

## 信息披露

## Disclosure

# 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

## 2018年第二季度报告

沪深300 指数是由中证指数有限公司编制,从上海和深圳证券交易所中选取300只A股作为样本的综合性指数,具有良好的市场代表性。中证综合债券指数由中证指数有限公司编制,是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短期融资券的跨市场债券指数,较全面地反映我国债券市场整体价格变动趋势,为债券投资者提供更为客观的市场基准。本基金是在基金运作过程中,债券资产占基金资产的比例为50%-95%,其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券等金融工具金融工具。因此,“50%”沪深300 指数收益率+50%”中证综合债券指数收益率”是衡量本基金投资业绩的比较基准。

2. 本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*50%+中证综合债券指数收益率\*50%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较



本基金A类份额成立于2015年6月13日,C类份额成立于2017年2月9日。本基金在建仓期结束后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。

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
王鹏	基金经理	2015年2月13日	至今	11	清华大学工学硕士,2007年4月至2008年12月就职于工商银行总行金融市场部,2009年12月至2011年7月就职于泰达宏利基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理,2011年7月加入泰达宏利基金管理有限公司,曾任任专户与工银瑞信资产管理(香港)有限公司基金经理,2014年12月加入泰达宏利基金管理有限公司,现任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基金经理,具有11年证券从业经验,11年证券投资基金管理经验,具有基金从业资格。

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规

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	29,099.05	0.01
B	矿采业	2,16,560.00	0.01
C	制造业	254,865.00	0.02
D	电力、热力、燃气及生产和服务供应业	2,416,703.05	0.04
E	建筑业	20,615,053.10	0.48
F	批发和零售业	13,650,347.10	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	9,999.00	0.00
H	住宿和餐饮业	13,481,629.04	0.34
I	金融业	21,175,226.40	0.43
K	房地产业	48,017,882.74	1.13
L	租赁和商务服务业	4,077,153.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	699,014.14	0.01
O	信息传输、软件和信息技术服务业	82,513.00	0.00
P	文化、体育和娱乐业	988,471.00	0.02
Q	综合	-	-
合计		383,463,138.22	69.26

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002228	大华股份	889,462	19,066,381.10	4.06
2	000002	万科A	799,422	17,353,381.20	4.04
3	000565	南矿集团	454,655	15,221,490.00	3.54
4	600552	荣泰发展	1,234,500	14,742,275.00	3.43
5	601218	华信新材	229,760	13,414,820.00	3.12
6	000533	康拓股份	244,800	12,798,670.00	2.88
7	000741	华信新材	502,890	11,096,426.48	2.78
8	000009	华鲁恒升	1,571,131	11,369,277.13	2.64
9	600309	万华化学	249,794	11,346,643.48	2.64
10	601688	中国铁建	2,059,540	11,246,088.00	2.62

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.11 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.13 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.14 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.15 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.16 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.17 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.18 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.19 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.20 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.21 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.22 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.23 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.24 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.25 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.26 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.27 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.28 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.29 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.30 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.31 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.32 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.33 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.34 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.35 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.36 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.37 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.38 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.39 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.40 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.41 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.42 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.43 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.44 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.45 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.46 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.47 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.48 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.49 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.50 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.51 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.52 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.53 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.54 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.55 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.56 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.57 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.58 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.59 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.60 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.61 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.62 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.63 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.64 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.65 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.66 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.67 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.68 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.69 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.70 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.71 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.72 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.73 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.74 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.75 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.76 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.77 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.78 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.79 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.80 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.81 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.82 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.83 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.84 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.85 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.86 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.87 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.88 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.89 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.90 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.91 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.92 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.93 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.94 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.95 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.96 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.97 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.98 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.99 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.100 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.101 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.102 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.103 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.104 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.105 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.106 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.107 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.108 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.109 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.110 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.111 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.112 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.113 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.114 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.115 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.116 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.117 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.118 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.119 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.120 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.121 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.122 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.123 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.124 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.125 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.126 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.127 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.128 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.129 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.130 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.131 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.132 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.133 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.134 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.135 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.136 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.137 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.138 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.139 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.140 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.141 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.142 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.143 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.144 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.145 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.146 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.147 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.148 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.149 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.150 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.151 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.152 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.153 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.154 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.155 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.156 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.157 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.158 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.159 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.160 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.161 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.162 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.163 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.164 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.165 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.166 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.167 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.168 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.169 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.170 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.171 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.172 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.173 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.174 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.175 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.176 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.177 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.178 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.179 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.180 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.181 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.182 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细