泰达宏利品质生活灵活配置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:中国建设银行股份有限公司

重要提示

泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金于2008年10月31日获中国证监会证监许可[2008]1248号文批准,基金合同于2009年4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。

投资有风险,投资人认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书正文。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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为2014年10月9日,有关财务数据和净值表现截止日为2014年9月30日,已经托管银行复核,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:010-66577676
联系人:张萍
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%

(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。

刘振宇先生,董事。毕业于天津师范大学和南开大学,拥有法学学士学位和经济学博士学位,律师、经济师。2000年至2002年任天津泰达集团有限公司投资部副部长。2002年至2008年任天津泰达投资控股有限公司资产管理部经理。2008年任天津市泰达国际控股(集团)有限公司总经理助理。2010年起任天津市泰达国际控股(集团)有限公司副总经理。兼任恒安标准人寿保险有限公司董事、渤海财产保险股份有限公司董事等职。

孙泉先生,董事。拥有天津南开大学经济学学士和经济学硕士学位及美国芝加哥罗斯福大学工商管理硕士学位。1988年任职天津开发区信托投资公司,负责信贷和外汇管理工作;1989年任职天津开发区管理委员会政策研究室,负责区域发展、国企改革、对外合作政策的研究和制定工作;1997年任职天津经济技术开发区总公司企划部,负责企业发展战略研究和计划经营管理工作; 2001年任职天津泰达投资控股公司资产管理部,负责泰达控股重组并购、资源整合、上市筹备和金融类、实业类企业的经营管理工作。现任天津泰达投资控股公司资产管理部经理,渤海产业基金投资管理公司、恒安标准人寿保险公司和天津钢管集团股份有限公司董事等职。

何达德先生,董事。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。何先生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年丰富经验,其间担任多个领导层要职。

雷柏剛(Robert Allen Cook)先生,加拿大国籍,董事。毕业于加拿大多伦多大学及卡尔加里大学,持有金融学工商管理硕士学位。雷先生为宏利金融亚洲区高级行政副总裁兼总经理,并为宏利金融执行委员会成员。雷先生统领宏利金融于中国内地、香港、印尼、日本、马来西亚、菲律宾、新加坡、台湾、泰国、越南等地的业务发展。雷先生于2007年出任现职前曾担任美国保险业务部行政副总裁,掌管恒康人寿保险、恒康长期护理、恒康金融网络等业务单位。 雷先生服务宏利逾三十载,历任美国、加拿大、国际及企业业务部多项管理要职,曾驻多伦多、沃特卢、波士顿、英格兰等地,现常驻香港。雷先生于策略规划、保险及年金产品管理、销售、市场推广等领域均饶富经验。现任宏利金融亚洲区高级行政副总裁兼总经理、宏利国际控股有限公司总裁兼首席行政总监及宏利资产管理(香港)有限公司主席。

杜汶高先生,董事。毕业于美国卡内基美隆大学,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,掌握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,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。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,拥有二十三年的资本市场经验。

刘青山先生,董事。毕业于中国人民大学,史学学士和管理学硕士。1997年就职于华夏证券基金部,参与筹建华夏基金管理公司,从事投资研究工作。2001年起参与筹建湘财合丰基金管理公司(泰达宏利基金管理有限公司前身)并工作至今,期间历任研究部负责人、基金经理、投资副总监,投资总监兼总经理助理、副总经理兼投资总监。2013年3月起任泰达宏利基金管理有限公司总经理。

汪丁丁先生,独立董事,毕业于北京师范学院数学系,中国科学院数学力学部理学硕士学位,1990年获夏威夷大学经济学博士学位。1984年至1998年先后担任中国科学院系统科学研究所助理研究员、美国东西方中心人口研究所访问学者、博士后研究员、香港大学经济与金融学院助理教授、德国杜依斯堡大学经济系客座教授、北京大学中国经济研究中心副教授及美国夏威夷大学经济系访问教授。目前担任北京大学及浙江大学教授,自2007年至今,担任东北财经大学"社会与行为"跨学科教育中心学术委员会主席兼主任。

周小明先生,独立董事。毕业于浙江大学法学院,中国政法大学法学硕士学位、民商法法学博士学位。1990年起先后任职于浙江大学、中国人民银行非银行金融机构监管司、君泽君律师事务所、安信信托投资股份有限公司。曾担任全国人大常委会财经委员会《信托法》、《证券投资基金法》起草小组成员、安信信托投资股份有限公司总裁。目前担任中国人民大学信托与基金研究所所长、君泽君律师事务所合伙人、清华大学法学院联合法律硕士导师、中国信托业协会培训与资格办公室副主任、《中国信托业发展报告》主编。

