泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

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:2017年3月30日

§1 重要提示

1.1 重要提示

本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。本年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3月28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。

本报告财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利蓝筹混合
基金主代码	001267
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月3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
报告期末基金份额总额	243,470,171.87份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严控风险的基础上,通过积极、主动的管理,精选业绩优良、收益稳定、在行业或细分行业内具有领先地位且价值相对低估的优质蓝筹上市公司股票,力争为投资者获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将科学、规范的选股方法与积极、灵活的资产配置相结合,通过“自上而下”和“自下而上”相结合的方法构建基金资产组合。一方面,本基金在对国内外宏观经济发展趋势、相关政策深入研究的基础上,从“自上而下”的角度对大类资产进行优化配置,并优选受益行业;另一方面,本基金凭借多年来不断积累形成的选股框架,从商业模式、市场前景、竞争壁垒、财务状况等方面出发,以“自下而上”的视角精选出具有长期竞争力和增长潜力的优质蓝筹上市公司,力求获取超越平均水平的良好回报。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×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。

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
信息披露负责人	姓名	陈沛	田青
	联系电话	010-66577808	010-67596096
	电子邮箱	ims@mfcteda.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话?		400-69-88888	010-67596096
传真		010-66577666	010-66275853

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.mfcteda.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年	2015年6月3日(基金合同生效日)-2015年12月31日
本期已实现收益	-50,339,388.78	-111,514,519.59
本期利润	-54,252,366.35	-104,893,432.22
加权平均基金份额本期利润	-0.2031	-0.3104
本期基金份额净值增长率	-26.64%	-26.80%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	-0.4761	-0.2968
期末基金资产净值	130,778,014.20	205,778,670.34
期末基金份额净值	0.537	0.732

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. 期末可供分配利润等于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;

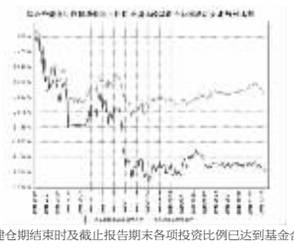
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-2.54%	0.74%	0.51%	0.44%	-3.05%	0.30%
过去六个月	-9.29%	0.90%	3.24%	0.46%	-12.53%	0.44%
过去一年	-26.64%	1.76%	-5.60%	0.84%	-21.04%	0.92%
自基金合同生效起至今	-46.30%	1.84%	-19.63%	1.21%	-26.67%	0.63%

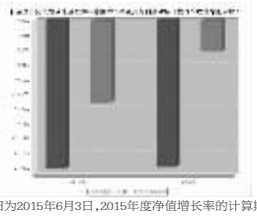
注:本基金的业绩比较基准:沪深300指数收益率*60%+中证综合债指数收益率*40%

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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



本基金合同生效日为2015年6月3日,2015年度净值增长率的计算期间为2015年6月3日至2015年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同于2015年6月3日生效。根据本基金合同及基金实际运作的情况,本基金自成立以来到本报告期末未进行利润分配。目前无其他收益分配安排。

§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、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金、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、泰达宏利收益增强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、泰达宏利养老收益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、泰达宏利多元回报债券型证券投资基金、泰达宏利增利灵活配置定期开放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在内的四十多只证券投资基金。

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		
陈丹琳	基金经理	2015年6月3日	-	9	经济学硕士;2007年7月加入泰达宏利基金管理有限公司,曾担任研究员、研究主管、研究部总经理助理等职务,具备9年证券投资管理经验,9年基金从业经验,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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人建立了公平交易制度和内部控制流程,严格执行相关制度规定。在投资管理活动中,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;在交易环节实行集中交易制度,交易部运用交易系统中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,确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易,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。

