

# 泰达宏利量化增强股票型证券投资基金 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】

本基金于2015年7月9日经中国证监会证监许可[2015]1577号文募集注册，并于2016年6月21日获得中国证监会证券投资基金机构监管部关于同意延期募集备案的回函（机构部函[2016]1406号）。基金合同于2016年8月30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。

本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。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、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。

本更新招募说明书所载内容截止日为2018年2月28日，有关数据和净值表现截止日为2017年12月31日。财务数据未经审计。

## 第1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：010-66577513

信息披露联系人：袁静

注册资本：一亿八千万元人民币

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、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。2017年10月1日起担任新界妇女与青少年福利协会有限公司董事。

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、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，从事财务管理和企业管理咨询工作。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

杨超先生

数学与金融计算硕士，2010年5月加入建信基金管理有限公司，从事金融工程等工作，历任投资管理部助理研究员、初级研究员、基金经理助理等职务；2014年6月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理助理，现任基金经理；2014年10月13日至今担任泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金经理；2014年10月13日至今担任泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金经理；2015年11月20日至今担任泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理；2016年8月30日至今担任泰达宏利量化增强股票型证券投资基金基金经理；2016年9月26日至今担任泰达宏利集利债券型证券投资基金基金经理；2016年12月27日至今担任泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年9月6日至今担任泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金基金经理；2017年12月19日至今担任泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018年3月16日至今担任泰达宏利沪深300指数增强型证券投资基金基金经理；具备8年证券基金从业经验，8年证券投资管理经验，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、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、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、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。

## 第2部分 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：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

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 12 月 31 日，中国银行已托管 650 只证券投资基金，其中境内基金 613 只，QDII 基金 37 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 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、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

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。

## 第3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：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/>

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：农行卡、建行卡、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、浦发银行卡和快钱支付账户、汇付天下“天天盈”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”账户和快钱支付账户。

客户服务电话：400-698-8888 或 010-66555662

客户服务信箱：irm@mfcteda.com

#### 2、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：陈四清

客服电话：95566

联系人：崔瑛

银行网站： [www.boc.cn](http://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

联系人：杨菲

银行网站： [www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

3) 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

联系人：张宏革

银行网址： [www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

4) 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：李建红

客服电话：95555

联系人：邓炯鹏

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

客户服务热线：95528

公司网站：[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：孙建一

联系人：张莉

客户服务热线：95511-3

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

7) 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)

8) 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.nbc.com.cn](http://www.nbc.com.cn)

9) 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

联系人：汤征程

客服电话：95594

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

10) 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

联系人：李欣

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

11) 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)

12) 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)

13) 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](http://www.gf.com.cn)

14) 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](http://www.csc108.com)

15) 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

16) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号平安金融大厦26楼

法定代表人：曹实凡

联系人：石静武

全国免费业务咨询电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

17) 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

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：王叔胤

客服电话：95523或400-889-5523

网址：www.swhysc.com



19) 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：韩志谦

联系人：王怀春

客户服务电话：400-800-0562

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

20) 中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市市中区经七路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

联系电话：许曼华

客服电话：95538

21) 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)

22) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路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：400-698-9898

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

网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

客户服务电话：95562

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

客服电话：95553，400-8888-001

联系人：金芸

公司网站：[www.htsec.com](http://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](http://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) 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：400-888-8228

联系人：马贤清

网站：www.jyzq.cn

### 31) 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

### 32) 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楼、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楼、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

33) 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：赵俊

联系人：王一彦

客服电话：95531；400-8888-588

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

34) 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](http://www.guodu.com)

35) 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](http://www.cfzq.com)

36) 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：胡运钊

客户服务热线：95579或400-888-8999

联系人：李良

长江证券客户服务网站：[www.95579.com](http://www.95579.com)

### 37) 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

### 38) 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：[www.citics.com](http://www.citics.com)

客服热线：95548

### 39) 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

40) 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：刘建武

联系人：梁承华

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

客服热线：95582

41) 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大厦7层、8层

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

法定代表人：黄扬录

联系人：罗艺琳

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

客服热线：

42) 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

43) 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

#### 44) 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

联系人：刘晓明

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

客服热线：95548

#### 45) 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：吴坚

联系人：张煜

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

客服热线：400-809-6096、95355

#### 46) 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](http://www.shhxzq.com)



47) 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](http://www.citicsf.com)

