泰达宏利品质生活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：中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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1月1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	泰达宏利品质生活混合
基金主代码	162211
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年4月9日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	44,322,218.16份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	随着中国经济增长迈上新的台阶，广大人民群众必然更加注重生活品质。本基金将重点把握生活品质提高的这一趋势，通过投资相关的受益行业和上市公司，充分分享中国国民经济实力的全面提升，力争为投资者带来长期稳定的投资回报。
投资策略	1.使用MVPS 模型进行战略性资产配置策略，确定股票债券比例。主要考虑M（宏观经济环境）、V（价值）、P（政策）、S（市场气氛）四方面因素。 2.股票投资策略。本基金采用双主线策略，对横纵交点进行重点的定性分析和定量分析，构建实际股票投资组合。横向上，利用“行业文档”分析方法，确定国内行业与提高生活品质有关行业中具有竞争优势和比较优势的行业；纵向上，努力挖掘市场上与本基金投资理念相一致的投资主题。 3.债券投资策略。本基金将结合宏观经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，运用利率预期、久期管理、收益率曲线等投资管理策略。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金属于较高风险的混合型证券投资基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈沛	田青
	联系电话	010-66577808	010-67595096
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-69-88888	010-67595096
传真		010-66577666	010-66275853

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1月1日 － 2015年6月30日)
本期已实现收益	60,186,448.80
本期利润	58,580,553.75
加权平均基金份额本期利润	0.5761
本期基金份额净值增长率	41.36%
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	0.4734
期末基金资产净值	65,305,514.63
期末基金份额净值	1.473

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

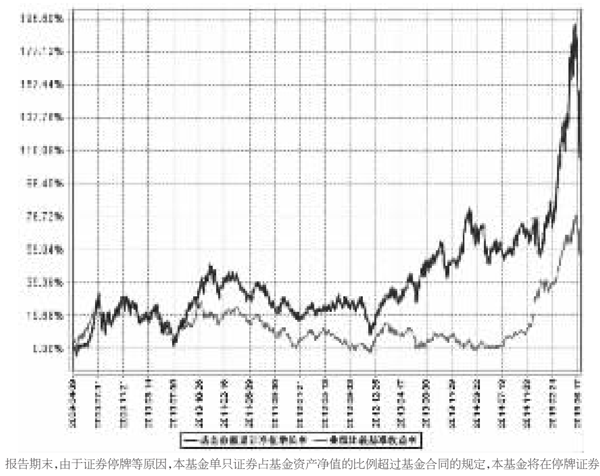
3.2 基金净值表现

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	-17.80%	3.38%	-4.16%	2.10%	-13.64%	1.28%
过去三个月	5.21%	2.93%	7.14%	1.57%	-1.93%	1.36%
过去六个月	41.36%	2.55%	17.30%	1.36%	24.06%	1.19%
过去一年	38.18%	2.03%	59.43%	1.10%	-21.25%	0.93%
过去三年	74.34%	1.56%	52.65%	0.90%	21.69%	0.66%
自基金合同生效起至今	120.47%	1.37%	62.03%	0.92%	58.44%	0.45%

注：本基金的业绩比较基准：60%×沪深300 指数收益率+40%×上证国债指数收益率。沪深300 指数是由上海和深圳证券市场中选取300 只A 股作为样本编制而成的成份股指数，该指数的指数样本覆盖了沪深两地市场七成左右的市值，具有良好的市场代表性。上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成，具有良好的市场代表性。

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



报告期末，由于证券停牌等原因，本基金单只证券占基金资产净值的比例超过基金合同的规定，本基金将在停牌证券复牌后尽快调整，使其投资比例符合基金合同的规定。

§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		
邓艺颖	本基金基金经理	2014年1月3日	2015年4月3日	9	金融学硕士；2004年5月至2005年4月就职于中国工商银行广东省分行公司业务部；2005年4月加盟泰达宏利基金管理有限公司，先后担任交易部交易员、固定收益部研究员、研究部研究部总监业务助理兼研究员；具备10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。
陈炜	本基金基金经理	2014年11月13日	2015年6月8日	7	金融学硕士；2005年9月至2007年10月就职于中国电信北京研究院，担任研究员，从事市场策略研究；2007年10月至2009年6月就职于中国民族证券，担任研究员，从事通信行业研究；2009年6月至2010年3月就职于新华资产管理股份有限公司，担任研究员，从事TMT行业研究；2010年3月加入泰达宏利基金管理有限公司，先后担任助理研究员、研究员、高级研究员等职，从事通信及电子行业研究；7年证券从业经验，具有基金从业资格。
庄腾飞	本基金基金经理	2015年5月14日	-	5	2010年7月加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于研究部，负责宏观经济及地产金融行业研究，曾先后担任助理研究员、研究员、高级研究员等职务。5年证券从业经验，5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

