# 泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金

## 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:中国建设银行股份有限公司**
**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。

基金托管人中国建设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 | 泰达宏利红利先锋混合 |
| 交易代码 | 162212 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年12月3日 |
| 报告期末基金份额总额 | 319,491,590.02份 |
| 投资目标 | 力争实现基金资产的长期稳定增值和基金的持续稳定分红。 |
| 投资策略 | 1.资产配置策略<br>基金投资股票资产的最低比例为基金资产的60%,最高为95%,投资于债券资产的比例最高为40%,最低为0%。<br>2.股票投资策略<br>本基金兼顾投资于具有持续分红特征及潜力的红利股和具有成长潜力特征的上市公司,其中投资于红利股的比例不低于基金股票资产的80%。红利股应具备本基金对红利股定量筛选标准中的一项或多项特征。<br>3.债券投资策略<br>对债券的投资将作为控制投资组合整体风险的重要手段之一,通过采用积极主动的投资策略,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,运用久期调整、凸度挖掘、信用分析、波动性交易、品种互换、回购套利等策略,权衡到期收益率与市场流动性,精选个券并构建和调整债券组合,在追求债券资产投资收益的同时兼顾流动性和安全性。<br>4.权证投资策略<br>本基金在确保与基金投资目标相一致的前提下,本着谨慎可控的原则,进行权证投资。 |
| 业绩比较基准 | 75%×标普中国A股红利机会指数收益率+25%×上证国债指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,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债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。 |
| 基金管理人 | 泰达宏利基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

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 | 1,573,864.50 |
| 2.本期利润 | 4,961,945.70 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0120 |
| 4.期末基金资产净值 | 363,908,167.46 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.139 |

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 | 1.54% | 1.81% | -1.02% | 0.78% | 2.56% | 1.03% |

本基金的业绩比较基准:75%×标普中国A股红利机会指数收益率+25%×上证国债指数收益率。

标普中国A股红利机会指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的具有高红利特征、营利能力和利润增长率稳定且具有一定规模及流动性的股票作为样本股,以股息率的最大化及覆盖个股与行业的多样化为标准,使用股息率作为加权指标构建的指数。它可以综合反映沪深证券市场中高股息股票的整体状况和走势,比较符合本基金的投资策略和投资方向。

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 | | |
| 邓艺颖 | 本基金基金经理 | 2015年4月3日 | - | 11 | 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任业务部职员;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、研究部副总监,现任投资副总监兼研究部总监;具备11年基金从业经验,11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 投资策略在报告期内的执行情况

回顾2季度,二级市场走势波动加大,结构性行情的特点非常明显。4月份,伴随着3月份和1季度经济数据的出台,市场对经济阶段性企稳回升的预期非常高,但同时也对通胀回升导致货币政策转向充满了担忧。与此同时,美联储的议息会议也使得市场提升对美国经济及其货币政策走向的关注,鸽派观点一出美元大幅走弱,进一步降低了6月美联储加息的预期;5月份,随着4月高频数据的跟踪以及监管机构对中概股借壳回归、上市公司并购等监管趋紧,同时叠加权威机构对经济增长的观点,使得市场风险偏好自期下降,并大幅降低了对经济持续走稳的预期,市场出现较大的调整;6月份,是投资者关注度最高的一个月份,这个月的投资大事件包括中国A股是否纳入MSCI新兴市场指数、美联储6月议息会议、英国脱欧公投、以及欧洲杯足球大赛。与此同时,6月底将是年中节点,万科A复牌等都将考验投资人的风险偏好。从市场表现来看,走势强于市场预期。即便是中国A股没有如期加入MSCI指数,以及英国意外脱欧等事件影响下,A股保持独立的结构性行情的特征。

我们的策略是坚持行业景气度比较和精选个股的配置思路,综合长期经济发展方向以及短期行业景气度排序,即具备行业景气度和产业链稀缺环节的新能源汽车产业链和基本面有行业竞争力的次新股,减少在行业和主题之间频繁的切换。

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1.139元,本报告期份额净值增长率为1.54%,同期业绩比较基准增长率为-1.02%。

