

**泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金
证券投资基金（原泰达宏利中证财富大
盘指数证券投资基金基金转型）
2018 年年度报告**

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 27 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。本年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金由原泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金转型而来。根据基金份额持有人大会决议，泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金于 2018 年 3 月 16 日转型成泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金。原泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金本报告期自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日止，泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金本报告期自 2018 年 3 月 16 日至 2018 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况（转型后）.....	6
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	6
2.2 基金产品说明（转型前）.....	7
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、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）.....	9
3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）.....	9
3.2 基金净值表现（转型后）.....	11
3.2 基金净值表现（转型前）.....	16
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型前）.....	20
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）.....	21
§4 管理人报告	22
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	22
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	24
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	24
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.....	25
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	26
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	26
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	27
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	27
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	27
§5 托管人报告	28
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	28
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.....	28
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	28
§6 审计报告（转型后）	29
6.1 审计报告基本信息.....	29
6.2 审计报告的基本内容.....	29
§6 审计报告（转型前）	32
6.1 审计报告基本信息.....	32
6.2 审计报告的基本内容.....	32
§7 年度财务报表（转型后）	35
7.1 资产负债表（转型后）.....	35
7.2 利润表.....	36
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	37
7.4 报表附注.....	38

§7 年度财务报表（转型前）	60
7.1 资产负债表（转型前）	60
7.2 利润表	61
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	62
7.4 报表附注	63
§8 投资组合报告（转型后）	88
8.1 期末基金资产组合情况	88
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	89
8.2 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	90
8.3 报告期内股票投资组合的重大变动	94
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	96
8.5 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	96
8.6 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	96
8.7 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	96
8.8 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	96
8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	96
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	97
8.11 投资组合报告附注	97
§8 投资组合报告（转型前）	99
8.1 期末基金资产组合情况	99
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	99
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	101
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	104
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	106
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	106
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	106
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	106
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	106
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	106
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	106
8.12 投资组合报告附注	106
§9 基金份额持有人信息（转型后）	108
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	108
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	108
9.3 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	108
§9 基金份额持有人信息（转型前）	109
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	109
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	109
9.3 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	110
§10 开放式基金份额变动(转型后)	110
§10 开放式基金份额变动(转型前)	111
§11 重大事件揭示	111
11.1 基金份额持有人大会决议	111
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	111
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	112

11.4 基金投资策略的改变.....	112
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	112
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	112
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）.....	112
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）.....	114
11.9 其他重大事件（转型后）.....	115
11.9 其他重大事件（转型前）.....	116
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	117
12.1 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（转型后）.....	117
12.1 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（转型前）.....	117
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	117
§13 备查文件目录.....	118
13.1 备查文件目录.....	118
13.2 存放地点.....	118
13.3 查阅方式.....	118

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	泰达宏利沪深 300	
基金主代码	162213	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 3 月 16 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	150,502,536.11 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰达宏利沪深 300A	泰达宏利沪深 300C
下属分级基金的交易代码	162213	003548
报告期末下属分级基金的份额总额	149,330,311.10 份	1,172,225.01 份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金	
基金简称	泰达宏利财富大盘指数	
基金主代码	162213	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 4 月 23 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	143,516,080.26 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰达宏利财富大盘指数 A	泰达宏利财富大盘指数 C
下属分级基金的交易代码	162213	003548
报告期末下属分级基金的份额总额	137,315,972.25 份	6,200,108.01 份

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对沪深 300 指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，力争获取超越标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，在控制与比较基准偏离风险的前提下，综合利用多种量化投资模型和指数增强技术，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，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。
--	---------------------

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	采用指数化投资策略，紧密跟踪中证财富大盘指数，力争获取与标的指数相似的投资收益，并力争将基金的日跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金采用指数完全复制方法，原则上按照标的指数成份股及其权重构建基金的投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整，以达到跟踪和复制指数的目的。但如遇特殊情况（如市场流动性不足、成份股被限制投资等）致使基金无法购得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理的方法进行适当替代，以使跟踪误差控制在限定范围内。
业绩比较基准	95%×中证财富大盘指数收益率+5%×同业存款利率。
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。

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	袁静	王永民
	联系电话	010-66577513	010-66594896
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-698-8888	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	陈四清

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 3 月 16 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	泰达宏利沪深 300A	泰达宏利沪深 300C
本期已实现收益	-32,465,430.76	-472,842.58
本期利润	-49,819,815.19	-841,846.09
加权平均基金份额本期利润	-0.3529	-0.4948
本期加权平均净值利润率	-26.93%	-36.97%
本期基金份额净值增长率	-23.51%	-23.66%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 12 月 31 日	
期末可供分配利润	22,333,783.83	179,502.83
期末可供分配基金份额利润	0.1496	0.1531
期末基金资产净值	171,664,094.93	1,351,727.84
期末基金份额净值	1.1496	1.1531
3.1.3 累计期末指标	2018 年 12 月 31 日	
基金份额累计净值增长率	-23.51%	-23.66%

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

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

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

3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日		2017 年		2016 年	
	泰达宏利财富大盘指数 A	泰达宏利财富大盘指数 C	泰达宏利财富大盘指数 A	泰达宏利财富大盘指数 C	泰达宏利财富大盘指数 A	泰达宏利财富大盘指

						数 C
本期已实现收益	511,609.99	-11,865.31	36,525,819.48	180,602.20	1,708,705.43	-
本期利润	-6,531,176.91	-527,251.10	43,120,905.82	114,297.16	-2,350,814.97	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0613	-0.1424	0.3776	0.2274	-0.0290	-
本期加权平均净值利润率	-3.98%	-9.27%	27.98%	16.18%	-2.24%	-
本期基金份额净值增长率	1.26%	1.28%	27.33%	24.11%	-3.51%	-
3.1.2 期末数据和指标	2018年3月15日		2017年末		2016年末	
期末可供分配利润	69,073,703.62	3,165,118.96	32,984,346.16	368,781.09	12,551,804.44	-
期末可供分配基金份额利润	0.5030	0.5105	0.4843	0.4914	0.1657	-
期末基金资产净值	206,389,675.87	9,365,226.97	101,091,466.95	1,119,185.43	88,315,640.89	-

期末基金 份额 净值	1.5030	1.5105	1.4843	1.4914	1.1657	-
3.1.3 累计 期末 指标	2018年3月15日		2017年末		2016年末	
基金 份额 累计 净值 增长 率	114.32%	25.70%	111.65%	24.11%	66.22%	-

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

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

3. 期末可供分配利润等于期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；

4. 根据泰达宏利基金管理有限公司 2017 年 2 月 7 日发布的《关于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、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金与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修改基金合同及托管协议的公告》，泰达宏利基金管理有限公司决定自 2017 年 2 月 9 日起，对旗下泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金增加收取销售服务费的 C 类份额并相应修订基金合同和托管协议。

3.2 基金净值表现（转型后）

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

泰达宏利沪深 300A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-13.19%	1.58%	-11.83%	1.56%	-1.36%	0.02%
过去六个月	-13.34%	1.43%	-13.51%	1.42%	0.17%	0.01%
自基金合同 生效起至今	-23.51%	1.32%	-25.27%	1.31%	1.76%	0.01%

泰达宏利沪深 300C

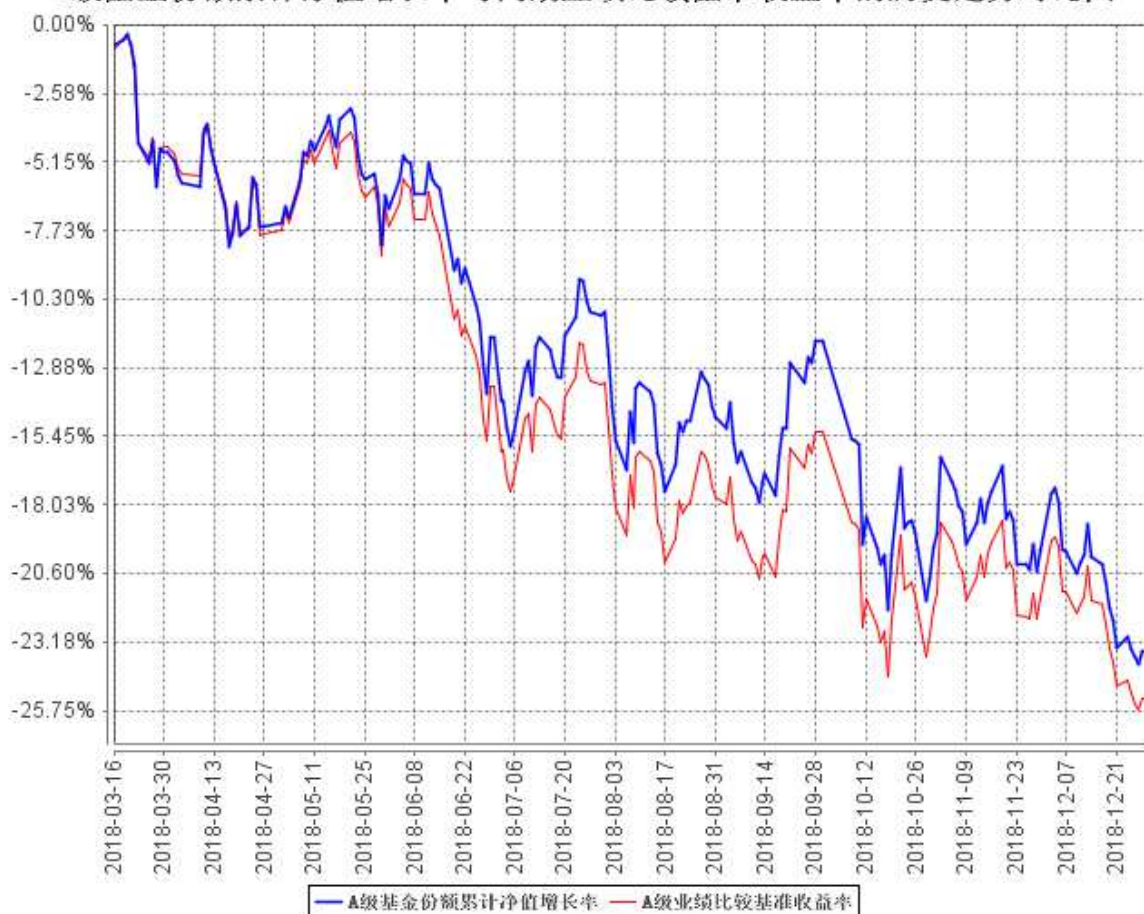
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-13.25%	1.58%	-11.83%	1.56%	-1.42%	0.02%
过去六个月	-13.46%	1.43%	-13.51%	1.42%	0.05%	0.01%
自基金合同 生效起至今	-23.66%	1.32%	-25.27%	1.31%	1.61%	0.01%

