

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司  
基金托管人:中国农业银行股份有限公司  
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。  
基金托管人中国农业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日起至2017年9月30日止。

**§2 基金产品概况**

基金简称	泰达宏利中证500
代码	002034
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月10日
报告期末基金份额总额	7,094,498,127.93
投资目标	本基金主要投资于中证500指数成份股及其备选成份股,力求获得超越中证500指数的长期投资回报。
投资策略	本基金奉行“价值投资”理念,在有效控制风险的前提下,通过精选个股和分散投资的方式,力争实现超越中证500指数的长期投资回报。本基金主要投资于中证500指数成份股及其备选成份股,力争实现超越中证500指数的长期投资回报。
业绩比较基准	中证500指数收益率×80%+一年期银行定期存款利率×20%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高风险品种,但属低风险品种,其预期收益和风险均低于股票型基金,高于混合型基金和债券型基金。
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	泰达宏利中证500E
下属分级基金的代码	002036
报告期末下属分级基金的份额总额	203,306,004.68
报告期末本基金份额总额	6,811,202,422.69

**§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

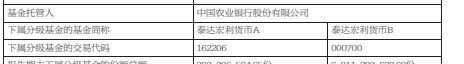
主要财务指标	报告期(2017年7月1日—2017年9月30日)
1.本期已实现收益	3,049,369.00
2.本期利润	89,638,474.38
3.期末基金资产净值	203,306,004.68
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润金额相等。	
2.本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。	

**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	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	0.0924%	0.0044%	0.0000%	0.0000%	0.0924%	0.0044%

注:1.本基金的业绩比较基准:一年期银行定期存款利率(税后)。  
2.本基金在合同生效日(2017年7月1日)起变更为“每日基金定投”。

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:本基金在建仓期结束时及截止本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	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
丁伟	本基金基金经理	2016年3月28日	9	毕业于2006年7月加入泰达宏利基金管理有限公司,担任交易员、基金经理、基金经理助理、基金经理等职务,2010年9月至2014年9月,担任泰达宏利中证500基金经理,2014年10月至2016年9月,担任泰达宏利中证500基金经理助理,2016年9月加入泰达宏利中证500基金经理,具有基金从业资格,具有多年证券从业经历。

**4.2 异常交易行为的专项说明**  
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。  
4.2.2 管理人对外报告期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;严格执行投资管理流程和执行权限的隔离;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、非公开发行证券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、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  
报告期内,海外经济继续复苏态势,国内供给侧改革继续,经济数据表现有所波动,但基本面仍对市场产生明显的趋势化影响。监管趋严仍在持续,但由于市场已有充分预期,并未带来明显波动。流动性保持紧平衡,严重依赖央行“削峰填谷”的公开市场操作,银行超额率达到历史低位,财政存款收放对资金面的影响突出。债券市场缺乏赚取资本利得的机会,但中长期息票水平已相对高位,配债价值显现,收益率曲线平坦化上行,信用债受到的冲击加大,高等级信用利差回升至中位数以上水平。基于市场情况,我们采取久期、低杠杆的策略,超配收益有吸引力的组合品种,优选个券以期超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现  
本报告期泰达宏利中证500E的基金份额净值收益率为0.0963%,本报告期泰达宏利中证500E的基金份额净值收益率为1.0181%,同期业绩比较基准收益率为0.3781%。

4.6 报告期内基金持有人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况。

**§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	3,341,426,623.88	40.75
2	其中:股票	3,341,426,623.88	40.75
3	固定收益投资	1,113,736,000.00	13.53
4	其中:债券	1,113,736,000.00	13.53
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	2,913,376,882.29	35.50
7	其他资产	38,302,524.04	0.47
8	合计	7,306,949,096.31	60.02

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	医药生物	265,900,413.30	2.30
2	计算机	—	—
3	有色金属	—	—
4	其他行业	—	—

注:上表中,报告期末债券公允价值为报告期内每日的债券余额的合计数,报告期末债券公允价值超过基金资产净值20%的说明  
本基金本报告期末未出现债券公允价值超过基金资产净值20%的情况。

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

序号	项目	天数
1	投资组合平均剩余期限	77
2	报告期内投资组合平均剩余期限最高值	80
3	报告期内投资组合平均剩余期限最低值	31

注:投资组合平均剩余期限超过120天情况说明  
本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余期限超过120天的情况。  
5.3.2 投资组合平均剩余期限分布比例

