

# 泰达宏利效率优选混合型证券投资基金 (LOF) 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 月 30 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 2017 年 3 月 28 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。

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 基金简称         | 泰达宏利效率优选混合 (LOF) |
| 基金主代码        | 162207           |
| 基金运作方式       | 上市契约型开放式 (LOF)   |
| 基金合同生效日      | 2006 年 5 月 12 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   | 804,187,483.77 份 |
| 基金合同存续期      | 不定期              |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所          |
| 上市日期         | 2006 年 7 月 21 日  |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                        |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 充分挖掘具有较高投资效率的上市公司，兼顾投资优质债券，力争为投资者获得超过业绩比较基准的投资回报。                                      |
| 投资策略   | 本基金采取“自上而下”和“自下而上”相结合的投资手段和方法，在正常的市场环境下不作主动性资产配置调整，股票及债券的资产配置比例基本保持在基准比例上下 10% 的范围内波动。 |
| 业绩比较基准 | 富时中国 A600 指数收益率*60%+中证国债指数收益率*35%+同业存款利率*5%。                                           |
| 风险收益特征 | 本基金的投资目标和投资范围决定了本基金属于风险较高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

|                    |                                                              |
|--------------------|--------------------------------------------------------------|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网 | <a href="http://www.mfcteda.com">http:// www.mfcteda.com</a> |
|--------------------|--------------------------------------------------------------|

|            |                |
|------------|----------------|
| 址          |                |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人的住所 |

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 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 | 2016 年          | 2015 年           | 2014 年           |
|---------------|-----------------|------------------|------------------|
| 本期已实现收益       | -169,300,746.53 | 1,062,235,187.34 | 1,036,147,223.82 |
| 本期利润          | -182,185,502.53 | 127,597,875.54   | 1,140,767,611.82 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.2155         | 0.0958           | 0.3629           |
| 本期基金份额净值增长率   | -15.80%         | -2.58%           | 44.32%           |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末         | 2015 年末          | 2014 年末          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.7046          | 0.9150           | 0.8042           |
| 期末基金资产净值      | 901,028,802.51  | 1,158,531,529.88 | 3,141,240,180.03 |
| 期末基金份额净值      | 1.1204          | 1.3307           | 1.3660           |

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. 期末可供分配利润等于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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | -4.48%   | 0.66%       | 0.15%      | 0.43%         | -4.63%  | 0.23% |
| 过去六个月      | 0.81%    | 0.71%       | 2.68%      | 0.46%         | -1.87%  | 0.25% |
| 过去一年       | -15.80%  | 1.26%       | -7.59%     | 0.86%         | -8.21%  | 0.40% |
| 过去三年       | 18.37%   | 1.56%       | 32.93%     | 1.06%         | -14.56% | 0.50% |
| 过去五年       | 60.15%   | 1.41%       | 36.50%     | 0.96%         | 23.65%  | 0.45% |
| 自基金合同生效起至今 | 169.48%  | 1.39%       | 133.92%    | 1.13%         | 35.56%  | 0.26% |

注：本基金业绩比较基准： $60\% \times \text{富时中国 A600 指数收益率} + 35\% \times \text{中证国债指数收益率} +$

5%×同业存款利率。

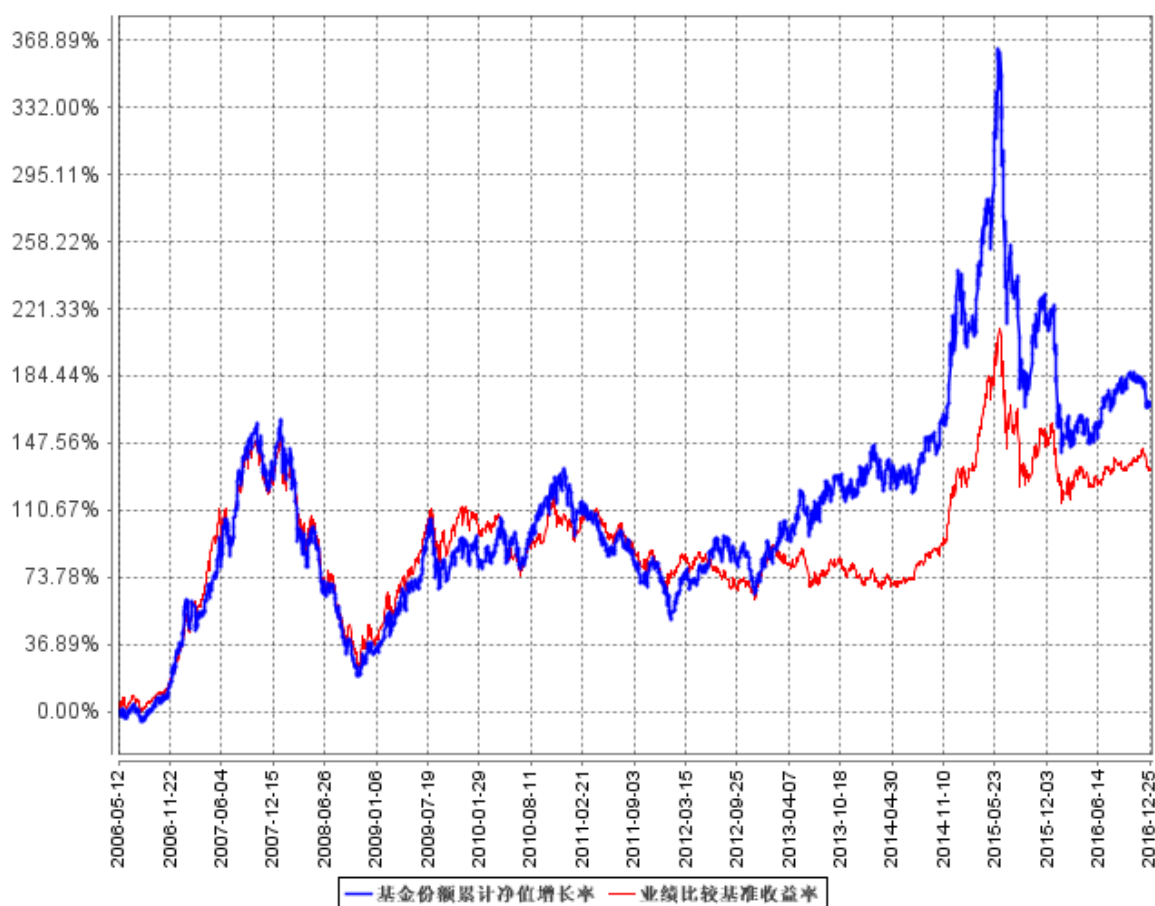
富时中国 A600 指数是富时指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所总市值最大的 600 只股票并以流通股本加权的股票指数，具有良好的市场代表性。

