

# 泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资 基金 2016 年半年度报告摘要

2016 年 6 月 30 日

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

送出日期：2016 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司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。本半年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2016 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利品质生活混合
基金主代码	162211
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 4 月 9 日
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
报告期末基金份额总额	38,019,936.71 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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关注生活品质。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。
投资策略	<p>1. 使用 MVPS 模型进行战略性资产配置策略，确定股票债券比例。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。</p> <p>2. 股票投资策略。本基金采用双主线策略，对横纵交点进行重点的定性分析和定量分析，构建实际股票投资组合。横向上，利用“行业文档”分析方法，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；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。</p> <p>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。</p>
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。
风险收益特征	本基金属于较高风险的混合型证券投资基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰达宏利基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈沛	田青

	联系电话	010—66577808	010-67595096
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-69-88888	010-67595096
传真		010—66577666	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http:// www.mfcteda.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-11,065,223.86
本期利润	-9,728,655.59
加权平均基金份额本期利润	-0.1872
本期基金份额净值增长率	-18.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0470
期末基金资产净值	36,233,506.59
期末基金份额净值	0.953

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益

2. 所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字

3. 对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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

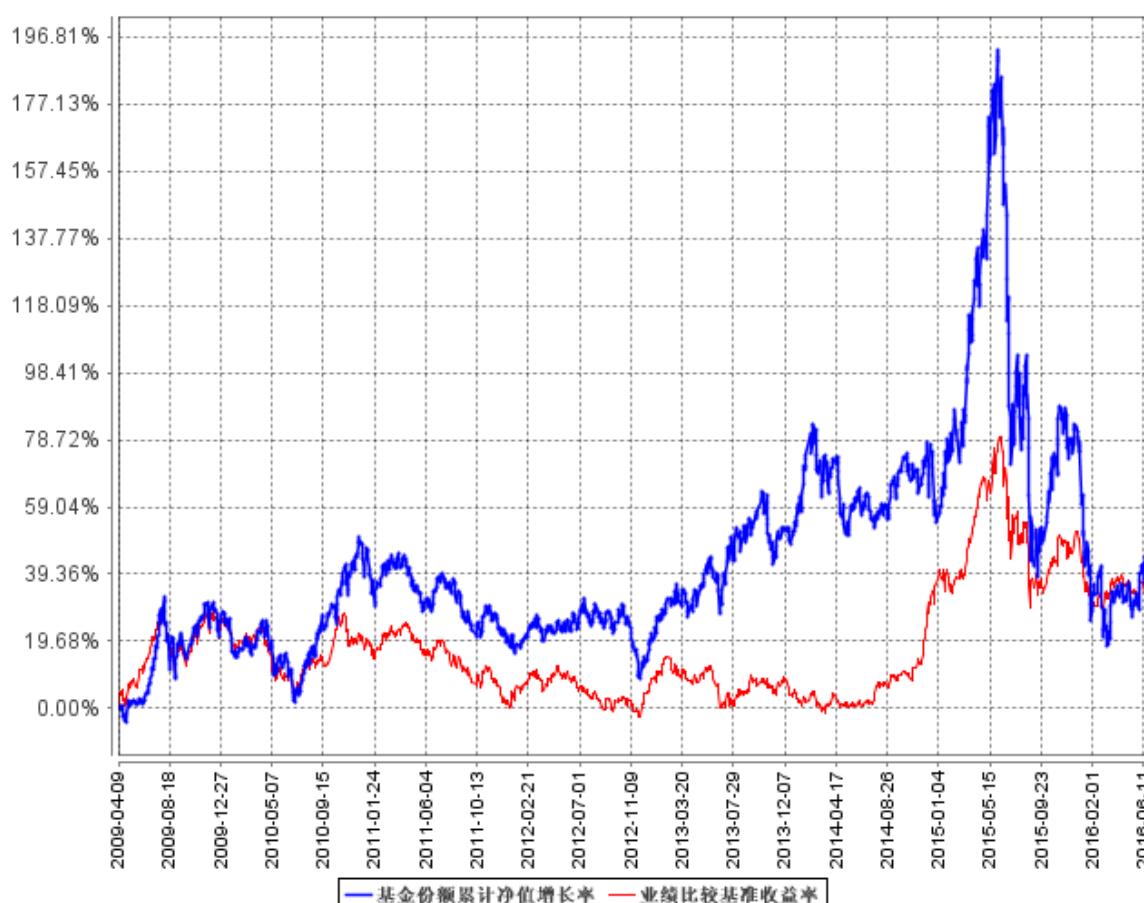
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.30%	1.79%	-0.15%	0.59%	5.45%	1.20%

