

泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金  
基金（LOF）证券投资基金（原泰达宏利中证  
500 指数分级证券投资基金转型）  
2019 年年度报告

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

送出日期：2020 年 4 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本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 2020 年 4 月 28 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。

泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 由原泰达宏利中证 500 指数分级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 500 指数分级证券投资基金于 2019 年 11 月 6 日转型成泰达宏利中证 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本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 11 月 5 日止，泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 本报告期自 2019 年 11 月 6 日起至 2019 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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.....	8
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现 (转型后) .....	10
3.2 基金净值表现 (转型前) .....	12
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	14
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>15</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
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 .....	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
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 .....	21
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>22</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	22
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 .....	22
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 .....	22
<b>§6 审计报告 (转型后)</b> .....	<b>23</b>
6.1 审计报告基本信息.....	23
6.2 审计报告的基本内容.....	23
<b>§6 审计报告 (转型前)</b> .....	<b>26</b>
6.1 审计报告基本信息.....	26
6.2 审计报告的基本内容.....	26
<b>§7 年度财务报表 (转型后)</b> .....	<b>29</b>
7.1 资产负债表 (转型后) .....	29
7.2 利润表.....	30
7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表.....	31
7.4 报表附注.....	32
<b>§7 年度财务报表 (转型前)</b> .....	<b>54</b>
7.1 资产负债表 (转型前) .....	54

7.2 利润表.....	55
7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表.....	56
7.4 报表附注.....	57
<b>§8 投资组合报告 (转型后) .....</b>	<b>84</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	84
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	84
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 .....	85
8.3 报告期内股票投资组合的重大变动.....	90
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	91
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 .....	92
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 .....	92
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 .....	92
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 .....	92
8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	92
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	92
8.11 投资组合报告附注.....	93
<b>§8 投资组合报告 (转型前) .....</b>	<b>94</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	94
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	94
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 .....	95
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	100
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	104
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 .....	104
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 .....	104
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 .....	104
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 .....	104
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	105
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	105
8.12 投资组合报告附注.....	105
<b>§9 基金份额持有人信息 (转型后) .....</b>	<b>107</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	107
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	107
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	107
9.4 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 .....	107
<b>§9 基金份额持有人信息 (转型前) .....</b>	<b>108</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	108
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	108
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	109
9.4 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 .....	109
<b>§ 10 开放式基金份额变动(转型后).....</b>	<b>110</b>
<b>§ 10 开放式基金份额变动(转型前).....</b>	<b>111</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>112</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	112
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 .....	112
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.....	113
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后).....	113
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前).....	115
11.9 其他重大事件 (转型后).....	118
11.9 其他重大事件 (转型前).....	118
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>119</b>
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.....	119
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	119
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>120</b>
13.1 备查文件目录.....	120
13.2 存放地点.....	120
13.3 查阅方式.....	120

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况 (转型后)

基金名称	泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)
基金简称	泰达宏利 500 指数增强 (LOF)
场内简称	泰达 500
基金主代码	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
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	262,207,561.12 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	2019 年 12 月 5 日

### 2.1 基金基本情况 (转型前)

基金名称	泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金		
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	283,184,730.54 份		
基金合同存续期 (若有)	不定期		
基金份额上市的证券交易所 (若有)	深圳证券交易所		
上市日期 (若有)	2011 年 12 月 20 日		
下属分级基金的基金简称	泰达 500A	泰达 500B	泰达中证 500
下属分级基金的场内简称	-	-	-
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	2,510,512.00 份	3,765,768.00 份	276,908,451.54 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。

## 2.2 基金产品说明 (转型前)

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, 以实现跟踪误差的有效控制。		
业绩比较基准 (若有)	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 (若有)	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	许俊
	联系电话	010-66577678	010-66594319
	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		北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100026	100818
法定代表人		弓劲梅	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	中国证券登记结算有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号



### § 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

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2019 年 11 月 6 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	4,940,419.63
本期利润	15,746,424.04
加权平均基金份额本期利润	0.0570
本期加权平均净值利润率	5.97%
本期基金份额净值增长率	6.15%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2019 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	148,628,691.27
期末可供分配基金份额利润	0.5668
期末基金资产净值	263,543,940.99
期末基金份额净值	1.0051
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2019 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	6.15%

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。

转型前

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 11 月 5 日	2018 年	2017 年
本期已实现收益	20,026,874.57	-47,193,520.09	22,630,906.09
本期利润	52,541,767.96	-73,189,730.48	29,130,937.26
加权平均基金份额本期利润	0.2295	-0.2772	0.1066
本期加权平均净值利润率	25.75%	-30.05%	10.59%
本期基金份额净值增长率	30.14%	-27.84%	11.95%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2019 年 11 月 5 日	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	148,452,530.62	70,611,460.23	172,632,846.85
期末可供分配基金份额利润	0.5242	0.3132	0.6134
期末基金资产净值	268,144,264.47	168,543,257.48	297,209,342.16
期末基金份额净值	0.9469	0.7476	1.0561
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2019 年 11 月 5 日	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	123.00%	71.36%	137.48%

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。

### 3.2 基金净值表现（转型后）

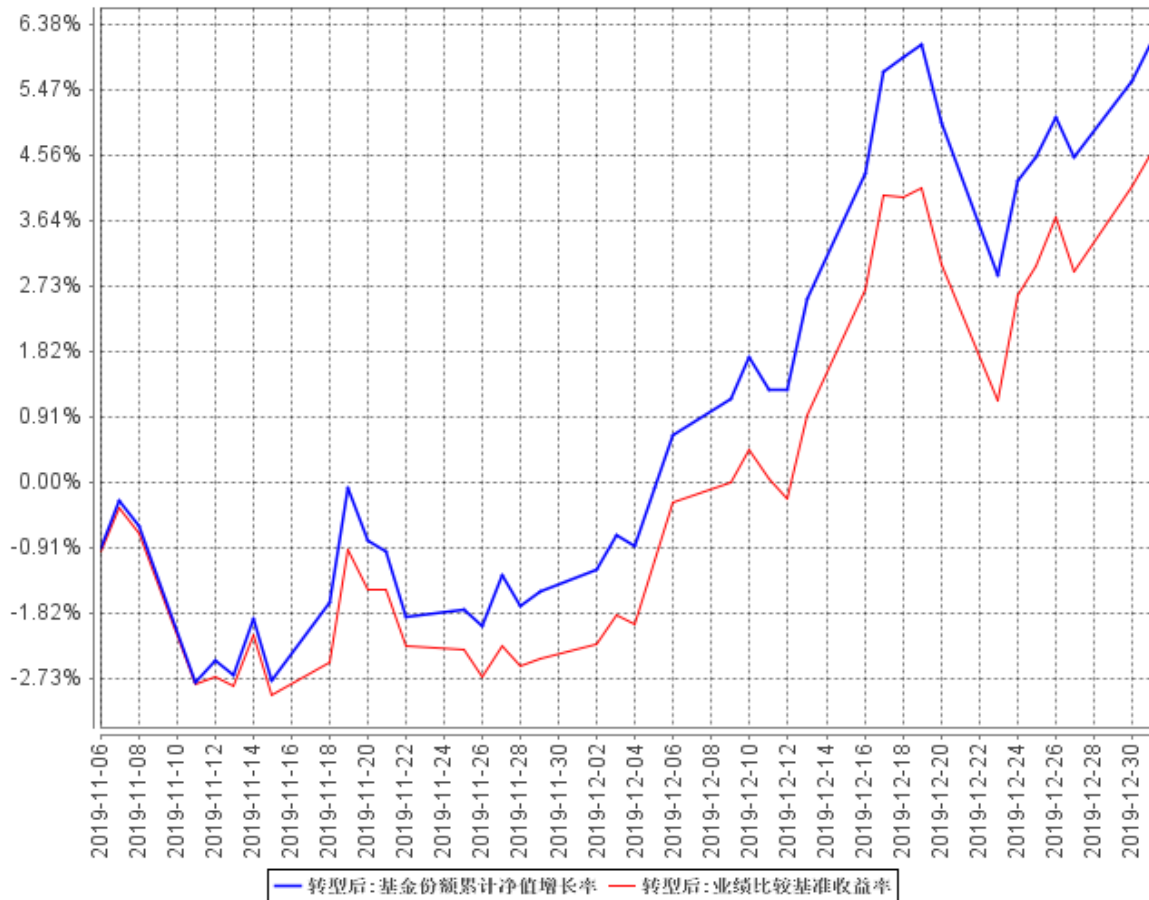
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
自基金合同生效起至今	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

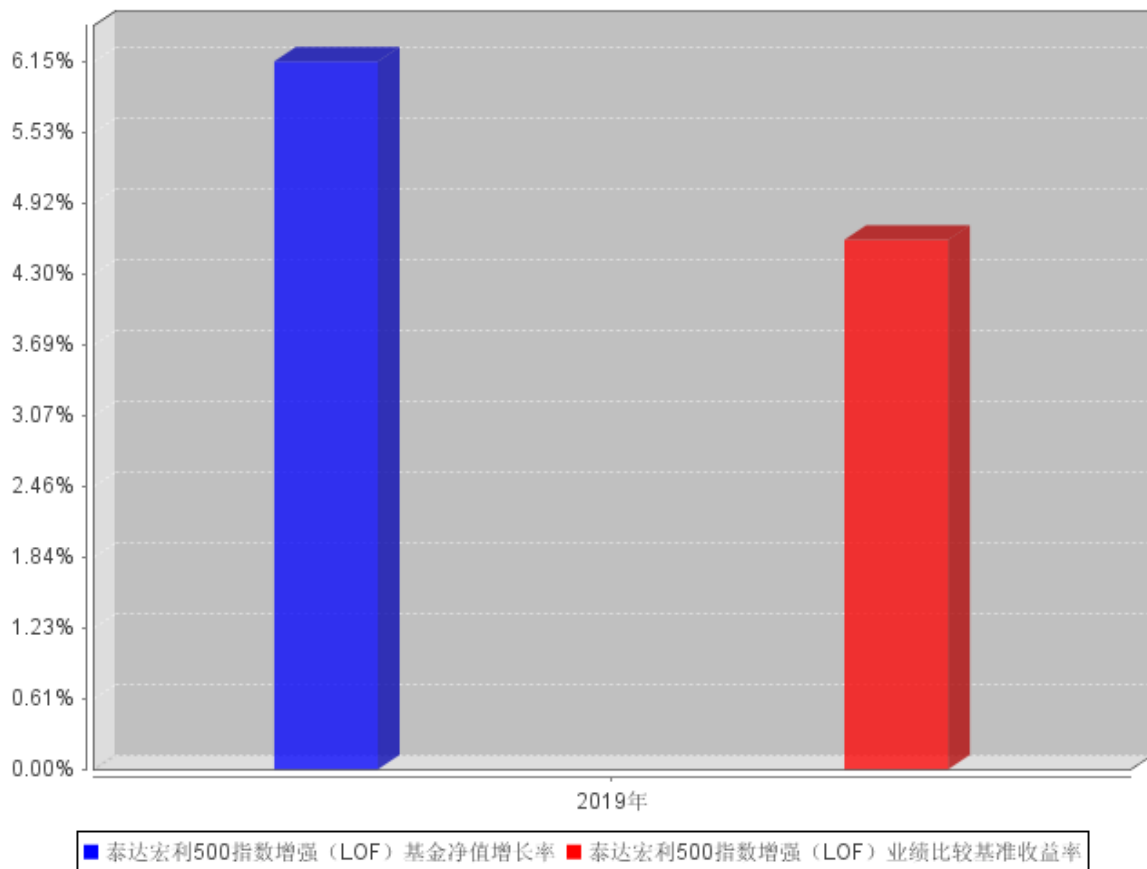
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2019 年 11 月 6 日转型，截止报告期末本基金仍在建仓期。

