

# 泰达宏利首选企业股票型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

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

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利首选企业股票
基金主代码	162208
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	387,162,572.73 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	集中投资于行业中的首选企业，分享中国经济的高速增长和自主创新，力争获取长期稳定的资本增值。
投资策略	本基金投资于各个行业中的首选企业并集中持有，充分分享各个首选企业在行业中的优势所带来的超额回报。 本基金采用灵活配置和自下而上相结合的投资管理模式，挑选出当前景气行业（如果行业内部差异性较大，将对行业进行进一步细分），借助首选企业评级标准，挑选出各行业中的首选企业，构建股票投资组合。原则上，从每个细分行业中挑选出来的企业不超过三家。
业绩比较基准	90%×富时中国 A200 指数收益率+10%×同业存款利率。
风险收益特征	本基金的投资目标和投资策略决定了基金属于高风险的证券投资基金，预期收益和风险高于混合型、债券型和货币市场基金。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈沛	林葛
	联系电话	010-66577808	010-66060069

	电子邮箱	irm@mfcteda.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-69-88888	95599
传真		010-66577666	010-68121816

## 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,002,688.35
本期利润	37,846,238.80
加权平均基金份额本期利润	0.0917
本期基金份额净值增长率	8.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.1616
期末基金资产净值	449,728,453.36
期末基金份额净值	1.1616

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

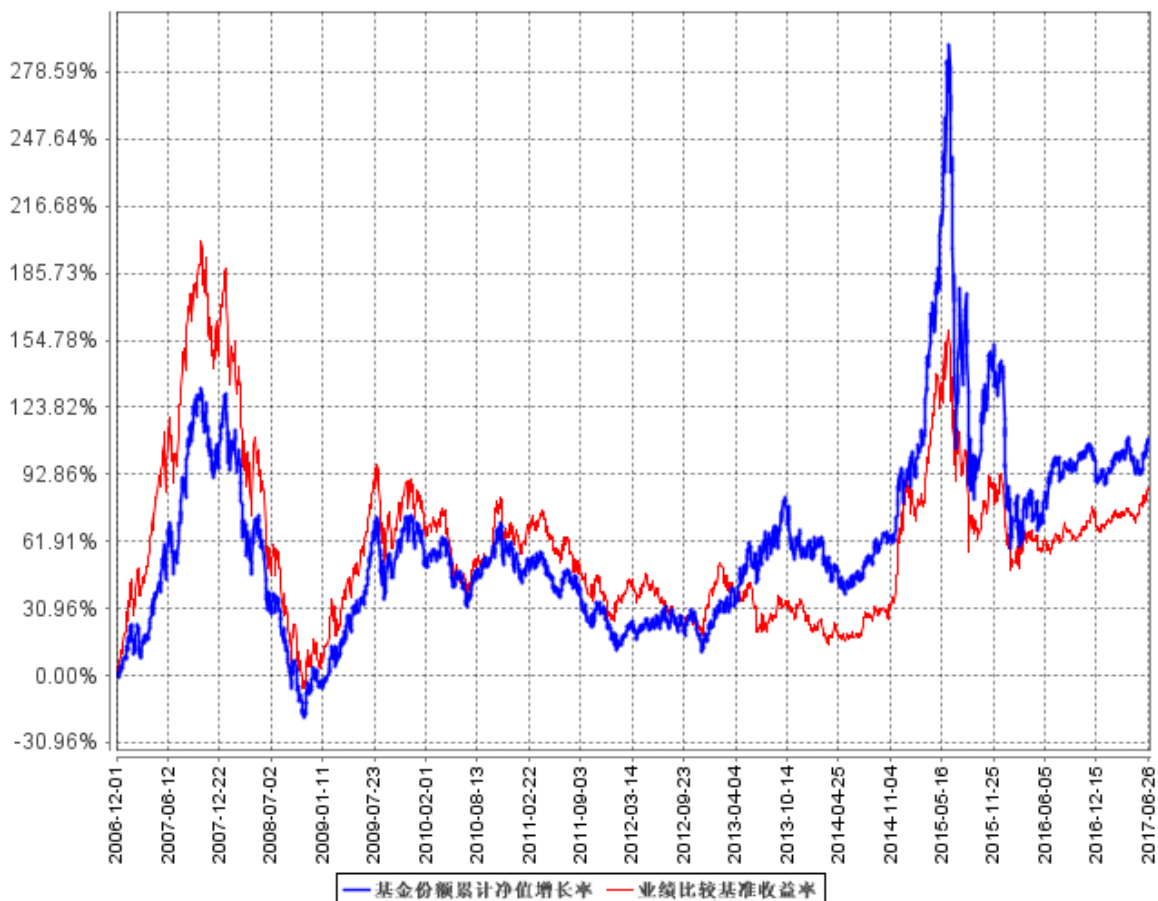
过去一个月	7.09%	0.76%	4.03%	0.62%	3.06%	0.14%
过去三个月	4.01%	0.80%	6.80%	0.56%	-2.79%	0.24%
过去六个月	8.99%	0.74%	11.39%	0.51%	-2.40%	0.23%
过去一年	8.10%	0.79%	17.11%	0.58%	-9.01%	0.21%
过去三年	42.97%	2.13%	56.67%	1.56%	-13.70%	0.57%
自基金合同生效起至今	109.04%	1.81%	86.39%	1.66%	22.65%	0.15%

