

# 泰达宏利行业精选混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 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>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	39
7.7 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.....	39
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	39
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39

7.12 投资组合报告附注.....	40
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	错误! 未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	42
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>42</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	错误! 未定义书签。
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>错误! 未定义书签。</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>45</b>
12.1 备查文件目录.....	45
12.2 存放地点.....	45
12.3 查阅方式.....	45

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利行业精选混合型证券投资基金
基金简称	泰达宏利行业混合
基金主代码	162204
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 7 月 9 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	168,686,387.89 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	追求资本的长期持续增值，为投资者寻求高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	全面引进荷兰银行的投资管理流程，采用“自上而下”资产配置和行业类别与行业配置，“自下而上”精选股票的投资策略，主要投资于具有国际、国内竞争力比较优势和长期增值潜力的行业 and 企业的股票。
业绩比较基准	70%×富时中国 A600 指数收益率+30%×中债国债总指数（财富）
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于风险较高的基金品种

### 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	陈沛	王永民
	联系电话	010-66577808	010-66594896
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-69-88888	95566
传真		010-66577666	010-66594942
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层	北京市西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码	100033	100818
法定代表人	弓劲梅	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http:// www.mfcteda.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泰达宏利基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	-174, 375, 429. 47
本期利润	-160, 143, 382. 72
加权平均基金份额本期利润	-0. 9290
本期加权平均净值利润率	-31. 63%
本期基金份额净值增长率	-20. 87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2016 年 6 月 30 日 )
期末可供分配利润	352, 380, 313. 86
期末可供分配基金份额利润	2. 0890
期末基金资产净值	524, 844, 023. 01
期末基金份额净值	3. 1114
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2016 年 6 月 30 日 )
基金份额累计净值增长率	439. 64%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

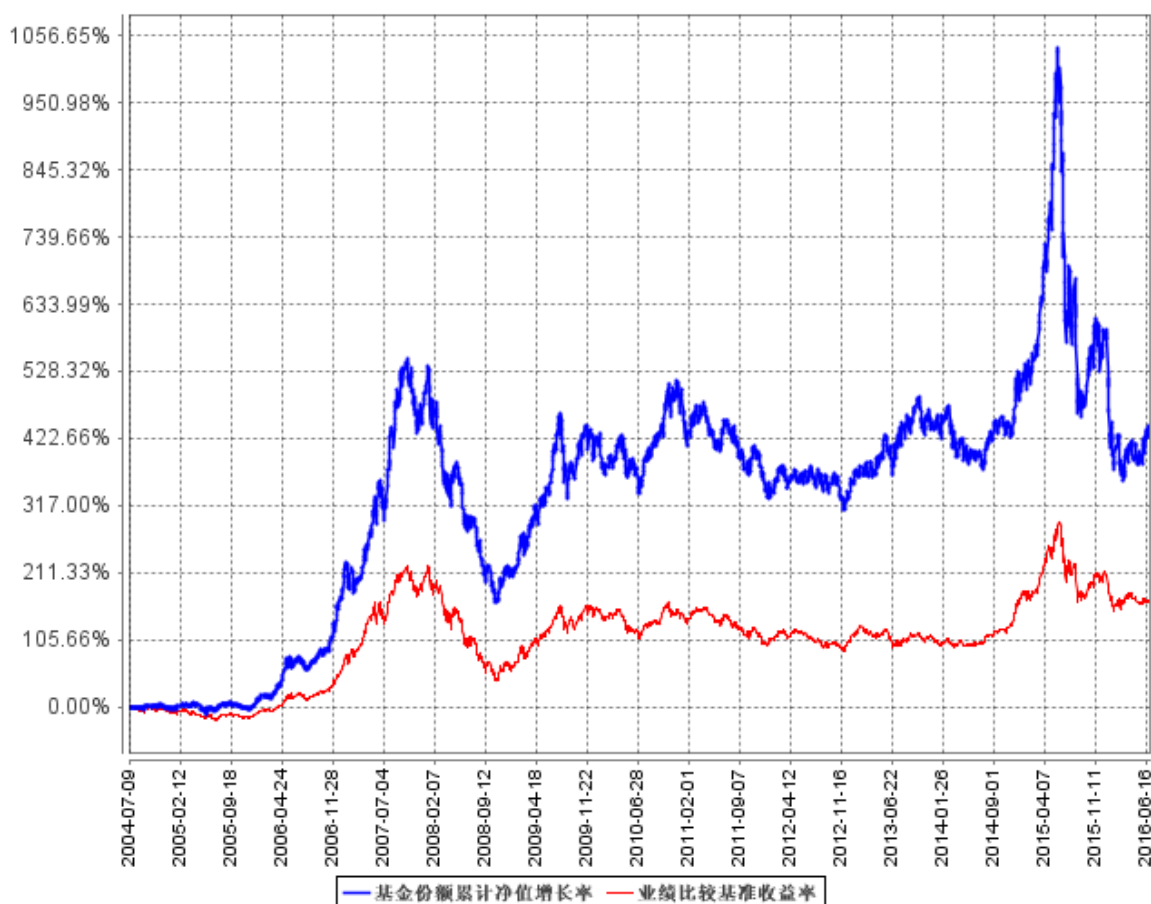
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.80%	1.70%	-0.26%	0.73%	8.06%	0.97%
过去三个月	7.26%	1.62%	-2.19%	0.78%	9.45%	0.84%
过去六个月	-20.87%	2.38%	-12.10%	1.34%	-8.77%	1.04%
过去一年	-36.30%	2.62%	-21.35%	1.61%	-14.95%	1.01%
过去三年	12.73%	2.04%	36.49%	1.27%	-23.76%	0.77%
自基金合同生效起至今	439.64%	1.68%	169.21%	1.29%	270.43%	0.39%