注：本基金业绩比较基准：95%×中证财富大盘指数收益率+5%×同业存款利率。

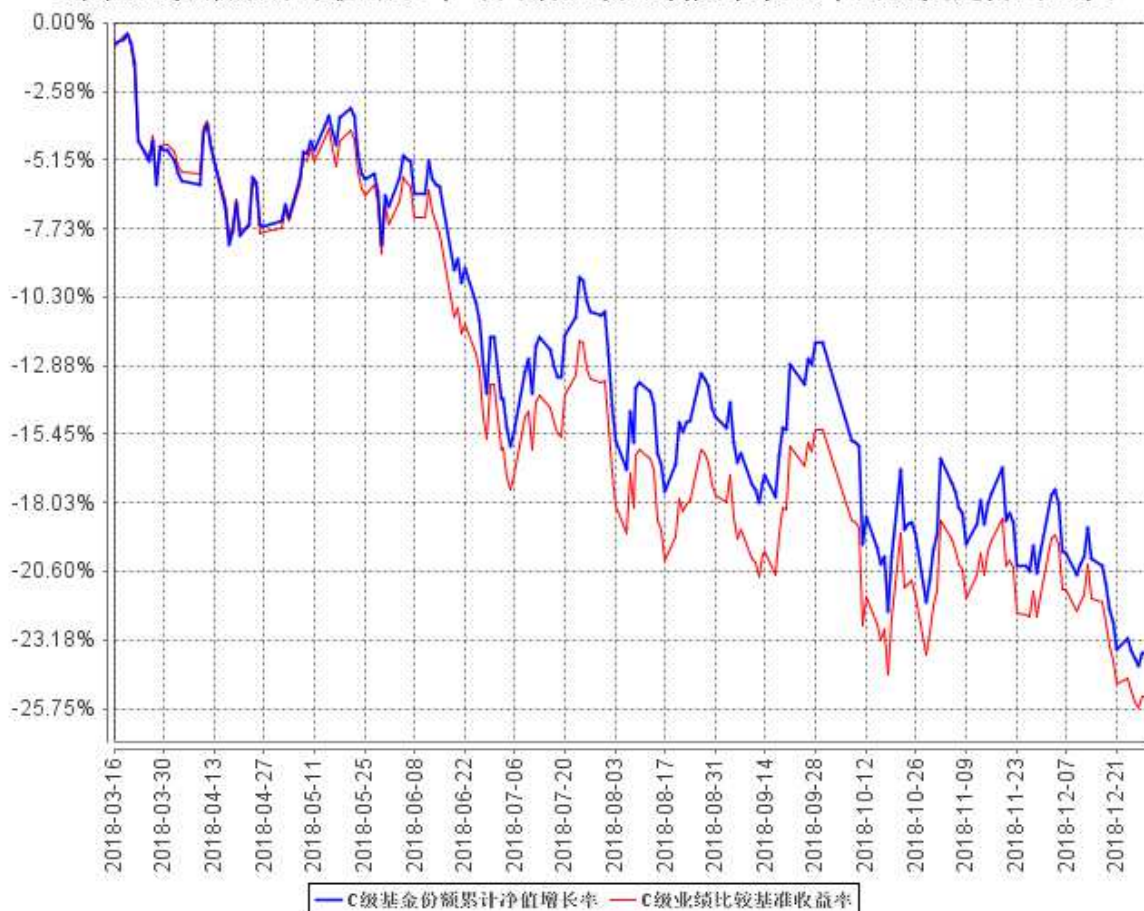
本基金股票资产的跟踪标的指数为中证财富大盘指数。中证财富大盘指数是由中证指数有限公司编制并开发的中国 A 股市场指数。该指数按照上市公司创造财富能力的大小进行选样，挑选最具创造财富能力的 300 家 A 股上市公司作为样本；此外该指数在加权方式上亦有所创新，不同于一般的市值加权指数，该指数样本个股的权重配置将与其创造财富能力的大小相适应，从而打破市值指数中价格与权重过于紧密的联系，预防个股权重由于价格的非理性波动而大起大落，提高了个股权重配置的稳定性。指数的表现综合反映了中国经济增长过程中核心企业真实的财富增长情况。

3.2.2 自基金转型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

A级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



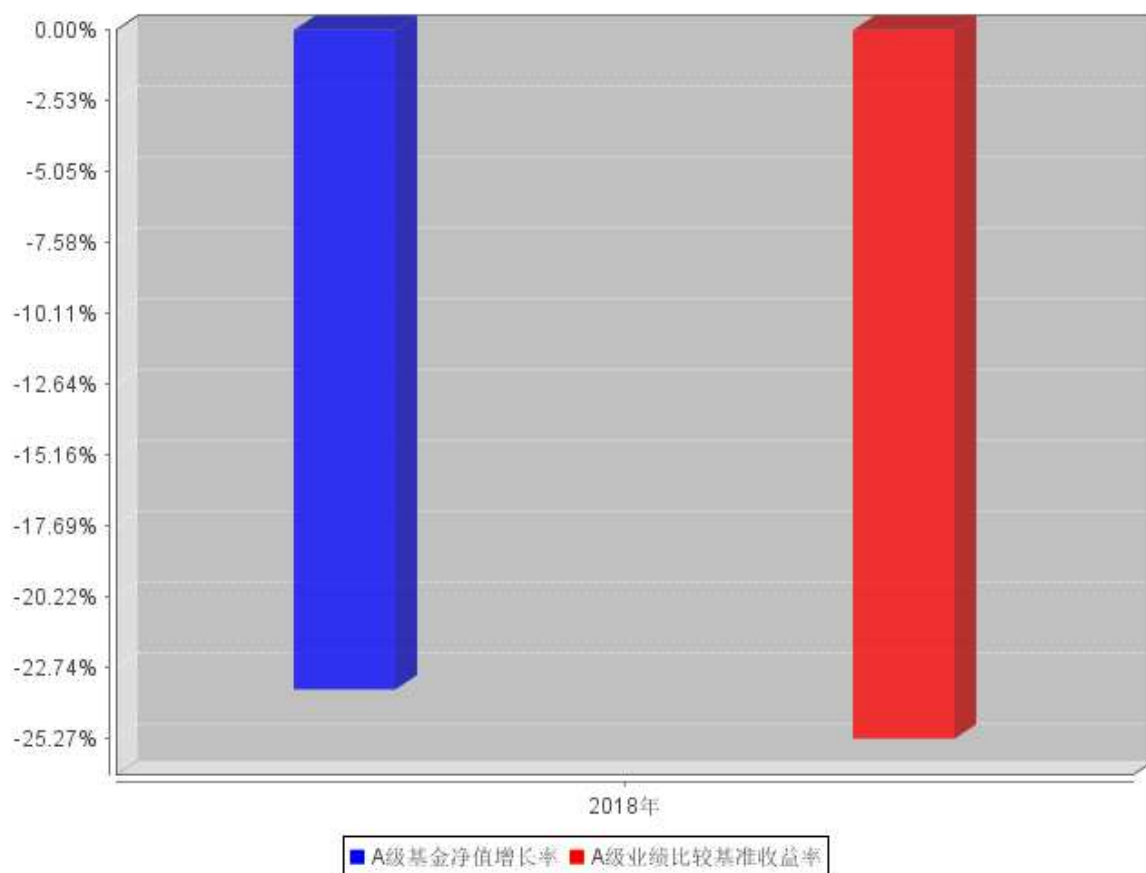
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



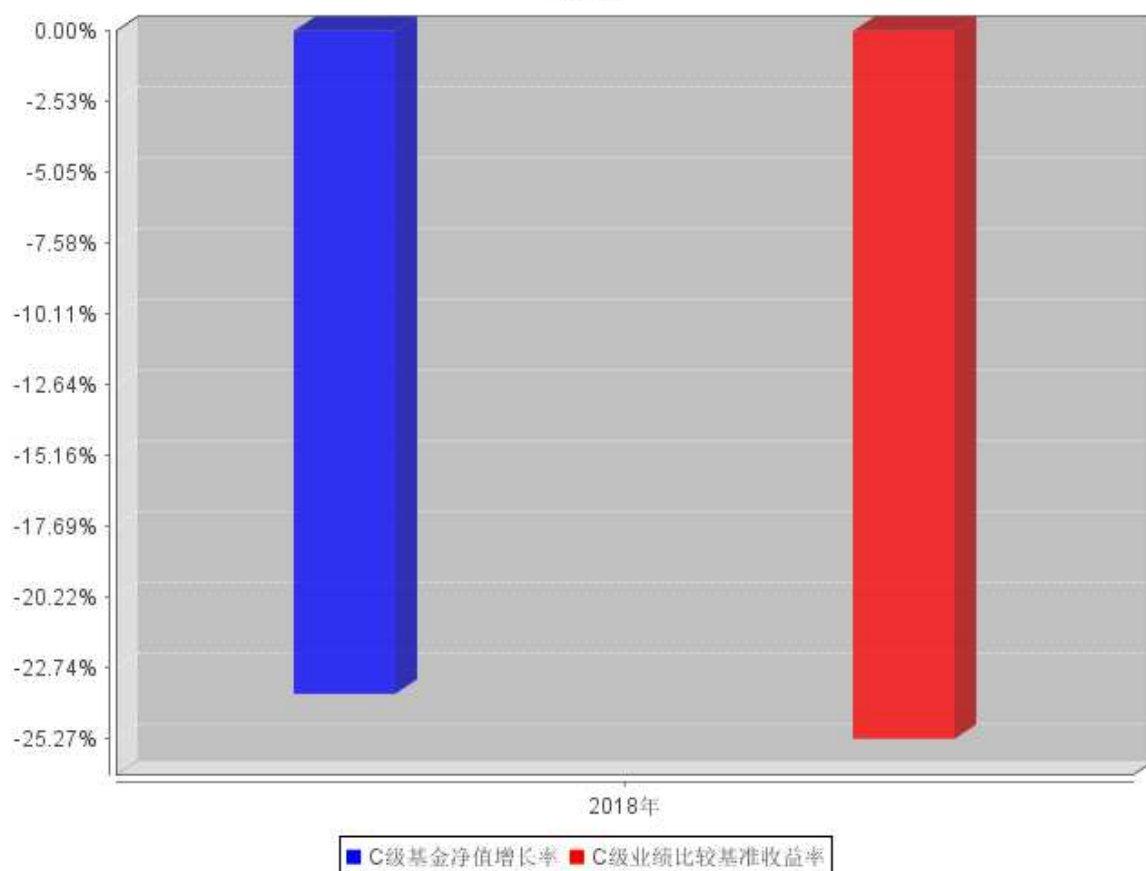
注：本基金于 2018 年 3 月 16 日转型，本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。截止报告期末，本基金转型尚不足一年。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金转型日期为 2018 年 3 月 16 日，2018 年度份额净值增长率的计算期间为 2018 年 3 月 16 日至 2018 年 12 月 31 日。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

泰达宏利财富大盘指数 A

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
2018. 1. 1-2018. 3. 15	1. 26%	1. 12%	1. 71%	1. 16%	-0. 45%	-0. 04%
2017. 7. 1-2018. 3. 15	12. 43%	0. 78%	9. 93%	0. 80%	2. 50%	-0. 02%
2015. 7. 1-2018. 3. 15	13. 46%	1. 37%	2. 68%	1. 30%	10. 78%	0. 07%
自基金合同生效起至 2018. 3. 15	114. 32%	1. 37%	56. 23%	1. 37%	58. 09%	0. 00%

泰达宏利财富大盘指数 C

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	③ ③	④ ④

2018. 1. 1-2018. 3. 15	1. 28%	1. 12%	1. 71%	1. 16%	-0. 43%	-0. 04%
2017. 7. 1-2018. 3. 15	12. 75%	0. 78%	9. 93%	0. 80%	2. 82%	-0. 02%
自基金合同生效起至 2018. 3. 15	25. 70%	0. 70%	19. 46%	0. 72%	6. 24%	-0. 02%

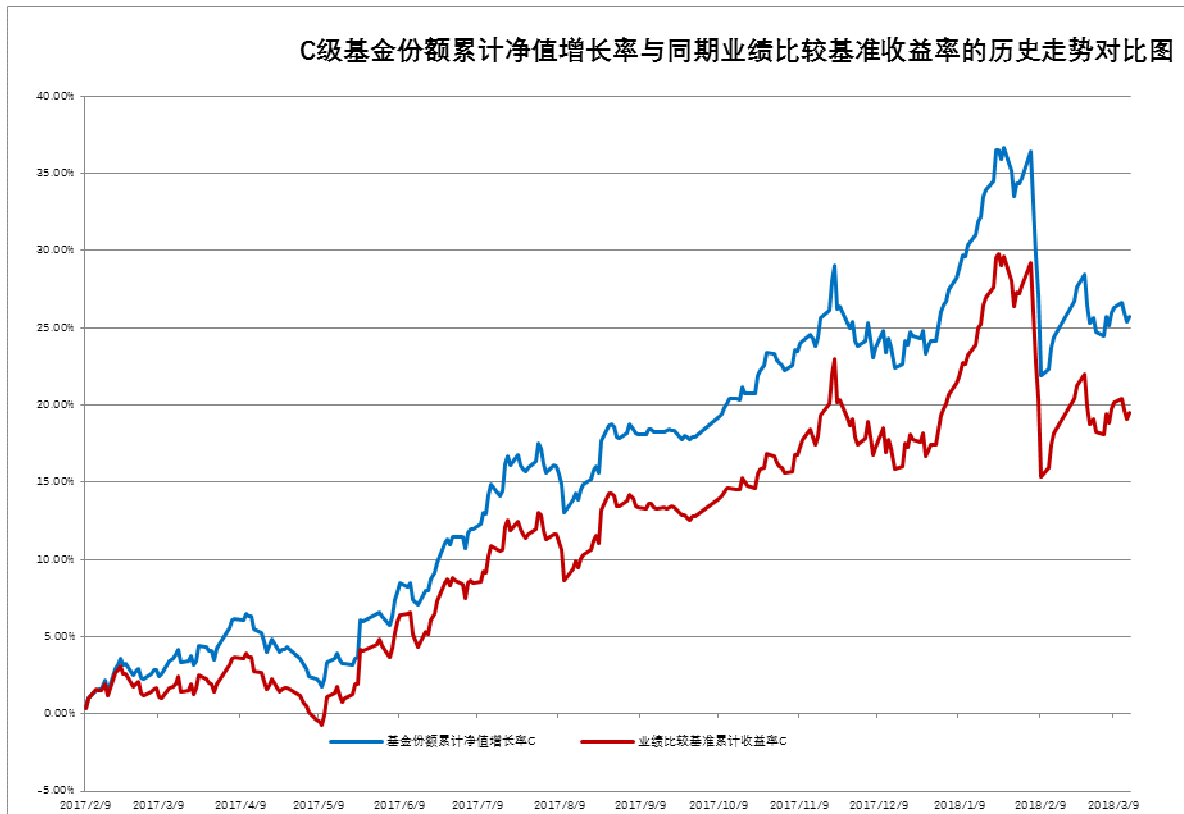
注：本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{中证财富大盘指数收益率} + 5\% \times \text{同业存款利率}$ 。

