

泰达宏利行业精选混合型证券投资基金

更新招募说明书摘要

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

泰达宏利行业精选混合型证券投资基金于2004年4月21日经中国证监会证监基金字【2004】58号文批准募集，基金合同于2004年7月9日正式生效。

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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资者赎回时，所得或会高于或低于投资者先前所支付的金额。

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，投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、管理风险、合规性风险、本基金的特定风险和其他风险等等。

本更新招募说明书摘要摘自更新招募说明书正文，投资者欲了解详细内容，应阅读更新招募说明书正文。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资者在认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，

基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2017 年 7 月 9 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 6 月 30 日，财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：泰达宏利基金管理有限公司

成立日期：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

信息披露联系人：陈沛

注册资本：1.8 亿元人民币

股权结构：北方国际信托股份有限公司：51%；宏利资产管理（香港）有限公司：49%。

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月，是中国首批合资基金管理公司之一。截至目前，公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金（LOF）、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基金、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）、泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利收益增强债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利养老收益混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债

券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利新起点灵活配置混合证券投资基金、泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利活期友货币市场基金、泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利多元回报债券型证券投资基金、泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金、泰达宏利汇利债券型证券投资基金、泰达宏利量化增强股票型证券投资基金、泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利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、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利京元宝货币市场基金、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、宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启迪灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启惠灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启明灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启泽灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利京天宝货币市场基金、泰达宏利启富灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金在内的五十多只证券投资基金。

（二）主要人员情况

1、董事会成员：

弓劲梅女士，董事长。拥有天津南开大学经济学博士学位。曾担任天津信托有限责任公司研究员，天弘基金管理有限公司高级研究员，天津泰达投资控股有限公司高级项目经理，天津市泰达国际控股（集团）有限公司融资与风险管理部副部长。现任天津市泰达国际控股（集团）有限公司资产管理部部长。

杨雪屏女士，董事。拥有天津大学工科学士和中国人民大学新闻学硕士学位。1995年至2003年曾在天津青年报社、经济观察报社、滨海时报社等报社担任记者及编辑；2003年至2012年就职于天津泰达投资控股有限公司办公室秘书科；自2012年至今就职于天津市泰达国际控股（集团）有限公司，曾担任资产管理部高级项目经理，现任综合办公室副主任。

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

何达德先生，董事。毕业于英国伦敦城市大学，取得精算学荣誉理学士学位。现为宏利行政副总裁及宏利人寿保险（国际）有限公司首席行政总监，宏利资产管理（香港）有限公司首席行政总监，负责宏利于香港的全线业务，包括个人保险、雇员福利及财富管理等业务。同时何先生分别为宏利人寿保险（国际）有限公司及宏利资产管理（香港）有限公司之董事。现为澳大利亚精算学会及美国精算学会会员，在寿险及退休顾问工作方面拥有三十多年的丰富经验，其间担任多个领导层要职。

杜汶高先生，董事。毕业于美国卡内基梅隆大学，持有数学及管理科学理学士学位，现为宏利资产管理（亚洲）总裁兼亚洲区主管及宏利资产管理（香港）有限公司董事，掌管亚洲及日本的投资事务，专责管理宏利于区内不断壮大的资产，并确保公司的投资业务符合监管规定。出任现职前，杜先生掌管宏利于亚洲区（香港除外）的投资事务。2001年至2004年，负责波士顿领导机构息差产品的开发工作。杜先生于2001年加入宏利，之前任职于一家环球评级机构，曾获派驻纽约、伦敦及悉尼担任杠杆融资及资产担保证券等不同部门的主管，拥有二十多年的资本市场经验。

任赛华女士，董事。毕业于加拿大滑铁卢大学（University of Waterloo），获得数学学士学位，加拿大安大略省会计师公会之特许会计师。任女士于2007年加盟宏利资产，曾任首席行政事务总监，现担任宏利资产亚洲区零售经销部主管。早年任女士曾任职于亚洲和加拿大的著名国际投资银行、会计事务所及省级退休金委员会，监管托管业务的销售及担任全球基金服务客户关系管理、新业务发展及会计等高级职务。2013年6月至2015年4月担任泰达宏利基金管理有限公司监事。

刘建先生，董事。先后毕业于中国政法大学、天津财经学院，获法学学士、经济学硕士学位。1988年至2001年任中国建设银行股份有限公司金融机构部副处长；2001年至2003年任中信银行股份有限公司资金清算中心负责人；2003年至2014年任中银国际证券有限责任公司机构业务部董事总经理。2014年10月加盟泰达宏利基金管理有限公司，2015年4月任公司副总经理，2015年8月起任公司总经理。

何自力先生，独立董事，1982年毕业于南开大学，经济学博士。1975年至1978年，于宁夏国营农场和工厂务农和做工；1982年至1985年，于宁夏自治区党务从事教学和科研工作；1988年至今任职于南开大学，历任经济学系系主任、经济学院副院长，担任教授、博士生导师；兼任中国经济发展研究会副会长和秘书长、天津经济学会副会长；2002年1月至7月在美国加利福尼亚大学伯克利分校作访问学者。

