

泰达宏利量化增强股票型证券投资基金 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.....	6
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
3.3 其他指标.....	错误！未定义书签。
§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.....	11
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
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本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.....	17
§7 投资组合报告.....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
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

§12 备查文件目录	50
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	泰达宏利量化增强股票型证券投资基金
基金简称	泰达宏利量化股票
基金主代码	001733
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 8 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
报告期末基金份额总额	234, 462, 510. 00 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为普通股票型基金，运用量化投资技术，在严格控制风险的前提下，力争为投资者获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金利用量化投资模型，在控制主动风险的基础上，力求投资业绩达到或超越业绩比较基准。
业绩比较基准	95%×中证 500 价格指数收益率+5%×人民银行一年期定存基准收益率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	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	1,929,572.61
本期利润	11,776,195.11
加权平均基金份额本期利润	0.0589
本期加权平均净值利润率	5.88%
本期基金份额净值增长率	5.89%
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	5,912,597.21
期末可供分配基金份额利润	0.0252
期末基金资产净值	240,375,107.21
期末基金份额净值	1.025
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	2.50%

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

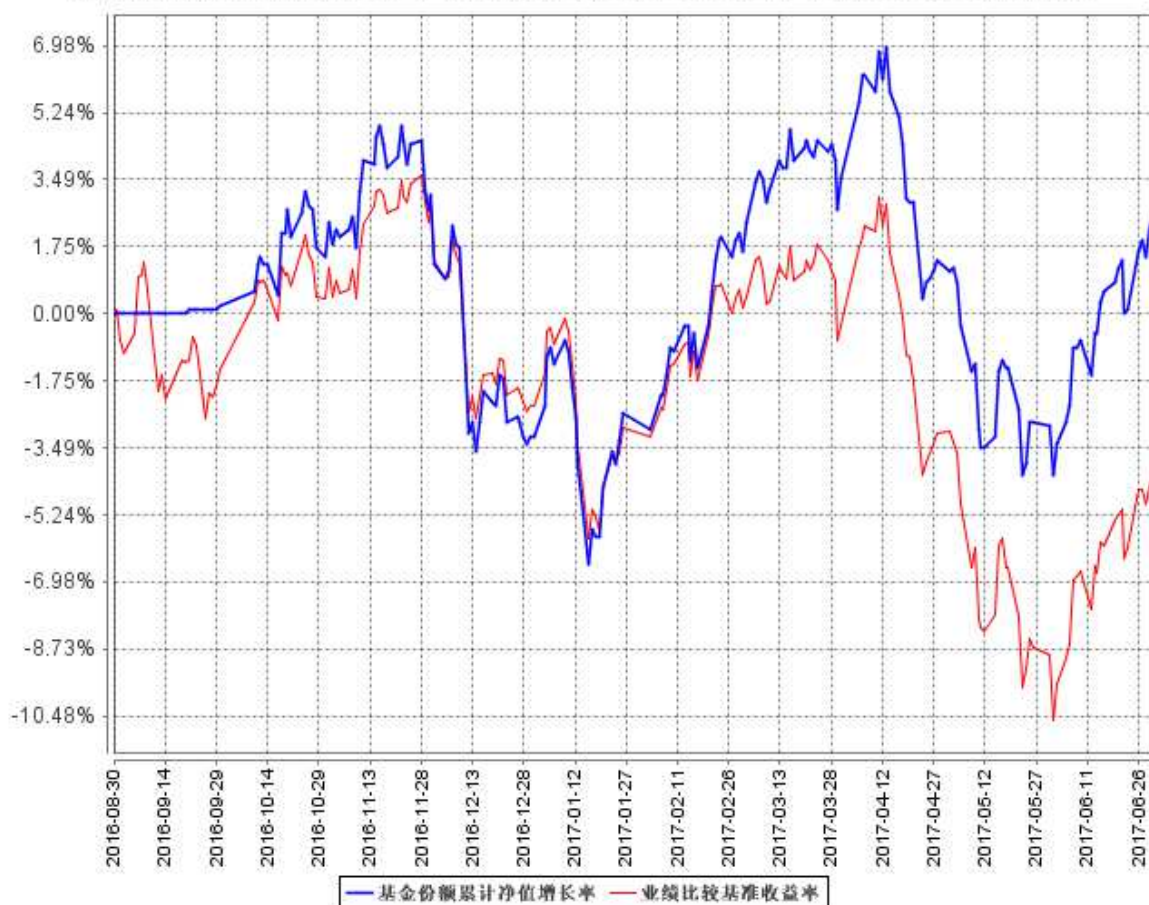
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.56%	0.76%	5.13%	0.89%	0.43%	-0.13%
过去三个月	-0.97%	0.87%	-3.88%	0.97%	2.91%	-0.10%
过去六个月	5.89%	0.81%	-1.85%	0.85%	7.74%	-0.04%
自基金合同生效起至今	2.50%	0.79%	-4.19%	0.83%	6.69%	-0.04%