注：本基金的业绩比较基准： $90\% \times \text{富时中国 A200 指数收益率} + 10\% \times \text{同业存款利率}$ 。

富时中国 A200 指数是新华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 200 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。因此，本基金选择富时中国 A200 指数衡量股票投资部分的业绩。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月，是中国首批合资基金管理公司之一。截至报告期末本公司股东及持股比例分别为：北方国际信托股份有限公司：51%；宏利资产管理（香港）有限公司：49%。

目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金（LOF）、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基金、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）、泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利收益增强债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利养老收益混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创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、泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金、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、泰达宏利京元宝货币市场基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利溢利债券型证券投资基金、泰达宏利恒利债券型证券投资基金、泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启迪灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启惠灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启明灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏

利启泽灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利京天宝货币市场基金、泰达宏利启富灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金在内的五十多只证券投资基金。

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		
张勋	本基金基金经理，研究部副总监	2014 年 11 月 21 日	-	11	2006 年 7 月至 2009 年 6 月就职于天相投资顾问有限公司，担任研究组长；2009 年 7 月至 2010 年 4 月就职于东兴证券股份有限公司，担任研究组长；2010 年 4 月加入泰达宏利基金管理有限公司，曾担任研究员、高级研究员，现任研究部副总监；具备 11 年证券从业经验，11 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度和流程，并严格执行制度的规定。在投资管理活动中，本基金管理人公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会；严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离；在交易环节实行集中交易制度，并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行

股票申购等以公司名义进行的交易，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数量统计、分析。在本报告期内，未发现利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控，风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估，向公司风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。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 5 次，未发现异常。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，整体经济形势延续了去年 4 季度以来的强劲态势，持续超出市场年初预期。具体表现为：工业增加值持续改善且维持了较高的增速，企业盈利持续改善，通胀维持在较低水平（低于市场预期水平），经济增长速度好于市场前期预期。较好的经济数据，给予了管理层更多的决策空间，政策持续围绕“资产脱虚向实”发力，1 季度宏观主线是改革（供给侧和国企混改），2 季度宏观主线是控风险（金融去杠杆）。上半年虽然间杂着美国加息、东北亚政治危机、欧洲部分国家大选等不确定因素，但全球经济整体表现稳中有进。

上述经济和政策的组合，使得 A 股市场上半年出现两个半场，年初以钢铁、水泥化工、造纸为代表的中游产业表现较好；而后在房地产数据超预期的背景下，地产产业链（家具、消费建材、家电等）表现优异，并带动 GARP 品种走强，实现了该类品种估值体系的进一步抬升；进入二季度，金融去杠杆，利率上行，价值白马股成为市场首选。

本基金上半年以均衡配置为主，降低组合的风险暴露度，在选股方面尽量规避不确定，表现中规中矩。未来看，本基金将坚持中长线投资理念，配置核心将继续集中在价值蓝筹（低估值、高 ROE）和中估值成长两个维度，拉长投资视角，降低短期基于概念和博弈的操作，力争为投资人提供稳定持续的回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1616 元；本报告期基金份额净值增长率为 8.99%，业



绩比较基准收益率为 11.39%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为经济的韧性可能要继续好于市场的预期。首先，国内市场的供给侧改革和国际市场中欧美经济的持续复苏，创造了比较有利的经济发展环境；其次，国内经济过去两年主要靠基建投资拉动，房地产投资和制造业投资表现低迷，伴随着房地产去库存进入尾声和制造业盈利复苏，房地产投资和制造业投资可以为经济增长给予更多的支持；最后，在党的十九大召开之前，维持大局稳定将继续成为现实的选择，确保了在政策方面难以出现激进的行为（过紧的货币和财政政策都不现实）。

