会成员基本情况

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。

吴纪泽先生，监事。毕业于新南威尔士大学（澳大利亚悉尼），商学硕士（金融专业）。现任宏利投资管理公司（香港）北亚区投资业务部业务伙伴关系管理总监。曾任宏利投信（台湾）产品开发部襄理、宏利投信（台湾）产品开

---

发部副理、宏利投资管理公司（香港）北亚区投资业务部业务发展高级经理、业务伙伴关系管理副总监等职。加入宏利前，吴纪泽先生曾先后任职于台湾龙扬资产管理、台湾宝来金融集团、AIG投资管理等。吴纪泽先生在跨国资产管理公司和投资银行积累了十六年的跨境战略发展、产品开发与咨询以及市场研究经验。

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、人力资源部副总经理，自2019年7月起担任人力资源部总经理。

王琳琳女士，职工监事。毕业于中华女子学院，会计学专业。曾担任北京天鸿永信会计师事务所审计专员、岳华会计师事务所有限责任公司审计师。2008年2月加入泰达宏利基金管理有限公司，现任公司销售管理部副总经理（主持工作）。

### 3、高级管理人员基本情况

弓劲梅女士，董事长。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；2019年6月起任公司副总经理兼财务总监、首席信息官；2019年8月起代理公司总经理，期限不超过90天。

刘晓玲女士，副总经理，毕业于河北大学，获经济学学士学位。2002年9月至2011年7月就职于博时基金管理有限公司，任零售业务部渠道总监；2011年7月至2013年9月任富国基金管理有限公司零售业务部负责人；2013年9月至2015年4月任泰康资产管理有限责任公司公募事业部市场总监；2015年4月加入融通基金管理有限公司，2015年9月至2018年7月任融通基金管理有限公司副总经理；2018年8月加入泰达宏利基金管理有限公司，2018年9月起任泰达宏利基金管理有限公司副总经理。

---

聂志刚先生，督察长。毕业于复旦大学，获经济学学士、法律硕士学位。2004年12月至2007年5月就职于中国证监会上海监管局；2007年5月至2010年5月任中银基金管理有限公司法律合规部部门总经理；2010年5月至2011年5月任富国基金管理有限公司监察稽核部部门总经理；2011年5月至2013年5月任中海基金管理有限公司风险管理部部门总经理兼风控总监；2013年5月至2015年9月任太平洋保险集团有限公司集团审计中心投资条线首席审计师；2015年9月至2017年10月任银河期货有限公司首席风险官；2017年10月至2018年8月任天风期货股份有限公司首席风险官。2018年8月加入泰达宏利基金管理有限公司，2018年11月起任公司督察长。

#### 4、本基金基金经理

张勋先生:张勋先生，对外经济贸易大学管理学硕士；2006年7月至2009年6月就职于天相投资顾问有限公司，担任研究组组长；2009年7月至2010年4月就职于东兴证券股份有限公司，担任研究组组长；2010年4月加入泰达宏利基金管理有限公司，曾担任研究员、高级研究员、研究部副总监，现任研究部总监兼基金经理；2014年11月21日至今担任泰达宏利首选企业股票型证券投资基金基金经理；2016年09月13日至今担任泰达宏利定宏混合型证券投资基金基金经理；2019年7月22日至今担任泰达宏利行业精选混合型证券投资基金；2019年7月22日至今泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金；具备13年证券从业经验，13年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

本基金历任基金经理：

陈晓舜先生(2015年06月至2015年06月)；

陈丹琳女士(2015年06月至2019年08月)。

#### 5、投资决策委员会

投资决策委员会成员由公司代理总经理傅国庆、投资副总监刘欣、研究部总监张勋、资深基金经理吴华、基金经理兼首席策略分析师庄腾飞、基金经理庞宝臣、基金经理傅浩、基金经理李祥源、信用研究部主管王龙组成。督察长聂志刚列席会议。

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) 固定收益类事项由傅国庆、庞宝臣、傅浩、李祥源、王龙表决。

(2) 权益类事项由刘欣、张勋、吴华、庄腾飞表决。

(3) 其它事项由全体成员参与表决。

6、上述人员之间不存在亲属关系。

### 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、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，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它职责。