杜英华女士,独立董事。任期始于2014年6月20日。毕业于南开大学法律系,获得法学学士和法学硕士学位。1992年10月,与其他合伙人共同发起设立天津津华律师事务所,现任该律所副主任,正高级律师,具有22年法律实务经验。同时担任天津第五届律师协会理事、天津第六届律师协会监事。

范小云女士,独立董事,毕业于南开大学金融学系,经济学博士学位。毕业于南开大学金融学系,经济学博士学位。1997年至2005年历任南开大学金融学系讲师、副教授。2005年起任南开大学金融学系教授、副主任、国际金融研究中心主任。2001年至2005年担任《南开经济研究》副主编。目前为教育部哲学社会科学重大攻关项目首席专家,南开大学金融学系教授、副主任、国际金融研究中心主任;兼任中国金融学会理事、中国国际金融学会理事。

2、监事会成员

邢吉海先生,监事,本期任期始于2010年3月31日。毕业于天津干部管理学院财会专业,会计师。1995年至1997年任天津泰达国际酒店集团副总经理兼财务总监。1997年至2000年任职于天津经济开发区财政局;2000年至2001年任天津开发区总公司财务中心主任;2001年起任天津泰达投资控股有限公司财务中心主任。现任天津市泰达投资控股(集团)有限公司总经理助理。

任赛华女士,监事。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,曾任首席行政事务总监,现担任宏利资产管理高级执行总监。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。

王泉先生,职工监事。管理学学士、经济学硕士。2002 年3 月加入泰达宏利基金管理有限公司工作至今,历任基金运营部基金会计、基金运营部副总经理、基金运营部总经理、运营总监。

邓艺颖女士,职工监事。金融学硕士, 2004年5月至2005年4月就职于中国工商银行广东省分行公司业务部职员; 2005年4月加盟泰达宏利基金管理有限公司,先后担任交易部交易员、固定收益部研究员、研究部总监业务助理兼研究员、研究部副总监; 具备9年基金从业经验,8年证券投资管理经验,具有基金从业资格。

3、总经理及其他高级管理人员

刘青山先生,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。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。

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

邓艺颖女士,本基金基金经理,简历同上;自2011年6月3日起担任泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金基金经理;自2014年1月起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;自2014年8月1日起担任泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理:史博先生,2009年4月至2009年9月管理本基金;李泽刚先生,2009年4月至2009年6月管理本基金;梁辉先生,2009年9月至2013年3月管理本基金;焦云女士,2013年3月至2014年1月管理本基金。

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青山,总经理助理兼投资总监梁辉,研究部副总监兼基金经理邓艺颖。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

一、基金托管人情况

(一)基本情况
名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田 青
联系电话:(010)6759 5096

中国建设银行拥有悠久的经营历史,其前身"中国人民建设银行"于1954年成立,1996年易名为"中国建设银行"。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

截至2013年12月31日,中国建设银行资产总额153,632.10亿元,较上年增长9.95%;客户贷款和垫款总额85,900.57亿元,增长14.35%;客户存款总额122,230.37亿元,增长7.76%。营业收入5,086.08亿元,较上年增长10.39%,其中,利息净收入增长10.29%,净利息收益率(NIM)为2.74%;手续费及佣金净收入1,042.83亿元,增长11.52%,占营业收入比重为20.50%。成本费用开支得到有效控制,成本收入比为29.65%。实现利润总额2,798.06亿元,较上年增长11.28%;净利润2,151.22亿元,增长11.12%。资产质量保持稳定,不良贷款率0.99%,拨备覆盖率268.22%;资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.34%和10.75%,保持同业领先。

中国建设银行在中国内地设有分支机构14,650个,服务于306.54万公司客户、2.91亿个人客户,与中国经济战略性行业的主导企业和大量高端客户保持密切合作关系;在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、大阪、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、墨尔本、台北、卢森堡设有海外分行,拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建行欧洲、建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿等多家子公司。

