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

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	泰达改革动力混合
交易代码	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
报告期末基金份额总额	760,657,537.51份
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
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	115,229,570.61
2.本期利润	90,604,139.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.1353
4.期末基金资产净值	1,002,808,557.33
5.期末基金份额净值	1.318

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	10.39%	1.53%	-0.72%	0.51%	11.11%	1.02%

本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%

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		
刘欣	本基金基金经理	2015年2月13日	-	9	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,曾担任产品与金融工程部高级研究员、金融工程部副总经理,现担任金融工程部总经理;具备9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。

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据统计、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,同日反向交易或交收净额交易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次涉及投资组合一方均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年二季度,A股市场呈现震荡上盘格局,经过一季度市场大幅波动后,二季度市场情绪开始逐渐恢复,包括新能源汽车、有色金属等板块均有可观的涨幅,主观层面,部分经济指标开始出现企稳迹象,在此背景下,整体市场出现幅度可观的反弹,其中新兴行业股票价格反弹幅度较大。

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,同时兼顾企业自身的成长性和基本面特征。

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1.318元,本报告期份额净值增长率为10.39%,同期业绩比较基准增长率为-0.72%。

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	865,599,999.71	85.59
	其中:股票	865,599,999.71	85.59
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	109,789,519.25	10.86
8	其他资产	35,903,455.55	3.55
9	合计	1,011,292,974.51	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	19,362,429.70	1.93
B	采矿业	4,896,048.00	0.49
C	制造业	468,408,530.51	46.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,668,029.32	1.96
E	建筑业	32,972,612.42	3.29
F	批发和零售业	48,104,623.95	4.80
G	交通运输、仓储和邮政业	5,216,795.55	0.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	61,845,007.51	6.17
J	金融业	126,032,764.48	12.57
K	房地产业	30,401,478.31	3.03
L	租赁和商务服务业	9,705,086.74	0.97
M	科学研究和技术服务业	4,642,278.72	0.46
N	水利、环境和公共设施管理业	880,225.00	0.09
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	21,524,700.46	2.15
S	综合	11,939,389.04	1.19
	合计	865,599,999.71	86.32

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	002247	帝龙新材	700,985	10,423,646.95	1.04
2	300042	朗科科技	301,870	10,290,748.30	1.03
3	300209	天泽信息	405,301	10,233,850.25	1.02
4	002468	艾迪西	353,431	10,115,195.22	1.01
5	601211	国泰君安	566,858	10,084,403.82	1.01
6	002025	航天电器	407,136	10,052,187.84	1.00
7	600505	西昌电力	1,121,971	10,007,981.32	1.00
8	300383	光环新网	264,021	10,006,395.90	1.00
9	300194	福安药业	462,088	10,004,205.20	1.00
10	600148	长春一东	453,778	9,996,729.34	1.00

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掘益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和掘益明细。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未设置于股指期货、该策略符合基金合同的规定。

5.10 报告期末本基金投资于国债期货的投资情况说明

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掘益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和掘益明细。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

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	12,863,638.41
2	应收证券清算款	22,590,712.78
3	应收股利	-
4	应收利息	22,989.57
5	应收申购款	426,114.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,903,455.55

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

本基金本报告期末前十名股票中存在流通受限情况。

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	623,702,395.26
报告期期间基金总申购份额	195,349,702.18
减:报告期期间基金总赎回份额	58,394,559.93
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	760,657,537.51

§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改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

2.《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》;

3.《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招募说明书》;

4.《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

泰达宏利复兴伟业灵活配置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	泰达宏利复兴混合
交易代码	001170
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月21日
报告期末基金份额总额	1,352,876,361.12份
投资目标	本基金紧跟新常态下国民经济发展过程中复兴伟业相关行业的投资机遇,基于大类资产配置策略,力争为投资者创造高于业绩比较基准的收益率。
投资策略	本基金紧跟新常态下国民经济发展过程中复兴伟业相关行业的投资机遇,结合国内外宏观经济发展趋势及各行业的发展前景,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	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,具有较高预期风险、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。
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	3,829,912.16
2.本期利润	49,923,413.18
3.加权平均基金份额本期利润	0.0360
4.期末基金资产净值	987,592,584.67
5.期末基金份额净值	0.730

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。

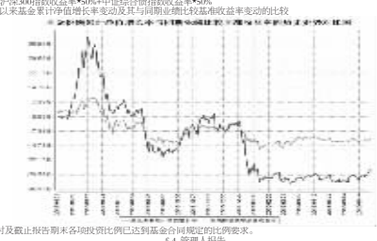
3.2 基金净值表现

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	5.34%	1.28%	-0.72%	0.51%	6.06%	0.77%

