泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金
2016 年半年度报告

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 重要提示及目录

1.1 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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
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 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 12
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 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 15
6.4 报表附注 16
§7 投资组合报告 33
7.1 期末基金资产组合情况 33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 40
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 40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 40
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 40
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 41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 41
7.12 投资组合报告附注 41

§8 基金份额持有人信息 42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 42
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 43
§9 开放式基金份额变动 43
§10 重大事件揭示 43
10.1 基金份额持有人大会决议 43
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 43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 43
10.4 基金投资策略的改变 43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 44
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 44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 44
10.8 其他重大事件 45
§11 备查文件目录 45
11.1 备查文件目录 45
11.2 存放地点 46
11.3 查阅方式 46

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金
基金简称	泰达宏利红利先锋混合
基金主代码	162212
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 3 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	319,491,590.02 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	力争实现基金资产的长期稳定增值和基金的持续稳定分红。
投资策略	1.资产配置策略 基金投资股票资产的最低比例为基金资产的 60%,最高为 95%,投资于债券资产的比例最高为 40%,最低为 0%。 2.股票投资策略 本基金兼顾投资于具有持续分红特征及潜力的红利股和具有成长潜力特征的上市公司，其中投资于红利股的比例不低于基金股票资产的 80%。“红利股”应具备本基金对红利股定量筛选标准中的一项或多项特征。 3.债券投资策略 对债券的投资将作为控制投资组合整体风险的重要手段之一，通过采用积极主动的投资策略， 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，运用久期调整、凸度挖掘、信用分析、波动性交易、品种互换、回购套利等策略，权衡到期收益率与市场流动性，精选个券并构建和调整债券组合，在追求债券资产投资收益的同时兼顾流动性和安全性。 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，本着谨慎可控的原则，进行权证投资。
业绩比较基准	75%×标普中国 A 股红利机会指数收益率+25%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于高风险、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。

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	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-69-88888	010-67595096
传真		010－66577666	010-66275853
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	北京市西城区金融大街 25 号
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100033	100033
法定代表人		弓劲梅	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泰达宏利基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

§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	-109,302,185.88
本期利润	-120,515,918.57
加权平均基金份额本期利润	-0.3047
本期加权平均净值利润率	-26.81%

本期基金份额净值增长率	-20.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（ 2016 年 6 月 30 日 ）
期末可供分配利润	44,416,577.44
期末可供分配基金份额利润	0.1390
期末基金资产净值	363,908,167.46
期末基金份额净值	1.139
3.1.3 累计期末指标	报告期末（ 2016 年 6 月 30 日 ）
基金份额累计净值增长率	59.96%

