

# 泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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.....	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.....	12
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
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.....	13
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
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.....	17
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>36</b>
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	45
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>45</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	48
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>49</b>
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.....	49

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>50</b>
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	泰达宏利品质生活混合
基金主代码	162211
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 4 月 9 日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	178,860,410.70 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	随着中国经济增长迈上新的台阶，广大人民群众必然更加注重生活品质。本基金将重点把握生活品质提高的这一趋势，通过投资相关的受益行业和上市公司，充分分享中国国民经济实力的全面提升，力争为投资者带来长期稳定的投资回报。
投资策略	<p>1. 使用 MVPS 模型进行战略性资产配置策略，确定股票债券比例。主要考虑 M（宏观经济环境）、V（价值）、P（政策）、S（市场气氛）四方面因素。</p> <p>2. 股票投资策略。本基金采用双主线策略，对横纵交点进行重点的定性分析和定量分析，构建实际股票投资组合。横向上，利用“行业文档”分析方法，确定国内行业与提高生活品质有关行业中具有竞争优势和比较优势的行业；纵向上，努力挖掘市场上与本基金投资理念相一致的投资主题。</p> <p>3. 债券投资策略。本基金将结合宏观经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，运用利率预期、久期管理、收益率曲线等投资管理策略。</p>
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金属于较高风险的混合型证券投资基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	泰达宏利基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	陈沛	田青
	联系电话	010-66577808	010-67595096
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-69-88888	010-67595096
传真		010-66577666	010-66275853
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100033	100033
法定代表人		弓劲梅	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.mfcteda.com">http://www.mfcteda.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,449,934.32
本期利润	7,494,168.25
加权平均基金份额本期利润	0.0221
本期加权平均净值利润率	2.61%
本期基金份额净值增长率	4.55%
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	-22,600,469.60
期末可供分配基金份额利润	-0.1264
期末基金资产净值	156,259,941.10
期末基金份额净值	0.874

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	30.81%

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

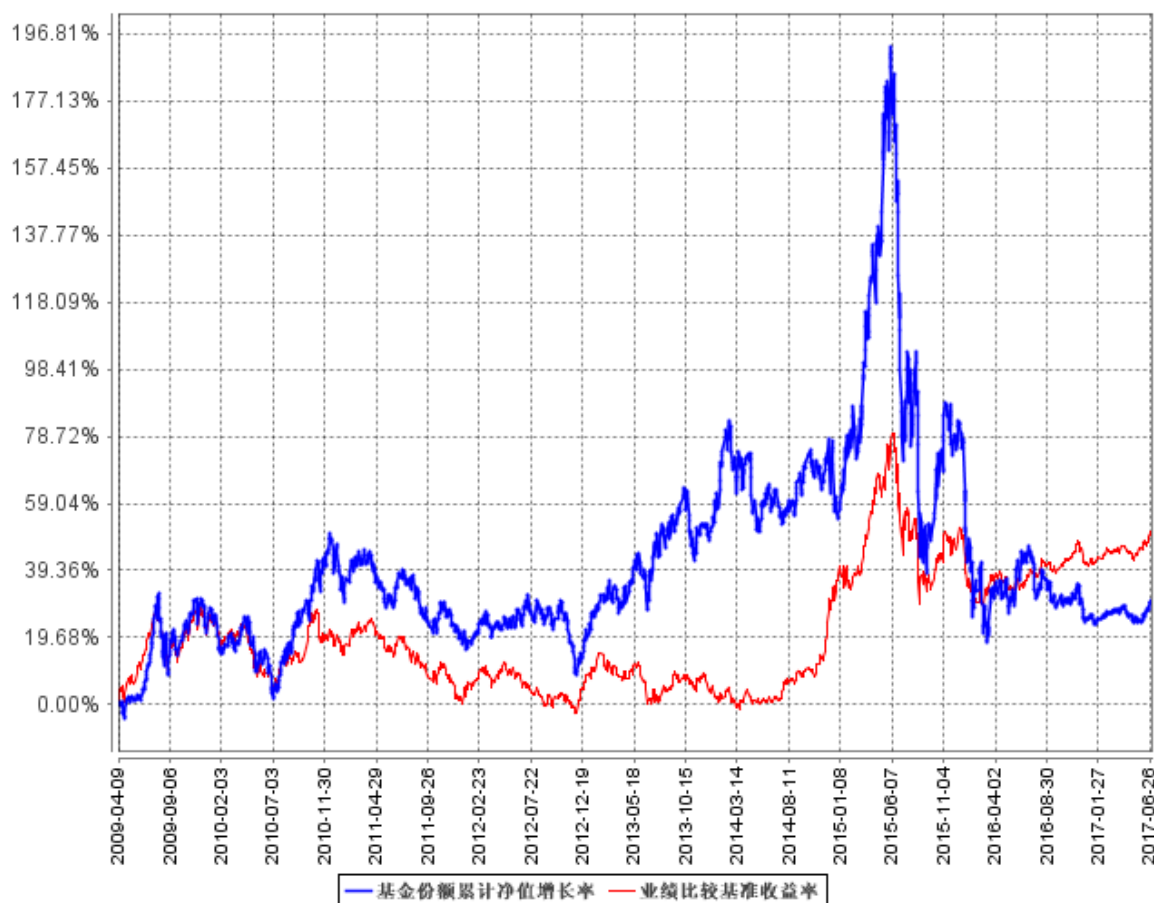
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.92%	0.49%	3.04%	0.40%	1.88%	0.09%
过去三个月	3.19%	0.45%	3.70%	0.37%	-0.51%	0.08%
过去六个月	4.55%	0.37%	6.55%	0.34%	-2.00%	0.03%
过去一年	-8.29%	0.73%	10.36%	0.40%	-18.65%	0.33%
过去三年	-18.01%	2.00%	48.03%	1.05%	-66.04%	0.95%
自基金合同生效起至今	30.81%	1.54%	50.45%	0.94%	-19.64%	0.60%