注：本基金业绩比较基准：95%×中证 500 价格指数收益率+5%×人民银行一年期定存基准收益率（税后）。

中证 500 指数是中证指数有限公司编制并发布的市场指数，它的成份股为样本空间内股票扣除沪深 300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300 名的股票，剩余股票按照最近一年（新股为上市以来）的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的股票，然后将剩余股票按照日均总市值由高到低进行排名，选取排名在前 500 名的股票作为中证 500 指数样本股。中证 500 指数综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本基金成立于 2016 年 8 月 30 日，截止报告期末本基金成立不满一年。按基金合同规定，自基金合同生效日起六个月内为建仓期。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	基金经理	2016年8月30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

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，本基金综合运用多因子策略，积极寻找有长期风险溢价的资产，在合理的风险控制基础上构建组合，在比较基准下跌的情况下获得了一定幅度的绝对收益。

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 1.025 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.89%，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，更加注重企业基本面因素带来的定价影响，本基金将一如既往在科学合理的风险控制下积极寻找 Alpha 因子进行组合优化投资，力争为投资者提供长期、持续、稳健的 Alpha 收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管基金运营的副总经理担任主任，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

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰达宏利量化增强股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本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：泰达宏利量化增强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	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	12,297,475.45	10,816,583.97
结算备付金		587,317.12	1,432,463.75
存出保证金		47,118.88	177,191.46
交易性金融资产	6.4.7.2	227,772,430.07	187,712,734.46
其中：股票投资		227,772,430.07	187,712,734.46
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		701,635.32	4,708,687.06
应收利息	6.4.7.5	2,532.15	2,858.58
应收股利		-	-
应收申购款		1,478.76	237,405.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		241,409,987.75	205,087,925.14
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		-	-
应付赎回款		61,010.78	28,146.16
应付管理人报酬		202,000.20	230,847.89
应付托管费		42,083.38	48,093.33
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	551,227.68	1,036,916.45
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	178,558.50	165,038.73
负债合计		1,034,880.54	1,509,042.56
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	234,462,510.00	210,288,832.97
未分配利润	6.4.7.10	5,912,597.21	-6,709,950.39
所有者权益合计		240,375,107.21	203,578,882.58
负债和所有者权益总计		241,409,987.75	205,087,925.14

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.025 元，基金份额总额 234,462,510.00 份。

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利量化增强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	附注号	本期
-----	-----	----

		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		14,695,469.09
1.利息收入		46,216.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	46,216.82
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）		4,760,277.82
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,536,242.31
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	-
股利收益	6.4.7.16	1,224,035.51
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	9,846,622.50
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	42,351.95
减：二、费用		2,919,273.98
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,189,630.36
2. 托管费	6.4.10.2.2	247,839.70
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,288,567.97
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	193,235.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,776,195.11
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,776,195.11

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利量化增强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)	210,288,832.97	-6,709,950.39	203,578,882.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,776,195.11	11,776,195.11
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)	24,173,677.03	846,352.49	25,020,029.52
其中：1.基金申购款	76,405,537.68	1,936,479.38	78,342,017.06
2.基金赎回款	-52,231,860.65	-1,090,126.89	-53,321,987.54
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)	234,462,510.00	5,912,597.21	240,375,107.21

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

泰达宏利量化增强股票型证券投资基金(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[2015]1577号《关于核准泰达宏利量化增强股票型证券投资基金注册的批复》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《泰达宏利量化增强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人民币556,691,763.37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(2016)第1147号验资报告予以验证。经向