### 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 and 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、基金托管人情况

#### (一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：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：田国立

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2018年末，集团资产规模23.22万亿元，较上年增长4.96%。2018年度，集团实现净利润2,556.26亿元，较上年增长4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为1.13%和14.04%；不良贷款率1.46%，保持稳中有降；资本充足率17.19%，保持领先同业。

2018年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018年中国最佳大型零售银行奖”、“2018年中国全面风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018年金龙奖一年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会2018年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

---

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等11个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工300余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玗，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本

---

养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2019年二季度末，中国建设银行已托管924只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### （三）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、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

### （一）监督方法



---

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

## （二）监督流程

1. 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2. 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

---

### 三、相关服务机构

#### (一) 销售机构及联系人

##### 1. 直销机构

泰达宏利基金管理有限公司直销中心

住所：北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元

办公地址：北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元

联系人：刘恋

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>

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/>

支持本公司旗下基金网上直销的银行卡和第三方支付有：中国银行卡、农业银行卡、建设银行卡、交通银行卡、招商银行卡、民生银行卡、兴业银行卡、中信银行卡、光大银行卡、浦发银行卡、广发银行卡和快钱支付。

(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

##### 2. 代销机构

(1) 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：田国立

客服电话：95533

---

联系人：王琳

银行网站：www.ccb.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：陈四清

客服电话：95588

联系人：杨威

银行网站：www.icbc.com.cn

(3) 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：刘连舸

客服电话：95566

联系人：崔瑛

银行网站：www.boc.cn

(4) 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：彭纯

客服电话：95559

联系人：王菁

银行网址：www.bankcomm.com

(5) 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

客服电话：95528

---

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

(6) 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: 谢永林

联系人: 赵杨

客户服务电话: 95511-3

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

(7) 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

联系人: 朱杰霞

客服电话: 400-119-6228

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

(8) 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

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)

(9) 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

联系人: 胡技勋

客户服务热线: 95574

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

---

(10) 包商银行股份有限公司

注册地址：包头市青山区钢铁大街6号

办公地址：包头市青山区钢铁大街6号

法定代表人：周学东

联系人：张建鑫

客服电话：95352

(11) 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：李琦

联系人：陈宇

客户服务电话：400-800-0562

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

(12) 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：孙永祥

客服电话：95351

联系人：李欣

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

(13) 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：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：王春峰

联系人：蔡霆

客户服务电话：400-651-5988

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

---

(14) 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或95551

联系人：辛国政

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

(15) 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：95587/4008-888-108

联系人：权唐

公司网站：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(16) 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：上海市静安区南京西路768号国泰君安大厦

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)

(17) 平安证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61-64层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61-64层

法定代表人：何之江

联系人：周一涵

全国免费业务咨询电话：95511-8

网址：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

(18) 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：陈宇

客服电话：95523或400-889-5523

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

（19）中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市经七路86号

办公地址：上海市花园石桥路66号东亚银行金融大厦18层

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

客服电话：95538

网址：<http://www.zts.com.cn>

（20）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

联系人：庞晓芸

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

（21）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：李福春

联系人：安岩岩

客户服务电话：95360

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

（22）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508号

---

办公地址：上海市静安区新闸路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

（23）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：叶顺德

联系人：田芳芳

客户服务电话：95399

公司网址：www.xsdzq.cn

（24）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：霍达

联系人：黄婵君

客户服务电话：95565，400-888-8111

公司网址：www.newone.com.cn

（25）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

（26）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：上海市浦东新区长柳路36号



---

法定代表人：杨华辉

联系人：乔琳雪

客户服务电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

（27）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

（28）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

（29）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）

联系人：王虹

公司网站：www.hfzq.com.cn

（30）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

公司网站：www.guosen.com.cn

（31）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：王作义

客户服务电话：4008-888-228

联系人：马贤清

网站：www.jyzq.cn

（32）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

联系人：朱磊

公司网站：www.tebon.com.cn

（33）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

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

（34）东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层

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：陈耀庭

联系人：王一彦

---

客服电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

（35）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)