注：本基金业绩比较基准：70%×富时中国 A600 指数+30%×中债国债总指数（财富）。富时中国 A600 指数是富时指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所总市值最大的 600 只股票并以流通股本加权的股票指数，具有良好的市场代表性。中债国债总指数（财富）是中央国债登记结算有限责任公司推出的中国国债总指数，该指数基于全市场角度编制的指数，价格选取上更侧重于全国银行间债券市场，选样广泛，全面而细致反映债券市场变动。

### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月，是中国首批合资基金管理公司之一。截至报告期末本公司股东及持股比例分别为：北方国际信托股份有限公司：51%；宏利资产管理（香港）有限公司：49%。

目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金（LOF）、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基



金、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）、泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利收益增强债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利养老收益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证券投资基金、泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利活期友货币市场基金、泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利多元回报债券型证券投资基金、泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金在内的三十多只证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈丹琳	本基金基金经理	2015 年 4 月 3 日	-	9	毕业于中国人民大学，经济学硕士，CFA、CPA；2007 年 7 月加入泰达宏利基金管理有限公司，曾担任研究员、研究主管、研究部总经理助理等职务；具备 9 年证券投资管理经验，9 年基金从业经验，具有基金从业资格。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控，风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估，向公司风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。监察稽核部定期对异常交易制度的执行和控制工作进行稽核。本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况共出现了 2 次。2 次涉及的投资组合一方均为按照量化策略进行投资，虽然买卖股票量少，但由于个股流动性较差，交易量小，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%，未发现异常。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构处罚的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年沪深 300 下跌 15.47%，振幅达到 24.26%。回顾上半年波动巨大的市场里的行业表现，食品饮料、有色金属、银行、家电、煤炭涨幅居于前五，零售、计算机、交通运输、餐饮旅游、传媒跌幅居于前五。

从宏观经济角度来看，1 月份 2.5 万亿信贷对于经济复苏的预期给予了极大的支撑，加上去年下半年以来的地产销售恢复，一季度经济复苏迹象明显。另外全部 A 股的一季报和中报预报的利润增长率也明显好于 2015 年年报，从中微观层面印证了经济企稳的判断。从全球大类资产表现看，上半年表现最好的是商品，CRB 商品指数上涨 10%，而债券的表现也让人惊艳，美国的 10 年期国债收益率逼近 1.3%，日本的 10 年期国债收益率则进入负值区间。美股虽然经历就业数据不

理想、英国脱欧等利空，但也创出了历史新高。全球代表性商品、债券、股票资产同时上涨，让我们重新思考全球低增长率+流动性泛滥背景下的资产和行业配置特点——低成长率、高确定性标的变得更加有吸引力。

