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 2018年半年度报告摘要

2018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：2018年8月27日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司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2018年8月23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2018年1月1日起至2018年6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利大数据混合	
基金主代码	002263	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年2月23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	59,616,558.73份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	泰达宏利大数据混合A	泰达宏利大数据混合C
下属分级基金的交易代码：	002263	003554
报告期末下属分级基金的份额总额	59,101,750.39份	514,808.34份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取大类资产配置策略，同时通过计算机算法分析互联网大数据，采用数量化投资方法挖掘潜在的投资机会，在严格控制风险的前提下，力争为基金份额持有人创造持久的、稳定的、较高的超额收益
投资策略	本基金通过综合分析互联网大数据所反映的投资者行为作为主线，通过量化投资方式精选个股。一方面，本基金在对投资者整体行为趋势研究的基础上，从"自上而下"的角度对大类资产进行优化配置，并优选受益行业；另一方面，本基金凭借多年来不断积累形成的量化选股框架，从网络点击量等互联网行为数据方面出发，适当结合估值、成长、盈利质量、情绪等因子，以"自下而上"的视角精选具有较好公司质地但被投资者低估的投资机会，力求在抵御各类风险的前提下获取超越平均水平的良好回报
业绩比较基准	50%*中证800指数收益率+50%*中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金

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	袁静	王永民
	联系电话	010－66577513	010-66594896
	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

2.4 信息披露方式

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	基金管理人及基金托管人住所

§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

基金级别	泰达宏利大数据混合A	泰达宏利大数据混合C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日－2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日－2018年6月30日)
本期已实现收益	-6,507,405.91	-207,612.57
本期利润	-9,977,021.03	-343,311.74
加权平均基金份额本期利润	-0.1481	-0.1616
本期基金份额净值增长率	-12.24%	-12.38%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1024	0.0971
期末基金资产净值	65,152,251.23	564,804.81
期末基金份额净值	1.1024	1.0971

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

泰达宏利大数据混合A

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	-5.98%	1.43%	-3.78%	0.69%	-2.20%	0.74%
过去三个月	-5.85%	1.19%	-4.74%	0.58%	-1.11%	0.61%
过去六个月	-12.24%	1.19%	-5.12%	0.58%	-7.12%	0.61%
过去一年	-5.71%	1.01%	-1.39%	0.48%	-4.32%	0.53%
自基金合同生效起至今	10.24%	0.97%	5.86%	0.49%	4.38%	0.48%

泰达宏利大数据混合C

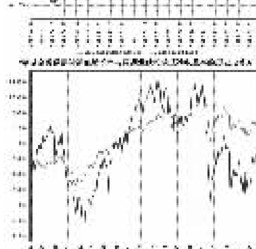
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-6.00%	1.43%	-3.78%	0.69%	-2.22%	0.74%
过去三个月	-5.91%	1.19%	-4.74%	0.58%	-1.17%	0.61%
过去六个月	-12.38%	1.19%	-5.12%	0.58%	-7.26%	0.61%
过去一年	-6.06%	1.01%	-1.39%	0.48%	-4.67%	0.53%
自基金合同生效起至今	-5.50%	0.95%	1.55%	0.44%	-7.05%	0.51%

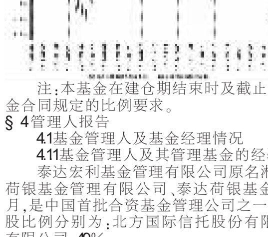
注：本基金的业绩比较基准：中证800指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%。

中证800指数是由中证指数有限公司编制，中证500和沪深300成份股一起构成中证800指数成份股，中证800指数综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况，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、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，较全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准。

本基金是混合型基金，基金在运作过程中股票资产占基金资产的比例为0%-95%，其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、债券回购、权证、资产支持证券等金融工具金融工具。因此，"50%*中证800指数收益率+50%*中证综合债指数收益率"是适合衡量本基金投资业绩的比较基准。

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





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、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、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、泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金、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、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利京元宝货币市场基金、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、泰达宏利京天宝货币市场基金、泰达宏利启富灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金、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

