泰达宏利中证500指数分级证券投资基金

【2017】第一季度报告

2017年3月31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:2017年4月21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2017年4月19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2017年1月1日至2017年3月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利500指数分级
交易代码	162216
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月1日
报告期末基金份额总额	285,311,037.66份
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证500指数,力争获取与标的指数相似的投资收益,并将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金采用指数完全复制方法,原则上按照标的指数成分股及权重构建基金的投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,以达到跟踪和复制指数的目的。但如遇特殊情况(如市场流动性不足,成分股被限制投资等)致使基金无法购得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理的方法进行适当替代,以实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准:95%×中证500指数收益率+5%×1年期定期存款利率
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,属于高风险、高收益的基金品种,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500A	泰达500B	泰达中证500
下属分级基金的交易代码	150053	150054	162216
报告期末下属分级基金的份额总额	4,345,504.00份	6,518,256.00份	274,447,277.66份
下属分级基金的风险收益特征	泰达500A份额具有低风险、收益相对稳定的特征	泰达500B份额具有高风险、高预期收益的特征	-

§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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	7,881,917.53
2.本期利润	12,303,422.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.0505
4.期末基金资产净值	284,740,511.99
5.期末基金份额净值	0.9980

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。

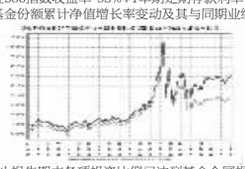
3.2 基金净值表现

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	5.79%	0.73%	2.12%	0.72%	3.67%	0.01%

本基金的业绩比较基准:中证500指数收益率*95%+1年期定期存款利率*5%。

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



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	2014年10月13日	-	7	毕业于英国威尔士斯旺西大学,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,先后担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。具备7年证券基金从业经验,7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

进入2017年一季度以来,宏观数据呈现企稳趋势,相对于传统蓝筹股,成长股表现相对滞后,市场整体风格向高分红、业绩确定性高、盈利稳健的公司倾斜,本基金恪守基金合同,运用多种量化技术控制市场风格切换给基金带来的冲击,把跟踪误差控制在约定范围内的同时,创造了一定超额收益。

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0.9980元;本报告期基金份额净值增长率为5.79%,业绩比较基准收益率为2.12%。

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	268,689,595.28	94.08
	其中:股票	268,689,595.28	94.08
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	16,508,046.60	5.78
8	其他资产	384,149.44	0.13
9	合计	285,581,791.32	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	5,885,032.00	2.07
B	采矿业	6,305,938.00	2.21
C	制造业	142,657,235.01	50.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,919,984.00	1.73
E	建筑业	5,559,467.00	1.95
F	批发和零售业	21,100,298.00	7.41
G	交通运输、仓储和邮政业	6,667,779.00	2.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,112,613.57	7.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	18,886,291.40	6.63
L	租赁和商务服务业	4,951,786.60	1.74
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,505,184.00	0.88
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	761,362.00	0.27
S	综合	3,327,479.20	1.17
	合计	243,640,449.78	85.57

5.2.2 报告期末积极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	-	-
B	采掘业	913,614.00	0.32
C	制造业	14,377,483.44	5.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	217,840.00	0.08
E	建筑业	768,343.50	0.27
F	批发和零售业	130,984.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	50,910.28	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,131.20	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,701,740.00	0.95
L	租赁和商务服务业	5,745,444.00	2.02
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	46,724.92	0.02
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	25,049,145.50	8.80

5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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	000656	金科股份	741,200	4,462,024.00	1.57
2	600166	福田汽车	1,191,200	3,895,224.00	1.37
3	002366	台海核电	74,399	3,748,221.62	1.32
4	600312	平高电气	215,400	3,635,952.00	1.28
5	600755	厦门国贸	398,000	3,617,820.00	1.27
6	600881	亚泰集团	588,600	3,537,486.00	1.24
7	300324	旋极信息	172,877	3,524,962.03	1.24
8	002491	通鼎互联	233,900	3,452,364.00	1.21
9	600039	四川路桥	687,100	3,435,500.00	1.21
10	000078	海王生物	555,400	3,426,818.00	1.20

