泰达宏利定宏混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9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
报告送出日期：2018年10月24日

§1 重要提示

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。

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10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期间为2018年7月1日至2018年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利定宏混合
交易代码	003104
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月13日
报告期末基金份额总额	50,370,189.93份
投资目标	本基金通过运用投资组合保险策略，在严格控制风险的基础上，追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金在保证资产配置符合基金合同规定的前提下，采用CPPI(Constant Proportion Portfolio Insurance)恒定比例组合保险策略来实现本金保值和增值的目标。CPPI主要根据市场的波动来调整、修正权益类资产的风险乘数，以确保投资组合在一段时间以后的价值不低于事先设定的某一目标价值，从而达到对投资组合保值增值的目的。投资过程中，基金管理人需在股票投资风险加大和收益增强这两者之间寻找适当的平衡点，即确定适当的风险乘数，力求既能够保证投资组合风险可控，又能尽量多为投资者创造更多收益。本基金的投资策略包含资产配置策略、固定收益类资产投资策略和权益类资产投资策略等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×25%+中证综合债券指数收益率×75%
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日－2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,601,896.99
2.本期利润	507,245.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0093
4.期末基金资产净值	49,982,685.67
5.期末基金份额净值	0.992

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。

3.2 基金净值表现

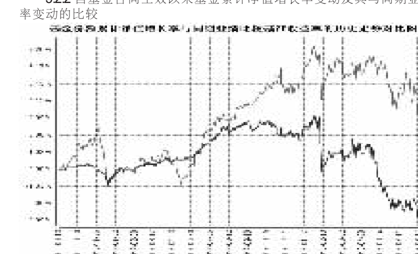
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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	1.02%	0.24%	0.58%	0.33%	0.44%	-0.09%

注：本基金业绩比较基准：中证综合债券指数收益率*75%+沪深300指数收益率*25%。

本基金选择市场认同度较高、行业分类标准和指数编制方法较为科学的沪深300指数作为本基金股票组合的业绩比较基准。沪深300指数由中证有限公司编制，是由沪深A股中规模大、流动股中规模大、流动性好的最具代表300只股票组成，可以综合反映沪深A股市场整体表现，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。中证综合债券指数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，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债，旨在全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。该指数具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势。本基金管理人认为，以沪深300指数收益率×25%+中证综合债券指数收益率×75%作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金持有人理性判断本基金产品的风险收益特征。

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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张勋	本基金基金经理；研究部副总监	2016年9月13日	-	12	对外经济贸易大学管理学硕士；2006年7月至2009年6月就职于天相投资顾问有限公司，担任研究组组长；2009年7月至2010年4月就职于东兴证券股份有限公司，担任研究组组长；2010年4月加入泰达宏利基金管理有限公司，曾担任研究员、高级研究员，现任研究部副总监兼基金经理。具备12年证券从业经验，12年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
庞宝臣	本基金基金经理	2016年9月26日	-	12	西安交通大学理学硕士；2006年7月至2011年8月，任职于永安财产保险股份有限公司，担任投资经理；2011年9月至2012年8月，任职于幸福人寿保险股份有限公司，担任高级经理、固定收益投资室负责人；2012年9月至2014年9月，任职于中华联合保险股份有限公司投资管理部，担任高级主管；2014年9月至2016年3月7日，任职于中华联合保险控股股份有限公司，担任投资经理；2016年3月10日加入泰达宏利基金管理有限公司，曾任固定收益部基金经理助理，现任基金经理。具备12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 公平交易专项说明

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。在本报告期内，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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，全球经济继续分化，美国经济保持强劲，劳动者薪酬增速提升，核心PCE上行，美联储维持既定加息节奏，美元保持强势；外债占比高企的新兴市场国家汇率大幅贬值，虽未对全球经济构成实质性冲击，但也降低了金融市场对新兴市场的风险偏好；叠加中美贸易摩擦升级，人民币汇率也受到一定影响，小幅贬值，外需前景不确定性上升；内需方面，去杠杆导向下融资条件收紧对投资需求的约束逐渐显现，基建投资低迷、地产投资回落，经济下行压力显现。

股票市场方面，宏观需求景气的下降，压制了盈利预期；融资条件紧张，股票市场流动性被动抽紧；虽然货币政策边际上转松，监管政策也由紧信用转向支持信用扩张，资金价格低位企稳，但对中小企业的融资恢复仍慢，信用溢价也维持高位，个股闪崩、强势股补跌显著地挫伤了市场情绪，风险溢价升至相对高位，本期内主要综合指数几乎全线下跌，大盘指数表现相对最好，中证100指数上涨1.12%，小盘指数表现较差，中证1000指数下跌-11.08%。

随着内外压力的上升，货币政策边际上转松，由稳健转为合理充裕，监管政策也由“去杠杆”转向“稳杠杆”，由紧信用到支持信用扩张；资金价格低位企稳，债券市场需求恢复，风险偏好缓慢回升，但受制于地方债放量发行，中长端债券收益率受供给压制，下行幅度较小，收益率陡峭化下行。

本期内，本组合3季度净值上涨1.43%，比较基准上涨1.34%，主要由于我们股票仓位维持在同类产品相对高的水平，并且持仓个股以大盘蓝筹为主；债券组合方面，考虑到规模的收缩，我们逐步减持了信用债，以流动性管理为主，对组合净值波动贡献较小。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.992元；本报告期基金份额净值增长率为1.02%，业绩比较基准收益率为0.58%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	10,961,994.64	21.85
	其中：股票	10,961,994.64	21.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	27,433,095.60	54.69
	其中：债券	27,433,095.60	54.69
	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	11,233,753.74	22.40
8	其他资产	529,372.16	1.06
9	合计	50,158,216.14	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境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	510,432.00	1.02
B	采矿业	6,071,410.64	12.15
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	490,560.00	0.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	919,050.00	1.84
J	金融业	2,970,542.00	5.94
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,961,994.64	21.93

5.2.2 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。

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	600028	中国石化	452,372	3,220,888.64	6.44
2	601088	中国神华	139,800	2,850,522.00	5.70
3	601998	中信银行	202,200	1,225,332.00	2.45
4	601318	中国平安	16,300	1,116,550.00	2.23
5	600050	中国联通	165,000	919,050.00	1.84
6	601229	上海银行	50,600	617,320.00	1.24
7	002299	圣农发展	31,200	510,432.00	1.02
8	600115	东方航空	87,600	490,560.00	0.98
9	601577	长沙银行	1,000	11,340.00	0.02

注：以上为本基金本报告期末持有的全部股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	9,795,160.00	19.60
2	央行票据	-	-
3	金融债券	14,695,460.00	29.40
	其中：政策性金融债	14,695,460.00	29.40
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	2,942,475.60	5.89
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	27,433,095.60	54.89

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明细

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明细

本基金报告期末未持有资产支持证券投资。

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明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

在报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	10,767.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	518,504.29
5	应收申购款	99.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	529,372.16

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120001	16以岭EB	2,942,475.60	5.89

5.11.5 报告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情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	58,447,642.65
报告期期间基金总申购份额	41,512.48
减：报告期期间基金总赎回份额	8,118,965.20
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	50,370,189.93

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金的管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

本公司于2018年9月27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》，聘任刘晓玲女士为公司副总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰达宏利定宏混合型证券投资基金设立的文件；
2、《泰达宏利定宏混合型证券投资基金基金合同》；
3、《泰达宏利定宏混合型证券投资基金招募说明书》；
4、《泰达宏利定宏混合型证券投资基金托管协议》；
5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
7、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资人可通过指定信息披露报纸(《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》)或登录基金管理人互联网网址(http://www.mfcteda.com)查阅。

泰达宏利基金管理有限公司
2018年10月24日

泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9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
报告送出日期：2018年10月24日

§1 重要提示

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。

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10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期间为2018年7月1日至2018年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利复兴混合
交易代码	001170
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月21日
报告期末基金份额总额	1,511,027,061.52份
投资目标	本基金紧跟新常态下国民经济发展过程中复兴伟业相关行业的投资机遇，基于大类资产配置策略，力争为投资者创造高于业绩比较基准的收益率。
投资策略	本基金紧跟新常态下国民经济发展过程中复兴伟业相关行业的投资机遇，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基准的良好回报。
业绩比较基准	50%*沪深300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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日－2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-225,581,369.81
2.本期利润	-159,687,301.43
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0958
4.期末基金资产净值	1,258,021,098.78
5.期末基金份额净值	0.833

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-9.85%	1.64%	-0.23%	0.67%	-9.62%	0.97%

注：本基金的业绩比较基准：50%*沪深300指数收益率+50%*中证综合债指数收益率。

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。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、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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴华	本基金基金经理	2015年4月21日	-	14	北京大学金融学硕士；2004年6月至2006年3月就职于方达基金管理有限公司，担任宏观策略分析员；2006年4月至2011年4月就职于中国国际金融有限公司，先后就职于研究部、资产管理部，担任经理、副总经理等职位；2011年5月加入泰达宏利基金管理有限公司，现任基金经理；具备14年证券从业经验，14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 公平交易专项说明

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。在本报告期内，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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年三季度组合业绩明显落后于基准。主要是因为组合行业配置和个股选择方面表现不佳。本基金此前配置了较多的具有国际竞争力的龙头公司。这些公司在电子和通信分布较多。受贸易摩擦预期的影响，这些板块表现明显落后市场。在8月9月上中旬，食品饮料和医药也出现大幅度下跌。这波下跌中，一些具有长线价值的优质龙头公司的投资价值显现出来，本基金在这个过程中逐步增持了这些优质龙头股票。这导致本基金中的优质龙头公司占比进一步上升。8月和9月上中旬，以小市值和低ROE为特征的劣质股走势明显强于优质龙头公司，这也导致组合业绩偏弱。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.833元；本报告期基金份额净值增长率为-9.85%，业绩比较基准收益率为-0.23%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,186,151,212.10	93.54
	其中：股票	1,186,151,212.10	93.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,120,000.00	1.59
	其中：债券	20,120,000.00	1.59
	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	53,237,198.75	4.20
8	其他资产	8,574,406.98	0.68
9	合计	1,268,082,817.83	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境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	844,928,071.94	67.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,074,699.76	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	56,760,022.54	4.51
J	金融业	172,138,954.36	13.68
K	房地产业	1,458.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	63,803,970.00	5.07
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	39,444,035.50	3.14
S	综合	-	-
	合计	1,186,151,212.10	94.29

5.2.2 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。

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	600519	贵州茅台	119,810	87,461,300.00	6.95
2	600276	恒瑞医药	1,280,109	81,286,921.50	6.46
3	603288	海天味业	1,025,500	81,219,600.00	6.46
4	600036	招商银行	2,556,094	78,446,524.86	6.24
5	600887	伊利股份	3,045,010	78,195,856.80	6.22
6	601318	中国平安	1,131,163	77,484,665.50	6.16
7	603899	晨光文具	2,147,637	66,684,128.85	5.30
8	002032	苏泊尔	1,224,530	66,100,129.40	5.25
9	603259	药明康德	689,400	63,803,970.00	5.07
10	002841	视源股份	1,030,900	62,060,180.00	4.93

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,120,000.00	1.60
	其中：政策性金融债	20,120,000.00	1.60
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,120,000.00	1.60

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明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018005	国开1701	200,000	20,120,000.00	1.60

注：以上为本基金本报告期末持有的全部债券投资。

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明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

基金管理人分析认为招商银行从2004年转型零售，大力发展零售业务，经过长期积累与发展逐渐形成独特的业务结构与经营特色，存款结构持续优化，资产配置稳健。我们判断属于此次行政处罚属于个别业务问题，不影响公司的正常稳健经营，不影响其长期投资价值，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九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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	382,840.42
2	应收证券清算款	7,756,773.61
3	应收股利	-
4	应收利息	389,828.62
5	应收申购款	44,964.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,574,406.98

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,677,176,389.51
报告期期间基金总申购份额	73,156,944.81
减：报告期期间基金总赎回份额	239,306,272.80
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,511,027,061.52

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金的管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180701-20180930	521,416,315.30	0.00	101,380,000.00	420,036,315.30	27.80%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情况，易发生巨额赎回的情况，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

注：报告期内，申购份额含红利再投资份额。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本公司于2018年9月27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》，聘任刘晓玲女士为公司副总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
2、《泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3、《泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
4、《泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
7、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资人可通过指定信息披露报纸(《中国证券报》《证券日报》)或登录基金管理人互联网网址(http://www.mfcteda.com)查阅。

泰达宏利基金管理有限公司
2018年10月24日

泰达宏利宏达混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9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
报告送出日期：2018年10月24日

§1 重要提示

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。

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10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期间为2018年7月1日至2018年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利宏达混合	
交易代码	000507	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年3月5日	
报告期末基金份额总额	245,799,170.83份	
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极主动的管理，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金管理人充分发挥自身的研究优势，将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，自上而下决定债券组合久期、期限结构配置及债券类别配置；同时在严谨深入的信用分析基础上，综合考量企业债券的信用评级以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，自下而上地精选具有较高投资价值的个券。同时，本基金深度关注股票市场的运行状况与相应风险收益特征，在严格控制基金资产运作风险的基础上，把握投资机会。	
业绩比较基准	人民银行一年期银行定期存款基准利率收益率(税后)+2%。	
风险收益特征	本基金为混合型基金，在证券投资基金中属于较高风险的品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	泰达宏利宏达混合A	泰达宏利宏达混合B
下属分级基金的交易代码	000507	000508
报告期末下属分级基金的份额总额	216,382,481.21份	29,416,689.62份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日－2018年9月30日)	
	泰达宏利宏达混合A	泰达宏利宏达混合B
1.本期已实现收益	3,882,032.01	480,213.01
2.本期利润	6,005,856.68	755,387.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0269	0.0251
4.期末基金资产净值	257,883,320.27	34,070,838.03
5.期末基金份额净值	1.192	1.158

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

泰达宏利宏达混合A

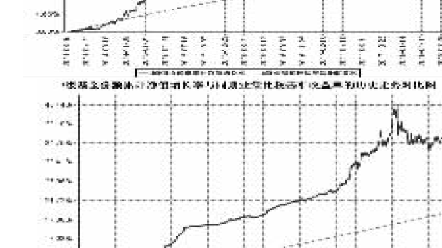
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	2.32%	0.24%	0.87%	0.01%	1.45%	0.23%

泰达宏利宏达混合B

阶段	净值增长率①	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	2.21%	0.24%	0.87%	0.01%	1.34%	0.23%

注：本基金业绩比较基准：人民银行一年期银行定期存款基准利率收益率(税后)+2%。

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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2015年6月16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。

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 公平交易专项说明

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。在本报告期内，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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，海外经济持续反弹，欧日经济数据颇有亮点，美国在经济超预期上行中扩大实行贸易保护政策，而美联储按预期节奏继续加息。全球金融市场风险偏好大幅降低，新兴市场明显承压。国内方面，投资数据暂时坚挺，消费受汽车、家电两大项的拖累，贸易数据出现明显“抢跑”迹象。而金融数据的大幅弱化预示信用扩张严重不足，未来经济存在明显下行压力。通胀方面，受到天气、疫情等非人为因素影响，CPI食品项同比连续超预期，但PPI超预期回落。货币政策保持宽松，财政政策方面，地方债大量发行，但基建等项目落地情况并不乐观。

债券市场弥漫担忧滞胀的情绪，短端被宽松的货币环境压制，1年以上品种收益率曲线震荡上行，利率债陡峭化程度达到历史高位。信用违约事件连续发生，信用市场分化明显，信用利差继续扩大。权益市场在低位盘整，成交量持续萎缩。其中，具有业绩支撑的蓝筹股出现反弹迹象。整体市场情绪较为悲观。

报告期内，我们认为利率债、高等级债券在收益率大幅反弹后具有较高的投资价值，本基金继续增加利率债仓位以及久期，增加杠杆，谨慎选择部分高评级债券获取稳定票息。权益方面，我们认为部分低估值高增长个股已经位于底部区间，逐步增加了股票仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达宏利宏达混合A基金份额净值为1.192元，本报告期基金份额净值增长率为2.32%；截至本报告期末泰达宏利宏达混合B基金份额净值为1.158元，本报告期基金份额净值增长率为2.21%；同期业绩比较基准收益率为0.87%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	44,739,350.00	15.26
	其中：股票	44,739,350.00	15.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	241,324,800.00	82.32
	其中：债券	241,324,800.00	82.32
	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	1,000,000.00	0.34
	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	332,129.67	0.11
8	其他资产	5,751,865.28	1.96
9	合计	293,148,144.95	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境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,262,384.00	1.12
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	41,476,966.00	14.21
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	44,739,350.00	15.32

5.2.2 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。

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	601288	农业银行	3,767,200	14,654,408.00	5.02
2	601398	工商银行	2,000,000	11,540,000.00	3.95
3	600036	招商银行	333,200	10,225,908.00	3.50
4	601318	中国平安	47,900	3,281,150.00	1.12
5	600028	中国石化	458,200	3,262,384.00	1.12
6	601601	中国太保	50,000	1,775,500.00	0.61

注：以上为本基金本报告期末持有的全部股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,403,800.00	34.39
	其中：政策性金融债	100,403,800.00	34.39
4	企业债券	10,135,000.00	3.47
5	企业短期融资券	100,807,000.00	34.53
6	中期票据	29,979,000.00	10.27
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	241,324,800.00	82.66

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明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180403	18农发03	400,000	41,488,000.00	14.21
2	180204	18国开04	300,000	30,873,000.00	10.57
3	011800208	18大同煤矿SCP002	200,000	20,172,000.00	6.91
4	011801068	18首钢SCP007	200,000	20,170,000.00	6.91
5	011801052	18陕煤化SCP009	200,000	20,160,000.00	6.91

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明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末不投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

基金管理人分析认为，我们判断公司发展战略清晰，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九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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	24,141.24
2	应收证券清算款	701,821.10
3	应收股利	-
4	应收利息	4,846,915.74
5	应收申购款	178,987.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,751,865.28

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达宏利宏达混合A	泰达宏利宏达混合B
报告期期初基金份额总额	232,073,824.27	31,475,497.99
报告期期间基金总申购份额	7,168,018.99	1,953,835.65
减：报告期期间基金总赎回份额	22,859,362.05	4,012,644.02
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	216,382,481.21	29,416,689.62

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金的管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180701-20180930	64,297,875.14	-	-	64,297,875.14	26.16%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情况，易发生巨额赎回的情况，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

注：报告期内，申购份额含红利再投资份额。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本公司于2018年9月27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》，聘任刘晓玲女士为公司副总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰达宏利宏达混合型证券投资基金设立的文件；
2、《泰达宏利宏达混合型证券投资基金基金合同》；
3、《泰达宏利宏达混合型证券投资基金招募说明书》；
4、《泰达宏利宏达混合型证券投资基金托管协议》；
5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
7、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资人可通过指定信息披露报纸(《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》)或登录基金管理人互联网网址(http://www.mfcteda.com)查阅。

泰达宏利基金管理有限公司
2018年10月24日