投资组合平均剩余期限分布比例	天数
投资组合平均剩余期限在30天以内(含30天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在30天-90天(含90天)的占比	100.00%
投资组合平均剩余期限在90天-180天(含180天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在180天-270天(含270天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在270天-360天(含360天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在360天-450天(含450天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在450天-540天(含540天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在540天-630天(含630天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在630天-720天(含720天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在720天-810天(含810天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在810天-900天(含900天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在900天-1080天(含1080天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在1080天-1260天(含1260天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在1260天-1440天(含1440天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在1440天-1620天(含1620天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在1620天-1800天(含1800天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在1800天-2160天(含2160天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在2160天-2520天(含2520天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在2520天-2880天(含2880天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在2880天-3240天(含3240天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在3240天-3600天(含3600天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在3600天-4320天(含4320天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在4320天-5040天(含5040天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在5040天-5760天(含5760天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在5760天-6480天(含6480天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在6480天-7200天(含7200天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在7200天-8100天(含8100天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在8100天-9000天(含9000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在9000天-10800天(含10800天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在10800天-12600天(含12600天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在12600天-14400天(含14400天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在14400天-16200天(含16200天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在16200天-18000天(含18000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在18000天-21600天(含21600天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在21600天-25200天(含25200天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在25200天-28800天(含28800天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在28800天-32400天(含32400天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在32400天-36000天(含36000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在36000天-43200天(含43200天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在43200天-50400天(含50400天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在50400天-57600天(含57600天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在57600天-64800天(含64800天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在64800天-72000天(含72000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在72000天-81000天(含81000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在81000天-90000天(含90000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在90000天-108000天(含108000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在108000天-126000天(含126000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在126000天-144000天(含144000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在144000天-162000天(含162000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在162000天-180000天(含180000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在180000天-216000天(含216000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在216000天-252000天(含252000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在252000天-288000天(含288000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在288000天-324000天(含324000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在324000天-360000天(含360000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在360000天-432000天(含432000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在432000天-504000天(含504000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在504000天-576000天(含576000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在576000天-648000天(含648000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在648000天-720000天(含720000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在720000天-810000天(含810000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在810000天-900000天(含900000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在900000天-1080000天(含1080000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在1080000天-1260000天(含1260000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在1260000天-1440000天(含1440000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在1440000天-1620000天(含1620000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在1620000天-1800000天(含1800000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在1800000天-2160000天(含2160000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在2160000天-2520000天(含2520000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在2520000天-2880000天(含2880000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在2880000天-3240000天(含3240000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在3240000天-3600000天(含3600000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在3600000天-4320000天(含4320000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在4320000天-5040000天(含5040000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在5040000天-5760000天(含5760000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在5760000天-6480000天(含6480000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在6480000天-7200000天(含7200000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在7200000天-8100000天(含8100000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在8100000天-9000000天(含9000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在9000000天-10800000天(含10800000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在10800000天-12600000天(含12600000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在12600000天-14400000天(含14400000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在14400000天-16200000天(含16200000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在16200000天-18000000天(含18000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在18000000天-21600000天(含21600000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在21600000天-25200000天(含25200000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在25200000天-28800000天(含28800000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在28800000天-32400000天(含32400000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在32400000天-36000000天(含36000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在36000000天-43200000天(含43200000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在43200000天-50400000天(含50400000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在50400000天-57600000天(含57600000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在57600000天-64800000天(含64800000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在64800000天-72000000天(含72000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在72000000天-81000000天(含81000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在81000000天-90000000天(含90000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在90000000天-108000000天(含108000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在108000000天-126000000天(含126000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在126000000天-144000000天(含144000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在144000000天-162000000天(含162000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在162000000天-180000000天(含180000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在180000000天-216000000天(含216000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在216000000天-252000000天(含252000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在252000000天-288000000天(含288000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在288000000天-324000000天(含324000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在324000000天-360000000天(含360000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在360000000天-432000000天(含432000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在432000000天-504000000天(含504000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在504000000天-576000000天(含576000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在576000000天-648000000天(含648000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在648000000天-720000000天(含720000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在720000000天-810000000天(含810000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在810000000天-900000000天(含900000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在900000000天-1080000000天(含1080000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在1080000000天-1260000000天(含1260000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在1260000000天-1440000000天(含1440000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在1440000000天-1620000000天(含1620000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在1620000000天-1800000000天(含1800000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在1800000000天-2160000000天(含2160000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在2160000000天-2520000000天(含2520000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在2520000000天-2880000000天(含2880000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在2880000000天-3240000000天(含3240000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在3240000000天-3600000000天(含3600000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在3600000000天-4320000000天(含4320000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在4320000000天-5040000000天(含5040000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在5040000000天-5760000000天(含5760000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在5760000000天-6480000000天(含6480000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在6480000000天-7200000000天(含7200000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在7200000000天-8100000000天(含8100000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在8100000000天-9000000000天(含9000000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在9000000000天-10800000000天(含10800000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在10800000000天-12600000000天(含12600000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在12600000000天-14400000000天(含14400000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在14400000000天-16200000000天(含16200000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在16200000000天-18000000000天(含18000000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在18000000000天-21600000000天(含21600000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在21600000000天-25200000000天(含25200000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在25200000000天-28800000000天(含28800000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在28800000000天-32400000000天(含32400000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在32400000000天-36000000000天(含36000000000天)的占比	0.00%
投资组合平均剩余期限在36000000000天-43200000000天	