

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）更新招募说 明书

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

【重要提示】

本基金于 2018 年 8 月 3 日经中国证监会证监许可[2018]1246 号文注册。基金合同于 2018 年 10 月 25 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。

基金名称中含有“养老”并不代表收益保障或其他任何形式的收益承诺，本基金不保本，可能发生亏损。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。

本基金为混合型基金中基金，以为投资者在严控风险的前提下创造较高投资收益为目标，因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险相对较小，而相对其业绩比较基准，由于投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。

本基金是养老目标风险系列 FOF 产品中风险处于中等的基金，风险收益相对均衡。本基金权益类资产和非权益类资产的战略配置比例是 50%：50%，基金经理可根据资本市场变化动态调整权益类资产和非权益资产，但权益类资产的向上、向下的战术调整幅度分别不得超过战略配置比例的 5%、10%，即权益类资产占基金资产的比例在 40%-55%之间。

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。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2019 年 4 月 25 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 3 月 31 日。财务数据未经审计。

目录

第 1 部分	绪言	1-1
第 2 部分	释义	2-1
第 3 部分	基金管理人	3-1
第 4 部分	基金托管人	4-1
第 5 部分	相关服务机构	5-1
第 6 部分	基金的募集	6-1
第 7 部分	基金合同的生效	7-1
第 8 部分	基金份额的申购与赎回	8-1
第 9 部分	基金的投资	9-1
第 10 部分	基金的财产	11-1
第 11 部分	基金资产的估值	12-1
第 12 部分	基金的收益与分配	13-1
第 13 部分	基金费用与税收	14-1
第 14 部分	基金的会计与审计	15-1
第 15 部分	基金的信息披露	16-1
第 16 部分	风险揭示	17-1
第 17 部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算	18-1
第 18 部分	基金合同的内容摘要	19-1
第 19 部分	基金托管协议的内容摘要	20-1
第 20 部分	对基金份额持有人的服务	21-1
第 21 部分	其他应披露事项	22-1
第 22 部分	招募说明书存放及查阅方式	23-1
第 23 部分	备查文件	24-1

第1部分 绪言

《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）招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依照《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第2号——基金中基金指引》（以下简称“《基金中基金指引》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《养老目标证券投资基金指引（试行）》（以下简称“《养老指引》”）和其他有关法律法规编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

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）（以下简称“基金”或“本基金”）是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、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》、基金合同及其他有关规定享有权利、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。

第2部分 释义

在《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）招募说明书》中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、招募说明书或本招募说明书：指《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）招募说明书》及其定期的更新

2、基金或本基金：指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）

3、基金管理人：指泰达宏利基金管理有限公司

4、基金托管人：指中国农业银行股份有限公司

5、基金合同：指《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）基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

6、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《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）托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

7、基金份额发售公告：指《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）基金份额发售公告》

8、法律法规：指中国（为本合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区）现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《基金中基金指引》：指中国证监会 2016 年 9 月 11 日发布并实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 2 号——基金中基金指引》及发布机关对其不时做出的修订

14、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日发布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及发布机关对其不时做出的修订

15、《养老指引》：指中国证监会 2018 年 2 月 11 日发布、并实施的《养老目标证券投资基金指引（试行）》及发布机关对其不时做出的修订

16、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

17、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

18、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

19、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险业监督管理委员会

20、基金中基金：指依据《基金中基金指引》的规定，将 80%以上的基金资产投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额的基金

21、被投资基金：指依据《基金中基金指引》和基金合同的约定，本基金投资的经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额的基金

22、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义

务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

23、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

24、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

25、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

26、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

27、投资人：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

28、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

29、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

30、销售机构：指泰达宏利基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

31、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

32、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为泰达宏利基金管理有限公司或接受泰达宏利基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