注：本基金的业绩比较基准： $60\% \times$  沪深 300 指数收益率  $+40\% \times$  上证国债指数收益率。沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，该指数的指数样本覆盖了沪深两地市场七成左右的市值，具有良好的市场代表性。上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成，具有良好的市场代表性。



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

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		
杨超	本基金基金经理	2016 年 12 月 27 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，历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，担任基金经理助理，现任基金经理。具备 7 年证券基金从业经验，7 年证券投资基金管理经验，具有基金从业资格。
庞宝臣	本基金基金经理	2017 年 5 月 18 日	-	11	2006 年 7 月至 2011 年 8 月，任职于永安财产保险股份有限公司，担任投资经理，负责债券研究与投资工作；2011 年 9 月至 2012 年 8 月，任职于幸福人寿保险股份有限公司，担任高级经理、固定收益投资室负责人，负责债券投资工作；2012 年 9 月至 2014 年 9 月，任职于中华联合保险股份有限公司投资管理部，担任高级主管一职；2014 年 9 月至 2016 年 3 月 7 日，任职于中华联合保险控股股份有限公司，担任投资经理一职；2016 年 3 月 10 日加入泰达宏利基金管理有限公司，担任固定收益部基金经理一职；具备 11 年证券投资基金管理经验，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，没有发生利益输送、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策略，坚持均衡配置和风险分散。

### 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 0.874 元；本报告期基金份额净值增长率为 4.55%，业绩比较基准收益率为 6.55%。

## 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。本基金将恪守基金合同，积极为投资者寻找估值合理兼顾成长性的个股进行均衡配置。

#### 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	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	6.4.7.1	7,493,601.10	51,924,739.40
结算备付金		514,190.09	181,531.83
存出保证金		26,111.13	15,683.58
交易性金融资产	6.4.7.2	148,357,224.82	248,235,177.20
其中：股票投资		123,370,724.82	93,811,177.20
基金投资		-	-
债券投资		24,986,500.00	154,424,000.00
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	-	20,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	497,040.47	1,187,160.69
应收股利		-	-
应收申购款		985.22	1,521.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		156,889,152.83	321,545,813.92
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年6月30日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	20,003,041.90
应付赎回款		13,014.89	913.06
应付管理人报酬		124,853.02	139,748.57

应付托管费		44,590.37	23,291.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	174,931.62	174,036.85
应交税费		81,360.00	81,360.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	190,461.83	109,000.00
负债合计		629,211.73	20,531,391.80
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	178,860,410.70	360,102,701.68
未分配利润	6.4.7.10	-22,600,469.60	-59,088,279.56
所有者权益合计		156,259,941.10	301,014,422.12
负债和所有者权益总计		156,889,152.83	321,545,813.92

