

**泰达宏利全能优选混合型基金中基金  
(FOF)  
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**

## § 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 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。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利全能混合（FOF）	
基金主代码	005221	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年11月2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	162,142,900.38份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	泰达宏利全能混合（FOF） A	泰达宏利全能混合（FOF） C
下属分级基金的交易代码：	005221	005222
报告期末下属分级基金的份额总额	147,775,310.34份	14,367,590.04份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要运用风险平价策略对大类资产进行配置，在风险可控的前提下，为投资者创造较高的绝对收益。
投资策略	本基金主要投资于其他公开募集的基金，不参与被投资基金的投资管理。本基金采用自上而下的投资策略，首先基于风险平价的资产配置策略确定各资产的配置方案，然后基于基金优选结果对各基金进行投资，基金经理将定期及不定期对组合投资情况进行业绩归因，适时进行仓位调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×20%+中证商品期货成份指数收益率×10%+中证综合债指数收益率×70%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，为投资者在严控风险的前提下创造较高投资收益为目标。因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险相对较小，而相对其业绩比较基准，由于投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。

### 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	王永民
	联系电话	010-66594896
	电子邮箱	fcid@bankofchina.com
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

基金级别	泰达宏利全能混合（FOF）A	泰达宏利全能混合（FOF）C
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)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	6,322,334.54	544,006.45
本期利润	17,203,714.22	1,479,630.59
加权平均基金份额本期利润	0.0772	0.0731
本期基金份额净值增长率	6.48%	6.31%
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	0.0225	0.0163
期末基金资产净值	152,557,724.03	14,742,495.82
期末基金份额净值	1.0324	1.0261

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

泰达宏利全能混合（FOF）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
过去一个月	1.96%	0.34%	1.81%	0.25%	0.15%	0.09%
过去三个月	0.53%	0.40%	1.12%	0.31%	-0.59%	0.09%
过去六个月	6.48%	0.36%	8.09%	0.32%	-1.61%	0.04%
过去一年	5.00%	0.33%	7.60%	0.31%	-2.60%	0.02%

自基金合同生效起至今	3.24%	0.29%	7.82%	0.28%	-4.58%	0.01%
------------	-------	-------	-------	-------	--------	-------

泰达宏利全能混合（FOF）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	①-③	②-④
过去一个月	1.93%	0.34%	1.81%	0.25%	0.12%	0.09%
过去三个月	0.45%	0.40%	1.12%	0.31%	-0.67%	0.09%
过去六个月	6.31%	0.36%	8.09%	0.32%	-1.78%	0.04%
过去一年	4.68%	0.33%	7.60%	0.31%	-2.92%	0.02%
自基金合同生效起至今	2.61%	0.29%	7.82%	0.28%	-5.21%	0.01%