本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%

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		
吴华	本基金基金经理	2015年4月21日	-	12	金融学硕士:2004年6月至2006年3月就职于易方达基金管理有限公司,担任宏观策略分析员职务;2006年4月至2011年4月就职于中国国际金融有限公司,先后就职于研究部、资产管理部,担任经理、副总经理等职位;2011年5月加入泰达宏利基金管理有限公司;具备12年证券从业经验,12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据统计、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,同日反向交易或交收净额交易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年二季度,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,美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,实体经济表现良好,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,美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,经济呈弱企稳迹象。二季度工业需求前景仍没有大幅改善,工业增加值增速较一季度没有大大改观,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同好。固定资产投资增速出现下滑,房地产销售火爆,但对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,央行继续采取了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的二次实施未给季末资金面以太大扰动,利率中枢在二季度维持相对稳定。

债券市场呈现熊牛格局,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美国退欧事件的影响,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,但政策率存在一定波动风险,同时信用风险事件频发,进的主体的性质和行业越发分散化,我们适当降低了债券杠杆并维持中短久期,精选信用债,严防信用风险事件,从资产轮动的角度考虑,我们维持了较低的转债仓位,较高的利率债仓位,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

聚利(转型后)

截止报告期末,本基金份额净值为1.009元,本报告期份额净值增长率为0.90%,同期业绩比较基准增长率为-0.18%。

聚利(转型前)

截止2016年5月13日,本基金份额净值为1.521元,本报告期份额净值增长率为-0.50%,同期业绩比较基准增长率为-1.84%。

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

转型后:

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	7,540,411.15	0.44
	其中:股票	7,540,411.15	0.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,667,887,067.80	97.75
	其中:债券	1,667,887,067.80	97.75
	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	3,846,472.51	0.23
8	其他资产	27,065,907.79	1.59
9	合计	1,706,339,859.25	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,324,320.00	0.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,195,171.15	0.23
E	建筑业	20,920.00	0.00
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,540,411.15	0.54

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	002521	齐峰新材	378,000	4,324,320.00	0.31
2	600023	浙能电力	627,735	3,195,171.15	0.23
3	601611	中国核建	1,000	20,920.00	0.00

注:以上为本基金本报告期末持有的全部股票投资。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	503,995,000.00	36.08
	其中:政策性金融债	503,995,000.00	36.08
4	企业债券	600,691,167.80	43.00
5	企业短期融资券	346,558,600.00	24.81
6	中期票据	214,570,000.00	15.36
7	可转债(可交换债)	2,072,300.00	0.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,667,887,067.80	119.40

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	160402	16农发02	2,000,000	199,440,000.00	14.28
2	150314	15进出14	1,000,000	103,930,000.00	7.44
3	011699696	16新兴际华SCP003	1,000,000	100,160,000.00	7.17
4	160414	16农发14	1,000,000	100,020,000.00	7.16
5	011698014	16中车SCP002	1,000,000	99,970,000.00	7.16

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掘益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和掘益明细。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

在本报告期内,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

在本报告期内,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掘益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和掘益明细。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末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	42,170.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,987,741.71
5	应收申购款	6,855.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	29,140.31
8	其他	-
9	合计	27,065,907.79

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	601611	中国核建	20,920.00	0.00	临时停牌

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。

转型前:

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	15,832,595.00	0.66
	其中:股票	15,832,595.00	0.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,017,441,989.00	83.78
	其中:债券	2,017,441,989.00	83.78
	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	325,000,762.50	13.50
	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	5,892,470.54	0.24
8	其他资产	43,786,566.24	1.82
9	合计	2,407,954,383.28	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	23,595.00	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,325,000.00	0.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,484,000.00	0.48
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	15,832,595.00	0.66

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	002462	嘉事堂	1,241,207	46,234,960.75	4.68
2	002221	东华能源	3,589,363	43,754,334.97	4.43
3	002043	兔宝宝	4,316,909	43,298,597.27	4.38
4	600556	慧球科技	2,629,186	42,566,521.34	4.31
5	300365	恒华科技	833,653	38,139,624.75	3.86
6	600340	华夏幸福	1,469,568	35,828,067.84	3.63
7	002007	华兰生物	1,131,460	35,527,844.00	3.60
8	300017	网宿科技	460,400	30,938,880.00	3.13
9	000568	泸州老窖	1,033,372	30,691,148.40	3.11
10	000333	美的集团	1,071,348	25,412,374.56	2.57

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	39,996,000.00	4.05
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	39,996,000.00	4.05

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	019515	15国债15	400,000	39,996,000.00	4.05

注:以上为本基金本报告期末持有的全部债券投资。

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掘益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和掘益明细。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未设置于股指期货、该策略符合基金合同的规定。

5.10 报告期末本基金投资于国债期货的投资情况说明

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掘益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和掘益明细。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

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	41,081.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	43,745,485.00
5	应收申购款	-
6