

泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金 2017 年半年度报告

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国银行股份有限公司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。

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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16

6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	45
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.....	45
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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 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	290,017,850.32 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 22 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	3,898,496.00 份	5,847,744.00 份	280,271,610.32 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@mfcteda.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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http:// www.mfcteda.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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	2,716,899.83
本期利润	7,931,384.47
加权平均基金份额本期利润	0.0299
本期加权平均净值利润率	3.09%
本期基金份额净值增长率	4.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	156,265,887.17
期末可供分配基金份额利润	0.5388
期末基金资产净值	284,645,181.72
期末基金份额净值	0.9815
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	120.71%

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

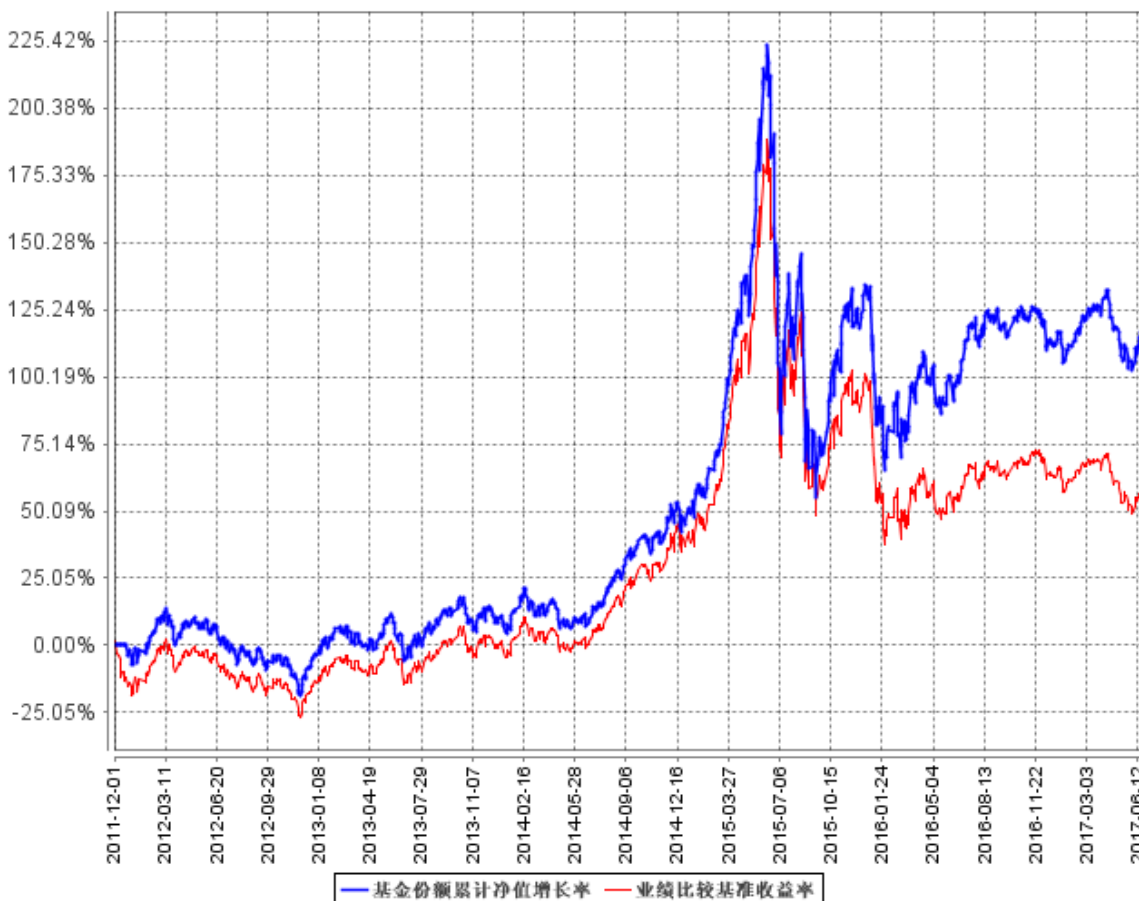
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	7.17%	0.94%	5.13%	0.89%	2.04%	0.05%
过去三个月	-1.65%	1.00%	-3.88%	0.97%	2.23%	0.03%
过去六个月	4.04%	0.87%	-1.85%	0.85%	5.89%	0.02%
过去一年	6.71%	0.88%	0.35%	0.86%	6.36%	0.02%
过去三年	97.82%	2.11%	54.55%	1.96%	43.27%	0.15%
自基金合同生效起至今	120.71%	1.80%	59.73%	1.72%	60.98%	0.08%

