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

2015 半年度 报告摘要

2015年6月30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
送出日期:2015年8月25日

§1 重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司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。本半年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年8月24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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2015年2月13日(基金合同生效日)起至2015年6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰达改革动力混合
基金主代码	001017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月13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
报告期末基金份额总额	923,528,164.57份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取大类资产配置策略,同时深入研究各项改革过程中带来的投资机会,包括但不限于国有企业改革、金融改革、土地改革、企业兼并重组等,采用数量化投资方法,力争为基金份额持有人创造持久的、稳定的、较高的超业绩基准收益。
投资策略	本基金以中国国有企业改革、金融改革、土地改革、企业兼并重组等产生的各类投资机遇为主线,通过量化投资方式精选个股。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,并优选收益行业;另一方面,本基金凭借多年来不断积累形成的量化选股框架,从国企改革因子、并购重组因子等方面出发,结合估值、成长、盈利质量、情绪等因子,以"自下而上"的视角精选出具有各项改革可能性、受益于改革的优质公司,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	50%*沪深300指数收益率+50%*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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈沛	王永民
	联系电话	010-66577808	010-66594896
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-69-88888	95566
传真		010-66577666	010-66594942

2.4信息披露方式

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

§3主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2015年2月13日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	812,945,082.66
本期利润	726,418,293.61
加权平均基金份额本期利润	0.4700
本期基金份额净值增长率	45.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.4520
期末基金资产净值	1,340,937,177.69
期末基金份额净值	1.452

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. 对期末可供分配利润,采用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

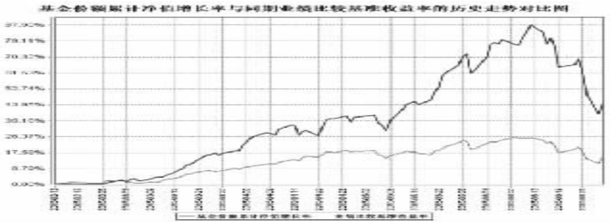
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	-10.87%	3.68%	-3.37%	1.74%	-7.50%	1.94%
过去三个月	22.64%	2.85%	6.74%	1.31%	15.90%	1.54%
自基金合同生效起至今	45.20%	2.42%	15.70%	1.14%	29.50%	1.28%

注:1、本基金的业绩比较基准:沪深300指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%。

2、本基金成立于2015年2月13日,按基金合同规定,自基金合同生效起六个月内为建仓期。截止本报告期末,本基金仍处在建仓期。

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



本基金成立于2015年2月13日,按基金合同规定,自基金合同生效起六个月内为建仓期。截止本报告期末,本基金仍处在建仓期。

§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证券投资基金、泰达宏利行业精选证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场证券投资基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选股票型证券投资基金、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、泰达宏利红利先锋股票型证券投资基金、泰达宏利中证财富大盘指数型证券投资基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金、泰达宏利全球新格局证券投资基金、泰达宏利中证500指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金、泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金、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在内的三十多只基金。

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		
刘欣	本基金基金经理	2015年2月13日	-	8	清华大学理学硕士;2007年7月至2008年12月就职于工银瑞信基金管理有限公司;2008年12月至2011年7月就职于嘉实基金管理有限公司;2011年7月加盟泰达宏利基金管理有限公司,担任产品与金融工程部高级研究员,现担任金融工程部副总经理、基金经理;具备8年基金从业经验,8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,没有发生利益输送、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。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。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 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

2015年上半年,股票市场在经历前5个月的快速上涨后,在6月份出现大幅剧烈震荡。前期强势的热门中小股票的调整幅度较大,银行券商为代表的金融股较为抗跌。

本基金在操作中,采用量化投资方法,均衡配置组合。在投资风格上以具备改革潜力的资产重估公司为主,同时兼企业自身的成长性和基本面特征。

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1.452元,成立以来的份额净值增长率为45.20%,同期业绩比较基准增长率为15.70%。

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,经济基本面出现筑底企稳迹象,部分周期性行业出现回暖。在宏观层面,适度宽松的货币政策和积极的改革措施持续为企业带来红利。在微观结构上,越来越多的企业通过并购重组、股权激励等手段从业务模式、持股结构两个维度上进行改革与创新,催生新的增长点。在市场情绪层面,经过前期市场大幅调整,市场前期积累的风险得到了快速释放,为后期市场走牛提供了一定基础。