本基金股票资产的跟踪标的指数为中证财富大盘指数。中证财富大盘指数是由中证指数有限公司编制并开发的中国 A 股市场指数。该指数按照上市公司创造财富能力的大小进行选择，挑选最具创造财富能力的 300 家 A 股上市公司作为样本；此外该指数在加权方式上亦有所创新，不同于一般的市值加权指数，该指数样本个股的权重配置将与其创造财富能力的大小相适应，从而打破市值指数中价格与权重过于紧密的联系，预防个股权重由于价格的非理性波动而大起大落，提高了个股权重配置的稳定性。指数的表现综合反映了中国经济增长过程中核心企业真实的财富增长情况。

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

A 级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

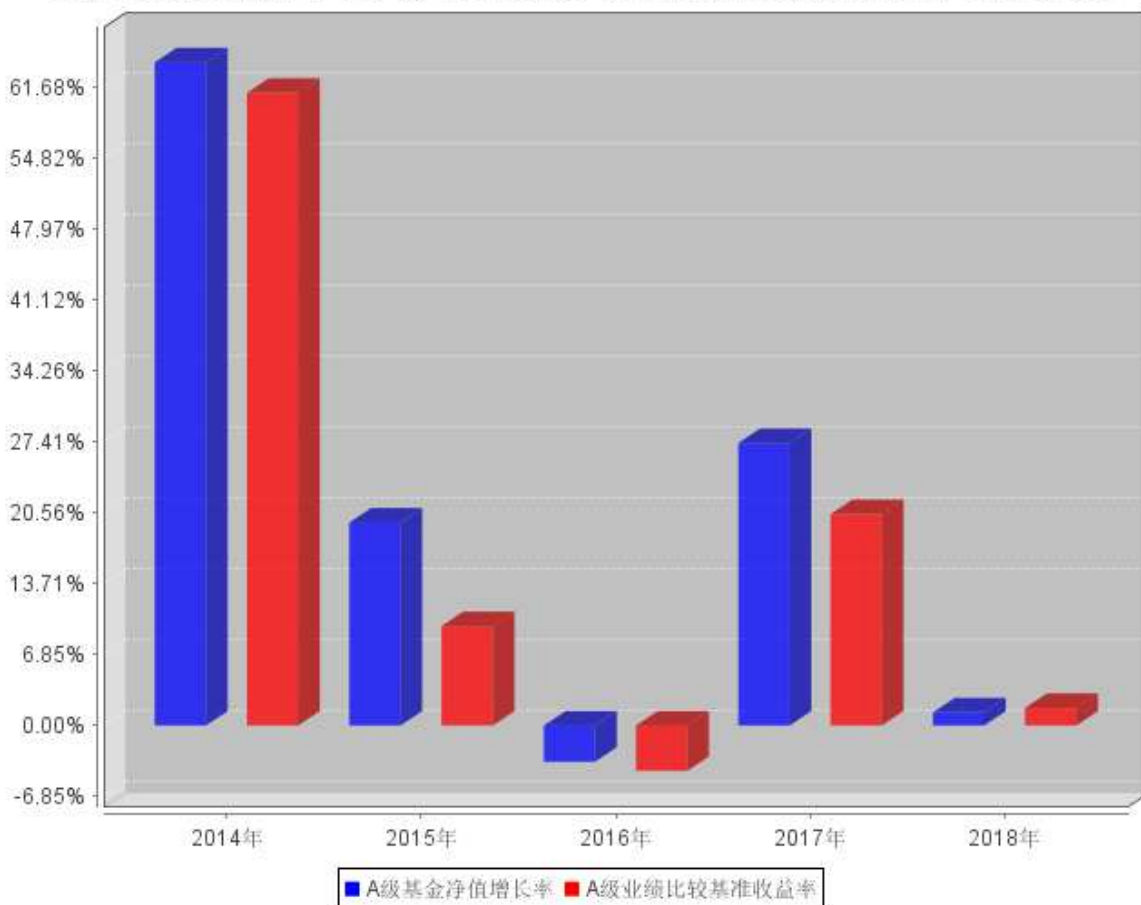




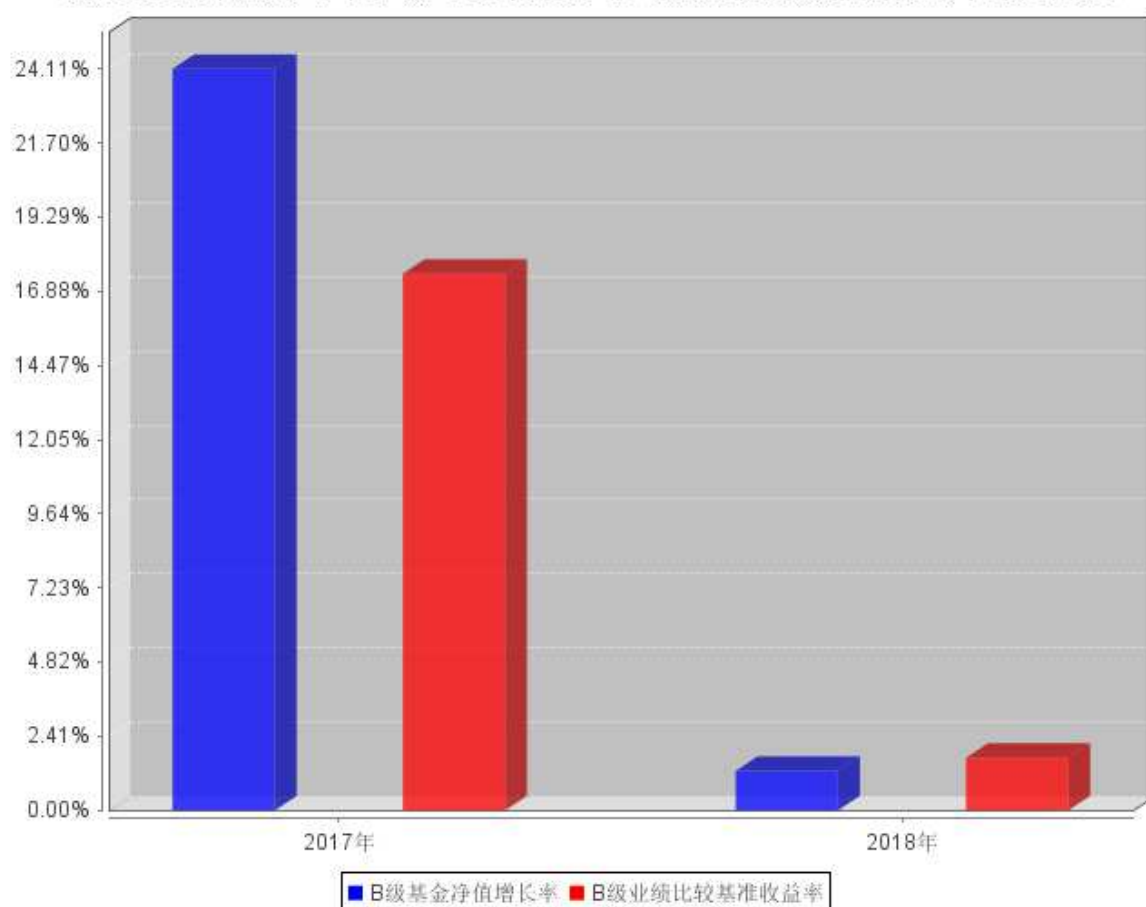
注：本基金 A 类份额成立于 2010 年 4 月 23 日，C 类份额成立于 2017 年 2 月 9 日。本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



B级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金 C 类份额成立于 2017 年 2 月 9 日，2017 年度 C 类份额净值增长率的计算期间为 2017 年 2 月 9 日至 2017 年 12 月 31 日。本基金转型之日为 2018 年 3 月 16 日，2018 年份额净值增长率的计算期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

单位：人民币元

泰达宏利财富大盘指数 A					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	-	-	-	-	
2017	-	-	-	-	
2016	4.2000	343,532,425.77	6,210,635.21	349,743,060.98	
合计	4.2000	343,532,425.77	6,210,635.21	349,743,060.98	

单位：人民币元

泰达宏利财富大盘指数 C					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	-	-	-	-	
2017	-	-	-	-	
2016	-	-	-	-	

合计	-	-	-	-	
----	---	---	---	---	--

3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金自 2018 年 3 月 16 日（基金转型后首个运作日）至 2018 年 12 月 31 日未进行利润分配。目前无其他收益分配安排。

§ 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：天津市泰达国际控股（集团）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、泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金、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、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利宏达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、泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金、泰达宏利全能优选混合型基金中基金 (FOF)、泰达宏利交利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利泽利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利泰和平衡养老目标三年持有期混合

型基金中基金（FOF）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（转型后）

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	2018年3月16日	-	8	英国南威尔士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8年证券基金从业经验，8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	2018年3月16日	2018年6月26日	3	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、基金经理助理等职；具备3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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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	2018年3月15日	8	英国南威尔士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 8 年证券基金从业经验, 8 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	2018 年 3 月 15 日	3	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 3 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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人建立了公平交易制度和内部控制流程, 严格执行相关制度规定。在投资管理活动中, 公平对待不同投资组合, 确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会; 在交易环节实行集中交易制度, 交易部运用交易系统中的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令, 确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续; 对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易, 交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配, 确保各投资组合享有公平的投资机会。

基金管理人的风险管理部定期对基金管理人管理的不同投资组合的收益率差异进行分析, 对连续四个季度期间内、不同时间窗下 (日内、3 日内、5 日内) 基金管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析, 并经公司管理层审核签署后存档备查。基金管理人的监察稽核部定期对公平交易制度的执行和控制工作进行稽核。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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，未发生任何利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控，风险管理部对可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，定期对各投资组合的交易行为进行整体分析评估，定期向风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。如发现疑似异常交易情况，相关投资组合经理对该交易情况进行合理性解释。监察稽核部定期对异常交易制度的执行和控制工作进行稽核。

本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该证券当日成交量的 5%，未发现异常。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构处罚的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年，A 股承受了内部去杠杆和外部贸易冲突的双重压力，企业盈利增速下降、流动性收紧、风险溢价抬升，导致市场风险偏好明显回落，是驱动 A 股估值不断降低的主要因素。影响市场风险偏好的变量中，内部矛盾从流动性的主动收紧逐渐转移到经济与企业盈利的下行，出现债务违约、股权质押、商誉减值等风险；而外部变量中全球经济复苏乏力、美联储持续加息、中美贸易摩擦反复不定、美股的剧烈震荡都对 A 股信心的恢复形成持续的压制。2018 年 A 股市场整体下跌，代表大盘蓝筹的上证 50、沪深 300 等指数下跌幅度稍小，而中小板、创业板、中证 1000 等中小股票回调幅度较大。市场风格上盈利质量较好、估值较低的银行、消费等板块占优，而估值较高，盈利能力欠缺或受贸易摩擦影响的板块如 TMT 等则处于较为不利的位置。市场延续蓝筹、龙头相对中小股票更强的风格，是在风险偏好降低，盈利与估值双双回落，部分企业出现流动性危机、业绩爆雷的环境下市场参与者追求确定性的选择。此外，市场增量资金的结构化变化，即个人投资者参与积极性降低，国外资金逐步加大 A 股配置也强化了这一趋势。

