泰达宏利中证500指数分级证券投资基金
2019年半年度报告摘要

2019年6月30日

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2019年8月24日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利500指数分级		
基金主代码	162216		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011年12月1日		
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	200,575,338.65份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2011年12月20日		
下属分级基金的基金简称	泰达500A	泰达500B	泰达500
下属分级基金的交易代码	150053	150054	162216
报告期末下属分级基金份额总额	2,622,284.00份	3,933,426.00份	194,019,628.65份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证500 指数，力争获取与标的指数相似的投资收益，并将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。		
投资策略	本基金采用指数完全复制方法，原则上按照标的指数成分股及权重构建基金的投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整，以达到跟踪和复制指数的目的。但如遇特殊情况（如市场流动性不足、成分股被限制投资等）致使基金无法购得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理的方法进行适当替代，以实现对跟踪误差的有效控制。		
业绩比较基准	95％×中证500 指数收益率+5％×1 年期定期存款利率（税后）		
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。		
下属分级基金的风险收益特征	泰达500A份额具有低风险、收益相对稳定的特征	泰达500B份额具有高风险、高预期收益的特征	-

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰达宏利基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	聂志刚	王永民
	联系电话	010－66577678	010-66594896
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	fcid@bankofchina.com

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

客户服务电话	400-698-8888	95566
传真	010－66577666	010-66594942

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	6,704,758.98
本期利润	33,212,450.57
加权平均基金份额本期利润	0.1616
本期基金份额净值增长率	19.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.4472
期末基金资产净值	174,470,938.00
期末基金份额净值	0.8699

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

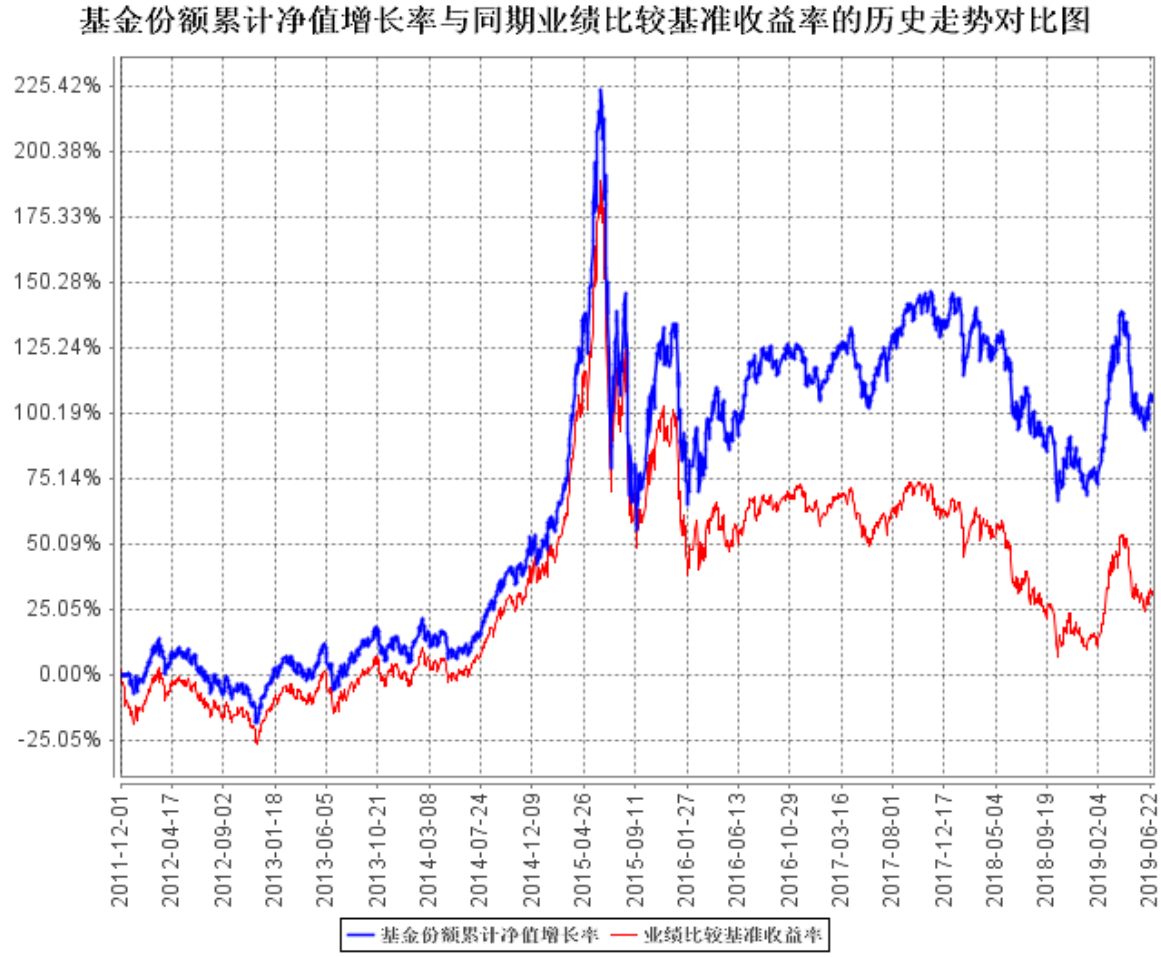
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	2.37%	1.27%	0.76%	1.32%	1.61%	-0.05%
过去三个月	-9.59%	1.67%	-10.19%	1.72%	0.60%	-0.05%
过去六个月	19.56%	1.66%	17.91%	1.70%	1.65%	-0.04%
过去一年	0.46%	1.59%	-4.64%	1.60%	5.10%	-0.01%
过去三年	-0.95%	1.25%	-17.86%	1.25%	16.91%	0.00%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