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		
刘欣	本基金基金经理；金融工程部总经理	2016年2月23日	-	11	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研究员、金融工程部副总经理，现担任金融工程部总经理兼基金经理。具备11年基金从业经验，11年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
刘洋	本基金基金经理助理	2017年4月21日	-	3	北京大学理学硕士。2015年1月至2015年5月就职于九坤投资(北京)有限公司，2015年5月加盟泰达宏利基金管理有限公司，曾担任金融工程部助理研究员、研究员，现担任基金经理助理。具备3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。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

2018年上半年，A股市场呈现下跌态势，总体风格与2017年有相似之处，蓝筹股与创业板权重股下跌较少，而缺少业绩支撑的中小盘股票下跌较多，其中尤以缺少现金流周转，股权大比例质押的股票跌幅较大，黑天鹅事件增加。行业层面看，结构性差异较大，抗周期盈利稳定的消费、医疗股票基本没有下跌，而传统周期股和制造业股票下跌较多。

本基金在操作中，有效的进行了结构性调整。在以投资者行为大数据分析为主要策略下，兼顾成长、估值、景气等因素，持续选取具有超额收益的股票。在持仓结构上分散由于市场风格大幅波动造成的风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达宏利大数据混合A基金份额净值为1.1024元，本报告期基金份额净值增长率为-12.24%；截至本报告期末泰达宏利大数据混合C基金份额净值为1.0971元，本报告期基金份额净值增长率为-12.38%；同期业绩比较基准收益率为-5.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们依然维持对市场整体长期看多的观点，认为当前是长期低估值区间，值得长期配置。从短期看，市场经过急速下跌后，存在反弹的可能性。蓝筹股的估值下降为未来投资提供更好的安全边际。在结构上，我们维持看好有业绩支撑的蓝筹股票，看淡估值虚高的热门伪成长股。从长期看，A股估值将趋势性的向国际靠拢，中间伴随存量资金博弈性的周期波动。目前A股蓝筹股估值基本与海外相当，甚至略低于海外市场；而中小股票估值显著高于海外，相差1.3倍。预计在金融逐渐开放，互联互通的大背景下，这一估值体系难以长期维系。从3-5年的中长期维度看，绩优风格股票将持续具有超额收益。就行业层面来看，医药等部分偏消费行业、部分信息技术概念股上涨较多，存在一定估值回归风险，但上行趋势短期未被打破，从长期看可能是转型方向，而建材等部分周期性行业受到房地产相关政策预期影响，估值较低，但不排除未来仍有压制估值的其他政策预期。因此在行业层面更倾向于均衡的配置，而风格层面把握高盈利龙头企业。当前市场的主要风险在于外部环境的不确定性对解决国内经济问题形成了干扰。

基于此观点，我们的配置偏向于具有真实业绩成长、估值合理且未被充分挖掘的股票。在交易时机上，本基金充分借鉴投资者行为大数据，选取情绪相对低迷的时点参与，在情绪过度亢奋期退出。本基金在持仓上相对分散，以平衡组合风险。

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基金运营的副总经理担任主任，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。

4.7 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")在对泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款		5,319,167.45	6,545,924.47
结算备付金		322,405.41	289,001.73
存出保证金		25,815.42	57,615.78
交易性金融资产		60,363,595.85	105,962,448.42
其中：股票投资		60,363,595.85	105,962,448.42
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		-	-
应收利息		1,259.66	1,657.76
应收股利		-	-
应收申购款		29,844.46	107,620.61
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		66,062,088.25	112,964,268.77
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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		16,542.40	92,958.62
应付管理人报酬		86,958.85	143,768.26
应付托管费		14,493.13	23,961.39
应付销售服务费		546.71	721.00
应付交易费用		159,543.08	281,509.21
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		66,948.04	360,020.23
负债合计		345,032.21	902,938.71
所有者权益：			
实收基金		59,616,558.73	89,220,481.78
未分配利润		6,100,497.31	22,840,848.28
所有者权益合计		65,717,056.04	112,061,330.06
负债和所有者权益总计		66,062,088.25	112,964,268.77