本基金在年初时，仓位中性偏高，重点配置在通信和传媒上，由于估值偏高、预期透支，因此在下跌过程中受伤较为严重。从 1 月底开始，行业配置趋于均衡，重点优选个股，增加了养殖、维生素为代表的周期价格上涨的标的，增加了新能源汽车产业链的配置，净值有所恢复。但对低成长率、高确定性的品种估值提升的情况估计不足，对有色、煤炭类周期品种配置也偏低。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 3.1114，份额净值增长率为-20.87%，业绩比较基准增长率为-12.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们预计经济增速将呈现平稳的低速增长态势，宏观政策保持托稳状态，资金面脱虚入实的政策引导力度会加大。企业盈利方面，略有恢复的盈利将对基本面提供支持。鉴于以上原因，我们认为下半年的证券市场并不悲观。但考虑到上半年市场结构性行情非常明显，既有 OLED、半导体、量子通信等主题类机会，也有 GARP 类行业如食品饮料和家电的亮眼表现，煤炭有色等周期类行业也取得不俗的相对收益，因此我们认为下半年的投资机会主要来源于自下而上精选有盈利支持的成长企业，而非自上而下的行业配置和主题配置。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的副总经理负责，成员包括督察长、投资总监、研究部、固定收益部、金融工程部、风险管理部、基金运营部的相关人员，均具有丰富的专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力。

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同及基金的实际运作情况，本基金于本报告期内未进行收益分配。

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

本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

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

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

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

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利行业精选混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	48,569,966.12	48,795,555.39

结算备付金		2,681,465.02	7,928,499.82
存出保证金		477,609.33	880,713.83
交易性金融资产	6.4.7.2	459,858,133.85	784,279,098.85
其中：股票投资		433,846,509.15	727,636,191.65
基金投资		-	-
债券投资		26,011,624.70	56,642,907.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		16,191,803.03	-
应收利息	6.4.7.5	270,544.79	894,655.71
应收股利		-	-
应收申购款		46,076.30	47,669.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		528,095,598.44	842,826,193.19
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	27,228.00
应付赎回款		710,620.52	284,450.80
应付管理人报酬		628,512.21	1,055,789.65
应付托管费		104,752.07	175,964.95
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,602,335.77	3,281,629.54
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	205,354.86	108,465.53
负债合计		3,251,575.43	4,933,528.47
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	168,686,387.89	213,107,315.33
未分配利润	6.4.7.10	356,157,635.12	624,785,349.39
所有者权益合计		524,844,023.01	837,892,664.72
负债和所有者权益总计		528,095,598.44	842,826,193.19

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.1114 元，基金份额总额 168,686,387.89 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰达宏利行业精选混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-150,467,725.52	546,660,045.93
1.利息收入		1,000,215.52	901,972.25
其中：存款利息收入	6.4.7.11	237,646.21	456,241.41
债券利息收入		762,569.31	416,913.30
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	28,817.54
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-165,868,310.39	748,181,183.01
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-167,237,807.31	745,408,953.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-108,300.00	-23,430.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,477,796.92	2,795,659.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	14,232,046.75	-203,379,765.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	168,322.60	956,656.64
<b>减：二、费用</b>		9,675,657.20	28,542,493.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,799,689.04	11,083,414.29
2. 托管费	6.4.10.2.2	633,281.55	1,847,235.76
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,013,840.82	15,361,876.11
5. 利息支出		-	9,340.48
其中：卖出回购金融资产支出		-	9,340.48
6. 其他费用	6.4.7.20	228,845.79	240,626.88
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-160,143,382.72	518,117,552.41
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-160,143,382.72	518,117,552.41

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利行业精选混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	213,107,315.33	624,785,349.39	837,892,664.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-160,143,382.72	-160,143,382.72
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)	-44,420,927.44	-108,484,331.55	-152,905,258.99
其中：1.基金申购款	8,110,800.39	15,913,898.76	24,024,699.15
2.基金赎回款	-52,531,727.83	-124,398,230.31	-176,929,958.14
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)	168,686,387.89	356,157,635.12	524,844,023.01
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	539,607,753.76	1,346,790,602.49	1,886,398,356.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	518,117,552.41	518,117,552.41
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)	-305,463,720.06	-955,402,852.25	-1,260,866,572.31
其中：1.基金申购款	51,735,647.93	206,308,418.14	258,044,066.07
2.基金赎回款	-357,199,367.99	-1,161,711,270.39	-1,518,910,638.38
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)	234,144,033.70	909,505,302.65	1,143,649,336.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

