泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金

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：中国银行股份有限公司
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部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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	泰达转型机遇股票
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	80,756,986.35份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

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，本基金凭借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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	聂志刚	王永民
	联系电话	010-66577678	010-66594896
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-698-8888	95566
传真		010-66577666	010-66594942

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

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）
本期已实现收益	8,747,344.03
本期利润	17,462,235.99
加权平均基金份额本期利润	0.2153
本期基金份额净值增长率	33.75%
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	-0.1401
期末基金资产净值	69,446,737.98
期末基金份额净值	0.860

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.对期末可供分配利润，采用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

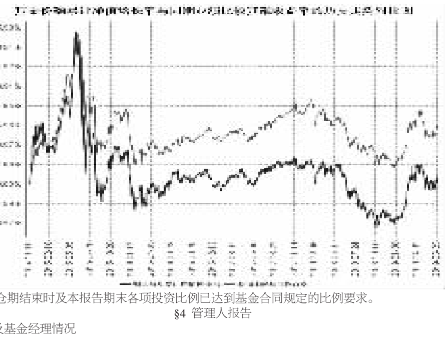
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.94%	1.77%	3.73%	1.01%	-2.79%	0.76%
过去三个月	-2.71%	2.14%	-2.88%	1.33%	0.17%	0.81%
过去六个月	33.75%	2.02%	21.52%	1.33%	12.23%	0.69%
过去一年	8.86%	1.90%	5.88%	1.30%	2.98%	0.60%
过去三年	-0.46%	1.39%	9.90%	0.95%	-10.36%	0.44%
自基金合同生效起至今	3.82%	1.96%	34.96%	1.39%	-31.14%	0.57%

注：本基金的业绩比较基准：85%×中证800指数收益率+ 15%×中证综合债指数收益率

本基金选择以中证800指数作为股票投资的业绩比较基准。中证800 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800只A股作为样本的综合性指数；样本选择标准为规模大、流动性好的股票，目前中证800 指数样本覆盖了沪深市场七成左右的市值，具有良好的市场代表性。本基金主要投资于转型机遇主题上市公司股票，投资标的与中证800指数成分股重合度较高。因此，中证800 指数适合作为本基金的业绩比较基准。

本基金是股票型基金，基金在运作过程中将维持80%-95%的股票资产，其余资产投资于债券及其他具有高流动性的短期金融工具。本基金将业绩比较基准中股票指数与债券指数的权重确定为85%和15%，并用中证综合债指数收益率代表债券资产收益率。因此，“85%×中证800指数收益率+15%×中证综合债指数收益率”是衡量本基金投资业绩的理想基准。

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		
王鹏	本基金基金经理	2017年12月19日	-	7	清华大学工学硕士；2012年7月至2014年3月，任职于中邮创业基金管理有限公司，担任TMT行业研究员；2014年3月至2015年6月，任职于上海磐信投资管理有限公司，担任电子行业研究员；2015年6月，加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于研究部，先后担任研究员、基金经理等职；具有7年证券从业经验，具有基金从业资格。
丁宇佳	本基金经理助理；固定收益部总经理	2015年6月9日	-	11	中央财经大学理学学士；2008年7月加入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、基金经理助理，现任固定收益部总经理兼基金经理；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处罚的情况。

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

上半年组合收益率明显跑赢基准，组合整体的投资策略是寻找景气向上行业的龙头公司，在景气底部重视变化，淡化估值，取得了不错的效果。

行业配置上选择了畜禽养殖景气大周期启动的农业、海外需求放量的光伏、对标科创板的电子半导体、需求偏刚性的消费以及医药中的龙头公司做了超额配置，绝大部分取得了正向回报。

本基金管理人将在均衡配置的思路下，坚持中长期的投资理念，通过学习不断提炼和总结长期适用的投资方法，力争为基金持有人提供稳定的持续回报。

4.4.2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0.860元；本报告期基金份额净值增长率为33.75%，业绩比较基准收益率为21.52%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

