泰达宏利货币市场基金

2016 第二季度 报告

2016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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月19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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月15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。

本报告期为2016年4月1日起至2016年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利货币	
交易代码	162206	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年11月10日	
报告期末基金份额总额	9,896,968,826.26份	
投资目标	在确保本金安全性和基金财产流动性的基础上,力争为投资者获取超过业绩比较基准的收益。	
投资策略	本基金将在遵守投资纪律并有效管理风险的基础上,实施稳健的投资风格和谨慎的交易操作,以价值分析为基础,数量分析为支持,采用自上而下确定投资策略和自下而上个券选择的程序,运用供求分析、久期偏离、收益率曲线配置和类属配置等积极投资策略,实现基金资产的保值增值。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为税后一年期银行定期存款利率。	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期收益率和预期风险均低于股票型、混合型和债券型基金。	
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	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B
下属分级基金的交易代码	162206	000700
报告期末下属分级基金的份额总额	226,531,070.78份	9,670,437,755.48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(2016年4月1日 - 2016年6月30日)	
	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B
1. 本期已实现收益	1,320,103.12	41,359,027.59
2.本期利润	1,320,103.12	41,359,027.59
3.期末基金资产净值	226,531,070.78	9,670,437,755.48

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的金额相等。

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收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰达宏利货币A

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	0.5707%	0.0021%	0.3740%	0.0000%	0.1967%	0.0021%

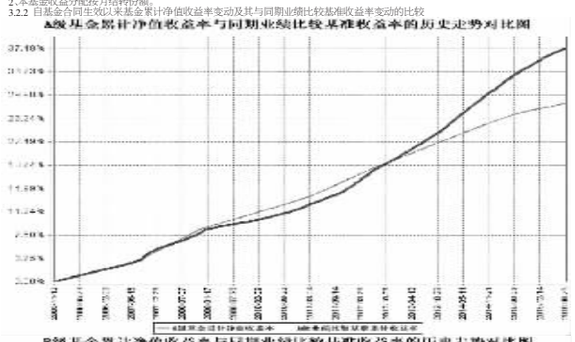
泰达宏利货币B

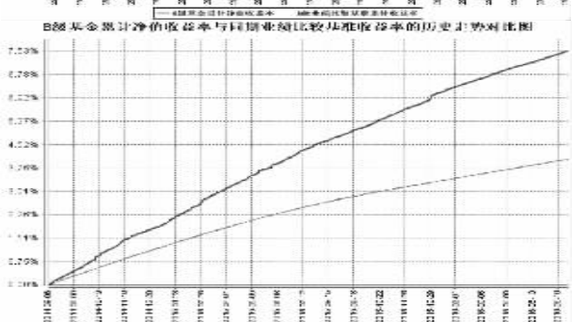
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6308%	0.0021%	0.3740%	0.0000%	0.2568%	0.0021%

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.本基金收益分配按月结转份额。

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





本基金A类份额成立于2005年11月10日,B类份额成立于2014年8月6日。本基金在建仓期结束时及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	本基金基金经理	2015年3月26日	-	8	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;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,未发生任何利益输送的情况。

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,2次涉及的投资组合一方均为按照量化策略进行投资,虽然买卖股票量少,但由于个股流动性较差,交易量小,致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%,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

2016年一季度,全球经济延续了低速复苏态势,美国二季度就业和消费数据稳健,英国退欧事件延缓了美国加息的步伐,稳定的国内经济继续推动CPI缓慢上行,宏观经济表现良好,日本继续维持负利率和量化宽松的货币政策,但升值压力使出口抗压,英国退欧事件给欧洲慢复苏蒙上了阴影,新兴经济体基本面仍不乐观。

国内经济高频数据出现一定程度改善,经济呈弱企稳态势。二季度工业需求前银仍没有大幅改善,工业增加值增速较一季度没有太大改观,但发电数据有所改善,PPI降幅收敛,第三产业发展平稳,服务业PMI回好。固定资产投资增速出现下滑,房地产销售火爆,但制造业和建筑业的拉动存在一定滞后,基建继续承压,内需仍维持低迷,外需在欧洲金融体系不稳定的背景下存在不确定性。蔬菜价格下跌,猪肉价格涨幅缩小,居民消费价格指数CPI同比增速处于下行通道。表外融资低迷,贷款有所恢复,但M2和社融数据受同比基数偏高的影响可能继续回落。

在供给侧改革与稳增长的背景下,央行继续实施了MLF、PSL和公开市场逆回购操作日常化等操作来提供流动性,以期降低社会融资成本,稳定资金面和提振经济,短期内央行中性偏宽松的货币政策不会改变。二季度人民币汇率继续面临贬值压力,但外汇储备下降幅度很小。MPA的二次实施来给季末资金面以大大扰动,利率中枢在二季度维持相对稳定。

