

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7月16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，并对其中内容的真实性、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7月12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当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。

本报告期财务报告期为2019年4月1日至2019年6月30日。

§ 2 基金基本情况

基金简称 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

交易代码 000107

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金份额首次确认日 2015年2月13日

报告期末基金份额总额 326,500,896.68份

投资目标 本基金通过大类资产配置策略，同时深入研究市场变化，通过中长期的资产配置，实现股票型基金、债券型基金、货币型基金等不同资产的配置比例为0%~95%，其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、期权、资产支持证券等金融工具。因此，“50%”沪深300指数组收益+50%“中证综合债指数收益率”是适合衡量本基金投资绩效的比较基准。

本基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应当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。

本报告期财务报告期为2019年4月1日至2019年6月30日。

§ 3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标		报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)		
		泰达宏利改革动力混合A	泰达宏利改革动力混合C	
1.本期已实现收益		30,277,242.03	13,893.26	
2.本期利润		-4,067,177.77	-15,403.64	
3.加权平均基金份额本期利润		-0.0122	-0.0076	
4.期末基金资产净值		403,730,238.08	227,962.76	
5.期末基金份额净值		1.2101	1.2179	

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.所述基金额度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将低于所列示。

3.基金净值表现

3.1 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

泰达宏利改革动力混合A

阶段 净值增长 率(%) 净值增长率 标准差(%) 收益率(%) 收益率标准差(%) ① -10.4% 10.7% -0.1% 0.7% ② -0.02% 15.7% -11.1% 0.7% -0.01% 0.62%

注：1.本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率\*50%+中证综合债指数收益率\*50%

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

泰达宏利改革动力混合A

阶段 净值增长 率(%) 净值增长率 标准差(%) 收益率(%) 收益率标准差(%) ① -1.3% 2.4% -0.1% 0.3% ② -0.03% 0.7% 0.0% 0.0%

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.所述基金额度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将低于所列示。

3.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

泰达宏利改革动力混合C

阶段 净值增长 率(%) 净值增长率 标准差(%) 收益率(%) 收益率标准差(%) ① -1.0% 1.0% -0.1% 0.1% ② -0.02% 1.5% -0.11% 0.7% -0.01% 0.62%

注：1.本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率\*50%+中证综合债指数收益率\*50%

3.3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标		报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)		
		泰达宏利改革动力混合A	泰达宏利改革动力混合C	
1.本期已实现收益		311,418.00		
2.本期利润		2,136,907.64	209,712.26	
3.加权平均基金份额本期利润		0.0137	0.0103	
4.期末基金资产净值		192,826,703.76	26,401,434.61	
5.期末基金份额净值		1.2022	1.1906	

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.所述基金额度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将低于所列示。

3.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

泰达宏利改革动力混合A

阶段 净值增长 率(%) 净值增长率 标准差(%) 收益率(%) 收益率标准差(%) ① -1.3% 2.4% -0.1% 0.3% ② -0.02% 1.5% -0.11% 0.7% -0.01% 0.62%

注：1.本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率\*50%+中证综合债指数收益率\*50%

3.3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标		报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)		
		泰达宏利改革动力混合A	泰达宏利改革动力混合C	
1.本期已实现收益		311,418.00		
2.本期利润		2,136,907.64	209,712.26	
3.加权平均基金份额本期利润		0.0137	0.0103	
4.期末基金资产净值		192,826,703.76	26,401,434.61	
5.期末基金份额净值		1.2022	1.1906	

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.所述基金额度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将低于所列示。

3.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

泰达宏利改革动力混合C

阶段 净值增长 率(%) 净值增长率 标准差(%) 收益率(%) 收益率标准差(%) ① -1.0% 1.0% -0.1% 0.1% ② -0.02% 1.5% -0.11% 0.7% -0.01% 0.62%

注：1.本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率\*50%+中证综合债指数收益率\*50%

3.3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标		报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)		
		泰达宏利改革动力混合A	泰达宏利改革动力混合C	
1.本期已实现收益		311,418.00		
2.本期利润		2,136,907.64	209,712.26	
3.加权平均基金份额本期利润		0.0137	0.0103	
4.期末基金资产净值		192,826,703.76	26,401,434.61	
5.期末基金份额净值		1.2022	1.1906	

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.所述基金额度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将低于所列示。

3.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

泰达宏利改革动力混合A

阶段 净值增长 率(%) 净值增长率 标准差(%) 收益率(%) 收益率标准差(%) ① -1.3% 2.4% -0.1% 0.3% ② -0.02% 1.5% -0.11% 0.7% -0.01% 0.62%

注：1.本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率\*50%+中证综合债指数收益率\*50%

3.3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标		报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)		
		泰达宏利改革动力混合A	泰达宏利改革动力混合C	
1.本期已实现收益		311,418.00		
2.本期利润		2,136,907.64	209,712.26	
3.加权平均基金份额本期利润		0.0137	0.0103	
4.期末基金资产净值		192,826,703.76	26,401,434.61	
5.期末基金份额净值		1.2022	1.1906	

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.所述基金额度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将低于所列示。

3.基金净值表现