首先，基金管理人认为消费股持续拔估值的行情难以持续。估值的扩张来源于景气超预期以及增量资金偏好，前者可复制，后者为一次性的过程。基金管理人认为在景气难超预期的情况下，消费龙头估值有可能维持在这个水平，但难以持续提升。

其次，科创板有望带来科技板块的投资机会。科创板的推出会改变市场对科技股的估值方法，带来科技公司的巨大分化。通过估值对标，优质科技公司市值仍有空间，讲故事、没业绩的公司将被市场抛弃。

最后，我们优选的农业、消费电子等板块，由于确定改善的景气度，下半年仍有望取得超额收益。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金

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	3,850,773.94	4,069,269.58
结算备付金	270,535.85	308,001.33
存出保证金	21,926.77	33,902.75
交易性金融资产	65,641,628.42	48,092,081.61
其中：股票投资	65,641,628.42	48,092,081.61
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	91,057.32	112,201.04
应收利息	810.79	1,105.72
应收股利	-	-
应收申购款	2,575.28	3,159.33
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	69,879,308.37	52,619,721.36

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	-	-
应付证券清算款	64,815.94	35,304.10
应付赎回款	7,620.82	235,519.62
应付管理人报酬	82,795.20	68,034.05
应付托管费	13,799.17	11,339.00
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	187,875.34	169,039.38
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	75,663.92	106,000.00
负债合计	432,570.39	625,236.15
所有者权益：		
实收基金	80,756,986.35	80,861,653.19
未分配利润	-11,310,248.37	-28,867,167.98
所有者权益合计	69,446,737.98	51,994,485.21
负债和所有者权益总计	69,879,308.37	52,619,721.36

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值0.860元，基金份额总额80,756,986.35份。

6.2利润表

会计主体：泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金

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	18,691,297.28	-9,268,997.69
1.利息收入	17,602.35	22,113.93
其中：存款利息收入	17,602.35	22,113.93
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	9,934,353.25	2,345,601.01
其中：股票投资收益	9,527,057.41	1,786,161.07
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	407,295.84	559,439.94
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	8,714,891.96	-11,640,831.49
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	24,449.72	4,118.86
减：二、费用	1,229,061.29	1,293,559.70
1.管理人报酬	485,452.94	596,540.50
2.托管费	80,908.84	99,423.37
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	574,565.80	532,533.19
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	-	-
7.其他费用	88,133.71	65,062.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	17,462,235.99	-10,562,557.39
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	17,462,235.99	-10,562,557.39

6.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金

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）	80,861,653.19	-28,867,167.98	51,994,485.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,462,235.99	17,462,235.99
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）	-104,666.84	94,683.62	-9,983.22
其中：1.基金申购款	9,413,515.50	-1,272,228.71	8,141,286.79
2.基金赎回款	-9,518,182.34	1,366,912.33	-8,151,270.01
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）	80,756,986.35	-11,310,248.37	69,446,737.98

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）	100,331,235.44	-8,363,447.14	91,967,788.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,562,557.39	-10,562,557.39
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）	-16,974,085.10	1,416,569.88	-15,557,515.22
其中：1.基金申购款	1,911,673.26	-206,650.58	1,705,022.68
2.基金赎回款	-18,885,758.36	1,623,220.46	-17,262,537.90
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）	83,357,150.34	-17,509,434.65	65,847,715.69

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

泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金（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〔2014〕125号《关于核准泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金募集的批复》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《泰达宏利转型机遇股票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760,346,969.47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（2014）第686号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金基金合同》于2014年11月18日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为760,658,619.16份基金份额，其中认购资金利息折合311,649.69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，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利转型机遇股票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）、权证、债券货币市场工具、资产支持证券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。本基金股票资产占基金资产的比例为80%-95%，其中投资于转型机遇主题的上市公司股票不低于非现金基金资产的80%，债券投资占基金资产的0%-20%，权证投资占基金资产净值的比例不高于3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为85%×中证800指数收益率 + 15%×中证综合债指数收益率。

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日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利转型机遇股票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〔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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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	485,452.94	596,540.50
其中：支付销售机构的客户维护费	209,650.06	257,816.37