注：报告截至日2018年6月30日，基金份额总额59,616,558.73份，其中下属A类基金份额59,101,750.39份，C类基金份额514,808.34份。下属A类基金份额净值1.1024元，C类基金份额净值1.0971元。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		-8,858,411.45	4,254,449.84
1.利息收入		24,478.20	65,218.40
其中：存款利息收入		24,478.20	65,218.40
债券利息收入		-	-
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)		-5,312,201.28	-3,975,959.06
其中：股票投资收益		-6,068,080.86	-5,243,674.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
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		755,879.58	1,267,715.19
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-3,605,314.29	7,718,927.52
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		34,625.92	446,262.98
减：二、费用		1,461,921.32	4,662,197.23
1. 管理人报酬		618,033.08	1,491,641.62
2. 托管费		103,005.49	248,606.97
3. 销售服务费		3,780.34	3,351.57
4. 交易费用		657,863.07	2,724,903.81
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		79,239.34	193,693.26
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-10,320,332.77	-407,747.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-10,320,332.77	-407,747.39

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：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

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	89,220,481.78	22,840,848.28	112,061,330.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-10,320,332.77	-10,320,332.77
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)	-29,603,923.05	-6,420,018.20	-36,023,941.25
其中：1.基金申购款	7,537,367.41	1,570,757.71	9,108,125.12
2.基金赎回款	-37,141,290.46	-7,990,775.91	-45,132,066.37
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)	59,616,558.73	6,100,497.31	65,717,056.04
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	175,286,888.31	30,260,490.93	205,547,379.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-407,747.39	-407,747.39
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)	-16,681,824.21	-3,034,864.41	-19,716,688.62
其中：1.基金申购款	109,817,443.14	19,516,812.97	129,334,256.11
2.基金赎回款	-126,499,267.35	-22,551,677.38	-149,050,944.73
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)	158,605,064.10	26,817,879.13	185,422,943.23

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

泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金(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[2015]2509号《关于准予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注册的批复》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《泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型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人民币393,716,889.89元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第076号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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基金合同》于2016年2月23日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为393,925,399.10份基金份额，其中认购资金利息折合208,509.21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")。

经与托管行协商一致并报中国证监会备案，本基金自2017年2月9日起增加收取销售服务费的C类份额，本基金的原有基金份额全部自动划归为该基金A类基金份额类别，A类份额的各项业务规则与原基金合同相同。详情参见管理人于2017年2月7日发布的《关于泰达宏利改革动力混合、财富大盘指数与大数据混合基金修改基金合同及托管协议的公告》。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金股票资产占基金资产的比例为0%-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。本基金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，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金的业绩比较基准为50%*中证800指数收益率+50%*中证综合债指数收益率。

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2018年8月27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》、《泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018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2018年6月30日的财务状况以及2018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》、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费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 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方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 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方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 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方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	618,033.08	1,491,641.62
其中：支付销售机构的客户维护费	266,572.28	592,621.37

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1.50%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X1.50%/当年天数。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	103,005.49	248,606.97

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X0.25%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利大数据混合A	泰达宏利大数据混合C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	2,795.27	2,795.27
中国银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	2,795.27	2,795.27
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利大数据混合A	泰达宏利大数据混合C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	1,374.58	1,374.58
中国银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	1,374.58	1,374.58

注：支付基金销售机构的销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泰达宏利基金管理有限公司，再由泰达宏利基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日C类基金份额销售服务费＝前一日C类基金份额基金资产净值X0.30%/当年天数。

6.4.8.3 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可比期间均无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	5,319,167.45	20,854.57	10,774,673.20	52,043.15

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。

6.4.8.6 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可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 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
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,659	21,716.31	21,716.31	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

6.4.9.2 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
600745	闻泰科技	2018年4月17日	重大事项	25.56	-	-	26,300	669,917.48	672,228.00	-
603838	四通股份	2018年5月24日	重大事项	10.03	-	-	35,600	357,767.42	357,068.00	-
300324	旋极信息	2018年5月30日	重大事项	9.49	-	-	16,558	173,004.90	157,135.42	-
601727	上海电气	2018年6月6日	重大事项	6.34	2018年8月7日	5.71	16,500	103,546.00	104,610.00	-
600506	香梨股份	2018年5月23日	重大事项	13.17	-	-	6,200	78,200.80	81,654.00	-
300146	汤臣倍健	2018年1月31日	重大事项	15.34	2018年7月31日	16.50	4,400	61,099.40	67,496.00	-
603501	韦尔股份	2018年5月15日	重大事项	37.70	-	-	1,500	59,709.52	56,550.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.10 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	60,363,595.85	91.37
	其中：股票	60,363,595.85	91.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	5,641,572.86	8.54
8	其他各项资产	56,919.54	0.09
9	合计	66,062,088.25	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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	695,796.00	1.06
B	采矿业	1,147,031.00	1.75
C	制造业	33,022,460.38	50.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	265,900.31	0.40
E	建筑业	862,508.80	1.31
F	批发和零售业	2,167,608.00	3.30
G	交通运输、仓储和邮政业	786,212.00	1.20
H	住宿和餐饮业	78,313.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,202,203.42	1.83
J	金融业	16,140,734.00	24.56
K	房地产业	1,860,415.44	2.83
L	租赁和商务服务业	1,264,579.36	1.92
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	434,592.14	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	24,270.00	0.04
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	410,972.00	0.63
S	综合	-	-
	合计	60,363,595.85	91.85

