

(上接B77版)
本基金以债券投资为主,最低为80%,股票等权益类资产配置比例最高为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%,以符合基金资产配置的总体要求。

本基金的业绩比较基准为:90%×上证国债指数收益率+10%×中证红利指数收益率。
本基金采用上证国债指数及中证红利指数衡量基金的投资业绩,其主要原因如下:

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。
中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市,现金股息率高、分红比较稳定,具有一定规模及流动性的股票作为样本股,能综合反映沪深证券市场高股息股票的整体状况和趋势。

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组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。
(一)宏观宏观经济环境(Macro Environment)
研究分析的主要指标包括:
1. GDP和工业增加值
2. 固定资产投资
3. 工业企业利润增长率
4. 货币供应量M2的增长率

我们衡量市场整体预期的主要指标是B/D和P/E,这两个指标有其自身的运行规律,都有价值回归的特征。当市场偏离真实价值太远时,都会出现回归的趋势,现实中我们总是无法判断市场真实价值是多少,而只会尝试用各种模型来描述其运行轨迹。
通过上述分析,我们运用的B/D、P/E运行模型能基本显示市场的重要拐点。
公司治理结构是影响证券市场发展的长期因素,这一因素虽然很难用具体指标来量化,但它的完善和提高,能促进企业的良性运作,最终在业绩和市场形象中得到体现。

国家宏观经济政策和监管政策对证券市场下一阶段的发展具有重要影响作用。
(四)资产配置策略
市场景气度是证券市场政策发挥作用的基础。在短期内,市场景气度决定国家政策,甚至宏观政策变化在证券市场可能得不到体现的重要基础。
资产配置:代表投资者对市场未来走势的看法。
估值指标:反映了市场上大多数分析师对市场的看法,能体现一定市场预期。

基金仓位:基金逐渐成为市场上一支有代表性的机构投资者队伍,其对股票的持仓比例反映了对市场的预期。
市场的特殊效应:每个市场会因为自身的特殊属性而反映出一定的效应。
投资决策委员会将每月召开例会,研究部将以上各层面提供分析报告,为投资决策提供参考依据,会议将形成对MVPS的评分,从而确定基金中各类资产的配置比例范围。

对于债券投资组合构建,本基金管理人将充分发挥在研究能力方面的优势,进行积极主动式管理,采用“自上而下”的方式结合我公司成功运用的MVPS模型对市场利率进行判断,分析信用分析、流动性分析和敏感性分析并获取债券类固本利值和类属配置比例,同时,将类属配置比例运用“自下而上”的固定收益分析方法对各个券种进行信用分析、久期分析及定价分析,分析估值和利率因素变化,根据分析结果挑选出优质个券,最后根据类属资产配置比例调整债券投资组合,通过综合运用久期调整、凸度调整、信用分析、波动性分析、品质选择、回购套利等策略提高债券组合回报率。

结合债券市场近期结构的历史数据,新增发行、回购及市场折溢价率,形成对收益率曲线变化的预期判断。当收益率曲线出现下行时采取积极的“哑铃”策略,高低点采取“子弹”策略。策略合理的哑铃策略已获得由收益率曲线变动带来的投资收益。

对于股票投资组合,本基金将重点关注具有持续分红特征的股票,该类股票一般是具有良好稳定的分红政策、持续良好的盈利及分红能力的上市公司。在筛选该类股票时采取以下策略:
- 在公司股票池中选取现金股息率(税后)的上市公司;

在此基础上筛选出预期未来3年连续税后分红)的上市公司形成备选库;
- 最后结合“行业龙头”分析法和ROA/ROE指标对备选库中股票进行深入分析,通过对盈利水平、现金流状况、股息率、P/E、P/B、持续分红能力和分红意愿的重点研究及实地考察筛选出股息率高、分红稳定且在行业中具有相对优势的优质上市公司股票。

本基金在确保与基金投资目标相一致的前提下,本着谨慎可控的原则,进行权益投资。
依据现代金融投资理论,计算证券的理论价值,结合对权证证券的基本面进行分析,寻找权益投资价值,同时结合对未来走势的判断,充分考虑权证的风险和收益特征,在严格控制风险的前提下,谨慎投资。

