

泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金 2016 年年度报告

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。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。

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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
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.....	14
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告	43
8.1 期末基金资产组合情况.....	43
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
8.3 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.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
8.7 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.....	58

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	58
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	58
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
8.12	投资组合报告附注	59
§9	基金份额持有人信息	60
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
9.2	期末上市基金前十名持有人	61
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	62
§10	开放式基金份额变动	62
§11	重大事件揭示	62
11.1	基金份额持有人大会决议	62
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	63
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
11.4	基金投资策略的改变	63
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	63
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
11.8	其他重大事件	65
§12	备查文件目录	66
12.1	备查文件目录	66
12.2	存放地点	66
12.3	查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金		
基金简称	泰达宏利 500 指数分级		
基金主代码	162216		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011 年 12 月 1 日		
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	228,701,417.05 份		
基金合同存续期	持续经营		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2011 年 12 月 20 日		
下属分级基金的基金简称	泰达 500A	泰达 500B	泰达中证 500
下属分级基金的交易代码	150053	150054	162216
报告期末下属分级基金份额总额	5,205,756.00 份	7,808,634.00 份	215,687,027.05 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证 500 指数，力争获取与标的指数相似的投资收益，并将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。		
投资策略	本基金采用指数完全复制方法，原则上按照标的指数成份股及其权重构建基金的投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整，以达到跟踪和复制指数的目的。但如遇特殊情况（如市场流动性不足、成份股被限制投资等）致使基金无法购得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理的方法进行适当替代，以实现跟踪误差的有效控制。		
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times 1 \text{ 年期定期存款利率（税后）}$		
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，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混合型基金、债券型基金和货币市场基金。		
下属分级基金的风险收益特征	泰达 500A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征	泰达 500B 份额具有高风险、高预期收益的特征	-

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈沛	王永民
	联系电话	010-66577808	010-66594896
	电子邮箱	irm@mfteda.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-69-88888	95566
传真		010-66577666	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		弓劲梅	田国立

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http:// www.mfteda.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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	461,042.71	53,113,913.05	8,202,255.07
本期利润	-5,725,310.64	53,550,237.71	6,333,196.82
加权平均基金份额本期利润	-0.0692	0.6662	0.3153

本期加权平均净值利润率	-7.27%	56.88%	25.62%
本期基金份额净值增长率	-7.73%	57.06%	32.25%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	116,961,156.02	29,112,332.22	28,054,978.63
期末可供分配基金份额利润	0.5114	0.6011	0.4384
期末基金资产净值	220,321,657.80	51,380,292.18	88,594,754.62
期末基金份额净值	0.9634	1.0608	1.3844
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	112.14%	129.92%	46.39%

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

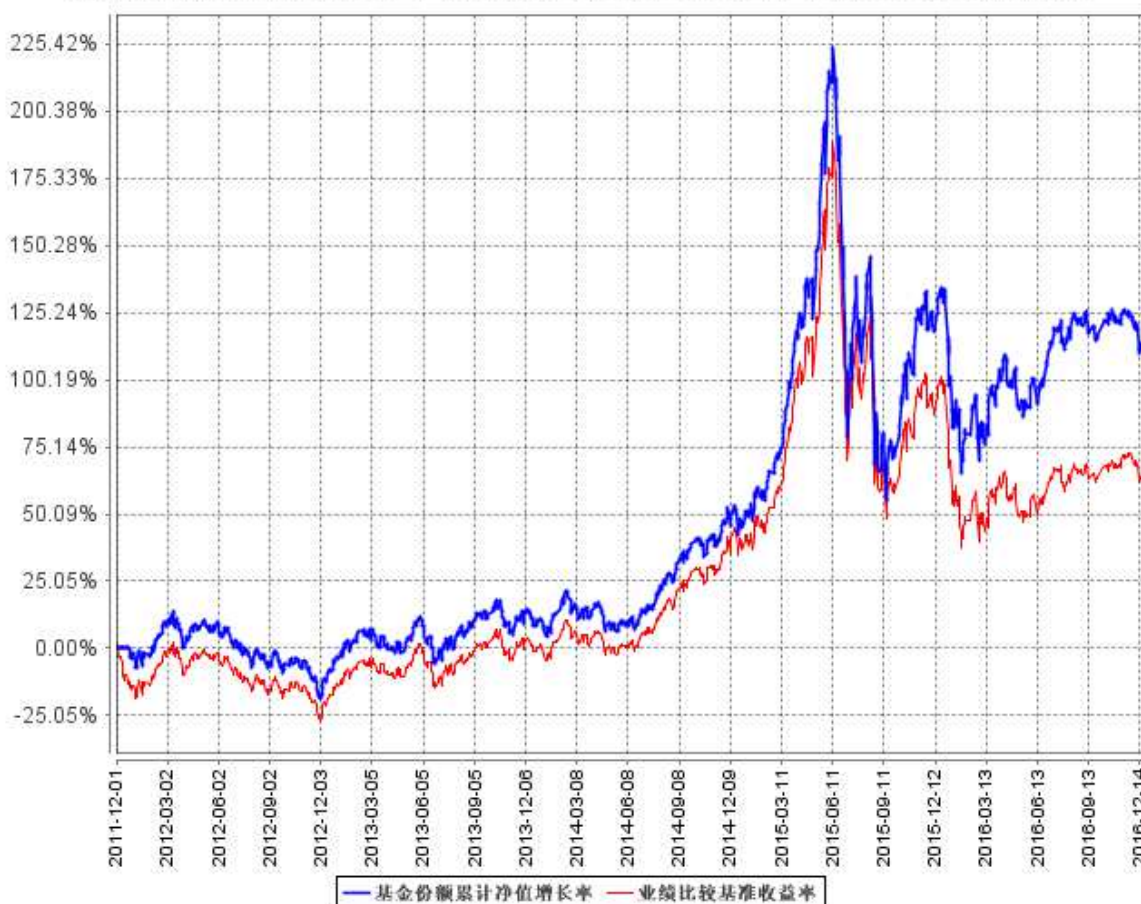
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-2.17%	0.81%	-0.94%	0.78%	-1.23%	0.03%
过去六个月	2.57%	0.89%	2.24%	0.88%	0.33%	0.01%
过去一年	-7.73%	1.89%	-16.72%	1.81%	8.99%	0.08%
过去三年	91.65%	2.14%	61.39%	1.98%	30.26%	0.16%
过去五年	116.47%	1.88%	88.74%	1.78%	27.73%	0.10%
自基金合同生效起至今	112.14%	1.86%	62.73%	1.78%	49.41%	0.08%