债券市场呈现慢牛格局,债市收益率维持震荡,二季度以来,债券市场情绪受信用事件和英国退欧事件的影响,波动较大,收益率曲线趋于平坦。

报告期内,我们认为,基本面对债市仍然有利,但收益率存在一定波动风险,同时信用风险事件频发,违约主体的性质和行业越发分散化。在季末时点,我们适当降低了债券仓位,大幅增持存款以及同业存单,维持中性久期和适当杠杆,报告期内获得了相对满意的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

货币A

截止报告期末,本基金份额净值为1.0000元,本报告期份额净值增长率为0.5707%,同期业绩比较基准增长率为0.3740%。

货币B

截止报告期末,本基金份额净值为1.0000元,本报告期份额净值增长率为0.6308%,同期业绩比较基准增长率为0.3740%。

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	固定收益投资	5,153,066,525.63	48.30
	其中:债券	5,153,066,525.63	48.30
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,210,003,655.00	11.34
	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	4,250,922,622.47	39.85
4	其他资产	53,867,771.65	0.50
5	合计	10,667,860,574.75	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	4.53	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	758,499,220.75	7.66
	其中:买断式回购融资	-	-

注:上表中,报表期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数,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日融资余额占基金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

本基金本报告期末出现债券正回购的资金余额超过基金资产净值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

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	106
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	110
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	72

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未出现超过180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	18.20	7.66
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	8.49	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.30	-
3	60天(含)-90天	25.85	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	37.46	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	17.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	107.24	7.66

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	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	529,509,205.71	5.35
	其中:政策性金融债	529,509,205.71	5.35
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,107,392,936.95	21.29
6	中期票据	291,797,082.69	2.95
7	同业存单	2,224,367,300.28	22.48
8	其他	-	-
9	合计	5,153,066,525.63	52.07
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	29,933,154.72	0.30

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111619024	16恒丰银行CD024	5,000,000	493,881,282.11	4.99
2	1182226	11首钢MTN1	2,900,000	291,797,082.69	2.95
3	111692121	16杭州银行CD057	2,000,000	198,398,847.19	2.00
4	111691669	16南京银行CD032	2,000,000	195,628,069.50	1.98
5	111694652	16广州农村商业银行CD097	2,000,000	193,165,013.89	1.95
6	111694693	16长安银行CD025	2,000,000	192,784,527.73	1.95
7	160401	16农发01	1,600,000	159,857,282.14	1.62
8	041560117	15内蒙电投CP001	1,500,000	149,941,657.87	1.52
9	111691112	16长沙银行CD024	1,300,000	126,989,254.56	1.28
10	150416	15农发16	1,200,000	120,011,620.58	1.21

5.6 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	1
报告期内偏离度的最高值	0.2530%
报告期内偏离度的最低值	0.0990%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1476%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

5.8.2

本基金本报告期内未存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 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	52,443,343.29
4	应收申购款	1,424,428.36
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	53,867,771.65

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1.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。

2.报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B
报告期期初基金份额总额	260,739,317.31	4,934,712,524.36
报告期期间基金总申购份额	115,865,381.84	13,746,907,695.16
报告期期间基金总赎回份额	150,073,628.37	9,011,182,464.04
报告期期末基金份额总额	226,531,070.78	9,670,437,755.48

§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

(一)中国证监会批准泰达宏利货币市场基金设立的文件;

(二)《泰达宏利货币市场基金合同》;

(三)《泰达宏利货币市场基金招募说明书》;

(四)《泰达宏利货币市场基金托管协议》。

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(《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
2016年7月19日

泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016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
报告送出日期:2016年7月19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2016年7月15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2016年4月1日至2016年6月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达转型机遇股票
交易代码	000828
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年11月18日
报告期末基金份额总额	143,234,008.07份
投资目标	在严控风险的基础上,通过积极、主动的管理,深度挖掘中国经济转型中产生的各类投资机遇,力争为投资者获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	以中国经济转型过程中产生的各类投资机遇作为主线,并通过"自上而下"和"自下而上"相结合的方法构建基金资产组合。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,并优选受益行业;另一方面,本基金秉持多年来不断积累形成的选股框架,从商业模式、市场前景、竞争壁垒、财务状况等方面出发,以"自下而上"的视角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	85%×中证800指数收益率+15%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中的高风险品种,其长期预期收益及预期风险均高于混合型、债券型和货币基金
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

§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(2016年4月1日 - 2016年6月30日)
1.本期已实现收益	6,567,913.63
2.本期利润	8,214,620.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.0564
4.期末基金资产净值	123,814,992.42
5.期末基金份额净值	0.864