客服电话：400-990-8826

48) 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](http://www.noah-fund.com)

客服热线：400-821-5399

49) 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](http://www.zlfund.cn)；[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

客服热线：4006-788-887

50) 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](http://www.ehowbuy.com)

客服热线：400-700-9665

**51) 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/>

**52) 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](http://www.1234567.com.cn)

**53) 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](http://www.erichfund.com)

54) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝外大街22号泛利大厦10层

办公地址：北京市朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王莉

联系人：刘洋

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：licaikexun.com

55) 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

56) 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

57) 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](http://www.yilucaifu.com)

58) 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>

59) 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](http://www.lufunds.com)

60) 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>

61) 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](http://www.jincheng-fund.com)

62) 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>

63) 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

公司网址: <http://www.66money.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

法定代表人: 钟斐斐

客服热线: 4000-618-518

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

65) 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

66) 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](http://www.chtfund.com)

67) 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

68) 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](http://www.gscaifu.com)

客服热线: 400-818-8866

69) 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/>

70) 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](http://www.yingmi.cn)

71) 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](http://www.jiyufund.com.cn)

72) 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

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](http://www.fundzone.cn)

73) 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

企业类型：有限责任公司

营业期限：持续经营

客服电话：400-820-1515

网址：www.zhengtongfunds.com

74) 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

法定代表人：王廷富

办公地址：中国（上海）浦东新区福山路 33 号 9 楼客服电话：021-5132 7185

传真：021-5071 0161

75) 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：4000988511/4000888816 公司网址：<http://fund.jd.com>

76) 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](http://www.gomefund.com)

客服电话：400-111-0889

77) 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

客服电话：400-066-8586

公司网址：www.igesafe.com

78) 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龙园 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人：林卓

客服电话：400-6411-999

网址：www.taichengcaifu.co

79) 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

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、孙睿

联系人：孙睿

#### 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4部分 基金的名称

泰达宏利量化增强股票型证券投资基金

## 第5部分 基金的类型

基金运作方式：契约型开放式。

基金的类别：股票型证券投资基金。

基金存续期限：不定期。

## 第6部分 基金的投资目标

本基金为普通股票型基金，运用量化投资技术，在严格控制风险的前提下，力争为投资者获取超越业绩比较基准的收益。

## 第7部分 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 80%-95%；权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，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，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。

## 第8部分 基金的投资策略

本基金利用量化投资模型，在控制主动风险的基础上，力求投资业绩达到或超越业绩比较基准。

### 1、比较基准的标的指数

中证 500 指数是中证指数有限公司编制并发布的市场指数，它的成份股为样本空间内股票扣除沪深 300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300 名的股票，剩余股票按照最近一年（新股为上市以来）的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的股票，然后将剩余股票按照日均总市值由高到低进行排名，选取排名在前 500 名的股票作为中证 500 指数样本股。中证 500 指数综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况。

### 2、以增强指数投资收益为目标的股票投资策略

本基金综合利用多种量化投资模型和指数增强技术，在控制主动风险的基础上，力求投资业绩持续超越业绩比较基准。本基金将综合运用量化模型选股结果，构建投资组合，并根据股票市场投资风格的转换，灵活地对投资组合进行调整，在实施严格的风险管理手段的基础上，力争实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。

本基金运用多因子选股模型，以中国股票市场较长期的回测研究为基础，结合前瞻性的市场判断，充分甄别筛选基本面优秀的个股进行投资。

多因子模型的因子可归为如下几类：估值，成长，盈利质量，动量，流动性，市场情绪，波动率，市场敏感度等等。公司的量化投研团队会对因子的有效性进行持续跟踪和深入研究，分析 Alpha 因子的作用条件，并关注其背后的市场逻辑，及时对模型和模型所采用的因子做出调整，力争保持模型的长期有效。