注：本基金的业绩比较基准：中证 500 指数收益率*95%+1 年期定期存款利率*5%。

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

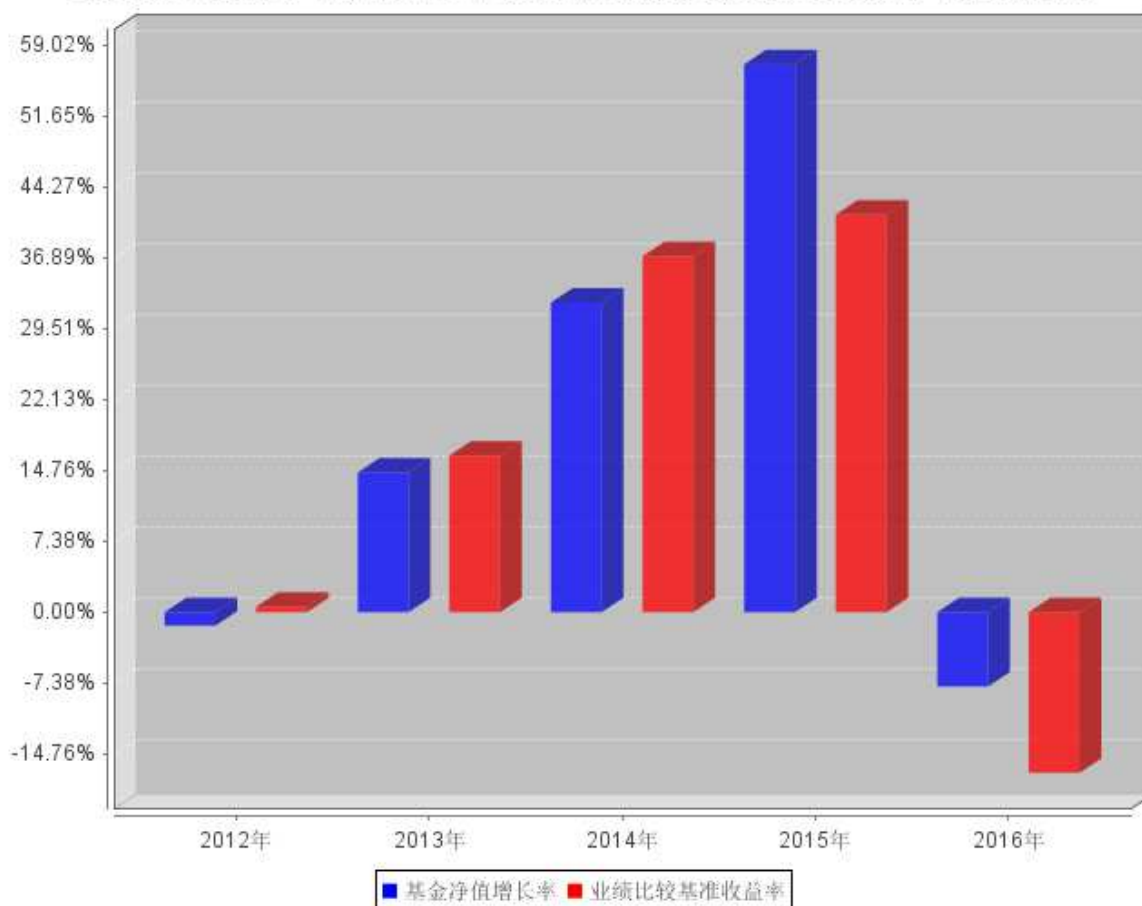
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

根据本基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额、泰达 500B 份额）不进行收益分配。

§ 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、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		
杨超	本基金基金经理	2014 年 10 月 13 日	-	6	毕业于英国威尔士斯旺西大学，数学与金融计算硕士。2010 年 5 月加入建信基金管理有限公司，从事金融工程等工作，先后担任投资管理部助理研究员、

					初级研究员、基金经理助理等职务。2014 年 6 月加入泰达宏利基金管理有限公司。具备 6 年证券基金从业经验，6 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
刘欣	本基金基金经理，金融工程部总经理	2012 年 8 月 14 日	2016 年 3 月 16 日	9	理学硕士。2007 年 7 月至 2008 年 12 月就职于工银瑞信基金管理有限公司任定量分析师；2008 年 12 月至 2011 年 7 月就职于嘉实基金管理有限公司任定量分析师；2011 年 7 月加盟泰达宏利基金管理有限公司，担任金融工程部总经理；具备 9 年基金从业经验，9 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

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 年度，在经济增速放缓的背景下，汇率冲击和流动性环境的趋紧使得整体市场波动加大。中证 500 指数在年初熔断期间出现急剧下跌后缓慢上涨，但是在四季度受成长股下跌的影响，全

年下跌 16.28%。本基金恪守基金合同，运用多种技术克服申购赎回带来的不利冲击的同时，积极应对市场微观结构变化对跟踪误差带来的不利影响，全年在把跟踪误差控制在了合理水平之内的同时为基金创造了一定幅度的超额收益。

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 0.9634 元，本报告期份额净值增长率为-7.73%，同期业绩比较基准增长率为-16.72%。

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，中国经济有望出现缓慢的复苏趋势，在流动性不再扩张的大背景下，投资者对实际经济的基本面，特别是盈利质量将愈发关注。本基金将继续遵循基金合同，积极控制跟踪误差和指数偏离。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，基金管理人为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，督察长、监察稽核部、风险管理部定期与不定期的对基金的投资、交易、研发、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的监督检查。

同时，公司制定了具体严格的投资授权流程与权限；在证券投资交易前由研究部门建立可供投资的基础库并定期进行全面维护更新和适时对个股进行维护更新，通过信息技术建立多级投资交易预警系统，并把禁选股票排除在交易系统之外；设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；引入外方股东在风险控制方面的先进经验，完善公司风险管理指标及流程，监控公司各项业务的运作状况和风险程度；独立于各业务部门的内部监察人员日常对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报公司董事会及外部监管部门。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额、泰达 500B 份额）不进行收益分配。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 21838 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金(以下简称“泰达宏利中证 500 指数基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是泰达宏利中证 500 指数基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表,并使其实现公允反映;</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为,上述泰达宏利中证 500 指数基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国

	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，公允反映了泰达宏利中证 500 指数基金 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。	
注册会计师的姓名	单峰	庞伊君
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	13,078,985.43	2,762,424.42
结算备付金		915,205.43	220,452.88
存出保证金		60,723.57	170,743.52
交易性金融资产	7.4.7.2	208,217,805.15	48,544,358.75
其中：股票投资		208,217,805.15	48,544,358.75
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	3,069.44	690.32
应收股利		-	-
应收申购款		50,029.63	67,126.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		222,325,818.65	51,765,796.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,363,770.75	-
应付赎回款		30,893.64	91,347.75
应付管理人报酬		160,010.99	44,311.06
应付托管费		32,002.18	8,862.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	259,682.89	111,937.88
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	157,800.40	129,044.95
负债合计		2,004,160.85	385,503.86
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	103,360,501.78	22,267,959.96
未分配利润	7.4.7.10	116,961,156.02	29,112,332.22
所有者权益合计		220,321,657.80	51,380,292.18
负债和所有者权益总计		222,325,818.65	51,765,796.04

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9634 元，基金份额总额 228,701,417.05 份，其中下属泰达中证 500 份额 215,687,027.05 份，泰达 500A 份额 5,205,756.00 份，泰达 500B 份额 7,808,634.00 份。下属泰达中证 500 份额净值 0.9634 元，泰达 500A 份额净值 1.0500 元，泰达 500B 份额净值 0.9057 元。

7.2 利润表

会计主体：泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金

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	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-3,649,677.63	56,779,171.69
1.利息收入		57,592.84	52,262.47
其中：存款利息收入	7.4.7.11	57,592.84	52,262.47
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		-	-

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,391,937.89	55,654,168.24
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,303,105.17	55,009,813.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	726,280.00	-
股利收益	7.4.7.16	362,552.72	644,355.01
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-6,186,353.35	436,324.66
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	87,144.99	636,416.32
减：二、费用		2,075,633.01	3,228,933.98
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	769,439.97	932,802.35
2. 托管费	7.4.10.2.2	153,887.93	186,560.51
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	960,950.24	1,883,149.31
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	191,354.87	226,421.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,725,310.64	53,550,237.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,725,310.64	53,550,237.71

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金

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 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）	22,267,959.96	29,112,332.22	51,380,292.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	-5,725,310.64	-5,725,310.64