中国证监会备案,《泰达宏利量化增强股票型证券投资基金基金合同》于 2016 年 8 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 556,805,116.77 份基金份额,其中认购资金利息折合 113,353.40 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《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利量化增强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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的业绩比较基准为:95%X 中证 500 价格指数收益率+5%X 人民银行一年期定存基准收益率(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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利量化增强股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的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 重要会计政策和会计估计

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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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	12,297,475.45
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-

其他存款	-
合计：	12,297,475.45

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	228,942,316.05	227,772,430.07	-1,169,885.98
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	228,942,316.05	227,772,430.07	-1,169,885.98

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	2,274.42
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	238.57
应收债券利息	-

应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	19.15
合计	2,532.15

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	551,227.68
银行间市场应付交易费用	-
合计	551,227.68

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	40.01
预提费用	178,518.49
合计	178,558.50

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	210,288,832.97	210,288,832.97
本期申购	76,405,537.68	76,405,537.68
本期赎回(以“-”号填列)	-52,231,860.65	-52,231,860.65
- 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	234,462,510.00	234,462,510.00

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	3,982,875.30	-10,692,825.69	-6,709,950.39
本期利润	1,929,572.61	9,846,622.50	11,776,195.11
本期基金份额交易产生的变动数	1,308,197.63	-461,845.14	846,352.49
其中：基金申购款	3,515,799.37	-1,579,319.99	1,936,479.38
基金赎回款	-2,207,601.74	1,117,474.85	-1,090,126.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,220,645.54	-1,308,048.33	5,912,597.21

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	38,722.23
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,683.84
其他	2,810.75
合计	46,216.82

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	416,206,783.13
减：卖出股票成本总额	412,670,540.82
买卖股票差价收入	3,536,242.31

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

本基金本报告期无债券投资收益-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

本基金本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-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	1,224,035.51
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,224,035.51

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	9,846,622.50
——股票投资	9,846,622.50
——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	9,846,622.50

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	41,383.75
基金转换费收入	968.20
合计	42,351.95

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，其中不低于转出基金的赎回费的 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	1,288,567.97
银行间市场交易费用	-
合计	1,288,567.97

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	29,752.78
信息披露费	148,765.71
帐户维护费	9,000.00
银行费用	5,717.46
合计	193,235.95

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

本基金本报告期未通过关联交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内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
当期发生的基金应支付的管理费	1,189,630.36
其中：支付销售机构的客户维护费	145,448.35

注：支付基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.20% / 当年天数。

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
当期发生的基金应支付的托管费	247,839.70

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 0.25% 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。

6.4.10.3 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	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	12,297,475.45	38,722.23

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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	-

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	-

6.4.12.2 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
002505	大康农业	2017年3月13日	重大事项	3.50	-	-	629,000	2,224,802.12	2,201,500.00	-
002600	江粉磁材	2017年2月27日	重大事项	11.46	2017年8月9日	6.25	174,000	1,702,346.59	1,994,040.00	-
000034	神州数码	2017年3月21日	重大事	24.45	2017年7月18日	22.01	80,000	2,191,474.10	1,956,000.00	-

002654	万润科技	2017年5月10日	重大事件	9.28	-	-	158,200	2,085,395.90	1,468,096.00	-
300075	数字政通	2017年6月29日	重大事件	20.94	2017年7月17日	18.86	68,900	1,423,067.71	1,442,766.00	-
600057	象屿股份	2017年6月27日	重大事件	10.17	2017年7月4日	10.17	137,047	1,554,858.70	1,393,767.99	-
600654	*ST中安	2017年6月7日	重大事件	13.48	-	-	90,400	1,847,296.00	1,218,592.00	-
300267	尔康制药	2017年5月10日	重大事件	11.46	-	-	83,195	1,151,678.72	953,414.70	-
300252	金信诺	2017年4月27日	重大事件	21.65	2017年7月27日	19.49	14,900	396,517.52	322,585.00	-
601919	中远海控	2017年5月17日	重大事件	5.35	2017年7月26日	5.89	34,501	184,969.35	184,580.35	-
601727	上海电气	2017年6月22日	重大事件	7.57	2017年7月3日	7.54	900	6,066.00	6,813.00	-
002356	赫美集团	2017年6月14日	重大事件	25.41	-	-	200	4,852.47	5,082.00	-