7.2.2 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。

7.3 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

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	601318	中国平安	49,500	2,899,710.00	4.41
2	600519	贵州茅台	3,300	2,413,818.00	3.67
3	600887	伊利股份	73,900	2,061,810.00	3.14
4	600036	招商银行	76,800	2,030,592.00	3.09
5	601166	兴业银行	112,400	1,618,560.00	2.46
6	601288	农业银行	443,600	1,525,984.00	2.32
7	600016	民生银行	193,600	1,355,200.00	2.06
8	600030	中信证券	81,500	1,350,455.00	2.05
9	601601	中国太保	37,300	1,188,005.00	1.81
10	601009	南京银行	113,700	878,901.00	1.34

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

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	601318	中国平安	6,086,096.00	5.43
2	600887	伊利股份	3,552,919.00	3.17
3	600036	招商银行	3,252,928.10	2.90
4	000786	北新建材	3,170,066.20	2.83
5	000885	同力水泥	2,926,532.63	2.61
6	000011	深物业A	2,578,310.00	2.30
7	600015	华夏银行	2,491,308.26	2.22
8	601166	兴业银行	2,470,542.00	2.20
9	600519	贵州茅台	2,396,543.00	2.14
10	600030	中信证券	2,370,989.00	2.12
11	000333	美的集团	2,349,279.00	2.10
12	601601	中国太保	2,323,518.00	2.07
13	601288	农业银行	1,914,470.00	1.71
14	600703	三安光电	1,796,549.00	1.60
15	600016	民生银行	1,764,915.40	1.57
16	600958	东方证券	1,748,883.00	1.56
17	601628	中国人寿	1,690,086.00	1.51
18	601818	光大银行	1,544,152.00	1.38
19	601099	太平洋	1,488,380.00	1.33
20	002032	苏泊尔	1,416,384.90	1.26

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	600516	方大炭素	4,205,507.90	3.75
2	601628	中国人寿	4,133,351.22	3.69
3	002195	二三四五	3,687,774.18	3.29
4	000786	北新建材	3,347,104.00	2.99
5	000895	双汇发展	3,302,168.00	2.95
6	600519	贵州茅台	3,263,149.00	2.91
7	600755	厦门国贸	3,135,100.00	2.80
8	600309	万华化学	3,030,329.23	2.70
9	300284	苏交科	2,946,741.43	2.63
10	300274	阳光电源	2,931,798.54	2.62
11	600612	老凤祥	2,927,804.02	2.61
12	000702	正虹科技	2,848,772.78	2.54
13	000885	同力水泥	2,833,244.00	2.53
14	002635	安洁科技	2,739,898.42	2.44
15	300293	蓝英装备	2,713,917.36	2.42
16	600511	国药股份	2,678,526.00	2.39
17	000915	山大华特	2,645,028.14	2.36
18	600015	华夏银行	2,642,660.24	2.36
19	300296	利亚德	2,562,099.00	2.29
20	601318	中国平安	2,449,837.00	2.19
21	600340	华夏幸福	2,348,689.00	2.10
22	300338	开元股份	2,298,333.20	2.05
23	601155	新城控股	2,263,087.00	2.02
24	000011	深物业A	2,260,517.00	2.02

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	192,874,334.29
卖出股票收入(成交)总额	228,799,791.71

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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

本基金将利用股指期货剥离多头股票资产部分的系统性风险或建立适当的股指期货多头头寸对冲市场向上风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。