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

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

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

2、监事会成员

许宁先生，监事长。毕业于南开大学，经济学硕士。1991年至2008年任职于天津市劳动和社会保障局；2008年加入天津市泰达国际控股（集团）有限公司，担任党委委员、董事会秘书、综合办公室主任。

陈景涛先生，监事。拥有澳大利亚麦考瑞大学商学学士、麦考瑞大学应用金融学硕士和南澳大学金融学博士学位。1998年先后就职于渣打银行、巴克莱资本、Baron Asset Management；2005年加入宏利资产，曾担任固定收益高级投资经理，现担任北

亚投资负责人。

廖仁勇先生，职工监事，人力资源管理在职研究生，曾在联想集团有限公司、中信国检信息技术有限公司从事人力资源管理工作；2007年6月加入泰达宏利基金管理有限公司，曾任人力资源部招聘与培训主管、人力资源部总经理助理，自2014年10月起担任人力资源部副总经理，主持部门工作。

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

3、总经理及其他高级管理人员

弓劲梅女士，董事长。简历同上。

刘建先生，总经理。简历同上

傅国庆先生，副总经理。毕业于南开大学和美国罗斯福大学，获文学学士和工商管理硕士学位，北京大学国家发展研究院EMBA。1993年至2006年就职于北方国际信托股份有限公司，从事信托业务管理工作，期间曾任办公室主任、研发部经理、信托业务总部总经理、董事会秘书、以及公司副总经理。2006年9月起任泰达宏利基金管理有限公司财务总监；2007年1月起任公司副总经理兼财务总监。

王彦杰先生，副总经理。毕业于台湾中山大学和淡江大学，获企业管理学士和财务金融硕士学位。1998年8月至2001年4月，先后在国际证券、日商大和证券、元大投信担任股票分析师；2001年5月至2008年2月，任保德信投信股票投资主管；2008年2月至2008年8月，就职于复华投信香港资产管理公司，担任执行长；2008年8月至2015年10月，就职于宏利资产管理有限公司，担任台湾地区投资主管；2015年10月加盟泰达宏利基金管理有限公司担任投资总监，2015年12月起任泰达宏利基金管理有限公司副总经理兼投资总监。

张萍女士，督察长。毕业于中国人民大学和中国科学院，管理学和理学双硕士。先后任职于中信公司、毕马威国际会计师事务所等公司，从事财务管理和管理咨询工作。2002年起在嘉实基金管理有限公司工作，任监察稽核部副总监。2005年10月起任泰达宏利基金管理有限公司风险管理部总监。2006年11月起任泰达宏利基金管理有限公司督察长。

4、基金经理

陈丹琳女士，毕业于中国人民大学，经济学硕士，CFA、CPA；2007年7月加入泰达宏利基金管理有限公司，曾担任研究员、研究主管、研究部总经理助理等职务；2015年4月3日至今担任泰达宏利行业精选混合型证券投资基金基金经理；2015年6月3日至今担任泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金基金经理；具备9年证券投资管理经验，9年基金从业经验，具有基金从业资格。

本基金历任基金经理：刘青山先生，2004年7月至2013年2月管理本基金。梁辉先生，2013年2月至2015年4月管理本基金。

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员包括公司总经理刘建、副总经理兼投资总监王彦杰、投资副总监兼基金投资部总监邓艺颖、金融工程部门总监戴洁、研究部总监陈伯祯、资深基金经理兼首席策略分析师庄腾飞。督察长张萍列席会议。

投资决策委员会根据决策事项，可分类固定收益类事项、权益类事项、其它事项：

- (1) 固定收益类事项由刘建、王彦杰表决。
- (2) 权益类事项由刘建、王彦杰、邓艺颖、戴洁、陈伯祯、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。

二、基金托管人

(一) 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于 1998 年，现有员工 110 余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60% 以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至 2017 年 06 月 30 日，中国银行已托管 611 只证券投资基金，其中境内基金 574 只，QDII 基金 37 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007 年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017 年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国

务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构

(一) 直销机构

一、直销机构

1) 泰达宏利基金管理有限公司直销中心

注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

联系人：于贺

联系电话：010-66577617

客服信箱：irm@mfcteda.com

客服电话：400-698-8888

传真：010-66577760/61

公司网站：<http://www.mfcteda.com>

2) 泰达宏利基金网上直销系统

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

目前网上直销支持的银行卡和第三方支付有：农行卡、建行卡、中国银行卡、民生银行卡、招商银行卡、中国银行卡、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、汇付天下“天天盈”、快钱支付账户等。

泰达宏利微信公众账号：mfcteda_BJ，支持民生银行卡、招商银行卡、汇付天下“天天盈”账户、快钱支付账户。

客户服务电话：400-698-8888 或 010-66555662

客户服务信箱：irm@mfcteda.com

(二) 代销机构

1) 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：田国立

客服电话：95566

银行网站：www.boc.cn

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：易会满

客服电话：95588

银行网站：www.icbc.com.cn

3) 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：王洪章

客服电话：95533

银行网站：www.ccb.com

4) 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

银行网站：www.abchina.com

5) 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：牛锡明

客服电话：95559

银行网址：www.bankcomm.com

6) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：傅育宁

客服电话：95555

联系人：邓炯鹏

公司网站：www.cmbchina.com

7) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

客户服务电话：95580

联系人：陈春林

传真：(010) 68858117

公司网址：www.psbc.com

8) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：(021) 61618888

传真：(021) 63604199

联系人：虞谷云

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

9) 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： 孙建一

电话： 021-38637673

传真： 021-50979507

联系人： 张莉

客户服务热线： 95511-3

公司网站： bank.pingan.com

10) 中信银行股份有限公司

注册地址： 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址： 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人： 常振明