联系人：黄静

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

（36）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

客服电话：95317

网址：www.cfzq.com

（37）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

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：李新华

客户服务热线：95579或4008-888-999

联系人：奚博宇

长江证券客户服务网站：www.95579.com

（38）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

注册地址：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.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

联系人: 刘婧漪、贾鹏

(39) 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: 张佑君

联系人: 郑慧

公司网址: <http://www.cs.ecitic.com/newsite/>

客服热线: 95548

(40) 西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址: 西藏自治区拉萨市北京中路101号

办公地址: 上海市宛平南路88号金座

法定代表人: 陈宏

联系人: 周艳琼

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

客服热线: 95357

(41) 西部证券股份有限公司

注册地址: 陕西省西安市东大街319号八幢10000室

办公地址: 陕西省西安市东大街319号八幢10000室

法定代表人: 徐朝晖

联系人: 梁承华

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

客服热线: 95582

(42) 中山证券有限责任公司

注册地址: 深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层

办公地址: 深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层

法定代表人: 林炳城

联系人: 罗艺琳

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

---

客服热线：95329

（43）江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址：黑龙江省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

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

客服热线：400-666-2288

（44）万联证券股份有限公司

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13号高德置地广场E栋12层

法定代表人：张建军

联系人：甘蕾

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

客服热线：400-888-8133

（45）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

法定代表人：姜晓林

客服热线：95548

联系人：刘晓明

公司网址：<http://sd.citics.com/>

（46）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

法定代表人：廖庆轩

客服热线：400-809-6096、95355

联系人：周青

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

---

(47) 上海华信证券有限责任公司

注册地址：上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼

办公地址：上海黄浦区南京西路399号明天广场22楼

法定代表人：郭林

客服电话：4008-205-999

联系人：李颖

公司网站：www.shhxzq.com

(48) 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

联系人：刘宏莹

公司网址：www.citicsf.com

客服电话：400-990-8826

(49) 诺亚正行基金销售有限公司

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：上海市杨浦区长阳路1687号2号楼

法定代表人：汪静波

公司网址：www.noah-fund.com

客服电话：400-821-5399

(50) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn；www.jjmmw.com

(51) 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

客服电话：400-700-9665

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

（52）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：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

（53）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦

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)

（54）上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层

法定代表人：张跃伟

客服电话：4008202899

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

（55）和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王莉

客服电话：400-920-0022

公司网址：<http://licaike.hexun.com/>

---

(56) 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6层

法定代表人：闫振杰

客服电话：400-818-8000

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

(57) 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

客服电话：4008-773-772

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

(58) 上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区黄河路333号201室A区056单元

办公地址：上海市徐汇区宜山路700号普天信息产业园2期C5栋2楼

法定代表人：金佶

客服电话：021-34013996

公司网址：[https:// www.hotjijin.com](https://www.hotjijin.com)

(59) 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：王之光

客服电话：400-821-9031

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

(60) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座6层

法定代表人：马勇

客服电话：400-166-1188



---

公司网址: <http://8.jrj.com.cn/>

(61) 上海联泰基金销售有限公司

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

办公地址: 上海市长宁区福泉北路518号8座3层

法定代表人: 燕斌

客服电话: 400-166-6788

公司网址: [www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(62) 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泛海国际SOHO城(一期)2301室

办公地址: 湖北省武汉市江汉区台北一路环亚大厦B座6楼

法定代表人: 陶捷

客服电话: 4000279899

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

(63) 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

办公地址: 北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室

法定代表人: 周斌

客服电话: 400-8980-618

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

(64) 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

客服电话: 4001599288

公司网址: <https://danjuanapp.com/>

(65) 北京广源达信基金销售有限公司

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

---

客服电话：400-623-6060

公司网址：<http://www.niuniufund.com>

(66) 北京晟视天下基金销售有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

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

法定代表人：蒋煜

客服电话：010-58170761

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

(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

办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院东区3号楼为明大厦C座

法定代表人：赵芯蕊

客服电话：010-62675369

公司网址：<http://www.xincai.com/>

(68) 珠海盈米基金销售有限公司

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)

(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潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人：王翔

客服电话：400-820-5369

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

(70) 北京汇成基金销售有限公司

---

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108号

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1138号

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

公司网址：www.hcjjjin.com

（71）上海云湾基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号、明月路1257号1幢  
1层103-1、103-2办公区

