泰达宏利中证500指数增强型证券投资基金（LOF）（原泰达宏利中证500指数分级证券投资基金）
2019年第4季度报告

2019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

报告送出日期：2020年1月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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 2020 年 1 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期间为 2019 年 10 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日。

§2 基金产品概况

转型后：

基金简称	泰达宏利 500 指数增强（LOF）
场内简称	泰达 500
交易代码	162216
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2019 年 11 月 6 日
报告期末基金份额总额	262,207,561.12 份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对中证 500 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	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。

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

转型前：

基金简称	泰达宏利 500 指数分级		
场内简称	泰达 500		
交易代码	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		
报告期末基金份额总额	283,184,730.54 份		
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。		
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		
下属分级基金的基金简称	泰达 500A	泰达 500B	泰达中证 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的份额总额	2,510,512.00 份	3,765,768.00 份	276,908,450.54 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019 年 11 月 6 日 － 2019 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	4,940,419.63
2.本期利润	15,746,424.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.0570

4.期末基金资产净值	263,543,940.99
5.期末基金份额净值	1.0051

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（ 2019 年 10 月 1 日 － 2019 年 11 月 5 日 ）
1.本期已实现收益	875,431.87
2.本期利润	4,546,312.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.0164
4.期末基金资产净值	268,144,264.47
5.期末基金份额净值	0.9469

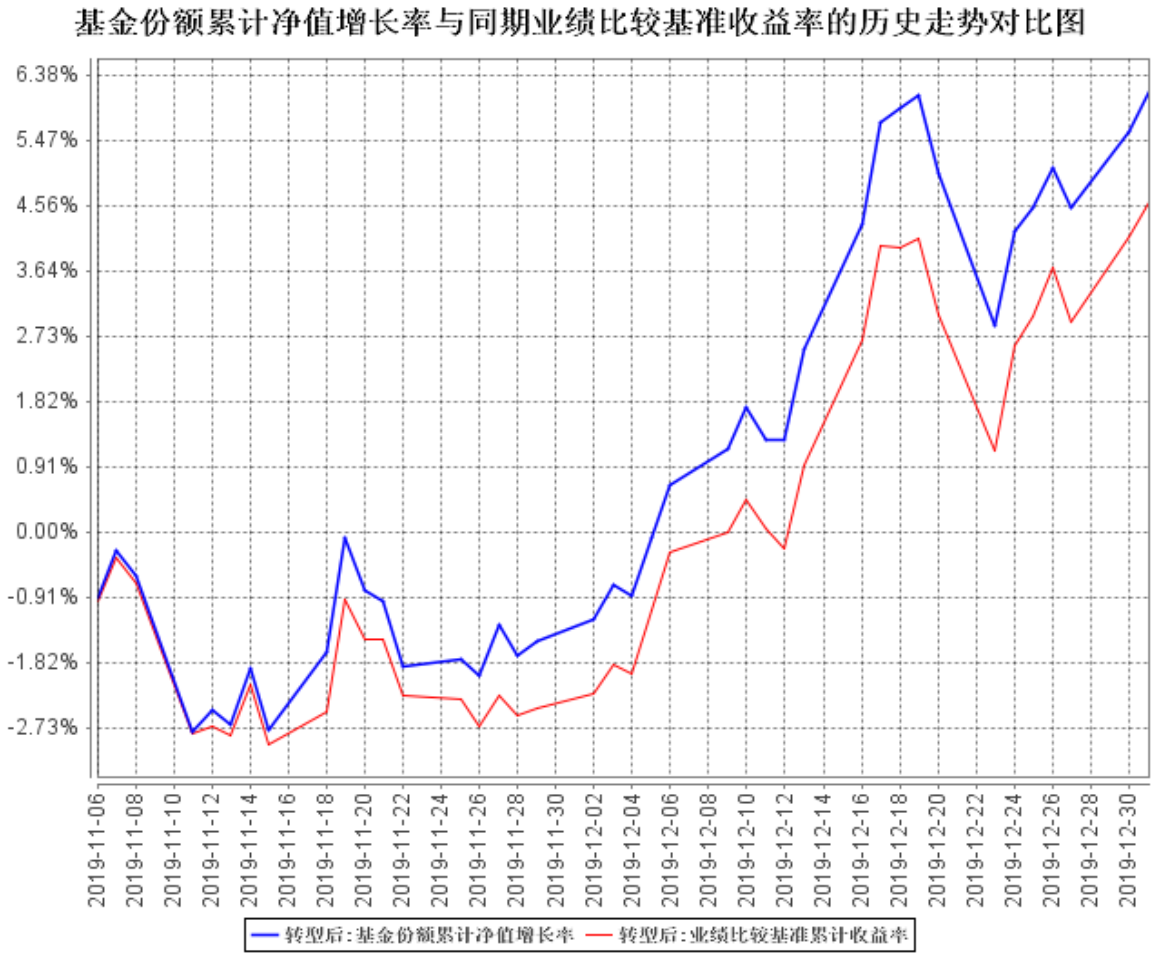
3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	6.15%	0.88%	4.60%	0.85%	1.55%	0.03%