客服电话： 95558

网址： <http://bank.ecitic.com>

11) 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

电话： 0769-22119061

传真： 0769-22117730

联系人： 陈幸

客服电话： 4001196228

公司网址： www.dongguanbank.cn

12) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：金煜

开放式基金咨询电话：021-962888

开放式基金业务传真：021-68476111

网址：www.bankofshanghai.com

13) 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

电话：022-58316666

传真：022-58316259

联系人：王宏

客户服务热线：95541

公司网站：www.cbhb.com.cn

14) 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

电话：0574-89068340

传真：0574-87050024

联系人：胡技勋

客户服务热线：95574

公司网站：www.nbc.com.cn

15) 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：吴建

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

16) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

客户服务电话：95526

公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

17) 天津银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区友谊路 15 号

办公地址：天津市河西区友谊路 15 号

法定代表人：王金龙

客户服务热线：4006-960296

公司网站：www.bank-of-tianjin.com

18) 温州银行股份有限公司

注册地址：温州市车站大道 196 号

办公地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

电话：0577-88990082

传真：0577-88995217

联系人：林波

客户服务热线：浙江省 96699，上海 962699，其他地区（0577）96699

公司网站：www.wzbank.cn

19) 花旗银行（中国）有限公司

注册地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦主楼 28 楼 01A 单元和 02A 单元、29 楼 02 单元、30 楼 01 单元、32 楼 01 单元和 01B 单元、33 楼 01 单元和 03 单元、34 楼 01 单元及 35 楼。

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦主楼 28 楼 01A 单元和 02A 单元、29 楼 02 单元、30 楼 01 单元、32 楼 01 单元和 01B 单元、33 楼 01 单元和 03 单元、34 楼 01 单元及 35 楼。

法定代表人：欧兆伦（AU SIU LUEN）

个人客户服务中心电话：800830 1880

机构客户服务中心电话：800 820 1268

公司网站：www.citibank.com.cn

20) 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

法定代表人：李镇西

成立时间：1998 年 12 月 16 日

注册资本：391173.904 万元人民币

企业类型：股份有限公司

营业期限：永续经营

电话：010-64816038

传真：010-84596546

21) 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：林俊波
客服电话：400-888-1551
传真：021- 68865680
公司网站：www.xcsc.com

22) 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：胡天彤
电话：022-28451709
传真：022-28451892
电子邮箱：hutt@bhq.com
客户服务电话：400-651-5988
网址：www.bhq.com

23) 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 号国际企业大厦 C 座
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
电话：010-66568292
联系人：邓颜
公司网站：www.chinastock.com.cn

24) 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

25) 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：4008888108
传真：010—65182261
公司网站：www.csc108.com

26) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号
办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼
法定代表人：杨德红
客服电话：95521
联系人：芮敏祺
公司网站：www.gtja.com

27) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼
法定代表人：杨宇翔
联系人：吴琼
全国免费业务咨询电话：95511
传真：0755-82400862
网址：www.PINGAN.com

28) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-23 层、25 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

客服电话：95503

联系人：胡月茹

公司网站：www.dfzq.com.cn

29) 世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：姜昧军

联系人：王雯

客服电话：0755-83199511

公司网站：www.csc.com.cn

30) 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

联系电话：021-33389888

客服电话：95523 或 400-889-5523

网址：www.swhysc.com

31) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼

法定代表人: 许建平

电话: 010-88085858

联系人: 李巍

客户服务电话: 400-800-0562

网址: www.hysec.com

32) 中泰证券股份有限公司

注册地址: 济南市经七路 86 号

法定代表人: 李玮

客服电话: 95538

网址: www.zts.com.cn

33) 中银国际证券有限责任公司

注册地址: 上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 40 层

法定代表人: 许刚

客服电话: 4006208888

传真: 021-50372474

联系人: 王炜哲

公司网站: www.bocichina.com

34) 华泰证券股份有限公司

注册地址: 江苏省南京市江东中路 228 号

办公地址: 江苏省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

传真: 0755-82492962

联系人: 庞晓芸

公司网站: www.htsc.com.cn

35) 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: 刘晨、李芳芳

客户服务电话: 95525、4008888788 10108998

传真: 021-22169134

公司网址: www.ebscn.com

36) 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: 刘汝军

联系人: 孙恺

客户服务电话: 4006989898

公司网址: www.xsdzq.cn

37) 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: 宫少林

联系人: 林生迎

联系电话: 0755-82943666

传真: 0755-82943636

客户服务电话: 95565, 4008888111

公司网址: www.newone.com.cn

38) 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：黄耀华

联系人：刘阳

传真：0755-83515567

客户服务电话：0755-33680000 400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

39) 南京证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

办公地址：江苏省南京市江东中路 389 号

法定代表人：步国旬

联系人：王万君

联系电话：025-58519523

客户服务电话：95386

公司网址：www.njzq.com.cn

40) 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：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 20 层