注：本基金业绩比较基准为 95%×中证 500 指数收益率+5%×1 年期活期存款利率。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金 (LOF)、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基金、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF)、泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利收益增强债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利养老收益混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、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、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		
杨超	本基金基金经理	2014年10月13日	-	7	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7年证券基金从业经验，7年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
曹龙洁	本基金基金经理助理	2017年4月21日	-	2	北京理工大学工学硕士，2007年4月至2015年9月就职于欧鹏（OpenTV）互动电视软件有限公司；2015年9月加盟泰达宏利基金管理有限公司，曾担任金融工程部研究员，现担任金融工程部基金经理助理；具备2年基金从业经验，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

2017 年上半年市场风格分化巨大，蓝筹股、绩优股涨幅巨大，而中小盘股票、创业板股票出现大幅度下跌，本基金综合运用多种量化管理策略，积极应对剧烈的市场风格分化和申购赎回给基金跟踪误差带来的不利冲击，将跟踪误差控制在很小的幅度，并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

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9815 元；本报告期基金份额净值增长率为 4.04%，业绩比较基准收益率为-1.85%。

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，宏观经济将整体保持稳定，金融去杠杆的效应或将延续，整体市场对估值将会非常敏感。本基金将持续恪守基金合同，积极合理地运用量化策略降低跟踪误差。

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

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

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

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合规守信、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	15,467,671.99	13,078,985.43
结算备付金		511,544.73	915,205.43
存出保证金		61,484.02	60,723.57
交易性金融资产	6.4.7.2	269,609,073.96	208,217,805.15
其中：股票投资		269,609,073.96	208,217,805.15
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,873.11	3,069.44
应收股利		-	-
应收申购款		69,899.82	50,029.63
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		285,722,547.63	222,325,818.65
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,363,770.75
应付赎回款		135,650.68	30,893.64
应付管理人报酬		225,324.16	160,010.99
应付托管费		45,064.83	32,002.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	445,852.64	259,682.89
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	225,473.60	157,800.40
负债合计		1,077,365.91	2,004,160.85
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	128,379,294.55	103,360,501.78
未分配利润	6.4.7.10	156,265,887.17	116,961,156.02
所有者权益合计		284,645,181.72	220,321,657.80
负债和所有者权益总计		285,722,547.63	222,325,818.65

注：报告截止日 2017 年 06 月 30 日，中证 500 份额净值 0.9815 元，泰达 500A 份额净值 1.0245 元，泰达 500B 份额净值 0.9528 元； 基金份额总额 290,017,850.32 份，其中中证 500 份额 280,271,610.32 份，泰达 500A 份额 3,898,496.00 份，泰达 500B 份额 5,847,744.00 份。

6.2 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	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
一、收入		10,905,922.44	-2,483,871.51
1.利息收入		60,496.83	20,172.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	60,496.83	20,172.02

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）		5,604,373.45	-3,162,551.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,729,278.12	-3,474,055.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	22,920.00
股利收益	6.4.7.16	1,875,095.33	288,583.88
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,214,484.64	614,687.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	26,567.52	43,820.54
减：二、费用		2,974,537.97	799,894.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,267,512.55	265,477.79
2. 托管费	6.4.10.2.2	253,502.50	53,095.54
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,203,059.95	388,758.67
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	250,462.97	92,562.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,931,384.47	-3,283,766.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,931,384.47	-3,283,766.13

