泰达宏利中证500指数分级证券投资基金

2015 年度报告摘要

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3月30日

§1 重要提示

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2016年3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。

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利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	48,434,460.99份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2011-12-22		
下属分级基金的基金简称	泰达500A	泰达500B	泰达中证500
下属分级基金的交易代码	150053	150054	162216
报告期末下属分级基金份额总额	6,289,500.00份	9,434,250.00份	32,710,710.99份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰达宏利基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	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		400-69-888888	95566
传真		010-66577666	010-66594942

2.4 信息披露方式

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

§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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	53,113,913.05	8,202,255.07	7,113,653.74
本期利润	53,550,237.71	6,333,196.82	6,450,715.14
加权平均基金份额本期利润	0.6662	0.3153	0.2214
本期基金份额净值增长率	57.06%	32.25%	14.55%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.6011	0.4384	0.1035
期末基金资产净值	51,380,292.18	88,594,754.62	18,403,113.01
期末基金份额净值	1.0608	1.3844	1.0728

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。

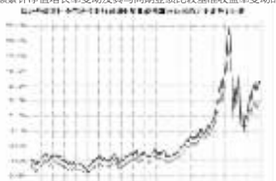
3.2 基金净值表现

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①①	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	33.35%	2.10%	23.15%	1.94%	10.20%	0.16%
过去六个月	-7.95%	3.52%	-13.48%	3.07%	5.53%	0.45%
过去一年	57.06%	2.97%	41.39%	2.68%	15.67%	0.29%
过去三年	137.95%	2.00%	125.37%	1.86%	12.58%	0.14%
自基金合同生效起至今	129.92%	1.86%	95.41%	1.77%	34.51%	0.09%

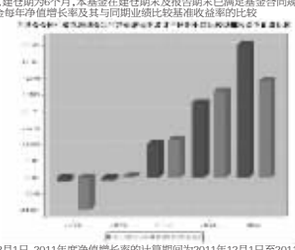
本基金的业绩比较基准:中证500指数收益率*95%+1年期定期存款利率(税后)*5%。

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



本基金于2011年12月1日成立,建仓期为6个月,本基金在建仓期末及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3 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比较



本基金合同生效日为2011年12月1日,2011年度净值增长率的计算期间为2011年12月1日至2011年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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。

§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、泰达宏利改革优选混合型证券投资基金、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、泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金、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、泰达宏利风险收益平衡混合型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利券商金股混合型证券投资基金、泰达宏利周期优选混合型证券投资基金、泰达宏利成长先锋混合型证券投资基金、泰达宏利稳健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、泰达宏利券商金股混合型证券投资基金、泰达宏利周期优选混合型证券投资基金、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、泰达宏利新起点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、泰达宏利盛景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)及其基金经理期限分

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
刘欢	本基金基金经理	2012年8月14日	-	8	清华大学数学科学系毕业,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任定量分析师;2008年12月至2011年7月就职于泰达宏利基金管理有限公司任定量分析师;2011年7月加盟泰达宏利基金管理有限公司,担任产品设计部工程师职位经理;具备6年基金从业经验,具有基金从业资格。
杨超	本基金基金经理	2014年10月13日	-	5	杨超先生毕业于英国威尔士斯旺西大学,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,先后担任投资管理部助理研究员、初级研究员、基金经理助理职务。2014年6月加入泰达宏利基金管理有限公司,担任基金经理助理一职。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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中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,确保公平交易顺畅作业,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率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,相关投资组合经理均须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。

在本报告期内,本基金管理人管理的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%,没有发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为,在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年上半年,A股在经济转型的预期下,配合流动性的持续宽松,权益市场表现抢眼,然而同期经济增速的持续放缓在二季度导致投资者担忧经济结构转型的速度无法支撑高估值的权益,市场在三季度大幅度下挫。

在股票市场巨幅波动时期,由于大量停牌股票的出现给基金管理带来了巨大困难,本基金采取适当措施积极应对市场波动带来的不利影响,运用适当的量化策略积极复制指数,有效控制了基金的偏离度,并为持有人创造了一定超额收益。

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1.0608元,本报告期份额净值增长率为57.06%,同期业绩比较基准增长率为41.39%。

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2016年,经济增速在较低水平维持的基本面态势下,市场的机会和热点将来自于过剩产能出清后的估值回落和企业盈利边际改善带来的机会,同时市场期待的中国经济结构调整和改革的推进将成为市场关注的焦点。

本基金将遵循基金合同,积极应对市场结构变化,有效控制跟踪误差。

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结算登记结算有限公司签署服务协议,由其按约定提供银行间债市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对泰达宏利中证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,完全履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

本基金2015年年度报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可阅读年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:泰达宏利中证500指数分级证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	2,762,424.42	4,050,698.78
结算备付金	220,452.88	719,074.03
存出保证金	170,743.52	37,186.43
交易性金融资产	48,544,358.75	83,977,251.16
其中:股票投资	48,544,358.75	83,977,251.16
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	210,740.56
应收利息	690.32	1,302.68
应收股利	-	-
应收申购款	67,126.15	19,862.24
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	51,765,796.04	89,016,115.88
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	91,347.75	1,921.98
应付管理人报酬	44,311.06	73,722.92
应付托管费	8,862.22	14,744.57
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	111,937.88	262,402.24
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	129,044.95	68,569.55
负债合计	385,503.86	421,361.26
所有者权益:		
实收基金	22,267,969.96	60,539,775.99
未分配利润	29,112,332.22	28,054,978.63
所有者权益合计	51,380,292.18	88,594,754.62
负债和所有者权益总计	51,765,796.04	89,016,115.88