33、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

34、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机

构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

35、**基金合同生效日**：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

36、**基金合同终止日**：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

37、**基金募集期**：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月

38、**存续期**：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

39、**工作日**：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

40、**T 日**：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

41、**T+n 日**：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日），n 为自然数

42、**开放日**：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

43、**开放时间**：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

44、**最短持有期**：本基金对每笔认购或申购的份额设置最短持有期为 3 年，最短持有期内，投资者不能提出赎回申请，期满后（含到期日）投资者可以申请赎回。认、申购份额的最短持有期的起始日分别为基金合同生效日、申购申请确认日，对应的最短持有期到期日分别为基金合同生效日、申购申请确认日的 3 年对日，无对日的，该月最后一日为到期日。若该日为非工作日，则顺延至下一工作日

45、**《业务规则》**：指《泰达宏利基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人 and 投资人共同遵守

46、**认购**：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

47、**申购**：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

48、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

49、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为

50、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

51、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、申购金额及扣款方式，由销售机构于每期约定申购日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

52、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%

53、元：指人民币元

54、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

55、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

56、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

57、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

58、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

59、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介

60、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

61、上市基金份额：指通过上海证券交易所、深圳证券交易所交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易业务的基金份额

62、非上市基金份额：指不通过上海证券交易所、深圳证券交易所交易系统，

而通过其他基金的招募说明书或临时报告列明的、及其不时更新的销售渠道办理基金份额认购、申购（转入）、赎回（转出）的基金份额

63、基金平台：指为基金投资其他基金提供便利服务的，具有提供基金市场信息，支持基金申购、赎回和基金转换功能，处理基金资金结算和分红收入归集，基金确认信息传递，基金分析报表等功能的平台

64、中国：指中华人民共和国，为基金合同的目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

第3部分 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

联系电话：010-66577808

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。

杜汶高先生，副董事长。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。

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。

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。

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。

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，现任宏利资产管理（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。

何自力先生，独立董事，1982年毕业于南开大学，经济学博士。1975至1978年，于宁夏国营农场和工厂务农和做工；1982年至1985年，于宁夏自治区党校

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。

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）。现任宏利资产管理公司（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、宏利资产管理公司（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，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。

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、基金经理

王彦杰先生，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。2018年10月25日至今担任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）基金经理。2018年10月25日至今担任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）基金经理，具有超22年证券从业经验，具有基金从业资格。

王建钦先生，组合基金部总监兼信用研究部总监。毕业于美国弗吉尼亚州州立欧道明大学，企业管理硕士。2000年至2001年任美林证券(美国)投资顾问。2001年至2008年历任台湾人寿保险股份有限公司投资部分析师、投资部资深分析师、国际投资部科长。2008年至2012年历任中央再保险公司(台湾) 投资部副理、投资部经理。2012年至2016年任宏利证券投资信托公司(台湾) 固定收益投资主管。2016年10月加盟泰达宏利基金管理有限公司，任泰达宏利基金管理有限公司信用研究部总监，2018年6月起任泰达宏利基金管理有限公司组合基金部总监兼信用研究部总监。2018年10月25日至今担任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)基金经理；具有19年证券从业经验，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、投资副总监戴洁（主持工作）、投资副总监刘欣、研究副总监张勋、固定收益部总经理丁宇佳、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、戴洁、丁宇佳、庞宝臣、傅浩表决。
- （2）权益类事项由刘建、戴洁、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和授权，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。

第4部分 基金托管人

一、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务

优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

二、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 240 名，其中具有高级职称的专家 30 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

三、证券投资基金托管情况

截止到 2019 年 3 月 31 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 440 只。

四、托管业务的内部控制制度

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，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。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

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；业务管理实行严格的复核、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。

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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒介和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

第5部分 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：郑小囡

联系电话：010-66577619、010-66577617

客服信箱：irm@mfcteda.com

客服电话：400-698-8888

传真：010-66577760/61

公司网站：<http://www.mfcteda.com>

2) 泰达宏利基金网上直销系统

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

支持基金管理人旗下基金网上直销的银行卡和第三方支付有：农行银行卡、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、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、其他销售机构