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1.5%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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 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	80,908.84	99,423.37

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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 X 0.25% / 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可比期间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
中国银行	3,850,773.94	14,627.98	9,399,858.18	19,511.96

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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可比期间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	-

6.4.9.2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

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

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	65,641,628.42	93.94
	其中：股票	65,641,628.42	93.94
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	4,121,309.79	5.90
8	其他各项资产	116,370.16	0.17
9	合计	69,879,308.37	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	4,423,805.00	6.37
B	采矿业	40,533.90	0.06
C	制造业	61,113,584.46	88.00
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,835.12	0.04
J	金融业	33,869.94	0.05
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	65,641,628.42	94.52

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	000858	五 粮 液	53,800	6,345,710.00	9.14
2	000661	长春高新	15,300	5,171,400.00	7.45
3	002157	正邦科技	293,200	4,884,712.00	7.03
4	600438	通威股份	343,500	4,829,610.00	6.95
5	300014	亿纬锂能	134,125	4,085,447.50	5.88
6	002567	唐人神	343,400	3,966,270.00	5.71
7	601012	隆基股份	139,400	3,221,534.00	4.64
8	300498	温氏股份	75,000	2,689,500.00	3.87
9	000568	泸州老窖	29,700	2,400,651.00	3.46
10	600519	贵州茅台	2,400	2,361,600.00	3.40

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	300498	温氏股份	8,073,577.64	15.53
2	002567	唐人神	5,104,115.30	9.82
3	000858	五 粮 液	4,945,579.00	9.51
4	600438	通威股份	4,201,834.00	8.08
5	000063	中兴通讯	3,994,782.00	7.68
6	300659	中孚信息	3,910,384.20	7.52
7	002180	纳思达	3,879,378.84	7.46
8	002074	国轩高科	3,446,558.00	6.63
9	002548	金新农	3,243,291.20	6.24
10	000651	格力电器	3,196,498.00	6.15
11	002371	北方华创	3,154,918.00	6.07
12	002714	牧原股份	3,129,065.00	6.02
13	300014	亿纬锂能	2,957,051.00	5.69
14	000568	泸州老窖	2,931,519.00	5.64
15	600519	贵州茅台	2,877,163.00	5.53
16	300450	先导智能	2,871,532.00	5.52
17	300567	精测电子	2,620,723.50	5.04
18	300596	利安隆	2,484,850.26	4.78
19	000401	冀东水泥	2,475,887.00	4.76
20	002384	东山精密	2,444,655.00	4.70
21	000333	美的集团	2,412,697.00	4.64
22	000661	长春高新	2,371,040.00	4.56
23	002299	圣农发展	2,283,837.00	4.39
24	300059	东方财富	2,217,829.31	4.27
25	601012	隆基股份	2,212,593.80	4.26
26	601166	兴业银行	2,170,697.00	4.17
27	600030	中信证券	2,042,031.00	3.93
28	600958	东方证券	2,041,374.00	3.93
29	600741	华域汽车	2,013,297.00	3.87
30	002202	金风科技	1,963,654.68	3.78
31	601688	华泰证券	1,947,912.54	3.75
32	002415	海康威视	1,942,907.00	3.74
33	300207	欣旺达	1,940,331.00	3.73
34	002594	比亚迪	1,822,913.00	3.51
35	000876	新 希 望	1,813,973.00	3.49
36	601799	星宇股份	1,804,518.48	3.47
37	002129	中环股份	1,754,601.32	3.37
38	002157	正邦科技	1,693,416.88	3.26
39	002886	沃特股份	1,653,163.00	3.18
40	600276	恒瑞医药	1,628,797.00	3.13
41	002439	启明星辰	1,573,580.00	3.03
42	300308	中际旭创	1,519,018.00	2.92
43	601555	东吴证券	1,487,911.00	2.86
44	603313	梦百合	1,479,259.00	2.85
45	002281	光迅科技	1,477,116.00	2.84
46	000001	平安银行	1,468,591.00	2.82
47	600383	金地集团	1,403,712.00	2.70
48	002271	东方雨虹	1,398,456.50	2.69
49	002463	沪电股份	1,379,826.00	2.65
50	002174	游族网络	1,327,321.00	2.55
51	300760	迈瑞医疗	1,302,894.00	2.51
52	603801	志邦家居	1,224,380.00	2.35
53	300724	捷佳伟创	1,219,985.00	2.35
54	600837	海通证券	1,178,915.00	2.27
55	603899	晨光文具	1,158,030.00	2.23
56	600115	东方航空	1,157,376.00	2.23
57	603323	苏农银行	1,138,227.00	2.19
58	601881	中国银河	1,130,619.00	2.17
59	002372	伟星新材	1,124,872.00	2.16
60	601111	中国国航	1,106,110.00	2.13
61	601888	中国国旅	1,079,547.20	2.08
62	601128	常熟银行	1,051,174.00	2.02