上述宏观背景决定了：企业盈利有较好的保障，市场流动性不会大幅度收紧，财政政策将继续维持。这些因素都有利于资本市场的稳定，因此，我们对市场相对乐观，认为结构性机会将继续存在。

就投资机会而言，相较于上半年显著的蓝筹龙头风格，我们认为下半年机会将比上半年更加均等，优选个股成为重中之重：1) 价值股在下半年存在估值切换的可能，继续保留消费股和金融股的底仓配置；2) 经济态势的维持有利于周期股行情波动中持续，优选铝、钢和稀有金属；3) 成长股继续分化，优选有核心竞争力、估值业绩匹配的个股。

## 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主任，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

根据本基金基金合同及基金的实际运作情况，本基金于本报告期内未进行收益分配。

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

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

在托管泰达宏利首选企业股票型证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定以及《泰达宏利首选企业股票型证券投资基金基金合同》、《泰达宏利首选企业股票型证券投资基金托管协议》的约定，对泰达宏利首选企业股票型证券投资基金管理人—泰达宏利基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人认为，泰达宏利基金管理有限公司在泰达宏利首选企业股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，泰达宏利基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的泰达宏利首选企业股票型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、

完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利首选企业股票型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7,004,967.74	317,631,995.57
结算备付金	1,015,100.72	1,367,603.84
存出保证金	283,997.01	336,603.27
交易性金融资产	445,348,244.78	269,898,826.05
其中：股票投资	419,169,064.78	245,443,826.05
基金投资	-	-
债券投资	26,179,180.00	24,455,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	552,513.41	825,155.92
应收股利	-	-
应收申购款	50,814.06	118,006.71
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	454,255,637.72	590,178,191.36
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2017 年 6 月 30 日</b>	<b>2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	3,021,095.08	22,880,428.89
应付赎回款	192,084.80	10,972,186.76
应付管理人报酬	537,197.59	866,892.66
应付托管费	89,532.93	144,482.11
应付销售服务费	-	-

应付交易费用	467,679.25	825,938.63
应交税费	20,915.20	20,915.20
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	198,679.51	440,964.24
负债合计	4,527,184.36	36,151,808.49
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	387,162,572.73	519,834,087.87
未分配利润	62,565,880.63	34,192,295.00
所有者权益合计	449,728,453.36	554,026,382.87
负债和所有者权益总计	454,255,637.72	590,178,191.36

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1616 元，基金份额总额 387,162,572.73 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰达宏利首选企业股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	43,722,608.20	-137,834,638.41
1.利息收入	444,712.78	504,192.96
其中：存款利息收入	158,110.41	187,875.72
债券利息收入	284,289.87	316,317.24
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,312.50	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	4,154,719.43	-121,335,991.66
其中：股票投资收益	2,027,416.23	-123,749,822.26
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,350.00	-68,276.70
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	2,128,653.20	2,482,107.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	38,848,927.15	-17,013,307.08
4.汇兑收益（损失以“-”号	-	-

填列)		
5.其他收入(损失以“-”号填列)	274,248.84	10,467.37
<b>减:二、费用</b>	<b>5,876,369.40</b>	<b>6,798,735.94</b>
1. 管理人报酬	3,402,184.71	3,356,980.58
2. 托管费	567,030.76	559,496.82
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,688,750.11	2,673,819.38
5. 利息支出	9,572.20	-
其中: 卖出回购金融资产支出	9,572.20	-
6. 其他费用	208,831.62	208,439.16
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>	<b>37,846,238.80</b>	<b>-144,633,374.35</b>
减: 所得税费用	-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>	<b>37,846,238.80</b>	<b>-144,633,374.35</b>