本基金采用上证国债指数及中证红利指数衡量基金的投资业绩,其主要原因如下:
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。
中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市,现金股息率高、分红比较稳定,具有一定规模及流动性的股票作为样本股,能综合反映沪深证券市场高股息股票的整体状况和趋势。

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在基金托管人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整前3个工作日内在中国证监会指定信息披露媒体上刊登公告。
本基金是债券型证券投资基金,属于具有中低风险的证券投资基金品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金,混合基金,高于货币型基金。

基金管理人承诺本基金的投资组合不存在虚假记载、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。
本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定,已于2018年10月9日复核了本投资组合报告的内容。

本投资组合报告所载数据截止2018年9月30日,本投资组合所列数据未经审计。
1. 报告期末按资产组合情况
2. 报告期末按行业分类的股票投资组合
(1) 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 5 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

对于债券投资组合构建,本基金管理人将充分发挥在研究能力方面的优势,进行积极主动式管理,采用“自上而下”的方式结合我公司成功运用的MVPS模型对市场利率进行判断,分析信用分析、流动性分析和敏感性分析并获取债券类固本利值和类属配置比例,同时,将类属配置比例运用“自下而上”的固定收益分析方法对各个券种进行信用分析、久期分析及定价分析,分析估值和利率因素变化,根据分析结果挑选出优质个券,最后根据类属资产配置比例调整债券投资组合,通过综合运用久期调整、凸度调整、信用分析、波动性分析、品质选择、回购套利等策略提高债券组合回报率。

结合债券市场近期结构的历史数据,新增发行、回购及市场折溢价率,形成对收益率曲线变化的预期判断。当收益率曲线出现下行时采取积极的“哑铃”策略,高低点采取“子弹”策略。策略合理的哑铃策略已获得由收益率曲线变动带来的投资收益。

对于股票投资组合,本基金将重点关注具有持续分红特征的股票,该类股票一般是具有良好稳定的分红政策、持续良好的盈利及分红能力的上市公司。在筛选该类股票时采取以下策略:
- 在公司股票池中选取现金股息率(税后)的上市公司;

在此基础上筛选出预期未来3年连续税后分红)的上市公司形成备选库;
- 最后结合“行业龙头”分析法和ROA/ROE指标对备选库中股票进行深入分析,通过对盈利水平、现金流状况、股息率、P/E、P/B、持续分红能力和分红意愿的重点研究及实地考察筛选出股息率高、分红稳定且在行业中具有相对优势的优质上市公司股票。

本基金在确保与基金投资目标相一致的前提下,本着谨慎可控的原则,进行权益投资。
依据现代金融投资理论,计算证券的理论价值,结合对权证证券的基本面进行分析,寻找权益投资价值,同时结合对未来走势的判断,充分考虑权证的风险和收益特征,在严格控制风险的前提下,谨慎投资。

本基金采用上证国债指数及中证红利指数衡量基金的投资业绩,其主要原因如下:
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。
中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市,现金股息率高、分红比较稳定,具有一定规模及流动性的股票作为样本股,能综合反映沪深证券市场高股息股票的整体状况和趋势。

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在基金托管人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整前3个工作日内在中国证监会指定信息披露媒体上刊登公告。

本基金是债券型证券投资基金,属于具有中低风险的证券投资基金品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金,混合基金,高于货币型基金。

在此基础上筛选出预期未来3年连续税后分红)的上市公司形成备选库;
- 最后结合“行业龙头”分析法和ROA/ROE指标对备选库中股票进行深入分析,通过对盈利水平、现金流状况、股息率、P/E、P/B、持续分红能力和分红意愿的重点研究及实地考察筛选出股息率高、分红稳定且在行业中具有相对优势的优质上市公司股票。

本基金在确保与基金投资目标相一致的前提下,本着谨慎可控的原则,进行权益投资。
依据现代金融投资理论,计算证券的理论价值,结合对权证证券的基本面进行分析,寻找权益投资价值,同时结合对未来走势的判断,充分考虑权证的风险和收益特征,在严格控制风险的前提下,谨慎投资。

本基金采用上证国债指数及中证红利指数衡量基金的投资业绩,其主要原因如下:
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。
中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市,现金股息率高、分红比较稳定,具有一定规模及流动性的股票作为样本股,能综合反映沪深证券市场高股息股票的整体状况和趋势。

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在基金托管人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整前3个工作日内在中国证监会指定信息披露媒体上刊登公告。