多因子模型综合考虑多种信息来源，形成合乎逻辑的投资理念，建立有效的量化模型。基金经理根据市场运行规律、风格切换及其他发展变化情况对各类因子的重要性做出判断，适时调整各因子类别的具体构成及相应的权重。

在风险管理方面，本基金将构建基本面风险模型和统计风险模型，对组合的风险敞口进行评估和管理，在有效控制投资组合主动风险的前提下，力争保持基金长期业绩的高信息比率。

### 3、债券投资策略

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、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。

### 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、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。

## 五、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）股票投资占基金资产的比例为 **80%-95%**；

（2）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；

- (3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- (8) 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%；
- (9) 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 20%；
- (10) 本基金持有的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%；
- (11) 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%；
- (12) 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；
- (13) 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%；
- (14) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；
- (15) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；所持有

的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

（16）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、期货市场波动、上市公司合并、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，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；在此期间内，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同约定。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）向其基金管理人、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、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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的原则，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调整上述规定的，本基金的投资按照调整后的规定执行。

## 第9部分 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 500 价格指数收益率} + 5\% \times \text{人民银行一年期定存基准收益率（税后）}$

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。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，并在中国证监会指定媒介上公告。

## 第10部分 基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

## 第11部分 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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年3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2017年12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	107,169,749.32	93.61
	其中：股票	107,169,749.32	93.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,677,054.41	5.83
8	其他资产	637,834.30	0.56
9	合计	114,484,638.03	100.00

### 1.2 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	479,562.00	0.42
B	采矿业	2,744,138.00	2.42
C	制造业	64,103,108.53	56.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,670,667.00	1.47
E	建筑业	1,266,909.00	1.12
F	批发和零售业	6,970,048.20	6.14
G	交通运输、仓储和邮政业	1,820,797.80	1.60
H	住宿和餐饮业	783,867.00	0.69
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,753,710.65	9.47
J	金融业	1,381,549.12	1.22
K	房地产业	8,286,651.76	7.30
L	租赁和商务服务业	1,644,051.06	1.45

M	科学研究和技术服务业	125,952.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	2,645,734.20	2.33
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	1,711,118.00	1.51
S	综合	781,885.00	0.69
	合计	107,169,749.32	94.40

## 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

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	000006	深振业A	305,100	3,005,235.00	2.65
2	603986	兆易创新	18,500	2,844,005.00	2.51
3	600516	方大炭素	72,500	2,093,800.00	1.84
4	000039	中集集团	76,300	1,743,455.00	1.54
5	000050	深天马A	85,400	1,683,234.00	1.48
6	300392	腾信股份	130,500	1,656,045.00	1.46
7	600392	盛和资源	85,600	1,626,400.00	1.43
8	600755	厦门国贸	158,362	1,599,456.20	1.41
9	600201	生物股份	49,260	1,563,512.40	1.38
10	000513	丽珠集团	23,500	1,561,575.00	1.38

## 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。

## 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。

## 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

本基金报告期末未持有资产支持证券投资。

## 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

### 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

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。

## 1.10 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

本报告期本基金没有投资国债期货。

## 1.11 投资组合报告附注

### 11.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制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	95,346.01
2	应收证券清算款	485,412.84
3	应收股利	-
4	应收利息	1,582.41
5	应收申购款	55,493.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	637,834.30

#### 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。

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000006	深振业A	3,005,235.00	2.65	重大事项
2	603986	兆易创新	2,844,005.00	2.51	重大事项
3	300392	腾信股份	1,656,045.00	1.46	重大事项

#### 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、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2016年8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：