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

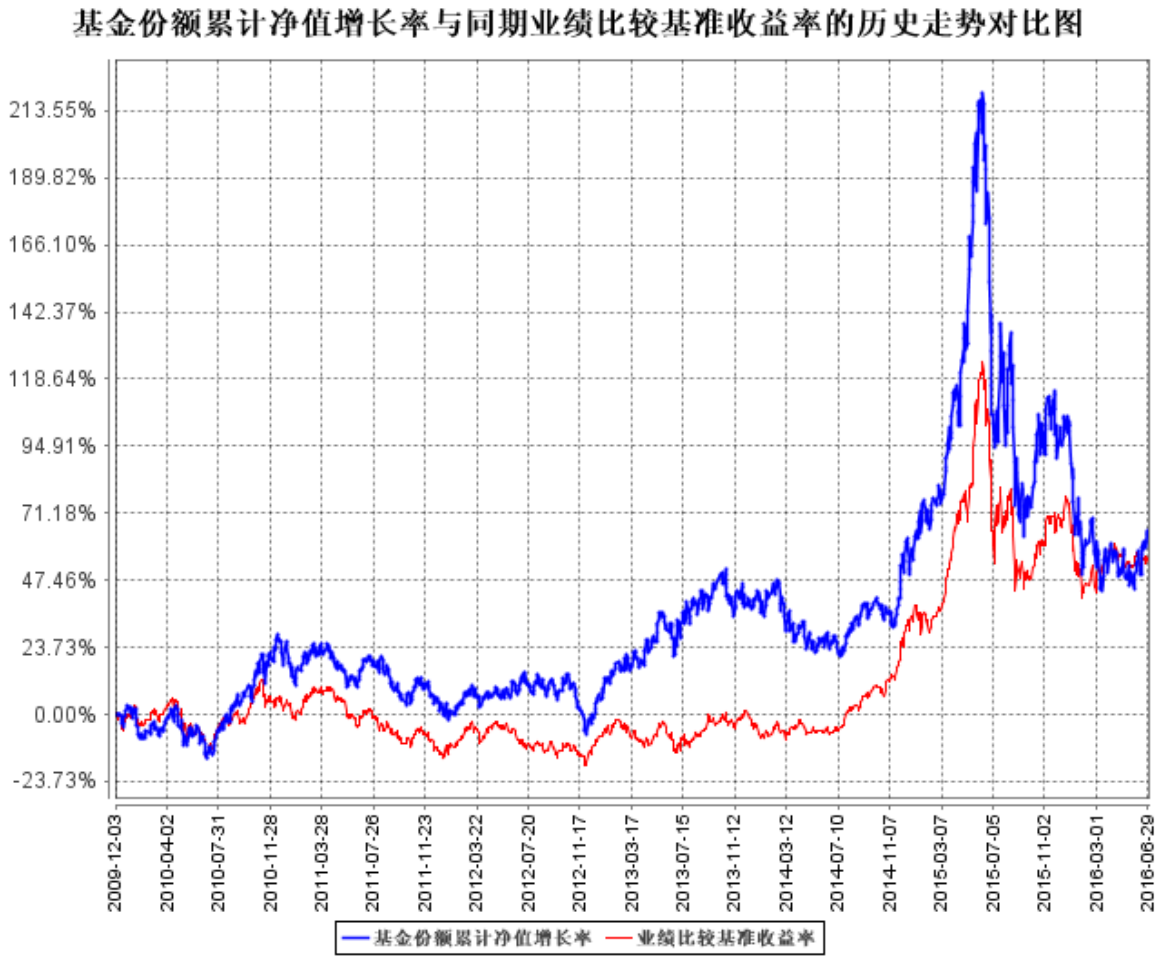
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	7.15%	1.99%	-0.11%	0.72%	7.26%	1.27%
过去三个月	1.54%	1.81%	-1.02%	0.78%	2.56%	1.03%
过去六个月	-20.23%	2.29%	-10.06%	1.42%	-10.17%	0.87%
过去一年	-33.69%	2.81%	-18.09%	1.81%	-15.60%	1.00%
过去三年	28.78%	2.17%	79.60%	1.41%	-50.82%	0.76%
自基金合同生效起至今	59.96%	1.74%	55.87%	1.22%	4.09%	0.52%

注：本基金的业绩比较基准：75%×标普中国 A 股红利机会指数+25%×上证国债指数。

标普中国 A 股红利机会指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的具有高红利特征、盈利能力和利润增长率稳定且具有一定规模及流动性的股票作为样本股，以股息率的最大化及覆盖个股与行业的多样化为标准，使用股息率作为加权指标构建的指数。它可以综合反映沪深证券市场中高股息股票的整体状况和走势，比较符合本基金的投资策略和投资方向。

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



注：本基金于 2009 年 12 月 3 日成立，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		
邓艺颖	本基金基金经理;投资副总监兼研究部总监	2015 年 4 月 3 日	-	11	金融学硕士，2004 年 5 月至 2005 年 4 月就职于中国工商银行广东省分行公司任业务部职员；2005 年 4 月加盟泰达宏利基金管理有限公司，先后担任交易部交易员、固定收益部研究员、研究部副总监，现任投资副总监兼研究部总监;具备 11 年基金从业经验，11 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，未发现利益输送、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处罚的情况。

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

回顾上半年，1 季度，市场先抑后扬，走出了一波反弹行情。1 月份市场出现大幅调整。从市场影响因素来分析，其一，人民币离岸市场波动叠加海外对冲基金攻击港币使得投资人担忧人民币贬值是最主要的原因；其二，新年伊始交易所推出的熔断机制使得市场流动性受到极大限制；其三，1 月 8 日开始大股东解禁限制到期形成的减持压力；其四，银行票据骗贷案件使得银行银根缩紧。2 月份春节后市场出现明显的上涨，主要原因是风险偏好和预期发生较大的变化，1）美联储加息概率下降。2）人民币贬值预期下降。3）经济增长下行担忧缓解。3 月份，进入两会政策观察期，战略新兴板暂时搁置，美国暂不加息且年内加息预期次数从 4 次降为 2 次，叠加房地产成交、投资数据利于经济短期企稳，市场风险偏好再次回升。2 季度，市场走势波动加大，结