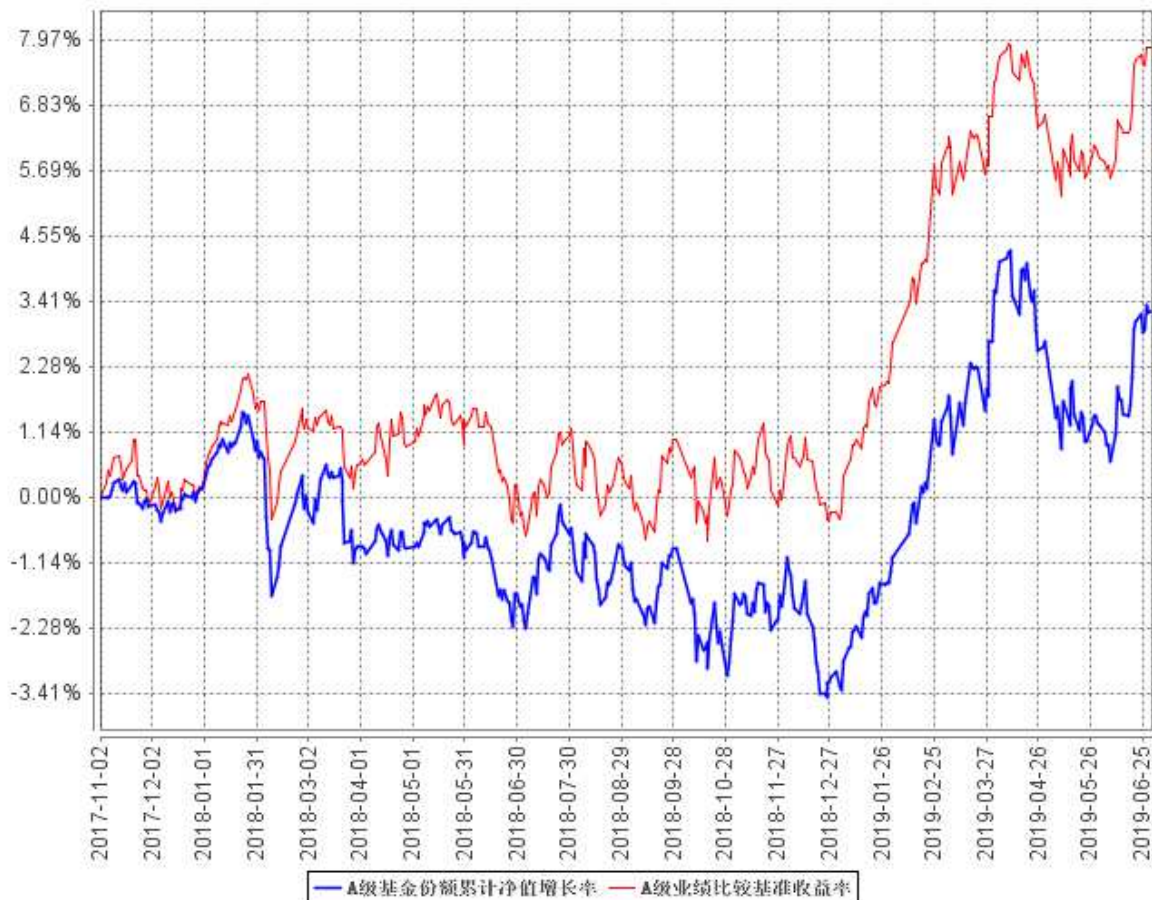
注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×20%+中证商品期货成份指数收益率×10%+中证综合债指数收益率×70%

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，从上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本的综合性指数，具有良好的市场代表性。中证商品期货成份指数从贵金属、农产品、能源化工等商品作为样本，侧重反映商品市场的整体表现。中证综合债券指数由中证指数有限公司编制，是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债等整体走势的跨市场债券指数，较全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准。

本基金是混合型基金中基金，以在严控风险的前提下为投资者创造较高投资收益为管理目标，根据本基金长期资产配置情况，“沪深 300 指数收益率×20%+中证商品期货成份指数收益率×10%+中证综合债指数收益率×70%”是适合衡量本基金投资业绩的比较基准。

### 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



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、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		
张晓龙	本基金基金经理	2017年11月2日	-	6	经济学博士；2013年8月加入泰达宏利基金管理有限公司，历任金融工程部助理研究员、研究员，基金组合部研究员、基金经理；具备6年证券基金从业经验，6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。

## 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。在本报告期内，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

整体上看，全球股票资产在 2019 年上半年均取得了不错的投资收益，据 wind 数据统计，沪深 300 指数上涨 27.07%、恒生指数上涨 10.43%、标普 500 指数上涨 17.35%，一扫去年的熊市阴影；全球的流动性宽松以及经济企稳预期成为股票资产大幅上扬的重要驱动。就国内股债而言，在全球贸易逆自由化、经济不确定性等问题以及金融支持实体的诉求增强，无风险利率的下行以及货币供给的宽松成为投资者关注的大概率事件。