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

本基金本报告期未投资于国债期货。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招商银行(600036)于2018年2月12日被银保监会做出行政处罚决定。招商银行因(一)内控管理严重违反审慎经营规则；(二)违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；(三)同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；(四)销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；(五)违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；(六)为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；(七)未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；(八)高管人员在获得任职资格核准前履职；(九)未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；(十)未严格审查贸易背景真实性开立信用证；(十一)违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；(十二)非真实转让信贷资产；(十三)违规向典当行发放贷款；(十四)违规向关系人发放信用贷款。罚款6570万元，没收违法所得3.024万元，罚没合计6573.024万元。

报告期内本基金投资的兴业银行(601166)于2018年4月19日被银保监会做出行政处罚决定。兴业银行因(一)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；(二)非真实转让信贷资产；(三)无授信额度或超授信额度办理同业业务；(四)内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；(五)同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；(六)债券卖出回购业务违规出表；(七)个人理财资金违规投资；(八)提供日期倒签的材料；(九)部分非现场监管统计数据与事实不符；(十)个别董事未经任职资格核准即履职；(十一)变相批量转让个人贷款；(十二)向四证不全的房地产项目提供融资。罚款5870万元。

基金管理人分析认为，我们判断上述两家公司发展战略清晰，公司整体呈现良好的发展态势。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八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	25,815.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,259.66
5	应收申购款	29,844.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	56,919.54

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

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

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
泰达宏利大数据混合A	20,081	2,943.17	0.00	0.00%	59,101,750.39	100.00%
泰达宏利大数据混合C	217	2,372.39	0.00	0.00%	514,808.34	100.00%
合计	20,298	2,937.07	0.00	0.00%	59,616,558.73	100.00%

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)。

8.3 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	泰达宏利大数据混合A	996,255.47	1.6857%
	泰达宏利大数据混合C	388.38	0.0754%
	合计	996,643.85	1.6718%

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

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	泰达宏利大数据混合A	10~50
	泰达宏利大数据混合C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达宏利大数据混合A	10~50
	泰达宏利大数据混合C	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达宏利大数据混合A	泰达宏利大数据混合C
基金合同生效日(2016年2月23日)基金份额总额	393,925,399.10	-
本报告期期初基金份额总额	86,925,393.56	2,295,088.22
本报告期基金总申购份额	7,146,205.88	391,161.53
减：本报告期基金总赎回份额	34,969,849.05	2,171,441.41
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	59,101,750.39	514,808.34

§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、本公司于2018年4月28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》，张萍女士因个人健康原因辞去公司督察长职务，由公司总经理刘建先生于4月28日起代为履行公司督察长职务。

2、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

本报告期内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

本报告期内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	
招商证券	1	129,913,517.27	30.89%	120,988.77	30.89%	-
广发证券	2	65,923,494.57	15.67%	61,392.30	15.67%	-
东方财富	1	58,110,947.82	13.82%	54,120.13	13.82%	-
天风证券	1	38,575,004.19	9.17%	35,925.65	9.17%	-
中信证券	2	30,759,313.98	7.31%	28,646.67	7.31%	-
国泰君安	1	20,187,651.96	4.80%	18,798.48	4.80%	-
太平洋	2	20,074,835.75	4.77%	18,695.86	4.77%	-
渤海证券	1	19,278,976.02	4.58%	17,954.00	4.58%	-
银河证券	2	18,519,410.43	4.40%	17,245.60	4.40%	-
东吴证券	1	9,837,315.32	2.34%	9,161.77	2.34%	-
申万宏源	2	9,422,534.14	2.24%	8,774.06	2.24%	-
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	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

注：(一)2018年上半年本基金新增长江证券交易单元。

(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

本基金本报告期未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称"《流动性风险规定》")以及相关基金合同和托管协议的有关规定，经与各基金托管人协商一致，并履行了必要程序，本基金管理人对本基金基金合同和托管协议进行修改。另外，根据《流动性风险规定》相关规定，自2018年3月31日起，本基金管理人对持续持有期少于7日的除货币市场基金外的基金赎回申请，收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。转换业务涉及的转出基金赎回费率等事项按上述规则进行调整，详情请见基金管理人2018年3月24日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下51只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告》以及更新后的基金合同与托管协议。

泰达宏利基金管理有限公司

2018年8月27日