过去三个月	6.12%	1.61%	-0.87%	0.61%	6.99%	1.00%
过去六个月	-18.55%	2.39%	-8.40%	1.10%	-10.15%	1.29%
过去一年	-35.30%	2.70%	-15.87%	1.38%	-19.43%	1.32%
过去三年	9.46%	2.11%	34.87%	1.10%	-25.41%	1.01%
自基金合同生效起至今	42.64%	1.62%	36.33%	1.00%	6.31%	0.62%

注：本基金的业绩比较基准： $60\% \times$  沪深 300 指数收益率 $+40\% \times$  上证国债指数收益率。沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所中选取 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。

### 3.2.2 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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。截至报告期末本公司股东及持股比例分别为：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%。

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在内的三十多只证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
庄腾飞	本基金基金经理, 首席策略分析师	2015 年 5 月 14 日	-	6	经济学硕士，2010 年 7 月加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于研究部，负责宏观经济、策略研究及金融、地产行业研

					究，曾先后担任助理研究员、研究员、高级研究员等职务，现任基金经理兼首席策略分析师；具备 6 年基金从业经验，6 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	---

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度和流程，并严格执行制度的规定。在投资管理活动中，本基金管理人公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会；严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离；在交易环节实行集中交易制度，并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数量统计、分析。在本报告期内，没有发生利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控，风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估，向公司风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。监察稽核部定期对异常交易制度的执行和控制工作进行稽核。本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况共出现了 2 次。2 次涉及的投资组合一方均为按照量化策略进行投资，虽然买卖股票量少，但由于个股流动性较差，交易量小，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%，未发现异常。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年一季度国内经济相对平稳，伴随春节后的开工旺季和流动性宽松的环境，基本面出现了逐步改善的状况。2016 年二季度初国内经济出现了房地产热销、大宗商品期货价格快速上行和通胀水平略有回升的状态，管理层通过官方媒体权威人士表态的方式调整市场预期，A 股市场对下半年经济预期向下修正，实体经济高频数据也有所放缓，社会融资总量累计同比增速也出现回落，与此同时，货币政策态度取向也趋于中性。在总需求疲弱的状态下，整体资本市场更加注重内生业绩高增长的板块和行业。

2016 年一季度的股票市场可以主要分为两大阶段，第一阶段是，1 月份出现了大幅度快速下跌，主要与市场熔断和市场经过反弹后估值偏高有关。第二阶段是，3 月 16 日后市场的持续反弹，更多源于美联储 3 月议息会议鸽派表态和全球原油反弹推动了全球风险资产的反弹。而 2016 年二季度的股票市场相对一季度较为平稳，在海外美联储加息预期下降的阶段，市场都会出现比较明显的反弹。从 5 月份开始，市场的结构性行情在存量资金的推动下出现了比较强的赚钱效应，从而强化了结构性的趋势。市场的逻辑是在目前国内下游普遍疲弱的背景下，持续地去寻找高景气度的行业，在里面寻找业绩确定性增长的公司。

在一季度的操作中，基金组合重点配置了养殖、传媒文化、金融和房地产等板块，重点把握了经济转型趋势上的产业机会和结构性涨价的细分子行业的机会。在二季度的操作中，基金组合基于自身基金契约对行业权重的要求，重点配置了银行、非银行金融、家电家装、农业（养殖和饲料）、食品饮料、电力和电池材料及锂资源回收等板块，重点把握了经济转型趋势上的产业机会和结构性涨价的细分子行业的机会。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 0.953 元，本报告期份额净值增长率为-18.55%，同期业绩比较基准增长率为-8.40%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期全球市场，包括中国，都出现了黄金、国债、股票三类大类资产同时大幅度上涨的情形，这反映出投资机构之间的高度分歧，也说明市场依然受到过去三年一直延续的逻辑推动，即宽松的流动性。而着眼未来 6-12 个月，全球的机构投资者是在下调欧盟、英国的经济增长预期的。全球正在进入一个高度不确定的阶段，给全球经济的增长带来压力。