全能优选基金在上半年坚持长期资产配置策略，根据宏观经济金融环境以及市场估值等情况进行有限度的动态调整策略，叠加对全市场的基金进行灵活优选，获得了良好的投资收益。从归因上看，资产配置及基金优选方面均有不同程度的收益贡献。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达宏利全能混合（FOF）A 基金份额净值为 1.0324 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.48%；截至本报告期末泰达宏利全能混合（FOF）C 基金份额净值为 1.0261 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.31%；同期业绩比较基准收益率为 8.09%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

通过过去 1 年多以来的协商、博弈，中美贸易问题不再是短期的影响性事件，投资者充分消化了其长期性、双方危害性。伴随利空因素的相对出尽，在我国财政及货币政策刺激下的经济逐步企稳，A 股企业利润不断改善，投资者风险偏好情绪有望提升。

全球货币宽松的逆周期调节机制有助于降低企业融资成本，在全球经济增速下行的大背景下，为企业的发展提供了良好的金融环境，美股、港股在内的非人民币计价资产都有望迎来短期的正回报期。在美债利率长期下行趋势明朗，逆贸易自由化及民粹主义多发的国际环境中，黄金资产仍具备较高的组合配置价值。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同及基金的实际运作情况，本基金于本报告期内未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰达宏利全能优选混合型基金中基金（FOF）（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：泰达宏利全能优选混合型基金中基金（FOF）

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	11,103,698.09	21,486,378.90
结算备付金	266,003.76	277,272.73
存出保证金	3,599.89	-
交易性金融资产	157,798,828.70	309,489,413.71
其中：股票投资	-	-
基金投资	157,798,828.70	309,489,413.71
债券投资	-	-
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	-	4,000,000.00
应收证券清算款	4,269,354.00	-
应收利息	2,130.78	3,520.53
应收股利	-	-
应收申购款	40,565.20	10,814.85
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	173,484,180.42	335,267,400.72
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2019年6月30日</b>	<b>2018年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	995,927.40
应付赎回款	5,955,337.16	1,353,475.78
应付管理人报酬	100,808.54	211,764.50
应付托管费	24,074.67	42,478.04
应付销售服务费	3,667.06	6,791.70
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	100,073.14	241,305.72
负债合计	6,183,960.57	2,851,743.14
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	162,142,900.38	342,953,347.32
未分配利润	5,157,319.47	-10,537,689.74
所有者权益合计	167,300,219.85	332,415,657.58
负债和所有者权益总计	173,484,180.42	335,267,400.72

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，泰达宏利全能混合（FOF）A 基金份额净值 1.0324 元，基金

份额总额 147,775,310.34 份；泰达宏利全能混合（FOF）C 基金份额净值 1.0261 元，基金份额总额 14,367,590.04 份。泰达宏利全能混合（FOF）份额总额合计为 162,142,900.38 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰达宏利全能优选混合型基金中基金（FOF）

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
<b>一、收入</b>	20,196,540.18	-4,009,753.58
1.利息收入	106,899.56	694,548.60
其中：存款利息收入	65,336.77	554,719.48
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	41,562.79	139,829.12
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	8,269,086.84	2,569,216.38
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	1,103,500.57	-3,002,269.16
债券投资收益	-	-
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	7,165,586.27	5,571,485.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	11,817,003.82	-7,876,800.19
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	3,549.96	603,281.63
<b>减：二、费用</b>	1,513,195.37	3,208,836.49
1. 管理人报酬	881,971.29	1,917,824.69
2. 托管费	194,808.78	456,271.25
3. 销售服务费	30,315.24	82,085.20
4. 交易费用	290,541.58	622,777.59
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	115,558.48	129,877.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”</b>	18,683,344.81	-7,218,590.07

号填列)		
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	18,683,344.81	-7,218,590.07

