

(上接B90版)

Table with 2 columns: 序号 and 名称. Lists financial advisors and their details.

2.场内销售机构
场内将通过深圳证券交易所具有基金销售业务资格并经过深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位销售。

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

3.基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
2.法律登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号

进行同步调整时,基金管理人将对投资组合进行优化,尽量降低跟踪误差。
在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不得超过4%。

2.债券投资策略
基于流动性管理的需要,本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和国债,债券投资的目标是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。

3.股指期货投资策略
本基金股指期货投资将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金投资股指期货的,基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

4.基金管理人运用基金财产的决策程序
(1) 投资决策
1) 有关法律、法规、基金合同等的有关规定;
2) 经济运行态势和证券市场走势。

(2) 投资管理体制
本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定资产配置的整体计划与投资原则;确定基金的投资策略和在不同阶段的投资资产配置比例,包括大类资产配置比例(股票、转债及其他债券)以及各相关资产内部行业比例等;审批基金经理提出的投资组合计划和重大单项投资。基金经理根据投资决策委员会的决策,负责投资组合的构建、调整 and 日常管理等工作。

(3) 投资程序
1) 金融工程部运用风险监测模型以及各种风险跟踪指标,结合国内外研究报告,对市场预期风险和投资组合风险进行风险测算与归因分析,提出此出研究分析报告。

2) 投资决策委员会依据金融工程部、研究开发部等部门提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,进行基金投资管理的日常工作。
3) 基金经理以基金投资合同、投资决策委员会决议、金融工程部和研究开发部研究报告等为决策依据建立基金的投资组合。

4) 交易管理部根据基金经理下达的交易指令制定交易策略,完成具体证券品种的交易。
5) 金融工程部等部门根据市场变化定期和不定期对基金进行投资绩效评价,并提供相关绩效评估报告。稽核监察部对投资计划的执行进行日常监督和实时风险控制。

6) 基金经理结合个券的基本面情况、流动性状况、基金申购赎回的现金流量情况、金融工程部和稽核监察部的绩效评价报告以及对各种风险的监控和评估结果,对投资组合进行监控和调整。
7) 本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序,并在招募说明书中更新。

第九部分 业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为: 沪深TMT50指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权,或标的指数由其他指数替代,或由指数编制方法的变更等事项导致本基金管理人认为标的指数不宜继续作为跟踪标的,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,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,在对新的主要基金资产的标的指数、业绩比较基准和基金名称、若变更标的指数,业绩比较基准对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制方法变更、指数更名等事项,则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。若变更业绩比较基准,标的指数的选择及本基金投资组合投资策略的实质性变更,则基金管理人就变更业绩比较基准、标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案。

第十部分 风险收益特征
本基金为股票型指数基金,但由于采取了基金份额分级的结构设计,不同的基金份额净值有不同的风险收益特征。
运作过程中,本基金共有三只基金份额,分别为国泰TMT50份额、TMT50A份额、TMT50B份额,其中国泰TMT50份额为普通的股票型基金份额,具有较高风险回报、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币型基金;TMT50A份额的预期风险和预期收益较TMT50B份额采用了杠杠式的结构,预期风险和预期收益有所放大,将高于普通的股票型基金。

第十一部分 基金投资组合报告
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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月7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6月30日,本报告所列财务数据未经审计。

Table with 2 columns: 单位:人民币万元 and 2018年9月30日(未经审计) / 2017年12月31日(经审计).

Table with 2 columns: 单位:人民币万元 and 2018年9月30日(未经审计) / 2017年12月31日(经审计).

Table with 2 columns: 单位:人民币万元 and 2018年9月30日(未经审计) / 2017年12月31日(经审计).

Table with 2 columns: 单位:人民币万元 and 2018年9月30日(未经审计) / 2017年12月31日(经审计).

Table with 2 columns: 单位:人民币万元 and 2018年9月30日(未经审计) / 2017年12月31日(经审计).

Table with 2 columns: 单位:人民币万元 and 2018年9月30日(未经审计) / 2017年12月31日(经审计).

Table with 2 columns: 单位:人民币万元 and 2018年9月30日(未经审计) / 2017年12月31日(经审计).

Table with 2 columns: 单位:人民币万元 and 2018年9月30日(未经审计) / 2017年12月31日(经审计).

Table with 2 columns: 单位:人民币万元 and 2018年9月30日(未经审计) / 2017年12月31日(经审计).

Table with 2 columns: 单位:人民币万元 and 2018年9月30日(未经审计) / 2017年12月31日(经审计).

Table with 2 columns: 单位:人民币万元 and 2018年9月30日(未经审计) / 2017年12月31日(经审计).