本基金在操作中恪守基金合同，采用指数增强策略，严格控制跟踪误差及其他风险属性。使用量化选股手段，挑选盈利质量高、盈利能力强、估值合理的大盘蓝筹股票，持仓结构分散以控制个股风险，仓位保持合理稳定。本报告期内，本基金增加了食品饮料、医药、电子元器件行业的配置，减少了银行、房地产、汽车行业的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

(转型后)截至本报告期末泰达宏利沪深 300A 基金份额净值为 1.1496 元;自转型以来(2018 年 3 月 16 日至 2018 年 12 月 31 日)基金份额净值增长率为-23.51%;截至本报告期末泰达宏利沪深 300C 基金份额净值为 1.1531 元;自转型以来(2018 年 3 月 16 日至 2018 年 12 月 31 日)基金份额净值增长率为-23.66%;业绩比较基准收益率为-25.27%。

(转型前)截至 2018 年 3 月 15 日泰达宏利中证财富大盘 A 基金份额净值为 1.5030 元;本报告期(2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日)基金份额净值增长率为 1.26%;截至 2018 年 3 月 15 日泰达宏利中证财富大盘 C 基金份额净值为 1.5105 元;本报告期(2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日)基金份额净值增长率为 1.28%;业绩比较基准收益率为 1.71%。

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 2019 年,影响 A 股的政策与外部环境相对 2018 年或有更积极的变化。流动性与信用的边际改善以及向实体经济的传导路径在进一步疏通,民营中小企业融资难问题在逐步得到缓解,更加积极的减税降费等财政政策有望得以实施,金融市场改革正在稳步推进。目前 A 股估值处于历史较低水平,在世界范围内权益市场的估值水平比较中也处于更有吸引力的位置。外资的长期资金在不断加大对 A 股的配置权重,国内社保与养老资金也在逐步布局权益市场。从中长期来看,我们对 A 股依然保持乐观的态度,市场或在年内企稳回升,交易情绪与估值有望得到修复。在市场风格上,我们继续看好受增量长期配置资金偏好的高盈利、低估值的蓝筹股,同时也看好具有真实的业绩成长性,符合政策导向与经济转型趋势的高端制造、新兴产业、服务消费等板块。目前市场的主要风险来源于经济与企业盈利增速的寻底节奏对市场情绪的压制,另外也需要关注中美贸易谈判的结果、美国经济增速放缓的可能性以及美股持续处于估值高位等不确定性因素带来的冲击。

基于基金合同与投资观点,本基金在选股策略上倾向于选择盈利质量高、盈利能力长期稳定、公司治理规范、估值合理的蓝筹股。在持仓上选择不过分暴露个股相对权重,分散投资以平衡组合风险。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会主任由主管基金运营的副总经理担任，成员包括但不限于督察长、主管投研的副总经理或投资总监、基金投资部、研究部、金融工程部、固定收益部、合规风控部门、基金运营部的主要负责人；委员会秘书由基金运营部负责人担任。所有人员均具有丰富的专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力。

基金经理参与估值委员会对相关停牌品种估值的讨论，发表相关意见和建议，但涉及停牌品种的基金经理不参与最终的投票表决。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金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利润分配，目前无其他收益分配安排。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金（转型前为泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金，以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告（转型后）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第 23408 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“泰达宏利沪深 300 指数基金”)的财务报表, 包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表, 2018 年 3 月 16 日(基金转型后首个运作日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制, 公允反映了泰达宏利沪深 300 指数基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 3 月 16 日(基金转型后首个运作日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于泰达宏利沪深 300 指数基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>泰达宏利沪深 300 指数基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错</p>

	<p>报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估泰达宏利沪深 300 指数基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算泰达宏利沪深 300 指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督泰达宏利沪深 300 指数基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对泰达宏利沪深 300 指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论</p>

	<p>基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致泰达宏利沪深 300 指数基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰 庞伊君
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2019 年 3 月 26 日

§ 6 审计报告（转型前）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第 23383 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金(以下简称“泰达宏利财富大盘指数基金”)的财务报表,包括 2018 年 3 月 15 日(基金转型前最后运作日)的资产负债表,2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日(基金转型前最后运作日)止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了泰达宏利财富大盘指数基金 2018 年 3 月 15 日(基金转型前最后运作日)的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日(基金转型前最后运作日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于泰达宏利财富大盘指数基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>泰达宏利财富大盘指数基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估泰达宏利财富大盘指数基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算泰达宏利财富大盘指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督泰达宏利财富大盘指数基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对泰达宏利财富大盘指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能</p>

	<p>导致泰达宏利财富大盘指数基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露), 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰 庞伊君
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2019 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	9,276,488.03
结算备付金		363,686.97
存出保证金		19,284.49
交易性金融资产	7.4.7.2	163,747,887.10
其中：股票投资		163,747,887.10
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	2,197.33
应收股利		-
应收申购款		120,371.92
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		173,529,915.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		17,457.05
应付管理人报酬		98,324.33
应付托管费		18,152.22
应付销售服务费		347.35
应付交易费用	7.4.7.7	194,757.30
应交税费		-
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	185,054.82
负债合计		514,093.07
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	150,502,536.11
未分配利润	7.4.7.10	22,513,286.66
所有者权益合计		173,015,822.77
负债和所有者权益总计		173,529,915.84

注：1. 报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额 150,502,536.11 份，其中下属 A 类基金份额 149,330,311.10 份，C 类基金份额 1,172,225.01 份。下属 A 类基金份额净值 1.1496 元，C 类基金份额净值 1.1531 元。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 3 月 16 日(基金转型后首个运作日)至 2018 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2018 年 3 月 16 日(基金转型后首个运作日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2018 年 3 月 16 日(基金转型后首个运作日)至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		-47,829,747.33
1. 利息收入		66,442.95
其中：存款利息收入	7.4.7.11	66,442.95
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）		-30,209,543.19
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-33,701,037.19
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	3,491,494.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-17,723,387.94
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	36,740.85
减：二、费用		2,831,913.95
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	971,172.53
2. 托管费	7.4.10.2.2	179,293.41
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	5,383.98
4. 交易费用	7.4.7.19	1,441,484.15
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.20	234,579.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-50,661,661.28
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-50,661,661.28

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2018 年 3 月 16 日(基金转型后首个运作日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 16 日(基金转型后首个运作日)至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	143,516,080.26	72,238,822.58	215,754,902.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-50,661,661.28	-50,661,661.28
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)	6,986,455.85	936,125.36	7,922,581.21
其中：1. 基金申购款	34,821,239.64	10,636,440.17	45,457,679.81
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-27,834,783.79	-9,700,314.81	-37,535,098.60
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)	150,502,536.11	22,513,286.66	173,015,822.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)由泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金(以下简称“泰达宏利财富大盘指数基金”)转型而来。根据基金管理人泰达宏利基金管理有限公司于 2018 年 3 月 7 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利中证财富大盘指数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》，原泰达宏利中证财富大盘指数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决议自表决通过之日起生效，基金管理人根据基金份额持有人大会的授权，定于 2018 年 3 月 16 日正式实施基金转型。《泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》自 2018 年 3 月 16 日起生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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《泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和《泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利沪深 300 指数增强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股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债券、可交换债券、可转债及分离交易可转债及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、资产支持证券、股指期货、货币市场工具、权证、同业存单及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票组合的比例不低于基金资产的 80%，投资组合中投资于沪深 300 指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。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，基金保留的现金或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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资股指期

货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的相关规定。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+同业存款利率×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利沪深 300 指数增强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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 3 月 16 日(基金转型后首个运作日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 3 月 16 日(基金转型后首个运作日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2018 年 3 月 16 日(基金转型后首个运作日)至 2018 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 于2017年12月5日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自2017年12月5日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行

股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、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》、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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017

年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	9,276,488.03
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	9,276,488.03

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	180,933,857.42	163,747,887.10	-17,185,970.32
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		180,933,857.42	163,747,887.10	-17,185,970.32

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未进行买断式逆回购交易。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
应收活期存款利息	2,024.82
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	163.70
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.11
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	8.70
合计	2,197.33

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	194,757.30

银行间市场应付交易费用	-
合计	194,757.30

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	54.82
预提费用	135,000.00
指数使用费	50,000.00
合计	185,054.82

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰达宏利沪深 300A		
项目	本期 2018 年 3 月 16 日(基金转型后首个运作日)至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金转型后首个运作日	137,315,972.25	137,315,972.25
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	32,935,463.10	32,935,463.10
本期赎回(以“-”号填列)	-20,921,124.25	-20,921,124.25
本期末	149,330,311.10	149,330,311.10

金额单位：人民币元

泰达宏利沪深 300C		
项目	本期 2018 年 3 月 16 日(基金转型后首个运作日)至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金转型后首个运作日	6,200,108.01	6,200,108.01
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	1,885,776.54	1,885,776.54

本期赎回(以“-”号填列)	-6,913,659.54	-6,913,659.54
本期末	1,172,225.01	1,172,225.01

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

泰达宏利沪深 300A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金转型后首个运作日	94,894,189.58	-25,820,485.96	69,073,703.62
本期利润	-32,465,430.76	-17,354,384.43	-49,819,815.19
本期基金份额交易产生的变动数	6,460,208.60	-3,380,313.20	3,079,895.40
其中：基金申购款	18,881,547.71	-8,805,502.86	10,076,044.85
基金赎回款	-12,421,339.11	5,425,189.66	-6,996,149.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	68,888,967.42	-46,555,183.59	22,333,783.83

金额单位：人民币元

泰达宏利沪深 300C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金转型后首个运作日	4,335,074.97	-1,169,956.01	3,165,118.96
本期利润	-472,842.58	-369,003.51	-841,846.09
本期基金份额交易产生的变动数	-3,315,829.44	1,172,059.40	-2,143,770.04
其中：基金申购款	1,091,097.23	-530,701.91	560,395.32
基金赎回款	-4,406,926.67	1,702,761.31	-2,704,165.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	546,402.95	-366,900.12	179,502.83

7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2018年3月16日(基金转型后首个运作日)至2018年12月31日
活期存款利息收入	59,987.54
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	5,896.50
其他	558.91
合计	66,442.95

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 3 月 16 日(基金转型后首个运作日)至 2018 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	469,927,471.68
减：卖出股票成本总额	503,628,508.87
买卖股票差价收入	-33,701,037.19

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期末有债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-买卖债券差价收入。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末有贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期末有买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有贵金属投资赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末未有贵金属投资申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期末未有衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期末未有衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月16日(基金转型后首个运作日)至2018 年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,491,494.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,491,494.00

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年3月16日(基金转型后首个运作日) 至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	-17,723,387.94
——股票投资	-17,723,387.94
——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	-17,723,387.94

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月16日(基金转型后首个运作日)至 2018年12月31日

基金赎回费收入	32,721.05
基金转换费收入	4,019.80
合计	36,740.85

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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 16 日(基金转型后首个运作日)至 2018 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,441,484.15
银行间市场交易费用	-
合计	1,441,484.15

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 16 日(基金转型后首个运作日) 至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	47,835.88
信息披露费	59,795.22
指数使用费	109,271.44
银行间账户维护费	13,500.00
银行费用	4,177.34
合计	234,579.88

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.016% 的年费率计提。基金合同生效后的指数许可使用费按日计提，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季(自然季度)人民币 50,000 元(大写：伍万圆)，计费区间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、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
北方国际信托股份有限公司	基金管理人的股东(自 2006 年 4 月 21 日至 2018 年 12 月 17 日止)
天津市泰达国际控股(集团)有限公司	基金管理人的股东(自 2018 年 12 月 18 日起)
宏利资产管理(香港)有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期末通过关联交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期末通过关联交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期末通过关联交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 16 日(基金转型后首个运作日)至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	971,172.53
其中：支付销售机构的客户维护费	230,065.73

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 0.65%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×0.65% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018年3月16日(基金转型后首个运作日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	179,293.41

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 0.12%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×0.12% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018年3月16日(基金转型后首个运作日)至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利沪深 300A	泰达宏利沪深 300C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	1,198.63	1,198.63
合计	-	1,198.63	1,198.63

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金基金份额前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泰达宏利基金管理有限公司，再由泰达宏利基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金基金份额销售服务费=C 类基金基金份额前一日基金资产净值 X 0.30%/ 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

泰达宏利沪深 300A		
关联方名称	本期末 2018 年 3 月 16 日(基金转型后首个运作日)至 2018 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
北方国际信托股份有限公司	12,368,730.29	8.2828%

