

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 2015 年年度报告摘要

2015 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

送出日期：2016 年 3 月 30 日

§ 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 28 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。

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 2 月 13 日（基金合同生效日）起至 2015 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|---------------------|
| 基金简称 | 泰达改革动力混合 |
| 基金主代码 | 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 |
| 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 | 611, 544, 176. 05 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 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 |

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 | 陈沛 | 王永民 |
| | 联系电话 | 010-66577808 | 010-66594896 |

| | | | |
|--------|------|-----------------|----------------------|
| | 电子邮箱 | irm@mfcteda.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-69-88888 | 95566 |
| 传真 | | 010-66577666 | 010-66594942 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-----------------|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.mfcteda.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人的住所 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2015 年 2 月 13 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日 |
|---------------|---|
| 本期已实现收益 | 549,700,720.38 |
| 本期利润 | 568,456,035.54 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.5406 |
| 本期基金份额净值增长率 | 36.30% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2715 |
| 期末基金资产净值 | 833,755,713.88 |
| 期末基金份额净值 | 1.363 |

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

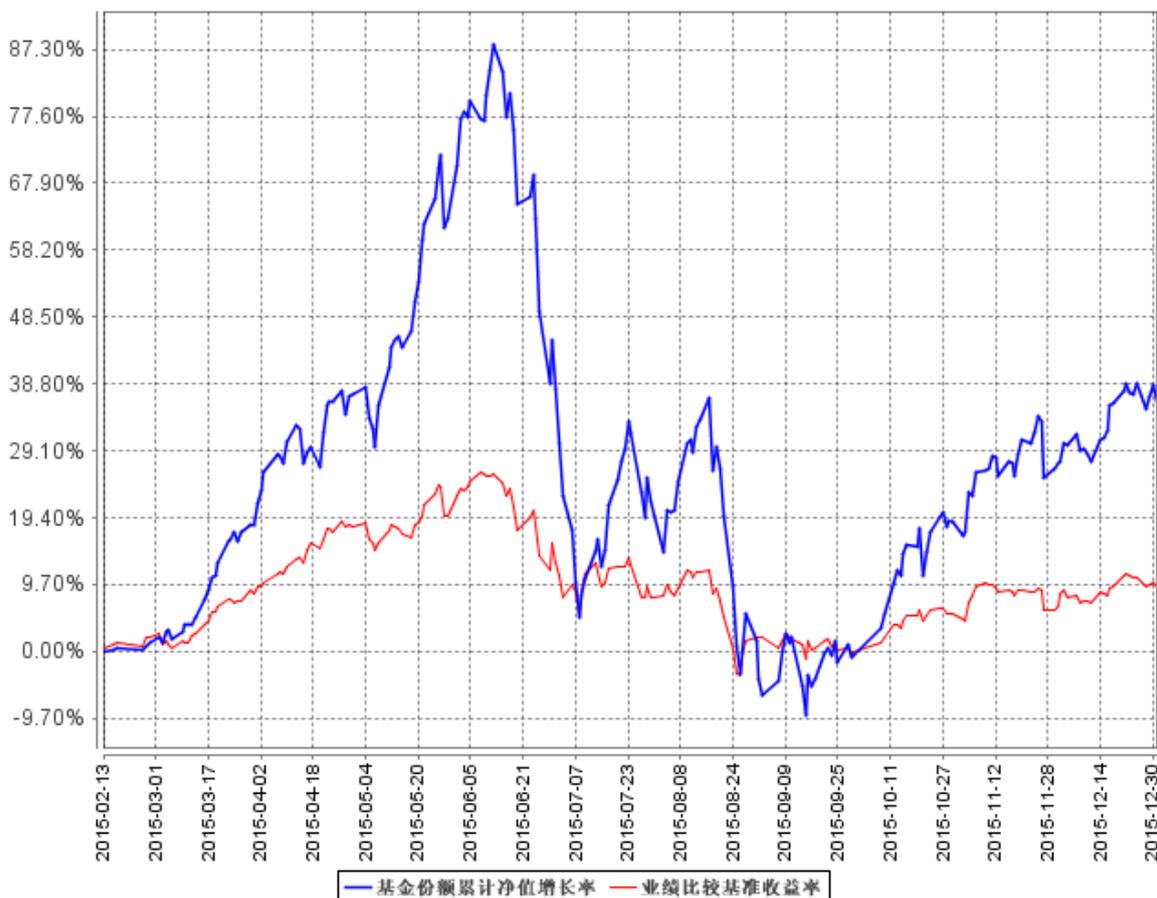
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 36.98% | 1.99% | 9.46% | 0.83% | 27.52% | 1.16% |
| 过去六个月 | -6.13% | 3.16% | -5.46% | 1.34% | -0.67% | 1.82% |
| 自基金合同生效起至今 | 36.30% | 2.88% | 9.39% | 1.26% | 26.91% | 1.62% |

注：本基金的业绩比较基准：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

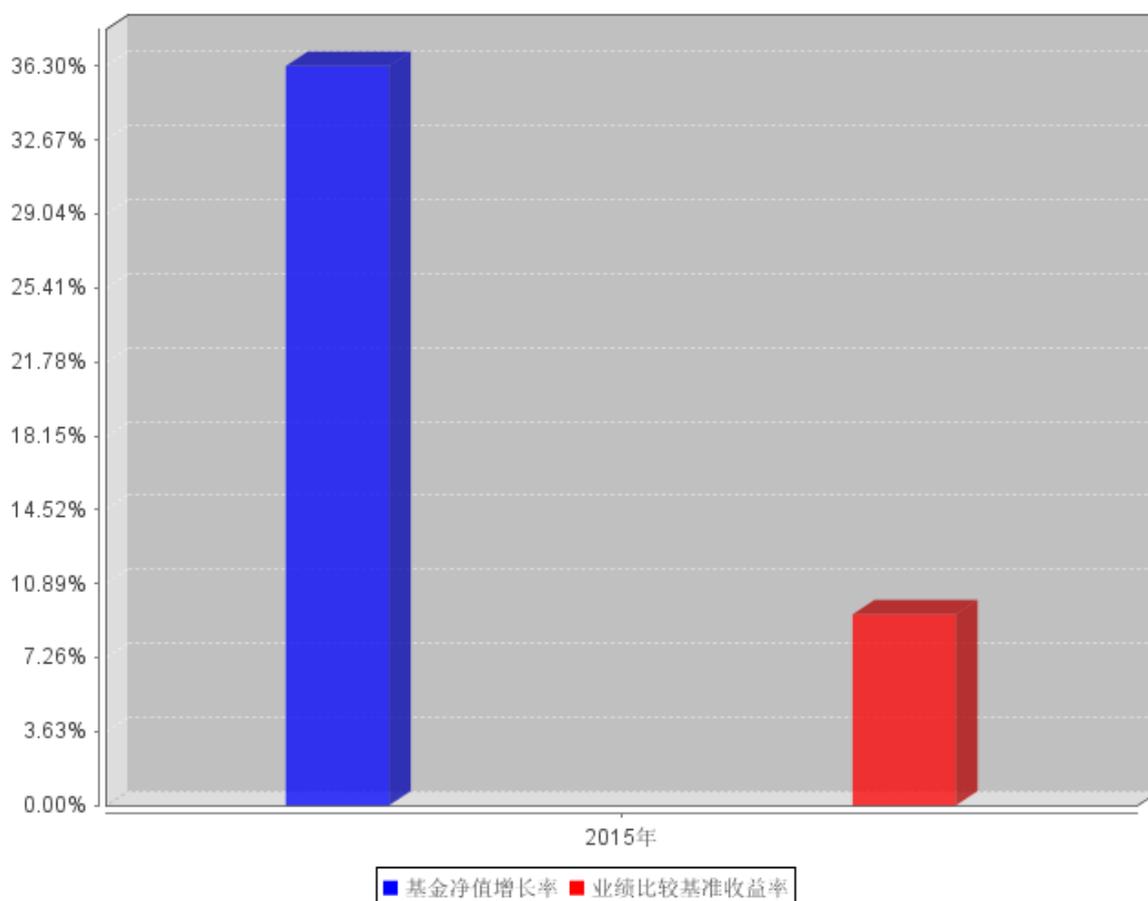
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本基金成立于 2015 年 2 月 13 日，按基金合同规定，自基金合同生效起六个月内为建仓期。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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