2014年四季度至今，中国整体经济基本面处于放缓的阶段，工业增长数据和通胀一路走低，市场对通缩的担心加剧，因此我们看到，管理层一方面采用传统的宽松货币政策和积极财政政策，对冲经济下滑的压力。与此同时，2015年年初开始，管理层积极鼓励创新和改革，积极支持经济结构转型，鼓励发展资本市场，推进直接融资市场发展反哺实体经济的融资需求。两会上，管理层明确提出了“互联网+”和“中国先进制造2025”两大方向，而这也体现了上半年资本市场的两大核心投资方向。在这样的大背景下，2015年一季度的行情出现了单边的小盘股风格，创业板指数不断创出新高，从年初的1400点不断上升到2800点附近，而主板指数的表现要逊色许多，这超出了整体市场预期，而在二季度的前半段小股票持续强势，直到6月份出现因为场内外去杠杆导致的市场急跌的状况。

2015年以来这波行情速度非常快，具有两个重要外部环境特点，第一，流动性极其宽松，包括货币放松、居民资金入市和场内外两融配资同时加杠杆；第二，实体经济需求疲弱，类通缩状态。因此，我们认为，市值不可测、估值弹性大的品种成为市场投资者关注的对象，成为市场追捧的稀缺产品。市场核心主导品种一直集中在估值弹性大的品种，从2014年四季度的券商股（牛市初期，业绩爆发），到2015年一季度到二季度的互联网+品种（符合产业发展方向，模式落地，流水爆发）。6月份市场整体出现了快速调整，我们认为造成这种变化的背后原因一方面是市场短期积累涨幅过大，与基本面出现较大偏离，另一方面，场外和场内融资杠杆在监管压力下出现去化，并且出现了负反馈的链式反应。

在基金操作方面，本基金在年初的时候，较好地把握住了小盘股行情，组合结构以小盘股为主，取到了比较好的效果，并从3月底开始进行了一定程度的均衡组合的调整，对小部分仓位涨幅过高品种进行确认收益，转移了小部分仓位到低估值的转型品种和业绩大概率超预期的蓝筹品种。二季度前期的配置主要还是集中在成长性比较好的传媒、计算机、电子和医药等行业股票，主要通过自下而上选股方式集中在长期成长性好并且具备合理估值的股票上，取得一定的投资效果。在二季度后半段互联网+龙头受到高价股和监管影响后，组合的配置方向开始转向个股Alpha型的品种，努力获取超额收益。在6月份的市场快速下跌阶段，组合也努力通过向业绩稳定的板块进行转移，主要进行了板块调整，转移出创业板，但对系统性风险的提前判断不足，在仓位的控制上做的不够，带来明显的组合回撤。在未来的市场中，我们将在组合现金管理上进行改进，在一定的宏观变量下，对指数有一个大的风险区域的映射框架判断，在高风险区域会进行一定的现金管理，提前做好系统性风险的防范。

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1.473元，本报告期份额净值增长率为41.36%，同期业绩比较基准增长率为17.30%。

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2015年下半年，资本市场最大的变量就是金融市场流动性环境的边际变化，即流动性持续放松的程度不如上半年，尽管大的方向依然是宽松。首先，货币政策放松的空间小于上半年，上半年已经推出多次降准降息，下半年财政政策逐步发力以后，经济总需求有阶段性小幅回升的可能；其次，经历了6月份的急速下跌，民间资金通过公募资金入市速度放缓；再次，下半年场内外加杠杆的过程也会放缓。