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)	81,092,541.82	93,574,134.44	174,666,676.26
其中：1. 基金申购款	115,146,382.97	130,751,618.43	245,898,001.40
2. 基金赎回款	-34,053,841.15	-37,177,483.99	-71,231,325.14
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)	103,360,501.78	116,961,156.02	220,321,657.80
项目	上年度可比期间 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)	60,539,775.99	28,054,978.63	88,594,754.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	53,550,237.71	53,550,237.71
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)	-38,271,816.03	-52,492,884.12	-90,764,700.15
其中：1. 基金申购款	171,962,326.49	249,466,198.64	421,428,525.13
2. 基金赎回款	-210,234,142.52	-301,959,082.76	-512,193,225.28
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)	22,267,959.96	29,112,332.22	51,380,292.18

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

泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2011]第 1338 号《关于核准泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金募集的批复》核准,由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《泰达宏利中证 500 指数分级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 1,435,113,080.87 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(2011)第 466 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》于 2011 年 12 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,435,467,765.48 份基金份额,其中认购资金利息折合 354,684.61 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,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》和《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金的基金份额包括泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“泰达中证 500 份额”)、泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额与泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金之进取收益类份额。根据《关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金变更场内基金简称的公告》,本基金自 2015 年 6 月 26 日起变更子份额的场内简称,泰达中证 500 之泰达稳健份额的简称由泰达稳健份额变更为泰达 500A 份额(以下统一简称“泰达 500A 份额”),泰达中证 500 之泰达进取份额的简称由泰达进取份额变更为泰达 500B 份额(以下统一简称“泰达 500B 份额”)。其中,泰达 500A 份额、泰达 500B 份额的基金份额配比始终保持 4:6 的比率不变。本基金通过场外、场内两种方式公开发售。本基金发售结束后,投资者场外认购的全部份额将确认为泰达中证 500 份额;投资者场内认购的全部份额将按 4:6 的比率自动分离为预期收益与风险不同的两种份额类别,即泰达 500A 份额和泰达 500B 份额。两类基金份额的基金资产合并运作。泰达中证 500 份额只可以进行场内与场外的申购和赎回,但不上市交易。泰达 500A 份额和泰达 500B 份额只可在深圳证券交易所上市交易,不可单独进行申购或赎回。本基金在每个工作日按基金合同约定的净值计算规则对泰达 500A 份额和泰达 500B 份额分别进行参考净值计算,本基金净资产优先确保泰达 500A 份额的本金及泰达 500A 份额累计约定日应得收益;本基金在优先确保泰达 500A 份额的本金及累计约定日应得收益后的剩余净资产计为泰达 500B 份额的净资产。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2011]第 379 号文审核同意,本基金泰达

500A 份额 74,125,804.00 份，泰达 500B 份额 111,188,706.00 份，于 2011 年 12 月 22 日在深交所挂牌交易。未上市交易的泰达中证 500 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，选择将泰达中证 500 份额拆分为泰达 500A 份额和泰达 500B 份额后即可上市流通。

在泰达 500A 份额、泰达中证 500 份额存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日，本基金将根据基金合同的规定进行基金的定期份额折算。在基金份额折算前与折算后，泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的份额配比保持 4:6 的比例。对于泰达 500A 份额期末的约定应得收益，即泰达 500A 份额每个会计年度 12 月 31 日份额参考净值超出 1.0000 元部分，将折算为泰达中证 500 份额的场内份额分配给泰达 500A 份额持有人。除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行不定期份额折算，即：当泰达中证 500 份额净值大于或等于 2.0000 元；当泰达 500B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元。当泰达中证 500 份额的基金份额净值大于或等于 2.0000 元后，本基金将分别对泰达 500A 份额、泰达 500B 份额和泰达中证 500 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的比例为 4:6，份额折算后泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的参考净值以及泰达中证 500 份额的基金份额净值均调整为 1.0000 元。当泰达 500B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元后，本基金将分别对泰达 500A 份额、泰达 500B 份额和泰达中证 500 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的比例为 4:6，份额折算后泰达中证 500 份额净值、泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.0000 元。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪中证 500 指数，力争获取与标的指数相似的投资收益。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、新股、固定收益产品、货币市场工具、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)占基金资产的比例为 85%-100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times 1 \text{ 年期定期存款利率 (税后)}$ 。

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》、《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》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相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 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》，在存续期内，本基金(包括泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额、泰达 500B 份额)不进行收益分配。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的

经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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政策的补充通知》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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	13,078,985.43	2,762,424.42
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	13,078,985.43	2,762,424.42

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	214,845,527.63	208,217,805.15	-6,627,722.48
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	214,845,527.63	208,217,805.15	-6,627,722.48
项目	上年度末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	48,985,727.88	48,544,358.75	-441,369.13
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	48,985,727.88	48,544,358.75	-441,369.13

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未进行买断式逆回购交易。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	2,629.25	510.44
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	408.40	99.22
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.19	3.86
应收黄金合约拆借孳息	-	-

其他	31.60	76.80
合计	3,069.44	690.32

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	259,682.89	111,937.88
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	259,682.89	111,937.88

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	100.90	344.19
预提费用	151,000.00	126,000.00
指数使用费	6,699.50	2,700.76
合计	157,800.40	129,044.95

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,434,460.99	22,267,959.96
本期申购	246,902.90	113,512.48
本期赎回（以“-”号填列）	-153,989.96	-70,796.18
2016 年 1 月 4 日 基金拆分/份 额折算前	48,527,373.93	22,310,676.26
基金拆分/份额折算变动份额	838,715.49	-
本期申购	254,528,557.08	115,032,870.49
本期赎回（以“-”号填列）	-75,193,229.45	-33,983,044.97
本期末	228,701,417.05	103,360,501.78

注：1. 根据《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》，本基金的泰达 500A 份额、泰达 500B 份额不接受投资者的申购与赎回；在本基金基金合同生效后，投资者可通过场内或场外两种方式对泰达中证 500 份额进行日常的申购与赎回。

2. 截至 2016 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 14,741,916.00 份，其中泰达 500A 份额为 5,205,756.00 份，泰达 500B 份额 7,808,634.00 份，泰达中证 500 份额 1,727,526.00 份（2015 年 12 月 31 日：深交所上市的基金份额 17,240,464.00 份，泰达 500A 份额 6,289,500.00 份，泰达 500B 份额 9,434,250.00 份，泰达中证 500 份额 1,516,714.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 213,959,501.05 份（2015 年 12 月 31 日：31,193,996.99 份）。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或在场内申购和赎回泰达中证 500 份额，投资者可选择将其场内申购的泰达中证 500 份额按 4:6 的比例分拆成泰达 500A 份额和泰达 500B 份额，投资者可按 4:6 的配比将其持有的泰达 500A 份额和泰达 500B 份额申请合并为泰达中证 500 份额后赎回。未上市的基金份额登记在证券登记系统，按基金份额净值申购或赎回。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，选择将泰达中证 500 分拆为泰达 500A 份额和泰达 500B 份额后即可上市流通。

3. 根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金于 2016 年 1 月 4 日进行了定期折算。详情请见泰达宏利基金管理有限公司发布的相关份额折算公告。

7.4.7.10 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	29,388,707.59	-276,375.37	29,112,332.22
本期利润	461,042.71	-6,186,353.35	-5,725,310.64
本期基金份额交易产生的变动数	106,272,808.00	-12,698,673.56	93,574,134.44
其中：基金申购款	147,974,525.98	-17,222,907.55	130,751,618.43
基金赎回款	-41,701,717.98	4,524,233.99	-37,177,483.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	136,122,558.30	-19,161,402.28	116,961,156.02

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	39,063.76	41,657.50
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	4,535.36	8,236.44
其他	13,993.72	2,368.53
合计	57,592.84	52,262.47

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	260,747,573.65	649,255,339.21
减：卖出股票成本总额	259,444,468.48	594,245,525.98
买卖股票差价收入	1,303,105.17	55,009,813.23

