泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

2019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:华夏银行股份有限公司
送出日期:2019年8月24日

§1 重要提示

1.1 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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月22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2019年1月1日起至2019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	泰达宏利创益混合	
基金主代码	001418	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年6月16日	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	158,757,683.23份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	泰达宏利创益混合A	泰达宏利创益混合B
下属分级基金的交易代码:	001418	002273
报告期末下属分级基金的份额总额	151,017,745.15份	7,739,938.08份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金紧跟新常态下我国经济发展转型过程中各类投资机遇,基于大类资产配置策略,力争为投资者创造稳定的较高投资收益。
投资策略	本基金紧跟新常态下国民经济发展过程中各类投资机遇,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	中证全债指数收益率+2%
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。

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	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	聂志刚	郑鹏
	联系电话	010-66577678	010-85238667
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	zhengpeng@hxb.com.cn
客户服务电话		400-698-8888	95577
传真		010-66577666	010-85238680

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	基金管理人及基金托管人住所

§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

基金级别	泰达宏利创益混合A	泰达宏利创益混合B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	24,228,026.06	32,696.63
本期利润	31,570,463.76	164,436.31
加权平均基金份额本期利润	0.2064	0.3187
本期基金份额净值增长率	16.81%	16.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.3134	0.3132
期末基金资产净值	198,346,374.85	10,164,436.31
期末基金份额净值	1.313	1.313

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.期末可供分配利润等于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

泰达宏利创益混合A

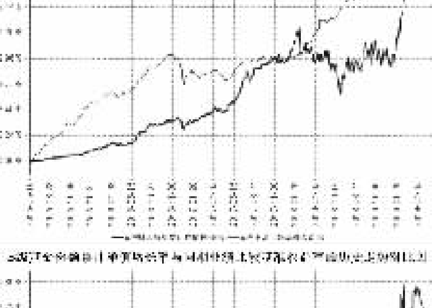
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.10%	0.29%	0.73%	0.03%	1.37%	0.26%
过去三个月	2.50%	0.31%	1.13%	0.07%	1.37%	0.24%
过去六个月	16.81%	0.68%	3.07%	0.07%	13.74%	0.61%
过去一年	19.58%	0.59%	8.59%	0.07%	10.99%	0.52%
过去三年	27.60%	0.38%	17.93%	0.08%	9.67%	0.30%
自基金合同生效起至今	31.30%	0.33%	29.26%	0.08%	2.04%	0.25%

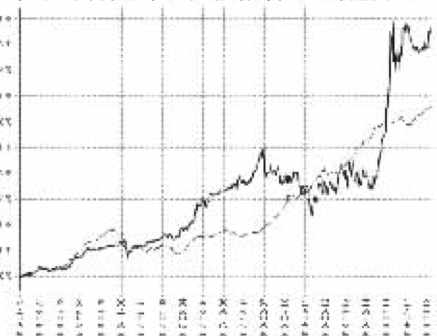
泰达宏利创益混合B

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	2.10%	0.28%	0.73%	0.03%	1.37%	0.25%
过去三个月	2.50%	0.31%	1.13%	0.07%	1.37%	0.24%
过去六个月	16.81%	0.68%	3.07%	0.07%	13.74%	0.61%
过去一年	19.58%	0.59%	8.59%	0.07%	10.99%	0.52%
过去三年	27.60%	0.38%	17.93%	0.08%	9.67%	0.30%
自基金合同生效起至今	29.62%	0.36%	20.34%	0.08%	9.28%	0.28%

注:本基金的业绩比较基准:中证全债指数收益率+2%

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





注:本基金A类份额成立于2015年6月16日,B类份额成立于2016年1月25日。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:天津市泰达国际控股(集团)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基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基金、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、泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金、泰达宏利沪深300指数增强型证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)、泰达宏利中证500指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利宏达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型证券投资基金、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、泰达宏利活期友货币市场基金、泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利汇利债券型证券投资基金、泰达宏利量化增强股票型证券投资基金、泰达宏利定宏混合型证券投资基金、泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利亚洲债券型证券投资基金、泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利京元宝货币市场基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利溢利债券型证券投资基金、泰达宏利恒利债券型证券投资基金、泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启富灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金、泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金、泰达宏利全能优选混合型基金中基金(FOF)、泰达宏利交利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利金利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利泽利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利泰和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)、泰达宏利印度机会股票型证券投资基金(QDII)、泰达宏利年年添利定期开放债券型证券投资基金在内的五十多只证券投资基金。