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

本基金是股票型证券投资基金，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运用量化投资技术，在严格控制风险的前提下，力争为投资者获取超越业绩比较基准的收益。

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。风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

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

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，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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持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，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 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	12,297,475.45	-	-	-	12,297,475.45
结算备付金	587,317.12	-	-	-	587,317.12
存出保证金	47,118.88	-	-	-	47,118.88
交易性金融资产	-	-	-	-227,772,430.07	227,772,430.07
应收证券清算款	-	-	-	701,635.32	701,635.32
应收利息	-	-	-	2,532.15	2,532.15
应收申购款	-	-	-	1,478.76	1,478.76
资产总计	12,931,911.45	-	-	-228,478,076.30	241,409,987.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	61,010.78	61,010.78
应付管理人报酬	-	-	-	202,000.20	202,000.20
应付托管费	-	-	-	42,083.38	42,083.38
应付交易费用	-	-	-	551,227.68	551,227.68
其他负债	-	-	-	178,558.50	178,558.50
负债总计	-	-	-	1,034,880.54	1,034,880.54
利率敏感度缺口	12,931,911.45	-	-	-227,443,195.76	240,375,107.21
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	10,816,583.97	-	-	-	10,816,583.97
结算备付金	1,432,463.75	-	-	-	1,432,463.75
存出保证金	177,191.46	-	-	-	177,191.46
交易性金融资产	-	-	-	-187,712,734.46	187,712,734.46
应收证券清算款	-	-	-	4,708,687.06	4,708,687.06
应收利息	-	-	-	2,858.58	2,858.58
应收申购款	-	-	-	237,405.86	237,405.86
资产总计	12,426,239.18	-	-	-192,661,685.96	205,087,925.14
负债					

应付赎回款	-	-	-	28,146.16	28,146.16
应付管理人报酬	-	-	-	230,847.89	230,847.89
应付托管费	-	-	-	48,093.33	48,093.33
应付交易费用	-	-	-	1,036,916.45	1,036,916.45
其他负债	-	-	-	165,038.73	165,038.73
负债总计	-	-	-	1,509,042.56	1,509,042.56
利率敏感度缺口	12,426,239.18	-	-	-191,152,643.40	203,578,882.58

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资产(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。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 80%-95%；权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，本基金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	227,772,430.07	94.76	187,712,734.46	92.21
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	227,772,430.07	94.76	187,712,734.46	92.21

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金运作尚不足一年，无足够经验数据。

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	227,772,430.07	94.35
	其中：股票	227,772,430.07	94.35
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	12,884,792.57	5.34
7	其他各项资产	752,765.11	0.31
8	合计	241,409,987.75	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	2,370,440.00	0.99
B	采矿业	13,779,677.04	5.73
C	制造业	127,472,098.84	53.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,711,487.20	2.79
E	建筑业	6,367,782.92	2.65
F	批发和零售业	15,743,423.37	6.55
G	交通运输、仓储和邮政业	5,081,639.35	2.11
H	住宿和餐饮业	837,390.00	0.35
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,677,198.62	4.86
J	金融业	1,961,887.04	0.82
K	房地产业	18,279,077.34	7.60

L	租赁和商务服务业	7,175,079.99	2.98
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,520,983.20	2.71
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	3,756,720.16	1.56
S	综合	37,545.00	0.02
	合计	227,772,430.07	94.76

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	600487	亨通光电	125,200	3,511,860.00	1.46
2	000997	新大陆	129,600	2,940,624.00	1.22
3	600325	华发股份	334,800	2,795,580.00	1.16
4	002601	龙鳞佰利	170,600	2,794,428.00	1.16
5	002573	清新环境	145,500	2,738,310.00	1.14
6	600183	生益科技	220,100	2,716,034.00	1.13
7	002019	亿帆医药	153,300	2,557,044.00	1.06
8	002589	瑞康医药	162,506	2,502,592.40	1.04
9	002266	浙富控股	499,730	2,438,682.40	1.01
10	600026	中远海能	361,900	2,399,397.00	1.00
11	000078	海王生物	378,400	2,281,752.00	0.95
12	600586	金晶科技	465,100	2,274,339.00	0.95
13	002636	金安国纪	131,500	2,271,005.00	0.94
14	002233	塔牌集团	185,900	2,262,403.00	0.94
15	600466	蓝光发展	260,700	2,249,841.00	0.94
16	000426	兴业矿业	247,300	2,230,646.00	0.93
17	600879	航天电子	251,800	2,213,322.00	0.92
18	002505	大康农业	629,000	2,201,500.00	0.92
19	300116	坚瑞沃能	203,500	2,187,625.00	0.91