### 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

泰达宏利500指数增强 (LOF) 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：本基金转型之日为 2019 年 11 月 6 日，2019 年份额净值增长率的计算期间为 2019 年 11 月 6 日至 2019 年 12 月 31 日。

## 3.2 基金净值表现 (转型前)

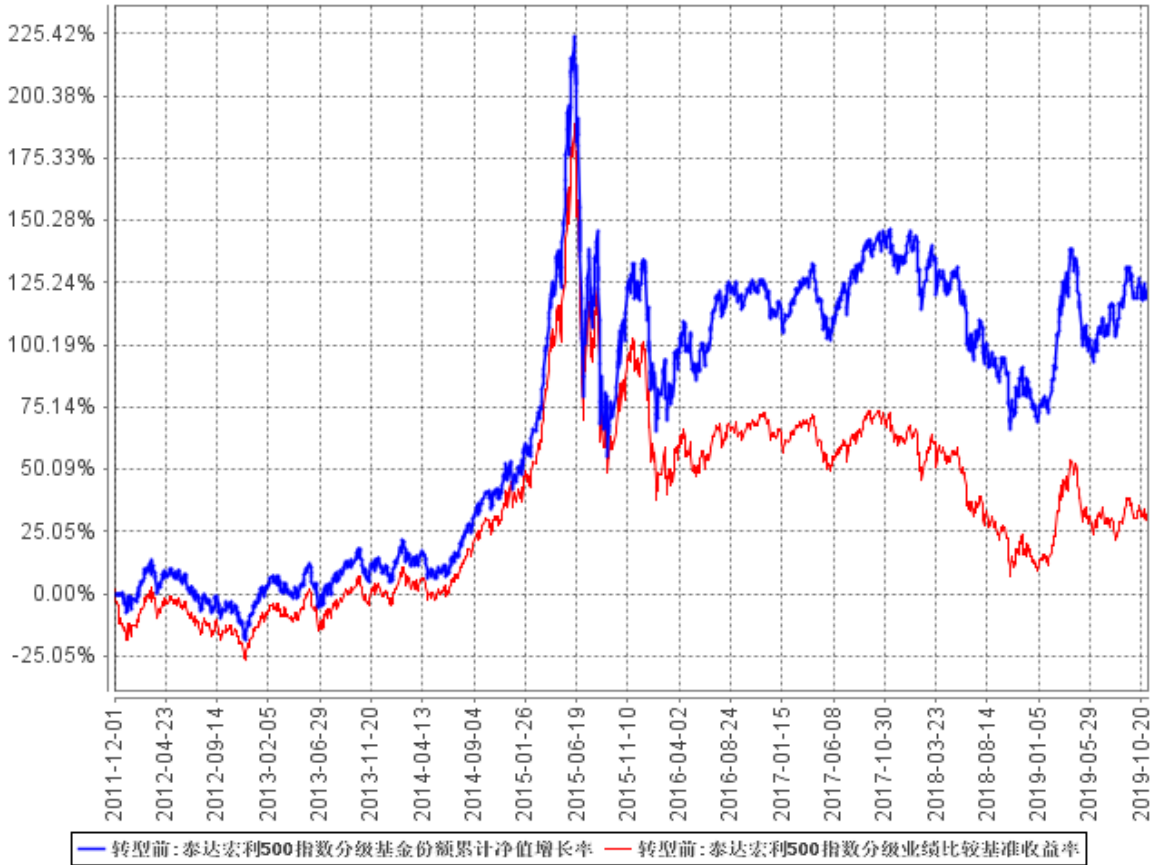
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.73%	0.95%	1.63%	0.94%	0.10%	0.01%
过去六个月	8.85%	1.11%	1.49%	1.10%	7.36%	0.01%
过去一年	30.14%	1.45%	19.66%	1.48%	10.48%	-0.03%
过去三年	5.12%	1.28%	-18.46%	1.28%	23.58%	0.00%
过去五年	52.34%	1.88%	-3.99%	1.77%	56.33%	0.11%
自基金合同生效起至今	123.00%	1.68%	32.69%	1.62%	90.31%	0.06%

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

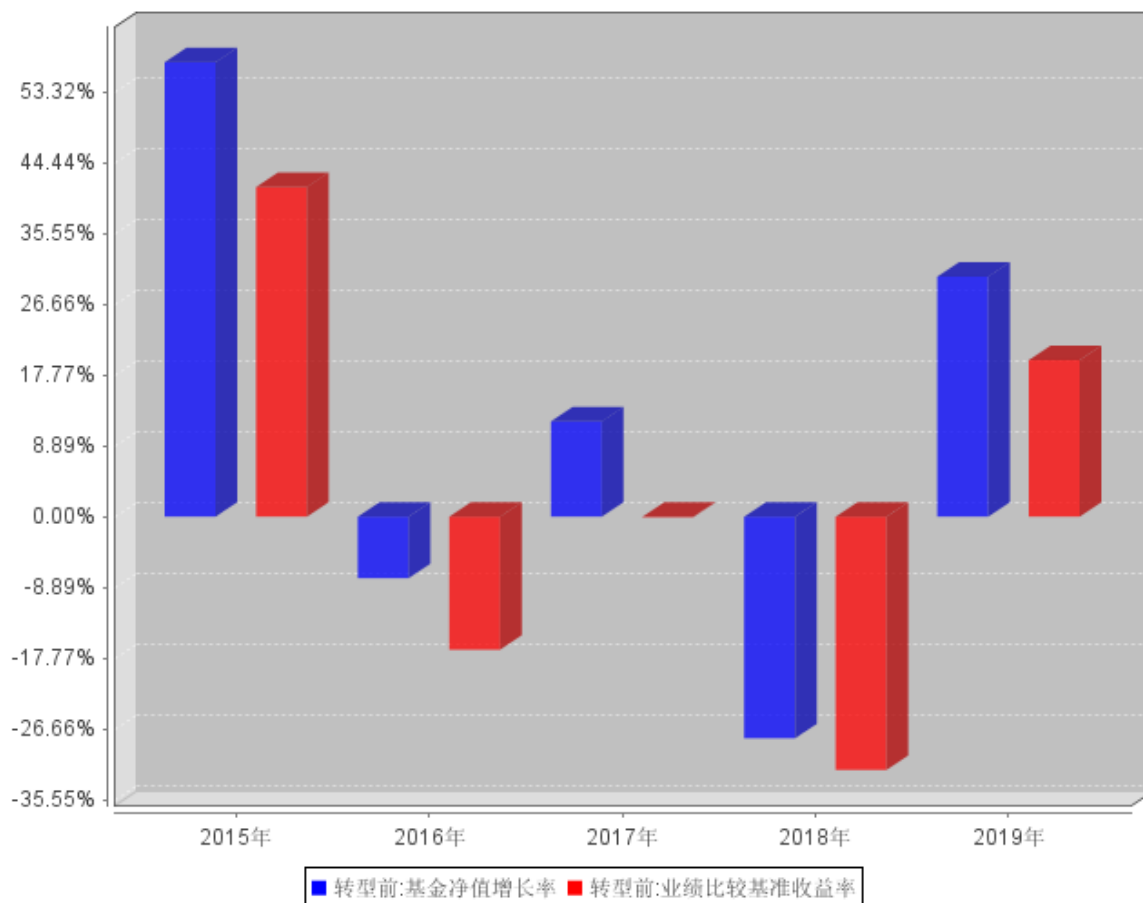
泰达宏利500指数分级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

### 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

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：本基金转型之日为 2019 年 11 月 6 日，2019 年份额净值增长率的计算期间为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 11 月 5 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

#### 转型前

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）不进行收益分配。

#### 转型后

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金自 2019 年 11 月 6 日（基金转型后首个运作日）至 2019 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%；宏利投资管理（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 指数增强型证券投资基金 (LOF)、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、泰达宏利鑫利半年定期开放债券型证券投资基金、

泰达宏利永利债券型证券投资基金、泰达宏利品牌升级混合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（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		
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。
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。
李婷婷	基金经理助理	2019 年 11 月 6 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。



#### 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		
刘洋	基金经理	2019 年 1 月 19 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。
李婷婷	基金经理助理	2019 年 5 月 29 日	2019 年 11 月 5 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	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。

#### 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内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

基金管理人的风险管理部事后从交易指令的公平性、同日反向交易、不同窗口下的同向交易溢价率和风格相似的基金的业绩等方面，对报告期内的公平交易执行情况进行统计分析。本报告期内，交易指令多为指令下达人管理的多只资产组合同时下发，未发现明显的非公平交易指令；基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；场外交易的交易价格与市场价格一致，场内交易的溢价率在剔除交易时间差异、交易数量悬殊、市场波动剧烈等因素后，处于正常范围之内；基金管理人管理的各投资组合的业绩由于投资策略、管理风格、业绩基准等方面的因素而有所不同。

本报告期内，本基金管理人管理的各投资组合之间未发现利益输送或不公平对待不同组合的情况。

#### 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，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

2019 年权益市场呈现出估值修复与情绪提升的回暖行情，在温和友好的货币、信贷与财政政

策环境、稳定的外资与社保养老等长期资金持续流入、A 股估值普遍位于历史较低水平、金融供给侧改革与大力发展直接融资市场的背景下，市场各板块均取得了不错的收益。食品饮料为代表的绩优蓝筹股估值中枢进一步抬升，受益于景气周期的养殖业、5G 产业链、自主可控等成为贯穿全年的主题。下半年科创板的推出吸引大量资金参与其中，对主板科技与医疗产业也形成了一定程度的估值提升效应。受增量资金偏好不可忽视的影响，市场风格回归高盈利质量的大盘蓝筹，长期动量效应较好，而低估值相对失效。机构持仓相对大部分中小盘标的优势明显，而主动管理公募基金业绩也普遍超越了市场指数。

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。本报告期内，本基金增加了电子元器件、非银行金融、综合的配置，减少了电力及公用事业、房地产、交通运输的配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型后

截至本报告期末，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 30.14%，业绩比较基准收益率为 19.66%。

#### 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，在金融供给侧改革背景下，机构对于高收益资产的需求或将使其对权益资产的配置比例进一步提高。市场流动性有望进一步改善，增量资金方面可望继续迎来外资、保险、银行理财子公司、社保基金、养老金等中长期资金入市。同时由于地产投资属性弱化，各类高收益理财产品打破刚兑，未来居民财富将可能有更大比例投向权益市场。若当前外部环境持续稳定，流动性不出现明显收紧，经济数据持续验证向好，企业盈利水平见底回升，中长期来看权益资产将有可期待的上行空间。由于机构主导权的进一步加强，高盈利质量的大盘蓝筹可能仍然是部分资金的选择；看好中小市值、低估值、高分红风格在未来的估值修复空间，理财、保险等类固收属性资金或更偏好高股息率标的；科技行业有望迎来业绩基本面与政策面的共振，值得重点关注。风险层面需关注经济与企业盈利企稳节奏以及全球范围内地缘政治事件带来的波动。

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、公司治理规范、估

值合理、有长期业绩成长能力的股票。在严格控制行业与风格暴露风险的前提下获取稳定的选股超额收益。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

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金本报告期内未进行利润分配。目前无其他利

润分配安排。

#### **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”）在对泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（转型前为泰达宏利中证 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(2020)第 22682 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 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)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 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,以下简称“泰达宏利中证 500 指数增强基金”)的财务报表,包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表,2019 年 11 月 6 日(基金转型后首个运作日)至 2019 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中证 500 指数增强基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年 11 月 6 日(基金转型后首个运作日)至 2019 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中证 500 指数增强基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>泰达宏利中证 500 指数增强基金的基金管理人泰达宏利基金管理股份有限公司(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中证 500 指数增强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中证 500 指数增强基金、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中证 500 指数增强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。</p>