6.3 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：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）	103,360,501.78	116,961,156.02	220,321,657.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,931,384.47	7,931,384.47
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）	25,018,792.77	31,373,346.68	56,392,139.45
其中：1.基金申购款	35,464,654.59	44,042,275.06	79,506,929.65
2.基金赎回款	-10,445,861.82	-12,668,928.38	-23,114,790.20
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）	128,379,294.55	156,265,887.17	284,645,181.72
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）	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（本期利润）	-	-3,283,766.13	-3,283,766.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	7,064,585.53	5,803,676.14	12,868,261.67
其中：1.基金申购款	24,981,898.13	23,339,112.45	48,321,010.58
2.基金赎回款	-17,917,312.60	-17,535,436.31	-35,452,748.91
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）	29,332,545.49	31,632,242.23	60,964,787.72

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(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。根据本基金管理人 2015 年 6 月 25 日发布的《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,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。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 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 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期内本基金无会计政策的变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计的变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内本基金无重大会计差错发生。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	15,467,671.99
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	15,467,671.99

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	271,022,311.80	269,609,073.96	-1,413,237.84
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	271,022,311.80	269,609,073.96	-1,413,237.84

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产和负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末买入返售金融资产无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	2,639.75
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	204.28
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
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	28.89
合计	2,873.11

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	445,852.64

银行间市场应付交易费用	-
合计	445,852.64

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	489.44
预提费用	211,246.91
指数使用费	13,737.25
合计	225,473.60

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	228,701,417.05	103,360,501.78
本期申购	93,507.72	42,260.87
本期赎回(以“-”号填列)	-46,811.20	-21,156.27
2017年1月3日 基金拆分/份额折算前	228,748,113.57	103,381,606.38
基金拆分/份额折算变动份额	4,799,934.45	-
本期申购	80,020,047.98	35,422,393.72
本期赎回(以“-”号填列)	-23,550,245.68	-10,424,705.55
本期末	290,017,850.32	128,379,294.55

注：(1) 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 2017 年 1 月 3 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。

(2) 截至 2017 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 11,740,712.00 份，其中泰达中证 500 基金 1,994,472.00 份，泰达 500A 3,898,496.00 份，泰达 500B 5,847,744.00 份；托管在场外未上市交易的中证 500 的基金份额为 278,277,138.32 份。泰达中证 500 份额设置单独的基金代码，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 份额交易代码不同，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。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	136,122,558.30	-19,161,402.28	116,961,156.02
本期利润	2,716,899.83	5,214,484.64	7,931,384.47
本期基金份额交易产生的变动数	34,455,043.24	-3,081,696.56	31,373,346.68
其中：基金申购款	48,829,457.22	-4,787,182.16	44,042,275.06
基金赎回款	-14,374,413.98	1,705,485.60	-12,668,928.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	173,294,501.37	-17,028,614.20	156,265,887.17

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	51,468.09
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	5,114.72
其他	3,914.02
合计	60,496.83

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	379,468,655.44
减：卖出股票成本总额	375,739,377.32
买卖股票差价收入	3,729,278.12

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回贵金属差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购贵金属差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,875,095.33

基金投资产生的股利收益	-
合计	1,875,095.33

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	5,214,484.64
——股票投资	5,214,484.64
——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	5,214,484.64

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	26,567.52
其他	-
合计	26,567.52

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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	1,203,059.95
银行间市场交易费用	-
合计	1,203,059.95

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	32,728.42
信息披露费	148,765.71
上市费	29,752.78
指数使用费	25,350.27
银行间账户维护费	9,000.00
银行费用	4,865.79
合计	250,462.97

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期没有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	1,267,512.55	265,477.79
其中：支付销售机构的客户维护费	151,155.05	86,627.93

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 1.0% 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 1.0% / 当年天数。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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托管费	253,502.50	53,095.54

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 0.2% 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 0.2% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	15,467,671.99	51,468.09	4,735,512.78	14,047.75

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

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。

6.4.12 期末(2017年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	2017年	2017	新股流	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-

	智能	6月26日	2017年7月3日	受限						
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	-

6.4.12.2 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
600545	新疆城建	2017年6月22日	重大事项	11.96	2017年7月3日	12.44	269,100	2,931,820.67	3,218,436.00	-
002505	大康农业	2017年3月13日	重大事项	3.50	-	-	744,720	2,644,602.43	2,606,520.00	-
600460	士兰微	2017年5月12日	重大事项	6.07	2017年8月15日	6.68	109,800	754,003.45	666,486.00	-
601717	郑煤机	2017年4月24日	重大事项	7.79	-	-	72,500	641,938.23	564,775.00	-
002711	欧浦智网	2017年6月26日	重大事项	18.79	2017年7月17日	11.94	1,000	18,551.00	18,790.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只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。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产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 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感