法定代表人：兰荣

联系人：黄英

联系电话：0591-38162212

客户服务电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

41) 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

客服电话：95553、400-8888-001

联系电话：021-23219000

公司网站：www.htsec.com

42) 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：020-961303

联系电话：020-88836999

传真：020-88836654

联系人：林洁茹

网址：www.gzs.com.cn

43) 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）

传真：0591-87383610

联系人：张宗锐

公司网站：www.hfzq.com.cn

44) 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

联系电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

公司网站：www.guosen.com.cn

45) 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：陆涛

客户服务电话：4008-888-228

传真：0755-83025625

联系人：马贤清

网站：www.jyzq.cn

46) 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

传真：021-68767981

联系人：朱磊

公司网站：www.tebon.com.cn

47) 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

联系电话：0755-82825551

网址：www.essence.com.cn

48) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 楼

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：赵俊

联系人：王一彦

电话：021-20333333

传真：021-50498825

公司网络地址：www.longone.com.cn

客服电话：95531，400-888-8588

49) 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：常喆

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

50) 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

联系电话：0731-84403319

开放式基金业务传真：0731-84403439

网址：www.cfzq.com

51) 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

法定代表人：胡运钊

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

长江证券客户服务网站：www.95579.com

52) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

公司地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

法定代表人：雷杰

客户服务热线：95571

网址：www.foundersc.com

53) 民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

法定代表人：余政

公司网址：www.msyzq.com

客服热线：400-619-8888

54) 国金证券股份有限公司

办公地址：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

联系电话：028-86690057、028-86690058

传真号码：028-88690126

55) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座

办公地址：北京市金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

客服电话：010-66045678

联系人：林爽

公司网址：www.txsec.com

56) 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：王东明

公司网址：www.citics.com

客服热线：95548

57) 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：上海市永和路 118 弄 24 号楼

法定代表人：陈宏

公司网址：www.xzsec.com

客服热线：400-911-2233

58) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层，深圳市华侨城深南大道 9010 号

法定代表人：吴永良

公司网址：www.zszq.com

客服热线：400-102-2011

59) 中信证券(山东)有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 20 层

办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

公司网址：www.citicssd.com

客服热线：95548

60) 红塔证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

办公地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人：况雨林

公司网址：www.hongtastock.com

客服热线：400-871-8880

61) 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 5 楼

法定代表人：吴坚
公司网址：www.swsc.com.cn
客服热线：400-809-6096

62) 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
电话：021-63898951
联系人：李颖
公司网站：www.shhxzq.com

63) 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
公司网址：www.citicsf.com
客服电话：400-990-8826

64) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
办公地址：上海市浦东新区银城中路68号8楼
法定代表人：汪静波
公司网址：www.noah-fund.com
客服热线：400-821-5399

65) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路1号物资控股置地大厦8楼

法定代表人：薛峰

公司网址：www.zlfund.cn；www.jjmmw.com

客服热线：4006-788-887

66) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼

法定代表人：杨文斌

公司网址：www.ehowbuy.com

客服热线：400-700-9665

67) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室

办公地址：杭州市西湖区天目山路266号黄龙时代广场B座支付宝

法定代表人：陈柏青

客服电话：400-076-6123

公司网址：<http://www.fund123.cn/>

68) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：浦东新区峨山路613号6幢551室

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C-9楼

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

69) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

联系人：刘潇

电话：021-021-20691942

传真：021-20691861

客服电话：400-820-2899

公司网址：www.erichfund.com

70) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区大街22号泛利大厦10层

办公地址：北京市朝阳区大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王莉

联系电话：021-20835817

传真号码：021-20835885

全国统一客服热线：400-920-0022/ 021-20835588

公司网址：licaike.hexun.com

71) 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号邮电新闻大厦二层

法定代表人：闫振杰

全国统一客服热线：400-888-6661

公司网址：www.myfund.com

72) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼4层

法定代表人：凌顺平

客户服务热线：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

73) 一路财富（北京）信息科技有限公司

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

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

客户服务热线：400-001-1566

公司网址：www.yilucaifu.com

74) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼

地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼

法定代表人：冯修敏

客户服务热线：400-820-2819

公司网址：<https://tty.chinapnr.com>

75) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人：郭坚

客户服务热线：400-821-9031

公司网址：www.lufunds.com

76) 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

地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层2302#

法定代表人：李悦

客户服务热线：4008-980-618

公司网址：www.chtfund.com

77) 大泰金石投资管理有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室

地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼

法定代表人：袁顾明

客户服务热线：400-928-2266

公司网址：<http://www.dtfortune.com>

78) 浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址：浙江省杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