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 泰达宏利首选企业股票型证券投资基金

本报告期: 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	519,834,087.87	34,192,295.00	554,026,382.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	37,846,238.80	37,846,238.80
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)	-132,671,515.14	-9,472,653.17	-142,144,168.31
其中: 1.基金申购款	81,028,086.24	9,143,335.85	90,171,422.09
2. 基金赎回款	-213,699,601.38	-18,615,989.02	-232,315,590.40
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)	387,162,572.73	62,565,880.63	449,728,453.36
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	398,626,495.41	327,050,811.50	725,677,306.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-144,633,374.35	-144,633,374.35
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)	-82,911,750.58	-30,804,288.07	-113,716,038.65
其中：1.基金申购款	12,599,117.85	4,649,945.78	17,249,063.63
2.基金赎回款	-95,510,868.43	-35,454,233.85	-130,965,102.28
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)	315,714,744.83	151,613,149.08	467,327,893.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 刘建	_____ 傅国庆	_____ 王泉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

泰达宏利首选企业股票型证券投资基金(以下简称“本基金”，原泰达荷银首选企业股票型证券投资基金)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]227号《关于同意泰达荷银首选企业股票型证券投资基金募集的批复》核准，由泰达荷银基金管理有限公司(于2010年3月9日更名为泰达宏利基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达荷银首选企业股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集8,538,826,891.87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(2006)第 176 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达荷银首选企业股票型证券投资基金基金合同》于 2006 年 12 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 8,540,342,977.42 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,516,085.55 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据本基金的基金管理人 2010 年 3 月 17 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于变更公司旗下公募基金名称的公告》,本基金自公告发布之日起更名为泰达宏利首选企业股票型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利首选企业股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、可转债、央行票据、短期融资券、回购、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金资产配置的比例范围是:股票资产占基金资产的 80%-95%,债券资产占基金资产的 5%-20%,权证占基金资产的 0%-3%,资产支持证券占基金资产的 0%-20%,并保持现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产的 5%。本基金的业绩比较基准:富时中国 A200 指数收益率 $\times$ 90%+同业存款利率 $\times$ 10%。

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 8 月 28 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策的变更。

### 6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计的变更。

### 6.4.4.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

## 6.4.5 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。



## 6.4.6 关联方关系

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

本基金本报告期没有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.7.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.7.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.7.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

## 6.4.7.2 关联方报酬

### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,402,184.71	3,356,980.58
其中：支付销售机构的客户维护费	501,242.51	537,809.54

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

#### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	567,030.76	559,496.82

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

#### 6.4.7.5 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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	7,004,967.74	141,325.25	16,126,536.27	169,756.29

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按约定利率计息。

#### 6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.8 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 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
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

#### 6.4.8.2 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						
600643	爱建集团	2017年4月17日	重大事项	16.31	2017年8月2日	16.48	716,500	8,878,560.17	11,686,115.00	-
300065	海兰信	2016年12月8日	重大事项	24.49	2017年7月6日	23.07	311,850	8,113,817.00	7,637,206.50	-
300100	双林股份	2017年4月5日	重大事项	25.96	-	-	138,749	3,998,194.66	3,601,924.04	-
603238	诺邦股份	2017年5月15日	重大事项	29.38	2017年8月23日	31.99	1,750	23,292.50	51,415.00	-

### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

#### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

### 6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	419,169,064.78	92.28
	其中：股票	419,169,064.78	92.28
2	固定收益投资	26,179,180.00	5.76
	其中：债券	26,179,180.00	5.76
	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	8,020,068.46	1.77
7	其他各项资产	887,324.48	0.20
8	合计	454,255,637.72	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,130,952.00	0.92
B	采矿业	4,505,021.00	1.00
C	制造业	243,255,391.53	54.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	17,262,268.36	3.84
F	批发和零售业	5,522,440.00	1.23

G	交通运输、仓储和邮政业	19,949,101.53	4.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,998,691.62	0.89
J	金融业	78,555,453.83	17.47
K	房地产业	4,150,690.00	0.92
L	租赁和商务服务业	6,909,786.00	1.54
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	12,114,214.66	2.69
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	18,815,054.25	4.18
S	综合	-	-
	合计	419,169,064.78	93.20

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	444,394	18,295,700.98	4.07
2	000858	五粮液	322,011	17,923,132.26	3.99
3	601328	交通银行	2,867,869	17,666,073.04	3.93
4	600068	葛洲坝	1,535,789	17,262,268.36	3.84
5	600963	岳阳林纸	1,933,176	14,556,815.28	3.24
6	002456	欧菲光	733,997	13,336,725.49	2.97
7	002245	澳洋顺昌	1,465,200	13,216,104.00	2.94
8	600015	华夏银行	1,368,024	12,613,181.28	2.80
9	600643	爱建集团	716,500	11,686,115.00	2.60
10	300144	宋城演艺	551,175	11,503,022.25	2.56