本基金合同生效日为 2015 年 2 月 13 日，2015 年度净值增长率的计算期间为 2015 年 2 月 13 日至 2015 年 12 月 31 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于 2015 年 2 月 13 日生效。根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金自成立以来到本报告期末未进行利润分配。目前无其他收益分配安排。

§ 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：北方国际信托股份有限公司：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、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、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金、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、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利收益增强债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利养老收益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、泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金在内的三十多只证券投资基金。

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 | | |
| 刘欣 | 本基金基金经理 | 2015 年 2 月 13 日 | - | 8 | 清华大学理学硕士；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， |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 担任产品与金融工程部高级研究员，现担任金融工程部副总经理、基金经理；具备 8 年基金从业经验，8 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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人建立了公平交易制度和内部控制流程，严格执行相关制度规定。在投资管理活动中，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；在交易环节实行集中交易制度，交易部运用交易系统中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，确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，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。

基金管理人的风险管理部定期对基金管理人管理的不同投资组合的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）基金管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，并经公司管理层审核签署后存档备查。基金管理人的监察稽核部定期对公平交易制度的执行和控制工作进行稽核。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人的风险管理部事后从交易指令的公平性、同日反向交易、不同窗口下的同向交易溢价率和风格相似的基金的业绩等方面，对报告期内的公平交易执行情况进行统计分析。本报告期内，交易指令多为指令下达人管理的多只资产组合同时下发，未发现明显的非公平交易指令；基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；场外交易的交易价格与市场价格一致，场内交易的溢价率在剔除交易时间差异、交易数量悬殊、市场波动剧烈等因素后，处于正常范围之内；基金管理人管理的各投资组合的业绩由于投资策略、管理风格、业绩基准等方面的因素而有所不同。

本报告期内，本基金管理人管理的各投资组合之间未发现利益输送或不公平对待不同组合的情况。

4.3.3 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，风险管理部对可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，定期对各投资组合的交易行为进行整体分析评估，定期向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。如发现疑似异常交易情况，相关投资组合经理对该交易情况进行合理性解释。监察稽核部定期对异常交易制度的执行和控制工作进行稽核。

在本报告期内，本基金管理人管理的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%，没有发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为，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

2015 年 A 股市场经历了较大的波动。上半年市场呈现单边上涨格局，创业板等新兴成长股上涨幅度较大，市场整体波动率伴随股市上行逐步提高。6 月后股市出现较大波折，杠杆资金的快速出清伴随恐慌情绪的释放，导致市场以不平常的速度迅速下跌寻底。至四季度，市场基本筑底企稳，风险偏好有所恢复。在下跌过程中，低估值蓝筹股体现出较好的抗跌性；而在反弹过程中，成长股表现较好。

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。

4.4.2 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 1.363 元，本基金自成立以来的额净值增长率为 36.30%，同期业绩比较基准增长率为 9.39%。

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，经济基本面仍在筑底过程中，部分周期性行业出现回暖。从宏观层面看，货币政策持续相对宽松，政府采取多种方式刺激经济企稳。在微观结构上，上市公司整体 ROE 水平仍处于低位，企业通过外延式并购维持利润增速。股票整体估值不低，但是结构差异较大，仍有大量优质中低估值股票值得关注。

基于此观点，我们的配置偏向于改革背景下，从业务模式、持股结构两个维度上进行改革与创新的價值重估股票。本基金在持仓上相对分散，以平衡组合风险。

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运营的副总经理负责，成员包括督察长、投资总监、研究部、固定收益部、金融工程部、风险管理部、基金运营部的相关人员，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

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金报告期内未进行利润分配。目前无其他利润分配安排。

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”）在对泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金（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 审计报告

本基金 2015 年年度报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可阅读年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产 | 本期末 2015 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|
| 资 产： | |
| 银行存款 | 69,832,114.05 |
| 结算备付金 | 52,213,277.66 |
| 存出保证金 | 17,074,390.43 |
| 交易性金融资产 | 699,533,002.05 |

| | |
|-----------------|--------------------|
| 其中：股票投资 | 699,533,002.05 |
| 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 | - |
| 应收利息 | 26,738.09 |
| 应收股利 | - |
| 应收申购款 | 934,086.59 |
| 递延所得税资产 | - |
| 其他资产 | - |
| 资产总计 | 839,613,608.87 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 |
| | 2015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 | - |
| 应付赎回款 | 1,459,459.04 |
| 应付管理人报酬 | 1,068,038.20 |
| 应付托管费 | 178,006.34 |
| 应付销售服务费 | - |
| 应付交易费用 | 3,050,477.19 |
| 应交税费 | - |
| 应付利息 | - |
| 应付利润 | - |
| 递延所得税负债 | - |
| 其他负债 | 101,914.22 |
| 负债合计 | 5,857,894.99 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 611,544,176.05 |
| 未分配利润 | 222,211,537.83 |
| 所有者权益合计 | 833,755,713.88 |
| 负债和所有者权益总计 | 839,613,608.87 |

注：1、报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.363 元，基金份额总额 611,544,176.05 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2015 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2015 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 |
|----------------------------|--|
| | 2015 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
| 一、收入 | 618,381,796.83 |
| 1. 利息收入 | 2,263,053.21 |
| 其中：存款利息收入 | 1,226,182.32 |
| 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 | 1,036,870.89 |
| 其他利息收入 | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 583,463,676.99 |
| 其中：股票投资收益 | 556,484,168.51 |
| 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 | 20,970,568.41 |
| 股利收益 | 6,008,940.07 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 18,755,315.16 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 13,899,751.47 |
| 减：二、费用 | 49,925,761.29 |
| 1. 管理人报酬 | 17,494,997.49 |
| 2. 托管费 | 2,915,832.83 |
| 3. 销售服务费 | - |
| 4. 交易费用 | 29,106,112.99 |
| 5. 利息支出 | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - |
| 6. 其他费用 | 408,817.98 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 568,456,035.54 |
| 减：所得税费用 | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 568,456,035.54 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2015 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 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） | 1,931,765,423.15 | - | 1,931,765,423.15 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润） | - | 568,456,035.54 | 568,456,035.54 |
| 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） | -1,320,221,247.10 | -346,244,497.71 | -1,666,465,744.81 |
| 其中：1. 基金申购款 | 1,143,501,394.46 | 565,650,447.09 | 1,709,151,841.55 |
| 2. 基金赎回款 | -2,463,722,641.56 | -911,894,944.80 | -3,375,617,586.36 |
| 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） | 611,544,176.05 | 222,211,537.83 | 833,755,713.88 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | - | - | - |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|-------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|
| <u> 刘建 </u> | <u> 傅国庆 </u> | <u> 王泉 </u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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(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]54号《关于核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》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 1,931,209,798.06 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 133 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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》于 2015 年 2 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,931,765,423.15 份基金份额,其中认购资金利息折合 555,625.09 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》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)。本基金投资的股票资产占基金资产的比例为 0%-95%,其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券等金融工具;其中投资于具有改革动力主题的证券不低于非现金基金资产的 80%;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:50%X 沪深 300 指数收益率+50%X 中证综合债指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司于 2016 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 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》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