	<p>同时,根据获取的审计证据,就可能对泰达宏利中证 500 指数增强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导致泰达宏利中证 500 指数增强基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,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   魏佳亮
会计师事务所的地址	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
审计报告日期	2020 年 4 月 23 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(2020)第 22728 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 500 指数分级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 500 指数分级证券投资基金(以下简称“泰达宏利中证 500 指数分级基金”)的财务报表, 包括 2019 年 11 月 5 日(基金转型前最后运作日)的资产负债表, 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 11 月 5 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中证 500 指数分级基金 2019 年 11 月 5 日(基金转型前最后运作日)的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 11 月 5 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中证 500 指数分级基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的	泰达宏利中证 500 指数分级基金的基金管理人泰达宏利基金管理

<p>责任</p>	<p>股份有限公司(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中证 500 指数分级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中证 500 指数分级基金、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中证 500 指数分级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,就可能对泰达宏利中证 500 指数</p>

	<p>分级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导致泰达宏利中证 500 指数分级基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，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>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>单峰 魏佳亮</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>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</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2020 年 4 月 23 日</p>

## § 7 年度财务报表 (转型后)

### 7.1 资产负债表 (转型后)

会计主体: 泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2019 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>		
银行存款	7.4.7.1	855,783.37
结算备付金		925,182.47
存出保证金		33,172.31
交易性金融资产	7.4.7.2	261,112,391.75
其中: 股票投资		248,101,107.75
基金投资		-
债券投资		13,011,284.00
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		2,131,472.61
应收利息	7.4.7.5	309,048.86
应收股利		-
应收申购款		715,945.94
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		266,082,997.31
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		594,043.07
应付赎回款		1,018,788.35
应付管理人报酬		226,233.99
应付托管费		45,246.77
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	405,909.35
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	248,834.79
负债合计		2,539,056.32
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	110,825,421.75
未分配利润	7.4.7.10	152,718,519.24
所有者权益合计		263,543,940.99
负债和所有者权益总计		266,082,997.31

注: 1. 报告截止日 2019 年 12 月 31 日, 基金份额净值 1.0051 元, 基金份额总额 262,207,561.12 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2019 年 11 月 6 日(基金转型后首个运作日)至 2019 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体: 泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2019 年 11 月 6 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期
		2019 年 11 月 6 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		16,734,902.52
1. 利息收入		80,214.23
其中: 存款利息收入	7.4.7.11	5,060.06
债券利息收入		75,154.17
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)		5,782,857.91
其中: 股票投资收益	7.4.7.12	5,743,200.93
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,379.89
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	41,036.87
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	10,806,004.41
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	65,825.97
<b>减: 二、费用</b>		988,478.48

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	404,330.70
2. 托管费	7.4.10.2.2	80,866.11
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	413,847.48
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	89,434.19
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>15,746,424.04</b>
减: 所得税费用		-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>15,746,424.04</b>

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2019 年 11 月 6 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 11 月 6 日(基金合同生效日)至 2019 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)	119,691,733.85	148,452,530.62	268,144,264.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,746,424.04	15,746,424.04
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)	-8,866,312.10	-11,480,435.42	-20,346,747.52
其中: 1. 基金申购款	14,088,670.32	17,852,237.39	31,940,907.71
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-22,954,982.42	-29,332,672.81	-52,287,655.23
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)	110,825,421.75	152,718,519.24	263,543,940.99

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:

傅国庆

基金管理人负责人

傅国庆

主管会计工作负责人

王泉

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 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”)由泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金 (以下简称“泰达宏利中证 500 指数分级基金”)转型而来。根据基金管理人泰达宏利基金管理有限公司于 2019 年 10 月 29 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金实施转型的公告》,原泰达宏利中证 500 指数分级基金以现场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 2019 年 11 月 6 日正式实施基金转型。《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》自 2019 年 11 月 6 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”)。

经深圳证券交易所 (以下简称“深交所”)深证上[2019]776 号核准,本基金 5,381,032.00 份基金份额于 2019 年 12 月 5 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,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即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票 (包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券 (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、可转换债券等)、债券回购、资产支持证券、股指期货、货币市场工具、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%,投资组合中投资于中证 500 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:95%×中证 500 指数收益率+5%×1 年期定期存款利率 (税后)。

### 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<年度报告和中期报告>》、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 指数增强型



证券投资基金 (LOF) 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 2019 年 11 月 6 日 (基金转型后首个运作日) 至 2019 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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年 11 月 6 日 (基金转型后首个运作日) 至 2019 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 2019 年 11 月 6 日 (基金转型后首个运作日) 至 2019 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和托管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，其中场外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，场内基金份额持有人只能选择现金分红。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) 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。

(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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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 2019 年 12 月 31 日
活期存款	855,783.37
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：	855,783.37

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	230,879,401.14	248,101,107.75	17,221,706.61
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	13,035,994.51	13,011,284.00
	银行间市场	-	-
	合计	13,035,994.51	13,011,284.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	243,915,395.65	261,112,391.75	17,196,996.10

### 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 2019年12月31日
应收活期存款利息	696.15
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	412.60
应收债券利息	307,920.60
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	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	19.50
合计	309,048.86

### 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 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	405,909.35
银行间市场应付交易费用	-
合计	405,909.35

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,234.25
预提费用	210,000.00

指数使用费	35,600.54
合计	248,834.79

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年11月6日(基金合同生效日)至2019年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	283,184,730.54	119,691,733.85
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	33,332,738.42	14,088,670.32
本期赎回(以“-”号填列)	-54,309,907.84	-22,954,982.42
本期末	262,207,561.12	110,825,421.75

注：1. 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。

2. 截至2019年12月31日止，本基金于深交所上市的基金份额为5,219,549.00份，托管在场外未上市交易的基金份额为256,988,012.12份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	155,427,053.28	-6,974,522.66	148,452,530.62
本期利润	4,940,419.63	10,806,004.41	15,746,424.04
本期基金份额交易产生的变动数	-11,738,781.64	258,346.22	-11,480,435.42
其中：基金申购款	18,580,915.08	-728,677.69	17,852,237.39
基金赎回款	-30,319,696.72	987,023.91	-29,332,672.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	148,628,691.27	4,089,827.97	152,718,519.24

#### 7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2019年11月6日(基金合同生效日)至2019年12月31日
	活期存款利息收入
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	1,640.09



其他	110.51
合计	5,060.06

#### 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 2019年11月6日(基金合同生效日)至2019年12月31日
卖出股票成交总额	141,282,012.68
减：卖出股票成本总额	135,538,811.75
买卖股票差价收入	5,743,200.93

#### 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 2019年11月6日(基金合同生效日)至2019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	-1,379.89
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	-1,379.89

##### 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 2019年11月6日(基金合同生效日)至2019年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	308,214.24
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	302,879.89
减：应收利息总额	6,714.24
买卖债券差价收入	-1,379.89

##### 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

本基金本报告期末未有债券投资收益-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 2019年11月6日(基金合同生效日)至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	41,036.87
基金投资产生的股利收益	-
合计	41,036.87

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年11月6日(基金合同生效日)至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	10,806,004.41
——股票投资	10,785,131.52
——债券投资	20,872.89
——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	10,806,004.41

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年11月6日(基金合同生效日)至2019年 12月31日
基金赎回费收入	65,825.97
合计	65,825.97

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年11月6日(基金合同生效日)至2019年12月31日	上年度可比期间 至2018年12月31日
交易所市场交易费用	413,847.48	-
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	413,847.48	-

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年11月6日(基金合同生效日)至2019 年12月31日
审计费用	34,126.62
信息披露费	18,822.82
上市费	5,000.00
指数使用费	30,434.78
银行费用	1,049.97
合计	89,434.19

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、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
天津市泰达国际控股(集团)有限公司	基金管理人的股东
宏利投资管理(香港)有限公司(原“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 2019 年 11 月 6 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日	
	当期发生的基金应支付的管理费	404,330.70
其中：支付销售机构的客户维护费	94,669.59	

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 X 1.0% / 当年天数。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 11 月 6 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日	
	当期发生的基金应支付的托管费	80,866.11

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。

#### 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

#### 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 2019 年 11 月 6 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
	中国银行	855,783.37

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。

#### 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

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末 (2019 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
688018	乐鑫科技	2019 年 7 月 12 日	2020 年 1 月 22 日	新股流通受限	62.60	163.82	6,264	392,126.40	1,026,168.48	-
688016	心脉医疗	2019 年 7 月 15 日	2020 年 1 月 22 日	新股流通受限	46.23	145.64	6,799	314,317.77	990,206.36	-
688188	柏楚电子	2019 年 7 月 31 日	2020 年 2 月 10 日	新股流通受限	68.58	152.09	6,277	430,476.66	954,668.93	-
688321	微芯生物	2019 年 8 月 2 日	2020 年 2 月 12 日	新股流通受限	20.43	53.73	13,328	272,291.04	716,113.44	-
688010	福光股份	2019 年 7 月 12 日	2020 年 1 月 22 日	新股流通受限	25.22	40.83	17,276	435,700.72	705,379.08	-
688020	方邦股份	2019 年 7 月 16 日	2020 年 1 月 22 日	新股流通受限	53.88	88.80	7,643	411,804.84	678,698.40	-

688005	容百科技	2019年7月12日	2020年1月22日	新股流通受限	26.62	31.84	17,040	453,604.80	542,553.60	-
688122	西部超导	2019年7月15日	2020年1月22日	新股流通受限	15.00	32.80	15,715	235,725.00	515,452.00	-
688023	安恒信息	2019年10月29日	2020年5月6日	新股流通受限	56.50	122.53	2,728	154,132.00	334,261.84	-
688128	中国电研	2019年10月29日	2020年5月6日	新股流通受限	18.79	17.52	9,027	169,617.33	158,153.04	-
688369	致远互联	2019年10月23日	2020年5月6日	新股流通受限	49.39	52.08	2,970	146,688.30	154,677.60	-
688181	八亿时空	2019年12月27日	2020年1月6日	新股流通受限	43.98	43.98	3,349	147,289.02	147,289.02	-
688058	宝兰德	2019年10月25日	2020年5月6日	新股流通受限	79.30	90.65	1,450	114,985.00	131,442.50	-
688389	普门科技	2019年10月29日	2020年5月6日	新股流通受限	9.10	13.56	6,931	63,072.10	93,984.36	-
688081	兴图新科	2019年12月26日	2020年1月6日	新股流通受限	28.21	28.21	3,153	88,946.13	88,946.13	-
002973	侨银环保	2019年12月27日	2020年1月6日	新股流通受限	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### **7.4.12.2 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。

#### **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债券正回购余额。

#### **7.4.13 金融工具风险及管理**

##### **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，因此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 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券、资产支持证券和同业存单投资。

### 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 2019 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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》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、存出保证金和债券投资等。

### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2019 年 12 月 31 日	1 个月 以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	-	-	-	-	-	-	855,783.37
结算备付金	-	-	-	-	-	-	925,182.47
存出保证金	-	-	-	-	-	-	33,172.31
交易性金融资产	-	-	-	-	-	248,101,107.75	261,112,391.75
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,131,472.61	2,131,472.61
应收利息	-	-	-	-	-	309,048.86	309,048.86
应收申购款	-	-	-	-	-	715,945.94	715,945.94
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	-	-	-	-	-	251,257,575.16	266,082,997.31
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	594,043.07	594,043.07
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,018,788.35	1,018,788.35
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	226,233.99	226,233.99
应付托管费	-	-	-	-	-	45,246.77	45,246.77
应付交易费用	-	-	-	-	-	405,909.35	405,909.35
其他负债	-	-	-	-	-	248,834.79	248,834.79
负债总计	-	-	-	-	-	2,539,056.32	2,539,056.32
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-	248,718,518.84	263,543,940.99

