

## 泰达宏利风险预算混合型证券投资基金

### 2018年第二季度报告

基金收益率为-1.08%。  
4.6 报告期内本基金持有人人数及基金资产净值摘要  
本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

#### § 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	70,794,692.39	37.22
2	其中:股票	70,794,692.39	37.22
3	固定收益投资	114,673,177.60	60.29
4	其中:债券	114,673,177.60	60.29
5	货币资金	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	衍生金融资产	-	-
8	其他资产	-	-
9	合计	185,467,870.00	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业		207,499.00	0.11
B 采矿业		2,330,293.90	1.26
C 制造业		41,306,097.02	21.85
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业		883,500.00	0.46
E 建筑业		2,281,000.00	1.23
F 批发和零售业		4,246,555.50	2.29
G 交通运输、仓储和邮政业		1,362,164.00	0.71
H 住宿和餐饮业		-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业		3,926,672.24	2.10
J 金融业		6,594,722.60	3.50
K 房地产业		5,586,327.00	3.02
L 租赁和商务服务业		2,002,289.76	1.17
M 科学研究和技术服务业		-	-
N 水利、环境和公共设施管理业		81,228.14	0.05
O 医药制造业		-	-
P 教育、文化和体育业		-	-
Q 综合		-	-
合计		70,794,692.39	41.40

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业		207,499.00	0.11
B 采矿业		2,330,293.90	1.26
C 制造业		41,306,097.02	21.85
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业		883,500.00	0.46
E 建筑业		2,281,000.00	1.23
F 批发和零售业		4,246,555.50	2.29
G 交通运输、仓储和邮政业		1,362,164.00	0.71
H 住宿和餐饮业		-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业		3,926,672.24	2.10
J 金融业		6,594,722.60	3.50
K 房地产业		5,586,327.00	3.02
L 租赁和商务服务业		2,002,289.76	1.17
M 科学研究和技术服务业		-	-
N 水利、环境和公共设施管理业		81,228.14	0.05
O 医药制造业		-	-
P 教育、文化和体育业		-	-
Q 综合		-	-
合计		70,794,692.39	41.40

5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600362	航发动力	224,400	2,081,580.00	1.07
2	601318	中国平安	46,300	3,633,074.00	1.95
3	600666	中国银业	122,000	2,433,260.00	1.27
4	601199	浦发银行	138,200	2,960,000.00	1.58
5	000002	万科A	76,500	1,881,200.00	1.00
6	600216	浙江龙盛	138,000	1,762,200.00	1.00
7	600511	国药股份	66,300	1,759,026.00	1.00
8	601888	中国国旅	27,300	1,758,200.00	1.03
9	600266	广汇能源	393,000	1,610,080.00	0.84
10	601717	恒顺醋业	264,700	1,537,007.00	0.80

5.2.4 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明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010002	国债1302	291,250	29,622,776.00	17.22
2	010003	国债1303	250,000	26,790,000.00	14.50
3	010008	国债1702	120,000	11,588,000.00	6.48
4	01047502	142次国债17M001	100,000	10,612,000.00	6.21
5	130304	国债1304	100,000	9,989,000.00	5.77

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

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

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010002	国债1302	291,250	29,622,776.00	17.22
2	010003	国债1303	250,000	26,790,000.00	14.50
3	010008	国债1702	120,000	11,588,000.00	6.48
4	01047502	142次国债17M001	100,000	10,612,000.00	6.21
5	130304	国债1304	100,000	9,989,000.00	5.77

5.2.6 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权证投资明细

5.2.1 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权证投资明细

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010002	国债1302	291,250	29,622,776.00	17.22
2	010003	国债1303	250,000	26,790,000.00	14.50
3	010008	国债1702	120,000	11,588,000.00	6.48
4	01047502	142次国债17M001	100,000	10,612,000.00	6.21
5	130304	国债1304	100,000	9,989,000.00	5.77

5.2.7 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

5.2.1 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

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010002	国债1302	291,250	29,622,776.00	17.22
2	010003	国债1303	250,000	26,790,000.00	14.50
3	010008	国债1702	120,000	11,588,000.00	6.48
4	01047502	142次国债17M001	100,000	10,612,000.00	6.21
5	130304	国债1304	100,000	9,989,000.00	5.77