或者(3) 该金融资产已转移, 虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬, 但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时, 其账面价值与收到的对价的差额, 计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时, 终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额, 计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值; 估值日无交易, 但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的, 按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具, 如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化, 参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素, 调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场, 采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时, 尽可能最大程度使用市场参数, 减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的; 且 2) 交易双方准备按净额结算时, 金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的

金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一

定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》和所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的

差价收入不予征收营业税

(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，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

7.4.7 关联方关系

| 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 |
| 北方国际信托股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 宏利资产管理(香港)有限公司 | 基金管理人的股东 |

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|-----------------|--|--|
| | 2015 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 | |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 17,494,997.49 | |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 7,532,198.99 | |

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|----------------|--|--|
| | 2015 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 | |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,915,832.83 | |

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×0.25% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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未持有本基金。

7.4.8.5 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 | | 上年度可比期间 | |
|-------|--|------------|----------------------------------|--------|
| | 2015 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 | | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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 | 69,832,114.05 | 963,697.02 | - | - |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|-------------|------|--------|------------|--------|-----------|---------------|---------------|----|
| 000813 | 天山纺织 | 2015年5月4日 | 重大事项 | 7.51 | 2016年1月15日 | 12.38 | 1,651,534 | 14,761,749.07 | 12,403,020.34 | - |
| 000712 | 锦龙股份 | 2015年12月25日 | 重大事项 | 29.12 | 2016年1月4日 | 28.00 | 202,966 | 6,412,430.84 | 5,910,369.92 | - |
| 002207 | 准油股份 | 2015年12月16日 | 重大事项 | 21.42 | - | - | 241,800 | 4,384,034.00 | 5,179,356.00 | - |
| 300331 | 苏大维格 | 2015年11月16日 | 重大事项 | 25.69 | - | - | 189,000 | 4,284,227.00 | 4,855,410.00 | - |
| 300025 | 华星创业 | 2015年11月26日 | 重大事项 | 28.28 | - | - | 170,122 | 3,078,842.98 | 4,811,050.16 | - |
| 002567 | 唐人神 | 2015年11月23日 | 重大事项 | 12.84 | 2016年2月25日 | 11.56 | 366,291 | 3,271,214.01 | 4,703,176.44 | - |
| 300132 | 青松 | 2015 | 重大 | 10.04 | 2016 | 9.04 | 457,000 | 3,463,613.63 | 4,588,280.00 | - |

| | 股份 | 年 12 月 11 日 | 事项 | | 年 3 月 25 日 | | | | | |
|--------|------|------------------|------|-------|-----------------|-------|---------|--------------|--------------|---|
| 300281 | 金明精机 | 2015 年 12 月 7 日 | 重大事项 | 18.95 | 2016 年 1 月 6 日 | 17.06 | 222,403 | 4,055,269.26 | 4,214,536.85 | - |
| 000980 | 金马股份 | 2015 年 9 月 29 日 | 重大事项 | 6.20 | - | - | 635,500 | 3,628,426.00 | 3,940,100.00 | - |
| 601137 | 博威合金 | 2015 年 12 月 22 日 | 重大事项 | 24.85 | 2016 年 2 月 29 日 | 22.37 | 147,000 | 2,224,898.81 | 3,652,950.00 | - |
| 000066 | 长城电脑 | 2015 年 6 月 18 日 | 重大事项 | 15.19 | 2016 年 3 月 10 日 | 19.39 | 215,200 | 4,792,286.01 | 3,268,888.00 | - |
| 002514 | 宝馨科技 | 2015 年 7 月 8 日 | 重大事项 | 14.80 | 2016 年 1 月 8 日 | 16.28 | 188,746 | 5,641,336.89 | 2,793,440.80 | - |
| 002582 | 好想你 | 2015 年 9 月 17 日 | 重大事项 | 15.62 | 2016 年 2 月 24 日 | 17.18 | 156,700 | 2,316,505.00 | 2,447,654.00 | - |
| 600452 | 涪陵电力 | 2015 年 12 月 31 日 | 重大事项 | 32.89 | 2016 年 3 月 10 日 | 29.60 | 27,610 | 894,586.20 | 908,092.90 | - |
| 002452 | 长高集团 | 2015 年 7 月 20 日 | 重大事项 | 9.14 | 2016 年 1 月 6 日 | 10.05 | 95,796 | 935,676.58 | 875,575.44 | - |
| 002174 | 游族网络 | 2015 年 7 月 23 日 | 重大事项 | 89.53 | 2016 年 2 月 15 日 | 80.58 | 7,240 | 635,777.17 | 648,197.20 | - |
| 002286 | 保龄宝 | 2015 年 8 月 3 日 | 重大事项 | 14.50 | 2016 年 2 月 24 日 | 15.95 | 6,542 | 119,150.10 | 94,859.00 | - |

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 634,238,045.00 元，属于第二层次的余额为 65,294,957.05 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 27 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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 | 699,533,002.05 | 83.32 |
| | 其中：股票 | 699,533,002.05 | 83.32 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 122,045,391.71 | 14.54 |
| 7 | 其他各项资产 | 18,035,215.11 | 2.15 |
| 8 | 合计 | 839,613,608.87 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 20,963,151.16 | 2.51 |
| B | 采矿业 | 23,690,833.30 | 2.84 |
| C | 制造业 | 424,744,082.61 | 50.94 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 11,412,258.90 | 1.37 |
| E | 建筑业 | 37,470,882.50 | 4.49 |
| F | 批发和零售业 | 25,430,473.24 | 3.05 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 30,184,444.91 | 3.62 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 17,828,340.96 | 2.14 |
| J | 金融业 | 59,195,582.19 | 7.10 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| K | 房地产业 | 33,874,654.48 | 4.06 |
| 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 | 9,477,547.80 | 1.14 |
| 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 | 318,036.00 | 0.04 |
| S | 综合 | 4,942,714.00 | 0.59 |
| | 合计 | 699,533,002.05 | 83.90 |

8.2.2 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。

8.3 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 | 000813 | 天山纺织 | 1,651,534 | 12,403,020.34 | 1.49 |
| 2 | 600297 | 广汇汽车 | 894,900 | 11,490,516.00 | 1.38 |
| 3 | 300121 | 阳谷华泰 | 439,576 | 7,077,173.60 | 0.85 |
| 4 | 300046 | 台基股份 | 246,800 | 6,836,360.00 | 0.82 |
| 5 | 300174 | 元力股份 | 213,573 | 6,834,336.00 | 0.82 |
| 6 | 002403 | 爱仕达 | 418,200 | 6,661,926.00 | 0.80 |
| 7 | 300095 | 华伍股份 | 437,164 | 6,631,777.88 | 0.80 |
| 8 | 300330 | 华虹计通 | 301,755 | 6,493,767.60 | 0.78 |
| 9 | 300319 | 麦捷科技 | 179,950 | 6,478,200.00 | 0.78 |
| 10 | 300214 | 日科化学 | 587,300 | 6,407,443.00 | 0.77 |