地址：浙江省杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

法定代表人：徐黎云

客户服务热线：400-068-0058

公司网址：<http://www.jincheng-fund.com>

79) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座17层

法定代表人：杨懿

客户服务热线：400-166-1188

公司网址：<http://money.jrj.com.cn>

80) 上海联泰资产管理有限公司

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

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

客户服务热线：400-046-6788

81) 北京广源达信投资管理有限公司

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

公司网址：<http://www.niuguwang.com>

客服热线：400-623-6060

82) 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武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号4号

办公地址：武汉市泛海国际SOHO城7栋2301、2304

法定代表人：陶捷

公司网址：<http://www.buyfunds.cn>

客服热线：400-027-9899

83) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

法定代表人：蒋煜

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

公司网址：www.gscaifu.com

客服热线：400-818-8866

84) 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

法定代表人：钟斐斐

客服热线：4000-618-518

网址：www.ncfjj.com

85) 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

法定代表人：李昭琛

客服电话：010-62675369

公司网址：<http://www.xincai.com/>

86) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

87) 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路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发
展区）

办公地址：上海市杨浦区昆明路518号A1002室

法定代表人：王翔

电话：021-65370077-209

公司网站：www.jiyufund.com.cn

88) 北京汇成基金管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-90595

网址：www.fundzone.cn

89) 上海云湾投资管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层

法定代表人：戴新装

客服电话：400-820-1515

网址：www.zhengtongfunds.com

90) 上海万得投资顾问有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

法定代表人：王廷富

电话：021-5132 7185

传真：021-5071 0161

91) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址:北京市海淀区海淀东三街2号4层 401-15

办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院 a 座 17 层

法定代表人:陈超

联系人:赵德赛

客服电话:95518/400 088 8816

公司网址:<http://fund.jd.com>

92) 天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼D座二层202-124室

办公地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼D座二层202-124室

法定代表人：丁东华

公司网址：www.gomefund.com

客服热线：400-111-0889

93) 北京格上富信投资顾问有限公司

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

联系人：曹庆展

客户服务电话：400-066-8586

公司网址：www.igesafe.com

94) 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公园3号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海公园3号

法定代表人：林卓

客服电话：400-6411-999

网址：www.taichengcaifu.com

95) 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：上海市浦东新区东方路989号中达广场2楼

法定代表人：沈继伟

客户服务电话：400-921-7755

公司网址：www.leadfund.com.cn

(三) 注册登记机构

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

电话：010-66577769

传真：010-66577750

(四) 律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

电话：(021) 51150298

传真：(021) 51150398

经办律师：梁丽金、刘佳

(五) 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

四、基金的名称

五、基金的类型

本基金的类型： 契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金的投资目标：追求资本的长期持续增值，为投资者寻求高于业绩比较基准的投资回报。

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、债券，以及法律、法规、规章或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票投资比例为基金资产净值的 60%—95%，债券投资比例为基金资产净值的 0%—35%，现金及现金等价物投资比例为基金资产净值的 5%—30%。

八、基金的投资策略

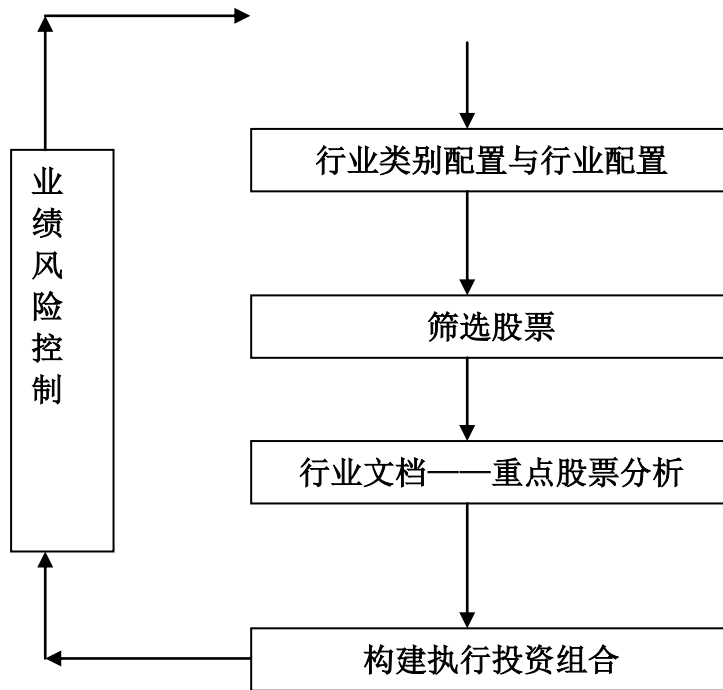
全面引进荷兰银行的投资管理流程，采用“自上而下”资产配置和行业类别与行业配置，“自下而上”精选股票的投资策略，主要投资于具有国际和国内竞争力比较优势和长期增值潜力的行业和企业股票。

资产配置和行业类别与行业配置，主要采用“自上而下”的投资策略：（1）投资决策委员会根据 MVPS 模型，结合宏观和行业分析，确定投资组合资产配置比例；（2）根据行业特点和市场状况，确定行业类别与行业配置比例。

精选个股主要采用“自下而上”的投资策略包括：（1）以流动性指标筛选股票。（2）对筛选后的股票进行定量分析和评分筛选。（3）以定性的股票评级系统全面考察公司股票的未来发展。