注：报告截止日 2017 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.874 元，基金份额总额 178,860,410.70 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金

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	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
<b>一、收入</b>		10,421,312.20	-8,932,202.94
1.利息收入		2,235,422.32	100,504.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	28,852.83	13,740.58
债券利息收入		2,144,790.99	86,763.74
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		61,778.50	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,951,930.77	-10,407,341.83
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,291,296.54	-10,467,090.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	932,165.96	-22,908.99
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	728,468.27	82,657.94
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,044,233.93	1,336,568.27
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	189,725.18	38,066.30

减：二、费用		2,927,143.95	796,452.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,847,538.83	351,307.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	357,945.34	58,551.17
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	480,827.18	310,432.94
5. 利息支出		27,906.44	855.07
其中：卖出回购金融资产支出		27,906.44	855.07
6. 其他费用	6.4.7.20	212,926.16	75,306.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,494,168.25	-9,728,655.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,494,168.25	-9,728,655.59

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金

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）	360,102,701.68	-59,088,279.56	301,014,422.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,494,168.25	7,494,168.25
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）	-181,242,290.98	28,993,641.71	-152,248,649.27
其中：1. 基金申购款	1,707,067.58	-264,675.49	1,442,392.09
2. 基金赎回款	-182,949,358.56	29,258,317.20	-153,691,041.36
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）	178,860,410.70	-22,600,469.60	156,259,941.10



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)	45,779,970.22	7,782,252.20	53,562,222.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-9,728,655.59	-9,728,655.59
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)	-7,760,033.51	159,973.27	-7,600,060.24
其中：1.基金申购款	26,927,173.51	-3,002,526.24	23,924,647.27
2.基金赎回款	-34,687,207.02	3,162,499.51	-31,524,707.51
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)	38,019,936.71	-1,786,430.12	36,233,506.59

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：

<u>          刘建          </u>	<u>          傅国庆          </u>	<u>          王泉          </u>
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

泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”，原泰达荷银品质生活灵活配置混合型证券投资基金)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]第 1248 号《关于核准泰达荷银品质生活灵活配置混合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《泰达荷银品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,294,571,230.82 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2009)第 063 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰达荷银品质生活灵活配置混合型证券投资

基金基金合同》于 2009 年 4 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,294,884,284.12 份基金份额,其中认购资金利息折合 313,053.30 份基金份额。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

2010 年 3 月 17 日,经基金管理人董事会批准、报中国证监会同意,本基金更名为泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中股票资产占基金资产的 30%—80%,债券资产占基金资产的 15%—65%,权证占基金资产净值的 0—3%,资产支持证券占基金资产净值的 0—20%,并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:60%×沪深 300 指数收益率+40%×上证国债指数收益率。

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》、《泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 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**

本基金本报告期内无会计政策的变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计的变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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)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	7,493,601.10
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	7,493,601.10

#### 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	119,273,270.95	123,370,724.82	4,097,453.87
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,986,000.00	4,994,500.00
	银行间市场	19,906,158.63	19,992,000.00
	合计	24,892,158.63	24,986,500.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	144,165,429.58	148,357,224.82	4,191,795.24

#### 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	1,495.97
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	231.40
应收债券利息	495,301.38
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.02
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	11.70
合计	497,040.47

#### 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	171,474.80
银行间市场应付交易费用	3,456.82
合计	174,931.62

#### 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	40.78
预提费用	190,421.05
合计	190,461.83

#### 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	360,102,701.68	360,102,701.68
本期申购	1,707,067.58	1,707,067.58
本期赎回(以“-”号填列)	-182,949,358.56	-182,949,358.56

- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	178,860,410.70	178,860,410.70

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	93,402,027.99	-152,490,307.55	-59,088,279.56
本期利润	3,449,934.32	4,044,233.93	7,494,168.25
本期基金份额交易产生的变动数	-50,205,624.15	79,199,265.86	28,993,641.71
其中：基金申购款	451,979.29	-716,654.78	-264,675.49
基金赎回款	-50,657,603.44	79,915,920.64	29,258,317.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	46,646,338.16	-69,246,807.76	-22,600,469.60