对于中国的 A 股市场，应对这样的“超低利率+高不确定”大类资产环境趋势，赚估值的钱



很难，但赚业绩的钱是重要的方向，我们有两条思路：第一，配置业绩高增长的确切品种，尤其是 2017 年确定性高增长的板块。因为 2016 年市场的核心焦点是业绩增长，这是今年最大的稀缺品。品种包括新材料行业、家装厨电、养殖。第二，配置具备高价值边际、基本面趋势好转的大消费蓝筹股，这类品种在货币贬值的过程中具备核心资源价值，某种程度上具有贵金属类似的金融属性，同时基本面趋势好转的品种会匹配涨价现象。如食品饮料中的白酒、中药、部分消费行业龙头蓝筹。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的副总经理负责，成员包括督察长、投资总监、研究部、固定收益部、金融工程部、风险管理部、基金运营部的相关人员，均具有丰富的专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力。

基金经理参与估值委员会对相关停牌品种估值的讨论，发表相关意见和建议，但涉及停牌品种的基金经理不参与最终的投票表决。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同及基金的实际运作情况，本基金于本报告期内未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

1. 本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
2. 本报告期内本基金出现连续二十个工作日但不足六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职

尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	1,652,649.39	3,474,341.80
结算备付金	248,725.94	237,643.12
存出保证金	25,603.13	57,937.45
交易性金融资产	34,712,150.26	50,776,562.68
其中：股票投资	28,961,602.66	42,157,642.68
基金投资	-	-
债券投资	5,750,547.60	8,618,920.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	96,254.48	148,074.78
应收股利	-	-
应收申购款	25,653.40	2,404.79
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-

资产总计	36,761,036.60	54,696,964.62
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016年6月30日</b>	<b>2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	141,450.96	749,362.49
应付赎回款	58,284.97	29,808.03
应付管理人报酬	65,601.50	69,890.47
应付托管费	10,933.57	11,648.39
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	115,620.49	108,609.87
应交税费	81,360.00	81,360.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	54,278.52	84,062.95
负债合计	527,530.01	1,134,742.20
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	38,019,936.71	45,779,970.22
未分配利润	-1,786,430.12	7,782,252.20
所有者权益合计	36,233,506.59	53,562,222.42
负债和所有者权益总计	36,761,036.60	54,696,964.62

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.953 元，基金份额总额 38,019,936.71 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 6月30日
<b>一、收入</b>	-8,932,202.94	61,549,548.01
1.利息收入	100,504.32	651,137.65
其中：存款利息收入	13,740.58	41,318.93
债券利息收入	86,763.74	596,448.54
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	13,370.18
其他利息收入	-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）	-10,407,341.83	62,000,338.95
其中：股票投资收益	-10,467,090.78	61,658,567.40
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-22,908.99	165,729.99
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	82,657.94	176,041.56
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,336,568.27	-1,605,895.05
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	38,066.30	503,966.46
<b>减：二、费用</b>	<b>796,452.65</b>	<b>2,968,994.26</b>
1. 管理人报酬	351,307.05	1,030,085.32
2. 托管费	58,551.17	171,680.88
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	310,432.94	1,527,298.37
5. 利息支出	855.07	23,289.63
其中：卖出回购金融资产支出	855.07	23,289.63
6. 其他费用	75,306.42	216,640.06
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-9,728,655.59</b>	<b>58,580,553.75</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-9,728,655.59</b>	<b>58,580,553.75</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	45,779,970.22	7,782,252.20	53,562,222.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	-9,728,655.59	-9,728,655.59

期净利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-7,760,033.51	159,973.27	-7,600,060.24
其中:1.基金申购款	26,927,173.51	-3,002,526.24	23,924,647.27
2.基金赎回款	-34,687,207.02	3,162,499.51	-31,524,707.51
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	38,019,936.71	-1,786,430.12	36,233,506.59
	上上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
项目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	233,707,381.15	9,852,642.84	243,560,023.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	58,580,553.75	58,580,553.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-189,385,162.99	-47,449,900.12	-236,835,063.11
其中:1.基金申购款	223,061,000.34	53,580,867.02	276,641,867.36
2.基金赎回款	-412,446,163.33	-101,030,767.14	-513,476,930.47
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	44,322,218.16	20,983,296.47	65,305,514.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