本公司采用团队投资方式,即通过整个投资团队全体人员的共同努力,力求实现基金财产的持续增值。

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		
傅浩	本基金基金经理	2017年3月6日	-	12	华中科技大学理学硕士;2007年7月至2011年8月,任职于东兴证券研究所,担任固定收益研究员;2011年8月至2013年4月,任职于中邮证券有限责任公司,担任投资主办人;2013年5月至2014年4月,任职于民生证券股份有限公司,担任投资经理;2014年5月至2016年11月,任职于中加基金管理有限公司,担任投资经理;2016年11月加入泰达宏利基金管理有限公司,先后担任固定收益部基金经理助理、基金经理等职;具备12年证券投资管理经验,具有基金从业资格。
张勋	基金经理助理;研究部副总监	2017年7月25日	-	13	对外经济贸易大学管理学硕士;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,现任研究部副总监兼基金经理。具备13年证券从业经验,13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 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,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。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

2019年上半年,在结构上,以白酒、家电行业为代表的高盈利龙头企业上涨较多,整体行情呈现一定的二八现象。而在其他股票中,农业、5G等景气度较高的细分行业有较大幅度上涨。重组预期股票在2月份表现很好,之后回归平淡。从整体看,市场依旧延续我们之前认为的机构投资者增加驱动绩优股的逻辑运行.

组合配置上,去年四季度我们重仓配置券商和非银金融,作为混合类基金今年以来整体绝对收益已经超越了15%,二季度开始我们选择了减轻仓位,在并不存在长期牛市的预判下,适时撤出一些仓位,使得净值保持平稳更有利于持有人的利益。从战略方向考虑,目前面临的是科创板的开市,积极准备赚取新的制度红利是三季度重点着手准备的事情。

本基金在选股操作中,投资风格兼顾成长确定、估值合理、低波动率,和估值低、基本面稳健、存在改善预期的蓝筹股。从结构上分散由于市场风格大幅波动造成的风险。本报告期内,本基金增加了石油石化、汽车、银行的配置,减少了机械、非银行金融的配置。

债券方面定向降准吹响了主动性宽松的最后号角,一季度快速降低久期,躲过了股票以及一季度数据突变的冲击,二季度由于风险偏好的下降,已经逐步展开的经济数据的证伪,我们开始拉长久期赚取债券这方面超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达宏利创益混合A基金份额净值为1.313元,本报告期基金份额净值增长率为16.81%;截至本报告期末泰达宏利创益混合B基金份额净值为1.313元,本报告期基金份额净值增长率为16.81%;同期业绩比较基准收益率为3.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,我们延续与前几个季度相同的观点,从中短期看,国内对并购重组的松绑政策可能会对中期市场风格产生一定影响,小型公司的壳价值可能再度显现,值得关注。叠加科创板可能在2个月内开板的影响,未来不排除A股在风格上呈现一些短期改变,即成长风格和中小股票出现优势,甚至不排除出现绩优蓝筹与小盘重组双头部的格局。

基于基金合同与投资观点,我们的配置偏向于具有真实业绩成长且估值合理的股票。本基金在持仓上相对分散,以平衡组合风险。股票将继续保持估值择低的轮动策变,以稳为主,下半年重点选择方向就是权益仓位净值贡献平稳,最大可能赚取新股红利。

看债券市场,我们认为经济处于"支柱产业结构调整期"的观点没有变化,债券市场逆转也是不太能实现的形态。二季度短暂冲击之后,必然对应着下行修复行情。拉长久期坐享收益。在个券选择上依旧倾向于骑乘收益率最佳的点位介入。

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基金运营的副总经理担任主任,成员包括但不限于督察长、主管投研的副总经理或投资总监、基金投资部、研究部、金融工程部、固定收益部、合规风控部门、基金运营部的主要负责人;委员会秘书由基金运营部负责人担任。所有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

报告期内,本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面,能够遵守有关法律法规,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