构性行情的特点非常明显。4 月份，伴随着 3 月份和 1 季度经济数据的出台，市场对经济阶段性企稳回升预期高涨的同时，也对通胀回升导致货币政策转向充满了担忧。与此同时，美联储的议息会议也使得市场提升对美国经济及其货币政策走向的关注，鸽派观点一出美元大幅走弱，进一步降低了 6 月美联储加息的预期；5 月份，随着 4 月高频数据的跟踪以及监管机构对中概股借壳回归、上市公司并购等监管驱紧，同时叠加权威机构对经济增长的观点，使得市场风险偏好急剧下降，并大幅降低了对经济持续走稳的预期，市场出现较大的调整；6 月份，是投资者关注度最高的一个月份，这个月的投资大事件包括中国 A 股是否纳入 MSCI 新兴市场指数、美联储 6 月议息会议、英国脱欧公投，以及欧洲杯足球大赛。与此同时，6 月底将是年中节点，万科 A 复牌等都将考验投资人的风险偏好。

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 1.139 元，本报告期份额净值增长率为-20.23%，同期业绩比较基准增长率为-10.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，短期而言，市场的支撑因素包括：1）6 月份货币政策和财政政策均呈现出较强的宽松特征，和市场退欧之后预期的再一轮宽松政策预期吻合；2）市场指数表现较强，吸引部分场外投资者进入市场，形成增量资金的预期；3）供给测改革、国企改革提升周期性板块、地方国资控股公司的吸引力。市场存在的隐忧包括：1）中报业绩窗口期，部分高估值且业绩不达预期的个股可能存在调整风险；2）监管机构可能推出上市公司退市管理办法，以及 IPO 的提速；3）市场缺乏基本面和估值匹配的行业板块投资热点。中期来看，投资者需要在经济增长预期、货币财政政策、汇率、行业政策以及上市公司业绩增长等层面形成一个新的框架。金融监管思路和政策变化也将影响投资者的价值偏好。

市场可能的机会在于：1）国企改革加速，部分地方国有企业在混合所有制等领域的改革进入实施期；2）内生增长确定的消费、医药、家电、汽车等个股出现估值切换的行情；3）教育、体育行业政策出现较大变化，物联网等创新领域有新的投资逻辑。

我们的策略是适当降低仓位，回归价值成长的阵营，重点配置在医药、消费、农业等板块中，同时关注教育、消费电子等行业中个股性的机会。

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

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金于 2016 年 1 月 12 日公告按每 10 份基金份额派发 0.60 元进行利润分配，权益登记日、除权日为 2016 年 1 月 14 日，红利发放日为 2016 年 1 月 15 日，共分配 19,637,648.13 元；本基金于 2016 年 4 月 11 日公告按每 10 份基金份额派发 0.20 元进行利润分配，权益登记日、除权日为 2016 年 4 月 13 日，红利发放日为 2016 年 4 月 14 日，共分配 7,969,549.04 元。

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

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或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 27,607,197.17 元。

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：泰达宏利红利先锋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	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	67,132,675.51	228,508,903.15
结算备付金		2,120,323.83	7,001,097.89
存出保证金		537,039.91	1,400,770.45
交易性金融资产	6.4.7.2	315,785,935.30	348,792,701.55
其中：股票投资		315,785,935.30	348,792,701.55
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		35,257,953.00	-
应收利息	6.4.7.5	11,719.22	35,783.04
应收股利		-	-
应收申购款		58,068.69	553,623.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		420,903,715.46	586,292,879.74
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2016 年 6 月 30 日**	**上年度末 2015 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-

应付赎回款		54,336,812.84	192,633.30
应付管理人报酬		538,060.71	763,745.51
应付托管费		89,676.75	127,290.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,627,882.67	2,824,967.23
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	403,115.03	100,431.36
负债合计		56,995,548.00	4,009,068.36
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	319,491,590.02	381,233,609.37
未分配利润	6.4.7.10	44,416,577.44	201,050,202.01
所有者权益合计		363,908,167.46	582,283,811.38
负债和所有者权益总计		420,903,715.46	586,292,879.74

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.139 元，基金份额总额 319,491,590.02 份。

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利红利先锋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	附注号	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
一、收入		-110,864,349.59	297,878,508.60
1.利息收入		406,899.75	299,073.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	356,073.79	286,700.51
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		50,825.96	12,372.64
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-100,493,620.10	424,941,718.29
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-102,439,120.59	423,233,763.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,945,500.49	1,707,954.77
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-11,213,732.69	-127,930,517.14
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	436,103.45	568,234.30
减：二、费用		9,651,568.98	14,716,087.65
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	3,366,500.06	5,607,380.26
2．托管费	6.4.10.2.2	561,083.26	934,563.35
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.19	5,494,605.18	7,943,793.80
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．其他费用	6.4.7.20	229,380.48	230,350.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-120,515,918.57	283,162,420.95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-120,515,918.57	283,162,420.95