自基金合同生效起至今	104.87%	1.70%	30.75%	1.64%	74.12%	0.06%

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

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



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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月，是中国首批合资基金管理公司之一。截至报告期末本公司股东及持股比例分别为：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、

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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、泰达宏利定宏混合型证券投资基金、泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利亚洲债券型证券投资基金、泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利京元宝货币市场基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利溢利债券型证券投资基金、泰达宏利恒利债券型证券投资基金、泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启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）、泰达宏利印度机会股票型证券投资基金（QDII）、泰达宏利年年添利定期开放债券型证券投资基金在内的五十多只证券投资基金。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资团队全体人员的共同努力，力求实现基金财产的持续增值。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘洋	本基金基金经理	2019年1月9日	-	4	北京大学理学硕士；2015年1月至2015年

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

					4 月就职于九坤投资（北京）有限公司，2015 年 5 月加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于金融工程部，先后担任助理研究员、研究员、基金经理助理等职务，现担任基金经理；具备 4 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
李婷婷	本基金经理助理	2019 年 5 月 29 日	-	2	北京大学金融硕士，2017 年 7 月加入泰达宏利基金管理有限公司，曾任助理研究员，现任基金经理助理，具备 2 年基金从业经验，具有基金从业资格。
杨超	本基金基金经理	2014 年 10 月 13 日	2019 年 1 月 22 日	9	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 9 年基金从业经验，9 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度和流程，并严格执行制度的规定。在投资管理活动中，本基金管理人公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会；严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离；在交易环节实行集中交易制度，并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数量统计、分析。在本报告期内，未发现利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在去杠杆思路逐步弱化，流动性与信用环境受到政策呵护，社融与信贷增速等超预期，外部环境缓和等背景下，叠加A股估值在2018年末已经处于历史相对低位，2019年一季度市场出现了一波凌厉的估值与情绪修复带来的涨势。随之而来的二季度部分资金短期获利兑现，且贸易摩擦在5月份突然升温，市场快速回调并震荡，估值回到相对合理的位置。交易情绪与风险偏好也显现出前高后低的特点，一季度弹性较大与成长性的板块涨幅居前，二季度业绩确定性更强的大消费板块更受青睐。纵观上半年，食品饮料与农业最为强势，而通信、电子、计算机、有色、化工等行业随市场环境变化都有阶段性表现。

本基金在操作中恪守基金合同，采用量化风险模型严格控制跟踪误差及成分股权重，控制行业与风格暴露等其他风险属性。持仓严格控制个股相对权重，仓位合理稳定。本报告期内，本基金增加了通信、非银行金融、有色金属的配置，减少了电力及公用事业、机械、传媒的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.8699元；本报告期基金份额净值增长率为19.56%，业