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间未有债券投资收益-买卖债券差价收入。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未有资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均未有贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有贵金属投资赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有贵金属投资申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间收益金 额 2015年1月1日至2015 年12月31日
权证投资收益	-	-
股指期货-投资收益	726,280.00	-

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
股票投资产生的股利收益	362,552.72	644,355.01
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	362,552.72	644,355.01

7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-6,186,353.35	436,324.66
——股票投资	-6,186,353.35	436,324.66
——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	-6,186,353.35	436,324.66

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	87,144.99	636,416.32
其他	-	-
合计	87,144.99	636,416.32

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	960,950.24	1,883,149.31
银行间市场交易费用	-	-
合计	960,950.24	1,883,149.31

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	66,000.00	66,000.00
信息披露费	25,000.00	50,000.00

其他	200.00	200.00
上市费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	15,388.77	18,656.09
银行间账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行费用	6,766.10	13,565.72
-	-	-
合计	191,354.87	226,421.81

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 50,000 元。该下限超出当季累计指数使用费的部分由基金管理人自行承担，不作为基金费用从基金财产中列支。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

1. 根据《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》，深交所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金以 2017 年 1 月 3 日为份额折算基准日，对泰达宏利中证 500 指数份额的场外份额、场内份额以及泰达 500A 份额实施定期份额折算。

2. 财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税[2016]140 号），要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2 号），2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。截至本财务报表批准报出日止，上述税收政策对本基金截至 2016 年 12 月 31 日止年度的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 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交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 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交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 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交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	769,439.97	932,802.35
其中：支付销售机构的客户维护费	217,517.37	177,216.58

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 1.00% 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 × 1.00% / 当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	153,887.93	186,560.51

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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×0.20%/当年天数。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 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
中国银行	13,078,985.43	39,063.76	2,762,424.42	41,657.50

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

根据本基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额、泰达 500B 份额）不进行收益分配。

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

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
300583	赛托生物	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股流通受限	21.30	21.30	2,989	63,665.70	63,665.70	-
603689	皖天然气	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603266	天龙股份	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	10.44	10.44	2,117	22,101.48	22,101.48	-
603228	景旺电子	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	23.16	23.16	894	20,705.04	20,705.04	-
300587	天铁股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
300591	万里马	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-

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。

7.4.12.2 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
002491	通鼎互联	2016 年 12 月 22 日	重大事项	15.54	2017 年 1 月 3 日	15.89	150,000	2,388,108.00	2,331,000.00	-
600537	亿晶光电	2016 年 12 月 27 日	重大事项	7.43	2017 年 1 月 13 日	8.17	287,800	2,133,930.23	2,138,354.00	-
002727	一心堂	2016 年 12 月 28 日	重大事项	21.20	2017 年 1 月 5 日	21.66	57,600	1,205,876.80	1,221,120.00	-
002681	奋达科技	2016 年 12 月 19 日	重大事项	12.93	-	-	64,000	817,621.00	827,520.00	-
002602	世纪华通	2016 年 12 月 15 日	重大事项	46.89	2017 年 1 月 9 日	50.00	14,300	674,490.00	670,527.00	-

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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场正回购余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只股票型指数投资基金，属于高风险品种。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。

7.4.13.1 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。风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

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。

7.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，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，因此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 12 月 31 日，本基金未持有债券投资资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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 12 月 31 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、结算备付金及存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	13,078,985.43	-	-	-	13,078,985.43
结算备付金	915,205.43	-	-	-	915,205.43
存出保证金	60,723.57	-	-	-	60,723.57
交易性金融资产	-	-	-	-208,217,805.15	208,217,805.15
应收利息	-	-	-	3,069.44	3,069.44
应收申购款	-	-	-	50,029.63	50,029.63
资产总计	14,054,914.43	-	-	-208,270,904.22	222,325,818.65
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,363,770.75	1,363,770.75
应付赎回款	-	-	-	30,893.64	30,893.64
应付管理人报酬	-	-	-	160,010.99	160,010.99
应付托管费	-	-	-	32,002.18	32,002.18
应付交易费用	-	-	-	259,682.89	259,682.89
其他负债	-	-	-	157,800.40	157,800.40
负债总计	-	-	-	2,004,160.85	2,004,160.85
利率敏感度缺口	14,054,914.43	-	-	-206,266,743.37	220,321,657.80
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	2,762,424.42	-	-	-	2,762,424.42
结算备付金	220,452.88	-	-	-	220,452.88
存出保证金	170,743.52	-	-	-	170,743.52
交易性金融资产	-	-	-	48,544,358.75	48,544,358.75
应收利息	-	-	-	690.32	690.32
应收申购款	3,181.51	-	-	63,944.64	67,126.15
资产总计	3,156,802.33	-	-	48,608,993.71	51,765,796.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	91,347.75	91,347.75
应付管理人报酬	-	-	-	44,311.06	44,311.06
应付托管费	-	-	-	8,862.22	8,862.22
应付交易费用	-	-	-	111,937.88	111,937.88
其他负债	-	-	-	129,044.95	129,044.95
负债总计	-	-	-	385,503.86	385,503.86
利率敏感度缺口	3,156,802.33	-	-	48,223,489.85	51,380,292.18

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有的交易性债券投资(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重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 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。本基金的投资组合中股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)占基金资产的比例为 85%-100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	208,217,805.15	94.51	48,544,358.75	94.48
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	208,217,805.15	94.51	48,544,358.75	94.48

7.4.13.4.3.2 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12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	13,700,000.00	2,590,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-13,700,000.00	-2,590,000.00

7.4.14 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资产中属于第一层次的余额为 200,758,772.76 元，属于第二层次的余额为 7,459,032.39 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 44,336,278.20 元，第二层次 4,208,080.55 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 (%)
1	权益投资	208,217,805.15	93.65
	其中：股票	208,217,805.15	93.65
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	13,994,190.86	6.29
7	其他各项资产	113,822.64	0.05
8	合计	222,325,818.65	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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	934,984.80	0.42
B	采矿业	9,109,378.00	4.13
C	制造业	115,324,357.57	52.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,540,475.78	1.61
E	建筑业	929,772.00	0.42
F	批发和零售业	13,069,385.00	5.93
G	交通运输、仓储和邮政业	4,933,361.60	2.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,398,587.82	6.08
J	金融业	1,883,476.00	0.85
K	房地产业	15,562,505.00	7.06
L	租赁和商务服务业	4,076,168.00	1.85
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,370,679.00	1.08
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	759,534.00	0.34
S	综合	1,920,448.75	0.87
	合计	187,813,113.32	85.24

8.2.2 期末积极投资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	1,432,230.96	0.65
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,367,193.13	5.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,690,536.66	0.77
E	建筑业	1,673,361.00	0.76
F	批发和零售业	2,544,756.00	1.16

G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	334,396.08	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	302,941.00	0.14
J	金融业	612.00	0.00
K	房地产业	58,665.00	0.03
L	租赁和商务服务业	-	-
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	20,404,691.83	9.26

8.2.3 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所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600079	人福医药	139,700	2,787,015.00	1.26
2	600522	中天科技	258,800	2,725,164.00	1.24
3	601012	隆基股份	197,500	2,644,525.00	1.20
4	600487	亨通光电	136,200	2,541,492.00	1.15
5	600879	航天电子	161,773	2,465,420.52	1.12
6	600503	华丽家族	292,200	2,422,338.00	1.10
7	002573	清新环境	135,700	2,370,679.00	1.08
8	002001	新和成	120,700	2,365,720.00	1.07
9	600635	大众公用	392,800	2,360,728.00	1.07
10	002491	通鼎互联	150,000	2,331,000.00	1.06

