(上接B41版)

84)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
85)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
86)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
87)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.com
88)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:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
法定代表人:沈继伟
客服电话:400-067-6266
网址:www.leadfund.com.cn
89)济安财富(北京)资本管理有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层
法定代表人:杨健
客服电话:400-673-7010
公司网站:www.jianfortune.com
90)天津万家财富资产管理有限公司
注册地址:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址:北京市西城区太平桥大街丰盛胡同28号太平洋保险大厦A座5层
法定代表人:李修辞
客服电话:010-59013842
公司网址:www.wanjiawealth.com
91)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号楼soho现代城C座18层1809
法定代表人:戎兵
客服电话:400-6099-200
公司网址:http://www.yixinfund.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:石楠
联系电话:010-66577769
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:梁丽金、刘佳
(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:赵柏基
经办注册会计师:单峰、庞伊君
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:庞伊君

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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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:

Macro 宏观经济	Valuation 价值	Policy 政策取向	Sentiment 市场气氛
[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

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)

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2018年4月27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2018年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

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	21,782,542.26	78.81
	其中:股票	21,782,542.26	78.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,780,756.24	17.30
	其中:债券	4,780,756.24	17.30
	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	1,020,111.65	3.69
8	其他资产	54,687.81	0.20
9	合计	27,638,097.96	100.00

2、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	-	-
B	采矿业	811,087.00	2.96
C	制造业	12,117,094.24	44.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	536,133.00	1.96
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	6,963,817.22	25.45
J	金融业	-	-
K	房地产业	21,108.00	0.08
L	租赁和商务服务业	393,402.80	1.44
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	117,941.00	0.43
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	821,959.00	3.00
S	综合	-	-
	合计	21,782,542.26	79.62

3、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	002415	海康威视	21,600	892,080.00	3.26
2	000725	京东方A	145,900	776,188.00	2.84
3	002008	大族激光	10,000	547,000.00	2.00
4	601012	隆基股份	13,500	462,645.00	1.69
5	300392	腾信股份	32,400	438,696.00	1.60
6	600703	三安光电	18,700	436,271.00	1.59
7	600157	永泰能源	122,200	410,592.00	1.50
8	002558	巨人网络	12,800	408,448.00	1.49
9	600711	盛屯矿业	46,300	400,495.00	1.46
10	000516	国际医学	81,700	399,513.00	1.46

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	1,598,080.00	5.84
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	3,182,676.24	11.63
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,780,756.24	17.47

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	019540	16国债12	16,000	1,598,080.00	5.84
2	113011	光大转债	12,000	1,301,760.00	4.76
3	132012	17巨化EB	10,000	1,029,500.00	3.76
4	128012	辉丰转债	8,907	842,780.34	3.08
5	128017	金禾转债	73	8,635.90	0.03

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

本基金本报告期末投资于国债期货。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)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,在报告编制日前一年内未收到公开谴责、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	8,241.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	45,450.29
5	应收申购款	996.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,687.81

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	113011	光大转债	1,301,760.00	4.76
2	128012	辉丰转债	842,780.34	3.08

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	300392	腾信股份	438,696.00	1.60	重大事项
2	600157	永泰能源	410,592.00	1.50	重大事项
3	600711	盛屯矿业	400,495.00	1.46	重大事项
4	000516	国际医学	399,513.00	1.46	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2018年3月31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%
2014.1.1~2014.12.31	2.36%	1.41%	31.20%	0.73%	-28.84%	0.68%
2015.1.1~2015.12.31	12.28%	2.78%	7.74%	1.49%	4.54%	1.29%
2016.1.1~2016.12.31	-28.55%	1.80%	-5.13%	0.84%	-23.42%	0.96%
2017.1.1~2017.12.31	5.74%	0.59%	12.98%	0.38%	-7.24%	0.21%
2018.1.1~2018.3.31	0.11%	0.95%	-1.37%	0.71%	1.48%	0.24%
基金合同生效以来至2018.3.31	32.46%	1.49%	57.35%	0.92%	-24.89%	0.57%

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。

(二)自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

泰达宏利品质生活灵活配置型基金累计份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2009年4月9日至2018年3月31日)

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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的约定基金管理年费率计提。管理费的计算方法如下:

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。

本报告期内,本基金的约定基金管理年费率于2017年5月8日前为1.50%/年,自2017年5月8日起为0.70%/年。详见基金管理人于2017年5月6日发布的《关于调整泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金管理费率并修改基金合同和托管协议的公告》。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)在“一、绪言”中增加“《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》”。

(三)“二、释义”新增“《流动性风险管理规定》”、“流动性受限资产”、“摆动定价机制”内容。

(四)对“三、基金管理人”中,基金管理人概况、基金经理部分进行更新。

(五)更新了“四、基金托管人”中的内容。

(六)“五、相关服务机构”中,更新代销机构、第三方销售机构部分内容及增加第三方销售机构。

(七)对“八、基金的份额的申购与赎回”根据流动性新规修改。

(八)“九、基金的投资”部分投资组合报告内容更新至2018年3月31日及更新投资范围、投资限制等部分内容。

(九)“十、基金的业绩”部分对基金业绩更新至2018年3月31日,并更新了历史走势对比图。

(十)“十二、基金资产的估值”部分增加内容。

(十一)“十六、基金的信息披露”部分增加内容。

(十二)对“二十、基金托管协议的内容摘要”部分进行更新及增加内容。

(十三)更新“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5月23日

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

证券代码:600601 证券简称:方正科技 公告编号:临2018-023

方正科技集团股份有限公司
关于召开2017年年度股东大会的通知

重要内容提示:

●股东大会召开日期:2018年6月12日

●本次股东大会采用的网络投票系统:中国证券登记结算有限责任公司上市公司股东大会网络投票系统

一、召开会议的基本情况

(一)股东大会类型和届次

2017年年度股东大会

(二)股东大会召集人:董事会

(三)投票方式:本次股东大会所采用的表决方式是现场投票和网络投票相结合的方式

(四)现场会议召开的日期、时间和地点

召开的日期时间:2018年6月12日 14点 30分

召开地点:北京市海淀区中关村北大街127号北大博雅国际酒店1A会议室

(五)网络投票的系统、起止日期和投票时间。

网络投票系统:中国证券登记结算有限责任公司上市公司股东大会网络投票系统

网络投票起止时间:自2018年6月11日

至2018年6月12日

投票时间为:2018年6月11日下午15:00至2018年6月12日下午15:00止

(六)融资融券、转融通、约定购回业务账户和沪股通投资者的投票程序

涉及融资融券、转融通业务、约定购回业务相关账户以及沪股通投资者的投票,应按照《上海证券交易所上市公司股东大会网络投票实施细则》等有关规定执行。

(七)涉及公开征集股东投票权

无

二、会议审议事项

本次股东大会审议议案及投票股东类型

序号	议案名称	投票股东类型 A股股东
非累积投票议案		
1	关于2017年度计提资产减值准备的议案	√
2	公司2017年度董事会工作报告	√
3	公司2017年度监事会工作报告	√
4	公司2017年度财务决算报告	√
5	公司2017年年度报告全文和摘要	√
6	公司2017年度利润分配预案	√
7	关于续聘公司2018年度审计机构的议案	√
8	关于2018年度公司对控股子公司预计担保额度的议案	√
9	关于2018年度公司向金融机构申请借款额度的议案	√
10	关于公司2017年度日常关联交易情况及2018年度日常关联交易预计的议案	√
11	公司2017年度募集资金存放与实际使用情况的专项报告	√
12	关于公司使用暂时闲置资金委托理财的议案	√
13	关于新建珠海方正PCB高端智能化产业基地项目的议案	√
14	关于公司第十一届董事会董事变更的议案	√

本次股东大会还将听取《公司独立董事2017年度述职报告》。

1、各议案已披露的时间和披露媒体

公司分别于2018年1月18日召开的第十一届董事会2018年第一次会议、2018年4月26日召开的第十一届董事会2018年第三次会议和第十一届监事会2018年第二次会议审议通过了上述议案,详见公司分别于2018年1月20日、2018年4月28日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)的相关公告。公司将在本次股东大会召开前,在上海证券交易所网站登载《2017年年度股东大会会议资料》。

2、特别决议议案:议案8

3、对中小投资者单独计票的议案:议案1、议案6、议案7、议案8、议案10、议案12、议案14

4、涉及关联股东回避表决的议案:议案10

应回避表决的关联股东名称:北大方正信息产业集团有限公司

5、涉及优先股股东参与表决的议案:无

三、股东大会投票注意事项

(一)同一表决权通过现场、本所网络投票平台或其他方式重复进行表决的,以第一次投票结果为准。

(二)股东对所有议案均表决完毕才能提交。

(三)本所认可的其他网络投票系统的投票流程、方法和注意事项。

本次会议采用现场投票与网络投票相结合的表决方式,流通股股东可通过中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)上市公司股东大会网络投票系统对有关议案进行投票表决,现将网络投票事项通知如下:

1、本次股东大会网络投票起止时间为2018年6月11日15:00至2018年6月12日15:00。为有利于投票意见的顺利提交,请拟参加网络投票的投资者在上述时间内及早登录中国结算网络投票系统(www.chinaclear.cn)投票表决。

2、投资者办理网络投票业务前,需尽可能对相关证券账户提前开通中国结算网络服务功能,开通网络服务功能的方式如下:

第一步:访问中国结算网站(网址同上),点击右上角“注册”,填写姓名/名称、身份证件号码、深市证券账户号码、手机号码等信息,并设置网络用户名及网络服务密码;提交并注册成功后,投资者填注的手机号将收到一个8位数字校验号码;

第二步:在证券交易时间通过证券公司自助交易平台(如交易软件、电话委托交易系统等)以买入证券的方式,输入证券代码(369991,简称“中登认证”)、购买价格(密码激活为1.00元)、委托数量(短信收到的8位校验号码),提交报盘指令;

第三步:网络服务密码当日激活后,投资者可使用注册时填注或设置的证券账户号/网络用户名及密码登录中国结算网络投票系统,并可将与该深市账户同属于同一“一码通”账户下的沪市账户等其他证券账户进行网上关联,开通该“一码通”账户下全部证券账户的网络服务功能。

投资者除可通过上述方式开通网络服务功能外,也可选择至其托管券商营业部提交相关身份证明文件,申请通过统一账户平台开通中国结算网络服务功能;或选择先在中国结算网站注册后再携带相关身份证明文件至网上选定的证券公司营业部等机构办理身份认证开通网络服务功能。仅持有沪市账户的投资者仅可通过上述后两种方式开通网络服务功能。详细信息请登录中国结算网站(www.chinaclear.cn),点击“投资者服务专区－股东大会网络投票－业务办理－投资者业务办理”查询,或拨打热线电话4008058058了解更多内容。

3、同一表决权只能选择现场、网络投票方式中的一种。同一表决权出现重复表决的以第一次投票结果为准。

四、会议出席对象

(一)股权登记日收市后在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司登记在册的公司股东有权出席股东大会(具体情况详见下表),并可以以书面形式委托代理人出席会议和参加表决。该代理人不必是公司股东。

股份类别	股票代码	股票简称	股权登记日
A股	600601	方正科技	2018/6/1

(二)公司董事、监事和高级管理人员。

(三)公司聘请的律师。

(四)其他人员

五、会议登记方法

出席现场会议的股东持本人身份证、证券账户卡;被委托人持委托人证券账户卡、被委托人身份证、加盖印章或亲笔签名的委托书;法人股股东持营业执照复印件、持股凭证、法定代表人授权书、被委托人身份证出席。出席现场会议的股东请于2018年6月4日至6月6日的工作时间通过电话、传真、信函方式进行登记。

信函送达地址:上海市浦东南路360号新上海国际大厦36层

方正科技投资者关系管理部

邮编:200120

登记电话:021-58400030

登记传真:021-58408970

六、其他事项

1、电话:021-58400030;传真:021-58408970;

2、股东或股东代表参加现场会议的交通、食宿等费用自理。

特此公告。

方正科技集团股份有限公司董事会
2018年5月23日

附件1:授权委托书

授权委托书

方正科技集团股份有限公司:

兹委托 先生(女士)代表本单位(或本人)出席2018年6月12日召开的贵公司2017年年度股东大会,并代为行使表决权。

委托人持普通股数: 委托人股东帐户号:

序号	非累积投票议案名称	同意	反对	弃权
1	关于2017年度计提资产减值准备的议案			
2	公司2017年度董事会工作报告			
3	公司2017年度监事会工作报告			
4	公司2017年度财务决算报告			
5	公司2017年年度报告全文和摘要			
6	公司2017年度利润分配预案			
7	关于续聘公司2018年度审计机构的议案			
8	关于2018年度公司对控股子公司预计担保额度的议案			
9	关于2018年度公司向金融机构申请