本基金股票投资流程如下图所示：

MVPS 资产配置



1、投资决策委员会根据 MVPS 模型，确定投资组合资产配置比例

MVPS 模型——通过四个层面研究确定基金资产配置比例

➤ M—宏观经济环境（Macro Environment）

研究分析的主要指标包括：

- ✓ 季度 GDP 的增长速度
- ✓ 每月 CPI 的数据
- ✓ 每月工业增加值的增长速度
- ✓ 货币供应量 M2 的增长

➤ V-价值（Valuation）

研究分析的主要指标包括：

- ✓ P/B、P/E 运行模型
- ✓ 公司治理结构

➤ P-政策（Policy）

- ✓ 国家宏观经济政策和监管政策对证券市场下一阶段的发展具有的重要影响作用。

➤ S-气氛（Sentiment）

研究分析的主要指标包括：

- ✓ 保证金
- ✓ 分析师指数
- ✓ 基金仓位
- ✓ 市场的特殊效应

2、利用 SRS 模型进行行业分析和行业类别与行业配置

根据行业特点和市场状况，确定行业类别与行业配置比例

- 根据波特理论，通过以下分析，确定行业相对投资价值 and 行业在投资组合中的配置比例范围。
 - ✓ 对全球、地区、国内行业发展趋势和发展环境进行分析，判断行业或产品的增长前景（全球观念下，行业景气趋势分析）
 - ✓ 宏观经济周期对行业发展的影响（宏观分析）
 - ✓ 优势行业的发展模式分析（评价商业模式）
 - ✓ 与最佳行业的比较分析（测量竞争优势）
 - ✓ 该行业财务状况分析（财务稳健性分析）
- 根据行业(P/E)指标和资金流指标，对行业类别与行业配置比例进行调整
在调整行业配置比例时，应综合考虑行业(P/E)指标和资金流指标，对资金流指标的临界数值应根据市场变化进行相应调整。

3、利用市值指标作为流动性指标，对股票进行筛选，建立待投资股票库：

首先对股票市值按大小进行排序，挑选出符合基金投资规模和流动性需要的股票，作为模型的基础股票池。

4、对待投资股票库的股票利用 QSE 模型，对股票投资价值和股票预期收益增长性进行定量分析与评分筛选。

5、利用商业评估、公司评估、价值评估和盈利预测，在基础股票库中寻找价格合理、基本面良好的上市公司：

(1) 将上市公司作为一个商业组合，根据上市公司所在行业包括的业务类别，从商业性质、上市公司管理水平、竞争优势、上市公司发展前景、市场份额、营业利润率、财务能力等方面对基础股票库中的股票进行评级。将影响上市公司的因素概括为商业因素、公司因素、财务因素，结合上述评级，确定上市公司商业因素、公司因素、财务因素的分值和上市公司的综合评分。

(2) 利用财务定价模型对企业的长期盈利状况进行预测，依靠多种价值参数，选择自身投资价值被市场低估、与同类公司相比定价较低、对比市场以往历史数据定价有合理上涨空间的上市公司。结合盈利预测和价值评估对上市公司进行打分。

(3) 按照本基金认为合理的权重，对商业评估和公司评估、盈利预测与价值评估进行综合评分，按分值大小，选择股票基础库中最好的上市公司。

6、基于“自上而下”进行的资产配置和行业类别与行业配置，“自下而上”选择的股票，结合自身的研究分析，基金经理构建、执行投资组合。

7、风险控制小组运用引进荷兰银行的风险控制模型，对基金投资组合的风险进行定期跟踪、监控、评估和风险构成的度量预测分析。监察稽核部负责对基金投资过程进行定期监督。

8、基金经理将跟踪证券市场和上市公司的发展变化，结合基金申购和赎回导致的现金流量变化情况，以及对基金投资组合风险和流动性的评估结果，对投资组合进行动态调整。

债券投资方面，基金管理人将依据市场利率的预期变化或不同债券收益曲线的变化，利用利率期限结构差异，权衡到期收益率与市场流动性，选择适宜的债券，构建和调整债券组合，在追求投资收益的同时兼顾债券资产的流动性和安全性。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准=70%×富时中国 A600 指数收益率+30%×中债国债总指数（财富）

十、基金的风险收益特征

基金的投资目标和投资范围决定了本基金属于风险较高的证券投资基金。

十一、基金的投资组合报告（未经审计）

1、重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或

重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于 2017 年 7 月 25 日复核了本投资组合报告的内容。

本投资组合报告所载数据截止 2017 年 06 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

2、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	412,454,675.29	89.44
	其中：股票	412,454,675.29	89.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,687,111.20	2.75
	其中：债券	12,687,111.20	2.75
	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	34,401,677.41	7.46
8	其他资产	1,608,272.93	0.35
9	合计	461,151,736.83	100.00

3、报告期末按行业分类的股票投资组合

3.1 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	2,612.40	0.00
B	采矿业	1,696.31	0.00
C	制造业	323,250,704.04	70.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	38,778.24	0.01
F	批发和零售业	38,950.40	0.01
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	9,316,036.29	2.03
J	金融业	57,001,965.50	12.42