2013年,本集团的出色业绩与良好表现受到市场与业界的充分认可,先后荣获国内外102项奖项,多项综合排名进一步提高,在英国《银行家》杂志"全球银行1000强排名"中位列第5,较上年上升2位;在美国《福布斯》杂志发布的"2013年度全球上市公司2000强排名"中,位列第2,较上年上升13位。此外,本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、养老金、国际业务、电子商务和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工220余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

(二)主要人员情况

杨新丰,投资托管业务部总经理,曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部,长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

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

黄秀莲,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(三)基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2013年12月31日,中国建设银行已托管349只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至2012年连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为"中国最佳托管银行";获和讯网的中国"最佳资产托管银行"奖;境内权威经济媒体《每日经济观察》的"最佳基金托管银行"奖;中央国债登记结算有限责任公司的"优秀托管机构"奖。

三、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
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:010-66577619、010-66577617
客服信箱:irm@mfcteda.com
客服电话:400-698-8888(免长话费)
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/

目前支持的网上直销银行卡: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、浦发银行卡、交通银行卡和汇付天下"天天盈"账户、支付宝账户、泰达宏利淘宝官方网店(http://tfund.taobao.com/)等。

客户服务电话:400-698-8888(免长话费)或010-66555662
客户服务信箱:irm@mfcteda.com

2、代销机构

1) 中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
客服电话:95533
银行网站:www.ccb.com

2) 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:蒋超良
客服电话:95599
银行网站:www.abchina.com

3) 中国银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:田国立
客服电话:95566
银行网站:www.boc.cn

4) 交通银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:牛锡明
客服电话:95559
银行网址:www.bankcomm.com

5) 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

6) 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
客服电话:95528
公司网址:www.spdb.com.cn

7) 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: 孔丹
客服电话:95558
网址:http://bank.ecitic.com

8) 东莞银行股份有限公司
注册地址:东莞市运河东一路193号
办公地址:东莞市运河东一路193号
法定代表人:廖玉林
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

9) 宁波银行股份有限公司
注册地址:宁波市江东区中山东路294号
办公地址: 宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人: 陆华裕
电话:0574-89068340
传真:0574-87050024
联系人: 胡技勋
客户服务热线:96528(上海地区962528)
公司网站:www.nbcb.com.cn

10) 渤海银行股份有限公司
注册地址:天津市河西区马场道201-205号
办公地址:天津市河西区马场道201-205号
法定代表人:刘宝凤
电话:022-58316666
传真:022-58316259
联系人:王宏
客户服务热线:400- 888-8811
公司网站:www.cbhb.com.cn

11) 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

12) 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:阎冰竹
客户服务电话:95526
公司网站:www.bankofbeijing.com.cn

13) 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

14) 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
联系电话:4006-960296
公司网站:www.bank-of-tianjin.com

15) 湘财证券有限责任公司
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
联系人:赵小明
联系电话:021-68634510-8620
公司网站:www.xcsc.com

16) 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:杜庆平
联系人:胡天彤
电话:022-28451709
传真:022-28451892
电子邮箱:hutt@bhzq.com
客户服务电话:400-651-5988
网址:www.bhzq.com

17) 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:陈有安
电话:010-66568450
联系人:宋明
公司网址:www.chinastock.com.cn

18) 广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区天河北路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
公司网址:www.gf.com,cn

19) 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:400-888-8108
传真:010-65182261
公司网站:www.csc108.com

20) 国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路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:万建华
客服电话:400-888-8666
联系人:吴倩
公司网址:www.gtja.com

21) 平安证券有限责任公司
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:郑舒丽
全国免费业务咨询电话:95511
传真:.0755-82400862
网址:www.PINGAN.com

22) 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22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

23) 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:袁媛
客服电话:0755-83199511
网址:www.csco.com.cn

24) 申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市长乐路989号45楼
办公地址:上海市长乐路989号40楼
法定代表人:储晓明
联系人:李清怡
联系电话:021-54033888
客服电话:95523或400-889-5523
网址:www.sywg.com

25) 齐鲁证券有限公司
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.qlzq.com.cn

26) 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39层
法定代表人:许刚
客服电话:400-620-8888
传真:021-50372474
联系人:王炜哲
公司网站:www.bocichina.com

27) 华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
客户服务电话: 025-95597
传真:025-84579763
联系人:庞晓芸
公司网站:www.htsc.com.cn

28) 东北证券股份有限公司
注册地址:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:矫正中
联系人:安岩岩
电话:0431-85096517
客户服务电话:400-600-0686
网址:www.nesc.cn

