富荣货币市场基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:富荣基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2017年04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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	富荣货币	
基金主代码	003467	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月26日	
报告期末基金份额总额	3,123,302,804.39份	
投资目标	在保持本金安全和资产流动性基础上追求较高的当期收益。	
投资策略	本基金将综合宏观经济运行状况,货币政策、财政政策等政府宏观经济状况及政策,分析资本市场资金供给状况的变动趋势,预测市场利率水平变动趋势。在此基础上,综合考虑各类投资品种的流动性、收益性以及信用风险状况,进行积极的投资组合管理。	
业绩比较基准	活期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
基金管理人	富荣基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	富荣货币A	富荣货币B
下属各类别基金的交易代码	003467	003468
报告期末下属分级基金的份额总额	27,913,662.78份	3,085,389,141.61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01月01日 - 2017年03月31日)	
	富荣货币A	富荣货币B
1.本期已实现收益	530,416.72	17,647,415.11
2.本期利润	530,416.72	17,647,415.11
3.期末基金资产净值	27,913,662.78	3,085,389,141.61

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

富荣货币A净值表现

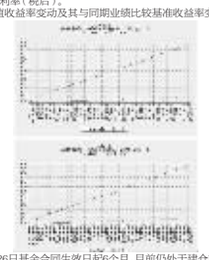
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7873%	0.0033%	0.0875%	0.0000%	0.6998%	0.0033%

富荣货币B净值表现

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8483%	0.0033%	0.0875%	0.0000%	0.7608%	0.0033%

注:本基金的业绩比较基准为:活期存款利率(税后)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:①本基金的建仓期为自2016年12月26日基金合同生效日起6个月,目前仍处于建仓期;
②基金合同生效日(2016年12月26日)起至本报告期末不满一年。

§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			
贺翔	固定收益部副总监/基金经理	2016-12-26	-	5.5	中国人民大学金融硕士。曾任神农投资基金经理助理,浙商金汇信托资本市场部助理(债券投资交易),天安财险固定收益处负责人。现任富荣基金管理有限公司固定收益部副总监。2016年12月起担任富荣货币市场基金经理。2017年3月起任富荣富兴纯债债券型证券投资基金、富荣富祥纯债债券型证券投资基金基金经理。	

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金未出现投资监控指标超标的情况,对基金份额持有人利益未造成损害。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金与其他基金或专户发生同向和反向交易行为,因此不存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度债券收益率经历了1月份短暂的下行之后大幅上升。2月份以来,央行公开市场操作大量到期叠加MPA考核预期持续发酵,同业存单供给继续放量,债券市场出现比较大的调整。从收益率上行幅度看,1年内同业存单一级发行利率上行超过40BP,短融收益率上行超过50BP,5-10年金融债上行超过30BP。资金面整体偏紧,一季度期间银行间债券质押式回购利率中枢继续上行。

本基金根据对货币市场的判断,以保持资产的流动性作为第一原则,灵活运用短期存款、回购以及债券等工具,主动降低组合杠杆,为组合取得了较好的投资回报。

展望接下来的宏观环境,从境外市场来看,我们认为进出口贸易在2017年或将比较稳定,人民币汇率预期也趋向平稳,原油价格对国内工业品价格长期影响需重视。而在美联储加息和资产负债表收缩的情况下,美元强势的预期不改,贸易保护主义的实质性影响不确定性更强。原油方面,我们认为2017年的原油价格受长期供过于求及产油国联合协议减产的影响,或将在页岩油成本价内维持一个稳定长期的均衡价格,全年对进出口影响将趋于平稳,新兴市场需求复苏更需关注。

国内整体宏观基本面预期平稳有改善,货币政策或将继续维持紧平衡。PMI数据数据连续6个月是于荣枯线以上,生产经营活动预期向好。虽然房地产投资偏弱,但是PPI进入落地效益的段,制造业投资延续2016年底热度,上半年料将为整体投资提供较好的支撑。信贷数据来看,上半年信贷意愿较足,在实体融资意愿抬升与政策面金融去杠杆合力下,资金配置向实的迹象明显。价格方面,原油对PPI的输入性抬升影响上半年比较突出,CPI或将呈现前高后低的格局,整体通胀对货币政策空间影响有限。在此格局下,货币政策或将继续维持紧平衡格局,适度收缩公开市场操作的同时,维持整体资金面稳定,但机构之间结构性分歧将加大,价格上短端波动加大,为金融去杠杆创造环境。

