泰达宏利启惠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22日

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人:北京银行股份有限公司

送出日期:2018年8月27日

§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。

基金托管人北京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22日(基金最后运作日)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	泰达宏利启惠混合	
基金主代码	004003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年3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	北京银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	5,007,631.73份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称;	泰达宏利启惠混合A	泰达宏利启惠混合C
下属分级基金的交易代码:	004003	004004
报告期末下属分级基金的份额总额	5,000,860.41份	6,771.32份

2.2基金产品说明

投资目标	本基金紧跟新常态下我国经济发展过程中的各类投资机遇,基于大类资产配置策略,力争为投资者创造较高投资收益
投资策略	本基金紧跟新常态下国民经济发展过程中各类投资机遇,结合国内外宏观经济发展趋势及各行业的发展前景,精选出具有长期竞争力和增长潜力的优质公司,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	中证全债指数收益率×75%+沪深300指数收益率×25%
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	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	袁静	刘晔
	联系电话	010-66577513	010-66223695
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	liuye1@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		400-698-8888	95526
传真		010-66577666	010-66226045

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

基金数据	泰达宏利启惠混合A	泰达宏利启惠混合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	27,211,710.55	3,270.89
本期利润	2,967,463.25	-390.46
加权平均基金份额本期利润	0.0304	-0.0319
本期基金份额净值增长率	-4.59%	-4.72%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年6月22日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0524	0.0489
期末基金资产净值	5,262,673.47	7,102.62
期末基金份额净值	1.0524	1.0489

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

4. 本财务报表的实际编制期间为2018年1月1日至2018年6月22日(基金最后运作日)

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

泰达宏利启惠混合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
2018.6.1-2018.6.22	-0.32%	0.04%	-1.07%	0.28%	0.75%	-0.24%
2018.4.1-2018.6.22	-0.82%	0.44%	-0.55%	0.27%	-0.27%	0.17%
2018.1.1-2018.6.22	-4.59%	0.90%	0.29%	0.28%	-4.88%	0.62%
2017.7.1-2018.6.22	3.91%	0.70%	2.64%	0.23%	1.27%	0.47%
自基金合同生效起至2018.6.22	6.87%	0.61%	4.38%	0.22%	2.49%	0.39%

泰达宏利启惠混合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
2018.6.1-2018.6.22	-0.35%	0.04%	-1.07%	0.28%	0.72%	-0.24%
2018.4.1-2018.6.22	-0.88%	0.44%	-0.55%	0.27%	-0.33%	0.17%
2018.1.1-2018.6.22	-4.72%	0.90%	0.29%	0.28%	-5.01%	0.62%
2017.7.1-2018.6.22	3.56%	0.70%	2.64%	0.23%	0.92%	0.47%
自基金合同生效起至2018.6.22	6.41%	0.61%	4.38%	0.22%	2.03%	0.39%

注:本基金的业绩比较基准:中证全债指数收益率*75%+沪深300指数收益率*25%

中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,中证指数有限公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标,为债券投资人提供投资分析工具和业绩评价基准。沪深300指数是由中证指数有限公司编制,从上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本的综合性指数,具有良好的市场代表性。本基金运用大类资产配置策略,严控下行风险,以为投资者创造稳定的较高收益为投资目标,因此选取"中证全债指数收益率×75%+沪深300指数收益率×25%"作为本基金的业绩比较基准。

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		
丁宇佳	本基金基金经理	2017年3月1日	2018年6月22日	10	中央财经大学理学学士;2008年7月加入泰达宏利基金管理有限公司,先后担任交易部交易员、固定收益部研究员、基金经理助理、基金经理、固定收益部总经理助理兼基金经理等职,具备10年基金从业经验,10年证券投资管理经验,具有基金从业资格。
庄腾飞	本基金基金经理、首席策略分析师	2017年3月7日	2018年6月22日	8	北京大学经济学硕士;2010年7月加入泰达宏利基金管理有限公司,任职于研究部,负责宏观经济、策略研究及金融、地产行业研究,曾先后担任助理研究员、研究员、高级研究员等职务,现任基金经理兼首席策略分析师;具备8年基金从业经验,8年证券投资管理经验,具有基金从业资格。
傅鸿	本基金基金经理助理	2017年3月3日	2018年6月22日	11	华中科技大学理学硕士;2007年7月至2011年8月,任职于东兴证券研究所,担任固定收益研究员;2011年8月至2013年4月,任职于中邮证券有限责任公司,担任投资主办人;2013年5月至2014年4月,任职于民生证券股份有限公司,担任投资经理;2014年5月至2016年11月,任职于中加基金管理有限公司,担任投资经理;2016年11月加入泰达宏利基金管理有限公司,先后担任固定收益部基金经理助理、基金经理等职,具备11年证券投资管理经验,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

