泰达宏利亚洲债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2017年10月26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10月24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7月1日至2017年9月30日。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利亚洲债券（QDII）	
交易代码	003463	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年10月14日	
报告期末基金份额总额	371,589,873.27份	
投资目标	本基金通过分析亚洲区域各国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面，寻找各类债券的投资机会，在谨慎投资的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金为债券型的QDII基金，密切跟踪相关国家或地区经济的景气周期以及财政、货币政策变化，把握市场利率水平的运行态势，从宏观层面了解亚洲各国家、行业的景气情况、防范系统性的宏观经济、政治以及信用风险，从而确定基金资产在不同国家、不同行业以及不同债券品种之间的配置比例。	
业绩比较基准	摩根大通亚洲信用指数总报酬（JP Morgan Asian Credit Index Composite Total Return）*95%+中国人民银行公告人民币活期存款基准利率*5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期的风险水平和预期收益都要低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种。	
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	
境外资产托管人	英文名称：Bank of China（Hong Kong）Limited	
	中文名称：中国银行（香港）有限公司	
下属分级基金的基金简称	泰达宏利亚洲债券（QDII）A	泰达宏利亚洲债券（QDII）C
下属分级基金的交易代码	003463	003464
报告期末下属分级基金的份额总额	360,171,269.34份	11,418,603.93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7月1日 － 2017年9月30日）	
	泰达宏利亚洲债券（QDII）A	泰达宏利亚洲债券（QDII）C
1.本期已实现收益	-2,609,111.84	-97,450.30
2.本期利润	-1,052,827.67	-67,677.35
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0027	-0.0049
4.期末基金资产净值	366,029,800.64	11,560,818.94
5.期末基金份额净值	1.0163	1.0125

注：①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。

②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。

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

泰达宏利亚洲债券（QDII）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	-0.20%	0.19%	1.41%	0.09%	-1.61%	0.10%

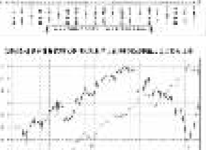
泰达宏利亚洲债券（QDII）C

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	-0.27%	0.19%	1.41%	0.09%	-1.68%	0.10%

本基金业绩比较基准：摩根大通亚洲信用指数总报酬（JP Morgan Asian Credit Index Composite Total Return）*95%+中国人民银行公告人民币活期存款基准利率*5%。

上述摩根大通亚洲信用指数总报酬代表该指数收益率。

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10月14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		
李安杰	基金经理	2016年10月14日	-	9	台湾成功大学财务金融硕士学位；CFA；2008年7月至2014年4月，就职于国泰人寿保险股份有限公司，负责海外债券投资；2014年5月至2016年1月，就职于国泰证券投资信托股份有限公司，担任台湾地区国泰投信-新兴市场高收益债基金经理人；2016年2月加盟泰达宏利基金管理有限公司国际业务部，现任基金经理；具有9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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金没有聘请境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。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2次，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的处罚情况。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2017年第三季，美国经济持续温和增长，但偏弱的通胀指数以及与朝鲜地缘政治冲突持续压抑美债表现。九月初随着地缘政治风险稍减、美联储如期推出资产负债表缩减计划，美债自今年低点反弹上扬，但第三季美债基准利率较上半年底仍呈现下滑态势。

亚洲信用市场方面，第二季财报整体而言表现优于预期，配合海外资金与中资投资人持续买进，虽然整体亚洲美元计价新券发行量已持续创下历史单年度新高，但整体信用利差仍小幅收窄。标准普尔继六月份穆迪调整中国信评后，于第三季跟进下调中国信评至A+，主要原因为整体债务水平上扬。今年以来中国经济调整相对平稳，去杠杆亦略见成效，强化投资人对中资发行人债信信心，此次信评下调，并未对相关债券信用利差产生明显负面影响。

汇率方面，欧元因欧洲央行计划逐渐退出量化宽松的货币政策预期明显走强，压抑美元表现，人民币顺势升值，中间价一度达6.4497兑1美元的近年高点。九月中旬后，随美联储行动、美国政府减税计划预期、欧元走强的不利影响导致欧洲央行持续偏宽松的利率决策，美元逐渐回落，但今年以来美元兑人民币仍呈明显贬值。