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利红利先锋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）	381,233,609.37	201,050,202.01	582,283,811.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-120,515,918.57	-120,515,918.57
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）	-61,742,019.35	-8,510,508.83	-70,252,528.18
其中：1.基金申购款	256,583,558.02	35,463,437.45	292,046,995.47
2.基金赎回款	-318,325,577.37	-43,973,946.28	-362,299,523.65
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）	-	-27,607,197.17	-27,607,197.17
五、期末所有者权益（基金净值）	319,491,590.02	44,416,577.44	363,908,167.46

项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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)	571,091,938.47	225,180,678.37	796,272,616.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	283,162,420.95	283,162,420.95
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）	-206,140,266.99	-100,131,180.65	-306,271,447.64
其中：1.基金申购款	175,255,314.06	168,337,245.32	343,592,559.38
2.基金赎回款	-381,395,581.05	-268,468,425.97	-649,864,007.02
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）	-	-35,314,319.45	-35,314,319.45
五、期末所有者权益(基金净值)	364,951,671.48	372,897,599.22	737,849,270.70

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	傅国庆	王泉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金(以下简称“本基金”，原泰达荷银红利先锋股票型证券投资基金，后更名为泰达宏利红利先锋股票型证券投资基金)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[2009]第 948 号《关于核准泰达荷银红利先锋股票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《泰达荷银红利先锋股票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 1,396,033,968.37 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 264 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰达荷银红利先锋股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 12 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为

1,396,164,951.08 份基金份额，其中认购资金利息折合 130,982.71 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”)。

根据本基金的基金管理人 2010 年 3 月 17 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于变更公司旗下公募基金名称的公告》，本基金自公告之日起更名为泰达宏利红利先锋股票型证券投资基金。根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，本基金于 2015 年 7 月 30 日公告后更名为泰达宏利红利先锋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《泰达宏利红利先锋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或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 60%-95%，债券资产占基金资产的 0%-40%，权证占基金资产净值的 0%-3%，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%。根据本基金管理人于 2014 年 12 月 25 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利红利先锋股票型证券投资基金因相关指数名称变更修改<基金合同>的公告》，自 2015 年 1 月 1 日起，本基金的业绩比较基准由中信标普中国 A 股红利机会指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%，变更为标普中国 A 股红利机会指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。

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》、《泰达宏利红利先锋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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	67,132,675.51
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	67,132,675.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		293,996,329.67	315,785,935.30	21,789,605.63
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		293,996,329.67	315,785,935.30	21,789,605.63

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产和负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末买入返售金融资产无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	10,522.70
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	954.20
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.62
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	241.70
合计	11,719.22

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,627,882.67
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,627,882.67

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	204,210.87
预提费用	198,904.16
-	-
合计	403,115.03

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	381,233,609.37	381,233,609.37
本期申购	256,583,558.02	256,583,558.02
本期赎回(以"-"号填列)	-318,325,577.37	-318,325,577.37
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以"-"号填列)	-	-
本期末	319,491,590.02	319,491,590.02

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	234,169,992.32	-33,119,790.31	201,050,202.01
本期利润	-109,302,185.88	-11,213,732.69	-120,515,918.57
本期基金份额交易产生的变动数	-18,546,554.51	10,036,045.68	-8,510,508.83
其中：基金申购款	79,567,447.44	-44,104,009.99	35,463,437.45
基金赎回款	-98,114,001.95	54,140,055.67	-43,973,946.28
本期已分配利润	-27,607,197.17	-	-27,607,197.17
本期末	78,714,054.76	-34,297,477.32	44,416,577.44

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	321,610.51
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	23,807.17
其他	10,656.11
合计	356,073.79

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,781,518,259.08
减：卖出股票成本总额	1,883,957,379.67
买卖股票差价收入	-102,439,120.59

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期未有债券投资收益-买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期未有债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未有债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回贵金属差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购贵金属差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,945,500.49
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,945,500.49

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-11,213,732.69
——股票投资	-11,213,732.69
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-11,213,732.69

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	245,181.25
基金转换费收入	190,922.20
其他	-
合计	436,103.45

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25%归入基金资产。

2.本基金的基金转换费用中的 25%归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	5,494,605.18
银行间市场交易费用	-
合计	5,494,605.18

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,178.12
其他	800.00
债券账户维护费	18,000.00
银行费用	11,676.32
-	-
合计	229,380.48

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2016 年 7 月 8 日宣告 2016 年度第 3 次分红，向截至 2016 年 7 月 12 日止在本基金注册登记人泰达宏利基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.2000 元。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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	3,366,500.06	5,607,380.26
其中：支付销售机构的客户维护费	200,952.50	396,925.61

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。

6.4.10.2.2 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	561,083.26	934,563.35