11	600664	哈药股份	271,230	2,327,153.40	1.06
12	002410	广联达	158,300	2,311,180.00	1.05
13	000959	首钢股份	347,300	2,299,126.00	1.04
14	600388	龙净环保	184,900	2,287,213.00	1.04
15	600094	大名城	256,600	2,283,740.00	1.04
16	002217	合力泰	126,300	2,260,770.00	1.03
17	600056	中国医药	117,920	2,244,017.60	1.02
18	002048	宁波华翔	101,308	2,242,959.12	1.02
19	002155	湖南黄金	192,800	2,207,560.00	1.00
20	300287	飞利信	184,800	2,199,120.00	1.00
21	601231	环旭电子	205,300	2,198,763.00	1.00
22	600597	光明乳业	167,000	2,181,020.00	0.99
23	000028	国药一致	32,200	2,154,180.00	0.98
24	600600	青岛啤酒	73,100	2,152,064.00	0.98
25	600216	浙江医药	169,500	2,149,260.00	0.98
26	600537	亿晶光电	287,800	2,138,354.00	0.97
27	600736	苏州高新	235,200	2,123,856.00	0.96
28	002503	搜于特	147,000	2,115,330.00	0.96
29	002589	瑞康医药	64,800	2,102,760.00	0.95
30	002285	世联行	276,340	2,100,184.00	0.95
31	002581	未名医药	86,348	2,095,665.96	0.95
32	600729	重庆百货	87,000	2,038,410.00	0.93
33	000877	天山股份	288,500	2,033,925.00	0.92
34	000973	佛塑科技	269,981	2,024,857.50	0.92
35	000861	海印股份	417,280	2,023,808.00	0.92
36	600395	盘江股份	243,300	1,963,431.00	0.89
37	002238	天威视讯	133,598	1,957,210.70	0.89
38	300043	星辉娱乐	192,900	1,956,006.00	0.89
39	600022	山东钢铁	755,400	1,888,500.00	0.86
40	600291	西水股份	98,200	1,883,476.00	0.85
41	000426	兴业矿业	215,200	1,876,544.00	0.85
42	600460	士兰微	301,200	1,873,464.00	0.85
43	002249	大洋电机	215,100	1,856,313.00	0.84
44	600468	百利电气	142,500	1,855,350.00	0.84
45	603589	口子窖	52,800	1,696,464.00	0.77
46	002460	赣锋锂业	63,900	1,693,989.00	0.77
47	600122	宏图高科	131,200	1,603,264.00	0.73
48	601001	大同煤业	259,400	1,584,934.00	0.72
49	300156	神雾环保	63,000	1,575,630.00	0.72

50	600699	均胜电子	46,400	1,535,376.00	0.70
51	600200	江苏吴中	79,100	1,527,421.00	0.69
52	002092	中泰化学	125,600	1,519,760.00	0.69
53	600466	蓝光发展	156,400	1,512,388.00	0.69
54	000636	风华高科	147,500	1,439,600.00	0.65
55	600409	三友化工	152,100	1,428,219.00	0.65
56	002244	滨江集团	203,200	1,418,336.00	0.64
57	002261	拓维信息	118,700	1,414,904.00	0.64
58	600240	华业资本	131,400	1,411,236.00	0.64
59	000810	创维数字	98,600	1,387,302.00	0.63
60	601233	桐昆股份	96,500	1,385,740.00	0.63
61	600611	大众交通	210,200	1,381,014.00	0.63
62	600298	安琪酵母	76,800	1,368,576.00	0.62
63	600978	宜华生活	126,600	1,348,290.00	0.61
64	300113	顺网科技	50,100	1,347,189.00	0.61
65	002223	鱼跃医疗	43,300	1,343,166.00	0.61
66	000960	锡业股份	101,500	1,331,680.00	0.60
67	000078	海王生物	209,800	1,321,740.00	0.60
68	002050	三花智控	119,600	1,320,384.00	0.60
69	300324	旋极信息	68,100	1,316,373.00	0.60
70	002603	以岭药业	75,578	1,302,964.72	0.59
71	600026	中远海能	187,500	1,276,875.00	0.58
72	600138	中青旅	60,300	1,264,491.00	0.57
73	600720	祁连山	153,200	1,251,644.00	0.57
74	002727	一心堂	57,600	1,221,120.00	0.55
75	600970	中材国际	169,650	1,202,818.50	0.55
76	601002	晋亿实业	126,100	1,200,472.00	0.54
77	002273	水晶光电	59,900	1,192,010.00	0.54
78	600750	江中药业	38,500	1,186,570.00	0.54
79	000997	新大陆	59,900	1,163,857.00	0.53
80	600160	巨化股份	107,652	1,138,958.16	0.52
81	000021	深科技	120,600	1,137,258.00	0.52
82	600869	智慧能源	142,900	1,106,046.00	0.50
83	600748	上实发展	134,400	1,100,736.00	0.50
84	600751	天海投资	128,000	1,070,080.00	0.49
85	600967	北方创业	76,503	1,038,145.71	0.47
86	600594	益佰制药	59,900	997,335.00	0.45
87	600312	平高电气	62,600	977,812.00	0.44
88	002551	尚荣医疗	48,500	965,635.00	0.44

89	002408	齐翔腾达	87,100	958,100.00	0.43
90	300253	卫宁健康	48,868	957,324.12	0.43
91	002505	大康农业	264,120	934,984.80	0.42
92	002431	棕榈股份	101,400	928,824.00	0.42
93	002221	东华能源	74,600	924,294.00	0.42
94	600260	凯乐科技	59,400	919,512.00	0.42
95	600516	方大炭素	95,868	887,737.68	0.40
96	600335	国机汽车	72,700	883,305.00	0.40
97	002340	格林美	133,400	873,770.00	0.40
98	002311	海大集团	57,214	861,070.70	0.39
99	601000	唐山港	210,260	843,142.60	0.38
100	002384	东山精密	42,300	829,503.00	0.38
101	002681	奋达科技	64,000	827,520.00	0.38
102	600755	厦门国贸	99,800	818,360.00	0.37
103	000031	中粮地产	90,550	807,706.00	0.37
104	600220	江苏阳光	185,100	803,334.00	0.36
105	600835	上海机电	39,600	772,992.00	0.35
106	002463	沪电股份	159,200	760,976.00	0.35
107	600757	长江传媒	91,400	759,534.00	0.34
108	000919	金陵药业	55,400	749,562.00	0.34
109	600640	号百控股	37,300	745,254.00	0.34
110	002078	太阳纸业	109,700	732,796.00	0.33
111	000012	南玻A	60,900	690,606.00	0.31
112	002308	威创股份	45,600	672,144.00	0.31
113	002179	中航光电	18,500	671,365.00	0.30
114	002602	世纪华通	14,300	670,527.00	0.30
115	600073	上海梅林	58,100	665,245.00	0.30
116	002093	国脉科技	59,500	658,665.00	0.30
117	000937	冀中能源	93,050	627,157.00	0.28
118	600433	冠豪高新	74,200	595,084.00	0.27
119	600436	片仔癀	12,300	563,217.00	0.26
120	600971	恒源煤电	85,600	536,712.00	0.24
121	000400	许继电气	27,900	506,385.00	0.23
122	002444	巨星科技	30,000	468,000.00	0.21
123	600187	国中水务	84,102	453,309.78	0.21
124	600183	生益科技	40,200	442,200.00	0.20
125	000598	兴蓉环境	72,100	415,296.00	0.19
126	600584	长电科技	23,100	407,715.00	0.19
127	600006	东风汽车	54,200	372,896.00	0.17