基于此观点,我们的配置偏向于在合理成长的安全边际下,具有改革背景的价值重估股票。此外,我们会积极把握被前期情绪错杀的优质股票的投资机会。

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运营的副总经理负责,成员包括督察长、投资总监、研究部、固定收益部、金融工程部、风险管理部、基金运营部的相关人员,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

根据本基金基金合同及基金的实际运作情况,本基金于本报告期内未进行收益分配。

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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对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(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体: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
报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年6月30日
资 产:	
银行存款	59,871,077.55
结算备付金	15,151,124.07
存出保证金	723,836.34
交易性金融资产	1,256,871,979.03
其中:股票投资	1,256,871,979.03
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	64,282,181.68
应收利息	29,608.56
应收股利	-
应收申购款	10,471,319.25
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	1,407,401,126.48
负债和所有者权益	本期末 2015年6月30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	-
应付赎回款	57,940,637.64
应付管理人报酬	2,046,001.58
应付托管费	341,000.26
应付销售服务费	-
应付交易费用	5,884,562.29
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	251,747.02
负债合计	66,463,948.79
所有者权益:	
实收基金	923,528,164.57
未分配利润	417,409,013.12
所有者权益合计	1,340,937,177.69
负债和所有者权益总计	1,407,401,126.48

注:1、报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.452元,基金份额总额 923,528,164.57份。

2、本基金于2015年2月13日基金合同生效。

6.2 利润表

会计主体: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
本报告期:2015年2月13日(基金合同生效日)至2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年2月13日(基金合同生效日)至2015年6月30日
一、收入	756,727,575.55
1.利息收入	1,738,578.54
其中:存款利息收入	701,707.65
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	1,036,870.89
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	832,085,097.12
其中:股票投资收益	826,854,973.37
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	5,230,123.75
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-86,526,789.05
4. 汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	9,430,688.94
减:二、费用	30,309,281.94
1.管理人报酬	11,282,666.77
2.托管费	1,880,444.42
3.销售服务费	-
4.交易费用	16,973,700.51
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	172,470.24
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	726,418,293.61
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	726,418,293.61

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: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
本报告期:2015年2月13日 至 2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年2月13日(基金合同生效日)至2015年6月30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)	1,931,765,423.15	-	1,931,765,423.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	726,418,293.61	726,418,293.61
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)	-1,008,237,258.58	-309,009,280.49	-1,317,246,539.07
其中:1.基金申购款	694,971,162.03	471,283,089.23	1,166,254,251.26
2.基金赎回款	-1,703,208,420.61	-780,292,369.72	-2,483,500,790.33
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)	923,528,164.57	417,409,013.12	1,340,937,177.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

傅国庆(代任总经理)	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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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(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]54号《关于核准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募集的批复》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《泰达宏利改革动力量化策略灵活配置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1,931,209,798.06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133号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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基金合同》于2015年2月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,931,765,423.15份基金份额,其中认购资金利息折合555,625.09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,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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。本基金股票资产占基金资产的比例为0%-95%,其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券等金融工具,其中投资于具有改革动力主题的证券不低于非现金基金资产的80%。本基金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,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金的业绩比较基准为50%×沪深300 指数收益率+50%×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2015年8月25日批准报出。

6.4.2 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日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年度上半年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2015年6月30日的财务状况以及2015年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

6.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11基金的收益分配政策

本基金每一类别的基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等, 则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

6.4.4.13其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作, 本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1)对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值; 若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本, 按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 自2015年3月27日起,本基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),采用第三方估值机构根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策的变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金管理人于2015年3月28日发布《关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》,自2015年3月27日起,本基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

除上述会计估计变更事项外,本报告期未发生其他会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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,股权的股息、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,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。自2013年1月1日起,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,暂减按25%计入应纳税所得额。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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期没有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年2月13日(基金合同生效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,282,666.77
其中:支付销售机构的客户维护费	4,890,205.52

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1.5%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 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年2月13日(基金合同生效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,880,444.42

注:支付基金托管人中国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 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

6.4.8.4.2 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未持有本基金。

6.4.8.5 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 2015年2月13日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	59,871,077.55	613,351.78