办公地址：上海市浦东新区新金桥水路27号1号楼

法定代表人：冯轶明

客服电话：400-820-1515

公司网址：www.zhengtongfunds.com

（72）上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼

法定代表人：王廷富

客服电话：4007991888

公司网址：www.520fund.com.cn

（73）北京肯特瑞基金销售有限公司

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：江卉

客服电话：95518/4000888816

公司网址：http://fund.jd.com

（74）北京格上富信基金销售有限公司

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

客服电话：400-066-8586

---

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

(75) 泰诚财富基金销售(大连)有限公司

注册地址: 辽宁省大连市沙河口区星海中路3号

办公地址: 辽宁省大连市沙河口区星海中路3号

法定代表人: 林卓

客服电话: 4000411001

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

(76) 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: 上海市虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场53楼

法定代表人: 李兴春

客服电话: 4009217755

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

(77) 济安财富(北京)基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

办公地址: 北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

法定代表人: 杨健

客服电话: 400-673-7010

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

(78) 万家财富基金销售(天津)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

办公地址: 北京市西城区丰盛胡同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: 010-59013825

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

(79) 宜信普泽(北京)基金销售有限公司

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：[www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

（80）北京百度百盈基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区上地十街10号1幢1层101

办公地址：北京市海淀区上地信息路甲9号奎科科技大厦

法定代表人：张旭阳

客服电话：95055-4

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

（81）嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层  
5312-15单元

办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850

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

（82）深圳盈信基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1

办公地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1

法定代表人：苗宏升

客服电话：4007903688

公司网址：<http://www.fundying.com/>

（83）上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5楼01、02、03室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5楼01、02、03室

法定代表人：冷飞

客服电话：400-711-8718

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

（84）北京唐鼎耀华基金销售有限公司

---

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街19号A座1505室

法定代表人：张冠宇

客服电话：400-819-9868

公司网址：<https://www.tdyhfund.com>

（85）海银基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路8号402室

办公地址：上海市浦东新区银城中路8号4楼

法定代表人：惠晓川

客服电话：400-808-1016

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

（86）奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海  
商务秘书有限公司

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

客服电话：400-684-0500

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

（87）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号

办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：王锋

客服电话：95177

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

（88）江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道47号

办公地址：南京市鼓楼区中山北路2号绿地紫峰大厦2005室

法定代表人：吴言林

客服电话：025-56663409

---

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

(89) 北京植信基金销售有限公司

注册地址: 北京市密云区兴盛南路8号院2号楼106室-67

办公地址: 北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号

法定代表人: 王军辉

客服电话: 4006-802-123

公司网址: [www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

(90) 上海攀赢基金销售有限公司

注册地址: 上海市闸北区广中西路1207号306室

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴银城中路488号太平金融大厦603室

法定代表人: 沈茹意

客服电话: 021-68889082

公司网址: <http://www.pytz.cn/>

(91) 玄元保险代理有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室

法定代表人: 马永谔

客服电话: 400-080-8208

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

(92) 上海中正达广基金销售有限公司

注册地址: 上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

办公地址: 上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

法定代表人: 黄欣

客服电话: 400-6767-523 (021-33635338)

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

(93) 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址: 海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层

办公地址: 北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层

法定代表人: 李科

---

客服电话：95510

公司网址：<http://fund.sinosig.com/>

（94）北京辉腾汇富基金销售有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号2-2-1

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦F座12层B

法定代表人：许宁

客服电话：400-829-1218

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

（95）一路财富（北京）基金销售股份有限公司

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

客服电话：400-001-1566

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

（二）注册登记机构

名称：泰达宏利基金管理有限公司

住所：北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元

办公地址：北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元

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和经办律师

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、孙睿

联系人：孙睿

（四）审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室

办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：庞伊君

经办注册会计师：单峰、庞伊君

---

#### 四、基金的名称

泰达宏利蓝筹价值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

在严控风险的基础上，通过积极、主动的管理，精选业绩优良、收益稳定、在行业或细分行业内具有领先地位且价值相对低估的优质蓝筹上市公司股票，力争为投资者获取超越业绩比较基准的收益。

