泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金

2017 第四季度 报告

2017年12月31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:2018年1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2018年1月17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2017年10月1日至2017年12月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利增利混合
交易代码	001568
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年6月30日
报告期末基金份额总额	81,105,954.26份
投资目标	在严格控制风险及保持流动性基础上,力求实现基金财产持续稳定增值的目标
投资策略	本基金将采取主动的资产配置策略,注重风险与收益的平衡。本基金将精选具有较高投资价值的股票和债券,力求实现基金资产的长期稳定增长
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,其预期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(2017年10月1日—2017年12月31日)
1.本期已实现收益	-11,094,719.21
2.本期利润	-17,606,991.91
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0508
4.期末基金资产净值	78,515,880.60
5.期末基金份额净值	0.968

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.本财务报表的实际编制期间为2017年10月1日至2017年12月29日(基金最后运作日)。

3.2 基金净值表现

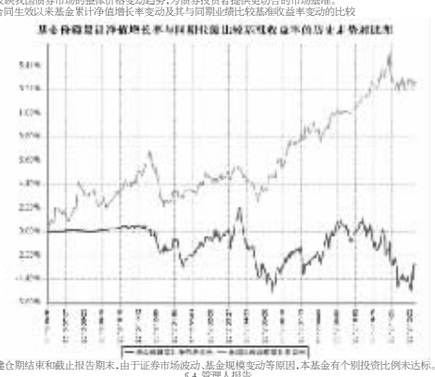
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-3.01%	0.64%	2.31%	0.41%	-5.32%	0.23%

注: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%。

沪深300指数是由中证指数有限公司编制,从上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本的综合性指数,具有良好的市场代表性。中证综合债券指数由中证指数有限公司编制,是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数,较全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势,为债券投资者提供更切合的市场基准。

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



注:本基金在建仓期结束和截止报告期末,由于证券市场波动,基金规模变动等原因,本基金有个别投资比例未达标。

§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		
张助	本基金基金经理;研究部副总监	2016年6月30日	2017年12月29日	11	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11年证券从业经验,11年证券投资管理经验,具有基金从业资格。
庞宝臣	本基金基金经理	2016年9月26日	2017年12月29日	11	理学硕士:2006年7月至2011年8月,任职于永安期产保险股份有限公司,担任投资经理,负责债券研究与投资工作;2011年9月至2012年8月,任职于幸福人寿保险股份有限公司,担任高级经理,固定收益投资总负责人,负责债券投资工作;2012年9月至2014年9月,任职于中华联合保险股份有限公司投资管理部,担任高级主管一职;2014年9月至2016年3月7日,任职于中华联合保险控股股份有限公司,担任投资经理一职;2016年3月10日加入泰达宏利基金管理有限公司,曾任固定收益部基金经理助理一职,现任基金经理;具备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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定,表中的任职日期指公司相关公告中披露的日期,离任日期指本基金最后运作日。

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,未发现利益输送、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。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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,海外经济延续复苏,主要指标向好,通胀温和回升,美联储如期加息、川普减税法案通过,市场维持较高的风险偏好,美元指数触底,无风险利率水平小幅提高,得益于外需的持续改善,国内出口相对强劲,对冲了环保限产的负面影响,国内经济维持平稳,物价水平温和提高,工业企业利润增速维持高位。

股票市场方面,股票市场历经了,A股市场冲高回落,走势再次分化,显气回升、业绩增长驱动的保险、食品饮料、家电、航空等板块震荡上行而以创业板指为代表的小盘投资多方面因素扰动转向下跌,受资金趋紧、季节性等因素影响,市场整体活跃度明显回落,市场成交明显收缩。

债券市场方面,稳定的基本面环境为政策结构性调整提供了空间,报告期内,监管政策趋严,货币政策中性偏紧,货币市场利率稳步抬升,资产供给持续回落,社会融资规模维持高位,供需失衡导致债券市场发生较大的调整,收益率曲线整体平坦化上行;信用债信用利差走阔,低等级以及民企受流动性等因素影响,冲击更为明显。