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

绩比较基准收益率为17.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，目前松紧适中的流动性政策环境料将持续，大规模减税降费或将继续拉动消费增速的提升，从而带动经济企稳。全球降息预期升温，人民币汇率担忧或能解除，贸易摩擦后续或有缓和空间带来的市场情绪提升。陆股通北向等市场增量资金已经出现一定程度的回流，市场在二季度的回调使得A股在估值上仍然具有较好的性价比。我们维持中长期看好A股上升趋势的观点不变，长期配置价值仍然显著。从盈利质量、增速确定性与减税降费政策加持的角度，我们继续看好消费、金融、医疗等绩优蓝筹股，尤其是受益于科创板与再融资等政策红利的券商板块；景气度周期性改善叠加估值低位的汽车、地产等周期性行业或有一定表现机会；而5G商业化落地、科创板估值映射、自主替代趋势以及资产重组新规对于科技成长板块有不可忽视的提振作用。总体来看在大盘蓝筹与新兴成长领域或均有结构性配置机会。外部风险方面，仍然需要关注中美贸易摩擦的进展程度，地缘政治风险，以及全球进入降息区间预示的经济下行趋势对于全球配置资金风险偏好的影响。另外持续关注经济先行指标与企业盈利增速企稳回升的节奏。

本基金将继续在投资中严格遵守基金合同，严控组合相对基准的跟踪误差与个股权重偏离，同时合理控制组合在行业与风格上的偏离程度。仓位保持与基准一致。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰达宏利中证500指数分级证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利中证500指数分级证券投资基金

报告截止日： 2019年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产：		
银行存款	9,527,301.65	9,612,293.51
结算备付金	1,247,022.35	424,413.43
存出保证金	27,332.86	43,531.08

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

交易性金融资产	164,304,220.10	158,912,256.95
其中：股票投资	164,304,220.10	158,841,739.45
基金投资	-	-
债券投资	-	70,517.50
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	2,197.29	2,243.77
应收股利	-	-
应收申购款	311,522.72	171,998.82
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	175,419,596.97	169,166,737.56
负债和所有者权益	**本期末 2019年6月30日**	**上年度末 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	293,807.37	9,456.48
应付管理人报酬	139,563.27	147,013.01
应付托管费	27,912.65	29,402.61
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	357,119.90	213,054.16
应交税费	-	0.69
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	130,255.78	224,553.13
负债合计	948,658.97	623,480.08
所有者权益：		
实收基金	84,776,160.05	97,931,797.25
未分配利润	89,694,777.95	70,611,460.23
所有者权益合计	174,470,938.00	168,543,257.48
负债和所有者权益总计	175,419,596.97	169,166,737.56

注：报告截止日2019年06月30日，中证500份额净值0.8699元，泰达500A份额净值1.0245元，泰达500B份额净值0.7668元；基金份额总额200,575,338.65份，其中中证500份额194,019,628.65份，泰达500A份额2,622,284.00份，泰达500B份额3,933,426.00份。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利中证500指数分级证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	35,668,367.33	-38,499,810.62
1.利息收入	43,154.07	71,747.08
其中：存款利息收入	43,074.06	71,747.08
债券利息收入	80.01	-
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）	9,017,135.71	-11,928,506.92
其中：股票投资收益	7,688,334.19	-14,194,514.02
基金投资收益	-	-
债券投资收益	15,273.74	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,313,527.78	2,266,007.10
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	26,507,691.59	-26,776,350.80
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	100,385.96	133,300.02
减：二、费用	2,455,916.76	3,684,425.44
1．管理人报酬	876,115.41	1,525,789.10
2．托管费	175,223.11	305,157.86
3．销售服务费	-	-
4．交易费用	1,253,841.70	1,671,421.42
5．利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6．税金及附加	0.33	-
7．其他费用	150,736.21	182,057.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	33,212,450.57	-42,184,236.06
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	33,212,450.57	-42,184,236.06