泰达宏利行业精选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”，原湘财荷银行业精选证券投资基金，后更名为泰达荷银行业精选证券投资基金，后更名为泰达宏利行业精选证券投资基金)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2004]第 58 号《关于同意湘财荷银行业精选证券投资基金设立的批复》核准，由基金发起人湘财荷银基金管理有限公司(于 2006 年 4 月 27 日更名为泰达荷银基金管理有限公司，于 2010 年 3 月 9 日更名为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《湘财荷银行业精选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 2,016,372,878.75 元，业经普华永道中天会计师事务所普华永道中天验字(2004)第 108 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《湘财荷银行业精选证券投资基金基金合同》于 2004 年 7 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,017,034,173.30 份基金份额，其中认购资金利息折合 661,294.55 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”)。

经中国证监会同意，本基金于 2006 年 6 月 6 日更名为泰达荷银行业精选证券投资基金。根据本基金的基金管理人 2010 年 3 月 17 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于变更旗下公募基金名称的公告》，本基金自公告发布之日起更名为泰达宏利行业精选证券投资基金。根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，泰达宏利行业精选股票型证券投资基金于 2015 年 7 月 30 日公告后更名为泰达宏利行业精选混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利行业精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票、债券，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票投资比例为基金资产净值的 60%-95%，债券投资比例为基金资产净值的 0%-35%，现金及现金等价物投资比例为基金资产净值的 5%-30%。在相关法规允许



的前提下，股票投资范围最高可以达到基金资产净值的 100%。本基金的业绩比较基准为：富时中国 A600 指数收益率×70%+中债国债总指数(财富)×30%。

本财务报表由本基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司于 2016 年 8 月 29 日批准报出。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利行业精选混合型证券投资基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2016 年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期内无会计政策的变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期内无会计估计的变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》[适用于 CEF]/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》[适用于 OEF]、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，股权的股息、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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	48,569,966.12
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	48,569,966.12

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		383,300,795.80	433,846,509.15	50,545,713.35
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	25,186,193.96	26,011,624.70	825,430.74
	银行间市场	-	-	-
	合计	25,186,193.96	26,011,624.70	825,430.74
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		408,486,989.76	459,858,133.85	51,371,144.09

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产和负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末买入返售金融资产无余额。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	7,922.78
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	1,086.03
应收债券利息	261,342.16
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.32
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	193.50
合计	270,544.79

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,602,335.77
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,602,335.77

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,472.18
预提费用	202,882.68
合计	205,354.86

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	213,107,315.33	213,107,315.33
本期申购	8,110,800.39	8,110,800.39
本期赎回(以“-”号填列)	-52,531,727.83	-52,531,727.83
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	168,686,387.89	168,686,387.89

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	660,637,386.38	-35,852,036.99	624,785,349.39
本期利润	-174,375,429.47	14,232,046.75	-160,143,382.72
本期基金份额交易产生的变动数	-133,881,643.05	25,397,311.50	-108,484,331.55
其中：基金申购款	20,047,739.41	-4,133,840.65	15,913,898.76

基金赎回款	-153,929,382.46	29,531,152.15	-124,398,230.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	352,380,313.86	3,777,321.26	356,157,635.12

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	207,209.73
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	23,349.38
其他	7,087.10
合计	237,646.21

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	1,697,168,331.69
减：卖出股票成本总额	1,864,406,139.00
买卖股票差价收入	-167,237,807.31

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30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	-108,300.00
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	-108,300.00

### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	30,957,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	30,108,300.00
减：应收利息总额	957,000.00
买卖债券差价收入	-108,300.00

### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-赎回差价收入。

### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-申购差价收入。

### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

#### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

#### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回贵金属差价收入。

#### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购贵金属差价收入。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

#### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,477,796.92
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,477,796.92

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	14,232,046.75
——股票投资	14,755,029.25
——债券投资	-522,982.50
——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	-
合计	14,232,046.75

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	168,322.60
其他	-
印花税手续费返还	-
合计	168,322.60

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
----	----------------------------

交易所市场交易费用	5,013,840.82
银行间市场交易费用	-
合计	5,013,840.82

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	53,704.56
信息披露费	149,178.12
其他	800.00
帐户维护费	18,000.00
银行费用	7,163.11
合计	228,845.79

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期无或有事项。

##### 6.4.8.2 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。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期没有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。



## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 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方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 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方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 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方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 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方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,799,689.04	11,083,414.29
其中：支付销售机构的客户维护费	574,997.83	1,388,960.26

注：支付基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%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 1.5% / 当年天数。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	633,281.55	1,847,235.76

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 0.25%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 0.25% / 当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 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。