性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,467,671.99	-	-	-	15,467,671.99
结算备付金	511,544.73	-	-	-	511,544.73
存出保证金	61,484.02	-	-	-	61,484.02
交易性金融资产	-	-	-	-269,609,073.96	269,609,073.96
应收利息	-	-	-	2,873.11	2,873.11
应收申购款	-	-	-	69,899.82	69,899.82
资产总计	16,040,700.74	-	-	-269,681,846.89	285,722,547.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	135,650.68	135,650.68
应付管理人报酬	-	-	-	225,324.16	225,324.16
应付托管费	-	-	-	45,064.83	45,064.83
应付交易费用	-	-	-	445,852.64	445,852.64
其他负债	-	-	-	225,473.60	225,473.60
负债总计	-	-	-	1,077,365.91	1,077,365.91
利率敏感度缺口	16,040,700.74	-	-	-268,604,480.98	284,645,181.72
上年度末 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

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2016 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（2016 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	269,609,073.96	94.72	208,217,805.15	94.51
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	269,609,073.96	94.72	208,217,805.15	94.51

6.4.13.4.3.2 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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	13,460,000.00	13,700,000.00
业绩比较基准下降 5%	-13,460,000.00	-13,700,000.00	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	269,609,073.96	94.36
	其中：股票	269,609,073.96	94.36
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	15,979,216.72	5.59
7	其他各项资产	134,256.95	0.05
8	合计	285,722,547.63	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,541,987.00	1.60
B	采矿业	9,681,370.00	3.40
C	制造业	142,281,613.23	49.99
D	电力、热力、燃气及水生产和	7,005,379.00	2.46

	供应业		
E	建筑业	6,264,692.00	2.20
F	批发和零售业	23,259,030.79	8.17
G	交通运输、仓储和邮政业	5,584,029.67	1.96
H	住宿和餐饮业	3,212,434.00	1.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,914,615.37	5.59
J	金融业	3,079,696.00	1.08
K	房地产业	16,211,948.05	5.70
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	2,205,704.00	0.77
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	3,935,517.00	1.38
S	综合	2,086,357.50	0.73
	合计	245,264,373.61	86.16

7.2.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	190,240.00	0.07
B	采矿业	3,340,608.00	1.17
C	制造业	13,070,465.46	4.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	423,738.00	0.15
E	建筑业	867.00	0.00
F	批发和零售业	84,040.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	1,507,270.00	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	105,941.62	0.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,139,439.20	1.45
L	租赁和商务服务业	1,480,346.60	0.52
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	1,744.47	0.00
S	综合	-	-
	合计	24,344,700.35	8.55

7.2.3 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所有股票投资明细

7.3.1 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	600219	南山铝业	1,187,400	4,025,286.00	1.41
2	002601	龙鳞佰利	222,300	3,641,274.00	1.28
3	002019	亿帆医药	217,950	3,635,406.00	1.28
4	600516	方大炭素	255,400	3,631,788.00	1.28
5	600183	生益科技	288,000	3,553,920.00	1.25
6	600755	厦门国贸	383,100	3,493,872.00	1.23
7	600282	南钢股份	937,300	3,477,383.00	1.22
8	002078	太阳纸业	468,200	3,441,270.00	1.21
9	002340	格林美	567,500	3,433,375.00	1.21
10	300324	旋极信息	185,877	3,390,396.48	1.19
11	600312	平高电气	246,400	3,385,536.00	1.19
12	002589	瑞康医药	218,630	3,366,902.00	1.18
13	600565	迪马股份	610,500	3,363,855.00	1.18
14	603766	隆鑫通用	457,000	3,326,960.00	1.17
15	000426	兴业矿业	368,700	3,325,674.00	1.17
16	002266	浙富控股	676,900	3,303,272.00	1.16
17	002002	鸿达兴业	420,800	3,294,864.00	1.16
18	000078	海王生物	546,000	3,292,380.00	1.16
19	600874	创业环保	167,900	3,285,803.00	1.15
20	600098	广州发展	414,700	3,280,277.00	1.15
21	600026	中远海能	490,109	3,249,422.67	1.14
22	002437	誉衡药业	445,100	3,240,328.00	1.14
23	002048	宁波华翔	155,308	3,239,724.88	1.14
24	601012	隆基股份	188,500	3,223,350.00	1.13