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利全能优选混合型基金中基金（FOF）

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）	342,953,347.32	-10,537,689.74	332,415,657.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,683,344.81	18,683,344.81
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）	-180,810,446.94	-2,988,335.60	-183,798,782.54
其中：1.基金申购款	2,579,259.96	52,196.47	2,631,456.43
2.基金赎回款	-183,389,706.90	-3,040,532.07	-186,430,238.97
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）	162,142,900.38	5,157,319.47	167,300,219.85
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）	827,166,042.36	1,033,004.25	828,199,046.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	-7,218,590.07	-7,218,590.07

期利润)			
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)	-393,380,694.17	-1,213,043.73	-394,593,737.90
其中：1.基金申购款	6,200,359.55	23,993.79	6,224,353.34
2.基金赎回款	-399,581,053.72	-1,237,037.52	-400,818,091.24
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)	433,785,348.19	-7,398,629.55	426,386,718.64

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>          刘建          </u>	<u>          傅国庆          </u>	<u>          王泉          </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

泰达宏利全能优选混合型基金中基金(FOF)(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[2017]1629号《关于准予泰达宏利全能优选混合型基金中基金(FOF)注册的批复》核准,由泰达宏利基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利全能优选混合型基金中基金(FOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币826,862,137.02元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第937号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利全能优选混合型基金中基金(FOF)基金合同》于2017年11月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为827,166,042.36份基金份额,其中认购资金利息折合303,905.34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《泰达宏利全能优选混合型基金中基金(FOF)基金合同》和《泰达宏利全能优选混合型基金中基金(FOF)招募说明书》并报中国证监会备案,本基金自募集期起根据认购费、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。其中,在投资人认购、申购时收取认购、

申购费，但不再从本类别基金财产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购、申购时不收取认购、申购费，但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，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。投资人可自由选择认购、申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利全能优选混合型基金中基金(FOF)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括经中国证监会依法批准或注册的公开募集的基金份额(含 QDII 基金，但基金中基金除外)，国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金投资于证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票型基金、混合型基金、商品期货基金和股票的资产占基金资产的比例为 0-40%；本基金每个交易日日终应保证不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×20%+中证商品期货成份指数收益率×10%+中证综合债指数收益率×70%。

#### 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》、《泰达宏利全能优选混合型基金中基金(FOF)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相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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 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。

##### 6.4.5.3 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。

#### 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 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	11,103,698.09
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：	11,103,698.09

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
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	155,675,241.56	157,798,828.70	2,123,587.14	
其他		-	-	-
合计	155,675,241.56	157,798,828.70	2,123,587.14	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产和负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末买入返售金融资产无余额。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	2,021.52
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	107.73
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.53
合计	2,130.78

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

### 6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	22.77
预提费用	100,050.37
合计	100,073.14

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰达宏利全能混合（FOF）A		
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	315,829,110.90	315,829,110.90
本期申购	1,531,105.53	1,531,105.53
本期赎回(以“-”号填列)	-169,584,906.09	-169,584,906.09
- 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	147,775,310.34	147,775,310.34

金额单位：人民币元

泰达宏利全能混合（FOF）C		
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	27,124,236.42	27,124,236.42
本期申购	1,048,154.43	1,048,154.43
本期赎回(以“-”号填列)	-13,804,800.81	-13,804,800.81
- 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	14,367,590.04	14,367,590.04

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

泰达宏利全能混合（FOF）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,345,457.13	-8,247,453.40	-9,592,910.53
本期利润	6,322,334.54	10,881,379.68	17,203,714.22
本期基金份额交易产生的变动数	-1,657,558.38	-1,170,831.62	-2,828,390.00
其中：基金申购款	20,087.04	7,264.76	27,351.80
基金赎回款	-1,677,645.42	-1,178,096.38	-2,855,741.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,319,319.03	1,463,094.66	4,782,413.69