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

托管人认为,由基金管理人编制并经托管人复核的本基金2019年半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§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:泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:		
银行存款	144,167.75	3,807,118.34
结算备付金	1,489,802.89	93,908.61
存出保证金	179,620.33	28,210.12
交易性金融资产	202,011,460.42	202,882,669.51
其中:股票投资	66,126,843.62	79,730,869.51
基金投资	-	-
债券投资	135,884,616.80	123,151,800.00
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	999,023.33	-
应收利息	2,025,655.95	2,926,853.31
应收股利	-	-
应收申购款	8,009,040.86	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	214,858,771.53	209,738,759.89
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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	6,000,000.00	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	82.22	-
应付管理人报酬	109,137.90	125,137.75
应付托管费	26,504.94	30,390.61
应付销售服务费	915.10	-
应付交易费用	108,644.26	40,341.62
应交税费	4,175.85	1.57
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	98,500.10	320,000.00
负债合计	6,347,960.37	515,871.55
所有者权益:		
实收基金	158,757,683.23	186,137,257.14
未分配利润	49,753,127.93	23,085,631.20
所有者权益合计	208,510,811.16	209,222,888.34
负债和所有者权益总计	214,858,771.53	209,738,759.89

注:报告截止日2019年6月30日,泰达宏利创益混合A基金份额净值1.313元,基金份额总额151,017,745.15份;泰达宏利创益混合B基金份额净值1.313元,基金份额总额7,739,938.08份。泰达宏利创益混合份额总额合计为158,757,683.23份。

6.2 利润表

会计主体:泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	33,101,145.75	-4,120,481.12
1.利息收入	2,098,474.62	4,825,481.14
其中:存款利息收入	37,238.09	13,860.28
债券利息收入	2,061,236.53	4,792,557.71
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	19,063.15
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	23,524,895.72	4,296,581.85
其中:股票投资收益	21,640,331.21	4,293,567.53
基金投资收益	-	-
债券投资收益	992,613.38	-674,866.06
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	891,951.13	677,880.38
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7,474,177.38	-13,369,850.53
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	3,598.03	127,306.42
减:二、费用	1,366,245.68	1,603,155.48
1. 管理人报酬	665,058.77	878,238.50
2. 托管费	161,514.24	213,286.52
3. 销售服务费	915.10	-
4. 交易费用	379,599.21	89,336.43
5. 利息支出	40,832.92	228,996.53
其中:卖出回购金融资产支出	40,832.92	228,996.53
6. 税金及附加	1,225.45	6,094.19
7. 其他费用	117,099.99	187,203.31
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	31,734,900.07	-5,723,636.60
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	31,734,900.07	-5,723,636.60

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	186,137,257.14	23,085,631.20	209,222,888.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	31,734,900.07	31,734,900.07
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)	-27,379,573.91	-5,067,403.34	-32,446,977.25
其中:1.基金申购款	143,767,824.62	42,133,664.06	185,901,488.68
2.基金赎回款	-171,147,398.53	-47,201,067.40	-218,348,465.93
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)	158,757,683.23	49,753,127.93	208,510,811.16
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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)	254,360,098.30	33,343,685.74	287,703,784.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,723,636.60	-5,723,636.60
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)	-62,400,621.55	-8,754,070.08	-71,154,691.63
其中:1.基金申购款	107,428.40	15,150.89	122,579.29
2.基金赎回款	-62,508,049.95	-8,769,220.97	-71,277,270.92
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)	191,959,476.75	18,865,979.06	210,825,455.81

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:

刘建　　　　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

泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")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[2015]1037号《关于核准泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由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《泰达宏利创益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人民币2,321,467,057.64元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第688号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年6月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,321,557,103.32份基金份额,其中认购资金利息折合90,045.68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,基金托管人为华夏银行股份有限公司(以下简称"华夏银行")。

根据《关于泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金增加B类份额并修改基金合同和托管协议的公告》并报证监会备案,本基金于2016年1月25日起根据申购费用、销售服务费用收取方式的不同和销售渠道的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用,赎回时根据持有期限收取赎回费用的,称为A类基金份额;不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费,赎回时根据持有期限收取赎回费用的,称为B类基金份额。本基金A类、B类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和B类基金份额分别计算基金份额净值。本基金的原有基金份额全部自动划归为该基金A类基金份额类别,A类基金份额的各项业务规则与原基金合同相同。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利创益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具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金股票资产占基金资产的比例为0%-95%,权证投资比例不超过基金资产净值的3%,本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金的业绩比较基准为中证全债指数收益率+2%。

