泰达宏利启智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:江苏银行股份有限公司

【重要提示】

本基金于2016年8月15日经中国证监会证监许可[2016] 1836号文注册。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。

本基金为混合型基金,预期风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

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。

本更新招募说明书所载内容截止日为2017年8月30日, 有关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。

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。

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:010-66577808

信息披露联系人:陈沛

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学士位,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。

横睿波先生,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

丁宇佳女士,

理学学士。 2008年7月加入泰达宏利基金管理有限公司,担任交易部交易员,负责债券交易工作;2013年9月至2014年9月,担任固定收益部研究员,从事债券研究工作; 2014年10月至2015年2月,担任固定收益部基金经理助理; 2015年3月26日至今担任泰达宏利货币市场基金基金经理;2015年6月11日至今担任泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)基金经理;2015年6月16日至今担任泰达宏利养老收益混合型证券投资基金;2015年6月16日至今担任泰达宏利淘利债券型证券投资基金基金经理;2015年11月4日至今担任泰达宏利活期友货币市场基金基金经理;2016年9月26日至今担任泰达宏利启智灵活配置混合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风险预算混合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9月29日至今担任泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2016年11月23日至今担任泰达宏利京元宝货币市场基金基金经理;2016年11月25日至今担任泰达宏利纯利债券型证券投资基金基金经理;2017年1月22日至今担任泰达宏利恒利债券型证券投资基金基金经理;2017年3月1日至今担任泰达宏利启泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2017年3月1日至今担任泰达宏利启惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理;具备9年基金从业经验,9年证券投资管理经验,具有基金从业资格。

本基金历任基金经理: 卓若伟先生, 自2016年8月起至2016年9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。

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他职责。

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)违反证券交易场所业务规则,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2部分 基金托管人

(一)基本情况

名称:江苏银行股份有限公司(简称"江苏银行")

住所:江苏省南京市中华路26号

办公地址:江苏省南京市中华路26号

法定代表人:夏平

成立时间:2007 年 1 月 22 日

组织形式:股份有限公司

注册资本:115.44亿元人民币

存续期间:持续经营

基金托管业务批准文号:证监许可[2014]619 号

联系人:赵越

电话:025 - 58588112

(二)主要人员情况

江苏银行托管业务条线现有员工47名,来自于基金、券商、托管行等不同的行业,具有会计、金融、法律、IT等不同的专业知识背景,团队成员具有较高的专业知识水平、良好的服务意识、科学严谨的态度;部门管理层有20 年以上金融从业经验,精通国内外证券市场的运作。

(三)基金托管业务经营情况

2014 年,江苏银行先后获得基金托管业务资格及保险资金托管业务资格。江苏银行依靠严密科学的风险管理和内部控制体系以及先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务。目前江苏银行的托管业务产品线已涵盖公募基金、信托计划、基金专户、基金子公司专项资管计划、券商资管计划、产业基金、私募投资基金等。江苏银行将在现有的基础上开拓创新继续完善各类托管产品线。江苏银行同时可以为各类客户提供提供现金管理、绩效评估、风险管理等个性化的托管增值服务。

(四)基金托管人的内部控制制度

1、内部风险控制目标

1.确保有关法律法规在托管业务中得到全面严格的贯彻执行;

2.确保我行有关托管的各项管理制度和业务操作规程在托管业务中得到全面严格的贯彻执行;

3.确保资产安全,保证托管业务稳健运行。

2、内部风险控制组织结构 由江苏银行内审部和资产托管部内设的监察稽核人员构成。资产托管部内部设置专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,对业务的运行独立行使稽核监察职权。