注：1. 本基金关联方投资本基金时所适用的费率为本基金基金合同中约定的费率；

2. 本基金的关联方在本报告期内未运用固有资金投资 C 类基金份额。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 3 月 16 日(基金转型后首个运作日)至 2018 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	9,276,488.03	59,987.54

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	说明
601860	紫金银行	2018 年 12 月 20 日	2019 年 1 月 3 日	新股流通受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600030	中信证券	2018年12月25日	重大事项	16.01	2019年1月10日	17.15	162,400	2,660,423.00	2,600,024.00	

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场正回购余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只股票型指数投资基金，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，

及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，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 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有债券、资产支持证券和同业存单(2017 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2018 年 12 月 31 日，除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要

求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2018 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	9,276,488.03	-	-	-	9,276,488.03
结算备付金	363,686.97	-	-	-	363,686.97
存出保证金	19,284.49	-	-	-	19,284.49
交易性金融资产	-	-	-	163,747,887.10	163,747,887.10
应收利息	-	-	-	2,197.33	2,197.33
应收申购款	-	-	-	120,371.92	120,371.92
资产总计	9,659,459.49	-	-	163,870,456.35	173,529,915.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	17,457.05	17,457.05
应付管理人报酬	-	-	-	98,324.33	98,324.33
应付托管费	-	-	-	18,152.22	18,152.22
应付销售服务费	-	-	-	347.35	347.35
应付交易费用	-	-	-	194,757.30	194,757.30
其他负债	-	-	-	185,054.82	185,054.82
负债总计	-	-	-	514,093.07	514,093.07
利率敏感度缺口	9,659,459.49	-	-	163,356,363.28	173,015,822.77

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的到期日予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2017 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(2017 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票组合的比例不低于基金资产的 90%，投资组合中投资于中证财富大盘指数成份股的资产不低于股票资产的 90%，现金及到期日在一年以内的政府债券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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	163,747,887.10	94.64
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	163,747,887.10	94.64

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2018 年 12 月 31 日，本基金转型尚不足一年，无足够经验数据。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 161,097,717.30 元，属于第二层次的余额为 2,650,169.80 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表（转型前）

会计主体：泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 3 月 15 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 3 月 15 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	14,734,564.95	6,099,730.52
结算备付金		150,374.36	238,665.41
存出保证金		40,651.35	101,003.38
交易性金融资产	7.4.7.2	201,347,361.64	96,133,246.23
其中：股票投资		201,347,361.64	96,133,246.23
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	20,589.55	1,302.31
应收股利		-	-
应收申购款		287,900.65	219,183.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		216,581,442.50	102,793,131.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 3 月 15 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		428,509.58	144,976.63
应付管理人报酬		57,810.99	56,522.37
应付托管费		10,672.78	10,434.89
应付销售服务费		1,146.06	284.10
应付交易费用	7.4.7.7	157,432.40	227,313.42
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	170,967.85	142,947.83
负债合计		826,539.66	582,479.24
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	143,516,080.26	68,857,525.13
未分配利润	7.4.7.10	72,238,822.58	33,353,127.25
所有者权益合计		215,754,902.84	102,210,652.38
负债和所有者权益总计		216,581,442.50	102,793,131.62

注：1、报告截止日 2018 年 03 月 15 日（基金转型前最后运作日），基金份额总额 143,516,080.26 份，其中下属 A 类基金份额 137,315,972.25 份，C 类基金份额 6,200,108.01 份。下属 A 类基金份额净值 1.5030 元，C 类基金份额净值 1.5105 元。

2、本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日（基金转型前最后运作日）。自 2018 年 3 月 16 日起，泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金转型为泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金。

7.2 利润表

会计主体：泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-6,544,042.64	45,954,263.79
1. 利息收入		19,287.24	71,305.13
其中：存款利息收入	7.4.7.11	19,287.24	71,273.66
债券利息收入		-	31.47
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）		967,910.22	39,143,650.54
其中：股票投资收益	7.4.7.12	978,121.59	34,614,408.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	10,164.13
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-10,211.37	4,519,078.03
3. 公允价值变动收益（损失以	7.4.7.17	-7,558,172.69	6,528,781.30

“-”号填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.18	26,932.59	210,526.82
减: 二、费用		514,385.37	2,719,060.81
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	227,309.94	997,161.23
2. 托管费	7.4.10.2.2	41,964.92	184,091.31
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	3,625.87	1,874.04
4. 交易费用	7.4.7.19	201,293.77	1,346,135.95
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	40,190.87	189,798.28
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-7,058,428.01	43,235,202.98
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-7,058,428.01	43,235,202.98

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

本报告期: 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 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)	68,857,525.13	33,353,127.25	102,210,652.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-7,058,428.01	-7,058,428.01
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)	74,658,555.13	45,944,123.34	120,602,678.47
其中: 1. 基金申购款	91,044,934.41	54,997,190.97	146,042,125.38
2. 基金赎回款	-16,386,379.28	-9,053,067.63	-25,439,446.91
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）	143,516,080.26	72,238,822.58	215,754,902.84
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	75,763,836.45	12,551,804.44	88,315,640.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	43,235,202.98	43,235,202.98
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）	-6,906,311.32	-22,433,880.17	-29,340,191.49
其中：1. 基金申购款	126,066,960.80	35,999,594.21	162,066,555.01
2. 基金赎回款	-132,973,272.12	-58,433,474.38	-191,406,746.50
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）	68,857,525.13	33,353,127.25	102,210,652.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金(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[2010]第 176 号《关于核准泰达宏利中证财富大盘指数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《泰达宏利中证财富大盘指数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 1,165,036,951.93 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 092 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》于 2010 年 4 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,165,158,636.81 份基金份额,其中认购资金利息折合 121,684.88 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《关于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、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金与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修改基金合同及托管协议的公告》并报证监会备案,本基金于 2017 年 2 月 9 日起按照投资者的申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用,称为 A 类基金份额;不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。本基金的原有基金份额全部自动划归为该基金 A 类基金份额类别,A 类基金份额的各项业务规则与原基金合同相同。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利中证财富大盘指数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财富大盘指数,力争获取与标的指数相似的投资收益,并力争将基金的日跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内,年化跟踪误差不超过 4%;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、债券、货币市场工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中投资于股票组合的比例不低于基金资产的 90%,投资组合中投资于中证财富大盘指数成份股的资产不低于股票资产的 90%,现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:95%×中证财富大盘指数收益率+5%×同业存款利率。

根据泰达宏利基金管理有限公司于 2018 年 3 月 7 日发布的《关于泰达宏利中证财富大盘指数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》,本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会,大会于 2018 年 3 月 5 日表决通过了《关于泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金转型及法律文件修改的议案》,同意本基金变更基金名称、投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、投资限制、收益分配原则、基金的估值、基金的费用、申购赎回以及其他部分条款,授权基金管理人泰达宏利基金管理有限公司办理本次基金转型及基金合同修改的有关具体事宜。基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效,基金管理人根据基金份额持有人大会的授权,定于 2018 年 3 月 16 日正式实施基金转型,自基金转型实施日起,《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》失效且《泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》同时生效,本基金正式变更为泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投

资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司根据基金份额持有人大会的授权,将本基金于 2018 年 3 月 16 日起转型为泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金,存续期不定,因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日(基金转型前最后运作日)止期间的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 2018 年 3 月 15 日(基金转型前最后运作日)的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日(基金转型前最后运作日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日(基金转型前最后运作日)。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 于 2017 年 12 月 5 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的

市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票
的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部
分确认为估值增值。自 2017 年 12 月 5 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发
行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中
基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的
通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值
日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该
流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券和私募债券除外）及在银
行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资
基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固
定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌
转让的固定收益品种（可转换债券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结
果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所
独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、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》、

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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 3 月 15 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
----	------------------------	--------------------------

活期存款	14,734,564.95	6,099,730.52
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	14,734,564.95	6,099,730.52

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 3 月 15 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	200,809,944.02	201,347,361.64	537,417.62
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	200,809,944.02	201,347,361.64	537,417.62
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	88,037,655.92	96,133,246.23	8,095,590.31
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	88,037,655.92	96,133,246.23	8,095,590.31

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未进行买断式逆回购交易。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年3月15日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	16,035.63	1,149.09
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	1,942.89	107.49
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	2,364.19	0.23
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	246.84	45.50
合计	20,589.55	1,302.31

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年3月15日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	157,432.40	227,313.42
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	157,432.40	227,313.42

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年3月15日	上年度末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-

应付赎回费	1,604.79	430.61
预提费用	162,368.90	135,000.00
指数使用费	6,994.16	7,517.22
合计	170,967.85	142,947.83

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰达宏利财富大盘指数 A		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	68,107,120.79	68,107,120.79
本期申购	84,585,568.61	84,585,568.61
本期赎回(以“-”号填列)	-15,376,717.15	-15,376,717.15
- 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	137,315,972.25	137,315,972.25

金额单位：人民币元

泰达宏利财富大盘指数 C		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	750,404.34	750,404.34
本期申购	6,459,365.80	6,459,365.80
本期赎回(以“-”号填列)	-1,009,662.13	-1,009,662.13
- 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	6,200,108.01	6,200,108.01

金额单位：人民币元

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

泰达宏利财富大盘指数 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	46,221,595.76	-13,237,249.60	32,984,346.16

本期利润	511,609.99	-7,042,786.90	-6,531,176.91
本期基金份额交易产生的变动数	48,160,983.83	-5,540,449.46	42,620,534.37
其中：基金申购款	58,794,583.23	-7,656,695.27	51,137,887.96
基金赎回款	-10,633,599.40	2,116,245.81	-8,517,353.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	94,894,189.58	-25,820,485.96	69,073,703.62

金额单位：人民币元

泰达宏利财富大盘指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	515,154.71	-146,373.62	368,781.09
本期利润	-11,865.31	-515,385.79	-527,251.10
本期基金份额交易产生的变动数	3,831,785.57	-508,196.60	3,323,588.97
其中：基金申购款	4,539,456.61	-680,153.60	3,859,303.01
基金赎回款	-707,671.04	171,957.00	-535,714.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,335,074.97	-1,169,956.01	3,165,118.96

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	14,886.54	63,130.11
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	1,835.40	5,400.98
其他	2,565.30	2,742.57
合计	19,287.24	71,273.66

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	28,859,792.76	453,536,051.31
减：卖出股票成本总额	27,881,671.17	418,921,642.93
买卖股票差价收入	978,121.59	34,614,408.38

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年3 月15日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31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	-	10,164.13
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	-	10,164.13

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年3 月15日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	369,195.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	359,000.00
减：应收利息总额	-	31.47
买卖债券差价收入	-	10,164.13

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未有资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均未有贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有贵金属投资赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有贵金属投资申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未有衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年3月15日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	-10,211.37	4,519,078.03
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	-10,211.37	4,519,078.03

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年3月15日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	-7,558,172.69	6,528,781.30
——股票投资	-7,558,172.69	6,528,781.30
——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	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-7,558,172.69	6,528,781.30

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	26,480.15	207,979.33
基金转换费收入	452.44	2,547.49
合计	26,932.59	210,526.82

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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	201,293.77	1,346,135.95
银行间市场交易费用	-	-
合计	201,293.77	1,346,135.95

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	12,164.12	60,000.00
信息披露费	15,204.78	75,000.00
指数使用费	6,994.16	30,681.84
银行间账户维护费	4,500.00	18,000.00
银行费用	1,327.81	5,916.44

其他	-	200.00
合计	40,190.87	189,798.28

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

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、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
北方国际信托股份有限公司	基金管理人的股东（自 2006 年 4 月 21 日至 2018 年 12 月 17 日止）
宏利资产管理（香港）有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年3月15日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	227,309.94	997,161.23
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	3,625.77	197,460.26

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 0.65%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×0.65% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年3月15日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	41,964.92	184,091.31

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 0.12%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×0.12% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018年1月1日至2018年3月15日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利财富大盘指数 A	泰达宏利财富大盘指数 C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	2,685.29	2,685.29

合计	-	2,685.29	2,685.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利财富大盘指数 A	泰达宏利财富大盘指数 C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	1.23	1.23
合计	-	1.23	1.23

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泰达宏利基金管理有限公司，再由泰达宏利基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费 = C 类基金份额前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

泰达宏利财富大盘指数 A				
关联方名称	本期末 2018年3月15日		上年度末 2017年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
北方国际信托股份有限公司	12,368,730.29	9.0075%	0.00	0.0000%