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	000008	神州高铁	330,800	2,891,192.00	1.02
2	601636	旗滨集团	637,700	2,818,634.00	0.99
3	600383	金地集团	243,400	2,701,740.00	0.95
4	300269	联建光电	99,600	2,250,960.00	0.79
5	002027	分众传媒	158,600	1,930,162.00	0.68

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。

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

本基金本报告期未未持有股指期货。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

本报告期内本基金没有投资国债期货。

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	114,455.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,552.58
5	应收申购款	266,141.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	384,149.44

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

5.11.6 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。

5.11.7 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。

5.11.8 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500A	泰达500B	泰达中证500
报告期期初基金份额总额	5,205,756.00	7,808,634.00	215,687,027.05
报告期期间基金总申购份额	-	-	63,276,800.67
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	11,467,114.51
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-860,252.00	-1,290,378.00	6,950,564.45
报告期期末基金份额总额	4,345,504.00	6,518,256.00	274,447,277.66

§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	20170101-20170331	149,791,409.36	3,143,147.73	0.00	152,934,557.09	53.60
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。							

报告期内,申购份额含红利再投资份额。

§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中证500指数分级证券投资基金设立的文件;

2、《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金合同》;

3、《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金招募说明书》;

4、《泰达宏利中证500指数分级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
2017年4月21日

泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

【2017】第一季度报告

2017年3月31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:2017年4月21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2017年4月19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2017年1月1日至2017年3月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利财富大盘指数	
交易代码	162213	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年4月23日	
报告期末基金份额总额	80,622,239.89份	
投资目标	采用指数化投资策略,紧密跟踪中证财富大盘指数,力争获取与标的指数相似的投资收益,并力争将基金的日跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年化跟踪误差不超过4%。	
投资策略	本基金采用指数完全复制方法,原则上按照标的指数成分股及权重构建基金的投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,以达到跟踪和复制指数的目的。但如遇特殊情况(如市场流动性不足,成分股被限制投资等)致使基金无法购得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理的方法进行适当替代,以使跟踪误差控制在限定范围内。	
业绩比较基准	95%×中证财富大盘指数收益率+5%×同业存款利率。	
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,属于高风险、高收益的基金品种,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	泰达宏利财富大盘指数A	泰达宏利财富大盘指数C
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	80,541,929.10份	80,310.79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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	
	泰达宏利财富大盘指数A	泰达宏利财富大盘指数C
1. 本期已实现收益	2,544,735.14	828.48
2. 本期利润	6,680,721.08	368.90
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0859	0.0188
4. 期末基金资产净值	100,831,036.98	100,589.18
5. 期末基金份额净值	1.2519	1.2525

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

泰达宏利财富大盘指数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	7.39%	0.47%	4.54%	0.49%	2.85%	-0.02%

泰达宏利财富大盘指数C

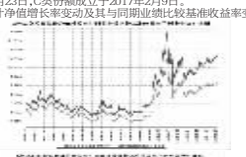
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2017年2月9日至2017年3月31日	4.23%	0.49%	1.95%	0.51%	2.28%	-0.02%

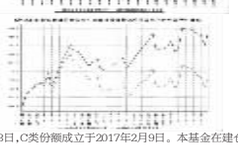
注:1.本基金业绩比较基准:95%×中证财富大盘指数收益率+5%×同业存款利率。

本基金股票资产的跟踪标的指数为中证财富大盘指数。中证财富大盘指数是由中证指数有限公司编制并开发的中国A股市场指数。该指数按照上市公司创造财富能力的大小进行选样,挑选最具创造财富能力的300家 A 股上市公司作为样本;此外该指数在加权方式上亦有所创新,不同于一般的市值加权指数,该指数样本个股的权重配置将与其创造财富能力的大小相适应,从而打破市值指数中价格与权重过于紧密的联系,预防个股权重由于价格的非理性波动而大起大落,提高了个股权重配置的稳定性。指数的表现综合反映了中国经济增长过程中核心企业真实的财富增长情况。