#### 6.4.10.4.2 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。

### 6.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	48,569,966.12	207,209.73	251,088,163.04	376,304.31

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

#### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	3,780	49,064.40	49,064.40	-

			日							
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300503	昊志机电	2016年6月30日	重大事项	84.72	2016年7月5日	82.99	188,313	13,036,012.86	15,953,877.36	-
000638	万方发展	2016年1月5日	重大事项	23.65	2016年7月25日	24.75	668,157	15,767,141.90	15,801,913.05	-
300080	易成新能	2016年5月19日	重大事项	7.76	-	-	539,700	4,851,555.76	4,188,072.00	-
002569	步森股份	2016年1月4日	重大事项停牌	43.64	2016年7月19日	39.28	13,400	233,972.50	584,776.00	-
601611	中国核建	2016年6月30日	临时停牌	20.92	2016年7月1日	23.01	12,403	43,038.41	259,470.76	-
300508	维宏股份	2016年6月30日	重大事项	254.50	2016年7月6日	242.00	970	19,477.60	246,865.00	-
601900	南方传媒	2016年6月6日	重大事项	17.67	-	-	13,027	79,855.51	230,187.09	-
603919	金徽酒	2016年6月	重大事项	30.90	2016年7月	33.99	6,604	72,247.76	204,063.60	-

		7 日			5 日				
--	--	-----	--	--	-----	--	--	--	--

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 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。

#### 6.4.12.3.2 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

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

#### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的信用债券占基金资产净值的比例为 0.51% (2015 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的信用债券占基金资产净值的比例为 0.37%)。

#### 6.4.13.3 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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大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，因此均能及时变现。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。

于 2016 年 6 月 30 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。

### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	48,569,966.12	-	-	-	48,569,966.12
结算备付金	2,681,465.02	-	-	-	2,681,465.02
存出保证金	477,609.33	-	-	-	477,609.33
交易性金融资产	-	2,661,297.70	23,350,327.00	433,846,509.15	459,858,133.85
应收证券清算款	-	-	-	16,191,803.03	16,191,803.03
应收利息	-	-	-	270,544.79	270,544.79
应收申购款	-	-	-	46,076.30	46,076.30
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	51,729,040.47	2,661,297.70	23,350,327.00	450,354,933.27	528,095,598.44
负债					
应付赎回款	-	-	-	710,620.52	710,620.52
应付管理人报酬	-	-	-	628,512.21	628,512.21
应付托管费	-	-	-	104,752.07	104,752.07
应付交易费用	-	-	-	1,602,335.77	1,602,335.77
其他负债	-	-	-	205,354.86	205,354.86

负债总计	-	-	-	3,251,575.43	3,251,575.43
利率敏感度缺口	51,729,040.47	2,661,297.70	23,350,327.00	447,103,357.84	524,844,023.01
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	48,795,555.39	-	-	-	48,795,555.39
结算备付金	7,928,499.82	-	-	-	7,928,499.82
存出保证金	880,713.83	-	-	-	880,713.83
交易性金融资产	30,087,000.00	-	-26,555,907.20	727,636,191.65	784,279,098.85
应收利息	-	-	-	894,655.71	894,655.71
应收申购款	-	-	-	47,669.59	47,669.59
资产总计	87,691,769.04	-	-26,555,907.20	728,578,516.95	842,826,193.19
负债					
应付证券清算款	-	-	-	27,228.00	27,228.00
应付赎回款	-	-	-	284,450.80	284,450.80
应付管理人报酬	-	-	-	1,055,789.65	1,055,789.65
应付托管费	-	-	-	175,964.95	175,964.95
应付交易费用	-	-	-	3,281,629.54	3,281,629.54
其他负债	-	-	-	108,465.53	108,465.53
负债总计	-	-	-	4,933,528.47	4,933,528.47
利率敏感度缺口	87,691,769.04	-	-26,555,907.20	723,644,988.48	837,892,664.72

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 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% (2015 年 12 月 31 日：6.76%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 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。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 60%-95%，债券资产占基金资产净值的 0%-35%，现金占基金资产净值的 5%-30%，在相关法规允许的前提下，基金股票投资范围最高可以达到基金资产净值的 100%。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。

#### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	433,846,509.15	82.66	727,636,191.65	86.84
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	433,846,509.15	82.66	727,636,191.65	86.84

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	24,920,000.00	35,940,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-24,920,000.00	-35,940,000.00