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利中证500指数分级证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	97,931,797.25	70,611,460.23	168,543,257.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	33,212,450.57	33,212,450.57
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）	-13,155,637.20	-14,129,132.85	-27,284,770.05
其中：1.基金申购款	25,559,305.20	27,859,082.15	53,418,387.35
2.基金赎回款	-38,714,942.40	-41,988,215.00	-80,703,157.40
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	84,776,160.05	89,694,777.95	174,470,938.00
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	124,576,495.31	172,632,846.85	297,209,342.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-42,184,236.06	-42,184,236.06
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）	-4,393,666.83	-4,480,869.89	-8,874,536.72
其中：1.基金申购款	59,213,656.63	76,547,038.31	135,760,694.94
2.基金赎回款	-63,607,323.46	-81,027,908.20	-144,635,231.66
四、本期向基金份额持有	-	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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）	120,182,828.48	125,967,740.90	246,150,569.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘建	傅国庆	王泉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰达宏利中证500指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第1338号《关于核准泰达宏利中证500指数分级证券投资基金募集的批复》核准，由泰达宏利基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,435,113,080.87元，业经普华永道中天会计师事务所普华永道中天验字(2011)第466号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金合同》于2011年12月1日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,435,467,765.48份基金份额，其中认购资金利息折合354,684.61份基金份额。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金合同》和《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金的基金份额包括泰达宏利中证500指数分级证券投资基金之基础份额(简称“泰达中证500份额”)、泰达宏利中证500指数分级证券投资基金之稳健收益类份额与泰达宏利中证500指数分级证券投资基金之进取收益类份额。根据本基金管理人2015年6月25日发布的《关于泰达宏利中证500指数分级证券投资基金变更场内基金简称的公告》，本基金自2015年6月26日起变更子份额的场内简称，泰达中证500之泰达稳健份额的简称由泰达稳健份额变更为泰达500A份额，泰达中证500之泰达进取份额的简称由泰达进取份额变更为泰达500B份额。其中，泰达500A份额、泰达500B份额的基金份额配比始终保持4:6的比率不变。本基金通过场外、场内两种方式公开发售。本基金发售结束后，投资者场外认购的全部份额将确认为泰达中证500份额；投资者场内认购的全部将按4:6的比率自动分离为预

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

期收益与风险不同的两种份额类别，即泰达500A份额和泰达500B份额。两类基金份额的基金资产合并运作。泰达中证500份额只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。泰达500A份额和泰达500B份额只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。本基金在每个工作日按基金合同约定的净值计算规则对泰达500A份额和泰达500B份额分别进行参考净值计算，本基金净资产优先确保泰达500A份额的本金及泰达500A份额累计约定日应得收益；本基金在优先确保泰达500A份额的本金及累计约定日应得收益后的剩余净资产计为泰达500B份额的净资产。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2011]第 379 号文审核同意，本基金泰达500A份额74,125,804.00份，泰达500B份额111,188,706.00份，于2011年12月22日在深交所挂牌交易。未上市交易的泰达中证500份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后，选择将泰达中证500份额拆分为泰达500A份额和泰达500B份额后即可上市流通。

在泰达500A份额、泰达中证500份额存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日，本基金将根据基金合同的规定进行基金的定期份额折算。在基金份额折算前与折算后，泰达500A份额和泰达500B份额的份额配比保持4:6的比例。对于泰达500A份额期末的约定应得收益，即泰达500A份额每个会计年度12月31日份额参考净值超出1.0000元部分，将折算为泰达中证500份额的场内份额分配给泰达500A份额持有人。除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行不定期份额折算，即：当泰达中证500份额净值大于或等于2.0000元；当泰达500B份额的基金份额参考净值小于或等于0.2500元。当泰达中证500份额的基金份额净值大于或等于2.0000元后，本基金将分别对泰达500A份额、泰达500B份额和泰达中证500份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰达500A份额和泰达500B份额的比例为4:6，份额折算后泰达500A份额和泰达500B份额的参考净值以及泰达中证500份额的基金份额净值均调整为1.0000元。当泰达500B份额的基金份额参考净值小于或等于0.2500元后，本基金将分别对泰达500A份额、泰达500B份额和泰达中证500份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰达500A份额和泰达500B份额的比例为4:6，份额折算后泰达中证500份额净值、泰达500A份额和泰达500B份额的基金份额参考净值均调整为1.0000元。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本金的投资目标是紧密跟踪中证500指数，力争获取与标的指数相似的投资收益。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成分股、新股、固定收益产品、货币市场工具、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)占基

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

金资产的比例为85%-100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%，投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：95%×中证500指数收益率+5%×1年期定期存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况以及2019年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期内本基金无会计政策的变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计的变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内本基金无重大会计差错发生。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.7 关联方关系

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

本基金本报告期没有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	876,115.41	1,525,789.10
其中：支付销售机构的客户维护费	219,580.05	169,495.15

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

注：支付基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.0%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值X1.0% / 当年天数。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	175,223.11	305,157.86

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.2% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

6.4.8.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	9,527,301.65	37,405.03	14,363,464.14	61,244.73