### 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	21,440.33
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	7,167.75
其他	244.75
合计	28,852.83

### 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	150,332,385.46
减：卖出股票成本总额	148,041,088.92
买卖股票差价收入	2,291,296.54

### 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

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	932,165.96
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	932,165.96

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	215,466,897.86
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	210,620,183.49
减：应收利息总额	3,914,548.41
买卖债券差价收入	932,165.96

#### 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	728,468.27
基金投资产生的股利收益	-
合计	728,468.27

#### 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	4,044,233.93
——股票投资	4,049,228.93
——债券投资	-4,995.00
——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	4,044,233.93



### 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	189,694.71
基金转换费收入	30.47
其他	-
合计	189,725.18

注：1. 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。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

### 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	478,002.18
银行间市场交易费用	2,825.00
合计	480,827.18

### 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	41,655.34
信息披露费	148,765.71
其他	800.00
银行费用	3,705.11
债券帐户维护费	18,000.00
合计	212,926.16

## 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、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	1,847,538.83	351,307.05
其中：支付销售机构的客	42,309.72	48,119.05

户维护费		
------	--	--

注：自基金合同生效日起，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。根据泰达宏利基金管理有限公司《关于调整泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金管理费率并修改基金合同金和托管协议的公告》，自 2017 年 5 月 8 日起，本基金管理人报酬调整为按前一日基金资产净值 0.7% 的年费率计提。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 约定管理费率 / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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	357,945.34	58,551.17

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

##### 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		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
中国建设银行	7,493,601.10	21,440.33	1,652,649.39	11,444.28

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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	-
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	-

### 6.4.12.2 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
601727	上海电气	2017年6月22日	重大事项	7.57	2017年7月3日	7.54	178,000	1,198,774.00	1,347,460.00	-
002010	传化智联	2017年6月30日	重大事项	15.26	2017年7月4日	16.77	76,755	1,207,540.25	1,171,281.30	-
600057	象屿股份	2017年6月27日	重大事项	10.17	2017年7月4日	10.17	108,316	1,256,835.08	1,101,573.72	-
600559	老白干酒	2017年1月23日	重大事项	22.69	-	-	41,850	937,693.50	949,576.50	-
000153	丰原药业	2017年1月16日	重大事项	12.52	2017年7月12日	11.27	62,000	810,733.00	776,240.00	-
300092	科新机电	2017年4月14日	重大事项	12.70	-	-	192	2,664.01	2,438.40	-

### 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

本基金是一只偏股型的混合型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主

要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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相对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“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

#### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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

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

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

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

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	10,000,000.00	19,870,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	99,642,000.00
合计	10,000,000.00	119,512,000.00

注：以上未评级的债券投资中包括同业存单以及超短期融资券等。

### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	14,986,500.00	34,912,000.00
合计	14,986,500.00	34,912,000.00

注：以上未评级的债券投资中包括国债、政策性金融债、地方债及央行票据等。

### 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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	7,493,601.10	-	-	-	7,493,601.10
结算备付金	514,190.09	-	-	-	514,190.09
存出保证金	26,111.13	-	-	-	26,111.13
交易性金融资产	24,986,500.00	-	-	123,370,724.82	148,357,224.82
应收利息	-	-	-	497,040.47	497,040.47
应收申购款	-	-	-	985.22	985.22
其他资产	-	-	-	-	-