29) 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 400-888-8788 101-089-98
传真:021-22169134
公司网址:www.ebscn.com

30) 新时代证券有限责任公司
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:400-698-9898
公司网址:www.xsdzq.cn

31) 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:95565,400-888-8111
公司网址:www.newone.com.cn

32) 长城证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、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

33) 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:江苏省南京市大钟亭8号
法定代表人:张华东
联系人:潘月
联系电话:025-52310569
客户服务电话:400-828-5888
公司网址:www.njzq.com.cn

34) 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: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

35) 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
网址:www.htsec.com

36) 广州证券有限责任公司
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:刘东
客服电话:020-961303
联系电话:020-88836999
传真:020-88836654
联系人:林洁茹
公司网址:www.gzs.com.cm

37) 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
公司网址:www.hfzq.com.cn

38) 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
网站:www.guosen.com.cm

39) 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
公司网址:www.jyzq.cn

40) 德邦证券有限责任公司
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
法人代表人:姚文平
客服电话:400-888-8128
传真:021-68767981
联系人:徐可
公司网址:www.tebon.com.cn

41) 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
深圳市福田区深南大道2008号凤凰大厦1栋9层
法定代表人:牛冠兴
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

42) 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:刘化军
联系人:王一彦
电话:021-20333333
传真:021-50498825
客服电话:95531,400-888-8588
公司网络地址:www.longone.com.cn

43) 国都证券有限责任公司
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

44) 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)
法定代表人: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:孙智勇
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

45) 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

46) 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
办公地址: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
客服服务热线:95571
网址:www.foundersc.com

47) 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.mszq.com
客服热线: 400-619-8888

48) 国金证券股份有限公司
注册地址:成都市东城根上街95号
办公地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
公司网址:www.gjzq.com.cn
客服热线:400-660-0109

49) 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:95558

50) 西藏同信证券股份有限公司
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:贾绍君
公司网址:www.xzsec.com
客服热线:400-881-1177

51) 中山证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29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、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

52) 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20层
法定代表人:杨宝林
公司网址:www.citicssd.com
客服热线:95548

53)中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
办公地址:杭州市解放东路29号迪凯银座22、23楼
法定代表人:沈强
公司网址:www.bigsun.com.cn
客服热线:95548

54)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

55)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

56)深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人:薛峰
公司网址:www.zlfund.cn;www.jjmmw.com
客服热线:4006-788-887

57)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

58)杭州数米基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
客服电话:4000-766-123
网站:http://www.fund123.cn/

59)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
网站: www.1234567.com.cn

60)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:单丙烨
电话:021-20691835
传真:021-20691861
客服电话:400-089-1289
公司网站:www.erichfund.com

61)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:习甜
联系电话:010-85650920
传真号码:010-85657357
全国统一客服热线:400-920-0022/021-20835588
公司网址:licaike.hexun.com

62)北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6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

(二)登记结算机构
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:王泉
联系电话:010-66577768
传真:010-66577750

(三)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:廖海

(四)会计师事务所
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:上海市卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800

四、基金的名称

泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

随着中国经济增长迈上新的台阶,广大人民群众必然更加注重生活品质。本基金将重点把握生活品质提高的这一趋势,通过投资相关的受益行业和上市公司,充分分享中国国民经济实力的全面提升,力争为投资者带来长期稳定的投资回报。

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、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规和监管机构以后允许投资的其他品种,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30%—80%,债券资产占基金资产的15%—65%,权证占基金资产净值的0%—3%,资产支持证券占基金资产净值的0%—20%,并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

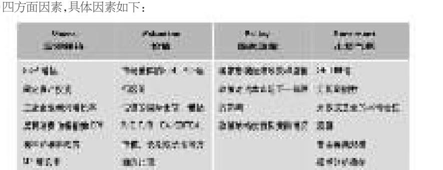
本基金主要投资于与居民提高生活品质密切相关的主题和行业中的优质企业, 对这些主题及行业所覆盖企业的投资占股票投资的比重不低于80%。

八、基金的投资策略

1.战略性资产配置策略,确定股票债券比例

本基金股票资产比例最低为基金资产的30%,最高为80% ,债券资产比例最高可以达到65%,最低为15%,权证资产比例最高可以达到3%,最低为0%,资产支持债券资产比例最高可以达到20%,最低为0%,并保持现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,以保持基金资产流动性的要求。