128	600525	长园集团	26,280	366,606.00	0.17
129	600575	皖江物流	63,000	362,250.00	0.16
130	002512	达华智能	20,200	329,866.00	0.15
131	002128	露天煤业	36,400	313,040.00	0.14
132	600651	飞乐音响	28,900	304,317.00	0.14
133	002407	多氟多	11,000	300,190.00	0.14
134	000541	佛山照明	29,700	292,248.00	0.13
135	600219	南山铝业	93,200	287,988.00	0.13
136	000661	长春高新	2,500	279,625.00	0.13
137	002271	东方雨虹	12,700	275,463.00	0.13
138	600770	综艺股份	22,765	235,617.75	0.11
139	000572	海马汽车	43,700	234,232.00	0.11
140	002327	富安娜	26,500	233,200.00	0.11
141	600639	浦东金桥	10,700	198,592.00	0.09
142	000667	美好置业	49,700	183,393.00	0.08
143	000939	凯迪生态	13,500	173,745.00	0.08
144	002345	潮宏基	13,200	159,456.00	0.07
145	600175	美都能源	31,800	157,410.00	0.07
146	600143	金发科技	18,200	141,596.00	0.06
147	600874	创业环保	16,900	137,397.00	0.06
148	002018	华信国际	9,500	96,615.00	0.04
149	600586	金晶科技	19,900	92,137.00	0.04
150	601689	拓普集团	3,000	88,260.00	0.04
151	002439	启明星辰	3,500	72,765.00	0.03
152	000062	深圳华强	1,500	42,615.00	0.02
153	000786	北新建材	2,000	20,580.00	0.01
154	600416	湘电股份	200	2,942.00	0.00
155	000501	鄂武商 A	100	1,952.00	0.00
156	600329	中新药业	100	1,744.00	0.00
157	002056	横店东磁	100	1,391.00	0.00
158	600422	昆药集团	100	1,351.00	0.00
159	600039	四川路桥	200	948.00	0.00

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600241	时代万恒	117,600	1,818,096.00	0.83

2	002580	圣阳股份	101,500	1,817,865.00	0.83
3	600505	西昌电力	148,300	1,505,245.00	0.68
4	600359	新农开发	152,200	1,429,158.00	0.65
5	002057	中钢天源	79,600	1,350,812.00	0.61
6	002310	东方园林	90,000	1,273,500.00	0.58
7	002615	哈尔斯	67,400	1,182,870.00	0.54
8	002395	双象股份	47,200	1,083,240.00	0.49
9	000936	华西股份	108,800	1,065,152.00	0.48
10	300112	万讯自控	60,500	864,545.00	0.39
11	000890	法尔胜	68,200	820,446.00	0.37
12	600531	豫光金铅	83,200	713,856.00	0.32
13	002457	青龙管业	60,700	704,727.00	0.32
14	300048	合康新能	84,700	696,234.00	0.32
15	600235	民丰特纸	59,530	631,613.30	0.29
16	002607	亚夏汽车	48,200	513,330.00	0.23
17	002349	精华制药	24,400	491,660.00	0.22
18	600853	龙建股份	57,700	399,861.00	0.18
19	300141	和顺电气	15,700	367,223.00	0.17
20	600258	首旅酒店	14,628	334,396.08	0.15
21	002624	完美世界	10,100	300,879.00	0.14
22	000785	武汉中商	14,900	212,474.00	0.10
23	300260	新莱应材	5,500	184,580.00	0.08
24	600101	明星电力	12,100	145,805.00	0.07
25	002108	沧州明珠	6,500	132,405.00	0.06
26	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.03
27	603877	太平鸟	2,989	63,665.70	0.03
28	002208	合肥城建	3,500	56,315.00	0.03
29	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.02
30	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.01
31	603035	常熟汽饰	2,117	22,101.48	0.01
32	603228	景旺电子	894	20,705.04	0.01
33	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.01
34	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.01
35	002466	天齐锂业	260	8,437.00	0.00
36	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
37	600482	中国动力	200	6,108.00	0.00
38	002721	金一文化	200	3,336.00	0.00
39	002714	牧原股份	132	3,072.96	0.00
40	000980	金马股份	200	2,886.00	0.00

41	002461	珠江啤酒	200	2,410.00	0.00
42	601155	新城控股	200	2,350.00	0.00
43	300182	捷成股份	200	2,062.00	0.00
44	002182	云海金属	100	1,861.00	0.00
45	601965	中国汽研	100	1,065.00	0.00
46	002267	陕天然气	100	959.00	0.00
47	600507	方大特钢	130	880.10	0.00
48	600297	广汇汽车	100	856.00	0.00
49	600705	中航资本	100	612.00	0.00
50	600236	桂冠电力	100	610.00	0.00
51	601636	旗滨集团	100	388.00	0.00

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	600503	华丽家族	4,278,653.00	8.33
2	600079	人福医药	3,852,324.00	7.50
3	600094	大名城	3,753,810.00	7.31
4	600522	中天科技	3,568,440.50	6.95
5	600537	亿晶光电	3,532,707.00	6.88
6	600635	大众公用	3,466,964.00	6.75
7	600482	中国动力	3,455,770.00	6.73
8	002238	天威视讯	3,240,883.24	6.31
9	000973	佛塑科技	3,190,971.93	6.21
10	600729	重庆百货	3,183,634.93	6.20
11	002217	合力泰	3,125,282.84	6.08
12	600409	三友化工	3,060,549.00	5.96
13	600216	浙江医药	3,060,108.00	5.96
14	600416	湘电股份	3,058,160.04	5.95
15	000890	法尔胜	3,024,559.26	5.89
16	002466	天齐锂业	2,988,244.63	5.82
17	601012	隆基股份	2,938,636.00	5.72
18	600869	智慧能源	2,928,307.43	5.70

19	002155	湖南黄金	2,901,603.00	5.65
20	002285	世联行	2,884,297.04	5.61
21	002503	搜于特	2,857,589.45	5.56
22	600978	宜华生活	2,812,386.00	5.47
23	002048	宁波华翔	2,684,798.79	5.23
24	002410	广联达	2,678,501.40	5.21
25	600026	中远海能	2,669,913.00	5.20
26	002221	东华能源	2,656,941.00	5.17
27	300287	飞利信	2,635,647.00	5.13
28	600388	龙净环保	2,616,624.10	5.09
29	002001	新和成	2,615,573.00	5.09
30	600736	苏州高新	2,604,274.98	5.07
31	300043	星辉娱乐	2,559,617.79	4.98
32	600597	光明乳业	2,541,508.32	4.95
33	002460	赣锋锂业	2,532,562.00	4.93
34	000028	国药一致	2,523,926.61	4.91
35	600487	亨通光电	2,481,666.00	4.83
36	600395	盘江股份	2,480,158.57	4.83
37	600664	哈药股份	2,462,804.89	4.79
38	000939	凯迪生态	2,421,053.00	4.71
39	600056	中国医药	2,419,221.60	4.71
40	600258	首旅酒店	2,395,951.60	4.66
41	002491	通鼎互联	2,388,108.00	4.65
42	000969	安泰科技	2,341,830.88	4.56
43	000021	深科技	2,324,403.27	4.52
44	002573	清新环境	2,313,535.00	4.50
45	002589	瑞康医药	2,305,418.00	4.49
46	600460	士兰微	2,303,951.20	4.48
47	600433	冠豪高新	2,292,907.00	4.46
48	000959	首钢股份	2,291,257.56	4.46
49	600240	华业资本	2,285,647.00	4.45
50	603589	口子窖	2,282,112.00	4.44
51	600138	中青旅	2,219,939.00	4.32
52	000919	金陵药业	2,218,496.00	4.32
53	600879	航天电子	2,214,628.41	4.31
54	600600	青岛啤酒	2,199,917.89	4.28