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年度报告正文

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|----------|----------------|
|----|------|------|----------|----------------|

| | | | | |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 1 | 300258 | 精锻科技 | 59,675,922.32 | 7.16 |
| 2 | 601628 | 中国人寿 | 57,077,455.93 | 6.85 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 54,681,006.08 | 6.56 |
| 4 | 601601 | 中国太保 | 49,849,151.41 | 5.98 |
| 5 | 601336 | 新华保险 | 49,310,912.59 | 5.91 |
| 6 | 600810 | 神马股份 | 45,291,821.21 | 5.43 |
| 7 | 002039 | 黔源电力 | 43,827,877.89 | 5.26 |
| 8 | 601555 | 东吴证券 | 42,341,475.69 | 5.08 |
| 9 | 000686 | 东北证券 | 41,396,788.52 | 4.97 |
| 10 | 000911 | 南宁糖业 | 38,951,728.82 | 4.67 |
| 11 | 600369 | 西南证券 | 36,543,845.30 | 4.38 |
| 12 | 300281 | 金明精机 | 36,344,931.38 | 4.36 |
| 13 | 300286 | 安科瑞 | 35,983,057.97 | 4.32 |
| 14 | 000798 | 中水渔业 | 34,749,700.90 | 4.17 |
| 15 | 600697 | 欧亚集团 | 34,612,113.70 | 4.15 |
| 16 | 300076 | GQY 视讯 | 34,517,349.37 | 4.14 |
| 17 | 000639 | 西王食品 | 34,150,570.64 | 4.10 |
| 18 | 002300 | 太阳电缆 | 34,025,468.85 | 4.08 |
| 19 | 300265 | 通光线缆 | 33,718,703.20 | 4.04 |
| 20 | 300227 | 光韵达 | 33,523,037.01 | 4.02 |
| 21 | 002386 | 天原集团 | 33,421,769.48 | 4.01 |
| 22 | 002321 | 华英农业 | 33,284,699.51 | 3.99 |
| 23 | 600291 | 西水股份 | 31,842,287.70 | 3.82 |
| 24 | 000001 | 平安银行 | 31,645,412.73 | 3.80 |
| 25 | 300282 | 汇冠股份 | 30,944,591.06 | 3.71 |
| 26 | 000713 | 丰乐种业 | 30,834,958.98 | 3.70 |
| 27 | 600015 | 华夏银行 | 30,809,320.07 | 3.70 |
| 28 | 002533 | 金杯电工 | 30,597,916.10 | 3.67 |
| 29 | 601009 | 南京银行 | 30,586,838.95 | 3.67 |
| 30 | 002142 | 宁波银行 | 30,558,219.26 | 3.67 |
| 31 | 601688 | 华泰证券 | 30,077,639.40 | 3.61 |
| 32 | 002333 | 罗普斯金 | 29,806,251.41 | 3.57 |
| 33 | 000551 | 创元科技 | 29,777,639.01 | 3.57 |
| 34 | 601377 | 兴业证券 | 29,343,825.90 | 3.52 |
| 35 | 600529 | 山东药玻 | 28,395,853.89 | 3.41 |
| 36 | 300180 | 华峰超纤 | 28,060,864.57 | 3.37 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 37 | 002601 | 佰利联 | 27,860,111.54 | 3.34 |
| 38 | 600290 | 华仪电气 | 27,850,992.80 | 3.34 |
| 39 | 600345 | 长江通信 | 27,686,720.66 | 3.32 |
| 40 | 601677 | 明泰铝业 | 26,720,777.44 | 3.20 |
| 41 | 300305 | 裕兴股份 | 26,619,022.90 | 3.19 |
| 42 | 002661 | 克明面业 | 26,606,001.87 | 3.19 |
| 43 | 600837 | 海通证券 | 26,304,568.02 | 3.15 |
| 44 | 000910 | 大亚科技 | 26,286,044.65 | 3.15 |
| 45 | 600030 | 中信证券 | 26,267,166.09 | 3.15 |
| 46 | 600101 | 明星电力 | 26,135,320.08 | 3.13 |
| 47 | 600016 | 民生银行 | 26,060,949.76 | 3.13 |
| 48 | 000951 | 中国重汽 | 25,921,303.42 | 3.11 |
| 49 | 002613 | 北玻股份 | 25,849,977.13 | 3.10 |
| 50 | 002566 | 益盛药业 | 25,478,445.37 | 3.06 |
| 51 | 300118 | 东方日升 | 25,409,707.59 | 3.05 |
| 52 | 000850 | 华茂股份 | 25,269,622.53 | 3.03 |
| 53 | 300121 | 阳谷华泰 | 25,132,565.05 | 3.01 |
| 54 | 000756 | 新华制药 | 25,033,514.96 | 3.00 |
| 55 | 000572 | 海马汽车 | 24,943,766.75 | 2.99 |
| 56 | 002567 | 唐人神 | 24,710,807.59 | 2.96 |
| 57 | 601166 | 兴业银行 | 24,705,467.52 | 2.96 |
| 58 | 002434 | 万里扬 | 24,626,862.31 | 2.95 |
| 59 | 000533 | 万家乐 | 24,622,159.79 | 2.95 |
| 60 | 300357 | 我武生物 | 24,395,423.41 | 2.93 |
| 61 | 002674 | 兴业科技 | 24,268,056.50 | 2.91 |
| 62 | 600521 | 华海药业 | 24,035,189.23 | 2.88 |
| 63 | 600029 | 南方航空 | 24,015,241.30 | 2.88 |
| 64 | 000712 | 锦龙股份 | 23,923,848.91 | 2.87 |
| 65 | 002521 | 齐峰新材 | 23,917,604.66 | 2.87 |
| 66 | 600827 | 百联股份 | 23,827,230.60 | 2.86 |
| 67 | 600742 | 一汽富维 | 23,666,023.25 | 2.84 |
| 68 | 600505 | 西昌电力 | 23,638,834.60 | 2.84 |
| 69 | 300224 | 正海磁材 | 23,534,352.95 | 2.82 |
| 70 | 002305 | 南国置业 | 23,422,643.56 | 2.81 |
| 71 | 600686 | 金龙汽车 | 23,227,091.27 | 2.79 |
| 72 | 300115 | 长盈精密 | 23,084,396.23 | 2.77 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 73 | 601111 | 中国国航 | 23,036,117.33 | 2.76 |
| 74 | 600551 | 时代出版 | 22,879,005.31 | 2.74 |
| 75 | 600829 | 人民同泰 | 22,873,470.62 | 2.74 |
| 76 | 002218 | 拓日新能 | 22,461,379.01 | 2.69 |
| 77 | 002290 | 禾盛新材 | 22,460,148.90 | 2.69 |
| 78 | 601998 | 中信银行 | 22,432,235.41 | 2.69 |
| 79 | 002433 | 太安堂 | 22,426,860.51 | 2.69 |
| 80 | 000758 | 中色股份 | 22,366,668.82 | 2.68 |
| 81 | 600272 | 开开实业 | 22,317,520.20 | 2.68 |
| 82 | 000550 | 江铃汽车 | 22,282,426.61 | 2.67 |
| 83 | 600115 | 东方航空 | 22,240,344.18 | 2.67 |
| 84 | 300375 | 鹏翎股份 | 21,885,553.13 | 2.62 |
| 85 | 600857 | 宁波中百 | 21,866,114.84 | 2.62 |
| 86 | 002238 | 天威视讯 | 21,834,588.06 | 2.62 |
| 87 | 300291 | 华录百纳 | 21,705,309.73 | 2.60 |
| 88 | 600109 | 国金证券 | 21,686,807.32 | 2.60 |
| 89 | 300073 | 当升科技 | 21,542,721.48 | 2.58 |
| 90 | 600416 | 湘电股份 | 21,510,176.82 | 2.58 |
| 91 | 601798 | 蓝科高新 | 21,454,819.29 | 2.57 |
| 92 | 601818 | 光大银行 | 21,394,734.48 | 2.57 |
| 93 | 300241 | 瑞丰光电 | 21,368,172.95 | 2.56 |
| 94 | 000776 | 广发证券 | 21,310,666.18 | 2.56 |
| 95 | 600886 | 国投电力 | 21,301,073.15 | 2.55 |
| 96 | 300033 | 同花顺 | 21,265,736.40 | 2.55 |
| 97 | 300295 | 三六五网 | 21,172,816.08 | 2.54 |
| 98 | 600373 | 中文传媒 | 21,165,970.49 | 2.54 |
| 99 | 600129 | 太极集团 | 21,139,403.93 | 2.54 |
| 100 | 600398 | 海澜之家 | 20,955,393.87 | 2.51 |
| 101 | 002099 | 海翔药业 | 20,944,916.08 | 2.51 |
| 102 | 002538 | 司尔特 | 20,869,570.15 | 2.50 |
| 103 | 600485 | 信威集团 | 20,742,619.05 | 2.49 |
| 104 | 002354 | 天神娱乐 | 20,735,672.95 | 2.49 |
| 105 | 002196 | 方正电机 | 20,634,633.99 | 2.47 |
| 106 | 600138 | 中青旅 | 20,585,342.83 | 2.47 |
| 107 | 000042 | 中洲控股 | 20,520,380.25 | 2.46 |
| 108 | 600182 | S 佳通 | 20,458,480.30 | 2.45 |