2017年金融监管力度继续加强,金融降杠杆行在路上,资金面脉冲式冲击难以避免。MPA考核等因素对市场的实质性影响逐渐显现,地方政府债务置换进入关键一年,公司债到期量大,债券市场面临需求不稳定、供给放量,到期兑付信用风险占据的三重考验。信用风险市场化定价将继续前行,整体财政预算结余较少而基建资金缺口较大,利率供料将迎来供给大年,因此整体全年来看,在宏观基本面向好、货币政策稳健中性、目标由数量型转向价格型的大框架下,收益率曲线中枢在抬升过程中陡峭化的可能性加大。在非银跨杠杆的过程中,资金面供需非常敏感,脉冲式资金面的冲击将难以避免。

本基金将坚持作为流动性管理工具的定位,密切跟踪货币市场利率的变动趋势,继续保持投资组合良好的流动性和适度的组合期限。未来一段时间,将继续对同业存单、短融和存款进行灵活配置,在保证组合安全性和流动性的基础上争取获得更佳的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金A类基金份额净值收益率为0.7873%,本基金B类基金份额净值收益率为0.8483%,同期业绩基准收益率0.0875%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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)	占基金资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,581,514,297.94	50.61
	其中:债券	1,581,514,297.94	50.61
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,179,031,143.65	37.70
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	350,904,942.86	11.23
4	其他资产	14,197,925.68	0.45
5	合计	3,124,648,310.25	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		35.9
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	59
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	106
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	17

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未发生超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	56.36	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	14.70	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	3.18	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	7.97	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	17.38	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.59	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期未出现平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(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	299,879,937.44	9.60
	其中:政策性金融债	299,879,937.44	9.60
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	590,101,883.16	18.89
6	中期票据	-	-
7	同业存单	691,532,477.34	22.14
8	其他	-	-
9	合计	1,581,514,297.94	50.64
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量	摊余成本	占基金资产净值比例
1	011754006	17金圆SCP001	1,500,000	150,072,257.96	4.80
2	170203	17国开03	1,000,000	99,910,856.01	3.20
3	111693776	16包商银行CD028	1,000,000	99,406,770.39	3.18
4	111719051	17恒丰银行CD051	1,000,000	99,263,484.72	3.18
5	111792619	17宁波银行CD046	1,000,000	98,221,968.09	3.14
6	011698289	16南航股份SCP005	600,000	60,062,190.16	1.92
7	160419	16农发19	600,000	59,866,271.50	1.92
8	140438	14农发38	500,000	50,243,817.92	1.61
9	011698084	16厦翔业SCP008	500,000	50,072,751.38	1.60
10	011754003	17鲁高速SCP001	500,000	50,004,983.43	1.60

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0214%
报告期内偏离度的最低值	-0.0044%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0093%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本货币市场基金负偏离度的绝对值未超过0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未超过0.5%。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持1.00元。

5.9.2 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	14,194,018.68
4	应收申购款	3,907.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	14,197,925.68

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述

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

	富荣货币A	富荣货币B
报告期期初基金份额总额	197,688,722.98	2,910,069,324.23
报告期期间基金总申购份额	40,885,047.03	3,713,586,571.11
报告期期间基金总赎回份额	200,660,107.23	3,538,256,753.73
报告期期末基金份额总额	37,913,662.78	3,085,389,141.61

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额	交易金额	适用费率
1	赎回	2017-01-13	1,500,000.00	1,500,000.00	-
2	赎回	2017-02-27	2,000,000.00	2,000,000.00	-
3	赎回	2017-03-30	2,000,000.00	2,000,000.00	-
合计			5,500,000.00	5,500,000.00	

§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	序号	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
		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	2017-01-01 至 2017-02-14 2017-02-14 至 2017-03-31 2017-03-31 至	1,000,000,000.00	1,203,687,853.64	1,603,687,853.64	600,000,000.00	19.25
	2	2017-01-19 至 2017-02-10 2017-02-14 至 2017-03-31	50,002,638.89	502,156,335.76	-	552,157,974.67	17.71
	3	2017-02-14 至 2017-03-31	500,026,388.89	302,260,541.49	300,000,000.00	502,286,930.38	16.11
产品特有风险							