资产总计	33,020,402.32	-	-	-123,868,750.51	156,889,152.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	13,014.89	13,014.89
应付管理人报酬	-	-	-	124,853.02	124,853.02
应付托管费	-	-	-	44,590.37	44,590.37
应付交易费用	-	-	-	174,931.62	174,931.62
应交税费	-	-	-	81,360.00	81,360.00
其他负债	-	-	-	190,461.83	190,461.83
负债总计	-	-	-	629,211.73	629,211.73
利率敏感度缺口	33,020,402.32	-	-	-123,239,538.78	156,259,941.10
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	51,924,739.40	-	-	-	51,924,739.40
结算备付金	181,531.83	-	-	-	181,531.83
存出保证金	15,683.58	-	-	-	15,683.58
交易性金融资产	154,424,000.00	-	-	93,811,177.20	248,235,177.20
买入返售金融资产	20,000,000.00	-	-	-	20,000,000.00
应收利息	-	-	-	1,187,160.69	1,187,160.69
应收申购款	-	-	-	1,521.22	1,521.22
资产总计	226,545,954.81	-	-	94,999,859.11	321,545,813.92
负债					
应付证券清算款	-	-	-	20,003,041.90	20,003,041.90
应付赎回款	-	-	-	913.06	913.06
应付管理人报酬	-	-	-	139,748.57	139,748.57
应付托管费	-	-	-	23,291.42	23,291.42
应付交易费用	-	-	-	174,036.85	174,036.85
应交税费	-	-	-	81,360.00	81,360.00
其他负债	-	-	-	109,000.00	109,000.00
负债总计	-	-	-	20,531,391.80	20,531,391.80
利率敏感度缺口	226,545,954.81	-	-	74,468,467.31	301,014,422.12

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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）
	市场利率下降 25 个基点	10,000.00	190,000.00

	市场利率上升 25 个基点	-10,000.00	-190,000.00
--	---------------	------------	-------------

#### 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。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 30%-80%，债券资产占基金资产的 15%-65%，权证占基金资产净值的 0%-3%，资产支持证券占基金资产净值的 0%-20%，并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 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	123,370,724.82	78.95	93,811,177.20	31.17
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	123,370,724.82	78.95	93,811,177.20	31.17

#### 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%	6,160,000.00	16,670,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-6,160,000.00	-16,670,000.00

#### 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	123,370,724.82	78.64
	其中：股票	123,370,724.82	78.64
2	固定收益投资	24,986,500.00	15.93
	其中：债券	24,986,500.00	15.93
	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	8,007,791.19	5.10
7	其他各项资产	524,136.82	0.33
8	合计	156,889,152.83	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,213,750.00	0.78
B	采矿业	7,502,637.10	4.80
C	制造业	66,483,956.37	42.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,376,676.00	4.08
E	建筑业	6,012,131.24	3.85
F	批发和零售业	5,569,588.05	3.56
G	交通运输、仓储和邮政业	5,788,751.00	3.70
H	住宿和餐饮业	1,265,570.00	0.81
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,215,486.98	3.34
J	金融业	2,444,802.96	1.56
K	房地产业	10,858,009.40	6.95
L	租赁和商务服务业	3,428,905.72	2.19
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	1,210,460.00	0.77
S	综合	-	-
	合计	123,370,724.82	78.95

### 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	603993	洛阳钼业	269,000	1,361,140.00	0.87
2	601727	上海电气	178,000	1,347,460.00	0.86
3	600516	方大炭素	93,500	1,329,570.00	0.85
4	002601	龙蟒佰利	80,800	1,323,504.00	0.85
5	000050	深天马A	64,200	1,320,594.00	0.85
6	600690	青岛海尔	87,200	1,312,360.00	0.84
7	000426	兴业矿业	143,500	1,294,370.00	0.83
8	002530	金财互联	43,898	1,293,235.08	0.83
9	002019	亿帆医药	77,056	1,285,294.08	0.82
10	601800	中国交建	80,700	1,282,323.00	0.82
11	600856	中天能源	113,200	1,274,632.00	0.82
12	600754	锦江股份	46,700	1,265,570.00	0.81
13	600160	巨化股份	104,800	1,260,744.00	0.81
14	600900	长江电力	81,900	1,259,622.00	0.81
15	002589	瑞康医药	81,600	1,256,640.00	0.80
16	600309	万华化学	43,680	1,250,995.20	0.80
17	601127	小康股份	62,600	1,248,870.00	0.80
18	600019	宝钢股份	185,800	1,246,718.00	0.80
19	000060	中金岭南	111,300	1,246,560.00	0.80
20	300072	三聚环保	33,600	1,244,880.00	0.80
21	002352	顺丰控股	23,300	1,238,628.00	0.79
22	000425	徐工机械	330,000	1,237,500.00	0.79
23	000959	首钢股份	176,900	1,236,531.00	0.79
24	600966	博汇纸业	238,200	1,236,258.00	0.79
25	601186	中国铁建	102,300	1,230,669.00	0.79