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 | 315,785,935.30 | 75.03 |
| | 其中:股票 | 315,785,935.30 | 75.03 |
| 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 | 69,252,999.34 | 16.45 |
| 8 | 其他资产 | 35,864,780.82 | 8.52 |
| 9 | 合计 | 420,903,715.46 | 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

| 序号 | 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 | - | - |
| C | 制造业 | 230,955,475.16 | 63.47 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 230,998.64 | 0.06 |
| F | 批发和零售业 | 33,085,283.55 | 9.09 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 9,878,949.49 | 2.71 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,878,332.90 | 1.62 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 16,801,612.20 | 4.62 |
| L | 租赁和商务服务业 | 18,264,970.62 | 5.02 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 18,288.10 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 672,024.64 | 0.18 |
| 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 | 315,785,935.30 | 86.78 |

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 | 784,653 | 18,557,043.45 | 5.10 |
| 2 | 002127 | 南极电商 | 1,896,674 | 18,264,970.62 | 5.02 |
| 3 | 300507 | 苏奥传感 | 113,524 | 17,911,816.72 | 4.92 |
| 4 | 000718 | 苏宁环球 | 1,695,420 | 16,801,612.20 | 4.62 |
| 5 | 603799 | 华友钴业 | 423,654 | 15,759,928.80 | 4.33 |
| 6 | 300073 | 当升科技 | 229,564 | 15,367,014.16 | 4.22 |
| 7 | 600576 | 万家文化 | 667,045 | 14,528,240.10 | 3.99 |
| 8 | 603528 | 多伦科技 | 138,012 | 13,523,795.88 | 3.72 |
| 9 | 002418 | 康盛股份 | 1,253,538 | 13,237,361.28 | 3.64 |
| 10 | 002664 | 信质电机 | 386,587 | 13,151,689.74 | 3.61 |

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

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

本基金本报告期末无国债期货投资。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交易情况说明

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 | 537,039.91 |
| 2 | 应收证券清算款 | 35,257,953.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 11,719.22 |
| 5 | 应收申购款 | 58,068.69 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 35,864,780.82 |

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 | 18,557,043.45 | 5.10 | 重大事项 |
| 2 | 002127 | 南极电商 | 18,264,970.62 | 5.02 | 重大事项 |
| 3 | 300507 | 苏奥传感 | 17,911,816.72 | 4.92 | 重大事项 |
| 4 | 000718 | 苏宁环球 | 16,801,612.20 | 4.62 | 重大事项 |
| 5 | 600576 | 万家文化 | 14,528,240.10 | 3.99 | 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 | 397,814,393.71 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 99,772,200.56 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 178,095,004.25 |
| 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 | 319,491,590.02 |

§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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金管理人持有的本基金份额 | 5,475,903.61 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 5,475,903.61 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 1.71 |

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新增投资本基金。

§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红利先锋混合型证券投资基金设立的文件;

2、《泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金基金合同》;

3、《泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《泰达宏利红利先锋混合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

基金投资者也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》)或登录本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

# 泰达宏利行业精选混合型证券投资基金

## 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 | 泰达宏利行业混合 |
| 交易代码 | 162204 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2004年7月9日 |
| 报告期末基金份额总额 | 168,686,387.89份 |
| 投资目标 | 追求资本的长期持续增值,为投资者寻求高于业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 全面引进荷兰银行的投资管理流程,采用"自上而下"资产配置和行业类别与行业配置,"自下而上"精选股票的投资策略,主要投资于具有国际、国内竞争力比较优势和长期增值潜力的行业和企业的股票。 |
| 业绩比较基准 | 70%×富时中国A600指数收益率+30%×中债国债总指数(财富) |
| 风险收益特征 | 本基金在证券投资基金中属于风险较高的基金品种 |
| 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 |

§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 | -22,687,500.16 |
| 2.本期利润 | 35,800,418.15 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2106 |
| 4.期末基金资产净值 | 524,844,023.01 |
| 5.期末基金份额净值 | 3.1114 |

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 | 7.26% | 1.62% | -2.19% | 0.78% | 9.45% | 0.84% |

本基金业绩比较基准:70%×富时中国A600指数收益率+30%×中债国债总指数(财富)。

富时中国A600指数是富时指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所总市值最大的600只股票并以流通股本加权的股票指数,具有良好的市场代表性。

中债国债总指数(财富)是中央国债登记结算有限责任公司推出的中国国债总指数,该指数系基于全市场角度编制的指数,价格选取上更侧重于全国银行间债券市场,选择了泛、全面而细致反映债券市场变动。