注：支付基金托管人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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
基金合同生效日（ 2009 年 12 月 3 日 ）持有的基金份额	0.00	0.00
期初持有的基金份额	5,475,903.61	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额	5,475,903.61	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.7139%	0.0000%

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额；

2. 本基金管理人投资本基金时所适用的费率为本基金基金合同中约定的费率。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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	67,132,675.51	321,610.51	136,057,515.75	239,490.52

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。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2016 年 4 月 13 日	-	2016 年 4 月 13 日	0.2000	6,396,534.41	1,573,014.63	7,969,549.04	
2	2016 年 1 月 14 日	-	2016 年 1 月 14 日	0.6000	15,158,890.42	4,478,757.71	19,637,648.13	
合计	-	-		0.8000	21,555,424.83	6,051,772.34	27,607,197.17	

注：本基金于资产负债表日之后、财务报表批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配情况请参见“资产负债表日后事项”(附注 6.4.8.2)。

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

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
601966	玲珑轮胎	2016 年 6 月 24 日	2016 年 7 月 6 日	新股流通受限	12.98	12.98	3,287	42,665.26	42,665.26	-
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	1,602	13,600.98	13,600.98	-
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	926	9,306.30	9,306.30	-

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	971	5,631.80	5,631.80	-

6.4.12.2 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	784,653	18,849,764.54	18,557,043.45	-
002127	南极电商	2016 年 5 月 16 日	重大事项	9.63	-	-	1,896,674	18,852,333.89	18,264,970.62	-
300507	苏奥传感	2016 年 6 月 30 日	重大事项	157.78	2016 年 7 月 5 日	149.50	113,524	9,959,951.82	17,911,816.72	-
000718	苏宁环球	2016 年 1 月 4 日	重大事项	9.91	2016 年 7 月 18 日	11.78	1,695,420	18,833,766.00	16,801,612.20	-
600576	万家文化	2016 年 4 月 11 日	重大事项	21.78	-	-	667,045	13,093,473.39	14,528,240.10	-
300508	维宏股份	2016 年 6 月 30 日	重大事项	254.50	2016 年 7 月 6 日	242.00	22,839	2,788,361.09	5,812,525.50	-
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	11,042	38,315.74	230,998.64	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券投资资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	67,132,675.51	-	-	-	67,132,675.51
结算备付金	2,120,323.83	-	-	-	2,120,323.83
存出保证金	537,039.91	-	-	-	537,039.91
交易性金融资产	-	-	-	315,785,935.30	315,785,935.30
应收证券清算款	-	-	-	35,257,953.00	35,257,953.00
应收利息	-	-	-	11,719.22	11,719.22
应收申购款	-	-	-	58,068.69	58,068.69
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	69,790,039.25	-	-	351,113,676.21	420,903,715.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	54,336,812.84	54,336,812.84
应付管理人报酬	-	-	-	538,060.71	538,060.71
应付托管费	-	-	-	89,676.75	89,676.75
应付交易费用	-	-	-	1,627,882.67	1,627,882.67
其他负债	-	-	-	403,115.03	403,115.03
负债总计	-	-	-	56,995,548.00	56,995,548.00
利率敏感度缺口	69,790,039.25	-	-	294,118,128.21	363,908,167.46
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	228,508,903.15	-	-	-	228,508,903.15
结算备付金	7,001,097.89	-	-	-	7,001,097.89
存出保证金	1,400,770.45	-	-	-	1,400,770.45
交易性金融资产	-	-	-	348,792,701.55	348,792,701.55
应收利息	-	-	-	35,783.04	35,783.04
应收申购款	299.10	-	-	553,324.56	553,623.66
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	236,911,070.59	-	-	349,381,809.15	586,292,879.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	192,633.30	192,633.30
应付管理人报酬	-	-	-	763,745.51	763,745.51
应付托管费	-	-	-	127,290.96	127,290.96
应付交易费用	-	-	-	2,824,967.23	2,824,967.23
其他负债	-	-	-	100,431.36	100,431.36
负债总计	-	-	-	4,009,068.36	4,009,068.36
利率敏感度缺口	236,911,070.59	-	-	345,372,740.79	582,283,811.38

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早

者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资资产(2015 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 60%－95%，债券资产占基金资产的 0%－40%，权证占基金资产净值的 0%－3%，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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	315,785,935.30	86.78	348,792,701.55	59.90
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投	-	-	-	-

资				
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	315,785,935.30	86.78	348,792,701.55	59.90

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2016 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2015 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准上升 5%	17,380,000.00	25,930,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-17,380,000.00	-25,930,000.00