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新股或增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000786	北新建材	2015年4月10日	重大事项	19.13	-	-	1,301,080	16,388,708.85	24,889,660.40	-
000850	华茂股份	2015年5月7日	重大事项	12.38	-	-	1,642,770	18,460,451.05	20,337,492.60	-
000813	天山纺织	2015年5月4日	重大事项	11.25	-	-	1,651,534	14,761,749.07	18,579,757.50	-
002080	中材科技	2015年4月21日	重大事项	22.79	-	-	498,518	8,701,070.31	11,361,225.22	-
600416	湘电股份	2015年5月22日	重大事项	22.64	2015年7月20日	20.35	462,886	8,577,498.03	10,479,739.04	-
000665	湖北广电	2015年5月23日	重大事项	27.90	-	-	373,723	7,798,184.59	10,426,871.70	-
002003	伟星股份	2015年6月5日	重大事项	16.17	-	-	632,992	7,577,738.72	10,235,480.64	-
300071	华谊嘉信	2015年5月21日	重大事项	13.66	-	-	714,704	8,445,885.49	9,762,856.64	-
002662	京威股份	2015年5月15日	重大事项	17.84	2015年8月13日	16.06	472,578	7,141,757.62	8,430,791.52	-
300195	长荣股份	2015年6月22日	重大事项	31.96	-	-	214,167	8,721,523.45	6,844,777.32	-
002238	天威视讯	2015年6月29日	重大事项	23.76	-	-	287,599	6,142,134.68	6,833,352.24	-
300346	南大光电	2015年6月25日	重大事项	35.49	-	-	190,834	7,230,513.60	6,772,698.66	-
002354	天神娱乐	2015年5月28日	重大事项	69.63	2015年7月23日	87.27	94,911	8,789,974.77	6,608,652.93	-
300269	联建光电	2015年6月30日	重大事项	28.81	-	-	219,150	8,301,739.45	6,313,711.50	-
002183	怡亚通	2015年6月1日	重大事项	65.78	-	-	91,690	4,095,517.58	6,031,368.20	-
601111	中国国航	2015年6月30日	重大事项	15.36	2015年7月29日	13.78	391,155	4,163,441.69	6,008,140.80	-
600410	华胜天成	2015年5月28日	重大事项	47.84	2015年7月22日	43.06	122,465	3,453,310.83	5,858,725.60	-
002377	国创高新	2015年6月26日	重大事项	13.32	2015年7月3日	11.99	428,272	5,448,535.14	5,704,583.04	-
300144	宋城演艺	2015年6月18日	重大事项	56.66	2015年7月20日	68.82	95,900	8,071,184.70	5,433,694.00	-
002639	雪人股份	2015年6月30日	重大事项	38.30	2015年8月20日	34.47	137,995	5,568,567.53	5,285,208.50	-
000932	华菱钢铁	2015年5月14日	重大事项	4.71	2015年7月16日	4.24	1,058,652	4,915,615.17	4,986,250.92	-
002671	龙泉股份	2015年6月17日	重大事项	23.89	-	-	204,700	3,230,852.00	4,890,283.00	-
300287	飞利信	2015年6月2日	重大事项	38.08	-	-	128,100	3,614,255.79	4,878,048.00	-
300188	美亚柏科	2015年5月14日	重大事项	37.15	2015年8月21日	-	125,600	2,745,591.23	4,666,040.00	-
002649	博彦科技	2015年6月1日	重大事项	61.64	2015年8月18日	75.43	69,351	4,136,406.01	4,274,795.64	-
300030	阳普医疗	2015年6月25日	重大事项	27.34	2015年7月2日	24.61	154,701	3,842,976.78	4,229,525.34	-
000889	茂业物流	2015年6月3日	重大事项	23.00	2015年8月4日	20.70	180,500	4,033,806.93	4,151,500.00	-
000732	泰禾集团	2015年6月25日	重大事项	30.36	2015年7月2日	30.78	133,462	4,339,659.07	4,051,906.32	-
000066	长城电脑	2015年6月18日	重大事项	16.83	-	-	215,200	4,792,286.01	3,621,816.00	-
002557	洽洽食品	2015年6月29日	重大事项	16.38	-	-	214,250	4,592,185.12	3,509,415.00	-
002498	汉缆股份	2015年6月30日	重大事项	20.57	2015年7月20日	22.63	168,425	3,535,200.52	3,464,502.25	-
300212	易华录	2015年6月30日	重大事项	64.12	2015年7月13日	54.00	51,200	2,656,024.14	3,282,944.00	-
300291	华录百纳	2015年6月30日	重大事项	37.76	2015年7月13日	34.65	85,921	3,540,437.27	3,244,376.96	-
000592	平潭发展	2015年6月30日	重大事项	29.76	2015年7月14日	30.00	102,534	3,716,072.51	3,051,411.84	-
300007	汉威电子	2015年6月29日	重大事项	74.72	-	-	40,100	4,089,218.04	2,996,272.00	-