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 | | |
| 陈丹琳 | 本基金基金经理 | 2015年4月3日 | - | 9 | 毕业于中国人民大学,经济学硕士,CFA、CPA;2007年7月加入泰达宏利基金管理有限公司,曾担任研究员、研究主管、研究部总经理助理等职务;具备9年证券投资管理经验,9年基金从业经验,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,经济持续寻底,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。

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1.0527元,本报告期份额净值增长率为-1.68%,同期业绩比较基准增长率为-1.38%。

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 | 433,846,509.15 | 82.15 |
| | 其中:股票 | 433,846,509.15 | 82.15 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 26,011,624.70 | 4.93 |
| | 其中:债券 | 26,011,624.70 | 4.93 |
| | 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 | 51,251,431.14 | 9.70 |
| 8 | 其他资产 | 16,986,033.45 | 3.22 |
| 9 | 合计 | 528,095,598.44 | 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

| 序号 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 27,221,421.06 | 5.19 |
| B | 采矿业 | 5,175,962.82 | 0.99 |
| C | 制造业 | 354,448,310.61 | 67.53 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 485,994.07 | 0.09 |
| F | 批发和零售业 | 15,801,913.05 | 3.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 25,762,706.40 | 4.91 |
| J | 金融业 | 218,011.95 | 0.04 |
| 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 | 136,807.85 | 0.03 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 4,275,404.00 | 0.81 |
| 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 | 276,808.34 | 0.05 |
| S | 综合 | 43,169.00 | 0.01 |
| | 合计 | 433,846,509.15 | 82.66 |

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 | 600570 | 恒生电子 | 350,700 | 23,416,239.00 | 4.46 |
| 2 | 300073 | 当升科技 | 338,403 | 22,652,696.82 | 4.32 |
| 3 | 603601 | 再升科技 | 467,710 | 22,510,882.30 | 4.29 |
| 4 | 002079 | 苏州固锝 | 1,817,800 | 20,304,826.00 | 3.87 |
| 5 | 000911 | 南宁糖业 | 751,077 | 18,837,011.16 | 3.59 |
| 6 | 002108 | 沧州明珠 | 721,863 | 18,696,251.70 | 3.56 |
| 7 | 600584 | 长电科技 | 824,700 | 16,733,163.00 | 3.19 |
| 8 | 300503 | 昊志机电 | 188,313 | 15,953,877.36 | 3.04 |
| 9 | 000638 | 万方发展 | 668,157 | 15,801,913.05 | 3.01 |
| 10 | 600667 | 太极实业 | 1,579,300 | 15,777,207.00 | 3.01 |

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 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 23,350,327.00 | 4.45 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债(可交换债) | 2,661,297.70 | 0.51 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 26,011,624.70 | 4.96 |

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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 010303 | 03国债(3) | 121,100 | 12,542,327.00 | 2.39 |
| 2 | 010107 | 21国债(7) | 100,000 | 10,808,000.00 | 2.06 |
| 3 | 110031 | 航信转债 | 24,130 | 2,661,297.70 | 0.51 |

注:上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。

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 | 477,609.33 |
| 2 | 应收证券清算款 | 16,191,803.03 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 270,544.79 |
| 5 | 应收申购款 | 46,076.30 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 16,986,033.45 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 110031 | 航信转债 | 2,661,297.70 | 0.51 |

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 | 300503 | 昊志机电 | 15,953,877.36 | 3.04 | 重大事项 |
| 2 | 000638 | 万方发展 | 15,801,913.05 | 3.01 | 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 | 172,322,875.88 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,020,651.80 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 6,657,139.79 |
| 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 | 168,686,387.89 |

§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行业精选混合型证券投资基金设立的文件;

2、《泰达宏利行业精选混合型证券投资基金基金合同》;

3、《泰达宏利行业精选混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《泰达宏利行业精选混合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

# 泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

## 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 | 832,721,572.51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预定范围内。 |
| 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 |

§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 | -225,540.83 |
| 2.本期利润 | 545,508.33 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0061 |
| 4.期末基金资产净值 | 876,605,650.48 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0527 |

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 | -1.68% | 0.81% | -1.38% | 0.74% |