基金管理人的风险管理部定期对基金管理人管理的不同投资组合的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)基金管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析,并经公司管理层审核签署后存档备查。基金管理人的监察稽核部定期对公平交易制度的执行和控制工作进行稽核。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人的风险管理部事后从交易指令的公平性、同日反向交易、不同窗口下的同向交易溢价率和风格相似的基金的业绩等方面,对报告期内的公平交易执行情况进行统计分析。本报告期内,交易指令多为指令下达人管理的多只资产组合同时下发,未发现明显的非公平交易指令;基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易;场外交易的交易价格与市场价格一致,场内交易的溢价率在剔除交易时间差异、交易数量悬殊、市场波动剧烈等因素后,处于正常范围之内;基金管理人管理的各投资组合的业绩由于投资策略、管理风格、业绩基准等方面的因素而有所不同。

本报告期内,本基金管理人管理的各投资组合之间未发现利益输送或不公平对待不同组合的情况。

4.3.3 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,风险管理部对可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控,对异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析,定期对各投资组合的交易行为进行整体分析评估,定期向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。如发现疑似异常交易情况,相关投资组合经理对该交易情况进行合理性解释。监察稽核部定期对异常交易制度的执行和控制工作进行稽核。

本报告期内,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况共出现了30次。30次涉及的投资组合一方均为按照量化策略进行投资,虽然买卖股票量少,但由于个股流动性较差,交易量小,致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%,未发现异常。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构处罚的情况。

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

2016年股票市场在经历了年初的熔断式大幅下跌后窄幅震荡上行,沪深300指数全年下跌11.28%。从行业看,食品饮料、建材、建筑、家电、银行等偏稳定价值类的行业表现靠前,而计算机和传媒等成长类行业由于2015年积累的泡沫较大,2016年表现垫底。从大小票风格看,上证50指数全年仅下跌5.53%,创业板指全年大幅下跌27.70%。

从宏观和行业层面看,上中游周期类行业盈利明显回升,原因是2013-2015年的盈利压缩导致的自发去产能和库存叠加了2016年的供给侧改革和环保带来的去产能。中高端消费景气亦回升明显,整体经济展现了较好的韧性,开始有触底回升的迹象。

本基金在年初大幅下跌以及紧随其后展开的风格切换行情中,反应不够及时,导致基金业绩不理想。下半年我们开始有效修正在择时和择股上的操作细节,注重风险和收益的匹配,基金业绩在收益和波动性指标上有所好转。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为0.537元,本报告期份额净值增长率为-26.64%,同期业绩比较基准增长率为-5.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,虽然以债券收益率为代表的金融利率的上升幅度较大,但是代表企业融资成本的贷款利率还在较低的水平,如果考虑PPI的涨幅,企业融资的实际利率更低,这也在一定程度上解释了2017年开年后高涨的信贷需求。来自微观层面的指标在不断地反馈经济好转的趋势,但市场对其持续性还在观察。在投资策略上,我们认为2016年股票市场已经对2015年形成的成长股泡沫有了明显压缩,2017年的股票市场投资应该淡化风格的选择,在行业配置上趋于均衡,多进行自下而上的个股研究,从行业景气、公司业绩趋势双向印证。

4.6 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,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。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及基金实际运作的情况,本基金本报告期内未进行利润分配。目前无其他利润分配安排。

4.8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

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 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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、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的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第21819号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金(以下简称“泰达宏利蓝筹混合基金”),包括2016年12月31日的资产负债表、2016年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是泰达宏利蓝筹混合基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会以下简称“中国证券业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,上述泰达宏利蓝筹混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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,公允反映了泰达宏利蓝筹混合基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	单峰 / 庞伊君
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
审计报告日期	2017年3月24日