\_\_\_\_\_  
刘建

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
傅国庆

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
王泉

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”，原泰达荷银品质生活灵活配置混合型证券投资基金)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]第 1248 号《关于核准泰达荷银品质生活灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由泰达荷银基金管理有限公司(于 2010 年 3 月 9 日更名为泰达宏利基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达荷银品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,294,571,230.82 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2009)第 063 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰达荷银品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2009 年 4 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,294,884,284.12 份基金份额，其中认购资金利息折合 313,053.30 份基金份额。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

2010 年 3 月 17 日，经基金管理人董事会批准、报中国证监会同意，本基金更名为泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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。其中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%。本基金的业绩比较基准为： $60\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 40\% \times \text{上证国债指数收益率}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司于 2016 年 8 月 29 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策的变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计的变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》[适用于 CEF]/财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》[适用于 OEF]、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期没有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金



本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	351,307.05	1,030,085.32
其中：支付销售机构的客户维护费	48,119.05	176,137.54

注：支付基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	58,551.17	171,680.88

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

## 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均无与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

## 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。

### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

## 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国建设银行	1,652,649.39	11,444.28	8,150,236.91

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.9 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603016	新宏泰	2016 年 6 月 23 日	2016 年 7 月 1 日	新股流通受限	8.49	8.49	431	3,659.19	3,659.19	-
002805	丰元股份	2016 年 6 月 29 日	2016 年 7 月 7 日	新股流通受限	5.80	5.80	604	3,503.20	3,503.20	-
300520	科大国创	2016 年 6 月 30 日	2016 年 7 月 8 日	新股流通受限	10.05	10.05	348	3,497.40	3,497.40	-

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000638	万方发展	2016 年 1 月 5 日	重大事项	23.65	2016 年 7 月 25 日	24.75	75,000	1,839,702.00	1,773,750.00	-

000002	万 科 A	2015 年 12 月 18 日	重大 事项	18.20	2016 年 7 月 4 日	21.99	29,000	546,092.00	527,800.00	-
000547	航天 发展	2016 年 4 月 19 日	重大 事项	15.36	-	-	31,300	499,548.00	480,768.00	-
601611	中国 核建	2016 年 6 月 30 日	临时 停牌	20.92	2016 年 7 月 1 日	23.01	1,361	4,722.67	28,472.12	-

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	28,961,602.66	78.78
	其中：股票	28,961,602.66	78.78
2	固定收益投资	5,750,547.60	15.64
	其中：债券	5,750,547.60	15.64
	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	1,901,375.33	5.17
7	其他各项资产	147,511.01	0.40
8	合计	36,761,036.60	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	19,738,819.11	54.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	28,472.12	0.08
F	批发和零售业	1,773,750.00	4.90
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	4,368,876.29	12.06
J	金融业	2,411,368.92	6.66
K	房地产业	527,800.00	1.46
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	6,708.70	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	105,807.52	0.29
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	28,961,602.66	79.93

## 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

## 7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300073	当升科技	27,445	1,837,168.30	5.07
2	000638	万方发展	75,000	1,773,750.00	4.90
3	002340	格林美	201,263	1,765,076.51	4.87
4	300296	利亚德	52,192	1,652,398.72	4.56
5	603799	华友钴业	41,480	1,543,056.00	4.26
6	002108	沧州明珠	56,532	1,464,178.80	4.04
7	300377	赢时胜	28,579	1,414,374.71	3.90
8	002341	新纶科技	65,543	1,411,140.79	3.89
9	601688	华泰证券	66,999	1,267,621.08	3.50
10	600570	恒生电子	18,457	1,232,373.89	3.40