中证国债指数是中证指数公司编制的中国国债指数，涵盖了三个市场中（银行间市场，沪深交易所）的一年期以上的国债，具有良好的流动性和市场代表性。

自 2013 年 3 月 30 日起本基金业绩比较基准变更为“富时中国 A600 指数收益率\*60%+中证国债指数收益率\*35%+同业存款利率\*5%”。详情请参照我公司 2013 年 3 月 30 日发布的《泰达宏利效率优选混合型证券投资基金关于变更业绩比较基准及修改基金合同的公告》。

### 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

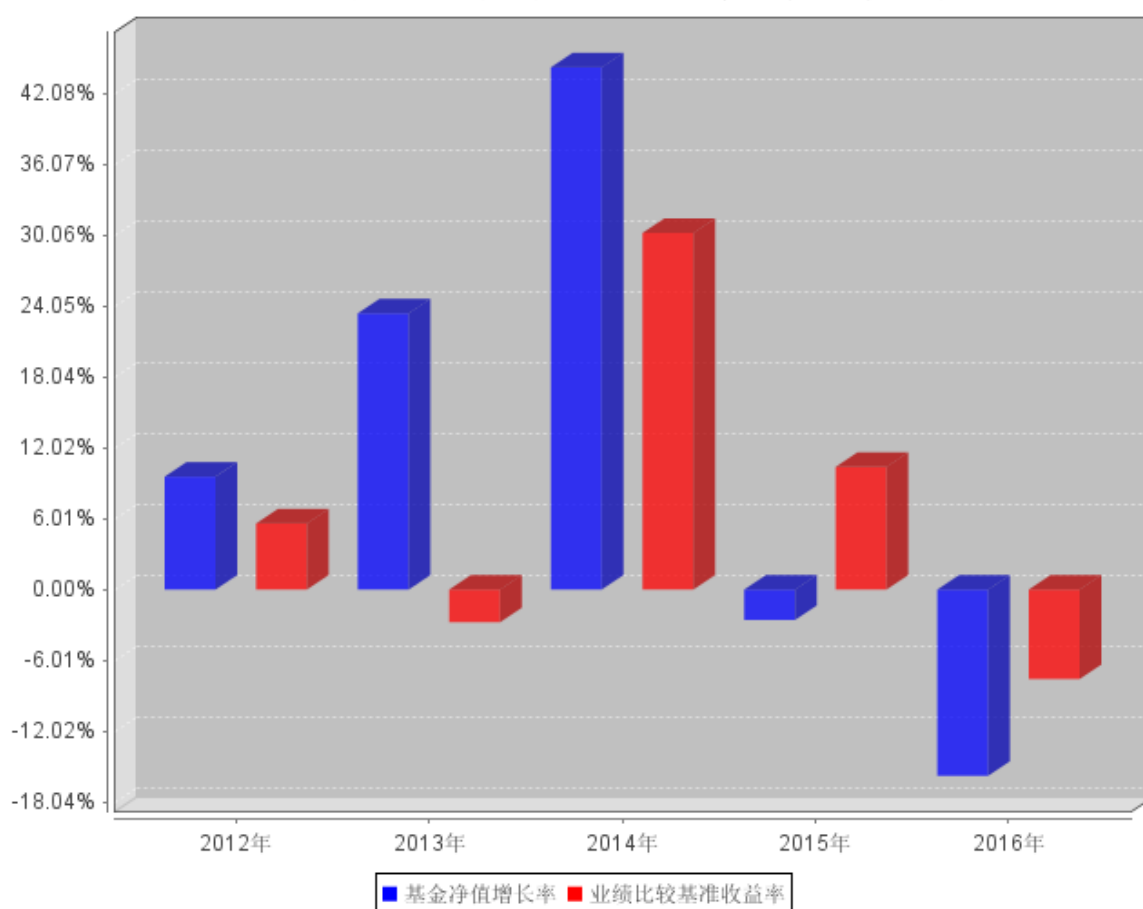
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金近三年未进行利润分配。目前无其他收益分配安排。