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资?产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资?产:		
银行存款	19,398,285.22	26,979,020.78
结算备付金	794,809.06	2,196,004.93
存出保证金	101,750.93	629,817.68
交易性金融资产	110,208,955.27	177,544,277.39
其中:股票投资	110,208,955.27	177,544,277.39
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	1,186,964.81	-
应收利息	4,920.25	7,690.85
应收股利	-	-
应收申购款	5,032.46	7,452.54
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	131,700,718.00	207,364,264.17
负债和所有者权益	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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	-	-
应付证券清算款	-	7,602.36
应付赎回款	917.21	190,486.06
应付管理人报酬	170,743.80	268,615.53
应付托管费	28,457.31	44,769.23
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	362,585.48	1,013,988.73
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	360,000.00	60,131.92
负债合计	922,703.80	1,585,593.83
所有者权益:		
实收基金	243,470,171.87	281,153,872.46
未分配利润	-112,692,157.67	-75,375,202.12
所有者权益合计	130,778,014.20	205,778,670.34
负债和所有者权益总计	131,700,718.00	207,364,264.17

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值0.537元,基金份额总额243,470,171.87份。

7.2 利润表

会计主体:泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入	-48,315,266.68	-97,409,251.37
1.利息收入	224,370.85	613,135.33
其中:存款利息收入	224,370.85	613,135.33
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-44,662,550.51	-104,977,799.93
其中:股票投资收益	-45,257,357.13	-106,324,170.29
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	594,806.62	1,346,370.36
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-3,912,977.57	6,621,087.37
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	35,890.55	334,325.86
减:二、费用	5,937,099.67	7,484,180.85
1. 管理人报酬	2,229,620.50	2,306,389.32
2. 托管费	371,603.42	384,398.20
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,943,034.45	4,541,900.47
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	392,841.30	251,492.86
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-54,252,366.35	-104,893,432.22
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-54,252,366.35	-104,893,432.22

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31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)	281,153,872.46	-75,375,202.12	205,778,670.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-54,252,366.35	-54,252,366.35
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)	-37,683,700.59	16,935,410.80	-20,748,289.79
其中:1.基金申购款	21,090,068.27	-9,171,867.71	11,918,200.56
2.基金赎回款	-58,773,768.86	26,107,278.51	-32,666,490.35
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)	243,470,171.87	-112,692,157.67	130,778,014.20
项目	上年度可比期间 2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31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)	395,735,299.12	-	395,735,299.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-104,893,432.22	-104,893,432.22
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)	-114,581,426.66	29,518,230.10	-85,063,196.56
其中:1.基金申购款	23,229,213.09	-3,978,054.27	19,251,158.82
2.基金赎回款	-137,810,639.75	33,496,284.37	-104,314,355.38
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)	281,153,872.46	-75,375,202.12	205,778,670.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰达宏利蓝筹价值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”)证监许可[2015]570号《关于核准泰达宏利蓝筹价值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《泰达宏利蓝筹价值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395,643,307.28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(2015)第619号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金基金合同》于2015年6月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 395,735,299.12 份基金份额,其中认购资金利息折合91,991.84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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利蓝筹价值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、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、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)。本基金投资的股票资产占基金资产的比例为60%-95%,其余资产投资于债券、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货等金融工具;权证投资占基金资产净值的比例不高于3%;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,现金类资产或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金投资于优质蓝筹上市公司的股票不低于非现金基金资产的80%。本基金的业绩比较基准为:60%X沪深300指数收益率+40%X中证综合债指数收益率。

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2017年3月30日批准报出。

7.4.2 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》、《泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年度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2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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代缴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。

7.4.7 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
北方国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
宏利资产管理(香港)有限公司	基金管理人的股东

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 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交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 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交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 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交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,229,620.50	2,306,389.32
其中:支付销售机构的客户维护费	891,690.02	1,010,135.09

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1.50%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 X 1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	371,603.42	384,398.20

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)的交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
基金合同生效日(2015年6月3日)持有的基金份额	0.00	0.00
期初持有的基金份额	11,559,537.57	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	11,559,537.57
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减:期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额	11,559,537.57	11,559,537.57
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.7478%	4.1115%

1. 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额,期间赎回/卖出总份额含转换出份额;

2. 本基金关联方投资本基金时所适用的费率为本基金基金合同中约定的费率。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	19,398,285.22	207,393.97	26,979,020.78	589,076.87

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.9.1.17受限证券类别:股票										