

# 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(C类份额)基金产品

## 资料概要更新

编制日期：2020年8月7日

送出日期：2020年08月28日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

### 一、产品概况

基金简称	泰达宏利改革动力混合	基金代码	001017	
分级基金简称	泰达宏利改革动力混合C	分级基金交易代码	003550	
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	
基金合同生效日	2015年2月13日	上市交易所及上市日期	-	-
基金类型	混合型	交易币种	人民币	
运作方式	开放式（普通开放式）	开放频率	每个开放日	
基金经理	刘欣	开始担任本基金基金经理的日期	2015年2月13日	
		证券从业日期	2007年07月01日	
其他	《基金合同》生效后，连续60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，基金合同应当终止并根据基金合同的约定进行基金财产清算，而无需召开基金份额持有人大会。			

### 二、基金投资与净值表现

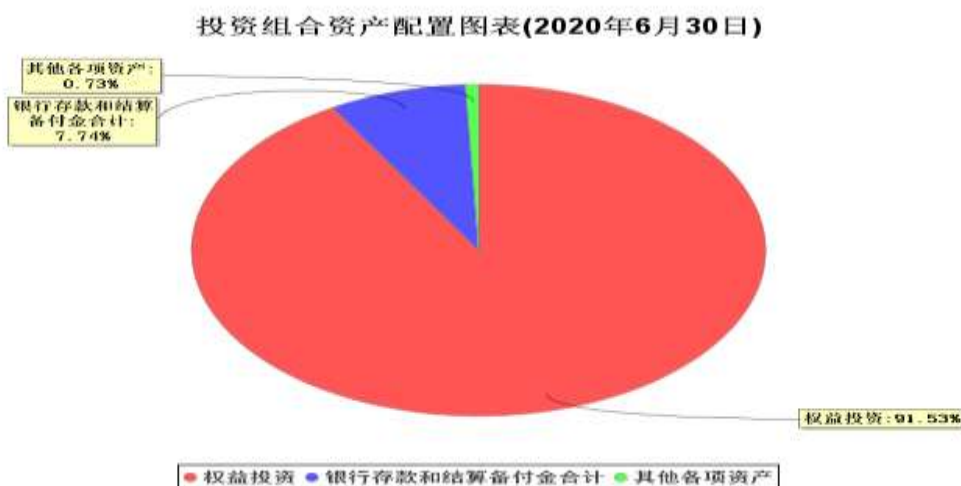
#### (一) 投资目标与投资策略

投资目标	本基金采取大类资产配置策略，同时深入研究各项改革过程中带来的投资机会，采用数量化投资方法，力争为基金份额持有人创造持久的、稳定的、较高的超额业绩基准收益。
投资范围	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0%-95%，其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券等金融工具；其中投资于具有改革动力主题的证券不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。

<p><b>主要投资策略</b></p>	<p>本基金以中国国有企业改革、金融改革、土地改革、企业兼并重组等产生的各类投资机遇为主线，通过量化投资方式精选个股。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，并优选收益行业；另一方面，本基金凭借多年来不断积累形成的量化选股框架，从国企改革因子、并购重组因子等方面出发，结合估值、成长、盈利质量、情绪等因子，以“自下而上”的视角精选出具有各项改革可能性、受益于改革的优质公司，力求在抵御各类风险的前提下获取超越平均水平的良好回报</p>
<p><b>业绩比较基准</b></p>	<p>50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率</p>
<p><b>风险收益特征</b></p>	<p>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。 根据 2017 年 7 月 1 日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，本基金的基金管理人和销售机构已按要求对本基金进行产品风险评级，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。</p>