## § 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、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(LOF)、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型证券投资基金、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、泰达宏利汇利债券型证券投资基金、泰达宏利量化增强股票型证券投资基金、泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利定宏混合型证券投资基金、泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利亚洲债券型证券投资基金、泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利京元宝货币市场基金在内的四十多只证券投资基金。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资团队全体人员的共同努力，力求实现基金财产的持续增值。

#### 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 |        |                                                                                                                                                 |
| 吴华 | 本基金基金经理 | 2014 年 3 月 25 日 | —    | 12     | 金融学硕士，2004 年 6 月至 2006 年 3 月就职于易方达基金管理有限公司，担任宏观策略分析员职务；2006 年 4 月至 2011 年 4 月就职于中国国际金融有限公司，先后就职于研究部、资产管理部，担任经理、副总经理等职位；2011 年 5 月加入泰达宏利基金管理有限公司 |

|     |           |                |   |   |                                                                                                                        |
|-----|-----------|----------------|---|---|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |           |                |   |   | 司。具备 12 年证券从业经验，12 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。                                                                                 |
| 丁宇佳 | 本基金基金经理助理 | 2015 年 6 月 9 日 | - | 8 | 理学学士；2008 年 7 月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任交易部交易员，负责债券交易工作；2013 年 9 月起先后担任固定收益部研究员、基金经理助理、基金经理；具备 8 年基金从业经验，8 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合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人建立了公平交易制度和内部控制流程，严格执行相关制度规定。在投资管理活动中，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；在交易环节实行集中交易制度，交易部运用交易系统内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，确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，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。

基金管理人的风险管理部定期对基金管理人管理的不同投资组合的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）基金管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，并经公司管理层审核签署后存档备查。基金管理人的监察稽核部定期对公平交易制度的执行和控制工作进行稽核。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人的风险管理部事后从交易指令的公平性、同日反向交易、不同窗口下的同向交易溢价率和风格相似的基金的业绩等方面，对报告期内的公平交易执行情况进行统计分析。本报告期内，交易指令多为指令下达人管理的多只资产组合同时下发，未发现明显的非公平交易指令；基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；场外交易的交易价格与市场价格一致，场内交易的溢价率在剔除交易时间差异、交易数量悬殊、市场波动剧烈等因素后，处于正常范围之内；基金管理人管理的各投资组合的业绩由于投资策略、管理风格、业绩基准等方面的因素而有所不同。

本报告期内，本基金管理人管理的各投资组合之间未发现利益输送或不公平对待不同组合的情况。

### 4.3.3 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，风险管理部对可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，定期对各投资组合的交易行为进行整体分析评估，定期向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。如发现疑似异常交易情况，相关投资组合经理对该交易情况进行合理性解释。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 30 次。30 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

2016 年宏观经济整体平稳，货币政策较为宽松，财政政策积极，供给侧改革力度较大。实体经济中部分行业明显复苏，产品价格显著上涨，比如煤炭、有色、钢铁、水泥、白酒和纸张等。而 2015 年关注度很高的互联网相关产业增长势头则维持平稳。而通讯相关行业依然保持了较好的增长势头，比如光纤光缆和智能终端部件。

2016 年的股市充分反映了经济结构性景气变化，煤炭、有色、建材板块领涨，光通信和智能终端部件行业也表现不俗，而计算机和传媒等板块领跌。此外，由于 2016 年利率水平在边

实际上并未出现明显下行，股市的估值水平未扩张。各行业的估值水平呈现出收敛的态势。前期估值较低的板块，如银行，出现了估值修复。而估值较高的计算机和传媒板块也经历了估值的压缩。整个市场的定价方式重新向价值投资的方向发展。

2016 年本基金在方法论上得到进一步的提升。基金以“业绩加速”为纲，通过量化初选、基本面精选和估值比较终选的三个步骤，挑选出一批长线增长潜力较好，估值比较便宜的优质股票，长线持有。这些优质股票使得组合既有较好的向上弹性又有较强的抗跌性。

#### 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 1.1204 元，本报告期份额净值增长率为-15.80%，同期业绩比较基准增长率为-7.59%。

#### 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 2017 年，基金管理人认为宏观经济依然会保持稳定，货币政策会回归中性，财政政策会适度积极，供给侧改革会继续推进。行业上看，虽然产能过剩行业的集中度会继续提升，但前期部分产品价格大幅度上涨的势头会放缓。住宅后市场（如家具家电、家装建材、新风防水等）有着巨大的消费空间。新材料、新功能在智能终端市场的层出不穷和迅速普及也会带来较大的商机。实体世界和虚拟世界的融合发展依然是不可逆转的大趋势。通讯和软件行业中能受益于这个趋势的部分企业依然有较大的成长空间。企业层面看，各行业的龙头公司的竞争优势有望得到增强，具有较强品牌力的企业会进一步脱颖而出。公司间的马太效应会更加明显。从市场估值看，企业的竞争力、盈利的质量和可持续性等因素会更多地影响企业的估值水平，而讲故事、外延收购和小市值等因素对估值的影响会有所减弱。整体来看，市场定价功能会日趋理性。