26	600398	海澜之家	129,600	1,229,904.00	0.79
27	002078	太阳纸业	166,800	1,225,980.00	0.78
28	300124	汇川技术	48,000	1,225,920.00	0.78
29	002434	万里扬	77,000	1,225,840.00	0.78
30	600269	赣粤高速	234,600	1,222,266.00	0.78
31	600438	通威股份	219,000	1,222,020.00	0.78
32	002270	华明装备	113,912	1,221,136.64	0.78
33	000036	华联控股	134,100	1,220,310.00	0.78
34	600297	广汇汽车	161,750	1,217,977.50	0.78
35	600663	陆家嘴	51,500	1,217,460.00	0.78
36	300193	佳士科技	146,300	1,215,753.00	0.78
37	002558	巨人网络	26,280	1,214,661.60	0.78
38	600415	小商品城	167,700	1,214,148.00	0.78
39	000735	罗牛山	194,200	1,213,750.00	0.78
40	600688	上海石化	183,500	1,212,935.00	0.78
41	600510	黑牡丹	158,200	1,211,812.00	0.78
42	002563	森马服饰	142,900	1,211,792.00	0.78
43	601669	中国电建	153,000	1,211,760.00	0.78
44	600498	烽火通信	47,800	1,211,730.00	0.78
45	300144	宋城演艺	58,000	1,210,460.00	0.77
46	600028	中国石化	204,100	1,210,313.00	0.77
47	000046	泛海控股	138,300	1,207,359.00	0.77
48	002266	浙富控股	247,300	1,206,824.00	0.77
49	600115	东方航空	176,900	1,202,920.00	0.77
50	002304	洋河股份	13,854	1,202,665.74	0.77
51	601857	中国石油	156,000	1,199,640.00	0.77
52	600547	山东黄金	41,400	1,197,702.00	0.77
53	002475	立讯精密	40,855	1,194,600.20	0.76
54	000898	鞍钢股份	211,000	1,194,260.00	0.76
55	600383	金地集团	103,800	1,190,586.00	0.76
56	000564	供销大集	182,800	1,190,028.00	0.76
57	000568	泸州老窖	23,500	1,188,630.00	0.76
58	300113	顺网科技	44,100	1,186,290.00	0.76
59	600009	上海机场	31,700	1,182,727.00	0.76
60	300116	坚瑞沃能	110,000	1,182,500.00	0.76
61	601390	中国中铁	136,100	1,179,987.00	0.76
62	002677	浙江美大	84,600	1,178,478.00	0.75
63	002010	传化智联	76,755	1,171,281.30	0.75
64	002555	三七互娱	45,158	1,154,690.06	0.74

65	601238	广汽集团	43,945	1,145,206.70	0.73
66	000517	荣安地产	246,176	1,144,718.40	0.73
67	600981	汇鸿集团	154,355	1,143,770.55	0.73
68	002466	天齐锂业	20,800	1,130,480.00	0.72
69	600021	上海电力	92,700	1,120,743.00	0.72
70	002564	天沃科技	122,600	1,119,338.00	0.72
71	601601	中国太保	32,941	1,115,711.67	0.71
72	002027	分众传媒	80,900	1,113,184.00	0.71
73	000002	万 科A	44,500	1,111,165.00	0.71
74	600057	象屿股份	108,316	1,101,573.72	0.70
75	600103	青山纸业	274,100	1,090,918.00	0.70
76	600748	上实发展	149,700	1,077,840.00	0.69
77	600236	桂冠电力	188,800	1,076,160.00	0.69
78	300179	四方达	163,500	1,069,290.00	0.68
79	600031	三一重工	126,400	1,027,632.00	0.66
80	000761	本钢板材	194,723	1,018,401.29	0.65
81	600873	梅花生物	172,500	978,075.00	0.63
82	600580	卧龙电气	142,600	972,532.00	0.62
83	601818	光大银行	237,600	962,280.00	0.62
84	000598	兴蓉环境	171,200	962,144.00	0.62
85	000157	中联重科	212,400	953,676.00	0.61
86	600559	老白干酒	41,850	949,576.50	0.61
87	601000	唐山港	180,500	942,210.00	0.60
88	000800	一汽轿车	88,900	904,113.00	0.58
89	002536	西泵股份	72,600	898,788.00	0.58
90	002385	大北农	142,800	898,212.00	0.57
91	600094	大名城	117,000	897,390.00	0.57
92	002594	比亚迪	17,100	854,145.00	0.55
93	601898	中煤能源	142,100	835,548.00	0.53
94	600352	浙江龙盛	86,400	823,392.00	0.53
95	600597	光明乳业	63,200	805,800.00	0.52
96	600519	贵州茅台	1,700	802,145.00	0.51
97	000153	丰原药业	62,000	776,240.00	0.50
98	600648	外高桥	41,100	761,172.00	0.49
99	002093	国脉科技	86,129	757,935.20	0.49
100	601985	中国核电	87,500	683,375.00	0.44
101	002533	金杯电工	79,100	597,996.00	0.38
102	002146	荣盛发展	58,700	579,369.00	0.37
103	002713	东易日盛	26,200	533,694.00	0.34