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日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利创益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、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019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2019年6月30日的财务状况以及2019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

本基金本报告期内无会计估计的变更。

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[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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》、财税[2015]101号《关于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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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,股票的股息、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,应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。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,暂免征收个人所得税。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。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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
华夏银行	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。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	665,058.77	878,238.50
其中:支付销售机构的客户维护费	48,777.62	91,262.93

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的0.7%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X0.7%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	161,514.24	213,286.52

注:支付基金托管人华夏银行的托管费按前一日基金资产净值0.17%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×0.17%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利创益混合A	泰达宏利创益混合B	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	915.10	915.10
华夏银行	-	-	-
合计	-	915.10	915.10
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利创益混合A	泰达宏利创益混合B	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	-	-
华夏银行	-	-	-
合计	-	-	-

注:1、支付基金销售机构的销售服务费按B类基金份额前一日基金资产净值0.3%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给泰达宏利基金管理有限公司,再由泰达宏利基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

日B类基金份额销售服务费=前一日B类基金份额基金资产净值X0.3%/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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
华夏银行	144,167.75	30,020.46	627,127.02	9,701.34

注:本基金的银行存款由基金托管人华夏银行保管,按约定利率计息。

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内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(2019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

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.12.1.2 受限证券类别:债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113028	环境转债	2019年6月20日	2019年7月8日	新债未上市	100.00	100.00	300	30,000.00	30,000.00	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

截至本报告期末2019年6月30日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额6,000,000.00元,于2019年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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	66,126,843.62	30.78
	其中:股票	66,126,843.62	30.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	135,884,616.80	63.24
	其中:债券	135,884,616.80	63.24
	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	1,633,970.64	0.76
8	其他各项资产	11,213,340.47	5.22
9	合计	214,858,771.53	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

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	22,821,641.41	10.95
C	制造业	5,626,728.51	2.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,562,000.00	2.67
E	建筑业	11,079,000.00	5.31
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	39,603.76	0.02
J	金融业	20,997,869.94	10.07
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	66,126,843.62	31.71

7.2.2 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。

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	600028	中国石化	1,599,968	8,751,824.96	4.20
2	601628	中国人寿	300,000	8,496,000.00	4.07
3	600489	中金黄金	800,000	8,216,000.00	3.94
4	601398	工商银行	1,200,000	7,068,000.00	3.39
5	601857	中国石油	830,000	5,710,400.00	2.74
6	600068	葛洲坝	900,000	5,607,000.00	2.69
7	601991	大唐发电	1,800,000	5,562,000.00	2.67
8	601618	中国中冶	1,800,000	5,472,000.00	2.62
9	601238	广汽集团	499,961	5,464,573.73	2.62
10	601288	农业银行	1,500,000	5,400,000.00	2.59

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于管理人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	000725	京东方A	17,260,000.00	8.25
2	000625	长安汽车	9,995,775.00	4.78
3	000858	五粮液	9,858,880.00	4.71
4	600028	中国石化	8,684,163.56	4.15
5	601398	工商银行	7,332,865.40	3.50
6	000166	申万宏源	7,067,974.16	3.38
7	601857	中国石油	5,946,000.00	2.84
8	601991	大唐发电	5,697,000.00	2.72
9	600068	葛洲坝	5,641,938.00	2.70
10	601238	广汽集团	5,639,296.31	2.70
11	601288	农业银行	5,535,000.00	2.65
12	601618	中国中冶	5,467,300.00	2.61
13	600989	宝丰能源	270,838.72	0.13
14	601298	青岛港	109,487.50	0.05
15	600928	西安银行	90,684.36	0.04
16	600968	海油发展	82,413.96	0.04
17	002958	青农商行	70,092.00	0.03
18	601615	明阳智能	63,797.25	0.03
19	603967	中创物流	38,575.76	0.02
20	300761	立华股份	37,890.85	0.02