3、内部风险控制原则

1.全面性原则。 "实行全员、全程风险控制方法",内部控制必须渗透到托管业务的各个操作环节,覆盖所有的岗位,不能留有任何死角。

2.预防性原则。 必须树立 "预防为主"的管理理念,以业务岗位为主体,从风险发生的源头加强内部控制,防患于未然,尽量避免业务操作中各种问题的产生。

3.及时性原则。 各团队要及时建立健全各项规章制度,采取有效措施加强内部控制。发现问题,要及时处理,堵塞漏洞。

4.独立性原则。 托管业务内部控制机构必须独立于托管业务执行机构,业务操作人员和检查人员必须分开,以保证内控机构的工作不受干扰。

(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

1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用投资监督系统,严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2、监督流程

1.每工作日按时通过基金监督子系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

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

网上直销交易系统网址: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:农业银行卡、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、上海银行卡和汇付天下"天天盈"、快钱支付等。

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。

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

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

电话:010-66568292

联系人:辛国政

公司网站:www.chinastock.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、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4部分 基金的名称

泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金

第5部分 基金的类型

一、基金运作方式

契约型开放式。

二、基金的类别

混合型证券投资基金。

三、基金存续期限

不定期。

第6部分 基金的投资目标

本基金紧跟新常态下我国经济发展转型过程中各类投资机遇, 基于大类资产配置策略,力争为投资者创造稳定的较高投资收益。

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(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、次级债券、可交换债券、可转债及分离交易可转债)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、同业存单、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%,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

本基金紧跟新常态下国民经济发展过程中各类投资机遇, 结合国内外宏观经济发展趋势及各行业的发展前景,精选出具有长期竞争力和增长潜力的优质公司,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。

1、类别资产配置策略

本基金的类别资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究, 基于定量与定性相结合的宏观及市场分析,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例,从而在一定程度上规避系统性风险。

在资产配置中,本基金主要考虑宏观经济指标,包括PMI水平、GDP增长率、M2增长率及变化趋势、PPI、CPI、利率水平与变化趋势、宏观经济政策等,来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向。

在经济周期各阶段,综合对所跟踪的宏观经济指标和市场指标的分析,本基金对大类资产进行配置的策略为:在经济的复苏和繁荣期超配股票资产;在经济的衰退和政策刺激阶段,超配债券等固定收益类资产,力争通过资产配置获得部分超额收益。

2、A股股票投资策略

本基金针对沪深两市,剔除其中不符合投资要求的股票(包括但不限于法律法规或公司制度明确禁止投资的股票、涉及重大案件和诉讼的股票等),筛选得到本基金重点投资的股票池。通过每个上市公司的财务、投资吸引力等方面进行分析,结合实地调研情况,构建投资股票投资组合。基于基金组合中单个证券的预期收益及风险特性,对组合进行优化,在合理风险水平下追求基金收益最大化,同时监控组合中证券的估值水平,在证券价格明显高于其内在合理价值时适时卖出证券。

(1)财务分析

从资产流动性、经营效率、盈利能力等方面分析公司的财务状况及变化趋势,考察企业持续发展能力,并力图通过公司财务报表相关项目的关联关系,剔除存在重大陷阱、财务危机以及应收账款管理严重不善的公司。本基金将对那些财务稳健、盈利能力强、经营效率高、风险管理能力强的公司给予较高的评级。

(2)投资吸引力评估

本基金将采用市盈率、市净率、市现率、市销率等相对估值指标,净资产收益率、销售收入增长率等盈利指标、增长性指标以及其他指标对公司进行多方面的综合评估。在综合评估的基础上,确定本基金的重点备选投资对象。对每一只备选投资股票,采用现金流折现模型等方法评估公司股票的合理内在价值, 同时结合股票的市场价格,选择最具有投资吸引力的股票。

3、债券投资策略

(1)债券类属配置策略

本基金将根据对政府债券、信用债等不同债券板块之间的相对投资价值分析,确定债券类属配置策略,并根据市场变化及时进行调整,从而选择既能匹配目标久期、同时又能获得较高持有期收益的类属债券配置比例。

(2)久期管理策略

本基金将根据对利率水平的预期,在预期利率下降时,增加组合久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益,在预期利率上升时,减小组合久期,以规避债券价格下降的风险。