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

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600963	岳阳林纸	16,331,965.32	2.95
2	000651	格力电器	14,187,816.00	2.56
3	002245	澳洋顺昌	13,842,729.34	2.50
4	000776	广发证券	12,994,732.09	2.35
5	600028	中国石化	12,732,077.00	2.30
6	600029	南方航空	12,006,221.56	2.17
7	601688	华泰证券	11,959,992.92	2.16
8	600685	中船防务	11,669,812.64	2.11
9	601328	交通银行	11,473,170.00	2.07
10	002456	欧菲光	10,817,505.52	1.95
11	603898	好莱客	10,775,476.98	1.94
12	000401	冀东水泥	9,820,682.89	1.77
13	600889	南京化纤	9,564,548.11	1.73
14	300207	欣旺达	9,491,392.38	1.71
15	603366	日出东方	9,080,466.96	1.64
16	000661	长春高新	9,023,368.13	1.63
17	601166	兴业银行	8,998,035.00	1.62
18	300362	天翔环境	8,992,975.33	1.62
19	601601	中国太保	8,838,334.35	1.60
20	601318	中国平安	8,615,740.00	1.56

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

### 7.4.2 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	600028	中国石化	16,763,646.28	3.03
2	000401	冀东水泥	14,128,903.72	2.55
3	600029	南方航空	13,463,107.26	2.43
4	601166	兴业银行	13,370,853.33	2.41
5	000776	广发证券	13,041,137.36	2.35
6	600685	中船防务	11,158,462.67	2.01
7	002739	万达电影	10,959,128.08	1.98
8	002631	德尔未来	10,439,126.22	1.88
9	000709	河钢股份	10,415,179.22	1.88
10	600502	安徽水利	10,135,991.68	1.83
11	002271	东方雨虹	9,502,411.12	1.72
12	300031	宝通科技	9,250,372.87	1.67
13	300033	同花顺	8,957,525.52	1.62
14	002468	申通快递	8,936,478.04	1.61
15	601318	中国平安	8,671,208.79	1.57
16	601088	中国神华	8,520,675.12	1.54
17	002221	东华能源	8,262,536.80	1.49
18	000898	鞍钢股份	8,231,441.74	1.49
19	002567	唐人神	8,117,080.09	1.47
20	603366	日出东方	7,384,407.46	1.33

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

### 7.4.3 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	645,236,927.47
卖出股票收入（成交）总额	512,320,762.12

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	6,193,180.00	1.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,986,000.00	4.44
	其中：政策性金融债	19,986,000.00	4.44



4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	26,179,180.00	5.82

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	160419	16 农发 19	200,000	19,986,000.00	4.44
2	019546	16 国债 18	62,000	6,193,180.00	1.38

注：以上为本基金本报告期末持有的全部债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

### 7.12.2

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	283,997.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	552,513.41
5	应收申购款	50,814.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	887,324.48
---	----	------------

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600643	爱建集团	11,686,115.00	2.60	重大事项

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
18,154	21,326.57	37,389,689.69	9.66%	349,772,883.04	90.34%

### 8.3 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	14,157.33	0.0037%

### 8.4 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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年12月1日）基金份额总额	8,540,342,977.42
本报告期期初基金份额总额	519,834,087.87
本报告期基金总申购份额	81,028,086.24
减：本报告期基金总赎回份额	213,699,601.38
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	387,162,572.73

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 本报告期内基金管理人未发生重大的人事变动。
2. 本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	1	287,814,038.72	24.96%	268,040.15	24.96%	-
长江证券	1	188,786,937.59	16.37%	175,817.66	16.37%	-
中泰证券	1	169,471,626.83	14.70%	157,829.11	14.70%	-
海通证券	1	166,851,239.03	14.47%	155,388.90	14.47%	-
华宝证券	1	112,171,055.73	9.73%	104,464.58	9.73%	-
招商证券	1	83,195,395.72	7.21%	77,480.15	7.21%	-
广州证券	1	78,597,292.14	6.82%	73,197.52	6.82%	-
中金公司	1	66,287,816.23	5.75%	61,733.83	5.75%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期无交易单元变更。

(二) 交易单元选择的标准和程序

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	997,800.00	16.13%	5,400,000.00	21.26%	-	-
长江证券	5,189,290.00	83.87%	20,000,000.00	78.74%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

泰达宏利基金管理有限公司  
2017年8月28日