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	164,304,220.10	93.66
	其中：股票	164,304,220.10	93.66
2	基金投资	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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	10,774,324.00	6.14
8	其他各项资产	341,052.87	0.19
9	合计	175,419,596.97	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,379,940.00	0.79
B	采矿业	6,046,617.60	3.47
C	制造业	79,243,104.97	45.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	975,158.60	0.56
E	建筑业	2,193,988.00	1.26
F	批发和零售业	9,990,151.28	5.73
G	交通运输、仓储和邮政业	6,109,282.00	3.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,866,425.50	7.37
J	金融业	8,819,157.00	5.05
K	房地产业	8,382,801.60	4.80
L	租赁和商务服务业	2,653,853.00	1.52
M	科学研究和技术服务业	1,711,959.00	0.98
N	水利、环境和公共设施管理业	157,849.20	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	852,396.00	0.49
R	文化、体育和娱乐业	4,440,442.27	2.55
S	综合	3,779,775.00	2.17
	合计	149,602,901.02	85.75

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

B	采矿业	102,318.10	0.06
C	制造业	10,115,485.68	5.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,287,492.00	1.31
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	882,163.76	0.51
J	金融业	33,869.94	0.02
K	房地产业	809,438.00	0.46
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	-	-
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	470,551.60	0.27
S	综合	-	-
	合计	14,701,319.08	8.43

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002195	二三四五	1,081,070	4,205,362.30	2.41
2	600673	东阳光	481,500	3,779,775.00	2.17
3	000686	东北证券	427,100	3,762,751.00	2.16
4	600466	蓝光发展	594,080	3,695,177.60	2.12
5	600388	龙净环保	278,700	3,453,093.00	1.98
6	600699	均胜电子	156,200	3,336,432.00	1.91
7	600755	厦门国贸	348,756	3,009,764.28	1.73
8	600073	上海梅林	308,400	2,837,280.00	1.63
9	002465	海格通信	294,800	2,812,392.00	1.61
10	603369	今世缘	100,100	2,791,789.00	1.60

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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

7.3.2 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前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600655	豫园股份	181,800	1,488,942.00	0.85
2	600887	伊利股份	39,500	1,319,695.00	0.76
3	002236	大华股份	80,100	1,163,052.00	0.67
4	002611	东方精工	234,900	904,365.00	0.52
5	603169	兰石重装	121,800	884,268.00	0.51

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002195	二三四五	5,592,611.50	3.32
2	600673	东阳光	4,589,942.00	2.72
3	600699	均胜电子	4,560,430.89	2.71
4	000656	金科股份	4,067,667.60	2.41
5	600073	上海梅林	4,055,606.00	2.41
6	002416	爱施德	3,780,525.60	2.24
7	000686	东北证券	3,766,558.00	2.23
8	600466	蓝光发展	3,733,793.86	2.22
9	600655	豫园股份	3,606,140.20	2.14
10	002589	瑞康医药	3,481,876.67	2.07
11	603369	今世缘	3,034,234.08	1.80
12	601958	金钼股份	3,024,830.50	1.79
13	300146	汤臣倍健	3,009,386.70	1.79
14	600373	中文传媒	2,932,734.20	1.74
15	600536	中国软件	2,912,946.00	1.73
16	600985	淮北矿业	2,908,531.78	1.73
17	000829	天音控股	2,907,080.00	1.72
18	600755	厦门国贸	2,897,557.92	1.72
19	002250	联化科技	2,796,865.00	1.66

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

20	600848	上海临港	2,790,032.00	1.66

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000656	金科股份	5,654,195.00	3.35
2	600053	九鼎投资	4,157,516.30	2.47
3	300010	立思辰	4,142,088.75	2.46
4	000078	海王生物	3,984,258.00	2.36
5	002400	省广集团	3,962,162.00	2.35
6	002589	瑞康医药	3,929,385.00	2.33
7	000887	中鼎股份	3,618,778.74	2.15
8	603000	人民网	3,557,612.00	2.11
9	300146	汤臣倍健	3,512,354.00	2.08
10	002373	千方科技	3,460,839.59	2.05
11	600160	巨化股份	3,403,651.30	2.02
12	600657	信达地产	3,375,067.90	2.00
13	600125	铁龙物流	3,330,210.41	1.98
14	000596	古井贡酒	3,321,018.00	1.97
15	002353	杰瑞股份	3,236,082.00	1.92
16	601958	金钼股份	3,164,010.15	1.88
17	002049	紫光国微	3,154,540.00	1.87
18	000009	中国宝安	3,115,393.58	1.85
19	600062	华润双鹤	3,089,536.04	1.83
20	000758	中色股份	3,060,877.62	1.82