份额单位：份

泰达宏利财富大盘指数 C		
关联方名称	本期末 2018年3月15日	上年度末 2017年12月31日

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
--	-------------	--------------------------	-------------	--------------------------

注：1. 本基金关联方投资本基金时所适用的费率为本基金基金合同中约定的费率；

2. 本基金的关联方在本报告期内未运用自有资金投资 C 类基金份额。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	14,734,564.95	14,886.54	6,099,730.52	63,130.11

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2018 年 3 月 15 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

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
000666	经纬纺 机	2018 年 3 月 12 日	重大事 项	18.29	2018 年 11 月 12 日	16.27	119,188	2,367,757.42	2,179,948.52	
000415	渤海金 控	2018 年 1 月 17 日	重大事 项	5.84	2018 年 7 月 17 日	5.26	193,800	1,305,358.43	1,131,792.00	
002450	康得新	2018 年 2 月 5 日	重大事 项	19.78	2018 年 4 月	20.01	55,300	1,409,121.29	1,093,834.00	

					27 日					
600682	南京新百	2018 年 2 月 2 日	重大事项	33.28	2018 年 6 月 7 日	29.95	25,000	943,147.00	832,000.00	
600157	永泰能源	2017 年 11 月 21 日	重大事项	3.36	2018 年 4 月 4 日	3.03	84,500	306,156.81	283,920.00	
300266	兴源环境	2018 年 2 月 5 日	重大事项	19.99	2018 年 7 月 2 日	17.99	8,200	215,949.73	163,918.00	
600309	万华化学	2017 年 12 月 5 日	重大事项	36.14	2018 年 6 月 4 日	40.08	400	14,352.47	14,456.00	

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场正回购余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只股票型指数投资基金，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，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 2018 年 3 月 15 日，本基金未持有债券、资产支持证券和同业存单(2017 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2018 年 3 月 15 日，除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2018 年 3 月 15 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	14,734,564.95	-	-	-	14,734,564.95
结算备付金	150,374.36	-	-	-	150,374.36
存出保证金	40,651.35	-	-	-	40,651.35
交易性金融资产	-	-	-	-201,347,361.64	201,347,361.64
应收利息	-	-	-	20,589.55	20,589.55
应收申购款	-	-	-	287,900.65	287,900.65
资产总计	14,925,590.66	-	-	-201,655,851.84	216,581,442.50
负债					
应付赎回款	-	-	-	428,509.58	428,509.58
应付管理人报酬	-	-	-	57,810.99	57,810.99
应付托管费	-	-	-	10,672.78	10,672.78
应付销售服务费	-	-	-	1,146.06	1,146.06
应付交易费用	-	-	-	157,432.40	157,432.40
其他负债	-	-	-	170,967.85	170,967.85
负债总计	-	-	-	826,539.66	826,539.66
利率敏感度缺口	14,925,590.66	-	-	-200,829,312.18	215,754,902.84
上年度末 2017 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	6,099,730.52	-	-	-	6,099,730.52
结算备付金	238,665.41	-	-	-	238,665.41
存出保证金	101,003.38	-	-	-	101,003.38
交易性金融资产	-	-	-	-96,133,246.23	96,133,246.23

应收利息	-	-	-	1,302.31	1,302.31
应收申购款	1,090.61	-	-	218,093.16	219,183.77
资产总计	6,440,489.92	-	-	96,352,641.70	102,793,131.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	144,976.63	144,976.63
应付管理人报酬	-	-	-	56,522.37	56,522.37
应付托管费	-	-	-	10,434.89	10,434.89
应付销售服务费	-	-	-	284.10	284.10
应付交易费用	-	-	-	227,313.42	227,313.42
其他负债	-	-	-	142,947.83	142,947.83
负债总计	-	-	-	582,479.24	582,479.24
利率敏感度缺口	6,440,489.92	-	-	95,770,162.46	102,210,652.38

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 3 月 15 日(基金转型前最后运作日)，本基金未持有交易性债券投资(2017 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(2017 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票组合的比例不低于基金资产的 90%，投资组合中投资于中证财富大盘指数成份股的资产不低于股票资产的 90%，现金及到期日在一年以内的政府债券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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 3 月 15 日		上年度末 2017 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	201,347,361.64	93.32	96,133,246.23	94.05
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	201,347,361.64	93.32	96,133,246.23	94.05

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 (2018 年 3 月 15 日)	上年度末 (2017 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	9,690,000.00	4,250,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-9,690,000.00	-4,250,000.00

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 3 月 15 日(基金转型前最后运作日)，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 201,347,361.64 元，无属于第二或第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 95,795,767.78 元，第二层次 337,478.45 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 3 月 15 日(基金转型前最后运作日)，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告（转型后）

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	163,747,887.10	94.36
	其中：股票	163,747,887.10	94.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,640,175.00	5.56
8	其他各项资产	141,853.74	0.08
9	合计	173,529,915.84	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	57,500.00	0.03
B	采矿业	3,658,189.00	2.11
C	制造业	43,980,347.69	25.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,510,370.00	3.18
E	建筑业	5,694,305.00	3.29
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,395,582.28	2.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,044,714.00	1.76
J	金融业	58,220,290.62	33.65
K	房地产业	8,414,430.04	4.86
L	租赁和商务服务业	1,914,360.00	1.11
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	2,453,790.00	1.42
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	137,343,878.63	79.38

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	219,912.00	0.13

B	采矿业	2,588,277.65	1.50
C	制造业	9,410,365.91	5.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	241,660.00	0.14
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,363,208.00	3.10
G	交通运输、仓储和邮政业	218,572.00	0.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,872,630.35	2.24
J	金融业	247,881.80	0.14
K	房地产业	-	-
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	1,464,685.00	0.85
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	2,118,255.76	1.22
S	综合	658,560.00	0.38
	合计	26,404,008.47	15.26

8.2.3 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。

8.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.2.1 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	601318	中国平安	252,695	14,176,189.50	8.19
2	601688	华泰证券	318,900	5,166,180.00	2.99
3	600016	民生银行	891,600	5,108,868.00	2.95
4	000651	格力电器	140,400	5,010,876.00	2.90
5	600887	伊利股份	201,493	4,610,159.84	2.66
6	601939	建设银行	688,221	4,383,967.77	2.53
7	600519	贵州茅台	7,416	4,375,514.16	2.53
8	002415	海康威视	163,300	4,206,608.00	2.43
9	600036	招商银行	162,567	4,096,688.40	2.37
10	600606	绿地控股	662,500	4,047,875.00	2.34

11	601169	北京银行	705,196	3,956,149.56	2.29
12	000858	五 粮 液	67,000	3,408,960.00	1.97
13	600276	恒瑞医药	64,055	3,378,901.25	1.95
14	600919	江苏银行	558,200	3,332,454.00	1.93
15	000002	万 科 A	139,222	3,316,268.04	1.92
16	601669	中国电建	600,300	2,917,458.00	1.69
17	600009	上海机场	57,153	2,901,086.28	1.68
18	600030	中信证券	162,400	2,600,024.00	1.50
19	601166	兴业银行	169,416	2,531,075.04	1.46
20	000338	潍柴动力	326,168	2,511,493.60	1.45
21	300015	爱尔眼科	93,300	2,453,790.00	1.42
22	000166	申万宏源	597,500	2,431,825.00	1.41
23	600104	上汽集团	79,200	2,112,264.00	1.22
24	601985	中国核电	381,900	2,012,613.00	1.16
25	600900	长江电力	123,500	1,961,180.00	1.13
26	000776	广发证券	153,700	1,948,916.00	1.13
27	601888	中国国旅	31,800	1,914,360.00	1.11
28	600050	中国联通	355,600	1,838,452.00	1.06
29	600585	海螺水泥	62,100	1,818,288.00	1.05
30	601998	中信银行	318,400	1,735,280.00	1.00
31	601818	光大银行	461,400	1,707,180.00	0.99
32	000725	京东方 A	599,400	1,576,422.00	0.91
33	002304	洋河股份	16,400	1,553,408.00	0.90
34	002032	苏 泊 尔	29,400	1,543,500.00	0.89
35	601668	中国建筑	269,300	1,535,010.00	0.89
36	603993	洛阳钼业	381,400	1,434,064.00	0.83
37	600886	国投电力	171,200	1,378,160.00	0.80
38	600309	万华化学	48,000	1,343,520.00	0.78
39	000063	中兴通讯	64,800	1,269,432.00	0.73
40	000001	平安银行	129,200	1,211,896.00	0.70
41	600867	通化东宝	85,800	1,192,620.00	0.69
42	600406	国电南瑞	63,400	1,174,802.00	0.68
43	600028	中国石化	230,100	1,162,005.00	0.67
44	601899	紫金矿业	318,000	1,062,120.00	0.61
45	600926	杭州银行	120,600	892,440.00	0.52
46	600068	葛洲坝	137,200	867,104.00	0.50
47	601600	中国铝业	242,700	861,585.00	0.50
48	600383	金地集团	84,600	813,852.00	0.47
49	601398	工商银行	152,715	807,862.35	0.47

50	600999	招商证券	59,100	791,940.00	0.46
51	601006	大秦铁路	92,600	762,098.00	0.44
52	000333	美的集团	20,200	744,572.00	0.43
53	601111	中国国航	91,100	696,004.00	0.40
54	601766	中国中车	72,700	655,754.00	0.38
55	601328	交通银行	111,700	646,743.00	0.37
56	601009	南京银行	98,600	636,956.00	0.37
57	000709	河钢股份	191,900	544,996.00	0.31
58	601727	上海电气	88,100	435,214.00	0.25
59	601618	中国中冶	114,700	356,717.00	0.21
60	600048	保利地产	20,000	235,800.00	0.14
61	601012	隆基股份	13,300	231,952.00	0.13
62	600031	三一重工	26,926	224,562.84	0.13
63	600518	康美药业	24,300	223,803.00	0.13
64	600027	华电国际	20,300	96,425.00	0.06
65	000895	双汇发展	3,800	89,642.00	0.05
66	600011	华能国际	8,400	61,992.00	0.04
67	002714	牧原股份	2,000	57,500.00	0.03
68	601336	新华保险	1,200	50,688.00	0.03
69	002594	比亚迪	900	45,900.00	0.03
70	300059	东方财富	2,600	31,460.00	0.02
71	600018	上港集团	5,700	29,526.00	0.02
72	601800	中国交建	1,600	18,016.00	0.01
73	600019	宝钢股份	1,600	10,400.00	0.01
74	601066	中信建投	800	6,968.00	0.00
75	601919	中远海控	1,700	6,868.00	0.00
76	000069	华侨城A	100	635.00	0.00

8.2.2 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	600511	国药股份	117,800	2,738,850.00	1.58
2	600718	东软集团	226,797	2,619,505.35	1.51
3	600755	厦门国贸	340,900	2,379,482.00	1.38
4	600426	华鲁恒升	187,900	2,267,953.00	1.31
5	000778	新兴铸管	506,800	2,184,308.00	1.26
6	002841	视源股份	27,100	1,541,990.00	0.89

7	603568	伟明环保	64,100	1,464,685.00	0.85
8	300133	华策影视	137,356	1,230,709.76	0.71
9	000968	蓝焰控股	95,381	1,015,807.65	0.59
10	601001	大同煤业	224,200	957,334.00	0.55
11	000793	华闻传媒	289,200	858,924.00	0.50
12	600845	宝信软件	32,000	667,200.00	0.39
13	600783	鲁信创投	42,000	658,560.00	0.38
14	300308	中际旭创	15,780	642,088.20	0.37
15	600256	广汇能源	163,600	615,136.00	0.36
16	000887	中鼎股份	43,500	440,220.00	0.25
17	002681	奋达科技	91,900	336,354.00	0.19
18	002353	杰瑞股份	22,000	330,000.00	0.19
19	300719	安达维尔	31,900	327,932.00	0.19
20	600633	浙数文化	36,100	294,215.00	0.17
21	601233	桐昆股份	29,600	288,896.00	0.17
22	600236	桂冠电力	43,000	241,660.00	0.14
23	300498	温氏股份	8,400	219,912.00	0.13
24	600053	九鼎投资	8,400	197,736.00	0.11
25	002151	北斗星通	9,300	196,230.00	0.11
26	600377	宁沪高速	20,000	196,000.00	0.11
27	002217	合力泰	39,500	184,860.00	0.11
28	600981	汇鸿集团	48,200	180,268.00	0.10
29	603258	电魂网络	9,700	164,997.00	0.10
30	000513	丽珠集团	6,200	155,930.00	0.09
31	600733	北汽蓝谷	18,700	148,852.00	0.09
32	000039	中集集团	8,200	86,756.00	0.05
33	002833	弘亚数控	2,400	81,600.00	0.05
34	002195	二三四五	19,700	72,693.00	0.04
35	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.04
36	603003	龙宇燃油	9,600	64,608.00	0.04
37	600418	江淮汽车	10,500	50,505.00	0.03
38	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.03
39	603629	利通电子	1,051	40,684.21	0.02
40	600373	中文传媒	2,200	28,622.00	0.02
41	601866	中远海发	9,900	22,572.00	0.01
42	300418	昆仑万维	1,500	19,290.00	0.01
43	603000	人民网	2,600	18,980.00	0.01
44	002113	天润数娱	4,200	15,750.00	0.01
45	300750	宁德时代	200	14,760.00	0.01