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	300498	温氏股份	6,372,018.00	12.26
2	000063	中兴通讯	4,478,115.00	8.61
3	002299	圣农发展	3,996,455.17	7.69
4	002180	纳思达	3,907,917.80	7.52
5	300659	中孚信息	3,830,443.40	7.37
6	002439	启明星辰	3,767,784.00	7.25
7	600570	恒生电子	3,732,906.05	7.18
8	601688	华泰证券	3,505,064.73	6.74
9	300059	东方财富	3,487,998.28	6.71
10	002074	国轩高科	3,247,982.00	6.25
11	002371	北方华创	3,216,014.69	6.19
12	002594	比亚迪	3,022,979.00	5.81
13	000651	格力电器	2,982,431.00	5.74
14	300596	利安隆	2,800,329.03	5.39
15	300122	智飞生物	2,765,355.00	5.32
16	603313	梦百合	2,491,926.00	4.79
17	000401	冀东水泥	2,483,687.00	4.78
18	002714	牧原股份	2,420,422.20	4.66
19	002384	东山精密	2,381,224.00	4.58
20	002281	光迅科技	2,208,189.55	4.25
21	300450	先导智能	2,102,145.00	4.04
22	601166	兴业银行	2,089,499.00	4.02
23	600030	中信证券	2,051,885.00	3.95
24	600958	东方证券	2,031,102.00	3.91
25	002202	金风科技	2,012,179.78	3.87
26	002129	中环股份	1,982,359.91	3.81
27	002458	益生股份	1,951,487.00	3.75
28	002886	沃特股份	1,913,800.50	3.68
29	600547	山东黄金	1,842,645.00	3.54
30	002174	游族网络	1,838,707.00	3.54
31	000876	新 希 望	1,802,188.00	3.47
32	600498	烽火通信	1,790,931.00	3.44
33	002548	金新农	1,788,688.93	3.44
34	300365	恒华科技	1,749,032.00	3.36
35	600741	华域汽车	1,741,520.00	3.35
36	300750	宁德时代	1,700,202.50	3.27
37	300014	亿纬锂能	1,602,617.12	3.08
38	300207	欣旺达	1,573,357.00	3.03
39	300271	华宇软件	1,554,454.00	2.99
40	002821	凯莱英	1,543,029.00	2.97
41	600340	华夏幸福	1,518,158.00	2.92
42	002376	新北洋	1,513,995.00	2.91
43	300454	深信服	1,440,541.00	2.77
44	300451	创业慧康	1,429,987.00	2.75
45	300166	东方国信	1,426,526.00	2.74
46	002271	东方雨虹	1,411,224.55	2.71
47	601555	东吴证券	1,407,785.00	2.71
48	300760	迈瑞医疗	1,385,616.90	2.66
49	600977	中国电影	1,358,154.00	2.61
50	000001	平安银行	1,350,558.00	2.60
51	603986	兆易创新	1,346,596.00	2.59
52	600489	中金黄金	1,332,850.00	2.56
53	600383	金地集团	1,303,599.00	2.51
54	300567	精测电子	1,292,996.00	2.49
55	002746	仙坛股份	1,283,174.20	2.47
56	300308	中际旭创	1,193,151.00	2.29
57	300595	欧普康视	1,167,059.30	2.24
58	300413	芒果超媒	1,159,610.00	2.23
59	002234	民和股份	1,142,332.00	2.20
60	600115	东方航空	1,120,263.00	2.15
61	601888	中国国旅	1,108,118.00	2.13
62	300523	辰安科技	1,099,848.00	2.12
63	601111	中国国航	1,087,252.00	2.09
64	002372	伟星新材	1,084,487.60	2.09
65	603323	苏农银行	1,077,486.92	2.07