注：本基金的业绩比较基准：中证 500 指数收益率*95%+1 年期定期存款利率(税后)*5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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：本基金于 2019 年 11 月 6 日转型，截止报告期末本基金仍在建仓期。

3.2 基金净值表现（转型前）

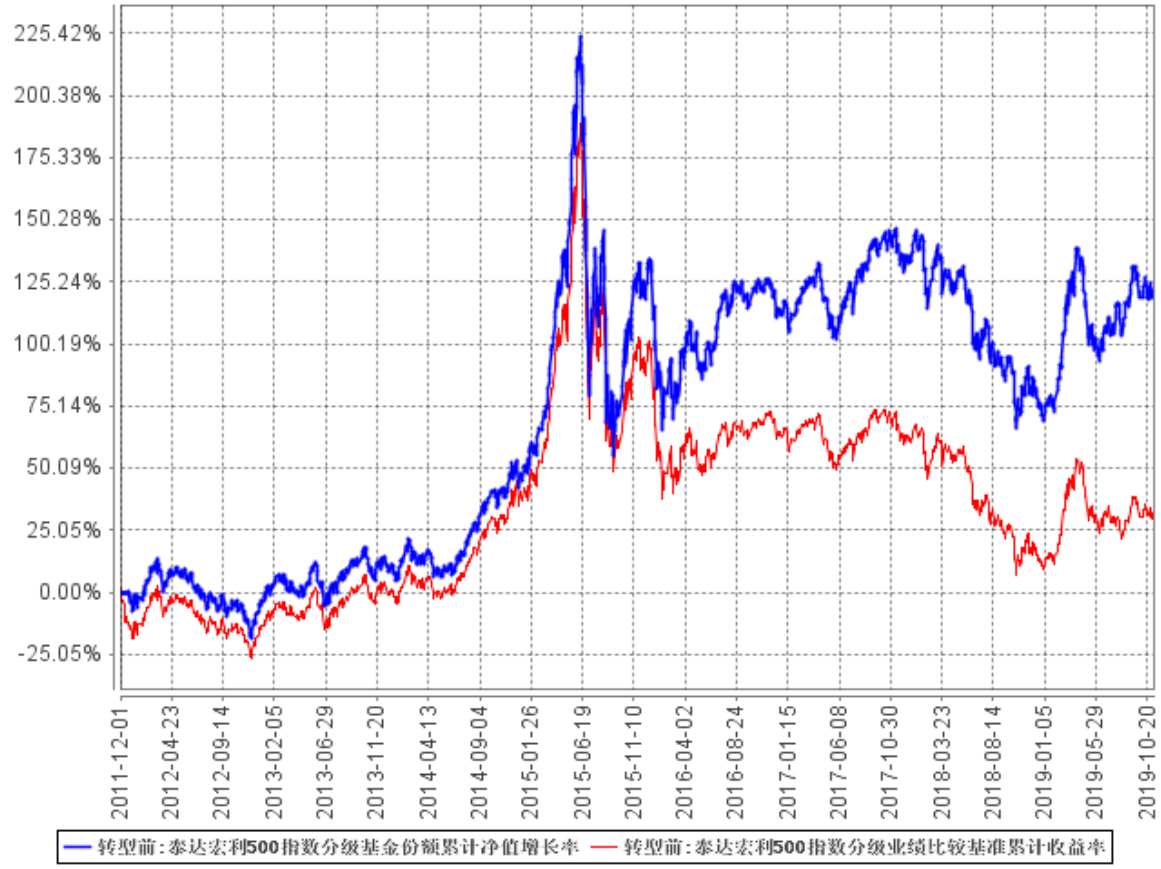
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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	1.73%	0.95%	1.63%	0.94%	0.10%	0.01%

注：本基金的业绩比较基准：中证 500 指数收益率*95%+1 年期定期存款利率(税后)*5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