#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

### § 7 投资组合报告

#### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	433,846,509.15	82.15
	其中：股票	433,846,509.15	82.15
2	固定收益投资	26,011,624.70	4.93
	其中：债券	26,011,624.70	4.93
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	51,251,431.14	9.70
7	其他各项资产	16,986,033.45	3.22
8	合计	528,095,598.44	100.00

#### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

##### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	27,221,421.06	5.19
B	采矿业	5,175,962.82	0.99
C	制造业	354,448,310.61	67.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	485,994.07	0.09
F	批发和零售业	15,801,913.05	3.01
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	25,762,706.40	4.91

J	金融业	218,011.95	0.04
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	136,807.85	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	4,275,404.00	0.81
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	276,808.34	0.05
S	综合	43,169.00	0.01
	合计	433,846,509.15	82.66

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600570	恒生电子	350,700	23,416,239.00	4.46
2	300073	当升科技	338,403	22,652,696.82	4.32
3	603601	再升科技	467,710	22,510,882.30	4.29
4	002079	苏州固锟	1,817,800	20,304,826.00	3.87
5	000911	南宁糖业	751,077	18,837,011.16	3.59
6	002108	沧州明珠	721,863	18,696,251.70	3.56
7	600584	长电科技	824,700	16,733,163.00	3.19
8	300503	昊志机电	188,313	15,953,877.36	3.04
9	000638	万方发展	668,157	15,801,913.05	3.01
10	600667	太极实业	1,579,300	15,777,207.00	3.01
11	002234	民和股份	468,154	13,768,409.14	2.62
12	300390	天华超净	792,100	13,671,646.00	2.60
13	300491	通合科技	130,300	13,509,504.00	2.57
14	002746	仙坛股份	322,769	13,453,011.92	2.56
15	002626	金达威	781,500	13,168,275.00	2.51
16	002582	好想你	277,562	10,969,250.24	2.09

17	601799	星宇股份	238,000	10,905,160.00	2.08
18	002035	华帝股份	435,752	10,667,208.96	2.03
19	000969	安泰科技	752,950	10,563,888.50	2.01
20	603609	禾丰牧业	660,515	10,455,952.45	1.99
21	000418	小天鹅 A	319,999	10,438,367.38	1.99
22	300054	鼎龙股份	412,300	10,315,746.00	1.97
23	002580	圣阳股份	523,701	9,929,370.96	1.89
24	300198	纳川股份	594,100	9,559,069.00	1.82
25	600884	杉杉股份	530,330	9,126,979.30	1.74
26	300007	汉威电子	286,900	8,010,248.00	1.53
27	002056	横店东磁	453,514	7,709,738.00	1.47
28	002340	格林美	842,000	7,384,340.00	1.41
29	300398	飞凯材料	76,600	5,729,680.00	1.09
30	300260	新莱应材	153,300	5,497,338.00	1.05
31	603799	华友钴业	144,900	5,390,280.00	1.03
32	600547	山东黄金	129,800	5,050,518.00	0.96
33	300037	新宙邦	77,300	5,039,187.00	0.96
34	000888	峨眉山 A	355,100	4,275,404.00	0.81
35	300080	易成新能	539,700	4,188,072.00	0.80
36	603002	宏昌电子	493,300	3,788,544.00	0.72
37	300429	强力新材	15,100	2,108,866.00	0.40
38	000892	星美联合	143,400	2,029,110.00	0.39
39	000596	古井贡酒	19,035	912,728.25	0.17
40	002569	步森股份	13,400	584,776.00	0.11
41	601611	中国核建	12,403	259,470.76	0.05
42	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.05
43	300508	维宏股份	970	246,865.00	0.05
44	601900	南方传媒	13,027	230,187.09	0.04
45	002792	通宇通讯	3,780	226,044.00	0.04
46	002797	第一创业	5,395	218,011.95	0.04
47	603919	金徽酒	6,604	204,063.60	0.04
48	603608	天创时尚	7,994	191,616.18	0.04
49	300512	中亚股份	1,873	187,150.16	0.04
50	601127	小康股份	6,547	156,276.89	0.03
51	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.03
52	603339	四方冷链	2,793	151,995.06	0.03
53	002790	瑞尔特	3,022	143,393.90	0.03
54	603861	白云电器	4,056	134,496.96	0.03
55	002791	坚朗五金	2,377	127,811.29	0.02