单位：人民币元

泰达宏利全能混合（FOF）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-239,022.93	-705,756.28	-944,779.21
本期利润	544,006.45	935,624.14	1,479,630.59
本期基金份额交易产生的变动数	-71,065.42	-88,880.18	-159,945.60
其中：基金申购款	14,595.07	10,249.60	24,844.67
基金赎回款	-85,660.49	-99,129.78	-184,790.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	233,918.10	140,987.68	374,905.78

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	62,640.33
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,689.18
其他	7.26
合计	65,336.77

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无买卖股票差价收入。

### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	206,998,411.37
减：卖出/赎回基金成本总额	205,894,910.80
基金投资收益	1,103,500.57

### 6.4.7.14 债券投资收益

#### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

#### 6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.15 贵金属投资收益

#### 6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

### 6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回贵金属差价收入。

### 6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购贵金属差价收入。

### 6.4.7.16 衍生工具收益

#### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

#### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	-
基金投资产生的股利收益	7,165,586.27
合计	7,165,586.27

### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	11,817,003.82
——股票投资	-
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	11,817,003.82
——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	11,817,003.82

### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,549.96
合计	3,549.96

### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	287.72
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	290,253.86
其中：申购费	-
赎回费	290,253.86
合计	290,541.58

#### 6.4.7.20.1 持有基金产生的费用

单位：人民币元

项目	本期费用 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	56,934.01
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	875,860.94
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	228,515.20

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出。



### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	41,159.40
信息披露费	58,890.97
账户维护费	9,000.00
银行费用	6,508.11
合计	115,558.48

### 6.4.8 关联方关系

#### 6.4.8.1 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。

#### 6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.9.1.1 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。

##### 6.4.9.1.2 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。

##### 6.4.9.1.3 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。

##### 6.4.9.1.4 基金交易

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基金交易。

##### 6.4.9.1.5 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。

### 6.4.9.1.6 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。

### 6.4.9.2 关联方报酬

#### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	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	881,971.29	1,917,824.69
其中：支付销售机构的客户维护费	435,794.93	1,244,086.55

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的0.80%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 × 0.80% / 当年天数。

#### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	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	194,808.78	456,271.25

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0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

#### 6.4.9.2.3 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		
	2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利全能混合（FOF）A	泰达宏利全能混合（FOF）C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	563.21	563.21
中国银行	-	5,030.81	5,030.81

合计	-	5,594.02	5,594.02
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	泰达宏利全能混合（FOF）A	泰达宏利全能混合（FOF）C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	1,300.76	1,300.76
中国银行	-	13,780.58	13,780.58
合计	-	15,081.34	15,081.34

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 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

#### 6.4.9.3 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可比期间均无与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.9.4.1 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。

##### 6.4.9.4.2 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。

#### 6.4.9.5 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	11,103,698.09	62,640.33	22,945,490.94	186,281.28

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

#### 6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

### 6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

#### 6.4.9.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末持有基金管理人泰达宏利基金管理有限公司所管理的基金合计 17,691,753.74 元，占本基金资产净值的比例为 10.57%。

#### 6.4.9.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

单位：人民币元

项目	本期费用
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付管理费 (元)	70,306.74
当期持有基金产生的应支付托管费 (元)	23,435.58

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出。

根据本基金合同的约定，本基金基金财产中投资于本基金管理人管理的其他基金份额的部分不收取管理费，本基金基金财产中投资于本基金托管人托管的其他基金份额的部分不收取托管费。本基金管理人运用本基金财产申购其自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。相关申购费、赎回费由本基金管理人直接减免，相关销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还。

### 6.4.10 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新股或增发而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.10.2 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。

### 6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.10.3.1 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。

#### 6.4.10.3.2 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。

### 6.4.11 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	157,798,828.70	90.96
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	11,369,701.85	6.55
8	其他各项资产	4,315,649.87	2.49
9	合计	173,484,180.42	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票资产。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### **7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