002194	武汉凡谷	2015年6月18日	重大事项	21.08	2015年7月24日	24.28	138,818	2,691,118.83	2,926,283.44	-
600531	豫光金铅	2015年6月11日	重大事项	27.53	2015年7月3日	24.78	101,357	2,245,706.95	2,790,358.21	-
000812	陕西金叶	2015年6月22日	重大事项	19.05	-	-	117,938	2,076,231.85	2,246,718.90	-
000903	云内动力	2015年6月2日	重大事项	12.39	2015年7月27日	11.10	179,600	2,201,424.78	2,225,244.00	-
002445	中南重工	2015年6月2日	重大事项	57.80	-	-	36,800	2,137,379.00	2,127,040.00	-
600113	浙江东日	2015年6月16日	重大事项	18.08	2015年7月8日	16.27	102,355	1,678,163.25	1,850,578.40	-
002045	国光电器	2015年6月1日	重大事项	13.92	2015年7月14日	12.53	132,546	1,410,502.96	1,845,040.32	-
002665	首航节能	2015年6月30日	重大事项	27.70	2015年7月1日	30.00	55,865	1,466,106.53	1,547,460.50	-
600778	友好集团	2015年6月2日	重大事项	16.10	-	-	94,854	1,292,435.91	1,527,149.40	-
002706	良信电器	2015年6月19日	重大事项	65.20	2015年7月7日	58.68	23,290	1,182,205.83	1,518,508.00	-
002668	奥马电器	2015年6月27日	重大事项	29.04	2015年7月21日	26.14	52,230	1,456,514.50	1,516,759.20	-
002242	九阳股份	2015年6月15日	重大事项	19.45	2015年7月7日	17.51	73,800	1,315,548.29	1,435,410.00	-
000952	广济药业	2015年6月29日	重大事项	15.30	2015年7月1日	14.18	90,940	1,868,889.94	1,391,382.00	-
002688	金河生物	2015年6月2日	重大事项	29.70	2015年7月14日	26.73	45,888	1,073,646.72	1,362,873.60	-
300048	合康变频	2015年6月1日	重大事项	21.29	-	-	55,900	985,021.21	1,190,111.00	-
600561	江西长运	2015年5月4日	重大事项	19.48	2015年8月20日	17.36	53,200	873,605.00	1,036,336.00	-
300294	博雅生物	2015年4月23日	重大事项	75.46	-	-	13,125	628,547.80	990,412.50	-
002643	万润股份	2015年5月4日	重大事项	28.70	-	-	33,878	617,921.53	972,298.60	-
002388	新亚制程	2015年5月20日	重大事项	28.59	2015年8月20日	12.87	30,600	653,376.98	874,854.00	-
002012	凯恩股份	2015年5月28日	重大事项	14.00	2015年7月1日	12.60	55,500	583,327.37	777,000.00	-
000608	阳光股份	2015年5月25日	重大事项	8.23	2015年8月21日	-	88,010	542,052.29	724,322.30	-
300084	海默科技	2015年6月3日	重大事项	21.43	2015年7月20日	19.29	20,280	328,109.34	434,600.40	-
300083	劲胜精密	2015年4月7日	重大事项	37.48	2015年8月17日	33.79	9,591	281,896.67	359,470.68	-
000963	华东医药	2015年6月26日	重大事项	71.48	2015年8月5日	69.20	3,195	226,441.48	228,378.60	-
002586	围海股份	2015年5月4日	重大事项	12.45	-	-	1,600	12,473.33	19,920.00	-
300113	顺网科技	2015年5月5日	重大事项	57.70	2015年8月6日	51.93	84	2,782.03	4,846.80	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,256,871,979.03	89.30
	其中:股票	1,256,871,979.03	89.30
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	75,022,201.62	5.33
7	其他各项资产	75,506,945.83	5.36
8	合计	1,407,401,126.48	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	32,018,724.79	2.39
B	采矿业	21,944,900.97	1.64
C	制造业	861,562,051.31	64.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,639,349.59	1.17
E	建筑业	1,777,349.10	0.13
F	批发和零售业	33,064,665.07	2.47
G	交通运输、仓储和邮政业	19,411,170.62	1.45
H	住宿和餐饮业	11,734,503.12	0.88
I	信息传输、软件和信息技术服务业	91,021,143.21	6.79
J	金融业	50,083,214.66	3.73
K	房地产业	17,908,579.99	1.34
L	租赁和商务服务业	32,962,532.94	2.46
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	17,802,722.61	1.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	309,195.44	0.02
R	文化、体育和娱乐业	40,881,793.78	3.05
S	综合	8,750,081.83	0.65
	合计	1,256,871,979.03	93.73