泰达宏利500指数分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转型日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 基金经理（或基金经理小组）简介 （转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘洋	基金经理	2019 年 1 月 9 日	2019 年 11 月 5 日	4	北京大学理学硕士；2015 年 1 月至 2015 年 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。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 （转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘洋	基金经理	2019 年 11 月 6 日	-	4	北京大学理学硕士；2015 年 1 月至 2015 年 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。 基金经理
刘欣	投资副总监；基金经理	2019 年 11 月 20 日	-	12	清华大学理学硕士；2007 年 7 月至 2008 年 12 月就职于工银瑞信基金管理有限公司；2008 年 12 月至 2011 年 7 月就职于嘉实基金管理有限公司；2011 年 7 月加盟泰达宏利基金管理有限公司，曾担任产品与金融工程部高级研究员、金融工程部副总经理，金融工程部总经理，现担任公司投资副总监兼基金经理；具备 12 年基金从业经验，12 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度市场在震荡中走强，经历了一个先抑后扬的过程。前两月市场情绪受经济下行压力与 CPI 超预期压制而低迷；进入 12 月以后，在外部环境转暖、流动性合理充裕、制造业 PMI 重回枯荣线以上等宏观环境的支持下，市场交易热度有明显提升。四季度以来前期超跌而具有估值优势的周期类板块涨幅居前，以电子、传媒为代表的成长板块以及大金融板块也有不错表现。市场热点相对前三季度出现一定程度的切换。

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、盈利增速稳定、估值合理的中盘绩优股票。选股风格偏向长期基本面，较好的控制了持仓换手率与交易成本。持仓结构分散以控制个股风险，仓位保持合理稳定。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型后

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.0051 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.15%，业绩比较基准收益率为 4.60%。

转型前

截至 2019 年 11 月 5 日，本基金份额净值为 0.9469 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.73%，业绩比较基准收益率为 1.63%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

转型后：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	248,101,107.75	93.24
	其中：股票	248,101,107.75	93.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,011,284.00	4.89
	其中：债券	13,011,284.00	4.89
	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	1,780,965.84	0.67
8	其他资产	3,189,639.72	1.20
9	合计	266,082,997.31	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	5,497,373.00	2.09

C	制造业	127,390,888.85	48.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,655,008.00	1.01
E	建筑业	706,758.00	0.27
F	批发和零售业	15,171,934.05	5.76
G	交通运输、仓储和邮政业	6,451,753.00	2.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,285,473.72	7.70
J	金融业	11,995,598.00	4.55
K	房地产业	11,925,748.31	4.53
L	租赁和商务服务业	9,305,300.00	3.53
M	科学研究和技术服务业	1,641,857.00	0.62
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	2,294,656.00	0.87
R	文化、体育和娱乐业	8,408,402.00	3.19
S	综合	2,205,696.00	0.84
	合计	225,936,445.93	85.73

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	采掘业	-	-
C	制造业	15,537,010.39	5.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,520,217.00	0.96
F	批发和零售业	336,226.00	0.13
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	3,475,775.35	1.32
J	金融业	-	-
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	288,855.04	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
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	22,164,661.82	8.41

5.2.3 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。

5.3 报告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

5.3.1 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002353	杰瑞股份	159,954	5,911,899.84	2.24
2	600729	重庆百货	166,053	4,956,682.05	1.88
3	601966	玲珑轮胎	214,500	4,918,485.00	1.87
4	002180	纳思达	134,968	4,443,146.56	1.69
5	000988	华工科技	208,600	4,232,494.00	1.61
6	000401	冀东水泥	243,729	4,145,830.29	1.57
7	000807	云铝股份	756,400	3,887,896.00	1.48
8	300207	欣旺达	195,800	3,822,016.00	1.45
9	002384	东山精密	159,300	3,687,795.00	1.40
10	601098	中南传媒	299,700	3,578,418.00	1.36

5.3.2 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603501	韦尔股份	20,500	2,939,700.00	1.12
2	600846	同济科技	270,700	2,520,217.00	0.96
3	300129	泰胜风能	250,300	1,216,458.00	0.46
4	000973	佛塑科技	253,300	1,175,312.00	0.45
5	688018	乐鑫科技	6,264	1,026,168.48	0.39

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	13,011,284.00	4.94
	其中：政策性金融债	13,011,284.00	4.94
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,011,284.00	4.94

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	108602	国开 1704	92,300	9,283,534.00	3.52
2	018007	国开 1801	37,000	3,727,750.00	1.41