1.报告期末基金投资组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) / 占基金总资产的比例(%)

2.报告期末按行业分类的股票投资组合
(1) 积极投资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(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元) / 占基金资产净值比例(%)

(2) 指数投资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(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元) / 占基金资产净值比例(%)

3.期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
(1) 期末指数投资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

Table with 5 columns: 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(%)

(2) 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

注:2018年3月26日为基金合同生效日
第十一部分 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

二、基金费用的计提方法
1. 基金管理人的管理费
H=E×1.0%×当年天数

三、其他费用
基金托管人的托管费;
标的指数使用许可费;
基金上市费及年费;
《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

四、现场会议登记方法
1.登记地点:2018年11月12日上午9:00至12:00,下午1:00至4:00;
2.登记时间:福州市晋安区岳峰镇横屿路号东二环泰禾城市广场2号楼29层证券事务部;

五、网络投票的具体操作流程
本公司股东大会,公司将提供网络投票平台,公司股东可以通过深交所交易系统和互联网投票系统参与投票。

六、其他事项
1.与会股东食宿及交通费用自理。
2.联系地址:福州市晋安区岳峰镇横屿路号东二环泰禾城市广场2号楼29层证券事务部

七、授权委托书
本人/本企业向福州太千大有限公司(个人)出席泰禾集团股份有限公司2018年第十二次临时股东大会,并代为行使表决权。

八、会议议程
1.审议《关于向福州太千大有限公司(个人)出席泰禾集团股份有限公司2018年第十二次临时股东大会,并代为行使表决权。

九、其他事项
1.与会股东食宿及交通费用自理。
2.联系地址:福州市晋安区岳峰镇横屿路号东二环泰禾城市广场2号楼29层证券事务部

十、授权委托书
本人/本企业向福州太千大有限公司(个人)出席泰禾集团股份有限公司2018年第十二次临时股东大会,并代为行使表决权。

十一、会议议程
1.审议《关于向福州太千大有限公司(个人)出席泰禾集团股份有限公司2018年第十二次临时股东大会,并代为行使表决权。

十二、其他事项
1.与会股东食宿及交通费用自理。
2.联系地址:福州市晋安区岳峰镇横屿路号东二环泰禾城市广场2号楼29层证券事务部

十三、授权委托书
本人/本企业向福州太千大有限公司(个人)出席泰禾集团股份有限公司2018年第十二次临时股东大会,并代为行使表决权。

十四、会议议程
1.审议《关于向福州太千大有限公司(个人)出席泰禾集团股份有限公司2018年第十二次临时股东大会,并代为行使表决权。

十五、其他事项
1.与会股东食宿及交通费用自理。
2.联系地址:福州市晋安区岳峰镇横屿路号东二环泰禾城市广场2号楼29层证券事务部

1.报告期末基金投资组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) / 占基金总资产的比例(%)

2.报告期末按行业分类的股票投资组合
(1) 积极投资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(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元) / 占基金资产净值比例(%)

(2) 指数投资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(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元) / 占基金资产净值比例(%)

3.期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
(1) 期末指数投资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

Table with 5 columns: 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(%)

(2) 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

注:2018年3月26日为基金合同生效日
第十二部分 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

二、基金费用的计提方法
1. 基金管理人的管理费
H=E×1.0%×当年天数

三、其他费用
基金托管人的托管费;
标的指数使用许可费;
基金上市费及年费;

四、现场会议登记方法
1.登记地点:2018年11月12日上午9:00至12:00,下午1:00至4:00;
2.登记时间:福州市晋安区岳峰镇横屿路号东二环泰禾城市广场2号楼29层证券事务部;

五、网络投票的具体操作流程
本公司股东大会,公司将提供网络投票平台,公司股东可以通过深交所交易系统和互联网投票系统参与投票。

六、其他事项
1.与会股东食宿及交通费用自理。
2.联系地址:福州市晋安区岳峰镇横屿路号东二环泰禾城市广场2号楼29层证券事务部

七、授权委托书
本人/本企业向福州太千大有限公司(个人)出席泰禾集团股份有限公司2018年第十二次临时股东大会,并代为行使表决权。

八、会议议程
1.审议《关于向福州太千大有限公司(个人)出席泰禾集团股份有限公司2018年第十二次临时股东大会,并代为行使表决权。

九、其他事项
1.与会股东食宿及交通费用自理。
2.联系地址:福州市晋安区岳峰镇横屿路号东二环泰禾城市广场2号楼29层证券事务部

十、授权委托书
本人/本企业向福州太千大有限公司(个人)出席泰禾集团股份有限公司2018年第十二次临时股东大会,并代为行使表决权。

十一、会议议程
1.审议《关于向福州太千大有限公司(个人)出席泰禾集团股份有限公司2018年第十二次临时股东大会,并代为行使表决权。

十二、其他事项
1.与会股东食宿及交通费用自理。
2.联系地址:福州市晋安区岳峰镇横屿路号东二环泰禾城市广场2号楼29层证券事务部

十三、授权委托书
本人/本企业向福州太千大有限公司(个人)出席泰禾集团股份有限公司2018年第十二次临时股东大会,并代为行使表决权。

十四、会议议程
1.审议《关于向福州太千大有限公司(个人)出席泰禾集团股份有限公司2018年第十二次临时股东大会,并代为行使表决权。

十五、其他事项
1.与会股东食宿及交通费用自理。
2.联系地址:福州市晋安区岳峰镇横屿路号东二环泰禾城市广场2号楼29层证券事务部