三季度美国公债利率变动幅度较大，我们于七月份增加了投资组合久期，主要通过加仓高信用品质投资等级债，以达到利率风险与信用风险的合理调配，并适时使用美国国债期货进行套期保值操作。随后，由于经济数据仍支持美联储继续加息，且十月份美联储缩表开始启动，我们认为现行美债利率偏低，后市预期走高，整体投资组合久期调整至偏中性水平，再配合期货调整整体久期。目标选择上，我们持续择机参与较具利差且基本面稳定的新券发行。汇率选择上则仍以美元为主。期间债券投资产生正贡献，但汇率产生负贡献，整体基金净值呈现下滑。

4.6报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达宏利亚洲债券（QDII）A基金份额净值为1.0163元，本报告期基金份额净值增长率为-0.20%；截至本报告期末泰达宏利亚洲债券（QDII）C基金份额净值为1.0125元，本报告期基金份额净值增长率为-0.27%；同期业绩比较基准收益率为1.41%。

4.7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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	0.00
	其中：普通股	-	0.00
	优先股	-	0.00
	存托凭证	-	0.00
	房地产信托凭证	-	0.00
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	328,808,899.93	85.92
	其中：债券	328,808,899.93	85.92
	资产支持证券	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
	其中：远期	-	0.00
	期货	-	0.00
	期权	-	0.00
	权证	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	货币市场工具	19,910,700.00	5.20
7	银行存款和结算备付金合计	22,460,354.80	5.87
8	其他资产	11,499,645.56	3.01
9	合计	382,679,600.29	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证投资。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证投资。

5.4 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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证投资。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
AAA	-	-
AA+至AA-	-	-
A+至A-	27,499,258.45	7.28
BBB+至BBB-	117,698,631.94	31.17
BB+至BB-	58,825,818.04	15.58
B+至B-	69,738,407.40	18.47
CCC+至C	-	-
其它	55,046,784.10	14.58
合计	328,808,899.93	87.08

注：本债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪等机构提供的债券信用评级信息，未提供评级信息的可适用内部评级。

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五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
1	XS1645684660	China Great Wall International Holdings III Ltd	9,955,350	9,890,242.01	2.62
2	XS1366918305	OVPH Ltd	8,627,970	9,023,476.14	2.39
3	XS1250898100	China Life Insurance Co Ltd	8,627,970	8,820,632.57	2.34
4	XS1511610906	Chalco Hong Kong Investment Co Ltd	8,627,970	8,783,791.14	2.33
5	XS1523140942	Shinhan Bank Co Ltd	8,627,970	8,783,100.90	2.33

注：1. 债券代码为ISIN码。

2. 数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留整数。

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投资。

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金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	TYZ7 Comdty	-54,059,624.53	-14.32

注：1. 以上为本基金本报告期末持有的全部金融衍生品投资明细。

2. 买入持仓市值以正数表示，卖出持仓市值以负数表示。

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十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

报告期内基金投资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受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	7,496,108.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,003,303.29
5	应收申购款	233.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,499,645.56

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.10.6 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	泰达宏利亚洲债券（QDII）A	泰达宏利亚洲债券（QDII）C
报告期期初基金份额总额	426,076,364.60	17,097,939.67
报告期期间基金总申购份额	237,268.52	56,479.94
减：报告期期间基金总赎回份额	66,142,363.78	5,735,815.68
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	360,171,269.34	11,418,603.93

§7 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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准泰达宏利亚洲债券型证券投资基金设立的文件；

2、《泰达宏利亚洲债券型证券投资基金基金合同》；

3、《泰达宏利亚洲债券型证券投资基金招募说明书》；

4、《泰达宏利亚洲债券型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。

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《上海证券报》、《证券时报》）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10月26日

泰达宏利中证500指数分级证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2017年10月26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10月24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7月1日至2017年9月30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	278,298,783.55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份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	3,329,148.00份	4,993,722.00份	269,975,913.55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7月1日 － 2017年9月30日）
1.本期已实现收益	6,532,616.97
2.本期利润	24,303,544.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.0860
4.期末基金资产净值	297,079,139.58
5.期末基金份额净值	1.0675