1) 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：周慕冰

客服电话：95599

联系人：张伟

银行网站：www.abchina.com

2) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号 s

办公地址：深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林 sss

联系人：赵杨

客户服务热线：95511-3

3) 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：李民吉

联系人：郑鹏

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

4) 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

5) 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：刘芸

公司网站：www.csc108.com

6) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：何之江

联系人：周驰全国免费业务咨询电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

7) 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

8) 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：待定

联系人：黄静

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

9) 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

联系人：刘婧漪、贾鹏

10) 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

11) 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/>

12) 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

13) 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

客服电话：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

14) 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

15) 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

16) 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

17) 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

18) 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

19) 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

20) 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

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：王之光

客服电话：400-821-9031

公司网址：www.lufunds.com

22) 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

23) 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/>

24) 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/>

25) 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

26) 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

27) 中宏人寿保险有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道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层

法定代表人：何达德（Michael Edward Huddart）

客服电话：95383

公司网址：<https://funds.manulife-sinochem.com/>

28) 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

29) 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

30) 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.hcjjin.com

31) 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

32) 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：95518/400 088 8816

公司网址：fund.jd.com

33) 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

34) 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

35) 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

36) 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

37) 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中环国际1413室

法定代表人：吴言林

客服电话：025-56663409

公司网址：www.huilinbd.com

38) 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

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

法定名称：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

第6部分 基金的募集

基金管理人按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集本基金，并于2018年8月3日经中国证监会证监许可[2018]1246号文募集注册。

一、基金运作方式

契约型开放式。

本基金每笔份额的最短持有期限为3年，最短持有期内，投资者不能提出赎回申请，期满后（含到期日）投资者可提出赎回申请。

申购份额的“3年持有期限起始日”为申购申请确认日；“3年持有期限到期日”为申购申请确认日的3年对日，无对日的，该月最后一日为到期日。若该日为非工作日，则顺延至下一工作日。

二、基金的类别

混合型FOF。

三、基金存续期限

不定期。

四、基金的募集情况

经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的有效认购户数为40,703户，净销售金额为人民币229,469,540.18元，折合基金份额229,469,540.18份；募集资金在基金合同生效前产生的利息共计人民币93,886.24元，折合93,886.24份基金份额归基金份额持有人所有，合计募集份额为229,563,426.42份。上述资金已于2018年10月24日划入本基金在基金托管人农业银行股份有限公司开立的基金托管专户。

第7部分 基金合同的生效

一、基金合同生效的条件

根据有关规定，本基金满足《基金合同》生效条件，《基金合同》于 2018 年 10 月 25 日正式生效。自《基金合同》生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露。连续 60 个工作日出现上述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或基金合同另有规定时，从其规定。

第8部分 基金份额的申购与赎回

一、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

依据基金合同约定，本基金每笔份额的最短持有期限为3年，最短持有期内，投资者不能提出赎回申请，期满后（含到期日）投资者可提出赎回申请。

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在调整实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金已于2018年11月5日起开放日常申购、赎回业务。

每笔基金份额持有期满3年后，基金份额持有人方可就基金份额提出赎回申请。基金管理人自基金合同生效之日后的认购份额的3年持有期限到期日之后开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日对应的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

5、“基金份额持有人利益优先”原则，即若发生申购、赎回损害基金份额持有人利益的情形时，应当及时暂停申购、赎回业务。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购申请即为成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+10 日(包括该日)内支付赎回款项。特殊情况下，基金份额持有人赎回申请成功后，基金管理人可与基金托管人协商，在法律法规规定的期限内向基金份额持有人支付赎回款项。如遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款顺延至问题解决后的下一个工作日划往基金份额持有人银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+3 日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在 T+4 日后(包括该日)及时

到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

在法律法规允许的范围内，本基金登记机构可根据相关业务规则，对上述业务办理时间进行调整，本基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。