6.4.14 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	315,785,935.30	75.03
	其中：股票	315,785,935.30	75.03
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	69,252,999.34	16.45
7	其他各项资产	35,864,780.82	8.52
8	合计	420,903,715.46	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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	230,955,475.16	63.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	230,998.64	0.06
F	批发和零售业	33,085,283.55	9.09
G	交通运输、仓储和邮政业	9,878,949.49	2.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,878,332.90	1.62
J	金融业	-	-
K	房地产业	16,801,612.20	4.62
L	租赁和商务服务业	18,264,970.62	5.02
M	科学研究和技术服务业	18,288.10	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	672,024.64	0.18
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	315,785,935.30	86.78

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所有股票投资明细

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	000638	万方发展	784,653	18,557,043.45	5.10

2	002127	南极电商	1,896,674	18,264,970.62	5.02
3	300507	苏奥传感	113,524	17,911,816.72	4.92
4	000718	苏宁环球	1,695,420	16,801,612.20	4.62
5	603799	华友钴业	423,654	15,759,928.80	4.33
6	300073	当升科技	229,564	15,367,014.16	4.22
7	600576	万家文化	667,045	14,528,240.10	3.99
8	603528	多伦科技	138,012	13,523,795.88	3.72
9	002418	康盛股份	1,253,538	13,237,361.28	3.64
10	002664	信质电机	386,587	13,151,689.74	3.61
11	002074	国轩高科	308,902	12,192,361.94	3.35
12	300491	通合科技	105,000	10,886,400.00	2.99
13	300048	合康变频	922,976	10,854,197.76	2.98
14	002643	万润股份	204,752	10,417,781.76	2.86
15	002165	红 宝 丽	1,066,398	9,960,157.32	2.74
16	600531	豫光金铅	1,191,570	9,949,609.50	2.73
17	002357	富临运业	640,243	9,878,949.49	2.71
18	002182	云海金属	491,158	9,774,044.20	2.69
19	300474	景嘉微	63,500	9,580,245.00	2.63
20	600303	曙光股份	625,176	9,283,863.60	2.55
21	300499	高澜股份	82,959	8,607,825.84	2.37
22	600006	XD 东风汽	909,047	8,063,246.89	2.22
23	603701	德宏股份	97,968	7,761,024.96	2.13
24	002108	沧州明珠	285,562	7,396,055.80	2.03
25	002580	圣阳股份	360,803	6,840,824.88	1.88
26	600232	金鹰股份	493,714	6,512,087.66	1.79
27	300508	维宏股份	22,839	5,812,525.50	1.60
28	300198	纳川股份	196,405	3,160,156.45	0.87
29	000888	峨眉山 A	55,816	672,024.64	0.18
30	601611	中国核建	11,042	230,998.64	0.06
31	300516	久之洋	1,233	215,984.61	0.06
32	603737	三棵树	1,228	142,546.24	0.04
33	601127	小康股份	5,018	119,779.66	0.03
34	603131	上海沪工	1,163	70,594.10	0.02
35	300515	三德科技	1,255	58,821.85	0.02
36	300518	盛讯达	1,206	56,501.10	0.02
37	002799	环球印务	980	42,767.20	0.01
38	601966	玲珑轮胎	3,287	42,665.26	0.01
39	603958	哈森股份	2,072	30,044.00	0.01
40	002802	洪汇新材	1,429	21,549.32	0.01

41	603909	合诚股份	995	18,288.10	0.01
42	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
43	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
44	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

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	603799	华友钴业	27,806,844.80	4.78
2	600136	当代明诚	26,384,322.26	4.53
3	600298	安琪酵母	23,275,437.21	4.00
4	002094	青岛金王	23,239,403.77	3.99
5	600395	盘江股份	23,108,736.75	3.97
6	601688	华泰证券	22,845,635.00	3.92
7	002643	万润股份	22,379,767.99	3.84
8	002285	世联行	22,199,011.51	3.81
9	002548	金新农	22,010,562.38	3.78
10	300113	顺网科技	21,356,758.00	3.67
11	002717	岭南园林	21,296,818.16	3.66
12	300465	高伟达	20,699,031.90	3.55
13	002117	东港股份	20,418,011.88	3.51
14	002635	安洁科技	20,158,335.84	3.46
15	300033	同花顺	19,862,898.26	3.41
16	002624	完美环球	19,515,381.00	3.35
17	002582	好想你	18,887,912.30	3.24
18	002127	南极电商	18,852,333.89	3.24
19	300144	宋城演艺	18,783,597.28	3.23
20	002074	国轩高科	18,314,525.00	3.15
21	600386	北巴传媒	17,801,079.44	3.06
22	600713	南京医药	17,224,170.86	2.96
23	300048	合康变频	16,897,787.25	2.90
24	300511	雪榕生物	16,823,724.22	2.89
25	002557	洽洽食品	16,661,521.13	2.86