46	600737	中粮糖业	1,400	10,304.00	0.01
47	000008	神州高铁	2,400	9,336.00	0.01
48	600764	中国海防	200	4,768.00	0.00

8.3 报告期内股票投资组合的重大变动

8.3.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600276	恒瑞医药	8,457,263.49	4.89
2	000776	广发证券	7,891,301.31	4.56
3	002415	海康威视	7,085,897.00	4.10
4	600887	伊利股份	7,010,853.17	4.05
5	002027	分众传媒	6,882,196.47	3.98
6	000651	格力电器	6,722,763.00	3.89
7	601888	中国国旅	6,306,328.00	3.64
8	603993	洛阳钼业	6,191,572.69	3.58
9	000858	五粮液	5,711,751.00	3.30
10	601688	华泰证券	5,525,738.00	3.19
11	000413	东旭光电	5,525,640.00	3.19
12	601939	建设银行	5,520,428.96	3.19
13	600016	民生银行	5,388,836.07	3.11
14	600519	贵州茅台	5,342,359.00	3.09
15	601857	中国石油	5,147,494.00	2.98
16	600606	绿地控股	5,105,449.49	2.95
17	600030	中信证券	5,075,257.00	2.93
18	000050	深天马A	4,735,597.00	2.74
19	000778	新兴铸管	4,526,085.18	2.62
20	600406	国电南瑞	4,313,766.50	2.49
21	600031	三一重工	4,227,825.70	2.44
22	001979	招商蛇口	4,203,586.37	2.43
23	601099	太平洋	4,079,922.00	2.36
24	600009	上海机场	4,065,022.04	2.35
25	002230	科大讯飞	4,056,022.00	2.34
26	000786	北新建材	4,013,923.50	2.32
27	002001	新和成	3,996,027.90	2.31

28	000703	恒逸石化	3,936,633.20	2.28
29	600309	万华化学	3,878,549.00	2.24
30	000001	平安银行	3,812,629.08	2.20
31	601318	中国平安	3,782,337.50	2.19
32	600690	青岛海尔	3,664,549.60	2.12
33	600029	南方航空	3,601,629.00	2.08
34	000725	京东方 A	3,567,960.00	2.06
35	600015	华夏银行	3,563,138.80	2.06
36	600705	中航资本	3,560,322.51	2.06
37	600919	江苏银行	3,539,775.00	2.05

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

8.3.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600015	华夏银行	8,289,863.60	4.79
2	601328	交通银行	8,229,684.68	4.76
3	600016	民生银行	8,060,935.00	4.66
4	601288	农业银行	7,645,722.89	4.42
5	600030	中信证券	6,529,206.00	3.77
6	601857	中国石油	5,891,401.28	3.41
7	000050	深天马 A	5,772,475.00	3.34
8	601398	工商银行	5,768,629.00	3.33
9	000776	广发证券	5,462,868.00	3.16
10	601166	兴业银行	5,330,963.00	3.08
11	600036	招商银行	5,209,670.00	3.01
12	002027	分众传媒	5,134,871.80	2.97
13	000413	东旭光电	5,053,749.53	2.92
14	600019	宝钢股份	4,877,422.40	2.82
15	600276	恒瑞医药	4,815,094.00	2.78
16	601099	太平洋	4,782,471.20	2.76
17	601888	中国国旅	4,290,892.25	2.48
18	601998	中信银行	4,186,460.00	2.42
19	000001	平安银行	4,087,002.24	2.36
20	601012	隆基股份	3,845,515.00	2.22
21	600690	青岛海尔	3,829,021.88	2.21

22	000786	北新建材	3,824,795.31	2.21
23	002230	科大讯飞	3,789,107.69	2.19
24	600519	贵州茅台	3,773,299.00	2.18
25	603993	洛阳钼业	3,743,923.00	2.16
26	600031	三一重工	3,732,996.92	2.16
27	601939	建设银行	3,724,057.64	2.15
28	000703	恒逸石化	3,628,442.63	2.10
29	002001	新和成	3,515,984.98	2.03
30	601390	中国中铁	3,489,593.00	2.02
31	600487	亨通光电	3,481,990.00	2.01
32	001979	招商蛇口	3,461,990.90	2.00

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

8.3.3 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	483,752,422.27
卖出股票收入（成交）总额	469,927,471.68

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

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

8.9.2 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

在报告期内，本基金未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

8.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的招商银行（600036）于 2018 年 2 月 12 日被银保监会做出行政处罚决定。招商银行因（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。

报告期内本基金投资的民生银行（600016）2018 年 11 月 9 日被银保监会做出行政处罚决定。民生银行因（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）同业投资违规接受担保；（三）同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；（四）本行理财产品之间风险隔离不到位；（五）个人理财资金违规投资；（六）票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；（七）为非保本理财产品提供保本承诺；（八）贷款业务严重违反审慎经营规则。共罚款 3360 万元。

基金管理人分析认为，上述两家公司发展战略清晰，公司整体呈现良好的发展态势，在报告期内是沪深 300 指数基金的成份股，为了维持贴近指数风险结构的目的，基金管理人经审慎分析，在本报告期内继续保持对其的投资。

本基金投资的其余证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

8.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	19,284.49
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	2,197.33
5	应收申购款	120,371.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	141,853.74

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.11.5.2 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情况。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1. 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；
2. 本节报告期内指 2018 年 3 月 16 日至 2018 年 12 月 31 日，报告期末指 2018 年 12 月 31 日。

§ 8 投资组合报告（转型前）

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	201,347,361.64	92.97
	其中：股票	201,347,361.64	92.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,884,939.31	6.87
8	其他资产	349,141.55	0.16
9	合计	216,581,442.50	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,349,597.00	2.48
C	制造业	50,772,541.08	23.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,604,390.00	2.60
E	建筑业	9,871,035.66	4.58
F	批发和零售业	785,174.00	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	4,767,346.00	2.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,906,295.00	1.35
J	金融业	95,034,367.46	44.05
K	房地产业	13,692,906.52	6.35
L	租赁和商务服务业	1,667,989.00	0.77
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	115,089.00	0.05

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	190,566,730.72	88.33

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	443,610.00	0.21
C	制造业	4,902,577.08	2.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,170,527.84	1.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	832,000.00	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	1,212,228.00	0.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	74,000.00	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	977,712.00	0.45
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	163,918.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,058.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	10,780,630.92	5.00

8.2.3 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	208,995	14,732,057.55	6.83
2	600036	招商银行	328,867	10,037,020.84	4.65
3	601328	交通银行	1,340,791	8,634,694.04	4.00
4	601288	农业银行	1,962,723	8,106,045.99	3.76
5	600016	民生银行	968,500	8,096,660.00	3.75
6	601398	工商银行	1,022,515	6,605,446.90	3.06
7	601166	兴业银行	318,316	5,627,826.88	2.61
8	601169	北京银行	759,096	5,480,673.12	2.54
9	000002	万科A	159,022	5,193,658.52	2.41
10	600015	华夏银行	494,388	4,578,032.88	2.12
11	600519	贵州茅台	5,916	4,416,116.52	2.05
12	600030	中信证券	221,900	4,171,720.00	1.93
13	601939	建设银行	470,549	3,792,624.94	1.76
14	600019	宝钢股份	331,700	3,164,418.00	1.47
15	601186	中国铁建	299,854	3,100,490.36	1.44
16	000338	潍柴动力	363,868	3,085,600.64	1.43
17	600050	中国联通	466,500	2,906,295.00	1.35
18	600000	浦发银行	231,302	2,865,831.78	1.33
19	601998	中信银行	422,900	2,812,285.00	1.30
20	000100	TCL 集团	738,500	2,806,300.00	1.30
21	601390	中国中铁	368,800	2,773,376.00	1.29
22	600518	康美药业	123,400	2,708,630.00	1.26
23	601985	中国核电	357,300	2,554,695.00	1.18
24	600104	上汽集团	69,300	2,548,161.00	1.18
25	000651	格力电器	46,800	2,517,840.00	1.17
26	000333	美的集团	39,600	2,431,836.00	1.13
27	601628	中国人寿	88,465	2,397,401.50	1.11
28	600688	上海石化	392,500	2,347,150.00	1.09
29	600606	绿地控股	301,700	2,329,124.00	1.08
30	601788	光大证券	180,300	2,320,461.00	1.08
31	000666	经纬纺机	119,188	2,179,948.52	1.01
32	000671	阳光城	257,900	2,145,728.00	0.99
33	600115	东方航空	281,000	2,076,590.00	0.96

34	600887	伊利股份	61,700	1,976,868.00	0.92
35	002241	歌尔股份	126,800	1,953,988.00	0.91
36	600900	长江电力	113,500	1,889,775.00	0.88
37	600585	海螺水泥	55,000	1,862,850.00	0.86
38	000001	平安银行	147,808	1,730,831.68	0.80
39	600362	江西铜业	91,500	1,683,600.00	0.78
40	601668	中国建筑	182,567	1,624,846.30	0.75
41	000830	鲁西化工	76,900	1,522,620.00	0.71
42	601898	中煤能源	269,400	1,522,110.00	0.71
43	600089	特变电工	167,700	1,517,685.00	0.70
44	600028	中国石化	231,500	1,486,230.00	0.69
45	600018	上港集团	181,800	1,338,048.00	0.62
46	601088	中国神华	56,400	1,329,912.00	0.62
47	601669	中国电建	177,100	1,257,410.00	0.58
48	600886	国投电力	161,100	1,159,920.00	0.54
49	000415	渤海金控	193,800	1,131,792.00	0.52
50	601012	隆基股份	30,800	1,128,512.00	0.52
51	600816	安信信托	87,800	1,127,352.00	0.52
52	600271	航天信息	51,900	1,107,027.00	0.51
53	002450	康得新	55,300	1,093,834.00	0.51
54	600325	华发股份	131,100	1,068,465.00	0.50
55	600208	新湖中宝	225,500	1,039,555.00	0.48
56	000039	中集集团	55,100	997,861.00	0.46
57	600048	保利地产	67,700	987,743.00	0.46
58	600010	包钢股份	391,000	899,300.00	0.42
59	601333	广深铁路	179,600	872,856.00	0.40
60	600170	上海建工	212,300	813,109.00	0.38
61	601607	上海医药	33,800	785,174.00	0.36
62	600219	南山铝业	223,200	758,880.00	0.35
63	002466	天齐锂业	11,620	735,778.40	0.34
64	601857	中国石油	91,500	727,425.00	0.34
65	002092	中泰化学	54,500	692,695.00	0.32
66	600657	信达地产	117,100	651,076.00	0.30
67	600690	青岛海尔	30,800	640,332.00	0.30
68	000876	新希望	81,100	612,305.00	0.28
69	601818	光大银行	143,164	607,015.36	0.28
70	000709	河钢股份	150,000	573,000.00	0.27
71	000488	晨鸣纸业	30,500	557,540.00	0.26
72	601009	南京银行	58,600	515,680.00	0.24