因此，2015年下半年的机构投资策略会发生改变，上半年市场追求的是估值的弹性，因为市场流动性极其泛滥，下半年市场追求的是确定性，既包括业绩环比加速的确定性，又包括公司事件或行业改革的确定性。我们将更加注重个股的业绩和基本面，注重业绩确定性和个股流动性安全，包括高股息率的股票都是我们的认可品种。同时，我们也积极寻找新兴经济的行业龙头，如业绩和并购合作等事件持续落地的品种，其中具有长期成长性的股票将具备较高的投资价值。从组合结构上而言，组合的进攻部分会积极把握主题性投资机会，包括文化体育产业、国企改革和军工板块，防御的部分会根据市场环境逐步增加稳定型的个股品种配置，估值安全、复合增速高、行业基本面改善、有正面催化剂的个股，行业上可能集中在化工、医药、轻工等。中长期而言，我们将继续通过前瞻性的研究和长线投资的风格来为投资人获取稳健的回报。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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：泰达宏利品质生活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	上年度末 2014年12月31日
资 产：		
银行存款	8,150,236.91	16,423,210.01
结算备付金	740,109.52	1,957,231.52
存出保证金	284,055.36	452,066.18
交易性金融资产	58,182,410.23	234,592,970.35
其中：股票投资	47,935,410.23	192,041,370.35
基金投资	-	-
债券投资	10,247,000.00	42,551,600.00
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	252,834.91	-
应收利息	285,817.86	2,075,161.33
应收股利	-	-
应收申购款	40,240.42	176,354.29
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	67,935,705.21	255,676,993.68
负债和所有者权益	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31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	629,523.44	9,668,927.34
应付赎回款	1,283,949.93	552,290.78
应付管理人报酬	108,637.33	501,142.81
应付托管费	18,106.23	83,523.82
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	316,649.48	1,144,864.64
应交税费	81,360.00	81,360.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	191,964.17	84,860.30
负债合计	2,630,190.58	12,116,969.69
所有者权益：		
实收基金	44,322,218.16	233,707,381.15
未分配利润	20,983,296.47	9,852,642.84
所有者权益合计	65,305,514.63	243,560,023.99
负债和所有者权益总计	67,935,705.21	255,676,993.68

注：报告截止日2015年06月30日，基金份额净值1.473元，基金份额总额 44,322,218.16份。

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入	61,549,548.01	16,578,317.56
1.利息收入	651,137.65	3,512,900.92
其中：存款利息收入	41,318.93	341,423.61
债券利息收入	596,448.54	3,116,707.07
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	13,370.18	54,770.24
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	62,000,338.95	-44,582,627.22
其中：股票投资收益	61,658,567.40	-45,061,967.47
基金投资收益	-	-
债券投资收益	165,729.99	-2,295,162.97
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	176,041.56	2,774,503.22
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,605,895.05	57,383,988.75
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	503,966.46	264,055.11
减：二、费用	2,968,994.26	10,344,366.98
1.管理人报酬	1,030,085.32	5,630,170.47
2.托管费	171,680.88	938,361.77
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,527,298.37	3,560,409.17
5.利息支出	23,289.63	14,640.77
其中：卖出回购金融资产支出	23,289.63	14,640.77
6.其他费用	216,640.06	200,784.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	58,580,553.75	6,233,950.58
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	58,580,553.75	6,233,950.58

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日 至 2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1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）	233,707,381.15	9,852,642.84	243,560,023.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	58,580,553.75	58,580,553.75
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）	-189,385,162.99	-47,449,900.12	-236,835,063.11
其中：1.基金申购款	223,061,000.34	53,580,867.02	276,641,867.36
2.基金赎回款	-412,446,163.33	-101,030,767.14	-513,476,930.47
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）	44,322,218.16	20,983,296.47	65,305,514.63
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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）	606,656,164.06	11,023,839.69	617,680,003.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	6,233,950.58	6,233,950.58
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）	186,983,472.30	35,065,522.27	222,048,994.57
其中：1.基金申购款	386,639,195.06	54,985,785.82	441,624,980.88
2.基金赎回款	-199,655,722.76	-19,920,263.55	-219,575,986.31
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）	793,639,636.36	52,323,312.54	845,962,948.90

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

泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”，原泰达荷银品质生活灵活配置混合型证券投资基金)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[2008]第1248号《关于核准泰达荷银品质生活灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由泰达荷银基金管理有限公司(于2010年3月9日更名为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《泰达荷银品质生活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1,294,571,230.82元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第063号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰达荷银品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2009年4月9日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,294,884,284.12份基金份额，其中认购资金利息折合313,053.30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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

2010年3月17日，经基金管理人董事会批准、报中国证监会同意，本基金更名为泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利品质生活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国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中股票资产占基金资产的30%—80%，债券资产占基金资产的15%—65%，权证占基金资产净值的0—3%，资产支持证券占基金资产净值的0—20%，并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：60%×沪深300 指数收益率+40%×上证国债指数收益率。