本基金在 2017 年会继续贯彻以上投资方法，同时不断提高公司研究的深度和广度。用全面的指标体系和更丰富的标的储备库来提高投资决策的准确度和胜率。基金经理力争更好地发现优质公司的价值，并在其股价低估时买入，高估时卖出，为投资者创造更好的收益。

#### 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基金运营的副总经理担任，成员包括但不限于督察长、主管投研的副总经理或投资总监、基金投资部、研究部、金融工程部、固定收益部、合规风控部门、基金运营部的主要负责人；委员会秘书由基金运营部负责人担任。所有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**

根据本基金合同及本基金实际运作的情况，本基金于本报告期内未进行利润分配，目前无其他收益分配安排。

#### **4.9 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 审计报告**

本基金 2016 年年度报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计

师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可阅读年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产             | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日         |
|-----------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |                                 |                                  |
| 银行存款            | 39,970,439.33                   | 35,422,398.13                    |
| 结算备付金           | 566,644.63                      | 3,883,498.34                     |
| 存出保证金           | 104,411.74                      | 1,108,138.85                     |
| 交易性金融资产         | 910,376,533.79                  | 1,116,320,887.19                 |
| 其中：股票投资         | 626,517,533.79                  | 795,911,625.49                   |
| 基金投资            | -                               | -                                |
| 债券投资            | 283,859,000.00                  | 320,409,261.70                   |
| 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        | -                               | 5,000,122.50                     |
| 应收证券清算款         | 683,235.91                      | 12,953,925.58                    |
| 应收利息            | 1,663,780.92                    | 5,507,832.21                     |
| 应收股利            | -                               | -                                |
| 应收申购款           | 5,928.55                        | 4,828.76                         |
| 递延所得税资产         | -                               | -                                |
| 其他资产            | -                               | -                                |
| 资产总计            | 953,370,974.87                  | 1,180,201,631.56                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>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       | 15,000,000.00                   | -                                |
| 应付证券清算款         | 30,853,921.70                   | 12,830,252.98                    |
| 应付赎回款           | 114,382.74                      | 876,647.35                       |
| 应付管理人报酬         | 1,164,286.90                    | 1,473,197.23                     |
| 应付托管费           | 194,047.81                      | 245,532.87                       |
| 应付销售服务费         | -                               | -                                |

|               |                |                  |
|---------------|----------------|------------------|
| 应付交易费用        | 296,380.65     | 1,907,454.92     |
| 应交税费          | 4,110,558.54   | 4,110,558.54     |
| 应付利息          | 2,583.34       | -                |
| 应付利润          | -              | -                |
| 递延所得税负债       | -              | -                |
| 其他负债          | 606,010.68     | 226,457.79       |
| 负债合计          | 52,342,172.36  | 21,670,101.68    |
| <b>所有者权益:</b> |                |                  |
| 实收基金          | 334,359,733.22 | 361,971,356.55   |
| 未分配利润         | 566,669,069.29 | 796,560,173.33   |
| 所有者权益合计       | 901,028,802.51 | 1,158,531,529.88 |
| 负债和所有者权益总计    | 953,370,974.87 | 1,180,201,631.56 |

注： 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1204 元，基金份额总额 804,187,483.77 份。

## 7.2 利润表

会计主体：泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)

本报告期： 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年<br>12 月 31 日 |
|------------------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>            | -159,459,886.71                           | 184,273,568.26                                 |
| 1. 利息收入                | 8,009,907.98                              | 13,674,861.71                                  |
| 其中：存款利息收入              | 428,251.25                                | 874,768.80                                     |
| 债券利息收入                 | 7,280,530.43                              | 12,561,260.89                                  |
| 资产支持证券利息收入             | -                                         | -                                              |
| 买入返售金融资产收入             | 301,126.30                                | 238,832.02                                     |
| 其他利息收入                 | -                                         | -                                              |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      | -154,597,974.14                           | 1,104,323,839.35                               |
| 其中：股票投资收益              | -157,068,180.13                           | 882,498,658.76                                 |
| 基金投资收益                 | -                                         | -                                              |
| 债券投资收益                 | -1,533,776.03                             | 215,034,279.72                                 |
| 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                   | 4,003,982.02                              | 6,790,900.87                                   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -12,884,756.00                            | -934,637,311.80                                |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -                                         | -                                              |