本基金是债券型证券投资基金,属于具有中低风险的证券投资基金品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金,混合基金,高于货币型基金。

基金管理人承诺本基金的投资组合不存在虚假记载、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。
本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定,已于2018年10月9日复核了本投资组合报告的内容。

本投资组合报告所载数据截止2018年9月30日,本投资组合所列数据未经审计。
1. 报告期末按资产组合情况
2. 报告期末按行业分类的股票投资组合
(1) 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 5 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

对于债券投资组合构建,本基金管理人将充分发挥在研究能力方面的优势,进行积极主动式管理,采用“自上而下”的方式结合我公司成功运用的MVPS模型对市场利率进行判断,分析信用分析、流动性分析和敏感性分析并获取债券类固本利值和类属配置比例,同时,将类属配置比例运用“自下而上”的固定收益分析方法对各个券种进行信用分析、久期分析及定价分析,分析估值和利率因素变化,根据分析结果挑选出优质个券,最后根据类属资产配置比例调整债券投资组合,通过综合运用久期调整、凸度调整、信用分析、波动性分析、品质选择、回购套利等策略提高债券组合回报率。

结合债券市场近期结构的历史数据,新增发行、回购及市场折溢价率,形成对收益率曲线变化的预期判断。当收益率曲线出现下行时采取积极的“哑铃”策略,高低点采取“子弹”策略。策略合理的哑铃策略已获得由收益率曲线变动带来的投资收益。

对于股票投资组合,本基金将重点关注具有持续分红特征的股票,该类股票一般是具有良好稳定的分红政策、持续良好的盈利及分红能力的上市公司。在筛选该类股票时采取以下策略:
- 在公司股票池中选取现金股息率(税后)的上市公司;

在此基础上筛选出预期未来3年连续税后分红)的上市公司形成备选库;
- 最后结合“行业龙头”分析法和ROA/ROE指标对备选库中股票进行深入分析,通过对盈利水平、现金流状况、股息率、P/E、P/B、持续分红能力和分红意愿的重点研究及实地考察筛选出股息率高、分红稳定且在行业中具有相对优势的优质上市公司股票。

本基金在确保与基金投资目标相一致的前提下,本着谨慎可控的原则,进行权益投资。
依据现代金融投资理论,计算证券的理论价值,结合对权证证券的基本面进行分析,寻找权益投资价值,同时结合对未来走势的判断,充分考虑权证的风险和收益特征,在严格控制风险的前提下,谨慎投资。

本基金采用上证国债指数及中证红利指数衡量基金的投资业绩,其主要原因如下:
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。
中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市,现金股息率高、分红比较稳定,具有一定规模及流动性的股票作为样本股,能综合反映沪深证券市场高股息股票的整体状况和趋势。

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在基金托管人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整前3个工作日内在中国证监会指定信息披露媒体上刊登公告。

本基金是债券型证券投资基金,属于具有中低风险的证券投资基金品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金,混合基金,高于货币型基金。

基金管理人承诺本基金的投资组合不存在虚假记载、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。
本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定,已于2018年10月9日复核了本投资组合报告的内容。

本投资组合报告所载数据截止2018年9月30日,本投资组合所列数据未经审计。
1. 报告期末按资产组合情况
2. 报告期末按行业分类的股票投资组合
(1) 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 5 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

对于债券投资组合构建,本基金管理人将充分发挥在研究能力方面的优势,进行积极主动式管理,采用“自上而下”的方式结合我公司成功运用的MVPS模型对市场利率进行判断,分析信用分析、流动性分析和敏感性分析并获取债券类固本利值和类属配置比例,同时,将类属配置比例运用“自下而上”的固定收益分析方法对各个券种进行信用分析、久期分析及定价分析,分析估值和利率因素变化,根据分析结果挑选出优质个券,最后根据类属资产配置比例调整债券投资组合,通过综合运用久期调整、凸度调整、信用分析、波动性分析、品质选择、回购套利等策略提高债券组合回报率。

结合债券市场近期结构的历史数据,新增发行、回购及市场折溢价率,形成对收益率曲线变化的预期判断。当收益率曲线出现下行时采取积极的“哑铃”策略,高低点采取“子弹”策略。策略合理的哑铃策略已获得由收益率曲线变动带来的投资收益。