本报告期本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况,未来或存在如下风险,敬请投资者留意:

(1)赎回申请延期办理的风险

持有份额比例较高的投资者("高比例投资者")大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回,中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险。

(2)基金资产净值大幅波动的风险

高比例投资者大额赎回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

(3)提前终止基金合同的风险

多名高比例投资者赎回后,可能出现基金资产净值低于5000万元的情形,根据本合同约定,若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人将向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,还将召开基金份额持有人大会进行表决。

(4)基金规模较小导致的风险

高比例投资者赎回后,可能导致基金规模较小,基金投资可能面临一定困难。

本基金管理人将继续勤勉尽责,执行相关投资策略,力争实现投资目标。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内未出现影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

10.1.1 中国证监会批准富荣货币市场基金设立的文件

10.1.2《富荣货币市场基金基金合同》

10.1.3《富荣货币市场基金托管协议》

10.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

10.1.5 报告期内富荣货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件 投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人富荣基金管理有限公司 客服热线:4006855600

富荣基金管理有限公司

二〇一七年四月二十一日

泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	泰达宏利创金混合	
交易代码	003414	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年9月29日	
报告期末基金份额总额	764,319,997.54份	
投资目标	本基金紧跟新常态下我国经济发展转型过程中各类投资机遇,基于大类资产配置策略,力争为投资者创造稳定的较高投资收益。	
投资策略	本基金紧跟新常态下国民经济发展过程中各类投资机遇,结合国内外宏观经济发展趋势及各行业的发展前景,精选出具有长期竞争力和增长潜力的优质公司,力求在抵御各类风险的前提下获取超越平均水平的良好回报。	
业绩比较基准	75%*中证全债指数收益率+25%*沪深300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,其预期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。	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	泰达宏利创金混合A	泰达宏利创金混合C
下属分级基金的交易代码	003414	003415
报告期末下属分级基金的份额总额	100,000,575.92份	664,319,421.62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)	
	泰达宏利创金混合A	泰达宏利创金混合C
1. 本期已实现收益	559,285.19	3,596,058.44
2. 本期利润	1,239,344.64	8,634,902.87
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0124	0.0117
4. 期末基金资产净值	101,320,384.81	672,091,195.73
5. 期末基金份额净值	1.0132	1.0117

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

泰达宏利创金混合A

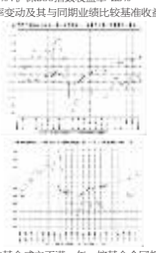
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.24%	0.04%	0.85%	0.14%	0.39%	-0.10%

泰达宏利创金混合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
过去三个月	1.16%	0.04%	0.85%	0.14%	0.31%	-0.10%

本基金业绩比较基准:中证全债指数收益率*75%+沪深300指数收益率*25%

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



本基金成立于2016年9月29日,截止报告期末本基金成立不满一年。按基金合同规定,自基金合同生效日起六个月内为建仓期。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	基金经理	2016年9月29日	-	9	理学学士;2008年7月加入泰达宏利基金管理有限公司,担任交易部交易员,负责债券交易工作;2013年9月起先后担任固定收益部研究员、基金经理助理、基金经理兼固定收益部总经理助理;具备9年基金从业经验,9年证券投资管理经验,具有基金从业资格。
庄腾飞	首席策略分析师、基金经理	2016年9月29日	-	7	2010年7月加入泰达宏利基金管理有限公司,任职于研究部,负责宏观经济、策略研究及金融、地产行业研究,曾先后担任助理研究员、研究员、高级研究员等职务,现任基金经理兼首席策略分析师。具备7年基金从业经验,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;交易席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有关指令;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,交易席按照价格优先、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

2017年一季度,海外经济继续低位企稳回升,美联储在进行充分预期管理后加息一次。 国内经济数据亮眼,但市场各方对后续是否能持续存疑。

中国央行坚持金融去杠杆的方向,陆续提高OMO以及MLF等利率,银行间市场流动性出现多次剧烈波动。整体市场收益率较去年同季度有100BP左右上行,但期限利差和评级利差则仍然处于历史低位。