55	000078	海王生物	2,197,856.49	4.28
56	000426	兴业矿业	2,167,986.00	4.22
57	002581	未名医药	2,148,399.12	4.18
58	300182	捷成股份	2,126,743.18	4.14
59	002092	中泰化学	2,119,269.00	4.12
60	002078	太阳纸业	2,118,224.90	4.12
61	002244	滨江集团	2,108,036.06	4.10
62	600531	豫光金铅	2,103,538.00	4.09
63	601231	环旭电子	2,102,864.00	4.09
64	600750	江中药业	2,087,045.00	4.06
65	000877	天山股份	2,048,960.00	3.99
66	600699	均胜电子	2,038,473.00	3.97
67	000861	海印股份	2,036,399.57	3.96
68	600498	烽火通信	1,987,738.84	3.87
69	600970	中材国际	1,981,486.11	3.86
70	600062	华润双鹤	1,976,896.00	3.85
71	600468	百利电气	1,972,011.68	3.84
72	600022	山东钢铁	1,957,312.00	3.81
73	600241	时代万恒	1,948,214.59	3.79
74	600122	宏图高科	1,941,208.92	3.78
75	002249	大洋电机	1,907,804.00	3.71
76	600291	西水股份	1,885,568.00	3.67
77	002603	以岭药业	1,869,152.00	3.64
78	002580	圣阳股份	1,845,278.00	3.59
79	600176	中国巨石	1,797,161.40	3.50
80	002551	尚荣医疗	1,792,157.29	3.49
81	002395	双象股份	1,767,766.50	3.44
82	600201	生物股份	1,758,986.35	3.42
83	300113	顺网科技	1,746,244.00	3.40
84	002261	拓维信息	1,732,375.08	3.37
85	600651	飞乐音响	1,722,573.00	3.35
86	000810	创维数字	1,719,197.00	3.35
87	600594	益佰制药	1,712,702.00	3.33
88	601001	大同煤业	1,693,119.00	3.30
89	601233	桐昆股份	1,689,878.04	3.29
90	000049	德赛电池	1,670,041.00	3.25

91	002273	水晶光电	1,631,074.00	3.17
92	002624	完美世界	1,618,360.00	3.15
93	002050	三花智控	1,587,076.00	3.09
94	600507	方大特钢	1,586,765.90	3.09
95	002615	哈尔斯	1,578,023.00	3.07
96	600219	南山铝业	1,556,813.00	3.03
97	300156	神雾环保	1,553,067.20	3.02
98	600298	安琪酵母	1,543,250.25	3.00
99	002681	奋达科技	1,533,437.00	2.98
100	002431	棕榈股份	1,528,193.00	2.97
101	002384	东山精密	1,522,881.00	2.96
102	002714	牧原股份	1,518,162.72	2.95
103	600200	江苏吴中	1,506,918.00	2.93
104	002310	东方园林	1,494,785.00	2.91
105	601908	京运通	1,491,534.50	2.90
106	600505	西昌电力	1,484,709.38	2.89
107	600611	大众交通	1,480,922.75	2.88
108	600757	长江传媒	1,477,901.00	2.88
109	300324	旋极信息	1,473,185.00	2.87
110	600236	桂冠电力	1,472,529.00	2.87
111	002223	鱼跃医疗	1,468,655.00	2.86
112	600720	祁连山	1,447,194.00	2.82
113	002203	海亮股份	1,442,052.60	2.81
114	000636	风华高科	1,441,308.99	2.81
115	600587	新华医疗	1,440,468.06	2.80
116	000936	华西股份	1,438,166.00	2.80
117	000960	锡业股份	1,414,179.00	2.75
118	002461	珠江啤酒	1,403,563.00	2.73
119	600359	新农开发	1,392,343.00	2.71
120	300088	长信科技	1,391,174.76	2.71
121	300253	卫宁健康	1,368,032.64	2.66
122	002128	露天煤业	1,356,766.69	2.64
123	600418	江淮汽车	1,353,422.97	2.63
124	000997	新大陆	1,337,153.10	2.60
125	600073	上海梅林	1,330,671.03	2.59
126	600260	凯乐科技	1,323,502.59	2.58

127	002308	威创股份	1,303,251.00	2.54
128	002600	江粉磁材	1,301,460.72	2.53
129	600466	蓝光发展	1,295,239.00	2.52
130	600160	巨化股份	1,285,935.96	2.50
131	002437	誉衡药业	1,275,922.00	2.48
132	600312	平高电气	1,266,018.00	2.46
133	601002	晋亿实业	1,259,309.00	2.45
134	600835	上海机电	1,258,722.65	2.45
135	600517	置信电气	1,228,690.71	2.39
136	002276	万马股份	1,227,931.72	2.39
137	002057	中钢天源	1,215,565.32	2.37
138	002727	一心堂	1,205,876.80	2.35
139	600422	昆药集团	1,198,073.00	2.33
140	000566	海南海药	1,188,433.00	2.31
141	002602	世纪华通	1,179,310.00	2.30
142	600751	天海投资	1,175,418.00	2.29
143	600525	长园集团	1,173,692.00	2.28
144	000667	美好置业	1,166,970.00	2.27
145	002426	胜利精密	1,161,403.50	2.26
146	002340	格林美	1,135,422.00	2.21
147	000528	柳工	1,120,305.00	2.18
148	600967	北方创业	1,120,123.69	2.18
149	000661	长春高新	1,111,805.00	2.16
150	600971	恒源煤电	1,100,266.00	2.14
151	600748	上实发展	1,088,658.19	2.12
152	600329	中新药业	1,084,769.00	2.11
153	600743	华远地产	1,074,884.00	2.09
154	000656	金科股份	1,072,270.33	2.09
155	002179	中航光电	1,072,031.00	2.09
156	600335	国机汽车	1,070,362.29	2.08
157	600516	方大炭素	1,069,700.00	2.08
158	600565	迪马股份	1,065,972.00	2.07
159	002368	太极股份	1,054,166.00	2.05
160	002311	海大集团	1,041,035.00	2.03
161	601636	旗滨集团	1,038,614.00	2.02
162	002408	齐翔腾达	1,038,491.00	2.02

163	002267	陕天然气	1,038,243.85	2.02
-----	--------	------	--------------	------

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	600482	中国动力	3,604,967.00	7.02
2	600416	湘电股份	3,405,307.50	6.63
3	002466	天齐锂业	3,297,440.00	6.42
4	000969	安泰科技	2,530,901.28	4.93
5	000939	凯迪生态	2,505,433.95	4.88
6	000890	法尔胜	2,409,441.99	4.69
7	300182	捷成股份	2,369,377.60	4.61
8	600176	中国巨石	2,352,931.85	4.58
9	600409	三友化工	2,242,694.48	4.36
10	600498	烽火通信	2,113,038.22	4.11
11	600062	华润双鹤	2,095,459.99	4.08
12	600537	亿晶光电	2,062,348.04	4.01
13	600094	大名城	2,045,143.00	3.98
14	002078	太阳纸业	1,977,294.56	3.85
15	002221	东华能源	1,969,335.00	3.83
16	600258	首旅酒店	1,965,047.53	3.82
17	002714	牧原股份	1,913,049.40	3.72
18	000667	美好置业	1,846,854.22	3.59
19	600869	智慧能源	1,837,314.00	3.58
20	000049	德赛电池	1,775,580.39	3.46
21	000758	中色股份	1,757,897.54	3.42
22	600201	生物股份	1,739,115.00	3.38
23	600503	华丽家族	1,734,113.30	3.38
24	600507	方大特钢	1,717,186.00	3.34
25	000066	长城电脑	1,715,369.00	3.34
26	002203	海亮股份	1,697,494.72	3.30
27	601908	京运通	1,682,101.73	3.27
28	600729	重庆百货	1,674,856.24	3.26
29	300088	长信科技	1,632,426.00	3.18
30	000919	金陵药业	1,592,954.00	3.10