| | | | | |
|-----|--------|-------|---------------|------|
| 109 | 000637 | 茂化实华 | 20,289,215.16 | 2.43 |
| 110 | 601098 | 中南传媒 | 20,269,737.84 | 2.43 |
| 111 | 002373 | 千方科技 | 20,260,383.88 | 2.43 |
| 112 | 300219 | 鸿利光电 | 20,174,957.29 | 2.42 |
| 113 | 002548 | 金新农 | 20,141,941.53 | 2.42 |
| 114 | 600000 | 浦发银行 | 20,087,349.80 | 2.41 |
| 115 | 002377 | 国创高新 | 20,015,360.21 | 2.40 |
| 116 | 600584 | 长电科技 | 20,010,035.69 | 2.40 |
| 117 | 300210 | 森远股份 | 19,930,738.13 | 2.39 |
| 118 | 000681 | 视觉中国 | 19,920,532.38 | 2.39 |
| 119 | 600273 | 嘉化能源 | 19,871,327.63 | 2.38 |
| 120 | 300275 | 梅安森 | 19,809,816.08 | 2.38 |
| 121 | 600606 | 绿地控股 | 19,766,340.97 | 2.37 |
| 122 | 300050 | 世纪鼎利 | 19,749,635.74 | 2.37 |
| 123 | 600999 | 招商证券 | 19,735,151.31 | 2.37 |
| 124 | 600885 | 宏发股份 | 19,585,216.50 | 2.35 |
| 125 | 000783 | 长江证券 | 19,516,630.93 | 2.34 |
| 126 | 300072 | 三聚环保 | 19,510,671.71 | 2.34 |
| 127 | 002688 | 金河生物 | 19,506,965.28 | 2.34 |
| 128 | 300094 | 国联水产 | 19,498,808.74 | 2.34 |
| 129 | 601218 | 吉鑫科技 | 19,424,738.47 | 2.33 |
| 130 | 600113 | 浙江东日 | 19,397,686.95 | 2.33 |
| 131 | 300071 | 华谊嘉信 | 19,360,119.28 | 2.32 |
| 132 | 600230 | 沧州大化 | 19,340,227.96 | 2.32 |
| 133 | 600475 | 华光股份 | 19,289,556.85 | 2.31 |
| 134 | 000888 | 峨眉山 A | 19,287,676.29 | 2.31 |
| 135 | 600864 | 哈投股份 | 19,246,352.36 | 2.31 |
| 136 | 000537 | 广宇发展 | 19,189,110.45 | 2.30 |
| 137 | 000665 | 湖北广电 | 19,118,106.41 | 2.29 |
| 138 | 000728 | 国元证券 | 19,001,293.29 | 2.28 |
| 139 | 300103 | 达刚路机 | 18,929,552.94 | 2.27 |
| 140 | 000698 | 沈阳化工 | 18,871,552.54 | 2.26 |
| 141 | 002725 | 跃岭股份 | 18,812,314.64 | 2.26 |
| 142 | 002718 | 友邦吊顶 | 18,739,451.60 | 2.25 |
| 143 | 000887 | 中鼎股份 | 18,730,485.95 | 2.25 |
| 144 | 601700 | 风范股份 | 18,571,700.80 | 2.23 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 145 | 601908 | 京运通 | 18,537,476.79 | 2.22 |
| 146 | 600480 | 凌云股份 | 18,488,761.37 | 2.22 |
| 147 | 002003 | 伟星股份 | 18,486,463.14 | 2.22 |
| 148 | 000930 | 中粮生化 | 18,483,060.50 | 2.22 |
| 149 | 600757 | 长江传媒 | 18,405,860.18 | 2.21 |
| 150 | 601999 | 出版传媒 | 18,314,042.88 | 2.20 |
| 151 | 002090 | 金智科技 | 18,313,407.81 | 2.20 |
| 152 | 600470 | 六国化工 | 18,122,202.27 | 2.17 |
| 153 | 300195 | 长荣股份 | 18,046,204.37 | 2.16 |
| 154 | 601222 | 林洋能源 | 18,002,168.55 | 2.16 |
| 155 | 002157 | 正邦科技 | 17,946,565.27 | 2.15 |
| 156 | 300301 | 长方照明 | 17,927,888.79 | 2.15 |
| 157 | 002452 | 长高集团 | 17,895,209.48 | 2.15 |
| 158 | 600159 | 大龙地产 | 17,818,787.86 | 2.14 |
| 159 | 002059 | 云南旅游 | 17,790,240.65 | 2.13 |
| 160 | 600006 | 东风汽车 | 17,786,102.25 | 2.13 |
| 161 | 002394 | 联发股份 | 17,695,164.67 | 2.12 |
| 162 | 002309 | 中利科技 | 17,584,281.41 | 2.11 |
| 163 | 300324 | 旋极信息 | 17,572,268.29 | 2.11 |
| 164 | 300336 | 新文化 | 17,558,678.33 | 2.11 |
| 165 | 002623 | 亚玛顿 | 17,503,690.95 | 2.10 |
| 166 | 601288 | 农业银行 | 17,406,488.68 | 2.09 |
| 167 | 002665 | 首航节能 | 17,384,785.96 | 2.09 |
| 168 | 002546 | 新联电子 | 17,374,739.96 | 2.08 |
| 169 | 600487 | 亨通光电 | 17,365,551.33 | 2.08 |
| 170 | 000400 | 许继电气 | 17,360,461.88 | 2.08 |
| 171 | 002028 | 思源电气 | 17,338,553.44 | 2.08 |
| 172 | 600560 | 金自天正 | 17,257,874.37 | 2.07 |
| 173 | 600036 | 招商银行 | 17,246,090.76 | 2.07 |
| 174 | 000957 | 中通客车 | 17,235,552.85 | 2.07 |
| 175 | 002579 | 中京电子 | 17,218,477.51 | 2.07 |
| 176 | 300269 | 联建光电 | 17,195,439.83 | 2.06 |
| 177 | 002356 | 浩宁达 | 17,181,142.94 | 2.06 |
| 178 | 002531 | 天顺风能 | 17,026,509.82 | 2.04 |
| 179 | 002045 | 国光电器 | 16,993,839.15 | 2.04 |
| 180 | 601328 | 交通银行 | 16,916,538.51 | 2.03 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 181 | 002606 | 大连电瓷 | 16,875,423.41 | 2.02 |
| 182 | 000488 | 晨鸣纸业 | 16,846,072.61 | 2.02 |
| 183 | 002267 | 陕天然气 | 16,811,762.11 | 2.02 |
| 184 | 601398 | 工商银行 | 16,747,975.20 | 2.01 |
| 185 | 300139 | 晓程科技 | 16,693,163.21 | 2.00 |
| 186 | 300335 | 迪森股份 | 16,691,351.77 | 2.00 |
| 187 | 600851 | 海欣股份 | 16,690,291.58 | 2.00 |