对于股票投资组合,本基金将重点关注具有持续分红特征的股票,该类股票一般是具有良好稳定的分红政策、持续良好的盈利及分红能力的上市公司。在筛选该类股票时采取以下策略:
- 在公司股票池中选取现金股息率(税后)的上市公司;

在此基础上筛选出预期未来3年连续税后分红)的上市公司形成备选库;
- 最后结合“行业龙头”分析法和ROA/ROE指标对备选库中股票进行深入分析,通过对盈利水平、现金流状况、股息率、P/E、P/B、持续分红能力和分红意愿的重点研究及实地考察筛选出股息率高、分红稳定且在行业中具有相对优势的优质上市公司股票。

本基金在确保与基金投资目标相一致的前提下,本着谨慎可控的原则,进行权益投资。
依据现代金融投资理论,计算证券的理论价值,结合对权证证券的基本面进行分析,寻找权益投资价值,同时结合对未来走势的判断,充分考虑权证的风险和收益特征,在严格控制风险的前提下,谨慎投资。

本基金采用上证国债指数及中证红利指数衡量基金的投资业绩,其主要原因如下:
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。
中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市,现金股息率高、分红比较稳定,具有一定规模及流动性的股票作为样本股,能综合反映沪深证券市场高股息股票的整体状况和趋势。

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
5. 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
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十名资产支持证券投资明细
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五名贵金属投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十五名权证投资明细
9. 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
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。

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。
(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。

Table with 5 columns: 序号, 名称, 公允价值(元)

12. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
13. 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不存在流通受限情况。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的投资净值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请仔细阅读本基金的招募说明书。
本基金合同生效日为2008年9月26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:

Table with 6 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 业绩比较基准增长率②, 净值比较基准差③, ①-③, ②-④

泰达宏利集利债券C
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券A
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券B
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券D
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券E
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券F
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券G
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券H
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券I
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券J
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券K
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券L
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券M
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券N
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券O
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

Table with 6 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 业绩比较基准增长率②, 净值比较基准差③, ①-③, ②-④

泰达宏利集利债券C
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券A
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券B
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券D
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券E
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券F
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券G
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券H
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券I
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券J
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券K
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券L
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券M
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券N
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券O
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券P
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券Q
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券R
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券S
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券T
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券U
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券V
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

泰达宏利集利债券W
阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准增长率② 净值比较基准差③ ①-③ ②-④

4. 因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等);
5. 基金合同生效以后的信息披露费用;
6. 基金份额持有人大会费用;
7. 基金合同生效以后的会计师事务所和律师费;
8. 基金的资金汇划费用;
9. 按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1. 与基金运作有关的费用
(1) 基金管理人的管理费
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.6%的年费率计提。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、休息日等,支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费
在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
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、休息日等,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其他有关法律法规及相关协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。
2. 与基金销售有关的费用
(1) 申购费
本基金申购费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金份额申购与赎回”一章。

(2) 赎回费
本基金赎回费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金份额的申购与赎回”一章。
(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按前一日C类基金资产净值的0.4%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×年销售服务费率÷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个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

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专项说明。
(三) 不列入基金费用的项目
基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用不列入基金费用。

基金合同生效前所发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用,不得从基金财产中列支。
(四) 基金管理费、托管费和销售服务费的调整
本基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况协商调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率等相关费率或变更收费模式。降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率等相关费率或在提高整体费率水平的前提下变更收费模式,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

基金管理人必须最迟于新的费率或收费模式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
(五) 基金赎回
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、招募说明书更新部分说明
本招募说明书根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,对本基金招募说明书进行了更新,主要内容如下:
(一) 在“重要提示”中,更新了招募说明书所载内容,有关财务数据均标注为报告期数据。
(二) “二、基金管理人”中对董事会成员、基金经理等内容进行了变更。
(三) 更新了“四、基金托管人”中的内容。
(四) “五、相关服务机构”部分对代销机构信息进行了变更。
(五) “六、基金的投资”部分对投资组合报告内容更新至2018年6月30日,新增了“流动性受限资产的投资”部分对基金业绩更新至2018年6月30日,并更新了历史走势图。
(七) 更新了“二十二、其他应披露事项”中的内容。

