泰达宏利宏达混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

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:2019年1月22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2019年1月18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10月1日至2018年12月31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	239,080,053.78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	213,797,718.93份 / 25,282,334.85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10月1日－2018年12月31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	1,967,089.80	214,872.47
2. 本期利润	－2,153,866.93	－295,400.54
3. 加权平均基金份额本期利润	－0.0100	－0.0109
4. 期末基金资产净值	252,666,221.42	29,012,897.29
5. 期末基金份额净值	1.182	1.148

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	－0.84%	0.22%	0.87%	0.01%	－1.71%	0.21%

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	－0.86%	0.22%	0.87%	0.01%	－1.73%	0.21%

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。先后担任交易席交易员、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。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,美国经济出现增速拐点,美联储加息一次,但后续加息预期有所弱化。欧央行拟减少资产购买,全球流动性有收紧迹象,金融市场风险偏好大幅降低,新兴市场明显承压。

国内方面,出口回落明显,金融数据出现较大幅度回落,预示实体主动融资需求明显收缩,经济下行压力近一步显现。

债券市场呈现明显牛平格局,长端利率大幅下行,广义基金配置力量强劲。临近年末,出现一定的交易拥挤现象。

股票市场在政策维稳的情况下,情绪仍然悲观,主要指数全线下跌且跌幅大多超过10%。

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1.182元,本报告期基金份额净值增长率为－0.84%;截至本报告期末泰达宏利宏达混合B基金份额净值为1.148元，本报告期基金份额净值增长率为－0.86%；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	38,625,694.00	12.27
	其中:股票	38,625,694.00	12.27
2	基金投资	－	－
3	固定收益投资	249,611,800.00	79.31
	其中:债券	249,611,800.00	79.31
	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	20,685,051.91	6.57
8	其他资产	5,825,614.26	1.85
9	合计	314,748,160.17	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	－	－
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,031,040.00	1.08
E	建筑业	－	－
F	批发和零售业	－	－
G	交通运输、仓储和邮政业	3,026,994.00	1.07
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	32,567,660.00	11.56
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	38,625,694.00	13.71

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	601398	工商银行	2,000,000	10,580,000.00	3.76
2	601288	农业银行	2,675,100	9,630,360.00	3.42
3	600036	招商银行	333,200	8,396,640.00	2.98
4	601318	中国平安	70,600	3,960,660.00	1.41
5	600795	国电电力	1,184,000	3,031,040.00	1.08
6	601006	大秦铁路	367,800	3,026,994.00	1.07

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	108,753,800.00	38.61
	其中:政策性金融债	108,753,800.00	38.61
4	企业债券	40,321,000.00	14.31
5	企业短期融资券	70,219,000.00	24.93
6	中期票据	30,122,000.00	10.69
7	可转债(可交换债)	196,000.00	0.07
8	同业存单	－	－
9	其他	－	－
10	合计	249,611,800.00	88.62

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	42,132,000.00	14.96
2	180204	18国开04	300,000	31,416,000.00	11.15
3	170215	17国开15	200,000	20,642,000.00	7.33
4	011801144	18鲁黄金SCP009	200,000	20,156,000.00	7.16
5	101653015	16平安租赁MTN004	200,000	20,084,000.00	7.13

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

本基金本报告期末投资于国债期货。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	12,883.88
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	5,611,635.53
5	应收申购款	201,094.85
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	5,825,614.26

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	216,382,481.21	29,416,689.62
报告期期间基金总申购份额	10,705,288.68	507,835.87
减:报告期期间基金总赎回份额	13,290,030.96	4,642,190.64
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"－"填列)	－	－
报告期末基金份额总额	213,797,718.93	25,282,334.85

§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	20181001－20181231	64,297,875.14	0.00	0.00	64,297,875.14	26.89%
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

1.本公司于2018年11月10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》,聘任聂志刚先生为公司督察长。

2.本公司于2018年12月22日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于股权变更的公告》，原公司中方股东北方国际信托股份有限公司将所持有的泰达宏利基金管理有限公司全部51%股权转让给天津市泰达国际控股(集团)有限公司。此次股权转让完成后,公司的注册资本保持不变,仍为人民币1.8亿元。

§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》)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
2019年1月22日

泰达宏利沪深300指数增强型证券投资基金

2018年第四季度报告

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:2019年1月22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2019年1月18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10月1日至2018年12月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利沪深300
交易代码	162213
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年3月16日
报告期末基金份额总额	150,502,536.11份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金,在对沪深300指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%,力争获取超越标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略,在控制与比较基准偏离风险的前提下,综合利用多种量化投资模型和指数增强技术,力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+同业存款利率×5%。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金,其预期风险和预期收益高于混合型基金、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
下属分级基金的基金简称	泰达宏利沪深300A / 泰达宏利沪深300C
下属分级基金的交易代码	162213 / 003548
报告期末下属分级基金的份额总额	149,330,311.10份 / 1,172,225.01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10月1日－2018年12月31日)	
	泰达宏利沪深300A	泰达宏利沪深300C
1. 本期已实现收益	－10,122,272.27	－124,688.41
2. 本期利润	－25,311,138.67	－267,282.69
3. 加权平均基金份额本期利润	－0.1731	－0.1624
4. 期末基金资产净值	171,664,094.93	1,351,727.94
5. 期末基金份额净值	1.1496	1.1531

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

泰达宏利沪深300A

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	－13.19%	1.58%	－11.83%	1.56%	－1.36%	0.02%

泰达宏利沪深300C

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	－13.25%	1.58%	－11.83%	1.56%	－1.42%	0.02%

注:本基金业绩比较基准:95%×沪深300指数收益率+5%×同业存款利率。

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:本基金于2018年3月16日转型,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		
杨超	本基金基金经理	2018年3月16日	－	8	英国南威尔士大学数学与金融计算硕士;2010年5月加入建信基金管理有限公司,从事金融工程等工作,历任投资管理部助理研究员、初级研究员、基金经理助理等职务;2014年6月加入泰达宏利基金管理有限公司,担任基金经理助理。现任基金经理。具备8年证券基金从业经验,8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

四季度市场维持震荡向下的趋势,权重股和中小盘股票持续低迷。市场流动性不断萎缩,给与组合管理带来一定的困难,本基金灵活运用多种策略,积极复制指数,极力减少申购赎回的冲击和成分股的调整给组合带来的误差冲击,通过积极管理偏离度将跟踪误差控制在了合同范围内,同时本基金将持续跟踪基本面因子的风险溢价,力争为组合创造超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达宏利沪深300A基金份额净值为1.1496元,本报告期基金份额净值增长率为－13.19%；截至本报告期末泰达宏利沪深300C基金份额净值为1.1531元,本报告期基金份额净值增长率为－13.25%;同期业绩比较基准收益率为－11.83%。

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	163,747,887.10	94.36
	其中:股票	163,747,887.10	94.36
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	9,640,175.00	5.56
8	其他资产	141,853.74	0.08
9	合计	173,529,915.84	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	57,500.00	0.03
B	采矿业	3,658,189.00	2.11
C	制造业	43,980,347.69	25.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,510,370.00	3.18
E	建筑业	5,694,305.00	3.29
F	批发和零售业	－	－
G	交通运输、仓储和邮政业	4,396,582.28	2.54
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,044,714.00	1.76
J	金融业	58,220,290.62	33.65
K	房地产业	8,414,430.04	4.86
L	租赁和商务服务业	1,914,360.00	1.11
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	2,118,256.76	1.22
S	综合	658,560.00	0.38
	合计	26,404,008.47	15.26

5.2.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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	601318	中国平安	252,695	14,176,189.50	8.19
2	601688	华泰证券	318,900	5,166,180.00	2.99
3	600016	民生银行	891,600	5,108,968.00	2.95
4	000651	格力电器	140,400	5,010,876.00	2.90
5	600887	伊利股份	201,493	4,610,159.84	2.66
6	601939	建设银行	688,221	4,383,967.77	2.53
7	600519	贵州茅台	7,416	4,375,514.16	2.53
8	002415	海康威视	163,300	4,206,608.00	2.43
9	600036	招商银行	162,567	4,096,688.40	2.37
10	600606	绿地控股	662,500	4,047,875.00	2.34

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600511	国药股份	117,800	2,738,850.00	1.58
2	600718	东软集团	226,797	2,619,505.35	1.51
3	600755	厦门国贸	340,900	2,379,482.00	1.38
4	600426	华鲁恒升	187,900	2,267,953.00	1.31
5	000778	新兴铸管	506,800	2,184,308.00	1.26

5.4 报告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明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

本基金在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

本基金在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,在报告编制日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	19,284.49
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	2,197.33
5	应收申购款	120,371.92
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	141,853.74

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

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	泰达宏利沪深300A	泰达宏利沪深300C
报告期期初基金份额总额	141,848,120.01	2,084,311.33
报告期期间基金总申购份额	12,881,510.80	230,616.96
减:报告期期间基金总赎回份额	5,399,319.71	1,142,703.28
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	149,330,311.10	1,172,225.01

§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	20181001－20181231	55,661,450.92	0.00	0.00	55,661,450.92	36.98%
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

1、本公司于2018年11月10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》,聘任聂志刚先生为公司督察长。

2、本公司于2018年12月22日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于股权变更的公告》，原公司中方股东北方国际信托股份有限公司将所持有的泰达宏利基金管理有限公司全部51%股权转让给天津市泰达国际控股(集团)有限公司。此次股权转让完成后,公司的注册资本保持不变,仍为人民币1.8亿元。

§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沪深300指数增强型证券投资基金设立的文件;

2、《泰达宏利沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》;

3、《泰达宏利沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书》;

4、《泰达宏利沪深300指数增强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》)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
2019年1月22日

泰达宏利汇利债券型证券投资基金

2018