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。

7.4.2 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	000725	京东方A	20,874,822.00	9.98
2	600030	中信证券	15,581,903.00	7.45
3	601601	中国太保	13,767,329.00	6.58
4	000858	五粮液	13,703,434.50	6.55
5	600837	海通证券	13,588,000.00	6.49
6	600547	山东黄金	11,555,521.00	5.52
7	000625	长安汽车	11,420,181.36	5.46
8	601939	建设银行	10,405,790.80	4.97
9	601398	工商银行	9,451,826.90	4.52
10	000166	申万宏源	7,220,915.84	3.45
11	601628	中国人寿	5,918,120.00	2.83
12	300498	温氏股份	3,330,911.00	1.59
13	600989	宝丰能源	331,241.60	0.16
14	600928	西安银行	212,371.92	0.10
15	601298	青岛港	194,020.00	0.09
16	002958	青农商行	161,778.00	0.08
17	601615	明阳智能	157,545.63	0.08
18	300761	立华股份	100,440.71	0.05
19	300762	上海瀚讯	99,478.44	0.05
20	601860	紫金银行	95,340.90	0.05

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。

7.4.3 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	95,486,125.73
卖出股票收入(成交)总额	139,484,342.80

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	30,618,116.80	14.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	69,773,000.00	33.46
	其中:政策性金融债	59,781,000.00	28.67
4	企业债券	35,463,500.00	17.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	30,000.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	135,884,616.80	65.17

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	010107	21国债(7)	297,610	30,618,116.80	14.68
2	190302	19进出02	300,000	29,973,000.00	14.37
3	190203	19国开03	300,000	29,808,000.00	14.30
4	124410	13国网03	100,000	10,280,000.00	4.93
5	136053	15南航01	100,000	10,096,000.00	4.84

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

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

本基金本报告期末投资于国债期货。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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	179,620.33
2	应收证券清算款	999,023.33
3	应收股利	-
4	应收利息	2,025,655.95
5	应收申购款	8,009,040.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,213,340.47

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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

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

份额级别	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
泰达宏利创益混合A	394	383,293.77	134,965,870.03	89.37%	16,051,875.12	10.63%
泰达宏利创益混合B	1	7,739,938.08	7,739,938.08	100.00%	0.00	0.00%
合计	395	401,918.19	142,705,808.11	89.89%	16,051,875.12	10.11%

注:分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	泰达宏利创益混合A	1,211.15	0.0008%
	泰达宏利创益混合B	0.00	0.0000%
	合计	1,211.15	0.0008%

8.3 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	份额级别	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	泰达宏利创益混合A	0
	泰达宏利创益混合B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达宏利创益混合A	0
	泰达宏利创益混合B	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	泰达宏利创益混合A	泰达宏利创益混合B
基金合同生效日(2015年6月16日)基金份额总额	2,321,557,103.32	-
本报告期期初基金份额总额	186,137,257.14	-
本报告期基金总申购份额	136,027,886.54	7,739,938.08
减:本报告期基金总赎回份额	171,147,398.53	-
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	151,017,745.15	7,739,938.08

§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2019年1月19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》,王彦杰先生不再担任公司副总经理。

2、本报告期内基金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、本基金托管人、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

本报告期内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

1.本报告期内,中国证券监督管理委员会北京监管局对我司进行了常规全面现场检查,就公司未能建立完善的内控监控体系,提出了整改意见并下达了行政监管措施,公司对此高度重视,立即制定整改计划和整改方案,认真进行整改,排除业务中存在的风险隐患,逐一落实各项整改要求,进一步提升了公司内部控制和风险管理能力。公司已按照要求于2019年4月完成整改工作,并通过了中国证券监督管理委员会北京监管局的检查验收。

2.本报告期内,本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
中投证券	2	233,610,535.23	100.00%	217,563.25	100.00%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-

注:(一)2019年上半年本基金新增海通证券交易单元。

(二)交易单元选择的标准和程序

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单元,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
中投证券	398,285,938.39	100.00%	100,000,000.00	100.00%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20190508~20190630	0.00	46,546,935.61	0.00	46,546,935.61	29.32%
	2	20190101~20190611	165,817,279.05	0.00	165,817,279.05	0.00	0.00%
	3	20190508~20190630	0.00	43,862,684.25	0.00	43,862,684.25	27.63%
产品特有风险							
报告期内,本基金存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。

泰达宏利基金管理有限公司
2019年8月24日