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。

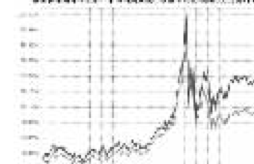
3.2 基金净值表现

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	8.76%	0.92%	7.22%	0.89%	1.54%	0.03%

注：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。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2次，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的处罚情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度以来，整体市场在宏观经济指标和企业盈利回稳的预期下走出一波活跃的行情，周期资源股表现抢眼，中小盘和消费股也有不俗表现，本基金恪守基金合同，综合运用多种定量技术克服申购赎回和市场结构变化带来的不利影响，将跟踪误差控制在了一定范围内，并获得了一定超额收益。

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1.0675元；本报告期基金份额净值增长率为8.76%，业绩比较基准收益率为7.22%。

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	280,872,970.40	94.18
	其中：股票	280,872,970.40	94.18
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	16,840,179.39	5.65
8	其他资产	531,256.56	0.18
9	合计	298,244,406.35	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	373.20	0.00
B	采矿业	10,904,786.00	3.67
C	制造业	156,278,045.63	52.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,841,015.00	2.30
E	建筑业	3,520,696.00	1.19
F	批发和零售业	25,864,356.90	8.71
G	交通运输、仓储和邮政业	5,116,262.62	1.72
H	住宿和餐饮业	2,544,656.00	0.86
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,035,776.07	6.07
J	金融业	1,690,246.00	0.57
K	房地产业	14,001,715.75	4.71
L	租赁和商务服务业	1,343.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,587,804.00	1.54
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	4,668,913.00	1.57
S	综合	1,266,804.00	0.43
	合计	255,322,793.17	85.94

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	39,793.60	0.01
C	制造业	17,488,295.54	5.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,884,770.44	0.63
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,385.45	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	693,786.13	0.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	231,412.03	0.08
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,041,973.00	1.02
L	租赁和商务服务业	2,015,685.00	0.68
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	115,299.99	0.04
R	文化、体育和娱乐业	12,776.05	0.00
S	综合	-	-
	合计	25,550,177.23	8.60

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	002460	赣锋锂业	66,500	5,805,450.00	1.95
2	300136	信维通信	120,344	5,054,448.00	1.70
3	600516	方大炭素	151,800	4,637,490.00	1.56
4	600176	中国巨石	396,120	4,539,535.20	1.53
5	600201	生物股份	129,800	4,340,512.00	1.46
6	600219	南山铝业	1,084,700	4,327,953.00	1.46
7	000078	海王生物	592,400	3,832,828.00	1.29
8	600978	宜华生活	366,800	3,796,380.00	1.28
9	000050	深天马A	168,200	3,786,182.00	1.27
10	600183	生益科技	243,900	3,738,987.00	1.26

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	000725	京东方A	748,200	3,292,080.00	1.11
2	600449	宁夏建材	226,500	2,883,345.00	0.97
3	000002	万 科A	101,500	2,664,375.00	0.90
4	600519	贵州茅台	4,000	2,070,560.00	0.70
5	300303	聚飞光电	494,300	2,066,174.00	0.70

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

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

本基金本报告期末未投资于国债期货。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

本基金本报告期没有投资国债期货。

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	37,568.45
2	应收证券清算款	316,945.09
3	应收股利	-
4	应收利息	3,015.93
5	应收申购款	173,727.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	531,256.56

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	3,898,496.00	5,847,744.00	280,271,610.32
报告期期间基金总申购份额	-	-	12,465,181.43
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-	24,184,248.20
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-569,348.00	-854,022.00	1,423,370.00
报告期期末基金份额总额	3,329,148.00	4,993,722.00	269,975,913.55

§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	20170701-20170930	152,934,557.09	0.00	0.00	152,934,557.09	54.95%
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10月26日

泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2017年10月26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10月24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7月1日至2017年9月30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	143,467,965.36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	142,836,368.30份	631,597.06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7月1日 － 2017年9月30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	13,233,910.48	69,544.34
2. 本期利润	11,713,880.23	46,352.34
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0736	0.0556
4. 期末基金资产净值	201,295,077.42	895,224.25
5. 期末基金份额净值	1.4093	1.4174