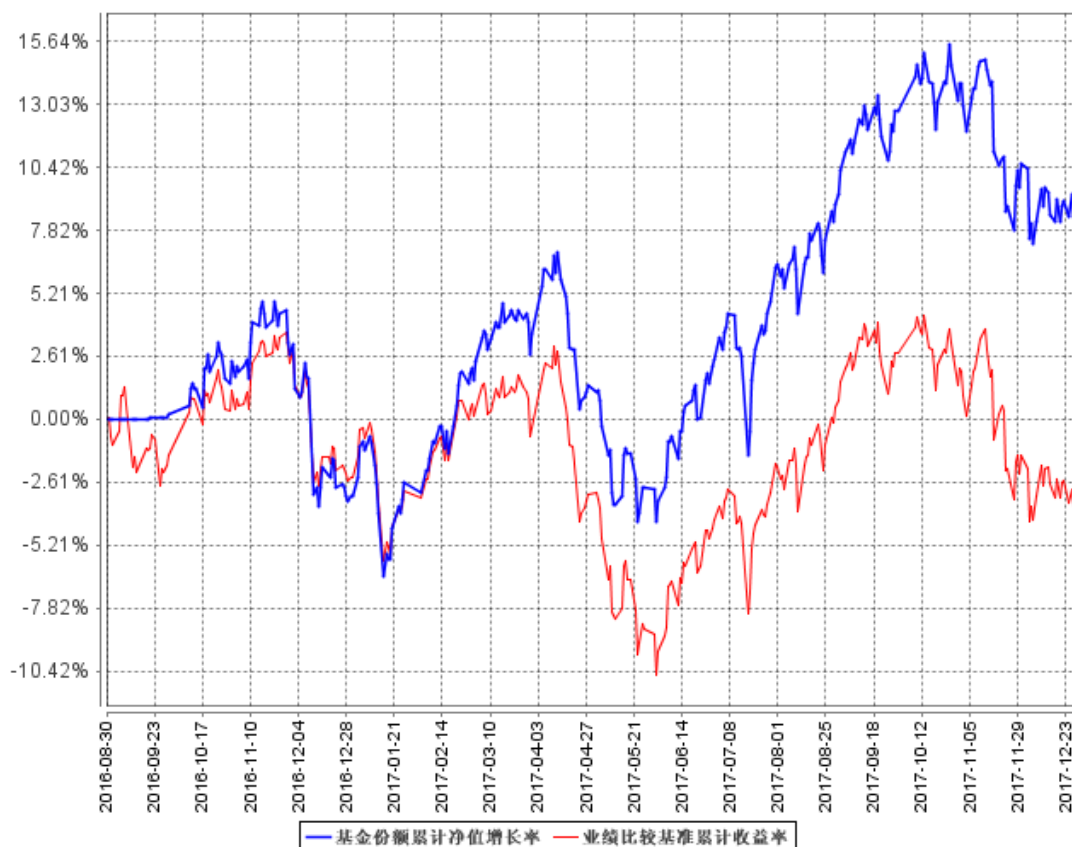
(一) 截止 2017 年 12 月 31 日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较:

阶段	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
2016 年 8 月 30 日 至 2016 年 12 月 31 日	-3.20%	0.76%	-2.39%	0.81%	-0.81%	-0.05%
2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	13.95%	0.86%	-0.07%	0.88%	14.02%	-0.02%
本基金合同生效 之日起至 2017 年 12 月 31 日	10.30%	0.83%	-2.45%	0.86%	12.75%	-0.03%

注: 本基金的业绩比较基准: 中证 500 价格指数收益率\*95%+人民银行一年期定存基准收益率(税后)\*5%

(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

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



本基金成立于2016年8月30日,按基金合同规定,自基金合同生效日起六个月内为建仓期。  
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。

## 第12部分 基金费用与税收

### 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 1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。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。

#### 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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。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。

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，酌情调低基金管理费率、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。



## 第13部分 对招募说明书更新部分的说明

（一）在“重要提示”中，更新了招募说明书所载内容、有关财务数据和净值表现的截止日期。

（二）对“三、基金管理人”中，基金管理人概况、基金经理等部分进行更新及增加内容。

（三）“四、基金托管人”部分进行了更新。

（四）“五、相关服务机构”中，更新直销机构、代销机构及补充第三方销售机构。

（五）“九、基金的投资”部分投资组合报告内容更新至2017年12月31日。

（六）“十、基金的业绩”部分对基金业绩更新至2017年12月31日，并更新了历史走势对比图。

（七）更新了“二十二、其他应披露事项”部分内容。

泰达宏利基金管理有限公司

2018年4月13日