20	000598	兴蓉环境	380,300	2,137,286.00	0.89
21	600067	冠城大通	309,923	2,129,171.01	0.89
22	600059	古越龙山	229,100	2,119,175.00	0.88
23	600266	北京城建	142,930	2,078,202.20	0.86
24	600711	盛屯矿业	310,900	2,064,376.00	0.86
25	000725	京东方 A	496,000	2,063,360.00	0.86
26	002688	金河生物	231,300	2,056,257.00	0.86
27	000036	华联控股	225,867	2,055,389.70	0.86
28	600271	航天信息	99,500	2,053,680.00	0.85
29	600873	梅花生物	360,810	2,045,792.70	0.85
30	601636	旗滨集团	451,200	2,034,912.00	0.85
31	600438	通威股份	363,400	2,027,772.00	0.84
32	300194	福安药业	290,100	2,016,195.00	0.84
33	601388	怡球资源	569,500	2,016,030.00	0.84
34	600648	外高桥	108,308	2,005,864.16	0.83
35	600252	中恒集团	496,000	2,003,840.00	0.83
36	002416	爱施德	185,598	2,002,602.42	0.83
37	002600	江粉磁材	174,000	1,994,040.00	0.83
38	600415	小商品城	274,600	1,988,104.00	0.83
39	002091	江苏国泰	206,255	1,969,735.25	0.82
40	000034	神州数码	80,000	1,956,000.00	0.81
41	000793	华闻传媒	192,500	1,948,100.00	0.81
42	600807	天业股份	206,301	1,945,418.43	0.81
43	603993	洛阳钼业	379,800	1,921,788.00	0.80
44	300292	吴通控股	280,600	1,899,662.00	0.79
45	600567	山鹰纸业	529,600	1,895,968.00	0.79
46	601179	中国西电	340,300	1,892,068.00	0.79
47	000826	启迪桑德	53,860	1,891,563.20	0.79
48	300070	碧水源	101,400	1,891,110.00	0.79
49	002653	海思科	145,100	1,887,751.00	0.79
50	002609	捷顺科技	126,100	1,887,717.00	0.79
51	002431	棕榈股份	170,700	1,881,114.00	0.78
52	000813	德展健康	213,250	1,840,347.50	0.77
53	300420	五洋科技	220,200	1,818,852.00	0.76
54	601100	恒立液压	111,579	1,817,621.91	0.76
55	002303	美盈森	235,300	1,816,516.00	0.76
56	002247	帝龙文化	138,000	1,810,560.00	0.75
57	300251	光线传媒	220,664	1,807,238.16	0.75
58	002018	华信国际	262,960	1,801,276.00	0.75