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》、《泰达宏利品质生活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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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，本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均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1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,030,085.32	5,630,170.47
其中：支付销售机构的客户维护费	176,137.54	208,192.48

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1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	171,680.88	938,361.77

注：支付基金托管人中国建设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

本基金本报告期及上年度可比期间内均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及上年度可比期间内均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及上年度末均未持有本基金。

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1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	8,150,236.91	28,069.92	13,714,361.80	311,503.84

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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

本基金本报告期及上年度可比期间均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
002739	万达院线	2015年5月13日	重大事项	221.88	2015年7月3日	219.68	38,261	3,765,122.74	8,489,350.68	-
600643	爱建股份	2015年6月30日	重大事项	17.98	-	-	114,010	2,602,083.03	2,049,899.80	-
300056	三维丝	2015年6月5日	重大事项	35.79	-	-	35,800	1,515,850.00	1,281,282.00	-

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	47,935,410.23	70.56
	其中：股票	47,935,410.23	70.56
2	固定收益投资	10,247,000.00	15.08
	其中：债券	10,247,000.00	15.08
	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	8,890,346.43	13.09
7	其他各项资产	862,948.55	1.27
8	合计	67,935,705.21	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	1,376,796.00	2.11
B	采矿业	-	-
C	制造业	14,447,926.55	22.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	658,007.00	1.01
E	建筑业	1,687,800.00	2.58
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,720,068.98	14.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,790,411.22	8.87
J	金融业	2,717,487.80	4.16
K	房地产业	2,045,610.00	3.13
L	租赁和商务服务业	1,001,952.00	1.53
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	8,489,350.68	13.00
S	综合	-	-
	合计	47,935,410.23	73.40

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	002739	万达院线	38,261	8,489,350.68	13.00
2	600614	鼎立股份	97,905	2,925,401.40	4.48
3	600125	铁龙物流	182,700	2,819,061.00	4.32
4	600029	南方航空	165,000	2,399,100.00	3.67
5	000768	中航飞机	54,500	2,375,110.00	3.64
6	600119	长江投资	99,854	2,333,587.98	3.57
7	300059	东方财富	34,586	2,182,030.74	3.34
8	600115	东方航空	176,000	2,168,320.00	3.32
9	600643	爱建股份	114,010	2,049,899.80	3.14
10	600158	中体产业	71,400	2,045,610.00	3.13

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初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例（%）
1	000831	五矿稀土	17,068,800.31	7.01
2	002236	大华股份	16,294,170.04	6.69
3	600446	金证股份	16,289,001.53	6.69
4	300191	潜能恒信	15,267,759.39	6.27
5	300016	北陆药业	13,212,449.11	5.42
6	002653	海思科	13,074,551.15	5.37
7	300104	乐视网	11,543,233.00	4.74
8	000821	京山轻机	10,966,699.16	4.50
9	600259	广晟有色	8,428,073.17	3.46
10	000024	招商地产	8,131,462.00	3.34
11	600030	中信证券	8,126,885.00	3.34
12	002364	中恒电气	7,720,367.16	3.17
13	300059	东方财富	7,186,310.30	2.95
14	300177	中海达	7,042,040.00	2.89
15	601166	兴业银行	6,136,658.00	2.52
16	300254	仟源医药	6,060,921.60	2.49
17	601688	华泰证券	5,942,768.00	2.44
18	002673	西部证券	5,825,595.00	2.39
19	600614	鼎立股份	5,659,816.97	2.32
20	600571	信雅达	5,556,338.00	2.28
21	600373	中文传媒	5,452,531.00	2.24
22	002739	万达院线	5,451,708.00	2.24
23	601601	XD中国太	5,419,400.00	2.23
24	300220	金运激光	5,220,021.00	2.14
25	600831	广电网络	5,159,020.00	2.12
26	300380	安硕信息	5,084,030.00	2.09
27	300399	京天利	5,044,581.00	2.07