五、申购和赎回的数量限制

1、通过基金管理人直销中心申购，单个基金账户单笔首次申购最低金额为 10 万元（含申购费），如有认购记录的，则首次申购最低金额不受 10 万元限制；追加申购最低金额为 1000 元（含申购费）；通过基金管理人网上直销进行申购，单个基金账户单笔最低申购金额为 1 元（含申购费），单笔交易上限及单日累计交易上限请参照网上直销相关说明。通过其他销售机构申购，单个基金账户单笔申购最低金额为 1 元人民币（含申购费），销售机构有权在不低于上述规定的前提下，根据自身情况设置。

2、基金份额持有人赎回时或赎回后，在销售机构（网点）单个交易账户保留的基金份额余额不足 1 份的，基金管理人有权一次将基金份额持有人在該交易账户保留的剩余基金份额全部赎回。

3、投资者可多次申购，对单个投资者累计持有基金份额的比例或数量不设上限限制，但单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%（在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外）。

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、申购费用

本基金在申购时收取基金申购费用。投资者如果有多笔基金份额的申购，适用费率按单笔分别计算。本基金对通过直销中心申购基金份额的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

(1) 通过基金管理人的直销中心申购本基金份额的养老金客户申购费率见下表：

申购金额（M，含申购费）	养老金客户申购费率
M<100 万元	0.30%
100 万元≤M<250 万元	0.20%
250 万元≤M<500 万元	0.15%
M≥500 万元	按笔收取，1000 元/笔

(2) 本基金其他投资者（非养老金客户）申购本基金 A 类基金份额申购费率如下表：

申购金额（M，含申购费）	非养老金客户申购费率
M<100 万元	1.20%
100 万元≤M<250 万元	0.80%
250 万元≤M<500 万元	0.6%
M≥500 万元	按笔收取，1000 元/笔

本基金的申购费用应在投资者申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

2、赎回费用

本基金不收取赎回费。每笔基金份额持有期满 3 年后，基金份额持有人方可就基金份额提出赎回申请。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调

低基金申购费率和基金赎回费率。

5、法律、法规或监管部门另有规定的，从其规定。

七、申购和赎回的数额和价格

1、申购份额的计算

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算。

(1) 基金份额申购

a) 若适用比例费率时，申购基金份额的计算方法如下：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日的基金份额净值

b) 若适用固定费用时，申购基金份额的计算方法如下：

净申购金额 = 申购金额 - 固定费用

申购费用 = 固定费用

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日的基金份额净值

上述计算结果均保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则、操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

例如：某投资者(非养老金客户)投资 5 万元申购本基金份额，对应费率为 1.20%，假设申购当日的基金份额净值为 1.0160 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率) = 50,000 / (1 + 1.20%) = 49,407.11 元

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额 = 50,000 - 49,407.11 = 592.89 元

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日的基金份额净值 = 49,407.11 / 1.0160 = 48,629.05 份

即：投资者(非养老金客户)投资 5 万元申购本基金份额，假设申购当日的基

金份额净值为 1.0160 元，则可得到 48,629.05 份基金份额。

2、基金份额赎回金额的计算

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以赎回申请当日的基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额。

赎回金额=赎回份额×T 日的基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额-赎回费用

计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则、操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

例如：某投资者赎回本基金份额 1 万份，持有时间为 1200 天，对应的赎回费率为 0.0%，假设赎回当日的基金份额净值是 1.1200 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回金额=10,000×1.1200=11,200.00 元

赎回费用=11,200.00×0.0%=0 元

净赎回金额=11,200.00-0=11,200.00 元

即：投资者赎回基金份额 1 万份，持有期限为 1200 天，假设赎回当日基金份额的基金份额净值是 1.1200 元，则其可得到的赎回金额为 11,200.00 元。

3、基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

T 日的基金份额净值在 T+2 日内完成计算，并在 T+3 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、若占相当比例的被投资基金暂停申购，基金管理人认为有必要暂停本基