104	000065	北方国际	22,400	532,672.00	0.34
105	002177	御银股份	88,500	502,680.00	0.32
106	300033	同花顺	7,900	491,459.00	0.31
107	600307	酒钢宏兴	165,700	472,245.00	0.30
108	300040	九洲电气	44,300	449,202.00	0.29
109	002155	湖南黄金	42,200	403,854.00	0.26
110	000651	格力电器	9,400	386,998.00	0.25
111	601100	恒立液压	20,500	333,945.00	0.21
112	002131	利欧股份	99,150	326,203.50	0.21
113	600600	青岛啤酒	9,200	322,920.00	0.21
114	600010	包钢股份	137,200	300,468.00	0.19
115	002092	中泰化学	22,800	289,560.00	0.19
116	002437	誉衡药业	37,900	275,912.00	0.18
117	002026	山东威达	29,100	263,937.00	0.17
118	600879	航天电子	28,700	252,273.00	0.16
119	601179	中国西电	44,600	247,976.00	0.16
120	600567	山鹰纸业	63,900	228,762.00	0.15
121	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.12
122	601318	中国平安	3,600	178,596.00	0.11
123	002436	兴森科技	27,600	173,880.00	0.11
124	601388	怡球资源	49,000	173,460.00	0.11
125	300292	吴通控股	18,200	123,214.00	0.08
126	600231	凌钢股份	37,300	123,090.00	0.08
127	603077	和邦生物	22,700	115,543.00	0.07
128	002406	远东传动	13,100	105,979.00	0.07
129	300324	旋极信息	4,200	76,608.00	0.05
130	002446	盛路通信	5,780	70,342.60	0.05
131	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.03
132	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.03
133	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.03
134	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.02
135	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.02
136	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
137	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
138	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
139	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
140	600449	宁夏建材	1,500	14,415.00	0.01
141	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
142	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01



143	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
144	603331	百达精工	999	9,620.37	0.01
145	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
146	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
147	601877	正泰电器	300	6,027.00	0.00
148	002460	赣锋锂业	72	3,330.00	0.00
149	600660	福耀玻璃	100	2,604.00	0.00
150	300092	科新机电	192	2,438.40	0.00
151	600068	葛洲坝	200	2,248.00	0.00
152	600816	安信信托	20	271.80	0.00
153	000758	中色股份	10	70.10	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	600519	贵州茅台	2,081,321.04	0.69
2	600449	宁夏建材	1,805,677.00	0.60
3	600089	特变电工	1,595,989.03	0.53
4	601038	一拖股份	1,593,690.00	0.53
5	600966	博汇纸业	1,558,486.10	0.52
6	300033	同花顺	1,478,877.00	0.49
7	002579	中京电子	1,401,703.00	0.47
8	000735	罗牛山	1,360,339.90	0.45
9	601000	唐山港	1,336,153.00	0.44
10	600856	中天能源	1,331,525.83	0.44
11	600688	上海石化	1,327,981.00	0.44
12	002270	华明装备	1,321,820.26	0.44
13	600510	黑牡丹	1,320,037.00	0.44
14	000004	国农科技	1,313,937.00	0.44
15	600663	陆家嘴	1,311,139.93	0.44
16	600502	安徽水利	1,310,281.00	0.44
17	002131	利欧股份	1,309,501.00	0.44
18	002078	太阳纸业	1,304,082.15	0.43
19	002434	万里扬	1,302,481.00	0.43