注：以上为本基金本报告期末持有的全部债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金没有投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	33,172.31
2	应收证券清算款	2,131,472.61
3	应收股利	-
4	应收利息	309,048.86
5	应收申购款	715,945.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,189,639.72

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688018	乐鑫科技	1,026,168.48	0.39	流通受限

5.11.6 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。

转型前：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	253,566,702.37	93.06
	其中：股票	253,566,702.37	93.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,293,291.00	4.88
	其中：债券	13,293,291.00	4.88
	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	5,326,897.57	1.96
8	其他资产	282,257.65	0.10
9	合计	272,469,148.59	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	1,088,491.00	0.41
B	采矿业	4,444,309.00	1.66
C	制造业	141,626,120.36	52.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,050,021.40	1.88
E	建筑业	3,580,947.00	1.34
F	批发和零售业	10,891,776.02	4.06
G	交通运输、仓储和邮政业	6,236,789.00	2.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,958,605.00	7.44
J	金融业	8,602,161.33	3.21
K	房地产业	13,516,677.55	5.04
L	租赁和商务服务业	2,930,346.00	1.09
M	科学研究和技术服务业	1,710,852.00	0.64
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	2,992,990.00	1.12
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	8,139,608.03	3.04
S	综合	-	-

	合计	230,769,693.69	86.06

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	采掘业	-	-
C	制造业	15,562,531.65	5.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,348,578.00	0.50
F	批发和零售业	1,588,552.00	0.59
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	3,620,465.21	1.35
J	金融业	143,000.00	0.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	134,408.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	399,473.82	0.15
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	22,797,008.68	8.50

5.2.3 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。

5.3 报告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

5.3.1 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000401	冀东水泥	347,129	4,998,657.60	1.86
2	002384	东山精密	186,000	3,930,180.00	1.47
3	603501	韦尔股份	32,900	3,801,595.00	1.42
4	002465	海格通信	381,400	3,703,394.00	1.38
5	600079	人福医药	267,400	3,609,900.00	1.35
6	002157	正邦科技	218,600	3,606,900.00	1.35

7	002353	杰瑞股份	113,354	3,426,691.42	1.28
8	600729	重庆百货	119,053	3,416,821.10	1.27
9	600699	均胜电子	227,776	3,407,528.96	1.27
10	000997	新 大 陆	217,300	3,407,264.00	1.27

5.3.2 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603063	禾望电气	277,300	2,429,148.00	0.91
2	002611	东方精工	500,500	2,422,420.00	0.90
3	600846	同济科技	152,900	1,348,578.00	0.50
4	000973	佛塑科技	310,500	1,276,155.00	0.48
5	000708	中信特钢	58,300	1,191,652.00	0.44

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	13,293,291.00	4.96
	其中：政策性金融债	13,293,291.00	4.96
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,293,291.00	4.96

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	108602	国开 1704	95,300	9,574,791.00	3.57
2	018007	国开 1801	37,000	3,718,500.00	1.39

注：以上为本基金本报告期末持有的全部债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金没有投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	34,091.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	248,165.98
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	282,257.65

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告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的情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（ 2019 年 11 月 6 日 ）基金份额总额	283,184,730.54
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	33,332,738.42
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	54,309,907.84
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）	-
报告期期末基金份额总额	262,207,561.12

§6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	泰达 500A	泰达 500B	泰达中证 500
报告期期初基金份额总额	5,639,856.00	8,459,784.00	267,893,854.75
报告期期间基金总申购份额	-	-	30,004,077.67
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	28,812,840.88

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-3,129,344.00	-4,694,016.00	7,823,359.00
报告期期末基金份额总额	2,510,512.00	3,765,768.00	276,908,450.54

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

本基金的管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

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 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

本基金的管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

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。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20191001~20191231	65,723,971.36	0.00	0.00	65,723,971.36	25.07%
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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据 2019 年 9 月 27 日基金份额持有人大会审议并表决通过的《关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，本基金由“泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金”转型为 “泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）”。自 2019 年 11 月 6 日起，《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》、《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》正式生效,《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》、《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金托管协议》自同一日起失效。

§9 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金设立的文件；

2、中国证监会准予泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金变更注册的批复的文件；

3、《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》；

4、《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）招募说明书》；

5、《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、基金托管人业务资格批件、营业执照；

8、中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

10.3 查阅方式

投资人可登录中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）或者基金管理人互联网网站（http://www.mfcteda.com） 查阅。

泰达宏利基金管理有限公司
2020 年 1 月 20 日