---

## 七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、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为60%-95%，其余资产投资于债券、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货等金融工具；权证投资占基金资产净值的比例不高于3%；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，现金类资产或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于优质蓝筹上市公司的股票不低于非现金基金资产的80%。

---

## 八、基金的投资策略

本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将科学、规范的选股方法与积极、灵活的资产配置相结合，通过“自上而下”和“自下而上”相结合的方法构建基金资产组合。一方面，本基金在对国内外宏观经济发展趋势、相关政策深入研究的基础上，从“自上而下”的角度对大类资产进行优化配置，并优选受益行业；另一方面，本基金凭借多年来不断积累形成的选股框架，从商业模式、市场前景、竞争壁垒、财务状况等方面出发，以“自下而上”的视角精选出具有长期竞争力和增长潜力的优质蓝筹上市公司，力求获取超越平均水平的良好回报。

### 1、资产配置策略

在资产配置中，本基金依据对宏观经济环境因素、价值因素、国家政策因素和市场情绪这四方面因素的综合分析判断，并通过定期召开投资决策委员会，形成对未来市场趋势的判断，从而确定基金中各类资产的中长期配置比例范围。

（1）宏观经济因素：主要关注定期的宏观经济指标、货币及财政政策的变化情况。关注指标包括但不限于：GDP增长、固定资产投资、工业企业利润增长率、CPI/PPI指数、货币流动性、财政政策以及国际经济数据等。

（2）价值因素：对价值因素的分析主要是对市场整体估值水平的考量，不仅对国内市场整体的P/E、P/B运行区间进行跟踪分析，同时也比较不同地区间的相对估值变化情况。

（3）国家政策因素：主要关注和分析国家宏观经济政策和监管政策对资本市场下一阶段可能产生的影响，以及政策的持续性和贯彻情况。

（4）市场情绪因素：通过对市场流动性的衡量来跟踪分析市场情绪变化情况，关注指标包括但不限于：技术分析指标、公募基金平均仓位、资金流向等。

### 2、股票投资策略

#### （1）投资范畴界定

---

本基金主要投资于蓝筹上市公司股票，指流通股市值在20亿元人民币以上的股票。

中国蓝筹股是股市价值的真正所在，从蓝筹股自身特点来说，首先，蓝筹公司历史悠久，具有较高的知名度和良好的信用，产品竞争力强，普遍具有相对稳定的盈利能力，能较好地抵御周期波动，同时股利政策稳定，股息率较高；其次，蓝筹股代表了经济结构和产业结构变迁的方向，把握了时代发展的脉搏。本基金主要通过投资于业绩优良、发展稳定、在行业内占有支配性地位、分红稳定的蓝筹上市公司股票，在有效控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，追求在稳定分红的基础上实现基金资产的长期稳定增长。蓝筹主题上市公司股票主要涉及传统蓝筹、中盘蓝筹和新兴蓝筹等。其中重点的行业和领域在以下几个方面：

**传统蓝筹：**传统行业中一些龙头公司经营稳健，在行业中占据领导地位，竞争优势显著，且分红收益率也明显较高，具备长期投资价值。而一些传统行业利用积累的优势，进军其他领域，也可以打开更大的长期成长空间。

**中盘蓝筹：**中盘蓝筹是指符合国家价值链重构、具有一定“护城河”、商业模式清晰可见、已经具有一定的行业地位，成功度过了“从小到大”的阶段，有望进入到“从大到强”的稳定成长期的一批公司。产业格局酝酿中盘蓝筹成长。借鉴日本成功转型的经验，中国需要通过产业升级来摆脱中等收入陷阱。这些产业主要集中于微笑曲线的两端，以技术、效率、品牌和服务的提升为主要线索，国内产业升级，向价值链的更高端转移，特别是中端制造业（通信设备，电子产品、高铁设备、电气设备、太阳能风能核电能源设备、军工装备等）和有望涌现更多的国际级龙头企业。而未来经济结构中消费贡献将不断提高，大众消费品中也将出现更多持续稳健成长的优质企业。