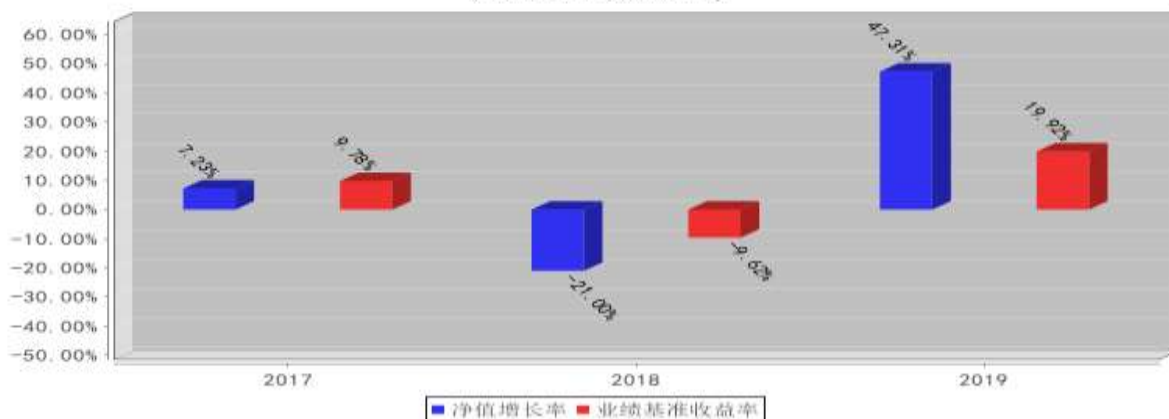
注: 详见《泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书》第九部分“基金的投资”。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(三) 自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

泰达宏利改革动力混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图 (2019年12月31日)



注:本基金A类份额合同生效日为2015年2月13日,2015年度净值增长率的计算期间为2015年2月13日至2015年12月31日。基金的过往业绩不代表未来表现。

### 三、投资本基金涉及的费用

#### (一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取:

费用类型	份额(S)或金额(M) /持有期限(N)	收费方式/费率
赎回费	1天 $\leq$ N $\leq$ 6天	1.50%
	7天 $\leq$ N $\leq$ 29天	0.50%
	N $\geq$ 30天	0.00%

注:泰达宏利改革动力混合C不收认购费和申购费。

#### (二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

费用类别	收费方式/年费率
管理费	1.50%
托管费	0.25%
销售服务费	0.30%
其他费用	信息披露费用、会计师费、律师费和诉讼费、基金份额持有人大会费用、基金相关账户的开户及维护费用、基金的证券、期货交易费用、银行汇划费用、及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。

注:本基金交易证券、基金等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

详见《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更新招募说明书》第十四部分“基金的费用与税收”。

### 四、风险揭示与重要提示

#### (一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险,投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金面临的主要风险有市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、管理风险、合规风险、本基金特有的风险、其他风险。

本基金特有的风险:

本基金属于混合型基金,将同时投资于权益类及固定收益类市场。如果股票市场、债券市场出现整体下跌,本基金的净值表现将受到影响。

在股票市场投资中,本基金特有的风险来自于以下几个方面:一是对国家颁布的经济转型方面的政策法规研究是否准确深入;二是对经济转型时期相关产业内部上市公司的研究是否符合市场预期,在研究过程中存在的投资人与上市公司之间的信息不对称问题同样值得关注。三是在股票投资方面的时间点选择是否恰当,基金经理、交易员在指令的发送时间、交易处理时间都会影响基金的净值情况。

在债券投资中,本基金特有的风险主要来自以下几个方面:一是对宏观经济趋势、政策以及债券市场基本面研究是否准确、深入。二是对企业类债券的优选和判断是否科学、准确。基本面研究及企业类债券分析的错误均可能导致所选择的证券不能完全符合本基金的预期目标。三是本基金所投资的企业类债券承载的信用风险要高于高信用等级债券(如国债),若债券发行人出现违约、不能按时或全额支付本金和利息,

将导致基金资产损失,发生信用风险。四是本基金对股票市场的筛选与判断是否科学、准确。基本面研究以及定量分析可能都无法使得本基金所选券种符合预期投资目标。

以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

## (二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册(或核准),并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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。

基金投资者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。

基金产品资料概要信息发生重大变更的,基金管理人将在三个工作日内更新,其他信息发生变更的,基金管理人每年更新一次。因此,本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后,如需及时、准确获取基金的相关信息,敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见泰达宏利基金管理有限公司网站[网址:<http://www.mfcteda.com>][客服电话:400-698-8888]

1. 基金合同、托管协议、招募说明书
2. 定期报告,包括基金季度报告、中期报告和年度报告
3. 基金份额净值
4. 基金销售机构及联系方式
5. 其他重要资料

## 六、其他情况说明

无