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 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.94%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

### 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。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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 2019 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	248,101,107.75	94.14
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	248,101,107.75	94.14

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2019 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 2019 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 240,856,534.93 元, 属于第二层次的余额为 20,255,856.82 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 2019 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) 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 500 指数分级证券投资基金

报告截止日: 2019 年 11 月 5 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 11 月 5 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	4,933,929.85	9,612,293.51
结算备付金		392,967.72	424,413.43
存出保证金		34,091.67	43,531.08
交易性金融资产	7.4.7.2	266,859,993.37	158,912,256.95
其中: 股票投资		253,566,702.37	158,841,739.45
基金投资		-	-
债券投资		13,293,291.00	70,517.50
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	248,165.98	2,243.77
应收股利		-	-
应收申购款		-	171,998.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		272,469,148.59	169,166,737.56
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 11 月 5 日</b>	<b>上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,954,626.47	-
应付赎回款		-	9,456.48
应付管理人报酬		35,932.41	147,013.01
应付托管费		7,186.48	29,402.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	164,922.44	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	7.4.7.8	162,216.32	224,553.13
负债合计		4,324,884.12	623,480.08
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	119,691,733.85	97,931,797.25
未分配利润	7.4.7.10	148,452,530.62	70,611,460.23
所有者权益合计		268,144,264.47	168,543,257.48
负债和所有者权益总计		272,469,148.59	169,166,737.56

注：1. 报告截止日 2019 年 11 月 5 日 (基金转型前最后运作日)，基金份额净值 0.9469 元，基金份额总额 283,184,730.54 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 11 月 5 日 (基金转型前最后运作日) 止期间。

## 7.2 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 11 月 5 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 11 月 5 日	上年度可比期间 至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		57,137,695.97	-67,267,144.21
1. 利息收入		178,819.86	113,907.25
其中：存款利息收入	7.4.7.11	67,208.76	113,823.28
债券利息收入		111,611.10	83.97
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)		24,235,911.68	-41,580,046.14
其中：股票投资收益	7.4.7.12	22,318,726.16	-44,789,204.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	15,273.74	-
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	1,901,911.78	3,209,158.54
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	7.4.7.17	32,514,893.39	-25,996,210.39
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	208,071.04	195,205.07

列)			
<b>减：二、费用</b>		4,595,928.01	5,922,586.27
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,733,377.70	2,438,015.84
2. 托管费	7.4.10.2.2	346,675.56	487,603.25
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,192,639.30	2,645,637.16
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	0.35
7. 其他费用	7.4.7.20	323,235.12	351,329.67
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		52,541,767.96	-73,189,730.48
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		52,541,767.96	-73,189,730.48

### 7.3 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 11 月 5 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 11 月 5 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）	-	52,541,767.96	52,541,767.96
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）	21,759,936.60	25,299,302.43	47,059,239.03
其中：1. 基金申购款	98,366,381.72	113,766,979.35	212,133,361.07
2. 基金赎回款	-76,606,445.12	-88,467,676.92	-165,074,122.04
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）	119,691,733.85	148,452,530.62	268,144,264.47
项目	上年度可比期间 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)	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)	-	-73,189,730.48	-73,189,730.48
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)	-26,644,698.06	-28,831,656.14	-55,476,354.20
其中：1.基金申购款	79,978,157.91	93,789,383.80	173,767,541.71
2.基金赎回款	-106,622,855.97	-122,621,039.94	-229,243,895.91
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)	97,931,797.25	70,611,460.23	168,543,257.48

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：

傅国庆	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 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有限公司普华永道中天验字(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》的相关规定,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(以下简称“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(以下简称“泰达 500A 份额”)及泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金之进取收益类份额(以下简称“泰达 500B 份额”)。本基金通过

场外、场内两种方式公开发售泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额及泰达 500B 份额。投资人场外认购所得的泰达中证 500 份额，不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的泰达中证 500 份额，将按 4:6 的基金份额配比自动分离为泰达 500A 份额与泰达 500B 份额。泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的数量保持 4:6 的比例不变。基金合同生效后，泰达中证 500 份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回，但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下，泰达 500A 份额和泰达 500B 份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内泰达中证 500 份额与泰达 500A 份额和泰达 500B 份额之间可以按照约定的规则进行场内份额的配对转换，包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 10 份场内泰达中证 500 份额按照 4:6 的份额配比转换成 4 份泰达 500A 份额与 6 份泰达 500B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 4 份泰达 500A 份额与 6 份泰达 500B 份额按照 4:6 的基金份额配比转换成 10 份场内泰达中证 500 份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：泰达中证 500 份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额和泰达 500B 份额数量的总和。本基金每 4 份泰达 500A 份额与每 6 份泰达 500B 份额构成一对份额组合，该份额组合的基金份额参考净值之和等于 10 份泰达中证 500 份额的基金份额净值之和。泰达 500A 份额的约定年基准收益率为“1 年期同期银行定期存款利率(税后)+3.5%”，泰达 500A 份额的份额净值每日按该约定年收益率逐日计算，计算出泰达 500A 份额的基金份额参考净值后，根据泰达中证 500 份额的基金份额净值与泰达 500A 份额、泰达 500B 份额之间的基金份额参考净值关系，可以计算出泰达 500B 份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金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，本基金将进行基金的定期份额折算：定期份额折算后泰达 500A 份额的基金份额参考净值调整为 1.0000 元，基金份额折算基准日折算前泰达 500A 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分将折算为场内泰达中证 500 份额分配给泰达 500A 份额持有人。泰达中证 500 份额持有人持有的每 10 份泰达中证 500 份额将按 4 份泰达 500A 份额获得新增泰达中证 500 份额的分配。持有场外泰达中证 500 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外泰达中证 500 份额的分配；持有场内泰达中证 500 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内泰达中证 500 份额的分配。经过上述份额折算后，泰达中证 500 份额的基金份额净值将相应调整。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。泰达 500B 份额不参与定期份额折算，每次定期份额折算不改变泰达 500B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上的定期份额折算外,当泰达中证 500 份额的基金份额净值达到 2.0000 元时,或当泰达 500B 份额的基金份额参考净值跌至 0.2500 元时,本基金将根据市场情况确定本基金不定期折算基准日,进行不定期份额折算:份额折算后本基金将确保泰达 500A 份额与泰达 500B 份额的比例为 4:6,份额折算后泰达 500A 份额的基金份额参考净值、泰达 500B 份额的基金份额参考净值和泰达中证 500 份额的基金份额净值均调整为 1.0000 元。当泰达中证 500 份额的基金份额净值达到 2.0000 元时,基金份额折算基准日折算前泰达中证 500 份额的基金份额净值及泰达 500A 份额、泰达 500B 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分均将折算为泰达中证 500 份额分别分配给泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的持有人。当泰达 500B 份额的基金份额参考净值跌至 0.2500 元时,泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2011]第 379 号核准,本基金泰达 500A 份额 74,125,804.00 份基金份额和泰达 500B 份额 111,188,706.00 份基金份额于 2011 年 12 月 22 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的泰达中证 500 份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其分拆为泰达 500A 份额和泰达 500B 份额即可上市流通;对于托管在场外的泰达中证 500 份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为泰达 500A 份额和泰达 500B 份额即可上市流通。

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,本基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、备选成份股、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:  $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times 1 \text{ 年期定期存款利率(税后)}$ 。

根据泰达宏利基金管理有限公司于 2019 年 10 月 29 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金实施转型的公告》,本基金于 2019 年 9 月 27 日以现场方式召开基金份额持有人大会,大会表决通过了《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》。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 2019 年 11 月 6 日正式实施基金转型,自基金转型实施日起,《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》失效且《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》同时生效, 本基金正式变更为泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)。

#### 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〈年度报告和中期报告〉》、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 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。

经中国证监会批准, 基金管理人泰达宏利基金管理有限公司将本基金于 2019 年 11 月 6 日转型为泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF), 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 11 月 5 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 2019 年 11 月 5 日 (基金转型前最后运作日) 的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 11 月 5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 11 月 5 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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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和托管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

根据《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》，在存续期内，本基金(包括泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额、泰达 500B 份额)不进行收益分配。

#### 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) 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。

(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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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 2019 年 11 月 5 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	4,933,929.85	9,612,293.51
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:	4,933,929.85	9,612,293.51
-----	--------------	--------------

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2019年11月5日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	247,130,127.28	253,566,702.37	6,436,575.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	13,338,874.40	13,293,291.00
	银行间市场	-	-
	合计	13,338,874.40	13,293,291.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	260,469,001.68	266,859,993.37	6,390,991.69
项目	上年度末 2018年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	184,969,158.65	158,841,739.45	-26,127,419.20
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	67,000.00	70,517.50
	银行间市场	-	-
	合计	67,000.00	70,517.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	185,036,158.65	158,912,256.95	-26,123,901.70

#### 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 2019 年 11 月 5 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	6,577.42	1,945.16
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	1,370.55	187.30
应收债券利息	239,480.67	86.93
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	600.03	0.28
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	137.31	24.10
合计	248,165.98	2,243.77

### 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 2019 年 11 月 5 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	164,922.44	213,054.16
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	164,922.44	213,054.16

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 11 月 5 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	26.01
预提费用	157,050.56	216,000.00
指数使用费	5,165.76	8,527.12
合计	162,216.32	224,553.13

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 11 月 5 日	
	基金份额 (份)	账面金额

上年度末	225,451,095.17	97,931,797.25
本期申购	249,208.29	108,256.83
本期赎回 (以“-”号填列)	-95,842.13	-41,634.02
2019 年 1 月 2 日 基金拆分/份额折算前	225,604,461.33	97,998,420.06
基金拆分/份额折算变动份额	6,254,683.07	-
本期申购	232,473,120.55	98,258,124.89
本期赎回 (以“-”号填列)	-181,147,534.41	-76,564,811.10
本期末	283,184,730.54	119,691,733.85

注：1. 根据《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》，本基金的泰达 500A 份额、泰达 500B 份额不接受投资者的申购与赎回；在本基金基金合同生效后，投资者可通过场内或场外两种方式对泰达中证 500 份额进行日常的申购与赎回。

2. 截至 2019 年 11 月 5 日 (基金转型前最后运作日) 止，本基金深交所场内基金份额为 15,165,803.00 份，为泰达中证 500 份额 (2018 年 12 月 31 日：深交所上市的基金份额 7,045,000.00 份，其中泰达 500A 份额 2,818,000.00 份，泰达 500B 份额 4,227,000.00 份，场内未上市的基金份额 1,465,821.00 份，为泰达中证 500 份额)；托管在场外未上市交易的基金份额为 268,018,927.54 份 (2018 年 12 月 31 日：216,940,274.17 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或在场内申购和赎回泰达中证 500 份额，投资者可选择将其场内申购的泰达中证 500 份额按 4:6 的比例分拆成泰达 500A 份额和泰达 500B 份额，投资者可按 4:6 的配比将其持有的泰达 500A 份额和泰达 500B 份额申请合并为泰达中证 500 份额后赎回。未上市的基金份额登记在证券登记系统，按基金份额净值申购或赎回。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 分拆为泰达 500A 份额和泰达 500B 份额后即可上市流通。