73	000425	徐工机械	112,500	472,500.00	0.22
74	600415	小商品城	86,500	467,965.00	0.22
75	000625	长安汽车	38,500	464,310.00	0.22
76	600837	海通证券	30,900	375,126.00	0.17
77	600026	中远海能	60,900	345,912.00	0.16
78	600705	中航资本	62,600	343,048.00	0.16
79	002415	海康威视	7,900	340,411.00	0.16
80	000725	京东方 A	55,100	327,845.00	0.15
81	000786	北新建材	12,300	313,035.00	0.15
82	600820	隧道股份	39,400	301,804.00	0.14
83	600157	永泰能源	84,500	283,920.00	0.13
84	000069	华侨城 A	23,100	199,122.00	0.09
85	600276	恒瑞医药	2,300	190,187.00	0.09
86	601006	大秦铁路	14,800	133,940.00	0.06
87	000826	启迪桑德	3,900	115,089.00	0.05
88	600660	福耀玻璃	3,300	88,902.00	0.04
89	601601	中国太保	1,900	76,532.00	0.04
90	601888	中国国旅	1,200	68,232.00	0.03
91	600177	雅戈尔	7,500	66,225.00	0.03
92	600176	中国巨石	2,000	34,420.00	0.02
93	600309	万华化学	400	14,456.00	0.01
94	600565	迪马股份	3,000	12,210.00	0.01
95	002008	大族激光	100	5,799.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000883	湖北能源	467,914	2,133,687.84	0.99
2	600277	亿利洁能	248,700	1,457,382.00	0.68
3	601238	广汽集团	62,900	1,410,847.00	0.65
4	600350	山东高速	200,700	1,212,228.00	0.56
5	600682	南京新百	25,000	832,000.00	0.39
6	600708	光明地产	96,300	689,508.00	0.32
7	000050	深天马 A	37,900	649,606.00	0.30
8	000937	冀中能源	79,500	443,610.00	0.21
9	002595	豪迈科技	23,800	410,312.00	0.19
10	300274	阳光电源	16,200	289,008.00	0.13

11	002133	广宇集团	65,800	288,204.00	0.13
12	000980	众泰汽车	19,300	209,019.00	0.10
13	002124	天邦股份	19,100	180,304.00	0.08
14	300266	兴源环境	8,200	163,918.00	0.08
15	600567	山鹰纸业	32,900	159,565.00	0.07
16	603712	七一二	4,022	91,058.08	0.04
17	002354	天神娱乐	4,000	74,000.00	0.03
18	600461	洪城水业	6,000	36,840.00	0.02
19	600761	安徽合力	2,200	23,276.00	0.01
20	002100	天康生物	2,600	20,514.00	0.01
21	300144	宋城演艺	200	4,058.00	0.00
22	002358	森源电气	100	1,686.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	7,795,349.00	7.63
2	601318	中国平安	7,450,033.00	7.29
3	600016	民生银行	5,793,737.00	5.67
4	601328	交通银行	4,834,487.00	4.73
5	600030	中信证券	4,780,792.00	4.68
6	601288	农业银行	4,526,507.00	4.43
7	601398	工商银行	3,857,166.00	3.77
8	601169	北京银行	3,304,859.00	3.23
9	000002	万科 A	3,211,510.00	3.14
10	601390	中国中铁	3,205,149.61	3.14
11	601998	中信银行	3,089,958.00	3.02
12	600015	华夏银行	3,033,604.00	2.97
13	600606	绿地控股	2,845,586.00	2.78
14	600019	宝钢股份	2,796,023.00	2.74
15	000100	TCL 集团	2,721,607.00	2.66
16	000671	阳光城	2,621,496.00	2.56
17	600115	东方航空	2,497,814.08	2.44
18	601628	中国人寿	2,342,715.35	2.29

19	600688	上海石化	2,258,631.00	2.21
20	600519	贵州茅台	2,225,573.00	2.18
21	000666	经纬纺机	2,217,398.54	2.17
22	601939	建设银行	2,164,430.45	2.12

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601818	光大银行	2,075,034.00	2.03
2	600482	中国动力	1,730,462.80	1.69
3	600166	福田汽车	1,488,086.00	1.46
4	601229	上海银行	1,286,842.00	1.26
5	600029	南方航空	1,252,238.00	1.23
6	600837	海通证券	1,232,834.00	1.21
7	000776	广发证券	995,105.48	0.97
8	601006	大秦铁路	970,645.00	0.95
9	600173	卧龙地产	870,593.00	0.85
10	000553	沙隆达 A	820,620.68	0.80
11	000631	顺发恒业	776,813.00	0.76
12	600606	绿地控股	736,298.00	0.72
13	000651	格力电器	657,908.00	0.64
14	000725	京东方 A	549,298.00	0.54
15	000709	河钢股份	536,148.00	0.52
16	600066	宇通客车	534,963.00	0.52
17	600009	上海机场	528,196.00	0.52
18	601088	中国神华	488,157.00	0.48
19	000768	中航飞机	484,070.00	0.47
20	600567	山鹰纸业	430,026.00	0.42

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	140,653,959.27
卖出股票收入（成交）总额	28,859,792.76

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

在报告期内，本基金未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的招商银行（600036）于 2018 年 2 月 12 日被银保监会做出行政处罚决定。招商银行因（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业

务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。

基金管理人分析认为，我们判断公司发展战略清晰，公司整体呈现良好的发展态势。因此，基金管理人经审慎分析，在本报告期内继续保持对其的投资。

本基金投资的其余前九名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	40,651.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,589.55
5	应收申购款	287,900.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	349,141.55

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	600682	南京新百	832,000.00	0.39	重大事项

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1. 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；
2. 本节报告期内指 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日，报告期末指 2018 年 3 月 15 日。

§ 9 基金份额持有人信息（转型后）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
泰达宏利沪深 300A	11,673	12,792.80	68,030,221.21	45.56%	81,300,089.89	54.44%
泰达宏利沪深 300C	371	3,159.64	0.00	0.00%	1,172,225.01	100.00%
合计	12,044	12,496.06	68,030,221.21	45.20%	82,472,314.90	54.80%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末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	泰达宏利沪深 300A	95,803.71	0.0642%
	泰达宏利沪深 300C	4,331.47	0.3695%
	合计	100,135.18	0.0665%

9.3 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	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	泰达宏利沪深 300A	0

投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泰达宏利沪深 300C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达宏利沪深 300A	0
	泰达宏利沪深 300C	0
	合计	0

§ 9 基金份额持有人信息（转型前）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
泰达宏利财富大盘指数 A	17,187	7,989.53	69,285,751.04	50.46%	68,030,221.21	49.54%
泰达宏利财富大盘指数 C	434	14,285.96	1,215,063.14	19.60%	4,985,044.87	80.40%
合计	17,621	8,144.60	70,500,814.18	49.12%	73,015,266.08	50.88%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末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	泰达宏利财富大盘指数 A	70,271.44	0.0512%
	泰达宏利财富大盘指数 C	335.78	0.0054%
	合计	70,607.22	0.0492%

9.3 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泰达宏利财富大盘指数 A	0
	泰达宏利财富大盘指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达宏利财富大盘指数 A	0
	泰达宏利财富大盘指数 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

项目	泰达宏利沪深 300A	泰达宏利沪深 300C
基金合同生效日基金份额总额	137,315,972.25	6,200,108.01
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	32,935,463.10	1,885,776.54
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	20,921,124.25	6,913,659.54
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	149,330,311.10	1,172,225.01

注：上述基金合同生效日的基金份额总额为基金转型起始日（2018年3月16日）的基金份额总额。

§ 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

项目	泰达宏利财富大 盘指数 A	泰达宏利财富大 盘指数 C
基金合同生效日基金份额总额	1,165,158,636.81	-
本报告期期初基金份额总额	68,107,120.79	750,404.34
本报告期期间基金总申购份额	84,585,568.61	6,459,365.80
减:本报告期期间基金总赎回份额	15,376,717.15	1,009,662.13
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以 "- "填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	137,315,972.25	6,200,108.01

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会表决投票时间为 2018 年 2 月 8 日起至 2018 年 3 月 4 日 17:00 止。本次基金份额持有人大会于 2018 年 3 月 5 日表决通过了《关于泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金转型及法律文件修改的议案》。根据持有人大会通过的议案及方案说明，本基金自 2018 年 3 月 16 日起实施转型。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本公司于 2018 年 4 月 28 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，张萍女士因个人健康原因辞去公司督察长职务，由公司总经理刘建先生于 4 月 28 日起代为履行公司督察长职务。

2、本公司于 2018 年 9 月 27 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，聘任刘晓玲女士为公司副总经理。

3、本公司于 2018 年 11 月 10 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，聘任聂志刚先生为公司督察长。

4、报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变

动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用为 6 万元，该审计机构对本基金已提供审计服务的年限为 7 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、本基金托管人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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	1	177,503,626.26	18.64%	165,310.68	18.64%	-
国泰君安	1	163,740,524.83	17.19%	152,493.43	17.19%	-
光大证券	1	133,854,875.00	14.05%	124,661.40	14.05%	-
中信建投	2	132,625,911.57	13.92%	123,517.44	13.92%	-
东方证券	4	91,774,133.52	9.64%	85,469.95	9.64%	-
华林证券	2	66,904,367.59	7.02%	62,309.28	7.02%	-
太平洋	2	52,035,317.69	5.46%	48,460.61	5.46%	-
渤海证券	1	41,160,761.33	4.32%	38,333.19	4.32%	-
天风证券	1	32,527,413.99	3.42%	30,292.54	3.41%	-
东吴证券	1	28,944,812.57	3.04%	26,956.44	3.04%	-

东方财富	1	22,576,759.06	2.37%	21,025.58	2.37%	-
广发证券	2	8,824,919.05	0.93%	8,217.95	0.93%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	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	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期内（2018年3月16日至2018年12月31日）新增长江证券、东亚前海证券、国盛证券、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，使用其席位作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- （1）经营规范，有较完备的内控制度；
- （2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要

(3) 能为基金管理人提供高质量的研究咨询服务。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券	1	97,703,152.86	57.80%	90,991.35	57.80%	-
兴业证券	1	18,736,280.65	11.08%	17,449.31	11.08%	-
中信建投	2	16,251,019.42	9.61%	15,134.07	9.61%	-
东方证券	4	12,716,092.54	7.52%	11,842.09	7.52%	-
中信证券	2	9,742,059.21	5.76%	9,072.48	5.76%	-
太平洋	2	6,338,663.70	3.75%	5,903.22	3.75%	-
光大证券	1	5,393,040.64	3.19%	5,022.31	3.19%	-
东方财富	1	2,166,303.02	1.28%	2,017.57	1.28%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

长江证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期内（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日）未新增、撤销席位；

（二）交易席位选择的标准和程序：

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

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》	公司网站	2018 年 3 月 10 日
2	《泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同摘要》	公司网站	2018 年 3 月 10 日
3	《泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》	公司网站	2018 年 3 月 10 日
4	《泰达宏利沪深 300 指数增强	公司网站	2018 年 3 月 10 日

	型证券投资基金招募说明书》		
5	《泰达宏利中证财富大盘指数基金转型为泰达宏利沪深 300 指数增强型基金的第一次提示性公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2018 年 3 月 10 日
6	《关于泰达宏利中证财富大盘指数基金转型为泰达宏利沪深 300 指数增强型基金的第二次提示性公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2018 年 3 月 17 日

11.9 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《关于以通讯开会方式召开泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2018 年 1 月 31 日
2	《关于以通讯开会方式召开泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2018 年 2 月 1 日
3	《关于以通讯开会方式召开泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2018 年 2 月 2 日
4	《北京市求是公证处关于泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金份额持有人大会的公证书》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2018 年 3 月 7 日
5	《关于泰达宏利中证财富大盘指数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》及公司网站	2018 年 3 月 7 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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（转型后）

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	20180316-20181231	55,661,450.92	0.00	0.00	55,661,450.92	36.98%
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。							

注：报告期内，申购份额含红利再投资份额。

12.1 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（转型前）

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	20180130-20180315	0.00	55,661,450.92	0.00	55,661,450.92	38.78%
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。							

注：报告期内，申购份额含红利再投资份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内，根据本基金基金份额持有人大会表决通过的《关于泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金转型及法律文件修改的议案》及《关于泰达宏利中证财富大盘指数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》，自 2018 年 3 月 16 日起，本基金正式实施转型，内容调整包括投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、投资限制、收益分配原则、基金的估值、基金的费用、申购赎回以及修订基金合同、托管协议、招募说明书

等，并更名为“泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金。

2、本公司于 2018 年 12 月 22 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于股权变更的公告》，原公司中方股东北方国际信托股份有限公司将所持有的泰达宏利基金管理有限公司全部 51% 股权转让给天津市泰达国际控股（集团）有限公司。此次股权转让完成后，公司的注册资本保持不变，仍为人民币 1.8 亿元。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

13.3 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》）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：客服服务中心电话：400-698-8888（免长话费）或 010-66555662。

泰达宏利基金管理有限公司

2019 年 3 月 27 日