注:本基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场正回购余额。

7.4.10 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2015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工具中属于第一层次的余额为44,336,278.20元,属于第二层次的余额为4,208,080.55元,无属于第三层次的余额(2014年12月31日:第一层次79,297,823.96元,第二层次4,679,427.20元,无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,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,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃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。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、资产支持证券和私募债券除外),本基金于2015年3月27日起改为采用中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注7.4.5.2),并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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2015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(2014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

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.0608元,基金份额总额48,434,460.99份,其中下属泰达中证500份额32,710,710.99份,泰达500A份额6,289,500.00份,泰达500B份额9,434,250.00份。下属泰达中证500份额净值1.0608元,泰达500A份额净值1.0416元,泰达500B份额净值1.0736元。

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:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一.收入	56,779,171.69	7,379,326.63
1.利息收入	52,262.47	15,393.72
其中:存款利息收入	52,262.47	15,387.72
债券利息收入	-	6.00
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)	55,654,168.24	9,158,388.77
其中:股票投资收益	55,009,813.23	9,005,048.25
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	2,798.36
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	644,355.01	150,555.16
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	436,324.66	-1,869,058.25
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	636,416.32	74,602.39
减:二.费用	3,228,933.98	1,046,129.81
1.管理人报酬	932,802.35	240,796.55
2.托管费	186,560.51	48,159.14
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,883,149.31	482,547.52
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	226,421.81	274,627.60
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)	53,550,237.71	6,333,196.82
减:所得税费用	-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)	53,550,237.71	6,333,196.82

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:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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)	60,539,775.99	28,054,978.63	88,594,754.62
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	53,550,237.71	53,550,237.71
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)	-38,271,816.03	-52,492,884.12	-90,764,700.15
其中:1.基金申购款	171,962,326.49	249,466,198.64	421,428,525.13
2.基金赎回款	-210,234,142.52	-301,959,082.76	-512,193,225.28
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)	22,267,959.96	29,112,332.22	51,380,292.18

项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	16,627,896.95	1,775,216.15	18,403,113.01
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	6,333,196.82	6,333,196.82
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)	43,911,879.13	19,946,565.66	63,858,444.79
其中:1.基金申购款	93,250,575.25	40,033,110.27	133,283,685.52
2.基金赎回款	-49,338,696.12	-20,086,544.61	-69,425,240.73
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)	60,539,775.99	28,054,978.63	88,594,754.62

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:

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

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普华永道中天验字(2011)第466号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金合同》于2011年12月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,435,467,765.48份基金份额,其中认购资金利息折合354,684.61份基金份额。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司以下简称"中国银行")。

根据《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金合同》和《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金的基金份额包括泰达宏利中证500指数分级证券投资基金之基础份额(简称"泰达中证500份额"),泰达宏利中证500指数分级证券投资基金之稳健收益类份额与泰达宏利中证500指数分级证券投资基金之进取收益类份额。根据本基金管理人2015年6月26日发布的《关于泰达宏利中证500指数分级证券投资基金交易场内基金简称的公告》,本基金自2015年6月26日起变更子份额的场内简称,泰达中证500之泰达稳健份额的简称由泰达稳健份额变更为泰达500A份额,泰达中证500之泰达进取份额的简称由泰达进取份额变更为泰达500B份额,其中,泰达500A份额、泰达500B份额的基金份额配比始终保持4:6的比率不变,本基金通过场外、场内两种方式公开发售。本基金发售结束后,投资者场外认购的全部份额将确认为泰达中证500份额;投资者场内认购的全部将按4:6的比率自动分离为预期收益与风险不同的两种份额类别,即泰达500A份额和泰达500B份额。两类基金份额的基金资产合并运作。泰达中证500份额只可以进行场内与场外的申购赎回,但不上市交易。泰达500A份额和泰达500B份额只可在深圳证券交易所上市交易,不可单独进行申购赎回。本基金在每个工作日按基金合同约定的净值计算规则对泰达500A份额和泰达500B份额分别进行参考净值计算,本基金净资产优先确保泰达500A份额的本金及泰达500A份额累计约定日应得收益;本基金在优先确保泰达500A份额的本金及累计约定日应得收益后的剩余净资产计为泰达500B份额的净资产。

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定,本金的投资目标是紧密跟踪中证500指数,力争获取与标的指数相似的投资收益。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成份股、备选成分股、新股、固定收益产品、货币市场工具、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为85%-100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的80%,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%的现金或实到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:95%×中证500指数收益率+5%×1年期定期存款利率(税后)。

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3月30日批准报出。

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-年度报告和半年度报告》,中国证券投资基金业协会以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》,《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年度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2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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

除下述事项外,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。

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、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《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》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

本基金本报告期内无发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

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、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值。

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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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。

7.4.7 关联方关系

项目	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
北方国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 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。

7.4.8