金申购的情形。

3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。

4、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

5、某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

6、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

7、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第 5 项、第 8 项外的暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、若占相当比例的被投资基金暂停赎回，基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的情形。

3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不

确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

4、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

5、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

6、某笔或某些赎回申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第5项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

十、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎

回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回:连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受基金的赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过 20 个工作日,并应当在指定媒介上进行公告。

(4) 当基金发生巨额赎回,在单个基金份额持有人超过基金总份额 20%以上的赎回申请情形下,基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人可以对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。基金管理人只接受其基金总份额 20%部分作为当日有效赎回申请,对于该基金份额持有人当日有效赎回申请,基金管理人可以根据前述“(1) 全额赎回”或“(2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。对单个基金份额持有人超过基金总份额 20%以上的赎回申请延期赎回。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。延期部分如选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在指定媒介上刊登公告。

十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的,基金管理人当日应立即向中国证监会

备案，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3、若暂停时间超过 1 日，基金管理人可以根据《信息披露办法》自行确定公告增加次数。

十二、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

十三、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

十四、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

十五、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

十六、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期申购金额，每期申购金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

本基金已于 2018 年 11 月 5 日起开放定期定额投资。

十七、基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

如相关法律法规允许基金管理人办理其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

第9部分 基金的投资

一、投资目标

本基金主要运用目标风险策略对大类资产进行配置，在风险可控的前提下，通过主动的资产配置、基金优选，力求基金资产稳定增值。

二、投资范围

本基金的投资范围包括经中国证监会依法批准或注册的公开募集的基金份额(含 QDII 基金、商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)，但基金中基金除外)、香港互认基金、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、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)等)、资产支持证券、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)、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需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：本基金投资于证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%；投资于权益类资产的战略配置比例为 50%，非权益类资产的战略配置比例为 50%，其中权益类资产为股票、股票型基金、以及符合以下两种情况之一的混合型基金：一是基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产的 50%，二是最近 4 个季度末，每季度定期报告披露的股票资产占基金资产的比例不低于 50%。

基金经理可以在符合本基金投资目标和投资策略的前提下，结合自身研判、投资经验等，对权益类资产、非权益类资产进行战术调整，但权益资产的向上、向下的战术调整幅度分别不得超过战略配置比例的 5%、10%，即权益类资产占基金资产的比例在 40%-55%之间。现金或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。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

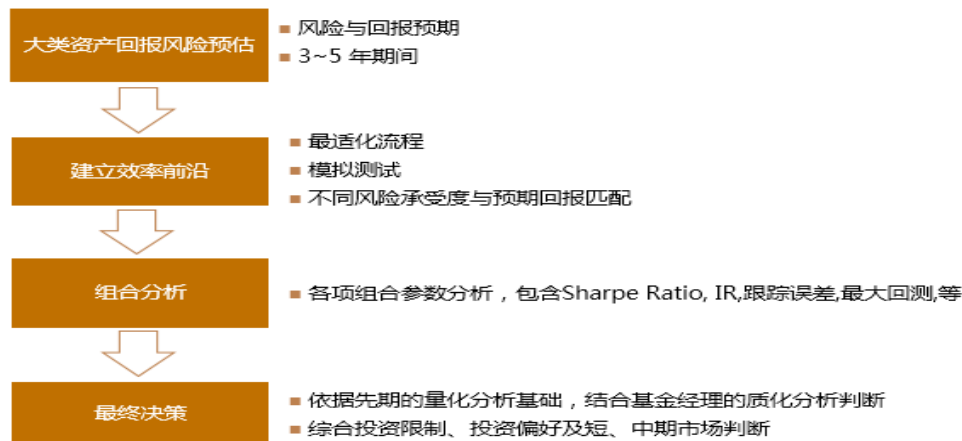
三、投资策略

本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，在各种类型的基金中进行优选。

1、资产配置策略

本基金为目标风险策略基金，根据基金合同约定的权益类、非权益类资产的目标配置比重进行资产配置。同时基金经理将结合资本市场实际发展情况，在基金合同约定的范围内对各期的大类资产配置比例进行动态调整。