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本公司网站的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601998	中信银行	2,676,590.00	5.00
2	600030	中信证券	2,646,822.00	4.94
3	002709	天赐材料	2,558,867.50	4.78
4	002340	格林美	2,488,964.00	4.65
5	601688	华泰证券	2,421,499.00	4.52
6	002108	沧州明珠	2,383,870.83	4.45
7	603799	华友钴业	2,352,313.00	4.39
8	002229	鸿博股份	2,341,049.00	4.37
9	300296	利亚德	2,294,287.85	4.28
10	601198	东兴证券	2,196,913.00	4.10
11	300073	当升科技	2,177,908.00	4.07
12	300113	顺网科技	2,111,029.00	3.94

13	300377	赢时胜	2,044,870.10	3.82
14	002341	新纶科技	1,931,069.00	3.61
15	600036	招商银行	1,924,370.00	3.59
16	000983	西山煤电	1,922,919.00	3.59
17	300409	道氏技术	1,890,539.00	3.53
18	002070	众和股份	1,860,934.00	3.47
19	600570	恒生电子	1,738,150.00	3.25
20	300329	海伦钢琴	1,719,746.00	3.21
21	601601	中国太保	1,705,116.00	3.18
22	002655	共达电声	1,642,424.00	3.07
23	002590	万安科技	1,613,861.00	3.01
24	002079	苏州固锝	1,488,553.00	2.78
25	603898	好莱客	1,417,454.00	2.65
26	002355	兴民钢圈	1,414,313.00	2.64
27	300386	飞天诚信	1,283,119.00	2.40
28	002284	亚太股份	1,281,808.00	2.39
29	000567	海德股份	1,280,933.00	2.39
30	300007	汉威电子	1,145,604.00	2.14
31	002001	新 和 成	1,143,759.00	2.14
32	000001	平安银行	1,121,819.00	2.09
33	000807	云铝股份	1,098,949.97	2.05

注：表中“买入金额”为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002709	天赐材料	3,857,802.38	7.20
2	601998	中信银行	3,161,656.90	5.90
3	601198	东兴证券	2,706,607.51	5.05
4	600030	中信证券	2,375,141.16	4.43
5	002229	鸿博股份	2,374,512.21	4.43
6	002407	多氟多	2,152,362.72	4.02
7	600036	招商银行	1,985,357.02	3.71
8	000563	陕国投 A	1,863,061.76	3.48
9	000402	金 融 街	1,850,667.66	3.46
10	300073	当升科技	1,820,078.38	3.40

11	601601	中国太保	1,745,562.03	3.26
12	002070	众和股份	1,720,628.02	3.21
13	601336	新华保险	1,679,507.38	3.14
14	000983	西山煤电	1,603,696.16	2.99
15	300113	顺网科技	1,558,558.28	2.91
16	002108	沧州明珠	1,529,100.01	2.85
17	002284	亚太股份	1,431,991.36	2.67
18	603898	好莱客	1,425,887.00	2.66
19	300329	海伦钢琴	1,394,618.27	2.60
20	601688	华泰证券	1,291,253.59	2.41
21	603799	华友钴业	1,259,250.19	2.35
22	002655	共达电声	1,257,448.06	2.35
23	000567	海德股份	1,237,909.38	2.31
24	002001	新和成	1,235,190.00	2.31
25	300409	道氏技术	1,233,595.42	2.30
26	000802	北京文化	1,204,339.73	2.25
27	002340	格林美	1,197,844.62	2.24
28	601009	南京银行	1,183,383.01	2.21
29	300296	利亚德	1,157,132.03	2.16
30	300078	思创医惠	1,154,500.70	2.16
31	600763	通策医疗	1,133,002.18	2.12
32	000001	平安银行	1,129,486.08	2.11
33	600683	京投发展	1,121,921.12	2.09
34	300310	宜通世纪	1,121,211.47	2.09
35	600816	安信信托	1,097,371.10	2.05
36	600136	当代明诚	1,093,564.84	2.04
37	300386	飞天诚信	1,092,012.44	2.04
38	000686	东北证券	1,082,650.41	2.02
39	002355	兴民钢圈	1,073,606.33	2.00

注：表中“卖出金额”为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	99,480,160.81
卖出股票收入（成交）总额	103,551,224.13

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	5,750,547.60	15.87
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（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,750,547.60	15.87

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019520	15 国债 20	50,040	5,000,997.60	13.80
2	019533	16 国债 05	7,500	749,550.00	2.07