25	300113	顺网科技	119,700	3,219,930.00	1.13
26	600545	新疆城建	269,100	3,218,436.00	1.13
27	600754	锦江股份	118,540	3,212,434.00	1.13
28	002491	通鼎互联	237,200	3,187,968.00	1.12
29	600466	蓝光发展	368,400	3,179,292.00	1.12
30	300026	红日药业	666,800	3,140,628.00	1.10
31	000417	合肥百货	369,800	3,050,850.00	1.07
32	600169	太原重工	789,500	3,047,470.00	1.07
33	000090	天健集团	274,400	3,045,840.00	1.07
34	002416	爱施德	281,601	3,038,474.79	1.07
35	000517	荣安地产	643,625	2,992,856.25	1.05
36	600056	中国医药	114,620	2,974,389.00	1.04
37	300136	信维通信	73,544	2,943,230.88	1.03
38	002635	安洁科技	81,000	2,933,820.00	1.03
39	002249	大洋电机	441,900	2,907,702.00	1.02
40	001696	宗申动力	370,400	2,803,928.00	0.99
41	300287	飞利信	304,700	2,797,146.00	0.98
42	000050	深天马 A	134,500	2,766,665.00	0.97
43	600862	中航高科	283,200	2,744,208.00	0.96
44	600458	时代新材	234,000	2,679,300.00	0.94
45	002018	华信国际	381,400	2,612,590.00	0.92
46	002505	大康农业	744,720	2,606,520.00	0.92
47	002221	东华能源	236,000	2,574,760.00	0.90
48	300116	坚瑞沃能	239,500	2,574,625.00	0.90
49	600300	维维股份	481,700	2,572,278.00	0.90
50	600633	浙数文化	131,800	2,546,376.00	0.89
51	000049	德赛电池	47,700	2,471,337.00	0.87
52	002155	湖南黄金	253,600	2,426,952.00	0.85
53	000418	小天鹅 A	51,800	2,423,722.00	0.85
54	000997	新大陆	104,800	2,377,912.00	0.84
55	002273	水晶光电	114,900	2,370,387.00	0.83
56	600751	天海投资	410,300	2,334,607.00	0.82
57	603198	迎驾贡酒	120,609	2,295,189.27	0.81
58	002460	赣锋锂业	49,400	2,284,750.00	0.80
59	300297	蓝盾股份	202,946	2,222,258.70	0.78
60	002285	世联行	276,340	2,216,246.80	0.78
61	002573	清新环境	117,200	2,205,704.00	0.77
62	600280	中央商场	273,400	2,168,062.00	0.76
63	000012	南玻 A	230,100	2,146,833.00	0.75