本基金在资产配置方面遵循严格的、纪律化的自上而下的决策流程。在战略资产配置层面，基金管理人将结合内外部的投资研究经验，对各大类资产的最近3~5年期间的投资回报进行展望，形成基金在各类资产的中长期的配置中枢。在短期内，基金管理人将结合当期宏观经济金融水平，对各类资产的短期风险水平进行估算，高配当前被低估的资产、低配被高估的资产。



具体来说，本基金将利用各类量化指标与宏观基本面研究，结合市场环境的变化引入战术资产配置，动态分配资产以符合投资组合的目标风险，使得不同环境中表现良好的资产都能为投资组合提供预期收益贡献。

在宏观分基本面分析上，经济周期的内生力量会受到政策周期的影响导致资产价值和价格偏移。因此，本基金将综合宏观、估值、情绪、政策等构建战术资产配置框架，对处于上升通道的强势资产，或短期趋势有大概率由弱转强的资产，将给予适当的超配；对处于下行通道的弱势资产，或短期趋势有大概率由强转弱的资产，将给予适当的低配。

2、基金投资策略

基金经理对全市场中的公募基金进行筛选，优选风格明确、超额收益良好的基金构建重点投资池。基金经理对重点投资池的基金进行持续跟踪，对各基金的整体表现进行及时评估。在重点投资池的范围内，根据各基金的相对收益、下行风险控制等方面的表现进行重点、长期持有。

（1）备选基金池的构建

进入备选基金池的基金需符合的条件有：

a. 子基金的运作期限应当不少于 2 年，最近 2 年平均季末基金净资产应当不低于 2 亿元；子基金为指数基金、ETF 和商品基金等品种的，运作期限应当不少于 1 年，最近定期报告披露的季末基金净资产应当不低于 1 亿元；

b. 如为上市基金份额，日均成交金额不低于 200 万元；

c. 基金份额不得具有复杂、衍生品性质，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额；

d. 子基金运作合规，风格清晰，中长期收益良好，业绩波动性较低；

e. 子基金基金管理人及子基金基金经理最近 2 年没有重大违法违规行为；

f. 中国证监会要求不能投资的其他基金除外。

g. 在特殊情况下，如某基金不满足 b 条件成交金额要求的，基金经理通过研究分析认为仍具备较高投资价值的，在履行相关程序后，可进入备选基金池。

（2）基金的筛选与投资

在各个类型基金的筛选方面，本基金将结合定量和定性分析，对基金池中的各类型基金计算其超额收益、绝对收益能力，对不同类型基金的基金经理投资能力进行评估，同时综合考虑基金规模、申购赎回特征、整体费率等方面，优选各个基金类型下的优质基金。

在具体基金的筛选方面，本基金主要基于量化度量指标，结合基金经理对各基金投资价值方面的主观判断能力，对各基金进行优选。

对于指数型基金，将根据组合投资需要，筛选跟踪标的指数的基金进行分析。具有相同跟踪标的指数的基金，将主要根据该基金对标的指数的超额收益、跟踪误差、信息比率等指标度量该基金的实际投资价值。基金将优选跟踪误差低、超额收益高以及基金经理稳定的基金作为重点投资对象，基金经理根据实际情况，对各基金的投资价值进行动态调整。

在主动管理类基金筛选方面，与指数型基金不同，主动管理类基金在投资策略方面没有明确的跟踪标的，因此基金经理结合定性、定量分析，筛选绩优基金。

主要因子有：各基金在各类风格资产的超额收益能力，基金经理的稳定性，基金的申购赎回情况，基金的相对收益排名等多项指标。基金经理根据市场实际情况，对包含上述指标在内的各项指标进行动态调整，优选有效性高的指标构建多因子模型进行基金优选。基金经理基于量化优选模型结果，对综合评分较高的基金进行重点研究分析，结合自身的研究及调查分析，对上述基金的前瞻性投资价值进行最终评估。