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	103,792.91	0.02
M	科学研究和技术服务业	30,178.20	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	20,338,000.00	4.43
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	2,299,278.00	0.50
S	综合	32,683.00	0.01
	合计	412,454,675.29	89.89

3.2 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。

4、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	000858	五粮液	459,300	25,564,638.00	5.57
2	000651	格力电器	451,100	18,571,787.00	4.05
3	600036	招商银行	718,700	17,184,117.00	3.75
4	601318	中国平安	323,200	16,033,952.00	3.49
5	000568	泸州老窖	316,400	16,003,512.00	3.49
6	000921	海信科龙	834,748	14,366,013.08	3.13
7	601939	建设银行	2,292,500	14,098,875.00	3.07
8	600516	方大炭素	973,600	13,844,592.00	3.02
9	600519	贵州茅台	28,792	13,585,505.20	2.96
10	002271	东方雨虹	357,200	13,252,120.00	2.89

5、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	10,191,104.00	2.22
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	2,496,007.20	0.54
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	12,687,111.20	2.77

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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
1	010303	03 国债(3)	103,400	10,191,104.00	2.22
2	110031	航信转债	24,130	2,496,007.20	0.54

注：上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

9、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

10、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

10.1 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。

10.2 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。

11、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

11.1 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。

11.2 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。

11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金没有投资国债期货。

12、投资组合报告附注

(1) 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报

告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

(2) 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

13、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	156,707.32
2	应收证券清算款	1,368,006.41
3	应收股利	-
4	应收利息	81,512.42
5	应收申购款	2,046.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,608,272.93

14、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	110031	航信转债	2,496,007.20	0.54

15、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。

16、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2004年7月9日，截止2017年6月30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：

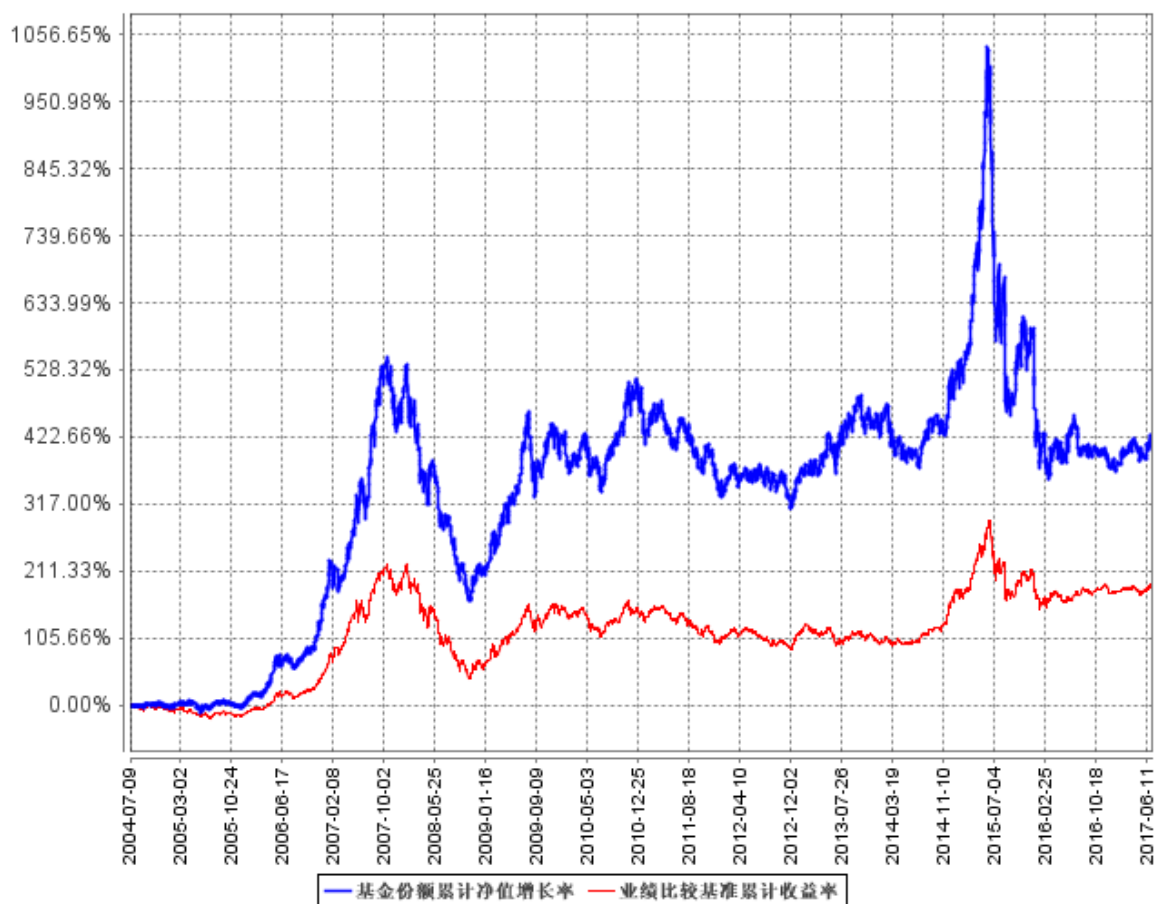
1. 历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	净值增长率	净值增长率标	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益	①-③	②-④
----	-------	--------	-----------	----------	-----	-----