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|---------------|----------------|
| 1 | 300258 | 精锻科技 | 57,760,303.11 | 6.93 |
| 2 | 601628 | 中国人寿 | 56,151,484.67 | 6.73 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 50,257,881.41 | 6.03 |
| 4 | 601601 | 中国太保 | 49,461,221.35 | 5.93 |
| 5 | 600810 | 神马股份 | 48,661,973.30 | 5.84 |
| 6 | 300286 | 安科瑞 | 44,448,298.94 | 5.33 |
| 7 | 002039 | 黔源电力 | 43,655,360.51 | 5.24 |
| 8 | 300227 | 光韵达 | 42,920,362.13 | 5.15 |
| 9 | 601336 | 新华保险 | 42,750,175.14 | 5.13 |
| 10 | 601555 | 东吴证券 | 42,676,607.76 | 5.12 |
| 11 | 300265 | 通光线缆 | 41,351,210.03 | 4.96 |
| 12 | 600369 | 西南证券 | 38,927,460.41 | 4.67 |
| 13 | 000911 | 南宁糖业 | 37,397,108.92 | 4.49 |
| 14 | 300076 | GQY 视讯 | 36,776,970.17 | 4.41 |
| 15 | 002386 | 天原集团 | 36,743,543.69 | 4.41 |
| 16 | 600606 | 绿地控股 | 36,541,093.90 | 4.38 |
| 17 | 000686 | 东北证券 | 34,972,189.17 | 4.19 |
| 18 | 002321 | 华英农业 | 34,739,124.04 | 4.17 |
| 19 | 000930 | 中粮生化 | 34,332,091.26 | 4.12 |
| 20 | 000798 | 中水渔业 | 34,226,159.51 | 4.11 |
| 21 | 000639 | 西王食品 | 33,780,549.20 | 4.05 |
| 22 | 600697 | 欧亚集团 | 32,743,233.89 | 3.93 |
| 23 | 600529 | 山东药玻 | 32,224,299.20 | 3.86 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 24 | 600291 | 西水股份 | 32,039,679.56 | 3.84 |
| 25 | 002090 | 金智科技 | 31,954,209.68 | 3.83 |
| 26 | 300282 | 汇冠股份 | 31,797,161.99 | 3.81 |
| 27 | 002567 | 唐人神 | 31,186,149.10 | 3.74 |
| 28 | 300180 | 华峰超纤 | 30,544,545.61 | 3.66 |
| 29 | 600290 | 华仪电气 | 30,098,046.06 | 3.61 |
| 30 | 601377 | 兴业证券 | 30,027,286.59 | 3.60 |
| 31 | 601688 | 华泰证券 | 29,836,711.25 | 3.58 |
| 32 | 300094 | 国联水产 | 29,336,697.02 | 3.52 |
| 33 | 601677 | 明泰铝业 | 29,138,137.48 | 3.49 |
| 34 | 002601 | 佰利联 | 28,930,872.89 | 3.47 |
| 35 | 600006 | 东风汽车 | 28,851,560.99 | 3.46 |
| 36 | 600837 | 海通证券 | 28,704,581.17 | 3.44 |
| 37 | 300033 | 同花顺 | 28,510,734.28 | 3.42 |
| 38 | 300281 | 金明精机 | 27,898,652.47 | 3.35 |
| 39 | 300118 | 东方日升 | 27,668,075.48 | 3.32 |
| 40 | 600827 | 百联股份 | 27,380,574.67 | 3.28 |
| 41 | 600373 | 中文传媒 | 27,325,633.74 | 3.28 |
| 42 | 000551 | 创元科技 | 27,243,240.21 | 3.27 |
| 43 | 600272 | 开开实业 | 27,213,004.33 | 3.26 |
| 44 | 600487 | 亨通光电 | 26,802,476.35 | 3.21 |
| 45 | 002531 | 天顺风能 | 26,725,057.25 | 3.21 |
| 46 | 600016 | 民生银行 | 26,606,325.64 | 3.19 |
| 47 | 600686 | 金龙汽车 | 26,584,070.39 | 3.19 |
| 48 | 000001 | 平安银行 | 26,553,265.43 | 3.18 |
| 49 | 600345 | 长江通信 | 26,226,084.20 | 3.15 |
| 50 | 002238 | 天威视讯 | 26,151,080.46 | 3.14 |
| 51 | 300357 | 我武生物 | 25,859,212.42 | 3.10 |
| 52 | 002445 | 中南重工 | 25,768,474.79 | 3.09 |
| 53 | 000042 | 中洲控股 | 25,747,043.58 | 3.09 |
| 54 | 600015 | 华夏银行 | 25,726,544.00 | 3.09 |
| 55 | 000533 | 万家乐 | 25,655,820.61 | 3.08 |
| 56 | 600030 | 中信证券 | 25,610,578.49 | 3.07 |
| 57 | 002566 | 益盛药业 | 25,530,850.54 | 3.06 |
| 58 | 002157 | 正邦科技 | 25,495,189.86 | 3.06 |
| 59 | 002533 | 金杯电工 | 25,376,348.56 | 3.04 |
| 60 | 002665 | 首航节能 | 25,324,091.27 | 3.04 |
| 61 | 000951 | 中国重汽 | 25,211,020.71 | 3.02 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 62 | 600115 | 东方航空 | 25,170,136.53 | 3.02 |
| 63 | 000910 | 大亚科技 | 25,160,398.75 | 3.02 |
| 64 | 000713 | 丰乐种业 | 25,064,102.65 | 3.01 |
| 65 | 601166 | 兴业银行 | 25,048,839.42 | 3.00 |
| 66 | 002521 | 齐峰新材 | 24,975,811.87 | 3.00 |
| 67 | 002142 | 宁波银行 | 24,967,062.27 | 2.99 |
| 68 | 002434 | 万里扬 | 24,910,871.79 | 2.99 |
| 69 | 601009 | 南京银行 | 24,904,676.95 | 2.99 |
| 70 | 600029 | 南方航空 | 24,693,682.09 | 2.96 |
| 71 | 300103 | 达刚路机 | 24,237,566.58 | 2.91 |
| 72 | 300375 | 鹏翎股份 | 24,222,723.30 | 2.91 |
| 73 | 002300 | 太阳电缆 | 24,182,717.71 | 2.90 |
| 74 | 600521 | 华海药业 | 24,156,863.88 | 2.90 |
| 75 | 600551 | 时代出版 | 24,123,323.36 | 2.89 |
| 76 | 600886 | 国投电力 | 24,112,214.89 | 2.89 |
| 77 | 002673 | 西部证券 | 23,998,651.16 | 2.88 |
| 78 | 000681 | 视觉中国 | 23,956,509.01 | 2.87 |
| 79 | 601908 | 京运通 | 23,770,228.34 | 2.85 |
| 80 | 600101 | 明星电力 | 23,728,013.24 | 2.85 |
| 81 | 000887 | 中鼎股份 | 23,476,210.15 | 2.82 |
| 82 | 600398 | 海澜之家 | 23,342,295.63 | 2.80 |
| 83 | 600416 | 湘电股份 | 23,323,886.32 | 2.80 |
| 84 | 600182 | S 佳通 | 23,267,910.02 | 2.79 |
| 85 | 300150 | 世纪瑞尔 | 23,243,693.71 | 2.79 |
| 86 | 002373 | 千方科技 | 23,134,031.99 | 2.77 |
| 87 | 601998 | 中信银行 | 23,090,181.67 | 2.77 |
| 88 | 002218 | 拓日新能 | 22,943,623.78 | 2.75 |
| 89 | 300295 | 三六五网 | 22,921,762.45 | 2.75 |
| 90 | 000671 | 阳光城 | 22,865,147.36 | 2.74 |
| 91 | 600885 | 宏发股份 | 22,820,035.84 | 2.74 |
| 92 | 000758 | 中色股份 | 22,777,854.72 | 2.73 |
| 93 | 600851 | 海欣股份 | 22,606,213.47 | 2.71 |
| 94 | 300224 | 正海磁材 | 22,598,992.20 | 2.71 |
| 95 | 002674 | 兴业科技 | 22,467,418.92 | 2.69 |
| 96 | 000850 | 华茂股份 | 22,450,013.43 | 2.69 |
| 97 | 002333 | 罗普斯金 | 22,413,071.61 | 2.69 |
| 98 | 600829 | 人民同泰 | 22,378,270.56 | 2.68 |
| 99 | 600159 | 大龙地产 | 22,312,417.10 | 2.68 |