64	600597	光明乳业	167,000	2,129,250.00	0.75
65	002001	新和成	109,100	2,117,631.00	0.74
66	000758	中色股份	287,900	2,018,179.00	0.71
67	600503	华丽家族	291,400	2,013,574.00	0.71
68	600176	中国巨石	176,820	1,941,483.60	0.68
69	002477	雏鹰农牧	436,900	1,935,467.00	0.68
70	600200	江苏吴中	144,100	1,902,120.00	0.67
71	000988	华工科技	112,100	1,635,539.00	0.57
72	002396	星网锐捷	84,200	1,629,270.00	0.57
73	002463	沪电股份	346,700	1,577,485.00	0.55
74	000563	陕国投 A	303,400	1,568,578.00	0.55
75	002807	江阴银行	120,600	1,511,118.00	0.53
76	603806	福斯特	46,688	1,494,482.88	0.53
77	600699	均胜电子	46,400	1,488,976.00	0.52
78	002233	塔牌集团	117,300	1,427,541.00	0.50
79	002092	中泰化学	111,500	1,416,050.00	0.50
80	000488	晨鸣纸业	108,500	1,399,650.00	0.49
81	600757	长江传媒	184,300	1,376,721.00	0.48
82	000830	鲁西化工	185,200	1,277,880.00	0.45
83	603328	依顿电子	88,824	1,256,859.60	0.44
84	300199	翰宇药业	78,500	1,204,190.00	0.42
85	600395	盘江股份	163,600	1,199,188.00	0.42
86	600053	九鼎投资	33,600	1,174,656.00	0.41
87	600079	人福医药	59,300	1,163,466.00	0.41
88	600122	宏图高科	102,800	1,141,080.00	0.40
89	600879	航天电子	128,946	1,133,435.34	0.40
90	002727	一心堂	57,600	1,059,840.00	0.37
91	000021	深科技	122,300	1,049,334.00	0.37
92	600380	健康元	115,100	1,045,108.00	0.37
93	300156	神雾环保	31,500	1,031,940.00	0.36
94	600748	上实发展	134,400	967,680.00	0.34
95	002093	国脉科技	109,430	962,984.00	0.34
96	600835	上海机电	38,800	820,232.00	0.29
97	600572	康恩贝	111,200	769,504.00	0.27
98	002179	中航光电	24,310	758,228.90	0.27
99	002004	华邦健康	90,836	711,245.88	0.25
100	002308	威创股份	52,100	679,905.00	0.24
101	600460	士兰微	109,800	666,486.00	0.23
102	300010	立思辰	50,800	657,860.00	0.23

103	600348	阳泉煤业	85,100	576,978.00	0.20
104	601717	郑煤机	72,500	564,775.00	0.20
105	600580	卧龙电气	78,800	537,416.00	0.19
106	600839	四川长虹	137,200	496,664.00	0.17
107	600881	亚泰集团	96,300	489,204.00	0.17
108	600642	申能股份	60,300	379,890.00	0.13
109	002503	搜于特	49,200	345,876.00	0.12
110	600808	马钢股份	94,000	332,760.00	0.12
111	002572	索菲亚	7,800	319,800.00	0.11
112	600006	东风汽车	54,200	317,070.00	0.11
113	002244	滨江集团	43,900	303,788.00	0.11
114	002073	软控股份	35,800	303,584.00	0.11
115	600160	巨化股份	25,200	303,156.00	0.11
116	600517	置信电气	38,000	287,660.00	0.10
117	600770	综艺股份	24,565	184,237.50	0.06
118	000400	许继电气	9,200	165,232.00	0.06
119	300253	卫宁健康	19,699	153,849.19	0.05
120	002373	千方科技	9,200	125,488.00	0.04
121	601168	西部矿业	13,100	100,739.00	0.04
122	600198	大唐电信	6,400	81,728.00	0.03
123	600073	上海梅林	7,900	75,445.00	0.03
124	000636	风华高科	8,600	73,186.00	0.03
125	000028	国药一致	900	72,810.00	0.03
126	600917	重庆燃气	6,300	59,409.00	0.02
127	000937	冀中能源	5,500	33,660.00	0.01
128	002699	美盛文化	900	12,420.00	0.00
129	600894	广日股份	700	8,288.00	0.00
130	002217	合力泰	600	5,928.00	0.00
131	002410	广联达	200	3,760.00	0.00
132	601231	环旭电子	200	3,142.00	0.00
133	600487	亨通光电	100	2,805.00	0.00
134	002439	启明星辰	100	1,860.00	0.00
135	000969	安泰科技	200	1,746.00	0.00
136	600720	祁连山	200	1,566.00	0.00
137	002261	拓维信息	100	1,171.00	0.00
138	600422	昆药集团	100	1,134.00	0.00
139	600978	宜华生活	100	1,005.00	0.00
140	000541	佛山照明	100	911.00	0.00
141	600307	酒钢宏兴	200	570.00	0.00

142	000761	本钢板材	100	523.00	0.00
143	603077	和邦生物	100	509.00	0.00
144	600039	四川路桥	100	416.00	0.00