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。

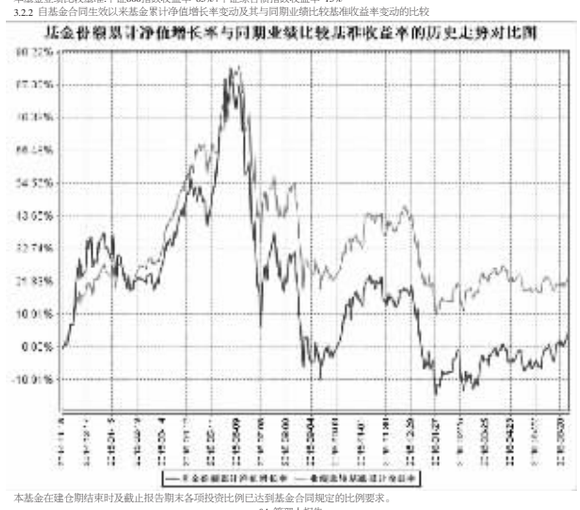
3.2 基金净值表现

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	6.93%	1.64%	-1.20%	1.00%	8.13%	0.64%

本基金业绩比较基准:中证800指数收益率*85%+中证综合债指数收益率*15%

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		
张勋	基金经理	2015年12月23日	-	10	管理学硕士;2006年7月至2009年6月就职于天相投资顾问有限公司,担任研究组长;2009年7月至2010年4月就职于东兴证券股份有限公司,担任研究组长;2010年4月加入泰达宏利基金管理有限公司,曾担任研究员、高级研究员,现任研究部副总监;具备10年证券从业经验,10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,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。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,2次涉及的投资组合一方均为按照量化策略进行投资,虽然买卖股票量少,但由于个股流动性较差,交易量小,致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%,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

二季度以来,经济持续平底,在供给侧改革的推进下,周期资源股在二季度表现活跃,市场估值中枢在重新修正中震荡,其间不乏结构性机会,基金操作运用合理适当的定量策略,积极应对大额申购、赎回和停复牌股票对组合跟踪误差带来的影响。同时基金在二季度积极应对市场剧烈波动带来的结构性机会,在合理控制跟踪误差的同时创造了4.88%的超额收益。

4.5 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0.9393元,本报告期份额净值增长率为4.44%,同期业绩比较基准增长率为-0.44%。

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	112,733,491.33	90.41
	其中:股票	112,733,491.33	90.41
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	9,610,806.42	7.71
8	其他资产	2,346,444.14	1.88
9	合计	124,690,741.89	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	4,848,218.00	3.92
B	采矿业	-	-
C	制造业	67,775,176.45	54.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	59,057.16	0.05
F	批发和零售业	15,022,564.60	12.13
G	交通运输、仓储和邮政业	5,838,687.00	4.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,834,452.16	10.37
J	金融业	3,846,026.56	3.11
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	13,417.40	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	2,495,892.00	2.02
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	112,733,491.33	91.05

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	000638	万方发展	265,840	6,287,116.00	5.08
2	000876	新希望	719,700	5,987,904.00	4.84
3	000028	国药一致	71,606	4,661,550.60	3.76
4	300031	宝通科技	181,600	4,634,432.00	3.74
5	002079	苏州固锝	390,900	4,366,353.00	3.53
6	002221	东华能源	334,200	4,073,898.00	3.29
7	300351	永贵电器	119,600	4,058,028.00	3.28
8	000911	南宁糖业	150,600	3,777,048.00	3.05
9	600718	东软集团	200,600	3,674,992.00	2.97
10	300314	戴维医疗	151,400	3,668,422.00	2.96

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1609	中证500股指期货IC1609合约	4	4,696,160.00	324,120.00	-
公允价值变动总额合计(元)					324,120.00
股指期货投资本期收益(元)					22,920.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					324,120.00

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

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	96,778.94
2	应收证券清算款	2,216,584.17
3	应收股利	-
4	应收利息	1,889.06
5	应收申购款	31,191.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,346,444.14

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000638	万方发展	6,287,116.00	5.08	重大事项
2	300351	永贵电器	4,058,028.00	3.28	重大事项

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

报告期期初基金份额总额	149,851,505.17
报告期期间基金总申购份额	7,414,153.56
减:报告期期间基金总赎回份额	14,031,650.66
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	143,234,008.07

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金设立的文件;

2、《泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金基金合同》;

3、《泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金托管协议》。

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
2016年7月19日

泰达宏利中证500指数分级证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016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
报告送出日期:2016年7月19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2016年7月15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2016年4月1日至2016年6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	64,903,571.91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,基金管理人将据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	
下属分级基金简称	泰达500A	泰达500B	泰达中证500
下属分级基金交易代码	150053	150054	162216
下属分级基金报告期末基金份额总额	5,897,464.00份	8,846,196.00份	50,159,911.91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(2016年4月1日 - 2016年6月30日)
1.本期已实现收益	217,924.07
2.本期利润	2,785,254.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0424
4.期末基金资产净值	60,964,787.72
5.期末基金份额净值	0.9393

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