| | | | | |
|-----|--------|-------|---------------|------|
| 100 | 000637 | 茂化实华 | 22,286,517.92 | 2.67 |
| 101 | 002309 | 中利科技 | 22,201,296.82 | 2.66 |
| 102 | 600857 | 宁波中百 | 22,012,052.88 | 2.64 |
| 103 | 000066 | 长城电脑 | 21,973,477.09 | 2.64 |
| 104 | 600505 | 西昌电力 | 21,956,747.73 | 2.63 |
| 105 | 000783 | 长江证券 | 21,923,602.72 | 2.63 |
| 106 | 000572 | 海马汽车 | 21,893,569.79 | 2.63 |
| 107 | 002099 | 海翔药业 | 21,872,096.25 | 2.62 |
| 108 | 600742 | 一汽富维 | 21,843,283.79 | 2.62 |
| 109 | 002538 | 司尔特 | 21,703,613.35 | 2.60 |
| 110 | 600273 | 嘉化能源 | 21,646,232.44 | 2.60 |
| 111 | 002546 | 新联电子 | 21,638,851.08 | 2.60 |
| 112 | 601098 | 中南传媒 | 21,499,881.82 | 2.58 |
| 113 | 002613 | 北玻股份 | 21,428,557.41 | 2.57 |
| 114 | 300291 | 华录百纳 | 21,408,225.42 | 2.57 |
| 115 | 000756 | 新华制药 | 21,381,659.54 | 2.56 |
| 116 | 600584 | 长电科技 | 21,277,116.31 | 2.55 |
| 117 | 601218 | 吉鑫科技 | 21,262,911.59 | 2.55 |
| 118 | 601818 | 光大银行 | 21,244,208.10 | 2.55 |
| 119 | 002433 | 太安堂 | 21,234,327.31 | 2.55 |
| 120 | 600999 | 招商证券 | 21,136,456.77 | 2.54 |
| 121 | 600757 | 长江传媒 | 21,091,556.72 | 2.53 |
| 122 | 300336 | 新文化 | 20,951,330.52 | 2.51 |
| 123 | 600480 | 凌云股份 | 20,914,134.63 | 2.51 |
| 124 | 002003 | 伟星股份 | 20,749,196.23 | 2.49 |
| 125 | 002059 | 云南旅游 | 20,715,494.43 | 2.48 |
| 126 | 600000 | 浦发银行 | 20,604,450.39 | 2.47 |
| 127 | 600483 | 福能股份 | 20,548,907.60 | 2.46 |
| 128 | 600428 | 中远航运 | 20,533,924.04 | 2.46 |
| 129 | 601999 | 出版传媒 | 20,500,318.57 | 2.46 |
| 130 | 000957 | 中通客车 | 20,482,893.86 | 2.46 |
| 131 | 002394 | 联发股份 | 20,430,187.23 | 2.45 |
| 132 | 002045 | 国光电器 | 20,215,840.54 | 2.42 |
| 133 | 000776 | 广发证券 | 20,109,471.52 | 2.41 |
| 134 | 000888 | 峨眉山 A | 20,100,442.54 | 2.41 |
| 135 | 300115 | 长盈精密 | 20,096,695.50 | 2.41 |
| 136 | 300071 | 华谊嘉信 | 20,094,753.64 | 2.41 |
| 137 | 600661 | 新南洋 | 19,922,355.08 | 2.39 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 138 | 002623 | 亚玛顿 | 19,854,406.15 | 2.38 |
| 139 | 300072 | 三聚环保 | 19,729,417.12 | 2.37 |
| 140 | 600230 | 沧州大化 | 19,715,834.70 | 2.36 |
| 141 | 600475 | 华光股份 | 19,672,407.86 | 2.36 |
| 142 | 601111 | 中国国航 | 19,670,617.50 | 2.36 |
| 143 | 000400 | 许继电气 | 19,637,722.05 | 2.36 |
| 144 | 300182 | 捷成股份 | 19,576,533.10 | 2.35 |
| 145 | 300335 | 迪森股份 | 19,533,731.12 | 2.34 |
| 146 | 601798 | 蓝科高新 | 19,482,353.50 | 2.34 |
| 147 | 300324 | 旋极信息 | 19,381,709.44 | 2.32 |
| 148 | 000712 | 锦龙股份 | 19,349,802.46 | 2.32 |
| 149 | 000550 | 江铃汽车 | 19,338,070.17 | 2.32 |
| 150 | 002452 | 长高集团 | 19,331,826.82 | 2.32 |
| 151 | 002028 | 思源电气 | 19,197,044.33 | 2.30 |
| 152 | 300305 | 裕兴股份 | 19,195,014.13 | 2.30 |
| 153 | 600138 | 中青旅 | 19,080,255.40 | 2.29 |
| 154 | 002354 | 天神娱乐 | 19,056,387.04 | 2.29 |
| 155 | 600470 | 六国化工 | 19,022,224.66 | 2.28 |
| 156 | 300050 | 世纪鼎利 | 19,014,001.90 | 2.28 |
| 157 | 000402 | 金融街 | 19,004,931.64 | 2.28 |
| 158 | 600162 | 香江控股 | 18,981,431.80 | 2.28 |
| 159 | 300073 | 当升科技 | 18,900,681.32 | 2.27 |
| 160 | 300121 | 阳谷华泰 | 18,874,855.95 | 2.26 |
| 161 | 300323 | 华灿光电 | 18,816,836.45 | 2.26 |
| 162 | 002196 | 方正电机 | 18,762,858.29 | 2.25 |
| 163 | 002736 | 国信证券 | 18,754,347.92 | 2.25 |
| 164 | 300232 | 洲明科技 | 18,591,959.71 | 2.23 |
| 165 | 300219 | 鸿利光电 | 18,580,688.24 | 2.23 |
| 166 | 000952 | 广济药业 | 18,566,315.18 | 2.23 |
| 167 | 002610 | 爱康科技 | 18,509,895.45 | 2.22 |
| 168 | 600063 | 皖维高新 | 18,499,467.98 | 2.22 |
| 169 | 601058 | 赛轮金宇 | 18,427,030.32 | 2.21 |
| 170 | 002377 | 国创高新 | 18,416,307.06 | 2.21 |
| 171 | 002688 | 金河生物 | 18,382,318.10 | 2.20 |
| 172 | 600485 | 信威集团 | 18,317,015.86 | 2.20 |
| 173 | 300269 | 联建光电 | 18,254,045.92 | 2.19 |
| 174 | 601099 | 太平洋 | 18,234,512.71 | 2.19 |
| 175 | 002547 | 春兴精工 | 18,198,459.24 | 2.18 |