3. 根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金于 2019 年 1 月 2 日进行了定期折算。详情请见泰达宏利基金管理有限公司发布的相关份额折算公告。

4. 根据泰达宏利基金管理有限公司于 2019 年 10 月 29 日发布的《关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金之泰达 500A 份额、泰达 500B 份额终止上市的公告》，在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的泰达 500A 份额及泰达 500B 份额于 2019 年 11 月 4 日终止在深圳证券交易所上市交易。泰达 500A 份额及泰达 500B 份额于 2019 年 11 月 5 日转换为泰达中证 500 份额，并最终转换为泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 份额。泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额与泰达 500B 份额的场内份额经转换后的份额数采用取整计算 (最小单位为 1 份)，取整后的余额计入基金资产。故基金份额转换后，由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份

额持有人存在着基金资产净值减小的风险。于 2019 年 11 月 5 日转换后, 基金份额调减 1.00 份。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位: 人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	103,780,183.48	-33,168,723.25	70,611,460.23
本期利润	20,026,874.57	32,514,893.39	52,541,767.96
本期基金份额交易产生的变动数	31,619,995.23	-6,320,692.80	25,299,302.43
其中: 基金申购款	118,847,990.14	-5,081,010.79	113,766,979.35
基金赎回款	-87,227,994.91	-1,239,682.01	-88,467,676.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	155,427,053.28	-6,974,522.66	148,452,530.62

#### 7.4.7.11 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 11 月 5 日	上年度可比期间 至 2018 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	55,370.83	97,898.49
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	8,908.59	12,105.73
其他	2,929.34	3,819.06
合计	67,208.76	113,823.28

#### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 11 月 5 日	上年度可比期间 至 2018 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	692,794,531.48	888,235,871.63
减: 卖出股票成本总额	670,475,805.32	933,025,076.31
买卖股票差价收入	22,318,726.16	-44,789,204.68

#### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 11 月 5 日	上年度可比期间 至 2018 年 12 月 31 日
债券投资收益——买卖债	15,273.74	-

券(、债转股及债券到期兑付) 差价收入		
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	15,273.74	-

#### 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 2019年1月1日至2019年 11月5日	上年度可比期间 至2018年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付) 成交总额	82,443.50	-
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付) 成本总额	67,000.00	-
减：应收利息总额	169.76	-
买卖债券差价收入	15,273.74	-

#### 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 2019年1月1日至2019年11月5日	上年度可比期间 至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,901,911.78	3,209,158.54
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,901,911.78	3,209,158.54

### 7.4.7.17 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11月5日	上年度可比期间 至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	32,514,893.39	-25,996,210.39
——股票投资	32,563,994.29	-25,999,727.89
——债券投资	-49,100.90	3,517.50
——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	32,514,893.39	-25,996,210.39

### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年11月5日	上年度可比期间 至2018年12月31日
基金赎回费收入	208,071.04	195,205.07
合计	208,071.04	195,205.07

注：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。

### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 11 月 5 日	上年度可比期间 至 2018 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	2,192,639.30	2,645,637.16
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	2,192,639.30	2,645,637.16

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 11 月 5 日	上年度可比期间 至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	55,873.38	66,000.00
信息披露费	101,177.18	150,000.00
其他	50,000.00	-
上市费	55,000.00	60,000.00
指数使用费	34,667.57	48,760.30
银行间账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行费用	8,516.99	8,569.37
合计	323,235.12	351,329.67

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

根据本基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司于 2019 年 11 月 6 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达中证 500 指数分级证券投资基金基金份额转换结果的公告》，泰达中证 500 指数分级份额已转换为泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的份额。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) 恢复申购 (含定期定额投资)、赎回和转托管 (包括场外转托管和跨系统转托管) 等相关业务。

#### 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、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
天津市泰达国际控股 (集团) 有限公司	基金管理人的股东
宏利投资管理 (香港) 有限公司 (原 “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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 11 月 5 日	上年度可比期间 至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,733,377.70	2,438,015.84

其中: 支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	409,008.55	347,956.58
-------------------------------	------------	------------

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 1.00% 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×1.00%/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
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 11 月 5 日	至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	346,675.56	487,603.25

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。

#### 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

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。

#### 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		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 11 月 5 日		至 2018 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	4,933,929.85	55,370.83	9,612,293.51	97,898.49

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。

#### 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

#### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

根据本基金合同的约定,在存续期内,本基金(包括泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额、泰达 500B 份额)不进行收益分配。

### 7.4.12 期末(2019 年 11 月 5 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
688016	心脉医疗	2019 年 7 月 15 日	2020 年 1 月 22 日	新股流通受限	46.23	129.31	6,799	314,317.77	879,178.69	-
688018	乐鑫科技	2019 年 7 月 12 日	2020 年 1 月 22 日	新股流通受限	62.60	129.45	6,264	392,126.40	810,874.80	-
688010	福光股份	2019 年 7 月 12 日	2020 年 1 月 22 日	新股流通受限	25.22	41.27	17,276	435,700.72	712,980.52	-
688188	柏楚电子	2019 年 7 月 31 日	2020 年 2 月 10 日	新股流通受限	68.58	96.45	6,277	430,476.66	605,416.65	-
688020	方邦股份	2019 年 7 月 16 日	2020 年 1 月 22 日	新股流通受限	53.88	73.80	7,643	411,804.84	564,053.40	-
688005	容百科技	2019 年 7 月 12 日	2020 年 1 月 22 日	新股流通受限	26.62	29.36	17,040	453,604.80	500,294.40	-
688321	微芯生物	2019 年 8 月 2 日	2020 年 2 月 12 日	新股流通受限	20.43	37.09	13,328	272,291.04	494,335.52	-
688122	西部超导	2019 年 7 月 15 日	2020 年 1 月 22 日	新股流通受限	15.00	28.79	15,715	235,725.00	452,434.85	-
688128	N 中电研	2019 年 10 月 29 日	2020 年 5 月	新股流通受限	18.79	24.56	9,027	169,617.33	221,703.12	-

		日	6 日							
688023	安恒信息	2019 年 10 月 29 日	2020 年 5 月 6 日	新股流通受限	56.50	72.02	2,728	154,132.00	196,470.56	-
688369	致远互联	2019 年 10 月 23 日	2020 年 5 月 6 日	新股流通受限	49.39	57.36	2,970	146,688.30	170,359.20	-
688299	长阳科技	2019 年 10 月 28 日	2019 年 11 月 6 日	新股流通受限	13.71	13.71	11,341	155,485.11	155,485.11	-
688058	宝兰德	2019 年 10 月 25 日	2020 年 5 月 6 日	新股流通受限	79.30	83.48	1,450	114,985.00	121,046.00	-
688389	普门科技	2019 年 10 月 29 日	2020 年 5 月 6 日	新股流通受限	9.10	16.32	6,931	63,072.10	113,113.92	-
688021	奥福环保	2019 年 10 月 29 日	2019 年 11 月 6 日	新股流通受限	26.17	26.17	2,940	76,939.80	76,939.80	-
603489	八方股份	2019 年 11 月 1 日	2019 年 11 月 11 日	新股流通受限	43.44	43.44	701	30,451.44	30,451.44	-
002967	广电计量	2019 年 11 月 1 日	2019 年 11 月 8 日	新股流通受限	7.43	7.43	2,723	20,231.89	20,231.89	-
300564	筑博设计	2019 年 11 月 1 日	2019 年 11 月 8 日	新股流通受限	22.69	22.69	497	11,276.93	11,276.93	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 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债券正回购余额。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 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，因此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 2019 年 11 月 5 日(基金转型前最后运作日)，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金

融债以外的债券、资产支持证券投资 and 同业存单。(2018 年 12 月 31 日: 本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券、资产支持证券和同业存单占基金资产净值的比例为 0.04%。)

### 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 2019 年 11 月 5 日, 本基金所承担的全部金融负债的合约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》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、存出保证金和债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2019 年 11 月 5 日	1 个月 以内	1-3 个 月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	-	-	-	-	-	-	4,933,929.85
结算备付金	-	-	-	-	-	-	392,967.72
存出保证金	-	-	-	-	-	-	34,091.67

交易性金融资产	-	-	-	-	-	-253,566,702.37	266,859,993.37
应收利息	-	-	-	-	-	248,165.98	248,165.98
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	-	-	-	-	-	-253,814,868.35	272,469,148.59
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,954,626.47	3,954,626.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	35,932.41	35,932.41
应付托管费	-	-	-	-	-	7,186.48	7,186.48
应付交易费用	-	-	-	-	-	164,922.44	164,922.44
其他负债	-	-	-	-	-	162,216.32	162,216.32
负债总计	-	-	-	-	-	4,324,884.12	4,324,884.12
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-	-249,489,984.23	268,144,264.47
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 个月 以内	1-3 个 月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-	-	-
银行存款	-	-	-	-	-	-	9,612,293.51
结算备付金	-	-	-	-	-	-	424,413.43
存出保证金	-	-	-	-	-	-	43,531.08
交易性金融资产	-	-	-	-	70,517.50	158,841,739.45	158,912,256.95
应收利息	-	-	-	-	-	2,243.77	2,243.77
应收申购款	-	-	-	-	-	171,004.78	171,998.82
资产总计	-	-	-	-	70,517.50	159,014,988.00	169,166,737.56
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	9,456.48	9,456.48
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	147,013.01	147,013.01
应付托管费	-	-	-	-	-	29,402.61	29,402.61
应付交易费用	-	-	-	-	-	213,054.16	213,054.16
应交税费	-	-	-	-	-	0.69	0.69
其他负债	-	-	-	-	-	224,553.13	224,553.13
负债总计	-	-	-	-	-	623,480.08	623,480.08
利率敏感度缺口	-	-	-	-	70,517.50	158,391,507.92	168,543,257.48

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 2019 年 11 月 5 日(基金转型前最后运作日)，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.96%(2018 年 12 月 31 日：0.04%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018 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。本基金的投资组合中股票市值和买入、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。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 2019 年 11 月 5 日		上年度末 2018 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	253,566,702.37	94.56	158,841,739.45	94.24
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	253,566,702.37	94.56	158,841,739.45	94.24

#### 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 (2019 年 11 月 5 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
		业绩比较基准上升 5%	12,770,000.00
业绩比较基准下降 5%	-12,770,000.00	-7,800,000.00	

#### 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 2019 年 11 月 5 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 253,272,317.20 元, 属于第二层次的余额为 13,587,676.17 元, 无属于第三层次的余额 (2018 年 12 月 31 日: 第一层次 158,862,111.15 元, 第二层次 50,145.80 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

于本期末, 本基金未持有公允价值归属于第三层次的金融工具 (2018 年 12 月 31 日: 同)。本基金本期净转入第三层次的金额为 0.00 元, 计入损益的第三层次金融工具公允价值变动为 0.00 元 (2018 年度: 净转入/(转出) 第三层次 178,821.00 元, 计入损益的第三层次金融工具公允价值变动 -178,821.00 元, 涉及长生生物科技股份有限公司发行的股票)。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 11 月 5 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 (2018 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) 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	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	其他各项资产	3,189,639.72	1.20
9	合计	266,082,997.31	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	5,497,373.00	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

### 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	-	-
B	采矿业	-	-
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