注：以上为本基金本报告期末持有的全部债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

## 7.8 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。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。



## 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内本基金投资的华泰证券（601688）于 2015 年 9 月 10 日发布《关于收到中国证券监督管理委员会行政处罚事先告知书的公告》，该公司未按照《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》第六条、第八条、第十三条，《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的信息进行审查和了解，违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（四）项所述的行为，获利 18,235,275.00 元；在 2015 年 7 月 12 日证监会发布《关于清理整顿违法从事证券业务活动的意见》（证监会公告[2015]19 号）之后，仍未采取有效措施严格审查客户身份的真实性，未切实防范客户借用证券交易通道违规从事交易活动，新增下挂子账户 102 个，性质恶劣、情节严重。华泰证券于 2015 年 9 月 12 日发布《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》，中国证监会拟对该上市公司一、对华泰证券责令改正，给予警告，没收违法所得 18,235,275.00 元，并处以 54,705,825.00 元罚款；二、对胡智给予警告，并处以 10 万元罚款；三、对陈栋给予警告，并处以 10 万元罚款。

本基金管理人在投资华泰证券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视为，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。

报告期内本基金投资的恒生电子（600570）于 2015 年 9 月 7 日发布收到公司控股子公司杭

州恒生网络并刘曙峰先生、官晓岚先生收到证监会行政处罚事先告知书的告知。恒生网络开发运营的 HOMS 系统，包含子账户开立、提供委托交易、存储、查询、清算等多种证券业务属性的功能，恒生网络明知客户经营方式，仍向不具有经营证券资质的客户销售该系统、提供相关服务，并获取收益的行为违反了《证券法》第一百二十二条的规定，构成《证券法》第一百九十七条所述非法经营证券业务的行为。时任恒生网络董事长刘曙峰为直接负责的主管人员，总经理官晓岚为其他直接责任人员。截止 2015 年 7 月 31 日，恒生网络与 180 个从事配资业务的客户签订协议，为其开立 316,905 个子账户，按照证券交易量的一定比例（万分之零点五到一点五），非法获取收入为 132,852,384.06 元。根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，依据《证券法》第一百九十七条的规定，证监会拟决定：一、没收恒生网络违法所得 132,852,384.06 元，并处以 398,557,152.18 元罚款；二、对刘曙峰给予警告，并处以 30 万元罚款；三、对官晓岚给予警告，并处以 30 万元罚款。

本基金管理人在投资恒生电子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。该事件发生在 2015 年 9 月，本基金管理人在 2016 年上半年对上市公司进行了进一步研究、调研和分析，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，该事件也不会对公司的中长期投资价值产生实质影响。

报告期内本基金投资的前十名证券发行主体中的其余八名本期没有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。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	25,603.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	96,254.48
5	应收申购款	25,653.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	147,511.01

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000638	万方发展	1,773,750.00	4.90	重大事项

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,793	10,023.71	0.00	0.00%	38,019,936.71	100.00%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	22,154.58	0.0583%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年4月9日）基金份额总额	1,294,884,284.12
本报告期期初基金份额总额	45,779,970.22
本报告期基金总申购份额	26,927,173.51
减：本报告期基金总赎回份额	34,687,207.02
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	38,019,936.71

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1. 本报告期基金管理人未受到任何稽查或处罚。  
2. 本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	2	63,789,207.63	31.45%	59,406.88	31.45%	-
长江证券	2	63,334,208.36	31.23%	58,983.56	31.23%	-
海通证券	1	39,920,533.10	19.68%	37,177.86	19.68%	-
万联证券	1	33,004,136.34	16.27%	30,736.78	16.27%	-
高华证券	2	1,560,019.27	0.77%	1,452.85	0.77%	-
华泰证券	1	1,193,227.92	0.59%	1,111.24	0.59%	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

(一) 本基金本报告期末新增、撤销交易单元。

(二) 交易单元选择的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 经营规范，有较完备的内控制度；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要；
- (3) 能为基金管理人提供高质量的研究咨询服务。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	21,161,432.45	100.00%	11,300,000.00	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

泰达宏利基金管理有限公司  
2016 年 8 月 29 日