20	600297	广汇汽车	1,300,535.00	0.43
----	--------	------	--------------	------

注：表中“买入金额”为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000069	华侨城 A	1,658,221.92	0.55
2	600089	特变电工	1,603,410.35	0.53
3	002457	青龙管业	1,511,685.00	0.50
4	600816	安信信托	1,492,497.00	0.50
5	000709	河钢股份	1,447,641.00	0.48
6	600449	宁夏建材	1,430,814.00	0.48
7	002139	拓邦股份	1,398,417.00	0.46
8	002460	赣锋锂业	1,345,897.00	0.45
9	002085	万丰奥威	1,336,541.00	0.44
10	600519	贵州茅台	1,321,074.00	0.44
11	600308	华泰股份	1,315,025.00	0.44
12	601038	一拖股份	1,304,294.00	0.43
13	600068	葛洲坝	1,299,409.75	0.43
14	000900	现代投资	1,296,253.00	0.43
15	601600	中国铝业	1,289,390.00	0.43
16	300017	网宿科技	1,277,071.00	0.42
17	300064	豫金刚石	1,238,497.00	0.41
18	600362	江西铜业	1,233,611.00	0.41
19	600668	尖峰集团	1,219,896.00	0.41
20	600023	浙能电力	1,219,531.57	0.41

注：表中“卖出金额”为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	173,551,407.61
卖出股票收入（成交）总额	150,332,385.46

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	4,994,500.00	3.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,992,000.00	6.39
	其中：政策性金融债	9,992,000.00	6.39
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,000,000.00	6.40
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,986,500.00	15.99

## 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	041660071	16 内蒙电投 CP001	100,000	10,000,000.00	6.40
2	160308	16 进出 08	100,000	9,992,000.00	6.39
3	019546	16 国债 18	50,000	4,994,500.00	3.20

注：以上为本基金本报告期末持有的全部债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期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	26,111.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	497,040.47
5	应收申购款	985.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	524,136.82

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601727	上海电气	1,347,460.00	0.86	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
3,396	52,667.97	142,965,311.00	79.93%	35,895,099.70	20.07%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	21,557.22	0.0121%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	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（2009年4月9日）基金份额总额	1,294,884,284.12
本报告期期初基金份额总额	360,102,701.68
本报告期基金总申购份额	1,707,067.58
减：本报告期基金总赎回份额	182,949,358.56
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	178,860,410.70

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，基金份额持有人大会表决投票时间为 2017 年 4 月 20 日起至 2017 年 5 月 3 日 17:00 止。本次基金份额持有人大会于 2017 年 5 月 4 日表决通过了《关于调整泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金管理费率的议案》。根据基金份额持有人大会通过的议案及方案说明，本基金管理费率自 2017 年 5 月 8 日起由 1.50%/年下调至 0.70%/年。详见本公司于 2017 年 3 月 27 日至 2017 年 5 月 6 日在指定媒体以及官网上发布的系列相关公告。

### 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

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	股票交易	应支付该券商的佣金
------	------	-----------

	交易单元 数量	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	备注
中金公司	2	162,513,565.39	50.59%	151,349.15	50.59%	-
海通证券	1	138,642,561.77	43.16%	129,118.30	43.16%	-
万联证券	1	20,071,825.70	6.25%	18,692.80	6.25%	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期末新增、撤销交易单元。

（二）交易单元选择的标准和程序

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

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
中金公司	11,136,381.53	100.00%	357,000,000.00	100.00%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《泰达宏利基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开泰达宏利	中国证券报、上海证券报、证券时报、公	2017年3月27日



	品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》	司网站	
2	《泰达宏利基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会第一次提示性公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 3 月 28 日
3	《泰达宏利基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会第二次提示性公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 3 月 29 日
4	《泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金持有人大会公证书》	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 5 月 6 日
5	《关于调整泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金费率并修改基金合同和托管协议的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 5 月 6 日
6	《关于泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 5 月 6 日
7	《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、公司网站	2017 年 5 月 20 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	322,965,311.00	0.00	180,000,000.00	142,965,311.00	79.93%
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。

## § 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》）或登录本基金管理人互联网网址（<http://www.mfcteda.com>）查阅。

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

泰达宏利基金管理有限公司

2017 年 8 月 28 日