报告期内,股票投资方面,考虑到产品将在12月开放可能涉及到申购赎回问题,未新增非公开发行股票仓位;股票操作以打新底仓和他对收益角度为主,主要配置金融及部分超跌个股,截止报告日,股票仓位仅余限售部分。债券组合方面,我们认为在防范金融风险的政策导向下,金融机构适应监管、调整报表结构的需求相对刚性,债市资金供给阶段性处于弱势,虽然债券估值水平具备较高配置价值,但获取资本利得的机会较少;基于市场情况,本基金操作上以流动性管理为主,债券仓位维持低位。12月25日~29日为本基金首个开放期,开放期最后一日日终基金资产净值低于2亿元,根据基金合同约定,无需召开基金份额持有人大会,基金合同终止并进入基金财产清算程序。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.968元;本报告期基金份额净值增长率为-3.01%,业绩比较基准收益率为2.31%。

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	75,808,950.21	84.67
	其中:股票	75,808,950.21	84.67
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	13,688,323.16	15.29
8	其他资产	41,709.41	0.05
9	合计	89,538,982.78	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	57,989,791.90	73.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	5,005,312.50	6.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,596,075.95	10.95
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	4,217,769.86	5.37
	合计	75,808,950.21	96.55

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	600579	天华院	2,720,000	37,821,600.00	48.17
2	600416	湘电股份	1,417,004	16,408,906.32	20.90
3	002298	中电鹿龙	1,014,885	8,596,075.95	10.95
4	000900	现代投资	800,850	5,005,312.50	6.37
5	600200	江苏吴中	393,082	4,217,769.86	5.37
6	002494	华斯股份	309,023	2,453,642.62	3.13
7	002303	美盈森	198,728	1,305,642.96	1.66

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金在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	31,962.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,746.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,709.41

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	600579	天华院	18,482,400.00	23.54	非公开发行
2	600416	湘电股份	16,408,906.32	20.90	非公开发行
3	002298	中电鹿龙	8,596,075.95	10.95	非公开发行
4	000900	现代投资	5,005,312.50	6.37	重大事项
5	600200	江苏吴中	4,217,769.86	5.37	非公开发行
6	002494	华斯股份	2,453,642.62	3.13	非公开发行
7	002303	美盈森	1,305,642.96	1.66	非公开发行

注:其中天华院非流通受限部分的公允价值为19,339,200.00元,占基金资产净值比例24.63%。

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

报告期初基金份额总额	364,476,184.13
报告期间申购基金总申购份额	52,109,661.06
减:报告期间赎回基金总赎回份额	335,479,890.93
报告期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	81,105,954.26

§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

报告期期初基金份额总额	0.00
报告期间买入/申购总份额	52,082,291.67
报告期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期末持有的本基金份额	52,082,291.67
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	64.22

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2017年12月27日	52,082,291.67	50,000,000.00	0.00%
合计			52,082,291.67	50,000,000.00	

1、本基金管理人投资本基金时所适用的费率为本基金合同中约定的费率;

2、根据本基金合同,本次申购适用费率为固定费用1000元。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20171027-20171231	0.00	52,082,291.67	0.00	52,082,291.67	64.22%
产品持有风险							
报告期内,本基金在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情况,易发生巨额赎回的情况,存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险,以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

注:报告期内,申购份额含红利再投资份额。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金2017年12月25至2017年12月29日为开放期,在开放期最后一日日终基金资产净值低于2亿元,已触发了基金合同终止条款,为维护基金份额持有人利益,根据本基金基金合同约定,无需召开基金份额持有人大会,本基金管理人应终止基金合同并依法履行基金财产清算程序,本基金于2017年12月30日起已进入清盘程序,详情请见基金管理人自2017年12月21日起陆续发布的《泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金开放申购、赎回业务的公告》、《关于泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告》、《关于泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金基金合同终止及财产清算的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金设立的文件;

2、《泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金基金合同》;

3、《泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金托管协议》;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 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
2018年1月19日

泰达宏利中证500指数分级证券投资基金

2017 第四季度 报告

2017年12月31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:2018年1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2018年1月17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2017年10月1日至2017年12月31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	281,426,943.83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,基金管理人将搭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		
下属分级基金的基金简称	泰达500A	泰达500B	泰达中证500
下属分级基金的交易代码	150053	150054	162216
报告期末下属分级基金的份额总额	3,025,876.00份	4,538,814.00份	273,862,253.83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(2017年10月1日—2017年12月31日)
1.本期已实现收益	13,381,389.29
2.本期利润	-3,103,992.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0111
4.期末基金资产净值	297,209,342.16
5.期末基金份额净值	1.0561