26	603898	好莱客	16,337,027.85	2.81
27	000959	首钢股份	16,224,360.64	2.79
28	600391	成发科技	16,073,807.16	2.76
29	002165	红 宝 丽	16,057,351.20	2.76
30	601009	南京银行	16,056,524.88	2.76
31	002418	康盛股份	15,173,778.00	2.61
32	002797	第一创业	14,904,376.90	2.56
33	002488	金固股份	14,860,914.01	2.55
34	002142	宁波银行	14,609,843.92	2.51
35	300491	通合科技	14,437,502.01	2.48
36	000807	云铝股份	14,391,226.37	2.47
37	002626	金达威	14,126,534.10	2.43
38	002001	新 和 成	14,117,145.26	2.42
39	002751	易尚展示	13,970,290.68	2.40
40	002562	兄弟科技	13,835,435.22	2.38
41	002019	亿帆鑫富	13,787,828.00	2.37
42	600705	中航资本	13,734,658.20	2.36
43	300059	东方财富	13,699,896.85	2.35
44	002195	二三四五	13,677,396.60	2.35
45	002609	捷顺科技	13,594,428.00	2.33
46	300496	中科创达	13,515,810.97	2.32
47	002452	长高集团	13,395,510.52	2.30
48	002056	横店东磁	13,323,009.40	2.29
49	603398	邦宝益智	13,263,632.53	2.28
50	000657	中钨高新	13,254,702.92	2.28
51	600432	*ST 吉恩	13,129,213.22	2.25
52	603528	多伦科技	13,125,128.60	2.25
53	002502	骅威文化	13,104,215.55	2.25
54	600576	万家文化	13,093,473.39	2.25
55	600366	宁波韵升	13,084,971.34	2.25
56	000656	金科股份	13,070,810.01	2.24
57	002244	滨江集团	13,070,019.00	2.24
58	002081	金 螳 螂	13,066,327.25	2.24
59	002713	东易日盛	13,063,331.04	2.24
60	002245	澳洋顺昌	13,055,155.59	2.24
61	300409	道氏技术	12,991,417.00	2.23

62	300101	振芯科技	12,985,167.23	2.23
63	002716	金贵银业	12,954,241.00	2.22
64	300073	当升科技	12,909,185.70	2.22
65	300507	苏奥传感	12,874,135.25	2.21
66	300474	景嘉微	12,871,124.77	2.21
67	000975	银泰资源	12,832,915.00	2.20
68	000960	锡业股份	12,697,257.10	2.18
69	000738	中航动控	12,539,992.00	2.15
70	002357	富临运业	12,506,177.92	2.15
71	002664	信质电机	12,443,398.68	2.14
72	000888	峨眉山Ａ	12,421,239.99	2.13
73	300383	光环新网	12,419,586.10	2.13
74	002431	棕榈股份	12,392,390.37	2.13
75	300049	福瑞股份	12,244,011.40	2.10
76	600216	浙江医药	12,223,783.13	2.10
77	000712	锦龙股份	12,176,316.30	2.09
78	601555	东吴证券	11,972,628.00	2.06
79	600801	华新水泥	11,932,967.86	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	300113	顺网科技	39,470,863.64	6.78
2	300310	宜通世纪	28,860,045.55	4.96
3	600136	当代明诚	25,719,144.67	4.42
4	002407	多氟多	25,576,665.11	4.39
5	600298	安琪酵母	23,850,014.28	4.10
6	002548	金新农	23,787,084.78	4.09
7	002635	安洁科技	23,609,411.04	4.05
8	600395	盘江股份	23,598,971.28	4.05
9	002712	思美传媒	22,936,522.64	3.94
10	601688	华泰证券	22,253,267.95	3.82
11	002582	好想你	21,196,827.58	3.64
12	002117	东港股份	19,465,077.32	3.34
13	002285	世联行	18,876,233.00	3.24