### 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	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
11	002500	山西证券	412,200	3,417,138.00	1.30
12	600699	均胜电子	190,876	3,416,680.40	1.30
13	600909	华安证券	466,600	3,406,180.00	1.29
14	600079	人福医药	252,000	3,404,520.00	1.29
15	600704	物产中大	647,900	3,401,475.00	1.29
16	002373	千方科技	188,300	3,396,932.00	1.29
17	002065	东华软件	326,646	3,370,986.72	1.28
18	600466	蓝光发展	451,780	3,329,618.60	1.26
19	000997	新大陆	207,600	3,296,688.00	1.25
20	600415	小商品城	838,500	3,244,995.00	1.23
21	300058	蓝色光标	559,700	3,162,305.00	1.20
22	002028	思源电气	226,000	3,112,020.00	1.18
23	002075	沙钢股份	499,000	3,108,770.00	1.18
24	600388	龙净环保	313,200	3,053,700.00	1.16
25	000930	中粮科技	461,300	3,044,580.00	1.16
26	300072	三聚环保	481,700	3,044,344.00	1.16
27	002465	海格通信	281,000	3,043,230.00	1.15
28	002583	海能达	360,121	3,028,617.61	1.15
29	300026	红日药业	858,100	3,011,931.00	1.14
30	600339	中油工程	884,500	2,998,455.00	1.14
31	002701	奥瑞金	679,900	2,998,359.00	1.14
32	002390	信邦制药	568,400	2,984,100.00	1.13
33	600582	天地科技	921,400	2,939,266.00	1.12
34	600373	中文传媒	214,100	2,913,901.00	1.11
35	600138	中青旅	230,000	2,898,000.00	1.10
36	600737	中粮糖业	330,700	2,797,722.00	1.06
37	600557	康缘药业	182,000	2,682,680.00	1.02
38	002463	沪电股份	119,517	2,654,472.57	1.01
39	600901	江苏租赁	412,500	2,607,000.00	0.99
40	002244	滨江集团	526,900	2,592,348.00	0.98

41	000848	承德露露	325,700	2,563,259.00	0.97
42	000932	华菱钢铁	523,160	2,500,704.80	0.95
43	600967	内蒙一机	233,800	2,485,294.00	0.94
44	300002	神州泰岳	754,400	2,459,344.00	0.93
45	600325	华发股份	305,737	2,393,920.71	0.91
46	002019	亿帆医药	142,900	2,322,125.00	0.88
47	603882	金域医学	44,800	2,294,656.00	0.87
48	600125	铁龙物流	380,800	2,277,184.00	0.86
49	002250	联化科技	132,700	2,273,151.00	0.86
50	600673	东阳光	215,400	2,205,696.00	0.84
51	600739	辽宁成大	139,200	2,120,016.00	0.80
52	002340	格林美	424,600	2,067,802.00	0.78
53	601128	常熟银行	222,600	2,027,886.00	0.77
54	600536	中国软件	27,200	1,949,968.00	0.74
55	000878	云南铜业	141,400	1,931,524.00	0.73
56	600499	科达洁能	426,500	1,846,745.00	0.70
57	000983	西山煤电	297,500	1,823,675.00	0.69
58	002093	国脉科技	204,200	1,645,852.00	0.62
59	600058	五矿发展	191,900	1,539,038.00	0.58
60	002191	劲嘉股份	134,100	1,530,081.00	0.58
61	601000	唐山港	578,500	1,504,100.00	0.57
62	002048	宁波华翔	97,000	1,499,620.00	0.57
63	000031	大悦城	208,200	1,494,876.00	0.57
64	000400	许继电气	130,400	1,404,408.00	0.53
65	603883	老百姓	21,900	1,403,352.00	0.53
66	600376	首开股份	173,300	1,381,201.00	0.52
67	600216	浙江医药	102,500	1,368,375.00	0.52
68	000027	深圳能源	214,600	1,332,666.00	0.51
69	300251	光线传媒	112,100	1,322,780.00	0.50
70	601615	明阳智能	106,100	1,305,030.00	0.50
71	300296	利亚德	168,200	1,290,094.00	0.49
72	600392	盛和资源	135,200	1,226,264.00	0.47
73	600273	嘉化能源	109,000	1,226,250.00	0.47
74	600787	中储股份	226,000	1,177,460.00	0.45
75	600879	航天电子	195,561	1,169,454.78	0.44
76	000028	国药一致	25,200	1,143,072.00	0.43
77	000301	东方盛虹	219,200	1,135,456.00	0.43
78	600008	首创股份	331,000	1,088,990.00	0.41
79	600718	东软集团	93,400	1,060,090.00	0.40

80	002152	广电运通	103,200	991,752.00	0.38
81	000729	燕京啤酒	150,500	981,260.00	0.37
82	600073	上海梅林	118,800	946,836.00	0.36
83	300274	阳光电源	86,900	915,057.00	0.35
84	002174	游族网络	37,800	879,606.00	0.33
85	600645	中源协和	51,800	876,974.00	0.33
86	600779	水井坊	16,800	869,400.00	0.33
87	603556	海兴电力	51,870	845,481.00	0.32
88	002544	杰赛科技	61,900	843,078.00	0.32
89	300253	卫宁健康	55,600	832,888.00	0.32
90	600166	福田汽车	379,100	792,319.00	0.30
91	002385	大北农	156,200	777,876.00	0.30
92	300012	华测检测	51,300	764,883.00	0.29
93	000006	深振业 A	136,900	733,784.00	0.28
94	600970	中材国际	101,400	706,758.00	0.27
95	002242	九阳股份	27,900	701,964.00	0.27
96	601958	金铂股份	84,300	675,243.00	0.26
97	000547	航天发展	65,800	672,476.00	0.26
98	000970	中科三环	58,600	629,950.00	0.24
99	600026	中远海能	97,200	620,136.00	0.24
100	002129	中环股份	49,700	586,957.00	0.22
101	601326	秦港股份	181,900	580,261.00	0.22
102	603650	彤程新材	29,700	517,374.00	0.20
103	002414	高德红外	24,100	506,100.00	0.19
104	601811	新华文轩	35,000	461,650.00	0.18
105	002273	水晶光电	28,300	457,328.00	0.17
106	300166	东方国信	32,100	417,300.00	0.16
107	002572	索菲亚	19,700	412,715.00	0.16
108	000066	中国长城	25,400	395,224.00	0.15
109	600511	国药股份	13,100	357,499.00	0.14
110	000021	深科技	27,900	339,822.00	0.13
111	601228	广州港	76,400	292,612.00	0.11
112	600643	爱建集团	30,300	290,880.00	0.11
113	300014	亿纬锂能	5,300	265,848.00	0.10
114	600765	中航重机	25,900	264,957.00	0.10
115	603233	大参林	4,800	250,800.00	0.10
116	002807	江阴银行	52,900	246,514.00	0.09
117	000598	兴蓉环境	50,400	233,352.00	0.09
118	002280	联络互动	34,300	132,741.00	0.05



119	601928	凤凰传媒	17,300	131,653.00	0.05
-----	--------	------	--------	------------	------

**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	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
6	688016	心脉医疗	6,799	990,206.36	0.38
7	300417	南华仪器	23,400	986,310.00	0.37
8	688188	柏楚电子	6,277	954,668.93	0.36
9	000977	浪潮信息	26,000	782,600.00	0.30
10	002734	利民股份	55,100	762,584.00	0.29
11	688321	微芯生物	13,328	716,113.44	0.27
12	688010	福光股份	17,276	705,379.08	0.27
13	688020	方邦股份	7,643	678,698.40	0.26
14	688005	容百科技	17,040	542,553.60	0.21
15	600183	生益科技	25,300	529,276.00	0.20
16	688122	西部超导	15,715	515,452.00	0.20
17	603008	喜临门	32,500	502,775.00	0.19
18	600405	动力源	95,100	449,823.00	0.17
19	300578	会畅通讯	17,600	448,976.00	0.17
20	300021	大禹节水	75,900	402,270.00	0.15
21	600153	建发股份	37,400	336,226.00	0.13
22	688023	安恒信息	2,728	334,261.84	0.13
23	300659	中孚信息	4,600	294,262.00	0.11
24	601058	赛轮轮胎	63,600	284,292.00	0.11
25	300756	中山金马	7,800	271,908.00	0.10
26	300433	蓝思科技	17,100	236,322.00	0.09
27	002225	濮耐股份	54,500	233,260.00	0.09
28	688128	中国电研	9,027	158,153.04	0.06
29	688369	致远互联	2,970	154,677.60	0.06
30	000550	江铃汽车	10,800	149,040.00	0.06
31	688181	八亿时空	3,349	147,289.02	0.06
32	600731	湖南海利	18,900	136,458.00	0.05
33	688058	宝兰德	1,450	131,442.50	0.05

34	300366	创意信息	12,700	131,318.00	0.05
35	002564	天沃科技	28,600	130,702.00	0.05
36	688389	普门科技	6,931	93,984.36	0.04
37	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.03
38	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	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	000988	华工科技	4,107,758.00	1.56
2	002180	纳思达	4,017,318.40	1.52
3	002065	东华软件	3,589,425.18	1.36
4	603883	老百姓	3,574,445.00	1.36
5	600909	华安证券	3,478,806.99	1.32
6	600415	小商品城	3,440,345.00	1.31
7	000807	云铝股份	3,260,473.00	1.24
8	300058	蓝色光标	3,216,261.00	1.22
9	600339	中油工程	3,091,229.00	1.17
10	601098	中南传媒	3,019,986.98	1.15
11	600704	物产中大	2,989,197.54	1.13
12	300072	三聚环保	2,973,782.20	1.13
13	601966	玲珑轮胎	2,843,999.00	1.08
14	603501	韦尔股份	2,681,141.00	1.02
15	600183	生益科技	2,629,630.00	1.00
16	603882	金城医学	2,317,176.00	0.88
17	600673	东阳光	2,201,860.00	0.84
18	600138	中青旅	2,188,307.00	0.83
19	002353	杰瑞股份	2,116,837.00	0.80
20	300014	亿纬锂能	2,056,832.00	0.78

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	603501	韦尔股份	4,835,283.40	1.83
2	600183	生益科技	3,478,234.00	1.32
3	002157	正邦科技	3,236,352.00	1.23
4	002004	华邦健康	3,233,614.79	1.23
5	603063	禾望电气	2,997,955.00	1.14
6	300115	长盈精密	2,905,805.00	1.10
7	600062	华润双鹤	2,813,597.60	1.07
8	002607	中公教育	2,772,418.34	1.05
9	600267	海正药业	2,690,769.00	1.02
10	002611	东方精工	2,569,471.00	0.97
11	601928	凤凰传媒	2,431,690.00	0.92
12	600939	重庆建工	2,352,726.00	0.89
13	002049	紫光国微	2,332,076.00	0.88
14	600584	长电科技	2,213,155.00	0.84
15	000301	东方盛虹	2,134,754.00	0.81
16	000829	天音控股	2,129,316.00	0.81
17	002707	众信旅游	2,027,317.00	0.77
18	603883	老百姓	2,026,915.16	0.77
19	000878	云南铜业	2,005,208.00	0.76
20	000686	东北证券	1,965,985.44	0.75

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	119,288,085.61
卖出股票收入（成交）总额	141,282,012.68

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	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。

### 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

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

#### 8.9.1 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。

### 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

本报告期本基金没有投资国债期货。

## 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。

### 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	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

### 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

本基金本报告期末指数投资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

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	688018	乐鑫科技	1,026,168.48	0.39	流通受限