|                            |                        |                       |
|----------------------------|------------------------|-----------------------|
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 12,935.45              | 912,179.00            |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>22,725,615.82</b>   | <b>56,675,692.72</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 14,102,802.16          | 28,298,759.79         |
| 2. 托管费                     | 2,350,466.96           | 4,716,459.88          |
| 3. 销售服务费                   | -                      | -                     |
| 4. 交易费用                    | 5,343,583.07           | 19,926,660.79         |
| 5. 利息支出                    | 304,568.59             | 3,094,533.83          |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 304,568.59             | 3,094,533.83          |
| 6. 其他费用                    | 624,195.04             | 639,278.43            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>-182,185,502.53</b> | <b>127,597,875.54</b> |
| 减：所得税费用                    | -                      | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>-182,185,502.53</b> | <b>127,597,875.54</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）                        | 361,971,356.55                         | 796,560,173.33  | 1,158,531,529.88 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -                                      | -182,185,502.53 | -182,185,502.53  |
| 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）      | -27,611,623.33                         | -47,705,601.51  | -75,317,224.84   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 4,830,614.76                           | 7,877,823.61    | 12,708,438.37    |
| 2. 基金赎回款                               | -32,442,238.09                         | -55,583,425.12  | -88,025,663.21   |
| 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                            | 334,359,733.22                         | 566,669,069.29  | 901,028,802.51   |

|                                        |                                             |                   |                   |
|----------------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| 金净值)                                   |                                             |                   |                   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）                        | 956,100,012.48                              | 2,185,140,167.55  | 3,141,240,180.03  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -                                           | 127,597,875.54    | 127,597,875.54    |
| 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）      | -594,128,655.93                             | -1,516,177,869.76 | -2,110,306,525.69 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 138,077,020.99                              | 330,176,727.71    | 468,253,748.70    |
| 2. 基金赎回款                               | -732,205,676.92                             | -1,846,354,597.47 | -2,578,560,274.39 |
| 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）                        | 361,971,356.55                              | 796,560,173.33    | 1,158,531,529.88  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF) (以下简称“本基金”，原湘财荷银效率优选混合型证券投资基金(LOF)，后更名为泰达荷银效率优选混合型证券投资基金(LOF))经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字 [2006]第 41 号《关于同意湘财荷银效率优选证券投资基金(LOF)设立的批复》核准，由湘财荷银基金管理有限公司(于 2006 年 4 月 27 日更名为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《湘财荷银效率优选混合型证券投资基金(LOF)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 4,331,970,453.84 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 54 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《湘财荷银效率优选混合型证券投资基金(LOF)基

金合同》于 2006 年 5 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,334,668,642.20 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,698,188.36 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”）。

经中国证监会同意，本基金于 2006 年 6 月 6 日更名为泰达荷银效率优选混合型证券投资基金(LOF)。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》，本基金自公告发布之日起更名为泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上字[2006]第 78 号文审核同意，本基金 256,749,748.00 份基金份额于 2006 年 7 月 21 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《泰达荷银效率优选混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》和《泰达荷银效率优选混合型证券投资基金(LOF)基金份额拆分比例的公告》的有关规定，本基金于 2007 年 8 月 27 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 2.405174385，并于 2007 年 8 月 28 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)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、可转债、央行票据、短期融资券、回购以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，其中股票投资比例范围为基金资产净值的 50%-70%，债券投资比例范围为基金资产净值的 25%-45%，现金保持在基金资产净值的 5%以上。自 2013 年 3 月 30 日起，本基金的业绩比较基准由富时中国 A600 指数收益率 $\times$ 60%+新华巴克莱资本中国国债指数收益率 $\times$ 35%+同业存款利率 $\times$ 5%，变更为富时中国 A600 指数收益率 $\times$ 60%+中证国债指数收益率 $\times$ 35%+同业存款利率 $\times$ 5%。

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 2017 年 3 月 30 日批准报出。

## 7.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（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（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 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。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。对证券投资基金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，对国债、地方政府债以及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，股票的股息、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，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。

## 7.4.7 关联方关系

| 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、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 |
| 北方国际信托股份有限公司           | 基金管理人的股东     |
| 宏利资产管理(香港)有限公司         | 基金管理人的股东     |

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。

## 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.8.1.1 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交易单元进行股票交易。

#### 7.4.8.1.2 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交易单元进行债券交易。

#### 7.4.8.1.3 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交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.8.1.4 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交易单元进行权证交易。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|                 | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年<br>12 月 31 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月<br>31 日 |
|-----------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 14,102,802.16                       | 28,298,759.79                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,083,362.71                        | 5,988,546.35                        |

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 1.50% 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 1.50% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月<br>31 日 |
|----------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,350,466.96                              | 4,716,459.88                                   |

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。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 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。

##### 7.4.8.4.2 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。

#### 7.4.8.5 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<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月<br>31 日 |            | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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 | 39,970,439.33                             | 384,684.39 | 35,422,398.13                               | 688,604.45 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按适用利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 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

| 7.4.10.1.1 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 |
| 002838               | 道恩股份 | 2016 年 12 月 28 日 | 2017 年 1 月 6 日 | 新股流通受限 | 15.28 | 15.28  | 681      | 10,405.68 | 10,405.68 | —  |
| 603186               | 华正新材 | 2016 年 12 月 26 日 | 2017 年 1 月 3 日 | 新股流通受限 | 5.37  | 5.37   | 1,874    | 10,063.38 | 10,063.38 | —  |
| 603032               | 德新交运 | 2016 年 12 月 27 日 | 2017 年 1 月 5 日 | 新股流通受限 | 5.81  | 5.81   | 1,628    | 9,458.68  | 9,458.68  | —  |
| 300586               | 美联新材 | 2016 年 12 月 26 日 | 2017 年 1 月 4 日 | 新股流通受限 | 9.30  | 9.30   | 1,006    | 9,355.80  | 9,355.80  | —  |
| 300588               | 熙菱信息 | 2016 年 12 月 27 日 | 2017 年 1 月 5 日 | 新股流通受限 | 4.94  | 4.94   | 1,380    | 6,817.20  | 6,817.20  | —  |