操作上,本基金采取相对谨慎的投资策略,降低久期和杠杆,谨慎选择中短期信用债券,利用中短期利率债进行波段操作。转债方面,积极参与一级申购,但出于对后市供给加大的担忧,总体仓位仍然较低。股票方面,仓位保持稳定,积极参与一级新股申购,整体风格向高分红、业绩确定性高、盈利稳健的公司倾斜。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达宏利创金混合A基金份额净值为1.0632元,本报告期基金份额净值增长率为1.63%;截至本报告期末泰达宏利创金混合B基金份额净值为1.0661元,本报告期基金份额净值增长率为1.63%;同期业绩比较基准收益率为0.16%。

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	63,140,573.39	8.16
	其中:股票	63,140,573.39	8.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	699,833,000.00	90.39
	其中:债券	699,833,000.00	90.39
	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	2,212,091.58	0.29
8	其他资产	9,067,668.95	1.17
9	合计	774,253,333.92	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	965,811.00	0.12
C	制造业	1,960,137.07	0.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	25,029.52	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,990.00	0.00
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	52,660,485.80	6.81
K	房地产业	7,525,120.00	0.97
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	63,140,573.39	8.16

5.2.2 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

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	3,423,900	16,571,676.00	2.14
2	601288	农业银行	3,484,670	11,638,797.80	1.50
3	601939	建设银行	1,902,500	11,300,850.00	1.46
4	600030	中信证券	692,100	11,149,731.00	1.44
5	600048	保利地产	555,200	5,291,056.00	0.68
6	600266	北京城建	152,600	2,234,064.00	0.29
7	601377	兴业证券	259,100	1,984,706.00	0.26
8	000858	五粮液	31,100	1,337,300.00	0.17
9	601958	金钼股份	124,300	965,811.00	0.12
10	000725	京东方A	59,472	204,583.68	0.03

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	49,970,000.00	6.46
	其中:政策性金融债	49,970,000.00	6.46
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	319,118,000.00	41.26
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	330,745,000.00	42.76
9	其他	-	-
10	合计	699,833,000.00	90.49

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	111680989	16杭州银行CD190	1,000,000	98,160,000.00	12.69
2	111612172	16北京银行CD172	800,000	78,760,000.00	10.18
3	041654069	16大秦铁路CP002	600,000	59,670,000.00	7.72
4	160414	16农发14	500,000	49,970,000.00	6.46
5	011698785	16深圳航空SCP009	500,000	49,900,000.00	6.45

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名证券投资明细

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货持仓和损益。

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

报告期内本基金投资的兴业证券(601377)于2016年7月28日发布收到证监会行政处罚决定书。兴业证券在推荐欣泰电气申请首次公开发行股票并在创业板上市过程中,未遵守业务规则和行业规范,未勤勉尽责地对欣泰电气IPO申请文件进行审核核查,出具的《兴业证券股份有限公司关于丹东欣泰电气股份有限公司首次公开发行股票并在创业板上市之发行保荐书》和《兴业证券股份有限公司关于丹东欣泰电气股份有限公司之 2012年度财务报告专项检查自查工作报告》存在虚假记载;在欣泰电气公开发行股票过程中,公司作为主承销商,未审慎核查公开发行募集文件的真实性和准确性,未发现《丹东欣泰电气股份有限公司首次公开发行股票并在创业板上市招股意向书》和《丹东欣泰电气股份有限公司首次公开发行股票并在创业板上市招股说明书》中涉及欣泰电气应收账款、流动资产和经营活动产生的现金流量净额等项目的财务数据存在虚假记载。证监会决定对公司给予警告,没收保荐业务收入1,200万元,并处以2,400万元罚款;没收承销股票违法所得2,078万元,并处以60万元罚款。

本基金管理人在投资兴业证券前严格执行了对上市公司的调研、内部研究推荐、投资计划审批等相关投资决策流程。上述股票根据股票池审批流程进入本基金备选库,由研究员跟踪并分析。上述事件发生后,本基金管理人对上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,因此,没有改变本基金管理人对上述上市公司的投资判断。

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	32,243.54
2	应收证券清算款	122,866.88
3	应收股利	-
4	应收利息	8,912,558.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,067,668.95

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

	泰达宏利创金混合A	泰达宏利创金混合C
报告期期初基金份额总额	100,000,794.12	664,261,067.11
报告期期间基金总申购份额	-	99,880,143.83
减:报告期期间基金总赎回份额	218