2.本基金A类份额成立于2010年4月23日,C类份额成立于2017年2月9日。

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





本基金A类份额成立于2010年4月23日,C类份额成立于2017年2月9日。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	2014年10月13日	-	7	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;具备7年证券基金从业经验,7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

进入2017年一季度以来,宏观数据呈现企稳趋势,相对传统蓝筹股,成长股表现相对滞后,市场整体风格向高分红、业绩确定性高、盈利稳健的公司倾斜,本基金恪守基金合同,运用多种量化技术控制市场风格切换给基金带来的冲击,把跟踪误差控制在约定范围内的同时,创造了一定超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

财富大盘指数A

截止报告期末,本基金份额净值为1.2519元,本报告期份额净值增长率为7.39%,同期业绩比较基准增长率为4.54%。

财富大盘指数C

截止报告期末,本基金份额净值为1.2525元,本报告期份额净值增长率为4.23%,同期业绩比较基准增长率为1.95%。

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	94,368,165.41	93.28
	其中:股票	94,368,165.41	93.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	359,000.00	0.35
	其中:债券	359,000.00	0.35
	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	6,071,818.17	6.00
8	其他资产	372,096.21	0.37
9	合计	101,171,079.79	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	154,442.00	0.15
B	采矿业	2,941,756.96	2.91
C	制造业	19,856,389.86	19.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,049,312.91	4.01
E	建筑业	7,028,656.40	6.96
F	批发和零售业	478,521.96	0.47
G	交通运输、仓储和邮政业	1,751,870.00	1.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	925,533.00	0.92
J	金融业	42,322,762.72	41.93
K	房地产业	5,522,332.60	5.47
L	租赁和商务服务业	1,090,177.00	1.08
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	119,560.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	86,241,315.41	85.45

5.2.2 报告期末积极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	689,526.00	0.68
B	采掘业	-	-
C	制造业	4,710,596.95	4.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	63,123.38	0.06
F	批发和零售业	638,028.84	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	79,127.91	0.08
H	住宿和餐饮业	16,050.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,131.20	0.08
J	金融业	57,152.00	0.06
K	房地产业	424,044.00	0.42
L	租赁和商务服务业	1,102,035.00	1.09
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	27,010.72	0.03
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	241,025.00	0.24
	合计	8,126,850.00	8.05

5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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	131,896	4,881,433.95	4.84
2	601166	兴业银行	258,366	4,188,112.86	4.15
3	600016	民生银行	442,300	3,750,704.00	3.72
4	601288	农业银行	1,054,923	3,523,442.82	3.49
5	601668	中国建筑	370,767	3,411,066.40	3.38
6	601328	交通银行	544,891	3,394,670.93	3.36
7	601398	工商银行	514,515	2,490,252.60	2.47
8	600015	华夏银行	187,140	2,112,810.60	2.09
9	601818	光大银行	476,964	1,960,322.04	1.94
10	600036	招商银行	102,167	1,958,541.39	1.94

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	300146	汤臣倍健	83,700	923,211.00	0.91
2	000683	远兴能源	267,500	775,750.00	0.77
3	601636	旗滨集团	135,500	598,910.00	0.59
4	002563	森马服饰	53,700	527,871.00	0.52
5	002491	通鼎互联	34,400	507,744.00	0.50

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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)	359,000.00	0.36
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	359,000.00	0.36

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	113011	光大转债	3,590	359,000.00	0.36

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

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

在报告期内,本基金未投资于国债期货。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

本报告期内本基金没有投资国债期货。

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	3,371.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,158.58
5	应收申购款	367,566.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	372,096.21

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

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	泰达宏利财富大盘指数A	泰达宏利财富大盘指数C
报告期期初基金份额总额	75,763,836.45	-
报告期期间基金总申购份额	10,087,375.15	87,861.14
减:报告期期间基金总赎回份额	5,309,282.50	7,550.35
报告期期间基金拆分变动份额(份额减