59	603986	兆易创新	22,900	1,781,849.00	0.74
60	300159	新研股份	132,300	1,751,652.00	0.73
61	600690	青岛海尔	115,800	1,742,790.00	0.73
62	603969	银龙股份	87,800	1,731,416.00	0.72
63	600785	新华百货	73,926	1,729,129.14	0.72
64	600383	金地集团	149,900	1,719,353.00	0.72
65	300171	东富龙	145,800	1,704,402.00	0.71
66	600188	兖州煤业	138,871	1,699,781.04	0.71
67	600116	三峡水利	151,400	1,697,194.00	0.71
68	002680	长生生物	110,800	1,694,132.00	0.70
69	000338	潍柴动力	125,500	1,656,600.00	0.69
70	600170	上海建工	433,374	1,655,488.68	0.69
71	000650	仁和药业	276,100	1,651,078.00	0.69
72	600160	巨化股份	132,300	1,591,569.00	0.66
73	600871	石化油服	471,200	1,573,808.00	0.65
74	600409	三友化工	156,249	1,573,427.43	0.65
75	601012	隆基股份	91,695	1,567,984.50	0.65
76	300255	常山药业	175,800	1,529,460.00	0.64
77	300304	云意电气	172,200	1,527,414.00	0.64
78	002654	万润科技	158,200	1,468,096.00	0.61
79	300075	数字政通	68,900	1,442,766.00	0.60
80	002155	湖南黄金	150,700	1,442,199.00	0.60
81	600261	阳光照明	215,900	1,418,463.00	0.59
82	000625	长安汽车	97,375	1,404,147.50	0.58
83	600098	广州发展	177,100	1,400,861.00	0.58
84	600057	象屿股份	137,047	1,393,767.99	0.58
85	002002	鸿达兴业	178,000	1,393,740.00	0.58
86	601800	中国交建	86,100	1,368,129.00	0.57
87	600510	黑牡丹	177,900	1,362,714.00	0.57
88	000936	华西股份	192,088	1,348,457.76	0.56
89	603566	普莱柯	55,200	1,339,152.00	0.56
90	601567	三星医疗	128,400	1,337,928.00	0.56
91	000055	方大集团	182,500	1,328,600.00	0.55
92	002285	世联行	165,600	1,328,112.00	0.55
93	002078	太阳纸业	180,100	1,323,735.00	0.55
94	002546	新联电子	220,400	1,311,380.00	0.55
95	601390	中国中铁	147,300	1,277,091.00	0.53
96	600862	中航高科	131,600	1,275,204.00	0.53
97	601168	西部矿业	164,000	1,261,160.00	0.52

98	002437	誉衡药业	173,200	1,260,896.00	0.52
99	000796	凯撒旅游	102,000	1,236,240.00	0.51
100	600654	*ST 中安	90,400	1,218,592.00	0.51
101	600073	上海梅林	117,200	1,119,260.00	0.47
102	000839	中信国安	111,700	1,115,883.00	0.46
103	603567	珍宝岛	64,100	1,078,803.00	0.45
104	601127	小康股份	52,500	1,047,375.00	0.44
105	000563	陕国投 A	199,600	1,031,932.00	0.43
106	600169	太原重工	258,200	996,652.00	0.41
107	002460	赣锋锂业	21,000	971,250.00	0.40
108	300267	尔康制药	83,195	953,414.70	0.40
109	600702	沱牌舍得	35,700	949,977.00	0.40
110	300113	顺网科技	34,800	936,120.00	0.39
111	600428	中远海特	142,500	886,350.00	0.37
112	000861	海印股份	240,900	884,103.00	0.37
113	002494	华斯股份	60,400	880,632.00	0.37
114	300324	旋极信息	47,600	868,224.00	0.36
115	000937	冀中能源	141,200	864,144.00	0.36
116	002530	金财互联	29,108	857,521.68	0.36
117	002712	思美传媒	39,000	841,620.00	0.35
118	600754	锦江股份	30,900	837,390.00	0.35
119	300269	联建光电	41,500	831,245.00	0.35
120	000581	威孚高科	31,882	825,743.80	0.34
121	002249	大洋电机	119,500	786,310.00	0.33
122	600031	三一重工	92,300	750,399.00	0.31
123	300316	晶盛机电	56,600	706,934.00	0.29
124	000418	小天鹅 A	15,000	701,850.00	0.29
125	601000	唐山港	130,900	683,298.00	0.28
126	000555	神州信息	40,500	676,350.00	0.28
127	002554	惠博普	109,700	647,230.00	0.27
128	002652	扬子新材	88,500	638,085.00	0.27
129	600021	上海电力	52,400	633,516.00	0.26
130	002563	森马服饰	73,400	622,432.00	0.26
131	600053	九鼎投资	17,600	615,296.00	0.26
132	600435	北方导航	42,700	611,037.00	0.25
133	002807	江阴银行	46,100	577,633.00	0.24
134	000778	新兴铸管	84,600	566,820.00	0.24
135	002221	东华能源	51,900	566,229.00	0.24
136	000425	徐工机械	150,400	564,000.00	0.23