本基金将使用MVPS模型来进行资产配置调整。MVPS模型主要考虑M(宏观经济环境)、V(价值)、P(政策)、S(市场气氛)四方面因素,具体因素如下:



MVPS模型作为本基金管理人持续一致的资产配置工具, 通过定量和定性分析的有效结合判断未来市场的发展趋势,为本基金的资产配置提供支持。

2.股票投资策略

对于股票投资组合的构建,本基金采用双主线策略。一方面,从横向上,本基金利用从外方股东引进并且已经成功运用的"行业文档"分析方法,运用国际比较的方法,对各行业的投资价值进行分析,确定国内行业与提高生活品质有关行业中具有竞争优势和比较优势的行业。另一方面,从纵向上,努力挖掘市场上与本基金投资理念相一致的投资主题,从中选择对相关行业和企业影响深刻且具有中长期投资价值的投资主题。对横纵交点进行重点的定性分析和定量分析, 从中选择出最优的企业,并辅以非交点优质企业,最后构建实际股票投资组合。

(1)行业配置

本基金选用天相分类标准作为行业分类的基本标准。该标准是由天相投资顾问有限公司创建的一个详尽且全面的产业及行业分析体系,为市场研究、交易及投资决策提供了相应的、易于使用的分类标准。该体系可将各企业划分至最能表述其业务性质的从属行业类别中,为基金管理人提供了一个具有普遍性的标准,可用于更为详尽的定量及定性分析。

在依据天相行业分类标准划分出的行业的基础上,本基金管理人通过利用从外方股东引进并且已经成功运用的"行业文档"分析方法,运用国际比较的方法,对各行业的投资价值进行分析,确定国内行业中符合本基金投资理念的且具有竞争优势和比较优势的行业。另外,随着时间的推移,在经济的不同发展阶段,符合本基金投资理念的行业和公司也将不尽相同,本基金管理人也将根据这些变化对行业配置进行调整。

行业文档的主要要素包括:
a. 行业趋势,不仅仅是从中国角度,还从全球视角来研究;
b. 详细分析中国特定行业公司的独特运作;
c. 主要业务的驱动因素和行业增长的驱动因素。

研究员对每个行业进行深入的分析,根据行业文档并结合对风险和收益的综合考虑,做出行业投资价值判断。

(2)主题配置

在国外,比较流行的对主题投资的定义是"一种寻找先于科技、经济、社会等变化,根据变化对仓位进行最优调整,以达到超越一般业绩水平的投资方式。" 投资主题的产生主要是源于科技发展、结构性和政策的变化并相应的对整个经济主体产生影响。主题投资主要依赖于对目标企业和行业的一系列宏观经济因素和传统基本面的深入研究。

本基金采用自上而下的分析研究方法,首先对可能使行业和经济环境发生积极变化的因素进行收集整理,之后在这些因素发生作用且对市场产生结构性变化的时候,对每一个趋势因素和催生这种变化的因素进行研究,最后归纳总结出前两步的分析,进行主题挖掘,再利用提炼出的投资主题作为过滤器缩小研究范围,并筛选出主题投资分析下的股票备选库。

基金管理人将通过两个层面去挑选符合提高生活品质的主题,包括主题挖掘和主题选择。

1)主题挖掘

本基金管理人的投研团队首先从宏观经济方面、政策方面及资金供应方面着手进行研究,推导出符合中国经济发展,健康稳定投资主题的基本方向。

之后,在此基础上,本基金透过自建的主题筛选模型对国内经济发展催生出的投资主题进行挖掘。

投资主题筛选模型主要由以下标准进行构建:
a. 前瞻性
b. 涉及企业或行业不唯一或不仅限于某一区域
c. 政策向导性强
d. 影响深刻

首先,由于经济发展速度和受益行业、企业的程度不同,导致投资主题会不断更替出现;其次,投资主题所影响的企业不仅仅局限于单一行业、地域这一传统的划分范围,只有具有跨行业、跨地域特点的投资主题才能为市场带来更多新的投资机会,另一方面,有利稳定的政策基础也是投资主题健康稳定发展的基础;最后,从投资角度来讲,一个优质的投资主题需要对企业或者行业有较深的正面影响。