(3)收益率曲线策略

本基金资产组合中的长、中、短期债券主要根据收益率曲线形状的变化进行合理配置。本基金在确定固定收益资产组合平均久期的基础上,将结合收益率曲线变化的预测,适时采用跟踪收益率曲线的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的子弹、杠铃及梯形策略构造组合,并进行动态调整。

(4)信用债券投资策略

本基金将主要通过买入并持有信用风险可承担、期限与收益率相对合理的信用债券产品,获取票息收益。此外,本基金还将通过对内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断,主动采用信用利差投资策略,获取利差收益。

(5)特殊固定收益品种投资策略

1)可转换公司债券投资策略

在综合分析可转换公司债券的股性特征、债性特征、流动性、摊薄率等因素的基础上,本基金采用Black-Scholes期权定价模型和二叉树期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值,选择其中安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好,并且基础股票基本面优良、具有较强盈利能力、成长前景好、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种,以合理价格买入并持有。根据内含收益率、折溢价比率、久期、凸性等因素构建可转换公司债券投资组合,获取稳健的投资回报。此外,本基金将通过分析不同市场环境下可转换公司债券股性和债性的相对价值, 通过对标的转债股性与债性的合理定价,力求选择被市场低估的品种。

2)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。

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、权证投资策略

本基金的权证投资是以权证的市场价值分析为基础, 配以权证定价模型寻求其合理估值水平,以主动式的科学投资管理为手段,充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,追求基金资产稳定的当期收益。

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)本基金股票资产占基金资产的比例为0%-95%;

(2)本基金如投资股指期货的,本基金在任何交易日日终,持有的卖出股指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%;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, 本基金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; 本基金在任何交易日日终, 持有的买入股指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)占基金资产的比例为0%-95%;

(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(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%;

(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)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;

(14)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%;在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(15)基金总资产不得超过基金净资产的140%;

(16)本基金投资流通受限证券,基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险;

(17)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,除上述第(12)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)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资;

(6)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;

(7)法律、行政法规和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取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资按照取消或调整后的规定执行。

第9部分 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:75%*中证全债指数收益率+25%*沪深300指数收益率

中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,中证指数有限公司每日计算并发布中证全债的收益指数及相应的债券属性指标, 为债券投资人提供投资分析工具和业绩评价基准。沪深300指数是由中证指数有限公司编制, 从上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本的综合性指数,具有良好的市场代表性。本基金运用大类资产配置策略,严控下行风险,以为投资者创造稳定的较高收益为投资目标,因此选取"75%*中证全债指数收益率+25%*沪深300指数收益率"作为本基金的业绩比较基准。

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时, 本基金可以在与托管人协商一致并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。

第10部分 基金的风险收益特征

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,其预期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。

第11部分 基金的投资组合(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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2017年9月11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	131,081,904.68	27.87
	其中:股票	131,081,904.68	27.87
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	331,941,260.00	70.58
	其中:债券	331,941,260.00	70.58
	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	1,249,840.74	0.27
8	其他资产	6,040,657.76	1.28
9	合计	470,313,663.18	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	–	–
B	采矿业	1,022,332.00	0.22
C	制造业	4,287,404.38	0.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,922,588.00	2.13
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	3,305,321.00	0.71
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.00
J	金融业	94,637,324.40	20.31
K	房地产业	11,274,906.00	2.42
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	6,624,389.28	1.42
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	131,081,904.68	28.14

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	000001	平安银行	3,623,513	34,024,787.07	7.30
2	601398	工商银行	4,266,136	22,397,214.00	4.81
3	601288	农业银行	5,952,440	20,952,588.80	4.50
4	000776	广发证券	548,200	9,456,450.00	2.03
5	000069	华侨城A	658,488	6,624,389.28	1.42
6	600048	保利地产	604,600	6,027,862.00	1.29
7	601601	中国太保	173,733	5,884,336.71	1.26
8	000402	金 融 街	447,700	5,247,044.00	1.13
9	601985	中国核电	667,900	5,216,299.00	1.12
10	000027	深圳能源	699,300	4,706,289.00	1.01