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

##### 7.4.9.2 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 | 期末估值单 | 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 |
|------|------|------|----|-------|------|--------|-------|--------|--------|----|
|------|------|------|----|-------|------|--------|-------|--------|--------|----|

|        |      |             | 原因   | 价      |            |        |           |               |               |   |
|--------|------|-------------|------|--------|------------|--------|-----------|---------------|---------------|---|
| 002462 | 嘉事堂  | 2016年9月28日  | 重大事项 | 43.67  | 2017年1月12日 | 38.98  | 1,013,265 | 42,553,982.60 | 44,249,282.55 | - |
| 603111 | 康尼机电 | 2016年12月26日 | 重大事项 | 14.70  | -          | -      | 679,190   | 9,085,392.11  | 9,984,093.00  | - |
| 603986 | 兆易创新 | 2016年9月19日  | 重大事项 | 177.97 | 2017年3月13日 | 195.77 | 1,133     | 26,353.58     | 201,640.01    | - |

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 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。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 15,000,000.00 元，于 2017 年 1 月 6 日（先后）到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额 572,036,417.49 元，属于第二层次的余额为 338,340,116.30 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 737,422,637.34 元，第二层次 378,898,249.85 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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<br>(%) |
|----|----------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资     | 626,517,533.79 | 65.72            |
|    | 其中：股票    | 626,517,533.79 | 65.72            |
| 2  | 固定收益投资   | 283,859,000.00 | 29.77            |
|    | 其中：债券    | 283,859,000.00 | 29.77            |
|    | 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      | 40,537,083.96  | 4.25   |
| 7 | 其他各项资产            | 2,457,357.12   | 0.26   |
| 8 | 合计                | 953,370,974.87 | 100.00 |

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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<br>(%) |
|----|------------------|----------------|------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -                |
| B  | 采矿业              | -              | -                |
| C  | 制造业              | 398,297,122.43 | 44.20            |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -                |
| E  | 建筑业              | 14,258,062.53  | 1.58             |
| F  | 批发和零售业           | 73,122,752.70  | 8.12             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 9,458.68       | 0.00             |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -                |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 109,416,056.34 | 12.14            |
| J  | 金融业              | 8,819,400.94   | 0.98             |
| K  | 房地产业             | 15,061,039.10  | 1.67             |
| L  | 租赁和商务服务业         | 7,533,641.07   | 0.84             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -                |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -              | -                |
| 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               | 626,517,533.79 | 69.53            |

## 8.2.2 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。

## 8.3 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  | 300365 | 恒华科技 | 1,182,394 | 49,069,351.00 | 5.45         |
| 2  | 002462 | 嘉事堂  | 1,013,265 | 44,249,282.55 | 4.91         |
| 3  | 002043 | 兔宝宝  | 3,470,706 | 40,156,068.42 | 4.46         |
| 4  | 600487 | 亨通光电 | 2,145,306 | 40,031,409.96 | 4.44         |
| 5  | 002007 | 华兰生物 | 1,045,817 | 37,387,957.75 | 4.15         |
| 6  | 603818 | 曲美家居 | 1,731,530 | 30,215,198.50 | 3.35         |
| 7  | 002221 | 东华能源 | 2,330,385 | 28,873,470.15 | 3.20         |
| 8  | 002705 | 新宝股份 | 1,587,377 | 26,842,545.07 | 2.98         |
| 9  | 300115 | 长盈精密 | 988,000   | 25,747,280.00 | 2.86         |
| 10 | 002182 | 云海金属 | 1,376,600 | 25,618,526.00 | 2.84         |

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年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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  | 300017 | 网宿科技 | 55,184,777.73 | 4.76           |
| 2  | 300498 | 温氏股份 | 50,017,167.38 | 4.32           |
| 3  | 300365 | 恒华科技 | 48,135,650.67 | 4.15           |
| 4  | 600900 | 长江电力 | 45,357,803.30 | 3.92           |
| 5  | 600340 | 华夏幸福 | 43,357,585.55 | 3.74           |
| 6  | 600487 | 亨通光电 | 40,900,177.80 | 3.53           |
| 7  | 601398 | 工商银行 | 40,702,433.00 | 3.51           |
| 8  | 601988 | 中国银行 | 40,473,890.00 | 3.49           |
| 9  | 002221 | 东华能源 | 36,139,536.44 | 3.12           |
| 10 | 002007 | 华兰生物 | 34,944,024.90 | 3.02           |
| 11 | 002043 | 兔宝宝  | 34,570,031.01 | 2.98           |
| 12 | 601318 | 中国平安 | 33,764,863.80 | 2.91           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 13 | 002714 | 牧原股份 | 32,263,370.99 | 2.78 |
| 14 | 603818 | 曲美家居 | 28,893,117.32 | 2.49 |
| 15 | 002458 | 益生股份 | 28,877,015.85 | 2.49 |
| 16 | 002410 | 广联达  | 28,322,269.59 | 2.44 |
| 17 | 000959 | 首钢股份 | 27,964,431.00 | 2.41 |
| 18 | 600376 | 首开股份 | 26,904,093.27 | 2.32 |
| 19 | 002705 | 新宝股份 | 26,417,343.46 | 2.28 |
| 20 | 002182 | 云海金属 | 25,734,199.70 | 2.22 |
| 21 | 002335 | 科华恒盛 | 25,016,844.12 | 2.16 |
| 22 | 600816 | 安信信托 | 24,445,680.43 | 2.11 |