**新兴产业蓝筹：**在经济转型的大趋势下，中国的国民经济结构正面临深刻调整，新兴产业是国家未来经济结构转型的方向，虽然目前新兴产业仍处于起步阶段，但随着国家加大对战略新兴产业的扶持力度，未来新兴产业中逐渐涌现出更多的行业龙头值得期待。

## （2）行业配置策略

本基金的行业配置，首先是基于以上受益于经济转型的行业，同时会随着

---

经济社会的不断发展，动态调整转型受益行业的范围。在操作过程中，本基金将根据宏观经济中期趋势、政策环境变化、各行业景气度情况以及估值区间水平等因素，对行业配置不断进行调整和优化。

### （3）个股精选策略（定性分析、定量分析）

#### 定量筛选：

使用贴现现金流量法（DCF）和现金分红折现法（DDM）等估值方法确定出上市公司的内在价值，将其与市场价格相比较，并参考国内同类企业和国外可比同类企业的估值水平，选择出被市场低估的股票作为基金的备选股票。

#### 定性筛选：

研究员将根据外部研究报告和实地调研情况对备选股票进行定性评分，研究评分的主要内容包括两方面：

a. 公司评价：主要包括分析公司竞争力、财务状况、发展战略、创新能力、公司治理、股东背景等方面。

b. 业务分析：主要包括对公司的业务进行逐项分析，包括所涉及业务的投资效率、行业前景、公司的市场地位、行业增长、公司增长等方面。

通过对上市公司及其业务的分析，判断其成长动力来源、成长潜力和成长的可持续性，从中挑选出运营情况良好，具有成长潜力的上市公司。

### 3、债券投资策略

对债券的投资将作为控制投资组合整体风险的重要手段之一，通过采用积极主动的投资策略，结合宏观经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，运用久期调整、凸度挖掘、信用分析、波动性交易、品种互换、回购套利等策略，权衡到期收益率与市场流动性，精选个券并构建和调整债券组合，在追求债券资产投资收益的同时兼顾流动性和安全性。

### 4、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具。本基金的权证投资以权证的市值价值分析为基础，依据权证定价模型确定其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产的长期稳定增长。



---

## 5、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。

## 6、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。

## 7、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、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准： $60\% \times \text{沪深300指数收益率} + 40\% \times \text{中证综合债指数收益率}$

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。中证综合债券指数由中证指数有限公司编制，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，较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。

本基金是混合型基金，基金在运作过程中股票资产占基金资产的比例为60%-95%，其余资产投资于债券、债权回购、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货等金融工具。因此，“ $60\% \times \text{沪深300指数收益率} + 40\% \times \text{中证综合债指数收益率}$ ”是适合衡量本基金投资业绩的比较基准。

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，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金经基金管理人和基金托管人协商一致，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，且无需召开基金份额持有人大会。如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时，基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，经基金托管人同意并按监管部门要求履行适当程序后，选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数，且无需召开基金份额持有人大会。

---

## 十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

## 十一、基金的投资组合报告

### 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。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年12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2018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	107,612,936.19	83.88
	其中：股票	107,612,936.19	83.88
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	315,107.70	0.25
	其中：债券	315,107.70	0.25
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买	—	—

	入返售金融资产		
7	银行存款和结算备付金 合计	20,320,866.42	15.84
8	其他资产	47,112.07	0.04
9	合计	128,296,022.38	100.00

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 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	6,122,480.00	4.94
B	采矿业	—	—
C	制造业	75,945,513.33	61.30
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	12,214,883.86	9.86
J	金融业	9,789,975.00	7.90
K	房地产业	2,716,104.00	2.19

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	823,980.00	0.67
S	综合	-	-
	合计	107,612,936.19	86.87

## 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。

## 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	300498	温氏股份	150,800	6,122,480.00	4.94
2	000858	五粮液	59,200	5,624,000.00	4.54
3	600519	贵州茅台	6,497	5,548,373.03	4.48
4	000860	顺鑫农业	84,700	5,135,361.00	4.15
5	300059	东方财富	258,334	5,006,512.92	4.04
6	300595	欧普康视	83,005	4,836,701.35	3.90

7	600570	恒生电子	52,800	4,623,168.00	3.73
8	000568	泸州老窖	56,500	3,761,770.00	3.04
9	601688	华泰证券	164,200	3,679,722.00	2.97
10	000661	长春高新	10,900	3,455,191.00	2.79