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	5,394,060.00	1.16
2	央行票据	–	–
3	金融债券	17,962,200.00	3.86
	其中:政策性金融债	17,962,200.00	3.86
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	同业存单	308,585,000.00	66.24
9	其他	–	–
10	合计	331,941,260.00	71.25

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	111615257	16民生CD257	1,000,000	96,740,000.00	20.77
2	111614180	16江苏银行CD180	1,000,000	96,680,000.00	20.75
3	111799953	17包商银行CD088	700,000	66,815,000.00	14.34
4	111610564	16兴业CD564	500,000	48,350,000.00	10.38
5	108601	国开1703	180,000	17,962,200.00	3.86

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)报告期内本基金投资的广发证券(000776)于2016年11月28日发布收到证监会依法对场外配资中证券违法违规案件作出行政处罚的通知。广发证券未按照《证券登记结算管理办法》第24条,《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第6条、第8条、第13条,《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第3条第(4)项,《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第50条的规定对客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第28条第1款规定。依据《证券公司监督管理条例》第84条规定,证监会决定对广发证券责令改正,给予警告,没收违法所得6,805,135.75元,并处以20,415,407.25元罚款。

本基金管理人在投资广发证券(000776)前严格执行了对上市公司的调研、内部研究推荐、投资计划审批等相关投资决策流程。上述股票根据股票池审批流程进入本基金备选库,由研究员跟踪并分析。上述事件发生后,本基金管理人对上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,因此,没有改变本基金管理人对上述上市公司的投资判断。

本基金投资的其余前九名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(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	147,355.10
2	应收证券清算款	220,484.50
3	应收股利	–
4	应收利息	5,672,818.16
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	6,040,657.76

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

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。

第12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6月30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:

泰达宏利启智A

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~2016年12月31日	-0.24%	0.07%	-0.94%	0.22%	0.70%	-0.15%
2017年1月1日~2017年6月30日	4.01%	0.13%	2.47%	0.16%	1.54%	-0.03%
本基金合同生效之日起至2017年6月30日	3.76%	0.11%	1.51%	0.19%	2.25%	-0.08%

泰达宏利启智C

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~2016年12月31日	-0.26%	0.08%	-0.94%	0.22%	0.68%	-0.14%
2017年1月1日~2017年6月30日	3.85%	0.13%	2.47%	0.16%	1.38%	-0.03%
本基金合同生效之日起至2017年6月30日	3.58%	0.11%	1.51%	0.19%	2.07%	-0.08%

注:本基金的业绩比较基准:中证全债指数收益率*75%+沪深300指数收益率*25%。

(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

注: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13部分 基金的财产

一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、期货账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产,并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任, 其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外,基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的,基金财产不属于其清算财产,但基金管理人、基金托管人有权收取的管理费、托管费以及本合同约定的其他费用除外。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权,不得与其固有资产产生的债务相互抵销;基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

第14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、C类份额的销售服务费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金相关账户的开户及维护费用;

8、基金的证券、期货交易费用;

9、基金的银行汇划费用;

10、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0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H=E \times 0.6\% \div$ 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

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令, 基金托管人复核后于次月前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0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H=E \times 0.15\% \div$ 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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费、基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月前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。

3、销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.30%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务,基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日C类份额基金资产净值的0.30%年费率计提。计算方法如下:

$H=E \times 0.30\% \div$ 当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金资产中划出,由登记机构代收,登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述"一、基金费用的种类"中第4-10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、销售服务费的调整

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, 酌情调整基金管理费率、基金托管费率、提高销售服务费率,并须召开基金份额持有人大会。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纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第15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6月30日。

(六)"十、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。

(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

2017年10月13日