本基金报告期末未持有股票投资。

### **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**

本基金报告期内未进行股票买卖交易。

#### **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**

本基金报告期内未进行股票买卖交易。

#### **7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

本基金报告期内未进行股票买卖交易。

### **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持有权证。

### **7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

#### **7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

#### **7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

在报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

### **7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

#### **7.11.1 本期国债期货投资政策**

在报告期内，本基金未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

#### **7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

### 7.12 本报告期投资基金情况

#### 7.12.1 投资政策及风险说明

本基金采用自上而下的投资策略，首先基于风险平价的资产配置策略确定各资产的配置方案，然后基于基金优选结果对各基金进行投资，基金经理将定期及不定期对组合投资情况进行业绩归因，适时进行仓位调整。

#### 7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	166008	中欧增强回报债券型基金	契约型上市开放式	17,446,806.12	18,905,359.11	11.30	否
2	000015	华夏纯债债券A	契约型开放式	14,664,118.59	17,948,881.15	10.73	否
3	000319	泰达宏利淘利债券A	契约型开放式	16,307,266.79	17,691,753.74	10.57	是
4	110037	易方达纯债A	契约型开放式	14,596,276.86	16,727,333.28	10.00	否
5	000206	易方达投资级信用债债券C	契约型开放式	14,134,318.15	16,098,988.37	9.62	否
6	531021	建信纯债C	契约型开放式	6,968,281.48	9,191,163.27	5.49	否
7	110003	易基50指数	契约型开放式	4,089,313.13	6,991,907.59	4.18	否
8	040008	华安策略优选混合	契约型开放式	3,485,574.73	6,144,371.13	3.67	否
9	100038	富国量化沪深300	契约型开放式	3,496,814.37	6,122,921.96	3.66	否
10	519069	汇添富价值精选A	契约型开放式	2,432,072.05	5,963,440.67	3.56	否

## 7.13 投资组合报告附注

### 7.13.1 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。

### 7.13.2 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。

### 7.13.3 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	3,599.89
2	应收证券清算款	4,269,354.00
3	应收股利	-
4	应收利息	2,130.78
5	应收申购款	40,565.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,315,649.87

### 7.13.4 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。

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末未持有股票投资。

### 7.13.6 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
泰达宏利全能	6,964	21,219.89	0.03	0.00%	147,775,310.31	100.00%



混合 (FOF)A						
泰达宏利全能混合 (FOF)C	1,506	9,540.23	0.00	0.00%	14,367,590.04	100.00%
合计	8,470	19,143.20	0.03	0.00%	162,142,900.35	100.00%

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	泰达宏利全能混合（FOF）A	113,254.22	0.0766%
	泰达宏利全能混合（FOF）C	178,875.74	1.2450%
	合计	292,129.96	0.1802%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	泰达宏利全能混合（FOF）A	0~10
	泰达宏利全能混合（FOF）C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达宏利全能混合（FOF）A	0
	泰达宏利全能混合（FOF）C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达宏利全能混合（FOF）A	泰达宏利全能混合（FOF）C

基金合同生效日（2017 年 11 月 2 日）基金份额总额	631, 556, 514. 24	195, 609, 528. 12
本报告期期初基金份额总额	315, 829, 110. 90	27, 124, 236. 42
本报告期基金总申购份额	1, 531, 105. 53	1, 048, 154. 43
减：本报告期基金总赎回份额	169, 584, 906. 09	13, 804, 800. 81
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	147, 775, 310. 34	14, 367, 590. 04

## § 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

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
安信证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：（一）2019年上半年本基金无新增和撤销交易单元。

（二）交易单元选择的标准和程序

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

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	3,350,375.80	54.76%
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国	-	-	329,300,000.00	100.00%	-	-	2,768,000.00	45.24%

---

际								
---	--	--	--	--	--	--	--	--

泰达宏利基金管理有限公司

2019 年 8 月 24 日