在满足投资组合相关风险约束的前提下，分散化选取具有超额收益潜质的基金。使得本基金在享受资产配置方面产生的投资收益的同时，也能够享受到投资优质基金而带来的超额收益，以最大化组合投资收益。

本基金投资其他基金的方式如下：

1) 申购（转换转入）和赎回（转换转出）：其他基金开放申购赎回后，进行申购赎回或者按照其他基金的法律文件的约定以其他方式申赎其他基金。

2) 二级市场方式：在二级市场进行上市基金的交易。

投资非自身管理的基金的，可以使用基金平台的服务。

当其他基金的申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。

(3) 在符合本基金上述投资策略的前提下，本基金可投资于本基金管理人管理的基金。

3、股票投资策略

在符合投资比例的条件下，本基金将参与沪深交易所内 A 股股票买卖等投资。本基金对公司基本面信息、财务信息、市场信息、投资者情绪信息等多方面数据进行处理和数量化研究，分析上市公司的成长能力、估值、盈利能力、公司治理能力、流动性、动量等因素，采用数量化风险模型对组合进行优化，获取相对稳定的超额收益。

4、债券投资策略

在符合投资比例的条件下，本基金将参与债券投资。债券作为债券类投资的一部分进行资产配置，将根据货币政策、市场利率走势、债券供求、债券的收益率水平和信用风险等因素，重点选择流动性好的、到期收益率和信用风险水平合理的债券品种。

5、资产支持证券投资策略

资产支持证券包括信贷资产支持证券、企业资产支持证券等，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。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金投资于证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%；

(2) 本基金投资于权益类资产的战略配置比例为 50%，非权益类资产的战略配置比例为 50%，其中权益类资产为股票、股票型基金、以及符合以下两种情况之一的混合型基金：一是基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产的 50%，二是最近 4 个季度末，每季度定期报告披露的股票资产占基金资产的比例不低于 50%。基金经理可以在符合本基金投资目标和投资策略的前提下，结合自身研判、投资经验等，对权益类资产、非权益类资产进行战术调整，但权益资产的向上、向下的战术调整幅度分别不得超过战略配置比例的 5%、10%，即权益类资产占基金资产的比例在 40%-55%之间；

(3) 本基金投资于股票、股票型基金、混合型基金、商品基金等品种的比例合计不超过基金资产的 60%，其中投资商品基金的比例不超过基金资产的 10%；

(4) 本基金持有单只基金的市值，不得高于本基金基金资产净值的 20%，且不得持有其他基金中基金；

(5) 除 ETF 联接基金外，本基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金不得超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准；

(6) 本基金不得持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额，中国证监会认可或批准的特殊基金中基金除外；

(7) 本基金投资的子基金运作期限应当不少于 2 年，最近 2 年平均季末基金净资产应当不低于 2 亿元；子基金为指数基金、ETF 和商品基金等品种的，运作期限应当不少于 1 年，最近定期报告披露的季末基金净资产应当不低于 1 亿元；子基金运作合规，风格清晰，中长期收益良好，业绩波动性较低；子基金的管理人及子基金基金经理最近 2 年没有重大违法违规行为；

(8) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(9) 本基金持有一家公司发行的证券（不含本基金所投资的基金份额），其市值不超过基金资产净值的 10%；

(10) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（不含本基金所投资的基金份额），不超过该证券的 10%；

(11) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；

(12) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(13) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 15%；

(14) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(15) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(16) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(17) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(18) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(19) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(20) 投资于封闭运作基金、定期开放基金等流通受限基金的市值不得高于基金资产净值的 10%；

(21) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本条所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(22) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对