7.3.2 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	600067	冠城大通	408,500	2,806,395.00	0.99
2	603993	洛阳钼业	549,900	2,782,494.00	0.98
3	002652	扬子新材	298,200	2,150,022.00	0.76
4	300420	五洋科技	246,000	2,031,960.00	0.71
5	002570	贝因美	143,300	1,948,880.00	0.68
6	002352	顺丰控股	28,000	1,488,480.00	0.52
7	600735	新华锦	129,000	1,457,700.00	0.51
8	600438	通威股份	255,893	1,427,882.94	0.50
9	600415	小商品城	195,900	1,418,316.00	0.50
10	000615	京汉股份	95,700	1,321,617.00	0.46
11	600449	宁夏建材	87,200	837,992.00	0.29
12	000425	徐工机械	191,700	718,875.00	0.25
13	601339	百隆东方	102,200	608,090.00	0.21
14	600871	石化油服	167,100	558,114.00	0.20
15	300309	吉艾科技	22,400	461,888.00	0.16
16	600116	三峡水利	37,800	423,738.00	0.15
17	601388	怡球资源	98,200	347,628.00	0.12
18	002498	汉缆股份	74,200	271,572.00	0.10
19	002327	富安娜	26,500	220,215.00	0.08
20	600313	农发种业	46,400	190,240.00	0.07
21	601179	中国西电	28,400	157,904.00	0.06
22	600261	阳光照明	18,636	122,438.52	0.04
23	600850	华东电脑	4,600	98,302.00	0.03
24	002091	江苏国泰	8,800	84,040.00	0.03
25	002712	思美传媒	2,700	58,266.00	0.02
26	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
27	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
28	603268	松发股份	1,100	35,574.00	0.01

29	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
30	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
31	002711	欧浦智网	1,000	18,790.00	0.01
32	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
33	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
34	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
35	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
36	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
37	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
38	600510	黑牡丹	1,400	10,724.00	0.00
39	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
40	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
41	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
42	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
43	000938	紫光股份	100	6,112.00	0.00
44	603969	银龙股份	300	5,916.00	0.00
45	300269	联建光电	100	2,003.00	0.00
46	000861	海印股份	480	1,761.60	0.00
47	300251	光线传媒	213	1,744.47	0.00
48	601390	中国中铁	100	867.00	0.00
49	002563	森马服饰	100	848.00	0.00
50	000718	苏宁环球	120	703.20	0.00
51	600433	冠豪高新	100	552.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600409	三友化工	4,623,488.12	2.10
2	600026	中远海能	4,440,632.47	2.02
3	000656	金科股份	4,265,126.00	1.94
4	600166	福田汽车	3,925,942.00	1.78
5	002463	沪电股份	3,918,357.98	1.78
6	600039	四川路桥	3,895,150.02	1.77
7	002340	格林美	3,842,798.00	1.74
8	002366	台海核电	3,760,766.17	1.71

9	002019	亿帆医药	3,695,476.37	1.68
10	600823	世茂股份	3,678,489.30	1.67
11	600219	南山铝业	3,644,877.00	1.65
12	601010	文峰股份	3,631,268.97	1.65
13	600881	亚泰集团	3,606,010.39	1.64
14	002437	誉衡药业	3,600,997.81	1.63
15	002004	华邦健康	3,574,969.36	1.62
16	600466	蓝光发展	3,538,569.00	1.61
17	600572	康恩贝	3,530,891.00	1.60
18	600862	中航高科	3,497,937.55	1.59
19	000761	本钢板材	3,428,021.61	1.56
20	000517	荣安地产	3,427,927.50	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	600409	三友化工	6,258,840.45	2.84
2	000959	首钢股份	5,002,119.21	2.27
3	000656	金科股份	4,436,999.00	2.01
4	600522	中天科技	4,287,308.15	1.95
5	000877	天山股份	3,747,648.00	1.70
6	600823	世茂股份	3,696,643.46	1.68
7	002503	搜于特	3,636,140.20	1.65
8	600664	哈药股份	3,455,826.40	1.57
9	600166	福田汽车	3,448,192.80	1.57
10	002366	台海核电	3,419,893.69	1.55
11	600582	天地科技	3,416,797.10	1.55
12	600094	大名城	3,409,629.00	1.55
13	600039	四川路桥	3,361,847.00	1.53
14	002463	沪电股份	3,279,392.24	1.49
15	600388	龙净环保	3,271,094.57	1.48
16	601010	文峰股份	3,005,488.67	1.36
17	002244	滨江集团	2,990,799.63	1.36