报告期内,欧日经济持续货币政策正常化进程,经济稳步复苏,而美国经济超预期强劲,并逐步加强贸易保护政策,大幅压低全球金融市场风险偏好。二季度美元出现快速升值。新兴市场明显承压。国内宏微观数据出现一定背离,但在6月出现同步恶化。央行货币政策较预期宽松,2次降准释放流动性。

债券市场收益率整体下行,期限曲线陡峭化。信用事件频发,于6月集中引发较为强烈的避险情绪,信用利差大幅走阔。权益市场波动增加,1月大幅上涨后风格切换明显,各主要指数后续下跌均接近或超过10%。基于市场情况,本基金在纯债方面大幅增加久期,加大杠杆,谨慎选择部分高评级债券获取稳定票息。股票市场今年上半年,整体波动较大,一方面国内受到资管新规带来非标融资放缓,实体经济中民营企业融资压力加大,另一方面,中美贸易冲突加剧导致机构投资人对全球经济增长和国内增长产生担忧,风险偏好下降。报告期内,本基金的股票组合部分维持了此前持续的配置思路,股票组合主要配置在流动性好、估值低、高股息的监等价值股品种,包括银行、家电、食品饮料等。

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启惠混合A基金份额净值为1.0524元,本报告期基金份额净值增长率为-4.59%;截至本报告期末泰达宏利启惠混合C基金份额净值为1.0489元,本报告期基金份额净值增长率为-4.72%;同期业绩比较基准收益率为0.29%。

4.5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。

4.6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。

4.7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

1.报告期内,本基金存在连续超过20个工作日但不超过60个工作日基金份额持有人人数少于200人的情形。

2.截至2018年6月22日,本基金已出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万的情形。

§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,本基金托管人在托管泰达宏利启惠灵活配置混合型证券投资基金(以下称"本基金")的过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定,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,本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真地复核,对本基金的投资运作进行了监督,未发现基金管理人有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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、收益分配情况、投资组合报告的内容(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分,以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内),保证复核内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

§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:泰达宏利启惠灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月22日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月22日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	3,003,619.22	3,868,259.37
结算备付金	-	866,338.34
存出保证金	128,332.08	36,422.83
交易性金融资产	2,009,500.91	216,323,675.92
其中:股票投资	6,900.91	150,151,475.92
基金投资	-	-
债券投资	2,002,600.00	66,172,200.00
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	264,979.42	-
应收利息	16,287.30	1,584,927.51
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,422,718.93	222,679,623.97
负债和所有者权益	本期末 2018年6月22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	-	1,500,000.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	1,909.37	121,926.35
应付托管费	318.23	20,321.10
应付销售服务费	1.32	5.96
应付交易费用	8,521.76	101,370.02
应交税费	-	-
应付利息	-	5,547.96
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	142,192.16	220,000.00
负债合计	152,942.84	1,969,171.39
所有者权益:		
实收基金	5,007,631.73	200,105,416.10
未分配利润	262,144.36	20,605,036.48
所有者权益合计	5,269,776.09	220,710,452.58
负债和所有者权益总计	5,422,718.93	222,679,623.97

注:1报告截止日2018年6月22日(基金最后运作日),基金份额总额5,007,631.73份。其中下属A类基金份额5,000,860.41份,C类基金份额6,771.32份。下属A类基金份额净值1.0524元,C类基金份额净值1.0489元。