手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(23) 本基金投资于股票、债券等金融工具的，投资品种和比例应当符合本基金的投资目标和投资策略；

(24) 本基金投资货币市场基金的比例不得超过基金资产的 5%；

(25) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合前款第(4)项、第(5)项规定的比例的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述第(4)项、第(5)项、第(8)项、第(16)项、第(21)项、第(22)项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，基金的投资范围、投资策略应该符合基金合同的约定。

基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (6) 法律、行政法规或者中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际

控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述规定的，本基金的投资不受上述限制或按照调整后的规定执行。

五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

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。

六、风险收益特征

本基金为混合型基金中基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。同时，本基金为目标风险系列基金中基金中风险收益特征相对均衡的基金。

七、基金的投资组合报告（未经审计）

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

本基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年5月8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 2019 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	185,865,013.17	73.25
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	67,364,440.74	26.55
8	其他资产	514,097.04	0.20
9	合计	253,743,550.95	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

1.2.2 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。

1.3 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

本基金报告期末未持有股票投资。

1.4 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。

1.5 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。

1.6 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。

1.7 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。

1.8 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。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1 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。

1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在本报告期末投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.10.1 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。

1.10.2 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。

1.10.3 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。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1 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。

1.11.2 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。

1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	6,440.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	170,271.67
4	应收利息	13,287.14
5	应收申购款	324,054.68
6	其他应收款	42.73

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	514,097.04

1.11.4 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。

1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末未持有股票投资。

1.11.6 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。

1.12 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金 资产净 值比例 (%)	是否 属于 基金 管理 人及 管理 人关 联方 所管 理的 基金
1	110038	易方达 纯债债 券 C	契约 型开 放式	15,642,207.06	17,738,262.81	7.00	否
2	000319	泰达宏 利淘利 债券 A	契约 型开 放式	14,469,200.50	16,276,403.64	6.42	是
3	233005	摩根士 丹利华 鑫强收 益债券 型证券 投资基 金	契约 型开 放式	8,931,685.98	16,227,980.26	6.40	否
4	518880	黄金 ETF	交易 型开 放式	5,118,600.00	14,270,656.80	5.63	否
5	003377	广发中 债 7-	契约 型开	11,380,652.89	11,863,192.57	4.68	否

		10年 国开债 指数C	放式				
6	000148	易方达 高等级 信用债 C	契约 型开 放式	10,081,450.31	11,775,133.96	4.65	否
7	100038	富国量 化沪深 300	契约 型开 放式	6,343,359.53	11,056,475.66	4.36	否
8	040008	华安策 略优选 混合	契约 型开 放式	6,165,887.38	10,581,279.33	4.18	否
9	000015	华夏纯 债债券 A	契约 型开 放式	8,455,862.61	10,240,049.62	4.04	否
10	270009	广发增 强债券	契约 型开 放式	8,880,994.67	10,230,905.86	4.04	否

1.13 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2019年1月1日 — 2019 年3月31日	其中：交易及持有基金管理 人以及管理人关联方所管理 基金产生的费用
当期交易基金产生的申购 费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回 费（元）	111,011.23	-
当期持有基金产生的应支 付销售服务费（元）	60,775.42	105.84
当期持有基金产生的应支 付管理费（元）	334,499.34	28,088.78
当期持有基金产生的应支 付托管费（元）	84,141.82	9,362.93

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出。

根据本基金合同的约定，本基金基金财产中投资于本基金管理人管理的其他基金份额的部分不收取管理费，本基金基金财产中投资于本基金托管人托管的其他基金份额的部分

不收取托管费。本基金管理人运用本基金财产申购其自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。相关申购费、赎回费由本基金管理人直接减免，相关销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还。

1.14 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无

第10部分 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 2018 年 10 月 25 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 2019 年 3 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：

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
2018.10.25-2018.12.31	-1.04%	0.26%	-0.31%	0.65%	-0.73%	-0.39%
2019.1.1-2019.3.31	5.65%					