31	600433	冠豪高新	1,584,414.92	3.08
32	600531	豫光金铅	1,540,242.00	3.00
33	600587	新华医疗	1,511,197.47	2.94
34	600978	宜华生活	1,503,682.10	2.93
35	600418	江淮汽车	1,474,726.00	2.87
36	002238	天威视讯	1,441,338.40	2.81
37	600219	南山铝业	1,428,715.00	2.78
38	600651	飞乐音响	1,410,955.10	2.75
39	600517	置信电气	1,401,222.58	2.73
40	600236	桂冠电力	1,392,498.00	2.71
41	002461	珠江啤酒	1,331,198.25	2.59
42	600329	中新药业	1,327,835.00	2.58
43	600079	人福医药	1,320,972.00	2.57
44	600458	时代新材	1,293,009.00	2.52
45	002600	江粉磁材	1,291,994.40	2.51
46	000786	北新建材	1,260,603.00	2.45
47	002437	誉衡药业	1,258,371.00	2.45
48	600704	物产中大	1,256,004.91	2.44
49	600757	长江传媒	1,247,178.00	2.43
50	002276	万马股份	1,239,109.11	2.41
51	000021	深科技	1,235,938.54	2.41
52	002267	陕天然气	1,231,787.56	2.40
53	002396	星网锐捷	1,228,158.05	2.39
54	000650	仁和药业	1,224,239.32	2.38
55	000078	海王生物	1,217,316.90	2.37
56	600132	重庆啤酒	1,211,619.23	2.36
57	002624	完美世界	1,205,001.76	2.35
58	002191	劲嘉股份	1,197,619.13	2.33
59	000656	金科股份	1,186,785.68	2.31
60	600422	昆药集团	1,172,982.00	2.28
61	002242	九阳股份	1,168,562.58	2.27
62	000528	柳 工	1,163,531.00	2.26
63	002371	七星电子	1,159,665.20	2.26
64	002217	合力泰	1,154,417.02	2.25
65	000566	海南海药	1,140,772.17	2.22
66	000023	深天地A	1,139,543.00	2.22
67	002368	太极股份	1,133,310.47	2.21
68	600565	迪马股份	1,128,164.00	2.20

69	600026	中远海能	1,121,793.67	2.18
70	600835	上海机电	1,117,370.40	2.17
71	600525	长园集团	1,116,789.66	2.17
72	601666	平煤股份	1,114,441.00	2.17
73	002332	仙琚制药	1,096,828.00	2.13
74	600260	凯乐科技	1,089,700.00	2.12
75	600289	亿阳信通	1,087,893.81	2.12
76	600337	美克家居	1,084,534.12	2.11
77	600635	大众公用	1,081,927.00	2.11
78	002426	胜利精密	1,078,924.00	2.10
79	600138	中青旅	1,077,196.90	2.10
80	600743	华远地产	1,068,593.50	2.08
81	601636	旗滨集团	1,041,228.61	2.03

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	425,304,268.23
卖出股票收入（成交）总额	260,747,573.65

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

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	60,723.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,069.44
5	应收申购款	50,029.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	113,822.64

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

8.12.5.1 期末指数投资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	002491	通鼎互联	2,331,000.00	1.06	重大事项

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

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

份额级别	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
泰达 500A	218	23,879.61	2,109,075.00	40.51%	3,096,681.00	59.49%
泰达 500B	718	10,875.53	3,154.00	0.04%	7,805,480.00	99.96%
泰达中证 500	8,545	25,241.31	150,088,905.05	69.59%	65,598,122.00	30.41%
合计	9,481	24,122.08	152,201,134.05	66.55%	76,500,283.00	33.45%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采

用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末上市基金前十名持有人

泰达 500A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	黄松友	1,171,618.00	22.51%
2	华夏未来资本管理有限公司—华夏未来添时 6 号私募证券投资基金	907,995.00	17.44%
3	中国对外经济贸易信托有限公司—外贸信托—华夏未来泽时进取 6 号	441,248.00	8.48%
4	李大鹏	213,300.00	4.10%
5	华夏未来资本管理有限公司—华夏未来添时 1 号基金	210,400.00	4.04%
6	龚雪松	202,032.00	3.88%
7	未来泽时（上海）资产管理中心（有限合伙）—华夏未来添时三号	161,736.00	3.11%
8	华夏未来资本管理有限公司—华夏未来添时 2 号基金	132,200.00	2.54%
9	高明桂	125,660.00	2.41%
10	谭文英	117,800.00	2.26%

泰达 500B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	龚雪松	300,000.00	3.84%
2	傅伟铮	273,528.00	3.50%
3	魏振水	193,512.00	2.48%
4	钟廷修	160,000.00	2.05%
5	傅新彩	136,280.00	1.75%
6	董晓庄	125,700.00	1.61%
7	蒲继清	123,700.00	1.58%
8	姜乐阳	122,000.00	1.56%
9	罗永祥	120,000.00	1.54%
10	钟廷修	120,000.00	1.54%

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	份额级别	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	泰达 500A	0.00	0.0000%
	泰达 500B	0.00	0.0000%

	泰达中证 500	351,726.53	0.1631%
	合计	351,726.53	0.1538%

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	份额级别	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	泰达 500A	0
	泰达 500B	0
	泰达中证 500	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达 500A	0
	泰达 500B	0
	泰达中证 500	10~50
	合计	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达 500A	泰达 500B	泰达中证 500
基金合同生效日（2011 年 12 月 1 日）基金份额总额	74,125,804.00	111,188,706.00	1,250,153,255.48
本报告期期初基金份额总额	6,289,500.00	9,434,250.00	32,710,710.99
本报告期基金总申购份额	-	-	254,775,459.98
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	75,347,219.41
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-1,083,744.00	-1,625,616.00	3,548,075.49
本报告期期末基金份额总额	5,205,756.00	7,808,634.00	215,687,027.05

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未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、2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本年度无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管人、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 66,000 元，该审计机构对本基金提供审计服务的连续年限为 5 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

本年度基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有发生受到监管部门稽查或处罚的任何情况。

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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	2	356,463,017.58	51.98%	331,975.90	51.98%	-
招商证券	1	248,793,138.86	36.28%	231,700.06	36.28%	-
银河证券	2	75,172,668.95	10.96%	70,009.89	10.96%	-
华林证券	2	5,352,505.10	0.78%	4,984.05	0.78%	-

中山证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：（一）2016 年本基金新增华林证券、东北证券、西南证券、东方财富、天风证券、新时代证券、长城证券交易单元，退租东海证券、南京证券交易单元。

（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

本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.8 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	《泰达宏利中证 500 指数分级基金办理定期份额折算业务期间暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 12 月 29 日
2	《关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 12 月 28 日
3	《关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金之泰达 500A 基金份额 2016 年下半年约定年基准收益率公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 7 月 2 日
4	《泰达宏利基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 3 月 18 日
5	《关于泰达 500A 份额定期份额折算后次日前收盘价调整公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 1 月 6 日
6	《关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 1 月 6 日
7	《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间泰达 500A 份额停复牌的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 1 月 5 日
8	《关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金之泰达 500A 基金份额 2016 年上半年约定年基准收益率公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 1 月 5 日

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 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》）或登陆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。

泰达宏利基金管理有限公司
2017 年 3 月 30 日