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	315,107.70	0.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	315,107.70	0.25

5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	110054	通威转债	2,040	204,000.00	0.16
2	128016	雨虹转债	957	111,107.70	0.09

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

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

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

10.1 本期国债期货投资政策

在报告期内，本基金未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

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 投资组合报告附注

11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。



11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明  
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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	32,822.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,967.13
5	应收申购款	9,321.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,112.07

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128016	雨虹转债	111,107.70	0.09

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。

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。

## 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2015年6月3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2018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：

泰达宏利蓝筹混合

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
本基金合同生效之日起至2015年12月31日	-26.80%	1.99%	-14.87%	1.67%	-11.93%	0.32%
2016年1月1日至2016年12月31日	-26.64%	1.76%	-5.60%	0.84%	-21.04%	0.92%
2017年1月1日至2017年12月31日	28.49%	0.96%	12.81%	0.38%	15.68%	0.58%
2018年1月1日至2018年9月30日	-15.22%	1.38%	-6.83%	0.73%	-8.39%	0.65%

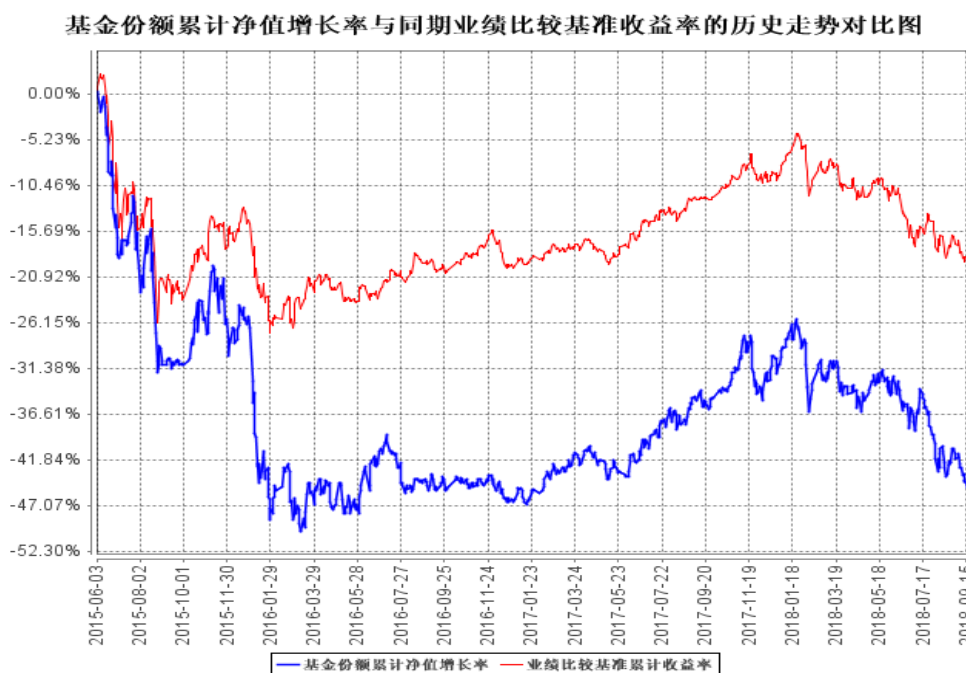
本基金合同生效之日起至 2018 年 9 月 30 日	-41.50%	1.53%	-15.53%	0.93%	- 25.97%	0.60%
-----------------------------	---------	-------	---------	-------	-------------	-------

注：本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率\*60%+中证综合债指数收益率\*40%

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。中证综合债券指数由中证指数有限公司编制，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，较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。

(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

泰达宏利蓝筹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6月3日至2018年9月30日）



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。

---

## 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、期货交易费用；
- 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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5 \% \div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### 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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

上述“一、基金费用的种类中第3—9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，酌情调低基金费率、基金托管费率，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

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金原招募说明书进行了更新。本次主要更新的内容为：根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》以及本基金的《基金合同》、《托管协议》，对招募说明书所涉章节进行了更新。

泰达宏利基金管理有限公司

2020年1月16日