56	601020	华钰矿业	4,377	125,444.82	0.02
57	603779	威龙股份	2,809	117,865.64	0.02
58	603959	百利科技	2,815	116,681.75	0.02
59	300505	川金诺	1,893	114,450.78	0.02
60	002789	建艺集团	1,500	107,520.00	0.02
61	603027	千禾味业	2,904	102,424.08	0.02
62	603798	康普顿	1,590	101,585.10	0.02
63	002795	永和智控	1,450	98,716.00	0.02
64	603028	赛福天	3,309	97,317.69	0.02
65	300506	名家汇	1,819	96,097.77	0.02
66	300510	金冠电气	1,365	92,219.40	0.02
67	002793	东音股份	1,413	91,859.13	0.02
68	002798	帝王洁具	1,056	91,555.20	0.02
69	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.01
70	603029	天鹅股份	1,618	72,211.34	0.01
71	603726	朗迪集团	1,361	68,798.55	0.01
72	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.01
73	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
74	601966	玲珑轮胎	3,780	49,064.40	0.01
75	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.01
76	002624	完美环球	1,235	46,621.25	0.01
77	002292	奥飞娱乐	1,514	45,344.30	0.01
78	600784	鲁银投资	4,900	43,169.00	0.01
79	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.01
80	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
81	300495	美尚生态	477	22,905.54	0.00
82	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
83	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
84	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
85	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
86	600060	海信电器	258	4,561.44	0.00
87	600687	刚泰控股	191	3,105.66	0.00
88	002117	东港股份	91	2,862.86	0.00
89	002537	海立美达	90	2,736.00	0.00
90	002470	金正大	136	1,094.80	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600340	华夏幸福	28,531,453.86	3.41
2	002626	金达威	26,176,261.19	3.12
3	000779	三毛派神	22,112,706.79	2.64
4	002714	牧原股份	21,922,491.20	2.62
5	600570	恒生电子	20,119,829.00	2.40
6	002746	仙坛股份	19,976,818.46	2.38
7	002108	沧州明珠	19,506,944.66	2.33
8	002079	苏州固锔	18,180,124.74	2.17
9	000959	首钢股份	17,621,259.99	2.10
10	002234	民和股份	17,555,093.60	2.10
11	300037	新宙邦	17,285,429.53	2.06
12	603601	再升科技	17,189,966.06	2.05
13	300017	网宿科技	17,081,770.00	2.04
14	600395	盘江股份	16,935,686.17	2.02
15	601198	东兴证券	16,777,615.46	2.00
16	300073	当升科技	16,018,181.64	1.91
17	300033	同花顺	15,984,113.72	1.91
18	601118	海南橡胶	15,975,944.32	1.91
19	600303	曙光股份	15,942,776.24	1.90
20	002624	完美环球	15,940,529.45	1.90

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

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300310	宜通世纪	43,056,662.18	5.14
2	000783	长江证券	36,337,440.09	4.34
3	300144	宋城演艺	32,924,378.29	3.93
4	002292	奥飞娱乐	28,797,965.49	3.44

5	600340	华夏幸福	28,469,983.55	3.40
6	002407	多氟多	25,272,805.14	3.02
7	600701	*ST 工新	25,228,995.87	3.01
8	300188	美亚柏科	24,599,059.85	2.94
9	300031	宝通科技	23,564,546.79	2.81
10	002714	牧原股份	23,078,194.44	2.75
11	000779	三毛派神	21,714,986.49	2.59
12	300232	洲明科技	19,498,596.69	2.33
13	300275	梅安森	19,035,352.39	2.27
14	300017	网宿科技	18,721,392.58	2.23
15	300048	合康变频	18,624,904.90	2.22
16	000959	首钢股份	17,992,911.09	2.15
17	600303	曙光股份	17,970,060.30	2.14
18	000596	古井贡酒	17,957,991.81	2.14
19	300128	锦富新材	17,909,329.00	2.14
20	600015	华夏银行	17,418,174.74	2.08
21	300089	文化长城	17,367,408.51	2.07
22	300028	金亚科技	17,241,794.36	2.06
23	002123	荣信股份	17,064,037.03	2.04

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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,555,861,427.25
卖出股票收入（成交）总额	1,697,168,331.69

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

### 7.5 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	23,350,327.00	4.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	2,661,297.70	0.51
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	26,011,624.70	4.96

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	010303	03 国债(3)	121,100	12,542,327.00	2.39
2	010107	21 国债(7)	100,000	10,808,000.00	2.06
3	110031	航信转债	24,130	2,661,297.70	0.51