18	000536	华映科技	2,972,303.00	1.35
19	600801	华新水泥	2,942,997.35	1.34
20	600158	中体产业	2,904,010.31	1.32

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	431,916,161.49
卖出股票收入（成交）总额	379,468,655.44

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。

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	61,484.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,873.11
5	应收申购款	69,899.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	134,256.95

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 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。

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

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	197	19,789.32	964,300.00	24.74%	2,934,196.00	75.26%
泰达 500B	627	9,326.55	5,478.00	0.09%	5,842,266.00	99.91%
泰达中证 500	8,618	32,521.65	202,724,370.02	72.33%	77,547,240.30	27.67%
合计	9,442	30,715.72	203,694,148.02	70.24%	86,323,702.30	29.76%

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）。

8.2 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	1,343,902.00	34.47%
2	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	432,256.00	11.09%

3	华夏未来资本管理有限公司—华夏未来泽时进取 1 号基金	300,900.00	7.72%
4	陶玲	206,100.00	5.29%
5	李大鹏	163,304.00	4.19%
6	未来泽时（上海）资产管理中心（有限合伙）—华夏未来添时三号	143,028.00	3.67%
7	谭文英	117,800.00	3.02%
8	张殿刚	104,892.00	2.69%
9	梁小红	90,000.00	2.31%
10	刘平	60,000.00	1.54%
11	谭莲英	60,000.00	1.54%
12	鹏华资产—中信银行—鹏华资产华夏未来泽时进取 7 号 1 期资产	60,000.00	1.54%

泰达 500B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	傅伟铮	240,000.00	4.10%
2	傅新彩	136,280.00	2.33%
3	董晓庄	125,700.00	2.15%
4	蒲继清	123,700.00	2.12%
5	钟廷修	110,000.00	1.88%
6	田红梅	98,375.00	1.68%
7	龚雪松	97,500.00	1.67%
8	沈建国	87,300.00	1.49%
9	吴翠珍	84,872.00	1.45%
10	尹粤蓉	79,300.00	1.36%

持有人为本基金场内持有人。

8.3 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	377,116.92	0.1346%
	合计	377,116.92	0.1300%

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	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、基金投资和研发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

§ 9 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	5,205,756.00	7,808,634.00	215,687,027.05
本报告期基金总申购份额	-	-	80,113,555.70
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	23,597,056.88
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-1,307,260.00	-1,960,890.00	8,068,084.45
本报告期期末基金份额总额	3,898,496.00	5,847,744.00	280,271,610.32

注：拆分变动份额含本基金三级份额之间的配对转换份额和基金份额折算后的调整份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内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	
光大证券	1	390,410,796.07	48.35%	363,595.32	48.35%	-
兴业证券	1	367,490,624.87	45.51%	342,247.13	45.51%	-
中金公司	2	49,521,439.68	6.13%	46,119.92	6.13%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

注：（一）2017 年上半年本基金新增东方证券交易单元。

（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，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期末通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《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	2017 年 1 月 5 日
2	《〈深圳证券交易所分级基金业务管理指引〉实施风险提示公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2017 年 4 月 25 日
3	《〈深圳证券交易所分级基金业务管理指引〉实施风险提示公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2017 年 4 月 26 日

4	《〈深圳证券交易所分级基金业务管理指引〉实施风险提示公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2017 年 4 月 27 日
5	《〈深圳证券交易所分级基金业务管理指引〉实施风险提示公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2017 年 4 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170630	149,791,409.36	3,143,147.73	0.00	152,934,557.09	52.73%

产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，易发生巨额赎回的情况，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。

报告期内，申购份额含红利再投资份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金为在深圳证券交易所上市交易的分级基金，根据 2017 年 5 月 1 日起施行的《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》，未在券商营业部开通分级基金相应权限的投资者，不能买入本基金子份额或分拆基础份额。详情请见基金管理人自 2017 年 4 月 25 日起陆续发布的《〈深圳证券交易所分级基金业务管理指引〉实施风险提示公告》。

§ 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，网址：<http://www.mfcteda.com>。

泰达宏利基金管理有限公司

2017 年 8 月 28 日