5.2.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.2.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010002	国债1302	291,250	29,622,776.00	17.22
2	010003	国债1303	250,000	26,790,000.00	14.50
3	010008	国债1702	120,000	11,588,000.00	6.48
4	01047502	142次国债17M001	100,000	10,612,000.00	6.21
5	130304	国债1304	100,000	9,989,000.00	5.77

5.2.9 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股指期货投资明细

5.2.1 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股指期货投资明细

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010002	国债1302	291,250	29,622,776.00	17.22
2	010003	国债1303	250,000	26,790,000.00	14.50
3	010008	国债1702	120,000	11,588,000.00	6.48
4	01047502	142次国债17M001	100,000	10,612,000.00	6.21
5	130304	国债1304	100,000	9,989,000.00	5.77

5.2.10 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国债期货投资明细

5.2.1 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国债期货投资明细

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010002	国债1302	291,250	29,622,776.00	17.22
2	010003	国债1303	250,000	26,790,000.00	14.50
3	010008	国债1702	120,000	11,588,000.00	6.48
4	01047502	142次国债17M001	100,000	10,612,000.00	6.21
5	130304	国债1304	100,000	9,989,000.00	5.77

5.2.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.2.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010002	国债1302	291,250	29,622,776.00	17.22
2	010003	国债1303	250,000	26,790,000.00	14.50
3	010008	国债1702	120,000	11,588,000.00	6.48
4	01047502	142次国债17M001	100,000	10,612,000.00	6.21
5	130304	国债1304	100,000	9,989,000.00	5.77

5.2.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.2.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010002	国债1302	291,250	29,622,776.00	17.22
2	010003	国债1303	250,000	26,790,000.00	14.50
3	010008	国债1702	120,000	11,588,000.00	6.48
4	01047502	142次国债17M001	100,000	10,612,000.00	6.21
5	130304	国债1304	100,000	9,989,000.00	5.77

5.2.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.2.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010002	国债1302	291,250	29,622,776.00	17.22
2	010003	国债1303	250,000	26,790,000.00	14.50
3	010008	国债1702	120,000	11,588,000.00	6.48
4	01047502	142次国债17M001	100,000	10,612,000.00	6.21
5	130304	国债1304	100,000	9,989,000.00	5.77

5.2.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.2.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010002	国债1302	291,250	29,622,776.00	17.22
2	010003	国债1303	250,000	26,790,000.00	14.50
3	010008	国债1702	120,000	11,588,000.00	6.48
4	01047502	142次国债17M001	100,000	10,612,000.00	6.21
5	130304	国债1304	100,000	9,989,000.00	5.77

5.2.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.2.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010002	国债1302	291,250	29,622,776.00	17.22
2	010003	国债1303	250,000	26,790,000.00	14.50
3	010008	国债1702	120,000	11,588,000.00	6.48
4	01047502	142次国债17M001	100,000	10,612,000.00	6.21
5	130304	国债1304	100,000	9,989,000.00	5.77

5.2.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.2.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010002	国债1302	291,250	29,622,776.00	17.22
2	010003	国债1303	250,000	26,790,000.00	14.50
3	010008	国债1702	120,000	11,588,000.00	6.48
4	01047502	142次国债17M001	100,000	10,612,000.00	6.21
5	130304	国债1304	100,000	9,989,000.00	5.77

5.2.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.2.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010002	国债1302	291,250	29,622,776.00	17.22
2	010003	国债1303	250,000	26,790,000.00	14.50
3	010008	国债1702	120,000	11,588,000.00	6.48
4	01047502	142次国债17M001	100,000	10,612,000.00	6.21
5	130304	国债1304	100,000	9,989,000.00	5.77

5.2.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.2.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010002	国债1302	291,250	29,622,776.00	17.22
2	010003	国债1303	250,000	26,790,000.00	14.50
3	010008	国债1702	120,000	11,588,000.00	6.48
4	01047502	142次国债17M001	100,000	10,612,000.00	6.21
5	130304	国债1304	100,000	9,989,000.00	5.77

5.2.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.2.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	----	----	-------	---------	--------------