14	600391	成发科技	18,843,117.87	3.24
15	002624	完美环球	18,607,787.53	3.20
16	002709	天赐材料	18,542,368.61	3.18
17	300033	同花顺	18,488,732.80	3.18
18	002094	青岛金王	18,418,722.16	3.16
19	002797	第一创业	17,970,557.15	3.09
20	300511	雪榕生物	17,563,914.46	3.02
21	600386	北巴传媒	17,549,271.61	3.01
22	002643	万润股份	17,345,380.36	2.98
23	002717	岭南园林	16,841,951.24	2.89
24	002001	新 和 成	16,514,448.95	2.84
25	002343	慈文传媒	16,502,539.43	2.83
26	002557	洽洽食品	16,439,659.34	2.82
27	300144	宋城演艺	16,279,737.55	2.80
28	600713	南京医药	16,201,204.48	2.78
29	002562	兄弟科技	15,486,653.05	2.66
30	000526	紫光学大	15,263,731.13	2.62
31	002626	金达威	15,235,098.62	2.62
32	300465	高伟达	14,921,946.21	2.56
33	601009	南京银行	14,870,052.81	2.55
34	000959	首钢股份	14,484,889.60	2.49
35	603799	华友钴业	14,458,315.38	2.48
36	002325	洪涛股份	14,404,276.63	2.47
37	002056	横店东磁	14,331,943.57	2.46
38	603898	好莱客	14,050,445.77	2.41
39	002502	骅威文化	13,999,439.08	2.40
40	300101	振芯科技	13,900,970.05	2.39
41	600705	中航资本	13,666,001.15	2.35
42	002019	亿帆鑫富	13,555,969.29	2.33
43	002452	长高集团	13,500,243.00	2.32
44	002245	澳洋顺昌	13,474,524.59	2.31
45	600366	宁波韵升	13,422,697.00	2.31
46	601099	太平洋	13,396,844.90	2.30
47	002081	金 螳 螂	13,344,222.39	2.29
48	002142	宁波银行	13,276,346.16	2.28
49	300409	道氏技术	13,207,127.26	2.27
50	300031	宝通科技	13,203,334.98	2.27
51	300401	花园生物	13,068,689.34	2.24

52	000960	锡业股份	12,993,015.86	2.23
53	600801	华新水泥	12,880,016.50	2.21
54	601555	东吴证券	12,668,532.04	2.18
55	000738	中航动控	12,542,696.05	2.15
56	600216	浙江医药	12,372,808.80	2.12
57	002308	威创股份	12,344,001.87	2.12
58	002716	金贵银业	12,216,797.26	2.10
59	000712	锦龙股份	12,203,194.08	2.10
60	002609	捷顺科技	12,143,540.80	2.09
61	000807	云铝股份	12,024,446.77	2.07
62	002195	二三四五	12,009,146.39	2.06
63	000975	银泰资源	11,923,262.09	2.05
64	300496	中科创达	11,875,632.43	2.04
65	600735	新华锦	11,828,107.43	2.03
66	300059	东方财富	11,717,735.13	2.01

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	1,862,164,346.11
卖出股票收入（成交）总额	1,781,518,259.08

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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受到公开谴责、处罚。

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	537,039.91
2	应收证券清算款	35,257,953.00
3	应收股利	-
4	应收利息	11,719.22
5	应收申购款	58,068.69
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,864,780.82

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	18,557,043.45	5.10	重大事项
2	002127	南极电商	18,264,970.62	5.02	重大事项
3	300507	苏奥传感	17,911,816.72	4.92	重大事项
4	000718	苏宁环球	16,801,612.20	4.62	重大事项
5	600576	万家文化	14,528,240.10	3.99	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
11,275	28,336.28	196,895,747.37	61.63%	122,595,842.65	38.37%

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	589,995.08	0.1847%

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	10~50
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 12 月 3 日 ）基金份额总额	1,396,164,951.08
本报告期期初基金份额总额	381,233,609.37
本报告期基金总申购份额	256,583,558.02
减:本报告期基金总赎回份额	318,325,577.37
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	319,491,590.02

§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	
海通证券	1	1,069,201,350.99	29.37%	995,748.23	29.37%	-
长江证券	2	868,223,046.87	23.85%	808,576.59	23.85%	-
万联证券	1	644,207,684.22	17.70%	599,951.82	17.70%	-
广发证券	1	622,725,519.79	17.11%	579,944.29	17.11%	-
申万宏源	1	351,895,463.22	9.67%	327,719.78	9.67%	-
华泰证券	1	54,522,835.84	1.50%	50,777.09	1.50%	-
高华证券	2	29,469,243.00	0.81%	27,444.62	0.81%	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-

中银国际	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

(一)本基金本报告期未新增、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

本基金本报告期未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金分红公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 1 月 12 日
2	《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金分红公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 4 月 11 日

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1、中国证监会批准基金募集的文件；

2、基金合同；

3、托管协议；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、基金托管人业务资格批件和营业执照；

6、中国证监会要求的其他文件。

11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所

11.3 查阅方式

基金投资者可在营业时间免费查阅，或基金投资者也可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）或登录本基金管理人互联网网址（http://www.mfcteda.com）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泰达宏利基金管理有限公司：客户服务中心电话：400-698-8888（免长话费）或 010-66555662； 网址：http://www.mfcteda.com。

泰达宏利基金管理有限公司
2016 年 8 月 29 日