	①	准差 ②	③	率标准差 ④		
2004. 7. 9~ 2004. 12. 31	-1. 12%	0. 62%	-7. 38%	0. 84%	6. 26%	-0. 22%
2005. 1. 1~ 2005. 12. 31	5. 70%	1. 04%	-5. 69%	0. 96%	11. 39%	0. 08%
2006. 1. 1~ 2006. 12. 31	159. 88%	1. 49%	77. 44%	0. 99%	82. 44%	0. 50%
2007. 1. 1~ 2007. 12. 31	119. 06%	2. 13%	96. 39%	1. 62%	22. 67%	0. 51%
2008. 1. 1~ 2008. 12. 31	-48. 44%	2. 02%	-48. 28%	2. 07%	-0. 16%	-0. 05%
2009. 1. 1~ 2009. 12. 31	71. 09%	1. 80%	62. 24%	1. 44%	8. 85%	0. 36%
2010. 1. 1~ 2010. 12. 31	12. 73%	1. 43%	-3. 91%	1. 09%	16. 64%	0. 34%
2011. 1. 1~ 2011. 12. 31	-23. 99%	1. 16%	-18. 12%	0. 91%	-5. 87%	0. 25%
2012. 1. 1~ 2012. 12. 31	2. 12%	1. 12%	5. 61%	0. 91%	-3. 49%	0. 21%
2013. 1. 1~ 2013. 12. 31	20.27%	1.43%	-3.10%	0.95%	23.37%	0.48%
2014. 1. 1~ 2014. 12. 31	9.76%	1.33%	34.25%	0.82%	-24.49%	0.51%
2015. 1. 1~ 2015. 12. 31	12.47%	2.63%	10.94%	1.71%	1.53%	0.92%
2016. 1. 1~ 2016. 12. 31	-30.12%	1.78%	-9.44%	1.01%	-20.68%	0.77%
2017. 1. 1~ 2017. 6. 30	10.04%	0.81%	4.83%	0.41%	5.21%	0.40%
基金合同生效以来 至 2017. 6. 30	424.39%	1.63%	190.73%	1.24%	233.66%	0.39%

2. 本基金自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图（2004年7月9日-2017年6月30日）

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



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) 基金运作费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金证券交易费用；
- 4、基金的信息披露费用；
- 5、基金的会计师费和律师费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、按照国家有关规定可以列支的其它费用。

(二) 基金运作费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理费按基金前一日的资产净值的 1.5% 的年费率计提，具体计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H: 为每日应计提的基金管理费;

E: 为前一日基金资产净值。

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人按照基金管理人划款指令于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

基金的基金托管费按基金前一日的资产净值的 0.25% 的年费率计提,具体计算方法如下:

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H: 为每日应计提的基金托管费;

E: 为前一日基金资产净值。

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月的前 2 个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

3、上述(一)3至7项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用,由基金托管人按照基金管理人的划款指令复核后从本基金资产中支付。基金合同生效前的验资费(会计师费)、律师费从基金认购费用中列支,招募说明书、发售公告等信息披露费用根据有关法律及中国证监会有关规定列支。

4、经基金管理人与基金托管人协商一致,可以酌情调低基金管理费率及基金托管费率,并报中国证监会核准后公告,无须召开基金持有人大会通过。

(三) 不列入基金费用的项目

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本基金资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金资产中列支。

(四) 申购、赎回的费用

1、申购费

申购费率如下:

申购金额 (M)	费率
M<50万	1.50%
50万≤M <250万	1.20%

250万≤M <500万	0.75%
500万≤M <1000万	0.50%
M≥1000万	每笔1000元

2、赎回费

赎回费率如下：

连续持有期限（日历日）	适用的赎回费率
1天—365天	0.5%
366天（含）—730天	0.25%
731天（含）以上	0

说明：①认购期持有期限起始日为基金合同生效日；申购期持有期限起始日为基金申购的注册登记日。持有期限的截止日为基金赎回的注册登记日。

②投资人对本基金连续持有期限超过365天，赎回费率为0.25%；连续持有期限超过730天，赎回费率为零。期间如进行基金转换，持有期限可以累计。

③赎回费的25%划归基金资产。

（五）基金税收

本基金及基金持有人应依据国家有关规定依法纳税。

十四、对招募说明书更新部分的说明

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》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

1、“重要提示”部分对更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期进行了更新。

2、“三、基金管理人”中，基金管理人概况、投资决策委员会成员名单部分进行变更及增加内容。

3、“四、基金托管人”部分对基金托管人部分进行了更新。

4、“五、相关服务机构”中，更新代销机构进行变更及增加内容。

5、“八、基金的投资”部分对投资组合报告内容更新至2017年6月30日。

6、“九、基金的业绩”部分对基金业绩更新至2017年6月30日，并更新了历史走势对比图。

7、“二十一、其他应披露事项”部分对报告期内应披露的本基金相关事项进行了更新。

泰达宏利基金管理有限公司

2017年8月22日