137	000008	神州高铁	73,400	534,352.00	0.22
138	300072	三聚环保	14,300	529,815.00	0.22
139	600755	厦门国贸	57,100	520,752.00	0.22
140	600585	海螺水泥	22,600	513,698.00	0.21
141	600008	首创股份	76,000	500,080.00	0.21
142	600115	东方航空	73,200	497,760.00	0.21
143	002402	和而泰	48,900	482,154.00	0.20
144	002245	澳洋顺昌	47,700	430,254.00	0.18
145	600079	人福医药	20,400	400,248.00	0.17
146	000799	酒鬼酒	20,778	381,899.64	0.16
147	300091	金通灵	26,900	362,343.00	0.15
148	000959	首钢股份	49,200	343,908.00	0.14
149	600312	平高电气	24,400	335,256.00	0.14
150	300252	金信诺	14,900	322,585.00	0.13
151	300327	中颖电子	9,700	307,490.00	0.13
152	300393	中来股份	5,200	286,052.00	0.12
153	002304	洋河股份	2,900	251,749.00	0.10
154	601700	风范股份	40,800	244,392.00	0.10
155	300287	飞利信	25,900	237,762.00	0.10
156	600198	大唐电信	17,800	227,306.00	0.09
157	000591	太阳能	43,780	225,029.20	0.09
158	603198	迎驾贡酒	11,800	224,554.00	0.09
159	000858	五 粮 液	3,800	211,508.00	0.09
160	600981	汇鸿集团	27,400	203,034.00	0.08
161	300170	汉得信息	19,100	196,921.00	0.08
162	600522	中天科技	15,500	186,775.00	0.08
163	601919	中远海控	34,501	184,580.35	0.08
164	603118	共进股份	12,760	173,918.80	0.07
165	600449	宁夏建材	17,600	169,136.00	0.07
166	300094	国联水产	22,900	168,315.00	0.07
167	601878	浙商证券	9,704	165,065.04	0.07
168	601186	中国铁建	12,200	146,766.00	0.06
169	600330	天通股份	16,600	145,748.00	0.06
170	603019	中科曙光	4,800	135,072.00	0.06
171	600282	南钢股份	33,900	125,769.00	0.05
172	000901	航天科技	4,300	116,788.00	0.05
173	601016	节能风电	31,700	116,656.00	0.05
174	002004	华邦健康	13,900	108,837.00	0.05
175	002491	通鼎互联	7,800	104,832.00	0.04

176	601601	中国太保	2,900	98,223.00	0.04
177	002329	皇氏集团	10,200	98,022.00	0.04
178	601628	中国人寿	3,300	89,034.00	0.04
179	300362	天翔环境	5,000	85,250.00	0.04
180	300017	网宿科技	7,000	84,490.00	0.04
181	000983	西山煤电	8,500	74,545.00	0.03
182	300222	科大智能	2,971	67,411.99	0.03
183	600850	华东电脑	3,000	64,110.00	0.03
184	600737	中粮糖业	6,100	57,584.00	0.02
185	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
186	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
187	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
188	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.02
189	600200	江苏吴中	2,700	35,640.00	0.01
190	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.01
191	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
192	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
193	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
194	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
195	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
196	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
197	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
198	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
199	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
200	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
201	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
202	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
203	000596	古井贡酒	200	10,190.00	0.00
204	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
205	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
206	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
207	600809	山西汾酒	200	6,938.00	0.00
208	601727	上海电气	900	6,813.00	0.00
209	600392	盛和资源	500	6,595.00	0.00
210	002356	赫美集团	200	5,082.00	0.00
211	002570	贝因美	200	2,720.00	0.00
212	601238	广汽集团	100	2,606.00	0.00
213	600966	博汇纸业	500	2,595.00	0.00
214	600475	华光股份	100	1,993.00	0.00