7.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000786	北新建材	1,301,080	24,889,660.40	1.86
2	000850	华茂股份	1,642,770	20,337,492.60	1.52
3	000813	天山纺织	1,651,534	18,579,757.50	1.39
4	000639	西王食品	532,539	12,168,516.15	0.91
5	002080	中材科技	498,518	11,361,225.22	0.85
6	002579	中京电子	706,430	11,161,594.00	0.83
7	600521	华海药业	336,171	10,505,343.75	0.78
8	600416	湘电股份	462,886	10,479,739.04	0.78
9	000665	湖北广电	373,723	10,426,871.70	0.78
10	002003	伟星股份	632,992	10,235,480.64	0.76

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本公司网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	32,705,270.86	2.44
2	600369	西南证券	32,433,274.08	2.42
3	601555	东吴证券	31,835,759.73	2.37
4	300286	安科瑞	31,000,144.97	2.31
5	601688	华泰证券	30,077,639.40	2.24
6	601336	新华保险	29,900,396.31	2.23
7	601377	兴业证券	29,343,825.90	2.19
8	601628	中国人寿	27,857,903.04	2.08
9	600291	西水股份	27,726,215.70	2.07
10	601601	中国太保	27,650,460.83	2.06
11	000850	华茂股份	25,269,622.53	1.88
12	600529	山东药玻	25,013,209.38	1.87
13	600827	百联股份	23,827,230.60	1.78
14	600521	华海药业	23,069,994.33	1.72
15	600290	华仪电气	22,986,071.47	1.71
16	002218	拓日新能	22,461,379.01	1.68
17	300265	通光线缆	22,410,240.86	1.67
18	000550	江铃汽车	22,282,426.61	1.66
19	000551	创元科技	22,090,546.98	1.65
20	002238	天威视讯	21,834,588.06	1.63

注:"买入金额"(或"买入股票成本")、"卖出金额"(或"卖出股票收入")均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600606	金丰投资	36,541,093.90	2.73
2	300286	安科瑞	36,078,076.36	2.69
3	601318	中国平安	35,053,900.11	2.61
4	000930	中粮生化	34,332,091.26	2.56
5	600369	西南证券	32,853,869.41	2.45
6	600291	西水股份	31,469,569.56	2.35
7	601336	新华保险	30,247,814.60	2.26
8	300094	国联水产	29,336,697.02	2.19
9	601601	中国太保	28,394,669.51	2.12
10	601628	中国人寿	28,076,990.49	2.09
11	600827	百联股份	27,380,574.67	2.04
12	002090	金智科技	27,215,605.92	2.03
13	002531	天顺风能	26,567,890.95	1.98
14	600006	东风汽车	26,475,705.21	1.97
15	300265	通光线缆	25,819,750.75	1.93
16	601555	东吴证券	25,179,549.94	1.88
17	002157	正邦科技	25,126,969.86	1.87
18	600529	山东药玻	24,339,805.82	1.82
19	601377	兴业证券	24,210,957.55	1.81
20	002567	唐人神	24,127,687.70	1.80

注:"买入金额"(或"买入股票成本")、"卖出金额"(或"卖出股票收入")均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	5,913,098,908.52
卖出股票收入(成交)总额	5,396,555,113.81

注:"买入金额"(或"买入股票成本")、"卖出金额"(或"卖出股票收入")均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1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。

7.10.2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。

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1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。

7.11.2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。

7.11.3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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	723,836.34
2	应收证券清算款	64,282,181.68
3	应收股利	-
4	应收利息	29,608.56
5	应收申购款	10,471,319.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	75,506,945.83

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000786	北新建材	24,889,660.40	1.86	重大事项
2	000850	华茂股份	20,337,492.60	1.52	重大事项
3	000813	天山纺织	18,579,757.50	1.39	重大事项
4	002080	中材科技	11,361,225.22	0.85	重大事项
5	600416	湘电股份	10,479,739.04	0.78	重大事项
6	000665	湖北广电	10,426,871.70	0.78	重大事项
7	002003	伟星股份	10,235,480.64	0.76	重大事项

7.12.6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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
19,543	47,256.21	43,138,063.69	4.67%	880,390,100.88	95.33%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	48,525.28	0.0053%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0

泰达宏利基金管理有限公司
2015年8月25日