在根据以上标准对市场进行深入分析后,总结归纳出影响经济和行业的趋势性因素和催生这种变化的因素,再根据对这些因素的发展变化进行跟踪和分析,推导出对提高生活品质相关行业有积极影响变化的投资主题及主题所覆盖的企业。

2)主题选择

在对主题进行过初次挖掘筛选后,本基金管理人的投研团队将结合对行业研究结果对所选出的主题进行二次筛选。重点把握与提高生活品质相关度高的投资主题,及在主题所覆盖下拥有优质基本面且蕴含升值潜力和价值低估的行业和企业,形成投资主题研究下的股票备选库。

(3)选择优质股票,建立股票优选库

在结合行业分析和主题选择后,本基金将采用定量分析和定性分析相结合的方法来建立股票优选库。第一步:将通过行业研究和主题挖掘提炼出的两个股票备选库合二为一,形成股票备选池,然后将股票进行分类、筛选,形成基金投资备选库;第二步:结合运用"行业文档"和"积分卡"对备选库股票进行进一步分析,挑选出优质股票,建立股票优选库。

a.定量筛选

按主营业务收入、主营业务利润、毛利率、市盈率(P/E)、净资产收益率(ROE)、资产收益率(ROA)及增长率等指标对基础库的股票进行综合排序、筛选,形成备选库。

b.定性分析

研究员将根据外部研究报告和实地调研情况对备选库中的股票进行定性分析,研究的主要内容包括两方面:

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

2)业务分析:主要包括对公司的业务进行逐项分析,对于不同产品特性的行业,考察的标准有所不同,对产品同质化的行业,公司业务评价主要包括企业规模和市场占有率等方面,对产品差异化的行业,公司业务评价主要包括技术优势和创新能力等方面。

(4)组合构建

基金经理结合研究员对行业和个股的分析结果及对未来投资主题的分析判断和把握,构建投资组合。

3、债券投资策略

本基金将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,运用利率预期、久期管理、收益率曲线等投资管理策略,权衡到期收益率与市场流动性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。

久期策略是指通过对宏观面、货币和财政政策、市场结构变化等的分析,可以预测整个债券市场的下一步趋势,确定债券组合的久期;类属配置是分析不同的债券类别包括国债、企业债、金融债和可转换债券未来的不同表现,同时可以确定在不同市场上交易的不同类型、不同到期年限债券的预期价值,据此可以发现市场的失衡情况,确定债券的类属配置;个券选择是指通过对比个券的久期、到期收益率、信用等级、税收因素等其他决定债券价值的因素,确定个券的投资价值并精选个券。

4、权证投资策略

本基金在确保与基金投资目标相一致的前提下, 通过对权证标的证券的基本面研究, 并结合权证定价模型估计权证价值,本着谨慎和风险可控的原则,为取得与承担风险相称的收益,投资于权证。

依据现代金融投资理论,计算权证的理论价值,结合对权证标的证券的基本面进行分析,评估权证投资价值;同时结合对未来走势的判断,充分评估权证的风险和收益特征,在严格控制风险的前提下,谨慎进行投资。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准:60%×沪深300指数收益率+40%×上证国债指数收益率。

本基金采用沪深300指数衡量股票投资部分的业绩,上证国债指数衡量债券投资部分的业绩,其主要原因如下:

1、沪深300指数

沪深300指数是由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数,该指数的指数样本覆盖了沪深两地市场70%左右的市值,具有良好的市场代表性。

2、上证国债指数

上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本,按照国债发行量加权而成,具有良好的市场代表性。

随着市场环境的变化,如果上述业绩比较基准不适用本基金时,本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,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。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,基金管理人应在调整前3个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为灵活配置混合型基金,属于中高风险、中高收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。

十一、基金投资组合报告(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。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月20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2014年9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	527,279,762.52	77.34
	其中:股票	527,279,762.52	77.34
2	固定收益投资	103,780,200.00	15.22
	其中:债券	103,780,200.00	15.22
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	47,111,596.05	6.91
7	其他资产	3,576,310.50	0.52
8	合计	681,747,869.07	100.00

3、报告期末按行业分类的股票投资组合

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	20,339,903.36	3.00
B	采矿业	–	–
C	制造业	363,020,968.37	53.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,679,572.71	1.43
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	103,609,468.02	15.27
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	20,614,057.38	3.04
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	10,015,792.68	1.48
S	综合	–	–
	合计	527,279,762.52	77.74