215	002080	中材科技	100	1,982.00	0.00
216	000881	中广核技	100	1,905.00	0.00
217	600110	诺德股份	100	1,409.00	0.00
218	601801	皖新传媒	100	1,382.00	0.00
219	000830	鲁西化工	200	1,380.00	0.00
220	002020	京新药业	100	1,185.00	0.00
221	000898	鞍钢股份	200	1,132.00	0.00
222	002340	格林美	160	968.00	0.00
223	002157	正邦科技	200	910.00	0.00
224	601339	百隆东方	147	874.65	0.00
225	601139	深圳燃气	100	865.00	0.00
226	000564	供销大集	100	651.00	0.00
227	000735	罗牛山	100	625.00	0.00
228	600582	天地科技	100	459.00	0.00
229	600039	四川路桥	100	416.00	0.00
230	300185	通裕重工	100	261.00	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	600026	中远海能	4,531,730.00	2.23
2	600409	三友化工	4,365,650.05	2.14
3	000725	京东方A	3,920,809.00	1.93
4	600711	盛屯矿业	3,871,676.76	1.90
5	000813	德展健康	3,514,311.46	1.73
6	600510	黑牡丹	3,463,264.99	1.70
7	601601	中国太保	3,272,153.99	1.61
8	600487	亨通光电	3,147,923.00	1.55
9	600325	华发股份	2,831,851.40	1.39
10	002342	巨力索具	2,828,688.00	1.39
11	601636	旗滨集团	2,817,524.00	1.38
12	300251	光线传媒	2,713,726.52	1.33
13	002573	清新环境	2,700,802.34	1.33
14	000997	新大陆	2,670,506.00	1.31

15	000718	苏宁环球	2,658,029.09	1.31
16	000078	海王生物	2,650,583.00	1.30
17	002004	华邦健康	2,643,053.46	1.30
18	600848	上海临港	2,615,600.32	1.28
19	002477	雏鹰农牧	2,613,145.00	1.28
20	600266	北京城建	2,562,909.00	1.26

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	002709	天赐材料	4,553,199.58	2.24
2	600522	中天科技	4,483,150.32	2.20
3	600867	通化东宝	3,746,079.85	1.84
4	002460	赣锋锂业	3,616,801.60	1.78
5	000709	河钢股份	3,350,053.33	1.65
6	601601	中国太保	3,200,934.22	1.57
7	600409	三友化工	3,187,613.00	1.57
8	600056	中国医药	3,094,937.05	1.52
9	002477	雏鹰农牧	2,906,597.00	1.43
10	002635	安洁科技	2,903,323.58	1.43
11	600635	大众公用	2,815,253.89	1.38
12	002342	巨力索具	2,755,191.00	1.35
13	002491	通鼎互联	2,751,573.52	1.35
14	000028	国药一致	2,722,589.16	1.34
15	002466	天齐锂业	2,702,226.00	1.33
16	000973	佛塑科技	2,650,166.00	1.30
17	600026	中远海能	2,620,607.00	1.29
18	600729	重庆百货	2,579,485.40	1.27
19	600848	上海临港	2,577,802.45	1.27
20	600971	恒源煤电	2,557,480.71	1.26

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	442,883,613.93
卖出股票收入（成交）总额	416,206,783.13

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

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，将利用股指期货剥离多头股票资产部分的系统性风险或建立适当的股指期货多头头寸对冲市场向上风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。

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

在报告期内，本基金未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

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

本报告期本基金没有投资国债期货。

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	47,118.88
2	应收证券清算款	701,635.32
3	应收股利	-
4	应收利息	2,532.15
5	应收申购款	1,478.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	752,765.11

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

本基金本报告期末前十名股票中未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

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
1,091	214,906.06	181,475,133.18	77.40%	52,987,376.82	22.60%

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	1,454,966.33	0.6206%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年8月30日）基金份额总额	556,805,116.77
本报告期期初基金份额总额	210,288,832.97
本报告期基金总申购份额	76,405,537.68
减：本报告期基金总赎回份额	52,231,860.65
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	234,462,510.00

§ 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

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

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

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	
天风证券	1	325,715,753.30	38.09%	303,341.91	38.09%	-
华林证券	2	155,485,630.91	18.18%	144,803.31	18.18%	-
光大证券	1	97,663,206.03	11.42%	90,953.12	11.42%	-
东方证券	3	88,265,796.74	10.32%	82,201.36	10.32%	-
财富证券	2	85,247,921.32	9.97%	79,391.91	9.97%	-
国金证券	1	47,118,296.78	5.51%	43,881.36	5.51%	-
银河证券	2	42,000,063.28	4.91%	39,114.94	4.91%	-
东方财富	1	13,654,363.48	1.60%	12,716.18	1.60%	-
国泰君安	1	77,496.82	0.01%	72.20	0.01%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

申万宏源	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-

(一) 本基金本报告期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

本基金本报告期未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

§ 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	99,999,000.00	0.00	0.00	99,999,000.00	42.65%
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、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、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