注：上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。

## 7.7 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。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内本基金投资的恒生电子（600570）于 2015 年 9 月 7 日发布收到公司控股子公司杭州恒生网络并刘曙峰先生、官晓岚先生收到证监会行政处罚事先告知书的通知。恒生网络开发运营的 HOMS 系统，包含子账户开立、提供委托交易、存储、查询、清算等多种证券业务属性的功能，恒生网络明知客户经营方式，仍向不具有经营证券资质的客户销售该系统、提供相关服务，并获取收益的行为违反了《证券法》第一百二十二条的规定，构成《证券法》第一百九十七条所述非法经营证券业务的行为。时任恒生网络董事长刘曙峰为直接负责的主管人员，总经理官晓岚为其其他直接责任人员。截止 2015 年 7 月 31 日，恒生网络与 180 个从事配资业务的客户签订协议，为其开立 316,905 个子账户，按照证券交易量的一定比例（万分之零点五到一点五），非法获取收入为 132,852,384.06 元。根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，依据《证券法》第一百九十七条的规定，证监会拟决定：一、没收恒生网络违法所得 132,852,384.06 元，并处以 398,557,152.18 元罚款；二、对刘曙峰给予警告，并处以 30 万元罚款；三、对官晓岚给予警告，并处以 30 万元罚款；

基金管理人分析认为，恒生电子子公司恒生网络 2015 年 9 月份被监管部门行政处罚的原因是向不具有经营证券资质的客户销售 HOMS 系统、提供相关服务，并获取收益。体现了该公司此前在内部管理方面存在的漏洞与不足，但公司自查及改正的态度是端正的，后续处理的情况也基本明朗，该事件不会影响公司后续经营活动的正常开展。我们判断公司本身的经营趋势向好，收入和利润持续快速增长，公司在金融信息化领域仍处于非常领先的位置。因此，基金管理人经审慎分析，在本报告期内继续保持对其的投资。

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

### 7.12.2

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。



### 7.12.3 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	477,609.33
2	应收证券清算款	16,191,803.03
3	应收股利	-
4	应收利息	270,544.79
5	应收申购款	46,076.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,986,033.45

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110031	航信转债	2,661,297.70	0.51

### 7.12.5 期末前十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	300503	昊志机电	15,953,877.36	3.04	重大事项
2	000638	万方发展	15,801,913.05	3.01	重大事项

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
24,195	6,971.95	4,785,995.19	2.84%	163,900,392.70	97.16%

### 8.2 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	23,040.36	0.0137%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004年7月9日）基金份额总额	2,017,034,173.30
本报告期期初基金份额总额	213,107,315.33
本报告期基金总申购份额	8,110,800.39
减：本报告期基金总赎回份额	52,531,727.83
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	168,686,387.89

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 本报告期内基金管理人未发生重大的人事变动。
2. 本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	1	1,215,236,918.32	37.37%	1,131,750.24	37.37%	-
中信证券	2	904,246,862.09	27.81%	842,126.16	27.81%	-
中山证券	1	313,258,070.13	9.63%	291,735.62	9.63%	-
招商证券	1	216,177,748.83	6.65%	201,325.90	6.65%	-
长城证券	1	167,089,563.49	5.14%	155,610.90	5.14%	-
财富证券	2	108,885,822.34	3.35%	101,405.57	3.35%	-
华林证券	2	86,033,833.94	2.65%	80,123.83	2.65%	-
银河证券	2	73,073,891.43	2.25%	68,053.76	2.25%	-
西南证券	1	64,476,943.37	1.98%	60,048.18	1.98%	-

国泰君安	1	56,516,261.05	1.74%	52,633.18	1.74%	-
中信建投	2	46,610,185.79	1.43%	43,408.22	1.43%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-

(一)2016 年上半年本基金新增华林证券、华信证券、东北证券交易单元，撤销南京证券、东海证券交易单元。

(二) 交易单元选择的标准和程序

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

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

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

本基金本报告期末通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

## § 11 备查文件目录

### 11.1 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。

### 11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所

### 11.3 查阅方式

基金投资者可在营业时间免费查阅，或基金投资者也可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）或登录本基金管理人互联网网址（<http://www.mfcteda.com>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泰达宏利基金管理有限公司：客户服务中心电话：400-698-8888（免长话费）或 010-66555662，网址：<http://www.mfcteda.com>。

泰达宏利基金管理有限公司  
2016 年 8 月 29 日