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	300315	掌趣科技	2,433,744	47,165,958.72	6.95
2	000788	北大医药	2,156,655	42,529,236.60	6.27
3	601012	隆基股份	1,921,091	39,862,638.25	5.88
4	600150	中国船舶	1,064,028	38,730,619.20	5.71
5	002030	达安基因	1,684,044	38,514,086.28	5.68
6	300098	高新兴	1,251,990	35,143,359.30	5.18
7	600217	秦岭水泥	4,137,035	33,882,316.65	5.00
8	300038	梅泰诺	1,393,639	33,656,381.85	4.96
9	000768	中航飞机	2,012.030	33,500,299.50	4.94
10	002366	丹甫股份	955,149	30,803,555.25	4.54

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	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	93,680,200.00	13.81
	其中:政策性金融债	93,680,200.00	13.81
4	企业债券	10,100,000.00	1.49
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	103,780,200.00	15.30

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)	占基金资产净值比例(%)
1	140204	14国开04	400,000	40,096,000.00	5.91
2	140430	14农发30	200,000	20,044,000.00	2.96
3	130212	13国开12	200,000	20,030,000.00	2.95
4	018001	国开1301	132,000	13,510,200.00	1.99
5	124123	13南城投	100,000	10,100,000.00	1.49

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
(1)、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。
(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
(1)本期国债期货投资政策
本基金本报告期未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。
(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
(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。
12、投资组合报告附注

(1)、申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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)、申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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	536,737.40
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	2,877,503.75
5	应收申购款	162,069.35
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	3,576,310.50

14、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。
15、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	300315	掌趣科技	47,165,958.72	6.95	重大事项
2	000768	中航飞机	33,500,299.50	4.94	重大事项

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2009年4月9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:

历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较(截止到2014年9月30日)

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2009.4.9(基金合同生效日)~2009.12.31	28.55%	1.42%	26.26%	1.17%	2.29%	0.25%
2010.1.1~2010.12.31	12.37%	1.28%	−5.83%	0.95%	18.20%	0.33%
2011.1.1~2011.12.31	−16.29%	0.94%	−14.09%	0.78%	−2.20%	0.16%
2012.1.1~2012.12.31	0.80%	0.97%	6.36%	0.77%	−5.56%	0.20%
2013.1.1~2013.12.31	25.00%	1.26%	−3.08%	0.84%	28.08%	0.42%
2014.1.1~2014.9.30	12.18%	1.32%	4.51%	0.60%	7.67%	0.72%
基金合同生效以来至2014.9.30	70.93%	1.19%	10.04%	0.86%	60.89%	0.33%

注:1、本基金业绩比较基准:60%×沪深300 指数收益率+40%×上证国债指数收益率。沪深300 指数是由上海和深圳证券市场中选取300 只A 股作为样本编制而成的成份股指数,该指数的指数样本覆盖了沪深两地市场七成左右的市值,具有良好的市场代表性。上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本,按照国债发行量加权而成,具有良好的市场代表性。

2、本基金基金合同生效日为2009年4月9日。

十三、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类
1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、基金财产拨划支付的银行费用;
4、基金合同生效后的信息披露费用;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;
7、基金的证券交易费用;
8、在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明;
9、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(三)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

在通常市场情况下,基金管理费按基金前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提,具体计算方法如下:

H=E×年管理费率÷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。

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3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,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常市场情况下,基金托管费按基金前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提,具体计算方法如下:

H=E×年托管费率÷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。

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3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,支付日期顺延。

3、除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

(四)与基金销售有关的费用

1、基金的申购费用

本基金的申购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式详见本基金招募说明书正文"基金份额的申购与赎回"一章。

2、基金的赎回费用

本基金的赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式详见本基金招募说明书正文"基金份额的申购与赎回"一章。

(五)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财产的损失, 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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(六)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

(七)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

十四、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、董事会成员、监事会成员等部分进行了更新。
(三)"四、基金托管人"部分内容进行了更新。
(四)"五、相关服务机构"中部分进行了更新与增加内容。
(五)"八、基金份额的申购与赎回" 部分内容进行了更新。
(六)"九、基金的投资"部分投资组合报告内容更新至2014年9月30日。
(七)"十、基金的业绩"部分对基金业绩更新至2014年9月30日,并更新了历史走势对比图。
(八)"二十、基金托管协议的内容摘要"对基金管理人中的法定代表人部分进行了变更。
(九)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
2014年11月21日