泰达宏利基金管理有限公司
2018年11月9日

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

长春高新技术产业(集团)股份有限公司(以下简称“公司”)第三届董事会第二十九次会议,2017年度股东大会审议通过了《关于2018年继续使用部分闲置自有资金购买理财产品进行现金管理的议案》,第三届董事会第三十二次会议,2018年第一次临时股东大会审议通过了《关于2018年继续使用部分闲置自有资金进行保本低风险现金管理的议案》。

根据现金管理情况统筹安排,公司继续使用部分闲置募集资金及自有资金在交通银行股份有限公司吉林分行、兴业银行股份有限公司长春分行购买了现金理财产品,具体情况如下:
一、公司使用部分闲置募集资金购买理财产品的实施情况
2018年11月7日,公司使用部分暂时闲置募集资金在交通银行股份有限公司吉林分行购买理财产品:

1. 产品名称:交通银行稳健增利结构性存款90天
2. 产品类型:结构性存款
3. 风险提示:本产品可能面临的风险主要包括政策风险、流动性风险、信息传递风险、不可抗力及意外事件风险等。

4. 预期理财收益率:4.10%(年化)(已扣除销售手续费、托管费等相关费用)
5. 产品期限:90天(产品成立日:2018年11月8日)
6. 认购金额:5,000万元人民币
7. 关联关系说明:公司与交通银行股份有限公司吉林分行无关联关系。

二、公司使用部分暂时闲置自有资金购买理财产品的实施情况
2018年11月7日,公司使用部分暂时闲置自有资金在兴业银行股份有限公司长春分行购买理财产品:
1. 产品名称:兴业银行企业金融结构性存款(封闭式)
2. 产品类型:保本浮动收益型

3. 风险提示:本产品可能面临的风险主要包括利率风险、提前终止风险、法律风险等。
4. 预期理财收益率:4.09%(年化)(已扣除销售手续费、托管费等相关费用)
5. 产品期限:120天(产品成立日:2018年11月7日)
6. 认购金额:10,000万元人民币
7. 关联关系说明:公司与兴业银行股份有限公司长春分行无关联关系。

三、公告日前十二个月内使用闲置募集资金和自有资金购买理财产品情况

Table with 10 columns: 受托人名称, 委托方, 资金来源, 是否关联交易, 产品类型, 委托理财金额(万元), 起始日期, 终止日期, 实际收回金额(万元), 实际损益金额(万元)

吉林九台农村商业银行股份有限公司敦化支行 华夏 自有资金 否 保本浮动型 1,000 2017-07-25 2017-12-14 1,000 16.92

吉林九台农村商业银行股份有限公司敦化支行 华夏 自有资金 否 保本浮动型 1,000 2017-07-25 2017-12-14 1,000 16.92

吉林九台农村商业银行股份有限公司敦化支行 华夏 自有资金 否 保本浮动型 1,000 2017-07-27 2017-12-12 1,000 15.50

吉林九台农村商业银行股份有限公司敦化支行 华夏 自有资金 否 保本浮动型 4,000 2017-08-01 2017-12-21 4,000 67.69

兴业银行股份有限公司 公司 募集资金 否 保本浮动收益型 20,000 2017-09-20 2017-12-20 20,000 204.44

证券代码:000661 证券简称:长春高新 公告编号:2018-101

长春高新技术产业(集团)股份有限公司
关于使用部分暂时闲置募集资金和闲置自有资金进行现金管理的进展公告

交通银行股份有限公司 公司 募集资金 否 保本浮动收益型 10,000 2017-09-30 2018-01-20 10,000 145.86

兴业银行股份有限公司 公司 自有资金 否 保本浮动收益型 5,000 2017-12-20 2018-03-21 5,000 59.09

兴业银行股份有限公司 公司 自有资金 否 保本浮动收益型 5,000 2017-12-21 2018-03-21 5,000 58.44

兴业银行股份有限公司 公司 自有资金 否 保本浮动收益型 20,000 2017-12-21 2018-03-21 20,000 235.75

兴业银行股份有限公司 公司 募集资金 否 保本浮动收益型 20,000 2017-12-21 2018-03-21 20,000 235.75

兴业银行股份有限公司 公司 募集资金 否 保本浮动收益型 13,000 2017-12-21 2018-03-21 13,000 151.94

吉林九台农村商业银行股份有限公司敦化支行 华夏 自有资金 否 保本浮动型 1,000