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。

#### 8.4.2 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  | 000959 | 首钢股份  | 52,365,655.86 | 4.52           |
| 2  | 300498 | 温氏股份  | 51,863,999.36 | 4.48           |
| 3  | 600900 | 长江电力  | 45,447,726.14 | 3.92           |
| 4  | 601398 | 工商银行  | 42,287,368.09 | 3.65           |
| 5  | 601988 | 中国银行  | 40,253,822.54 | 3.47           |
| 6  | 002714 | 牧原股份  | 36,659,273.58 | 3.16           |
| 7  | 603111 | 康尼机电  | 35,487,286.46 | 3.06           |
| 8  | 601318 | 中国平安  | 33,710,768.12 | 2.91           |
| 9  | 600556 | ST 慧球 | 33,634,092.43 | 2.90           |
| 10 | 603456 | 九洲药业  | 31,095,165.99 | 2.68           |
| 11 | 002321 | 华英农业  | 30,924,584.46 | 2.67           |
| 12 | 600340 | 华夏幸福  | 30,432,898.45 | 2.63           |
| 13 | 002458 | 益生股份  | 30,376,268.87 | 2.62           |
| 14 | 600276 | 恒瑞医药  | 28,793,281.43 | 2.49           |
| 15 | 300017 | 网宿科技  | 27,568,888.71 | 2.38           |
| 16 | 300048 | 合康新能  | 27,264,683.41 | 2.35           |
| 17 | 600376 | 首开股份  | 27,052,704.22 | 2.34           |
| 18 | 000028 | 国药一致  | 26,827,868.94 | 2.32           |
| 19 | 002504 | 弘高创意  | 26,210,925.13 | 2.26           |
| 20 | 300113 | 顺网科技  | 25,087,636.10 | 2.17           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 21 | 300021 | 大禹节水 | 24,288,697.21 | 2.10 |
| 22 | 300005 | 探路者  | 23,977,135.32 | 2.07 |
| 23 | 002335 | 科华恒盛 | 23,874,873.04 | 2.06 |
| 24 | 600990 | 四创电子 | 23,318,917.66 | 2.01 |

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。

### 8.4.3 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 | 1,755,371,726.68 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,759,736,071.61 |

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。

### 8.5 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      | 99,216,000.00  | 11.01        |
| 2  | 央行票据      | —              | —            |
| 3  | 金融债券      | 77,540,000.00  | 8.61         |
|    | 其中：政策性金融债 | 77,540,000.00  | 8.61         |
| 4  | 企业债券      | —              | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | 19,894,000.00  | 2.21         |
| 6  | 中期票据      | 87,209,000.00  | 9.68         |
| 7  | 可转债（可交换债） | —              | —            |
| 8  | 同业存单      | —              | —            |
| 9  | 其他        | —              | —            |
| 10 | 合计        | 283,859,000.00 | 31.50        |

注：其中金融债券包含上交所地方政府债，公允价值 28,410,000，占基金资产净值比例 3.15%

### 8.6 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  | 020135    | 16 贴现国债 37    | 600,000 | 59,352,000.00 | 6.59         |
| 2  | 160202    | 16 国开 02      | 500,000 | 49,130,000.00 | 5.45         |
| 3  | 101664064 | 16 桂投资 MTN001 | 500,000 | 47,645,000.00 | 5.29         |

|   |           |                   |         |               |      |
|---|-----------|-------------------|---------|---------------|------|
| 4 | 019546    | 16 国债 18          | 400,000 | 39,864,000.00 | 4.42 |
| 5 | 101580018 | 15 泰山投资<br>MTN001 | 400,000 | 39,564,000.00 | 4.39 |

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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   | 104,411.74   |
| 2  | 应收证券清算款 | 683,235.91   |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 1,663,780.92 |
| 5  | 应收申购款   | 5,928.55     |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 2,457,357.12 |

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 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  | 002462 | 嘉事堂  | 44,249,282.55 | 4.91         | 重大事项     |

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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<br>(户) | 户均持有的<br>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 |
| 74,170       | 10,842.49     | 3,944,698.38 | 0.49%  | 800,242,785.39 | 99.51% |