| | | | | |
|-----|--------|-------|---------------|------|
| 176 | 600560 | 金白天正 | 18,177,719.33 | 2.18 |
| 177 | 002290 | 禾盛新材 | 18,154,196.24 | 2.18 |
| 178 | 000608 | 阳光股份 | 18,128,775.05 | 2.17 |
| 179 | 600864 | 哈投股份 | 18,089,887.26 | 2.17 |
| 180 | 002661 | 克明面业 | 18,038,155.59 | 2.16 |
| 181 | 000011 | 深物业 A | 17,933,373.38 | 2.15 |
| 182 | 000918 | 嘉凯城 | 17,832,116.73 | 2.14 |
| 183 | 600113 | 浙江东日 | 17,827,834.90 | 2.14 |
| 184 | 000728 | 国元证券 | 17,776,249.85 | 2.13 |
| 185 | 002649 | 博彦科技 | 17,674,092.71 | 2.12 |
| 186 | 000665 | 湖北广电 | 17,598,749.12 | 2.11 |
| 187 | 002012 | 凯恩股份 | 17,498,840.90 | 2.10 |
| 188 | 002382 | 蓝帆医疗 | 17,493,096.15 | 2.10 |
| 189 | 002643 | 万润股份 | 17,458,426.10 | 2.09 |
| 190 | 300136 | 信维通信 | 17,453,952.34 | 2.09 |
| 191 | 601288 | 农业银行 | 17,366,637.75 | 2.08 |
| 192 | 300301 | 长方照明 | 17,330,736.76 | 2.08 |
| 193 | 000786 | 北新建材 | 17,231,551.93 | 2.07 |
| 194 | 300275 | 梅安森 | 17,117,197.17 | 2.05 |
| 195 | 002458 | 益生股份 | 17,059,537.83 | 2.05 |
| 196 | 600322 | 天房发展 | 16,988,174.81 | 2.04 |
| 197 | 600367 | 红星发展 | 16,876,071.94 | 2.02 |
| 198 | 600036 | 招商银行 | 16,799,492.83 | 2.01 |

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。

8.4.3 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 | 9,631,539,100.90 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 9,507,367,510.93 |

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

单位：人民币元

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|-------------------|--------------------------|----------|---------------|-------------|---------------|
| IC1601 | 中证 500 股指期货 IC1601 合约 | 55 | 81,389,000.00 | -155,204.66 | - |
| IF1601 | 沪深 300 股指期货 IF1601 合约 | 1 | 1,101,840.00 | -9,176.25 | - |
| IC1601 | 中证 500 股指期货 IC1601 合约 | -1 | -1,479,800.00 | 21,550.00 | - |
| IF1601 | 沪深 300 股指期货 IF1601 合约 | -1 | -1,101,840.00 | 20,902.50 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | -121,928.41 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | 20,970,568.41 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | -121,928.41 |

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，将利用股指期货剥离多头股票资产部分的系统性风险或建立适当的股指期货多头头寸对冲市场向上风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。

本基金投资于股指期货，剥离系统性风险，大幅降低净值波动率，符合既定的投资政策和投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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 | 17,074,390.43 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 26,738.09 |
| 5 | 应收申购款 | 934,086.59 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 18,035,215.11 |

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|---------------|---------------|----------|
| 1 | 000813 | 天山纺织 | 12,403,020.34 | 1.49 | 重大事项 |

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 |
| 13,213 | 46,283.52 | 59,816,046.73 | 9.78% | 551,728,129.32 | 90.22% |

9.2 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 | 33,561.91 | 0.0055% |

9.3 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 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日 (2015 年 2 月 13 日) 基金份额总额 | 1,931,765,423.15 |
| 本报告期期初基金份额总额 | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 1,143,501,394.46 |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 2,463,722,641.56 |

| | |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 611,544,176.05 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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 2015 年 4 月 28 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》，聘任刘建先生为公司副总经理。

2. 本公司于 2015 年 5 月 16 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》，刘青山先生因个人原因辞去公司总经理职务，由公司副总经理傅国庆先生于 5 月 15 日起代任总经理职务。

3. 本公司于 2015 年 8 月 15 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》，聘任刘建先生为公司总经理。

4. 本公司于 2015 年 12 月 4 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》，聘任王彦杰先生为公司副总经理。

5. 2015 年 4 月，李爱华不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本年度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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金无投资策略的变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用为人民币 100,000 元，该审计机构对本基金提供审计服务的连续年限为 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、本基金托管人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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 | |
| 中信证券 | 2 | 4,412,147,093.47 | 23.05% | 4,016,829.67 | 22.88% | - |
| 光大证券 | 1 | 3,128,294,117.11 | 16.35% | 2,857,694.58 | 16.28% | - |
| 方正证券 | 1 | 2,233,983,046.90 | 11.67% | 2,065,378.28 | 11.76% | - |
| 中信建投 | 2 | 1,600,392,376.68 | 8.36% | 1,463,900.46 | 8.34% | - |
| 东方证券 | 2 | 1,573,126,158.39 | 8.22% | 1,458,585.01 | 8.31% | - |
| 广发证券 | 2 | 1,336,354,648.24 | 6.98% | 1,226,795.09 | 6.99% | - |
| 财富证券 | 2 | 889,241,381.53 | 4.65% | 824,955.76 | 4.70% | - |
| 中银国际 | 2 | 875,626,736.85 | 4.58% | 797,170.79 | 4.54% | - |
| 国金证券 | 1 | 764,319,734.67 | 3.99% | 711,007.00 | 4.05% | - |
| 华泰证券 | 2 | 688,542,851.36 | 3.60% | 632,700.49 | 3.60% | - |
| 银河证券 | 2 | 576,763,162.64 | 3.01% | 525,081.85 | 2.99% | - |
| 申万宏源 | 1 | 474,706,238.84 | 2.48% | 432,173.96 | 2.46% | - |
| 国泰君安 | 1 | 366,527,112.91 | 1.92% | 341,347.16 | 1.94% | - |
| 招商证券 | 1 | 153,422,099.94 | 0.80% | 142,881.51 | 0.81% | - |
| 中金公司 | 2 | 65,356,127.30 | 0.34% | 59,500.34 | 0.34% | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源西部 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 九州证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 东海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 南京证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中山证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 财达证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：（一）2015 年本基金交易单元均为新增。

（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。

11.7.2 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 |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | 500,000,000.00 | 35.71% | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 财富证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | 900,000,000.00 | 64.29% | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------|---|---|---|---|---|---|
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源西部 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 九州证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 南京证券 | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中山证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | - | - | - | - | - | - |
| 财达证券 | - | - | - | - | - | - |

泰达宏利基金管理有限公司
2016 年 3 月 30 日