2.本期财务报表的实际编制期间为2018年1月1日至2018年6月22日(基金最后运作日)。比较财务报表的实际编制期间为2017年3月1日(基金合同生效日)至2017年12月31日。

6.2利润表

会计主体:泰达宏利启惠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22日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月22日	上年度可比期间 2017年3月1日(基金合同生效日)至2017年6月30日
一、收入	3,821,898.52	19,131,377.91
1.利息收入	800,508.24	7,516,175.82
其中:存款利息收入	21,851.62	5,009,809.30
债券利息收入	698,845.26	2,320,015.28
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	79,811.36	186,351.24
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	27,269,298.43	1,212,096.14
其中:股票投资收益	27,536,275.79	429,513.90
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-3,442.86	14,524.24
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	-263,534.50	768,058.00
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-24,247,908.45	10,403,012.70
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	0.30	93.25
减:二、费用	854,825.73	2,000,248.19
1.管理人报酬	324,105.50	1,202,473.24
2.托管费	54,017.60	200,412.20
3.销售服务费	20.09	266.80
4.交易费用	311,904.29	128,798.18
5.利息支出	410.94	378,249.65
其中:卖出回购金融资产支出	410.94	378,249.65
6.税金及附加	1,711.15	-
7.其他费用	162,656.16	90,048.12
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	2,967,072.79	17,131,129.72
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	2,967,072.79	17,131,129.72

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰达宏利启惠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22日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月22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)	200,105,416.10	20,605,036.48	220,710,452.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	2,967,072.79	2,967,072.79
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)	-195,097,784.37	-23,309,964.91	-218,407,749.28
其中:1.基金申购款	6,321.22	1,217.76	7,538.98
2.基金赎回款	-195,104,105.59	-23,311,182.67	-218,415,288.26
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)	5,007,631.73	262,144.36	5,269,776.09
项目	上年度可比期间 2017年3月1日(基金合同生效日)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)	600,461,238.33	-	600,461,238.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	17,131,129.72	17,131,129.72
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)	-296,593.29	-4,485.07	-301,078.36
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-296,593.29	-4,485.07	-301,078.36
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)	600,164,645.04	17,126,644.65	617,291,289.69

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

泰达宏利启惠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")正监许可[2016]2849号《关于准予泰达宏利启惠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《泰达宏利启惠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600,361,182.95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(2017)第144号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利启惠灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年3月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为600,461,238.33份基金份额,其中认购资金利息折合100,105.38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,基金托管人为北京银行股份有限公司(以下简称"北京银行")。

根据《泰达宏利启惠灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《泰达宏利启惠灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金自募集期起根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。其中,在投资人认购、申购时收取认购、申购费,但不再从本类别基金财产中计提销售服务费的一类基金份额,称为A类基金份额;在投资人认购、申购时不收取认购、申购费,但从本类别基金资产中计提销售服务费的一类基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择认购、申购某一类别的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利启惠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(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债券、可交换债券、可转债及分离交易可转债)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款(含同业存款、协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、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%;权证投资比例不超过基金资产净值的3%;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中证全债指数收益率×75%+沪深300指数收益率×25%。

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》、《泰达宏利启惠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。

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1月1日至2018年6月22日(基金最后运作日)的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22日(基金最后运作日)的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月22日(基金最后运作日)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
北京银行股份有限公司("北京银行")	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22日	上年度可比期间 2017年3月1日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	324,105.50	1,202,473.24
其中:支付销售机构的客户维护费	8.06	123.03

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0.60%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×0.60%/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22日	上年度可比期间 2017年3月1日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	54,017.60	200,412.20

注:支付基金托管人北京银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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×0.10%/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22日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利启惠混合A	泰达宏利启惠混合C	合计
北京银行	-	0.05	0.05
泰达宏利基金管理有限公司	-	1.48	1.48
合计	-	1.53	1.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年3月1日(基金合同生效日)至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利启惠混合A	泰达宏利启惠混合C	合计
北京银行	-	1.21	1.21
泰达宏利基金管理有限公司	-	0.13	0.13
合计	-	1.34	1.34

注:支付基金销售机构的销售服务费按C类基金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类基金基金份额销售服务费=C类基金基金份额前一日基金资产净值×0.30%/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