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额(份) | 占上市总份额 |
|----|-------|---------|--------|
|----|-------|---------|--------|

|    |     |              | 比例    |
|----|-----|--------------|-------|
| 1  | 严事成 | 1,672,301.00 | 4.46% |
| 2  | 麦丽娟 | 1,665,546.00 | 4.44% |
| 3  | 迟安功 | 634,459.00   | 1.69% |
| 4  | 杨晓慧 | 596,100.00   | 1.59% |
| 5  | 何晓光 | 278,861.00   | 0.74% |
| 6  | 温双文 | 240,590.00   | 0.64% |
| 7  | 苏英祥 | 240,000.00   | 0.64% |
| 8  | 郭凤玲 | 237,200.00   | 0.63% |
| 9  | 陈瑞荣 | 200,100.00   | 0.53% |
| 10 | 葛蓓  | 200,000.00   | 0.53% |
| 11 | 李倩玫 | 200,000.00   | 0.53% |

注：持有人为本基金场内持有人。

### 9.3 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 | 18,082.44 | 0.0022%  |

### 9.4 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                 |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2006年5月12日）基金份额总额 | 4,334,668,642.20 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 870,597,718.35   |
| 本报告期基金总申购份额               | 11,618,351.98    |
| 减:本报告期基金总赎回份额             | 78,028,586.56    |
| 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              | 804,187,483.77   |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

1、2016 年 12 月，基金管理人职工代表大会决议公布：廖仁勇、葛文娜担任公司新一届监事会职工监事，王泉、邓艺颖不再担任职工监事。监事会其余成员保持不变。

2、2016 年 12 月，基金管理人股东会决议：刁锋担任公司新一届董事会董事，孙泉不再担任董事；张建强、查卡拉·西索瓦、樸睿波担任新一届董事会独立董事，汪丁丁、周小明、杜英华不再担任独立董事。董事会其余成员保持不变。

3、本报告期本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金无投资策略的变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用为人民币 10.60 万元，该审计机构对本基金提供审计服务的年限为 11 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |

|      |   |                | 例      |            |        |   |
|------|---|----------------|--------|------------|--------|---|
| 广发华福 | 1 | 898,678,541.65 | 25.61% | 836,937.29 | 25.61% | - |
| 海通证券 | 1 | 869,572,177.25 | 24.78% | 809,833.53 | 24.78% | - |
| 申万宏源 | 1 | 353,125,325.74 | 10.06% | 328,864.46 | 10.06% | - |
| 广州证券 | 1 | 350,435,724.17 | 9.99%  | 326,361.43 | 9.99%  | - |
| 安信证券 | 3 | 318,254,141.14 | 9.07%  | 296,390.98 | 9.07%  | - |
| 中金公司 | 1 | 214,728,054.22 | 6.12%  | 199,976.68 | 6.12%  | - |
| 光大证券 | 1 | 190,552,840.86 | 5.43%  | 177,462.50 | 5.43%  | - |
| 东兴证券 | 2 | 138,907,805.82 | 3.96%  | 129,365.35 | 3.96%  | - |
| 华泰证券 | 1 | 88,461,997.31  | 2.52%  | 82,384.71  | 2.52%  | - |
| 万联证券 | 1 | 36,845,953.72  | 1.05%  | 34,314.66  | 1.05%  | - |
| 中泰证券 | 2 | 30,012,533.12  | 0.86%  | 27,950.74  | 0.86%  | - |
| 国信证券 | 2 | 19,604,247.17  | 0.56%  | 18,257.50  | 0.56%  | - |
| 国泰君安 | 1 | -              | -      | -          | -      | - |
| 银河证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | - |
| 民生证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | - |
| 高华证券 | 3 | -              | -      | -          | -      | - |
| 东方证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | - |
| 中信建投 | 1 | -              | -      | -          | -      | - |
| 长江证券 | 2 | -              | -      | -          | -      | - |
| 中信证券 | 3 | -              | -      | -          | -      | - |
| 招商证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | - |
| 瑞银证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | - |
| 浙商证券 | 2 | -              | -      | -          | -      | - |
| 中银国际 | 2 | -              | -      | -          | -      | - |
| 财富证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | - |
| 中投证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | - |
| 湘财证券 | 2 | -              | -      | -          | -      | - |
| 渤海证券 | 2 | -              | -      | -          | -      | - |

(一) 2016 年本基金开通财富证券交易单元；撤销德邦证券交易单元。

(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，使用其席位作为基金的专用交易单元，选择的的标准是：

(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。

### 11.7.2 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 |
| 广发华福 | 141,307,244.10 | 64.70%       | 817,000,000.00 | 88.23%         | -    | -            |
| 海通证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 申万宏源 | 39,300,927.60  | 17.99%       | 109,000,000.00 | 11.77%         | -    | -            |
| 广州证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 安信证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中金公司 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 光大证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 东兴证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 华泰证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 万联证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中泰证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 国信证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 国泰君安 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 银河证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 民生证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 高华证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 东方证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中信建投 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 长江证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中信证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 招商证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 瑞银证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 浙商证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中银国际 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 财富证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中投证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 湘财证券 | 37,803,427.25  | 17.31%       | -              | -              | -    | -            |
| 渤海证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |

泰达宏利基金管理有限公司  
2017 年 3 月 30 日