### 8.11.6 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。

## § 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	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

### 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	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

### 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	-	-
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

### 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	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
11	000878	云南铜业	299,400	3,326,334.00	1.24
12	600376	首开股份	412,800	3,323,040.00	1.24
13	300207	欣旺达	221,300	3,312,861.00	1.24
14	600466	蓝光发展	485,780	3,274,157.20	1.22
15	600373	中文传媒	268,600	3,236,630.00	1.21
16	002004	华邦健康	658,800	3,195,180.00	1.19
17	000930	中粮科技	464,300	3,161,883.00	1.18
18	600388	龙净环保	320,200	3,144,364.00	1.17
19	002028	思源电气	240,500	3,128,905.00	1.17
20	000301	东方盛虹	589,000	3,062,800.00	1.14
21	600582	天地科技	945,700	3,026,240.00	1.13
22	002607	中公教育	149,500	2,992,990.00	1.12
23	600062	华润双鹤	224,200	2,948,230.00	1.10
24	002583	海能达	319,721	2,874,291.79	1.07
25	002500	山西证券	360,400	2,850,764.00	1.06
26	300026	红日药业	814,800	2,827,356.00	1.05
27	000027	深圳能源	447,600	2,810,928.00	1.05
28	000031	大悦城	375,900	2,721,516.00	1.01
29	002701	奥瑞金	624,100	2,708,594.00	1.01
30	002373	千方科技	149,900	2,701,198.00	1.01
31	600325	华发股份	356,037	2,688,079.35	1.00
32	600267	海正药业	250,300	2,660,689.00	0.99
33	300115	长盈精密	172,900	2,636,725.00	0.98
34	002049	紫光国微	50,500	2,636,100.00	0.98
35	002463	沪电股份	116,917	2,609,587.44	0.97
36	601928	凤凰传媒	347,200	2,593,584.00	0.97
37	600216	浙江医药	193,600	2,514,864.00	0.94
38	300002	神州泰岳	751,000	2,485,810.00	0.93
39	600939	重庆建工	512,800	2,369,136.00	0.88
40	002075	沙钢股份	337,700	2,336,884.00	0.87
41	600557	康缘药业	130,400	2,304,168.00	0.86



42	002250	联化科技	159,300	2,271,618.00	0.85
43	002242	九阳股份	88,300	2,269,310.00	0.85
44	000829	天音控股	360,300	2,262,684.00	0.84
45	002191	劲嘉股份	204,000	2,229,720.00	0.83
46	002544	杰赛科技	165,200	2,208,724.00	0.82
47	600739	辽宁成大	154,600	2,204,596.00	0.82
48	002019	亿帆医药	160,500	2,203,665.00	0.82
49	600779	水井坊	38,200	2,157,154.00	0.80
50	600392	盛和资源	253,200	2,126,880.00	0.79
51	000686	东北证券	246,500	2,080,460.00	0.78
52	603556	海兴电力	129,270	2,070,905.40	0.77
53	002707	众信旅游	371,400	2,035,272.00	0.76
54	600737	中粮糖业	220,600	1,972,164.00	0.74
55	002340	格林美	444,600	1,969,578.00	0.73
56	603369	今世缘	60,200	1,966,132.00	0.73
57	600536	中国软件	27,000	1,956,960.00	0.73
58	002387	维信诺	118,500	1,884,150.00	0.70
59	002390	信邦制药	314,500	1,861,840.00	0.69
60	601966	玲珑轮胎	88,500	1,854,075.00	0.69
61	000932	华菱钢铁	441,460	1,840,888.20	0.69
62	000983	西山煤电	311,500	1,791,125.00	0.67
63	600993	马应龙	94,100	1,779,431.00	0.66
64	300166	东方国信	142,300	1,777,327.00	0.66
65	002174	游族网络	122,600	1,771,570.00	0.66
66	600073	上海梅林	182,800	1,712,836.00	0.64
67	600645	中源协和	99,700	1,710,852.00	0.64
68	600143	金发科技	252,800	1,693,760.00	0.63
69	600901	江苏租赁	277,000	1,686,930.00	0.63
70	000848	承德露露	208,800	1,653,696.00	0.62
71	601000	唐山港	620,300	1,600,374.00	0.60
72	002244	滨江集团	347,100	1,509,885.00	0.56
73	000400	许继电气	161,100	1,482,120.00	0.55
74	600787	中储股份	264,200	1,416,112.00	0.53
75	600718	东软集团	125,400	1,410,750.00	0.53
76	600967	内蒙一机	132,400	1,384,904.00	0.52
77	600183	生益科技	56,600	1,358,400.00	0.51
78	601615	明阳智能	104,600	1,328,420.00	0.50
79	600879	航天电子	204,661	1,213,639.73	0.45
80	600008	首创股份	350,700	1,174,845.00	0.44

81	300274	阳光电源	115,600	1,169,872.00	0.44
82	002368	太极股份	34,100	1,136,894.00	0.42
83	600757	长江传媒	183,667	1,118,532.03	0.42
84	600755	厦门国贸	149,156	1,091,821.92	0.41
85	600598	北大荒	112,100	1,088,491.00	0.41
86	000729	燕京啤酒	172,600	1,078,750.00	0.40
87	002048	宁波华翔	70,200	1,022,112.00	0.38
88	603659	璞泰来	16,600	973,756.00	0.36
89	002152	广电运通	107,900	972,179.00	0.36
90	600970	中材国际	144,200	898,366.00	0.34
91	600138	中青旅	72,300	895,074.00	0.33
92	002093	国脉科技	100,400	881,512.00	0.33
93	603816	顾家家居	22,492	864,817.40	0.32
94	600875	东方电气	95,647	860,823.00	0.32
95	002745	木林森	77,400	860,688.00	0.32
96	600125	铁龙物流	146,800	860,248.00	0.32
97	002217	合力泰	154,100	827,517.00	0.31
98	601872	招商轮船	145,400	825,872.00	0.31
99	600167	联美控股	67,510	812,820.40	0.30
100	600026	中远海能	135,400	796,152.00	0.30
101	601128	常熟银行	87,100	794,352.00	0.30
102	002408	齐翔腾达	106,200	758,268.00	0.28
103	601969	海南矿业	138,400	755,664.00	0.28
104	603650	彤程新材	42,900	752,895.00	0.28
105	600584	长电科技	39,000	744,510.00	0.28
106	002371	北方华创	10,154	738,703.50	0.28
107	600643	爱建集团	78,400	733,824.00	0.27
108	000547	航天发展	68,700	688,374.00	0.26
109	601811	新华文轩	50,700	619,047.00	0.23
110	601326	秦港股份	186,500	602,395.00	0.22
111	601958	金钼股份	82,600	587,286.00	0.22
112	601098	中南传媒	48,500	571,815.00	0.21
113	002414	高德红外	25,000	534,750.00	0.20
114	600259	广晟有色	15,000	459,000.00	0.17
115	300088	长信科技	62,100	458,298.00	0.17
116	300450	先导智能	12,826	438,264.42	0.16
117	600329	中新药业	25,700	375,991.00	0.14
118	600985	淮北矿业	39,540	369,699.00	0.14
119	002572	索菲亚	20,500	360,185.00	0.13

120	002332	仙琚制药	39,200	346,920.00	0.13
121	601611	中国核建	45,100	313,445.00	0.12
122	601699	潞安环能	39,500	274,525.00	0.10
123	000807	云铝股份	59,200	274,096.00	0.10
124	002807	江阴银行	59,500	268,940.00	0.10
125	000598	兴蓉环境	52,600	251,428.00	0.09
126	601231	环旭电子	15,550	237,759.50	0.09
127	300383	光环新网	12,400	220,596.00	0.08
128	601311	骆驼股份	24,000	219,360.00	0.08
129	002128	露天煤业	25,400	207,010.00	0.08
130	600750	江中药业	14,800	202,316.00	0.08
131	002926	华西证券	18,897	186,891.33	0.07
132	603517	绝味食品	3,700	170,829.00	0.06
133	300001	特锐德	9,000	154,080.00	0.06
134	600335	国机汽车	23,400	136,422.00	0.05
135	603885	吉祥航空	8,900	135,636.00	0.05
136	002444	巨星科技	12,800	133,248.00	0.05

**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	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
6	300569	天能重工	74,000	1,087,060.00	0.41
7	300096	易联众	105,600	959,904.00	0.36
8	688016	心脉医疗	6,799	879,178.69	0.33
9	688018	乐鑫科技	6,264	810,874.80	0.30
10	688010	福光股份	17,276	712,980.52	0.27
11	300366	创意信息	60,400	623,932.00	0.23
12	688188	柏楚电子	6,277	605,416.65	0.23
13	601058	赛轮轮胎	127,300	567,758.00	0.21
14	688020	方邦股份	7,643	564,053.40	0.21
15	600704	物产中大	90,400	521,608.00	0.19
16	688005	容百科技	17,040	500,294.40	0.19
17	688321	微芯生物	13,328	494,335.52	0.18

18	688122	西部超导	15,715	452,434.85	0.17
19	000019	深粮控股	67,800	417,648.00	0.16
20	300129	泰胜风能	69,800	328,060.00	0.12
21	600546	山煤国际	48,800	327,936.00	0.12
22	002605	姚记科技	23,200	327,120.00	0.12
23	600153	建发股份	39,000	321,360.00	0.12
24	002082	万邦德	37,500	310,875.00	0.12
25	600405	动力源	57,100	259,234.00	0.10
26	300737	科顺股份	23,100	252,483.00	0.09
27	688128	中国电研	9,027	221,703.12	0.08
28	300006	莱美药业	45,100	214,676.00	0.08
29	002045	国光电器	20,900	207,746.00	0.08
30	688023	安恒信息	2,728	196,470.56	0.07
31	688369	致远互联	2,970	170,359.20	0.06
32	603611	诺力股份	9,000	159,390.00	0.06
33	688299	长阳科技	11,341	155,485.11	0.06
34	300648	星云股份	9,200	147,844.00	0.06
35	601628	中国人寿	4,000	143,000.00	0.05
36	600057	厦门象屿	31,700	134,408.00	0.05
37	600667	太极实业	18,900	134,001.00	0.05
38	002204	大连重工	41,200	133,900.00	0.05
39	002564	天沃科技	28,300	133,859.00	0.05
40	002130	沃尔核材	28,700	133,742.00	0.05
41	300578	会畅通讯	5,400	132,462.00	0.05
42	688058	宝兰德	1,450	121,046.00	0.05
43	688389	普门科技	6,931	113,113.92	0.04
44	688021	奥福环保	2,940	76,939.80	0.03
45	603489	八方股份	701	30,451.44	0.01
46	002967	广电计量	2,723	20,231.89	0.01
47	300797	钢研纳克	1,582	12,402.88	0.00
48	300564	筑博设计	497	11,276.93	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	600699	均胜电子	9,968,436.73	5.91
2	000686	东北证券	8,015,013.00	4.76

3	600673	东阳光	7,602,253.00	4.51
4	002195	二三四五	7,596,878.39	4.51
5	000401	冀东水泥	6,754,462.89	4.01
6	000031	大悦城	6,634,986.00	3.94
7	600079	人福医药	6,610,772.00	3.92
8	002157	正邦科技	6,403,936.00	3.80
9	600388	龙净环保	6,061,460.97	3.60
10	600739	辽宁成大	5,898,537.00	3.50
11	002004	华邦健康	5,884,070.89	3.49
12	600166	福田汽车	5,815,467.00	3.45
13	600373	中文传媒	5,683,585.20	3.37
14	002465	海格通信	5,662,011.00	3.36
15	002373	千方科技	5,565,800.13	3.30
16	002384	东山精密	5,518,571.64	3.27
17	600073	上海梅林	5,454,366.00	3.24
18	000930	中粮科技	5,354,016.75	3.18
19	600536	中国软件	5,263,618.00	3.12
20	600416	湘电股份	5,240,083.95	3.11
21	002353	杰瑞股份	5,197,149.18	3.08
22	002745	木林森	5,155,724.00	3.06
23	601928	凤凰传媒	5,056,128.52	3.00
24	600729	重庆百货	5,019,174.21	2.98
25	600466	蓝光发展	4,846,087.86	2.88
26	002028	思源电气	4,822,474.62	2.86
27	000997	新大陆	4,779,621.80	2.84
28	002250	联化科技	4,771,493.92	2.83
29	002152	广电运通	4,616,195.41	2.74
30	600755	厦门国贸	4,602,425.42	2.73
31	600985	淮北矿业	4,542,069.78	2.69
32	601231	环旭电子	4,463,210.77	2.65
33	601717	郑煤机	4,350,364.34	2.58
34	002583	海能达	4,235,120.81	2.51
35	600062	华润双鹤	4,095,459.24	2.43
36	600376	首开股份	4,084,154.42	2.42
37	600169	太原重工	4,072,988.00	2.42
38	000656	金科股份	4,067,667.60	2.41