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	-1.07%	0.93%	-5.05%	0.93%	3.98%	0.00%

注:本基金的业绩比较基准:中证500指数收益率*95%+1年期定期存款利率*5%。

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		
杨超	本基金基金经理	2014年10月13日	-	7	毕业于英国威尔士阿旺西大学。数学与金融计算硕士,2010年5月加入建信基金管理有限公司,从事金融工程等工作,先后担任投资管理部助理研究员、初级研究员、基金经理助理等职务,2014年6月加入泰达宏利基金管理有限公司,担任基金经理助理,现任基金经理,具备7年证券基金从业经验,7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,未发现利益输送、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。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 报告期内基金投资策略和运作分析

进入四季度,市场风格加速分化,白马股表现抢眼,中小创持续低迷,周期股收益回落明显,本基金恪守基金合同,运用适当策略,基金控制跟踪误差,并获得了一定超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0561元;本报告期基金份额净值增长率为-1.07%,业绩比较基准收益率为-5.05%。

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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	279,541,810.43	93.68
	其中:股票	279,541,810.43	93.68
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	18,703,517.29	6.27
8	其他资产	166,201.68	0.06
9	合计	298,411,529.40	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	419,220.00	0.14
B	采矿业	7,026,749.00	2.36
C	制造业	152,959,544.91	51.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,597,730.00	1.88
E	建筑业	3,887,759.00	1.31
F	批发和零售业	24,641,637.97	8.29
G	交通运输、仓储和邮政业	6,432,622.08	2.16
H	住宿和餐饮业	169,199.60	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,588,527.84	7.94
J	金融业	3,306,925.00	1.11
K	房地产业	14,853,365.94	5.00
L	租赁和商务服务业	2,786,498.00	0.94
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,441,355.00	1.49
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	4,105,397.00	1.38
S	综合	-	-
	合计	254,216,531.34	85.53

5.2.2 报告期末积极投资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	2,810,905.08	0.95
B	采掘业	-	-
C	制造业	15,635,871.33	5.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	139,304.20	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,448,892.00	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	3,652,895.73	1.23
H	住宿和餐饮业	36,512.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	134,363.55	0.05
J	金融业	-	-
K	房地产业	726,740.00	0.24
L	租赁和商务服务业	707,472.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.01
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	25,325,279.09	8.52

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	600516	方大炭素	179,900	5,195,512.00	1.75
2	600201	生物股份	154,500	4,903,830.00	1.65
3	002340	格林美	599,100	4,307,529.00	1.45
4	000050	深天马A	206,929	4,078,570.59	1.37
5	600392	盛和资源	212,200	4,031,800.00	1.36
6	300266	兴源环境	146,300	3,950,100.00	1.33
7	002078	太阳纸业	424,700	3,941,216.00	1.33
8	000977	浪潮信息	198,000	3,936,240.00	1.32
9	600970	中材国际	393,100	3,887,759.00	1.31
10	000418	小天鹅A	56,800	3,853,880.00	1.30

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600219	南山铝业	808,500	2,975,280.00	1.00
2	002468	申通快递	119,317	2,945,936.73	0.99
3	600467	好当家	903,828	2,810,905.08	0.95
4	600362	江西铜业	109,100	2,200,547.00	0.74
5	600010	包钢股份	878,400	2,160,864.00	0.73

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

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

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

本基金本报告期没有投资国债期货。

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	24,344.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,677.24
5	应收申购款	138,179.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	166,201.68

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	600516	方大炭素	5,195,512.00	1.75	非公开发行
2	600201	生物股份	4,903,830.00	1.65	非公开发行
3	002340	格林美	4,307,529.00	1.45	非公开发行
4	000050	深天马A	4,078,570.59	1.37	非公开发行
5	600392	盛和资源	4,031,800.00	1.36	非公开发行
6	300266	兴源环境	3,950,100.00	1.33	非公开发行
7	002078	太阳纸业	3,941,216.00	1.33	非公开发行
8	000977	浪潮信息	3,936,240.00	1.32	非公开发行
9	600970	中材国际	3,887,759.00	1.31	非公开发行
10	000418	小天鹅A	3,853,880.00	1.30	非公开发行

5.11.6 报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.7 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.8 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

项目	泰达500A	泰达500B	泰达中证500
报告期期初基金份额总额	3,329,148.00	4,993,722.00	269,975,913.55
报告期间申