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.根据泰达宏利基金管理有限公司2017年2月7日发布的《关于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、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金与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修改基金合同及托管协议的公告》，泰达宏利基金管理有限公司决定自2017年2月9日起，对旗下泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金增加收取销售服务费的C类份额并相应修订基金合同和托管协议。

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	5.42%	0.55%	3.79%	0.55%	1.63%	0.00%

泰达宏利财富大盘指数C

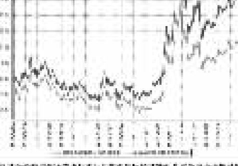
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	5.80%	0.55%	3.79%	0.55%	2.01%	0.00%

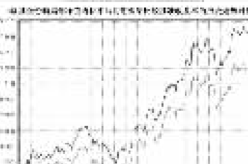
注：1、本基金业绩比较基准：95%×中证财富大盘指数收益率+5%×同业存款利率。

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。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2次，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的处罚情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度以来，整体市场在宏观经济指标和企业盈利回稳的预期下走出一波活跃的行情，周期资源股表现抢眼，中小盘和消费股也有不俗表现，本基金恪守基金合同，综合运用多种定量技术克服申购赎回和市场结构变化带来的不利影响，将跟踪误差控制在了一定范围内。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达宏利财富大盘指数A基金份额净值为1.4093元，本报告期基金份额净值增长率为5.42%；截至本报告期末泰达宏利财富大盘指数C基金份额净值为1.4174元，本报告期基金份额净值增长率为5.80%；同期业绩比较基准收益率为3.79%。

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	191,689,057.63	94.38
	其中：股票	191,689,057.63	94.38
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	11,037,583.68	5.43
8	其他资产	377,705.20	0.19
9	合计	203,104,346.51	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	-	-
B	采矿业	5,198,073.00	2.57
C	制造业	42,521,828.77	21.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,148,078.00	3.04
E	建筑业	10,592,282.76	5.24
F	批发和零售业	134,037.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	4,987,215.00	2.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	113,624.00	0.06
J	金融业	87,040,944.94	43.05
K	房地产业	12,208,337.50	6.04
L	租赁和商务服务业	5,157,301.00	2.55
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	804,729.00	0.40
S	综合	-	-
	合计	174,906,450.97	86.51

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	632,697.60	0.31
C	制造业	10,969,119.58	5.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,663,827.72	0.82
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,385.45	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,217,366.41	0.60
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,186,587.00	1.08
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	61,050.99	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	16,782,606.66	8.30

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	234,395	12,694,833.20	6.28
2	601166	兴业银行	588,016	10,166,796.64	5.03
3	600016	民生银行	1,231,300	9,875,026.00	4.88
4	601328	交通银行	1,427,991	9,024,903.12	4.46
5	000002	万 科A	241,022	6,326,827.50	3.13
6	601169	北京银行	805,596	6,009,746.16	2.97
7	600104	上汽集团	168,600	5,090,034.00	2.52
8	601818	光大银行	1,215,164	4,921,414.20	2.43
9	601288	农业银行	1,208,923	4,618,085.86	2.28
10	600036	招商银行	166,167	4,245,566.85	2.10

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	002601	龙蟒佰利	140,200	2,606,318.00	1.29
2	600641	万业企业	163,300	2,186,587.00	1.08
3	600073	上海梅林	179,800	1,727,878.00	0.85
4	002597	金禾实业	52,200	1,156,230.00	0.57
5	000883	湖北能源	225,514	1,123,059.72	0.56

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投资。

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

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

本基金本报告期没有投资国债期货。

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	110,573.65
2	应收证券清算款	94,686.94
3	应收股利	-
4	应收利息	2,114.36
5	应收申购款	170,330.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	377,705.20

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	158,524,200.49	407,380.63
报告期期间基金总申购份额	16,900,255.93	1,894,481.93
减：报告期期间基金总赎回份额	32,588,088.12	1,670,265.50
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	142,836,368.30	631,597.06

§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	20170701-20170930	72,638,418.08	0.00	0.00	72,638,418.08	50.63%
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财富大盘指数证券投资基金设立的文件；

2、《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》；

3、《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金招募说明书》；

4、《泰达宏利中证财富大盘指数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10月26日