39	600499	科达洁能	4,012,634.38	2.38
40	000975	银泰黄金	3,781,755.33	2.24
41	002416	爱施德	3,780,525.60	2.24
42	600410	华胜天成	3,773,940.00	2.24
43	603369	今世缘	3,715,361.08	2.20
44	000829	天音控股	3,708,892.99	2.20
45	601958	金钼股份	3,705,681.50	2.20
46	002387	维信诺	3,703,651.30	2.20
47	603501	韦尔股份	3,670,341.00	2.18
48	002611	东方精工	3,621,745.00	2.15
49	600655	豫园股份	3,606,140.20	2.14
50	600645	中源协和	3,572,213.47	2.12
51	002589	瑞康医药	3,481,876.67	2.07
52	002049	紫光国微	3,437,121.00	2.04
53	002544	杰赛科技	3,422,318.00	2.03
54	300207	欣旺达	3,403,175.00	2.02
55	600392	盛和资源	3,386,443.17	2.01

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	002195	二三四五	7,871,758.08	4.67
2	600673	东阳光	7,366,024.00	4.37
3	000031	大悦城	6,944,718.03	4.12
4	600699	均胜电子	6,783,538.90	4.02
5	600755	厦门国贸	6,109,470.54	3.62
6	600416	湘电股份	6,103,963.72	3.62
7	000686	东北证券	5,913,491.83	3.51
8	300010	立思辰	5,904,456.75	3.50
9	601717	郑煤机	5,886,645.22	3.49
10	600388	龙净环保	5,734,331.50	3.40
11	000656	金科股份	5,654,195.00	3.35
12	002745	木林森	5,604,804.00	3.33
13	601231	环旭电子	5,447,900.42	3.23

14	600536	中国软件	5,349,014.06	3.17
15	600166	福田汽车	5,330,878.00	3.16
16	300088	长信科技	5,138,506.00	3.05
17	300113	顺网科技	5,083,913.39	3.02
18	002152	广电运通	4,995,740.46	2.96
19	600410	华胜天成	4,747,462.40	2.82
20	600053	九鼎投资	4,737,620.30	2.81
21	600062	华润双鹤	4,302,096.04	2.55
22	002416	爱施德	4,060,785.89	2.41
23	000513	丽珠集团	4,048,030.04	2.40
24	600739	辽宁成大	3,986,198.57	2.37
25	000078	海王生物	3,984,258.00	2.36
26	002400	省广集团	3,962,162.00	2.35
27	600079	人福医药	3,935,192.00	2.33
28	002589	瑞康医药	3,929,385.00	2.33
29	002155	湖南黄金	3,847,048.00	2.28
30	600073	上海梅林	3,845,102.34	2.28
31	603000	人民网	3,832,049.00	2.27
32	000930	中粮科技	3,793,124.39	2.25
33	002353	杰瑞股份	3,734,089.00	2.22
34	600169	太原重工	3,707,197.50	2.20
35	600655	豫园股份	3,704,473.12	2.20
36	002250	联化科技	3,703,757.00	2.20
37	600985	淮北矿业	3,700,559.00	2.20
38	600466	蓝光发展	3,697,868.06	2.19
39	600499	科达洁能	3,692,320.00	2.19
40	300315	掌趣科技	3,687,307.00	2.19
41	000975	银泰黄金	3,662,728.56	2.17
42	000887	中鼎股份	3,618,778.74	2.15
43	002373	千方科技	3,572,368.59	2.12
44	300146	汤臣倍健	3,512,354.00	2.08
45	000600	建投能源	3,503,617.87	2.08
46	603077	和邦生物	3,418,081.00	2.03
47	600160	巨化股份	3,403,651.30	2.02
48	600657	信达地产	3,375,067.90	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。

### 8.4.3 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	732,636,773.95
卖出股票收入（成交）总额	692,794,531.48

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	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。

### 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

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。

## 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

本报告期本基金没有投资国债期货。

## 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。

### 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	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

#### **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**

本基金本报告期末指数投资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**

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。

#### **8.12.6 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。

## § 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

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
32,439	8,083.10	106,073,836.85	40.45%	156,133,724.27	59.55%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额 比例
1	龚雪松	314,557.00	6.03%
2	谭文英	138,943.00	2.66%
3	姜卫平	133,528.00	2.56%
4	傅新彩	126,271.00	2.42%
5	张志平	111,187.00	2.13%
6	刘忠吉	110,205.00	2.11%
7	沈雁	105,100.00	2.01%
8	马超	92,696.00	1.78%
9	田红梅	91,150.00	1.75%
10	杨凯	83,259.00	1.60%

注：持有人为本基金场内持有人。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	121,115.57	0.0462%

### 9.4 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 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 500A	142	17,679.66	35,168.00	1.40%	2,475,344.00	98.60%
泰达 500B	433	8,696.92	828.00	0.02%	3,764,940.00	99.98%
泰达中证 500	33,269	8,323.32	124,517,659.36	44.97%	152,390,792.18	55.03%
合计	33,844	8,367.35	124,553,655.36	43.98%	158,631,076.18	56.02%

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	黄健立	1,019,056.00	40.59%
2	赵从志	268,876.00	10.71%
3	黄晖	120,760.00	4.81%
4	谭文英	117,800.00	4.69%
5	张晓熊	103,512.00	4.12%
6	刘辉荣	100,000.00	3.98%
7	丁延钊	89,700.00	3.57%
8	梁小红	80,000.00	3.19%
9	庞剑锋	50,000.00	1.99%
10	谭莲英	40,000.00	1.59%

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	4.33%
2	傅新彩	136,280.00	3.62%
3	董晓庄	125,700.00	3.34%
4	张志平	120,000.00	3.19%
5	马超	100,044.00	2.66%
6	田红梅	98,375.00	2.61%
7	尹粤蓉	79,300.00	2.11%
8	丁强	60,400.00	1.60%

9	孙慧贤	60,000.00	1.59%
10	程艳萍	59,292.00	1.57%

泰达中证 500

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	国信证券股份有限公司	7,649,365.00	86.05%
2	龚雪松	314,557.00	3.54%
3	姜卫平	133,528.00	1.50%
4	刘忠吉	110,205.00	1.24%
5	郎虹	62,054.00	0.70%
6	曹小东	26,343.00	0.30%
7	陈海东	24,367.00	0.27%
8	郭莉芬	19,000.00	0.21%
9	都本有	17,849.00	0.20%
10	黄晖	16,500.00	0.19%

注：持有人为本基金场内持有人。

9.3 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	69,841.30	0.0252%
	合计	69,841.30	0.0247%

9.4 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

## § 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	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)	-
本报告期末基金份额总额	262,207,561.12

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（2019年11月6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 500A	泰达 500B	泰达中证 500
基金转型日(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	-	-	232,722,328.84
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	181,243,376.54
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-307,488.00	-461,232.00	7,023,403.07
本报告期期末基金份额总额	2,510,512.00	3,765,768.00	276,908,450.54

注：上述本报告期期末基金份额总额为 2019 年 11 月 5 日（基金转型前最后运作日）的基金份额总额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

2019 年 9 月 27 日基金份额持有人大会审议并表决通过《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。

### 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 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、本公司于 2019 年 8 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》，刘建先生不再担任公司总经理，由公司副总经理傅国庆先生代任总经理。

3、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。

4、2019 年 6 月，刘连舸先生任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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本年度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。

### 11.4 基金投资策略的改变

根据 2019 年 9 月 27 日基金份额持有人大会决议，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，本基金投资策略发生改变。

### 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)审计费用为人民币 90,000 元，该审计机构对本基金提供审计服务的连续年限为 8 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

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。

## 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	
东方证券	4	57,291,018.72	22.14%	53,354.05	22.14%	-
东吴证券	1	55,039,913.28	21.27%	51,260.26	21.27%	-
光大证券	1	47,808,222.98	18.48%	44,527.09	18.48%	-
天风证券	1	38,894,669.59	15.03%	36,223.86	15.03%	-
东北证券	2	20,039,909.90	7.74%	18,663.63	7.74%	-
方正证券	1	19,782,323.68	7.65%	18,423.53	7.65%	-
广发证券	2	10,557,776.36	4.08%	9,830.64	4.08%	-
中信建投	2	8,530,974.53	3.30%	7,945.09	3.30%	-
西南证券	2	814,685.00	0.31%	758.76	0.31%	-
招商证券	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	-	-	-	-	-
太平洋	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

长城证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期内（2019 年 11 月 6 日至 2019 年 12 月 31 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

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
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	301,500.00	100.00%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-

### 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	
光大证券	1	269,182,534.51	19.09%	250,702.76	19.09%	-
太平洋	2	207,560,718.06	14.72%	193,303.33	14.72%	-

东北证券	2	149,839,848.59	10.62%	139,539.89	10.62%	-
东吴证券	1	147,824,310.60	10.48%	137,674.42	10.48%	-
长江证券	1	147,656,367.69	10.47%	137,512.15	10.47%	-
天风证券	1	144,868,297.25	10.27%	134,916.98	10.27%	-
西南证券	2	113,620,517.91	8.06%	105,814.88	8.06%	-
中信建投	2	89,417,363.14	6.34%	83,276.30	6.34%	-
银河证券	2	53,807,187.22	3.82%	50,110.85	3.82%	-
中泰证券	1	41,972,916.26	2.98%	39,086.73	2.98%	-
财富证券	2	37,326,626.37	2.65%	34,761.83	2.65%	-
国泰君安	1	5,241,337.16	0.37%	4,881.23	0.37%	-
东方证券	4	1,806,270.07	0.13%	1,682.61	0.13%	-
广发证券	2	227,127.16	0.02%	211.52	0.02%	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-

注：(一)本基金本报告期内(2019年1月1日至2019年11月5日)本基金撤销中金公司 393987、安信证券 390408 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**

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
光大证券	3,717,390.00	27.70%	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	9,258,032.00	68.98%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	363,452.40	2.71%	-	-	-	-
银河证券	82,443.50	0.61%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

天源证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-

**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	《泰达宏利基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》	证券时报	2019 年 11 月 22 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	《泰达宏利基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》	证券时报	2019 年 1 月 10 日
2	《泰达宏利基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》	证券时报	2019 年 1 月 25 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

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	20190101~20191231	63,950,986.55	1,772,984.81	0.00	65,723,971.36	25.07%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

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、本公司于 2019 年 9 月 16 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于住所变更的公告》，自 2019 年 9 月 16 日起，公司住所由“北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层”变更为“北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元”。
- 2、本公司根据中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及监管规定，对本基金基金合同、托管协议及招募说明书中与信息披露相关的条款进行了修订，并于 2019 年 12 月 24 日，在中国证监会指定网站进行了公告。

## § 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

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。

投资者对本报告书如有疑问, 可咨询本基金管理人泰达宏利基金管理有限公司: 客户服务中心电话: 400-698-8888 或 010-66555662。

泰达宏利基金管理有限公司

2020 年 4 月 30 日