注：表中“买入金额”为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例（%）
1	300315	掌趣科技	46,948,579.69	19.28
2	600446	金证股份	46,322,009.74	19.02
3	002439	启明星辰	34,878,548.03	14.32
4	000831	五矿稀土	26,670,492.63	10.95
5	002329	皇氏集团	18,940,904.62	7.78
6	300104	乐视网	17,559,764.73	7.21
7	002236	大华股份	17,103,974.82	7.02
8	300016	北陆药业	16,948,696.48	6.96
9	600259	广晟有色	16,745,652.35	6.88
10	300191	潜能恒信	15,044,019.51	6.18
11	002653	海思科	14,246,842.51	5.85
12	000821	京山轻机	13,779,049.25	5.66
13	002364	中恒电气	11,979,489.29	4.92
14	000150	宜华健康	11,374,878.90	4.67
15	601688	华泰证券	11,199,697.88	4.60
16	601166	兴业银行	8,717,329.18	3.58
17	000024	招商地产	8,368,736.64	3.44
18	300177	中海达	8,152,706.53	3.35
19	600030	中信证券	8,090,050.00	3.32
20	000090	天健集团	8,040,196.19	3.30
21	600010	包钢股份	7,945,076.88	3.26
22	601318	中国平安	7,295,761.88	3.00
23	002673	西部证券	6,486,984.62	2.66
24	300377	赢时胜	6,418,087.50	2.64
25	002268	卫 士 通	6,364,625.40	2.61
26	601336	新华保险	6,226,551.58	2.56
27	300254	仟源医药	6,125,044.94	2.51
28	002104	恒宝股份	6,030,875.62	2.48
29	600373	中文传媒	5,537,574.50	2.27
30	600614	鼎立股份	5,475,281.72	2.25
31	601601	XD中国太	5,422,882.68	2.23
32	300220	金运激光	5,334,719.00	2.19
33	600571	信雅达	5,247,350.90	2.15
34	600831	广电网络	5,235,106.00	2.15
35	600392	盛和资源	5,157,274.95	2.12
36	300380	安硕信息	4,904,080.25	2.01

注：表中“卖出金额”为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），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	366,068,312.83
卖出股票收入（成交）总额	570,522,263.40

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,247,000.00	15.69
	其中：政策性金融债	10,247,000.00	15.69
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	10,247,000.00	15.69

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018001	国开1301	100,000	10,247,000.00	15.69

注：以上为本基金本报告期末持有的全部债券。

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

金额单位：人民币元

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	284,055.36
2	应收证券清算款	252,834.91
3	应收股利	-
4	应收利息	285,817.86
5	应收申购款	40,240.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	862,948.55

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	002739	万达院线	8,489,350.68	13.00	重大事项
2	600643	爱建股份	2,049,899.80	3.14	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
4,092	10,831.43	0.00	0.00%	44,322,218.16	100.00%

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	279,125.64	0.6298%

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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年4月9日 ）基金份额总额	1,294,884,284.12
本报告期期初基金份额总额	233,707,381.15
本报告期基金总申购份额	223,061,000.34
减：本报告期基金总赎回份额	412,446,163.33
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	44,322,218.16

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1.本公司于2015年4月28日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，聘任刘建先生为公司副总经理。

2.本公司于2015年5月16日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，刘青山先生因个人原因辞去公司总经理职务，由公司副总经理傅国庆先生于5月15日起代任总经理职务。

3.本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其相关高级管理人员没有发生受到监管部门稽查或处罚的任何情况。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	3	369,146,237.33	39.41%	336,070.85	39.41%	-
中金公司	2	254,178,838.33	27.14%	231,403.72	27.14%	-
中银国际	3	84,267,174.04	9.00%	76,716.71	9.00%	-
民生证券	1	69,629,962.28	7.43%	63,391.19	7.43%	-
中投证券	1	63,027,426.21	6.73%	57,380.37	6.73%	-
光大证券	1	55,875,544.09	5.97%	50,869.22	5.97%	-
齐鲁证券	2	24,468,907.33	2.61%	22,276.46	2.61%	-
国信证券	2	9,398,596.86	1.00%	8,556.44	1.00%	-
国泰君安	1	6,597,889.76	0.70%	6,006.75	0.70%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

(一) 本基金本报告期无新增交易席位，撤销东兴证券交易席位。

(二) 交易席位选择的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

（1）经营规范，有较完备的内控制度；

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要

（3）能为基金管理人提供高质量的研究咨询服务。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	79,989,227.46	87.89%	90,000,000.00	97.51%	-	-
中银国际	9,299,143.00	10.22%	2,300,000.00	2.49%	-	-
民生证券	862,161.76	0.95%	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	862,698.19	0.95%	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

泰达宏利基金管理有限公司
2015年8月25日