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	188,992,159.58
卖出股票收入（成交）总额	189,684,562.14

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期未投资于国债期货。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

本基金投资的正邦科技2018年7月20日发布《关于公司下属分子公司收到〈行政处罚决定书〉及〈责令改正违法行为决定书〉的公告》，披露下属子公司肇东正邦养殖有限公司收到肇东市环境保护局出具的《行政处罚决定书》（肇环罚〔2018〕0505号）、《行政处罚决定书》（肇环罚〔2018〕0607 号）及《责令改正违法行为决定书》（肇环责改字〔2018〕0607 号）；公司下属分公司肇东正邦养殖有限公司红光分公司收到肇东市环境保护局出具的《行政处罚决定书》（肇环罚〔2018〕180506 号）、《行政处罚决定书》（肇环罚〔2018〕0608 号）及《责令改正违法行为决定书》（肇环责改字〔2018〕0608 号）。处罚原因包括污水处理设施未运行、环保设施破损及其它环保防治措施不达标等。本次受处罚金额累计为205万元，占公司2017年度营业收入的0.01%，占2017年度归属于上市公司股东的净利润的0.39%，占2017年底净资产的0.03%，不会对公司的生产、经营造成重大影响。

基金管理人分析认为生猪养殖行业在19-20年将迎来确定性景气周期，上述公司是19-20年出栏规模弹性最大的生猪养殖企业之一，公司的成本和费用改善明显，并针对上述事项进行了相关整改，加强管理，截止目前公司及其下属公司未再受到环保行政处罚。基金管理人经审慎分析，在本报告期内继续保持对其的投资。

报告期内基金投资的前十名证券的其他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。

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	21,926.77
2	应收证券清算款	91,057.32
3	应收股利	-
4	应收利息	810.79
5	应收申购款	2,575.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	116,370.16

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

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
3,103	26,025.45	314,916.99	0.39%	80,442,069.36	99.61%

8.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	12,142.31	0.0150%

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年11月18日）基金份额总额	760,658,619.16
本报告期期初基金份额总额	80,861,653.19
本报告期基金总申购份额	9,413,515.50
减：本报告期基金总赎回份额	9,518,182.34
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	80,756,986.35

§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、2019年5月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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函，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	
东吴证券	1	63,073,224.41	16.72%	58,739.81	16.72%	-
招商证券	1	57,773,526.92	15.31%	53,804.58	15.31%	-
方正证券	1	53,583,842.49	14.20%	49,903.01	14.20%	-
西南证券	2	52,012,796.45	13.78%	48,439.97	13.78%	-
天风证券	1	49,881,836.61	13.22%	46,454.95	13.22%	-
兴业证券	1	31,338,581.92	8.31%	29,185.74	8.31%	-
长江证券	1	21,421,688.53	5.68%	19,950.24	5.68%	-
国盛证券	2	17,219,147.00	4.56%	16,036.13	4.56%	-
长城证券	1	10,869,558.28	2.88%	10,122.89	2.88%	-
光大证券	1	7,499,766.48	1.99%	6,984.61	1.99%	-
东方证券	4	7,167,546.88	1.90%	6,674.98	1.90%	-
广发证券	2	4,347,932.00	1.15%	4,049.21	1.15%	-
国泰君安	1	1,141,779.30	0.30%	1,063.37	0.30%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
太平洋	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-

注：（一）2019年上半年本基金撤销中金公司、安信证券交易单元。

（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，使用其交易单元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
东吴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

泰达宏利基金管理有限公司

2019年8月24日