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	393,941,146.00
卖出股票收入（成交）总额	422,678,208.63

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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	27,332.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,197.29
5	应收申购款	311,522.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	341,052.87

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
泰达500A	170	15,425.20	35,168.00	1.34%	2,587,116.00	98.66%
泰达500B	459	8,569.56	828.00	0.02%	3,932,598.00	99.98%
泰达中证500	28,123	6,898.97	65,967,154.16	34.00%	128,052,474.49	66.00%
合计	28,752	6,976.05	66,003,150.16	32.91%	134,572,188.49	67.09%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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

8.2 期末上市基金前十名持有人

泰达500A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	秦建德	315,200.00	12.02%
2	高明桂	284,832.00	10.86%
3	胡耀武	173,546.00	6.62%
4	秦春晖	156,300.00	5.96%
5	黄晖	122,044.00	4.65%
6	谭文英	117,800.00	4.49%
7	张晓熊	103,512.00	3.95%
8	刘辉荣	100,000.00	3.81%
9	李惠莲	94,151.00	3.59%
10	陶玲	83,076.00	3.17%

泰达500B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	劳伟杰	163,017.00	4.14%
2	傅新彩	136,280.00	3.47%
3	董晓庄	125,700.00	3.20%
4	张志平	120,000.00	3.05%
5	马超	100,044.00	2.54%
6	田红梅	98,375.00	2.50%
7	尹粤蓉	79,300.00	2.02%
8	孟京	72,559.00	1.84%
9	丁强	60,400.00	1.54%
10	孙慧贤	60,000.00	1.53%

注：持有人为本基金场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	泰达500A	0.00	0.0000%
	泰达500B	0.00	0.0000%
	泰达中证500	64,705.41	0.0333%
	合计	64,705.41	0.0323%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泰达500A	0
	泰达500B	0
	泰达中证500	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达500A	0
	泰达500B	0
	泰达中证500	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达500A	泰达500B	泰达中证500
基金合同生效日（2011年12月1日）基金份额总额	74,125,804.00	111,188,706.00	1,250,153,255.48
本报告期期初基金份额总额	2,818,000.00	4,227,000.00	218,406,095.17
本报告期基金总申购份额	-	-	60,465,171.96
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	91,595,612.55
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-195,716.00	-293,574.00	6,743,974.07
本报告期期末基金份额总额	2,622,284.00	3,933,426.00	194,019,628.65

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

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本公司于2019年1月19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》，王彦杰先生不再担任公司副总经理。

2、2019年5月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管人、基金托管业务的诉讼事项。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1.本报告期内，中国证券监督管理委员会北京监管局对我司进行了常规全面现场检查，就公司未能建立完善的内控监控体系，提出了整改意见并下达了行政监管措施函，公司对此高度重视，立即制定整改计划和整改方案，认真进行整改，排除业务中存在的风险隐患，逐一落实各项整改要求，进一步提升了公司内部控制和风险管理能力。公司已按照要求于2019年4月完成整改工作，并通过了中国证券监督管理委员会北京监管局的检查验收。

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
太平洋	2	182,581,946.01	22.41%	170,041.19	22.41%	-
光大证券	1	173,077,613.60	21.24%	161,201.17	21.24%	-
天风证券	1	144,868,297.25	17.78%	134,916.98	17.78%	-
东吴证券	1	107,811,679.16	13.23%	100,408.80	13.23%	-
东北证券	2	86,351,099.37	10.60%	80,413.46	10.60%	-
长江证券	1	60,559,258.58	7.43%	56,399.51	7.43%	-
银河证券	2	53,807,187.22	6.60%	50,110.85	6.60%	-
国泰君安	1	5,241,337.16	0.64%	4,881.23	0.64%	-
东方证券	4	282,731.27	0.03%	263.30	0.03%	-
广发证券	2	227,127.16	0.03%	211.52	0.03%	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

新时代证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

注：（一）2019年上半年本基金撤销中金公司、安信证券交易单元。

（二）交易单元选择的标准和程序

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

（1）经营规范，有较完备的内控制度；

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要；

（3）能为基金管理人提供高质量的研究咨询服务。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
太平洋	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

天风证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	82,443.50	100.00%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190101~20190630	63,950,986.55	1,772,984.81	0.00	65,723,971.36	32.77%
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。

泰达宏利基金管理有限公司

2019年8月24日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn