

泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)

2019年半年度报告摘要

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2019年8月24日

§ 1 重要提示

1.1 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。

基金管理人根据《中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月22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。

基金过往业绩并不代表未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期财务资料未经审计。

本基金报告期2019年1月1日起至2019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，请阅读半年度报告全文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利效率优选混合(LOF)
基金代码	162027
基金产品类型	上证红利联接开放式(LOF)
基金合同生效日	2006年1月12日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金资产总额	604,299,107.07元
基金合同的存续期	不定期
基金上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2009年7月21日

2.2 基金产品说明

投资目标 在充分控制投资风险的前提下，兼顾投资收益，力争在中长期实现资本的稳定增值。

本基金投资策略 “自下而上”地精选个股，相辅相成的资产配置，即通过股票、债券及货币市场工具的配置，实现资产的保值增值。

投资策略 本基金在投资管理活动中，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的机会，严格执行投资管理职能和交易执行职能的分离，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；交易规则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指指令，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

机。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未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期财务资料未经审计。

本基金报告期2019年1月1日起至2019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，请阅读半年度报告全文。

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	中国建设银行股份有限公司
姓名	张志刚	田雨
信息披露负责人	010-65576728	010-55695000
电子邮箱	lmdm@tdmfund.com	lmb@cboc.com
客户服务电话	400-898-0088	010-67666000
传真	010-66577666	010-66577663

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址: http://www.tdmfund.com

基金半年度报告备查目录

基金管理人和基金托管人的住所

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

3.1.1 当期数据和指标	报告期2019年1月1日至2019年6月30日
本期已实现收益	26,003,277.64
本期利润	163,116,677.18
加权平均基金份额本期利润	0.2880
本期基金份额净值增长率	27.74%

3.1.2 期末数据和指标

报告期/期2019年6月30日

期初基金份额净值

0.9062

期末基金份额净值

0.9060

报告期末基金资产净值

799,711,771.00

报告期末基金份额总额

1,324,000.00份

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,计算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

阶段 份额净增
长率(%) 比例化
基准收益
率(%) 业绩比
较基准
收益率(%)

过去一个月 6.61% 1.30% 0.08% 3.40% 0.03%

过去二个月 8.17% 1.20% -1.12% 9.20% 0.03%

过去三个月 27.74% 1.06% 16.14% 0.02% 11.00% 0.16%

过去一年 6.00% 1.24% 0.08% -0.08% 0.04%

过去三年 10.13% 1.08% 11.34% 0.06% 7.70% 0.42%

自基
金合
同
生
效
至
今 20.46% 1.26% 16.00% 1.00% 64.70% 0.29%

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,计算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。

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 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

基金名称 泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日: 2019年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末	上年年末
银行存款	26,224,260.62	27,518,572.05
结算备付金	268,716.88	369,430.03
存出保证金	155,774.67	244,104.13
交易性金融资产	770,420,006.68	671,194,447.20
其中：股票投资	660,409,153.26	489,977,966.30
基金投资	-	-
债券投资	211,920,863.03	182,176,461.00
衍生金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收股利	7,068,247.66	1,416,204.00
应收利息	1,872,564.20	4,662,975.10
应收股利	-	-
应收申购款	14,917.96	7,100.00
应付赎回款	-	-
应付交易费用	-	-
应付所得税款	4,110,503.63	4,110,607.07
应付利息	-	-
应付股利	-	-
应付申购款	620,110.04	63,050.50
应付赎回款	944,578.96	902,204.03
应付托管费	157,409.47	150,307.40
应付佣金	-	-
应付手续费	-	-
应付交易费用	289,152.69	469,300.73
应付税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
应付申购款	620,110.04	63,050.50
应付赎回款	944,578.96	902,204.03
应付托管费	157,409.47	150,307.40
应付佣金	-	-
应付手续费	-	-
应付交易费用	289,152.69	469,300.73
应付税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
应付申购款	620,110.04	63,050.50
应付赎回款	944,578.96	902,204.03
应付托管费	157,409.47	150,307.40
应付佣金	-	-
应付手续费	-	-
应付交易费用	289,152.69	469,300.73
应付税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
应付申购款	620,110.04	63,050.50
应付赎回款	944,578.96	902,204.03
应付托管费	157,409.47	150,307.40
应付佣金	-	-
应付手续费	-	-
应付交易费用	289,152.69	469,300.73
应付税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
应付申购款	620,110.04	63,050.50
应付赎回款	944,578.96	902,204.03
应付托管费	157,409.47	150,307.40
应付佣金	-	-
应付手续费	-	-
应付交易费用	289,152.69	469,300.73
应付税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
应付申购款	620,110.04	63,050.50
应付赎回款	944,578.96	902,204.03
应付托管费	157,409.47	150,307.40
应付佣金	-	-
应付手续费	-	-
应付交易费用	289,152.69	469,300.73
应付税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
应付申购款	620,110.04	63,050.50
应付赎回款	944,578.96	902,204.03
应付托管费	157,409.47	150,307.40
应付佣金	-	-
应付手续费	-	-
应付交易费用	289,152.69	469,300.73
应付税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
应付申购款	620,110.04	63,050.50
应付赎回款	944,578.96	902,204.03
应付托管费	157,409.47	150,307.40
应付佣金	-	-
应付手续费	-	-
应付交易费用	289,152.69	469,300.73
应付税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
应付申购款</td		