

泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。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 2016 年 8 月 25 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 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	42

§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
8.4 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.....	44
§9 开放式基金份额变动	45
§10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	47
§11 备查文件目录	48
11.1 备查文件目录.....	48
11.2 存放地点.....	48
11.3 查阅方式.....	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金		
基金简称	泰达宏利 500 指数分级		
基金主代码	162216		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011 年 12 月 1 日		
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	64,903,571.91 份		
基金合同存续期	持续经营		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2011-12-22		
下属分级基金的基金简称	泰达 500A	泰达 500B	泰达中证 500
下属分级基金的交易代码	150053	150054	162216
报告期末下属分级基金份额总额	5,897,464.00 份	8,846,196.00 份	50,159,911.91 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证 500 指数，力争获取与标的指数相似的投资收益，并将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。		
投资策略	本基金采用指数完全复制方法，原则上按照标的指数成份股及权重构建基金的投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整，以达到跟踪和复制指数的目的。但如遇特殊情况（如市场流动性不足、成份股被限制投资等）致使基金无法购得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理的方法进行适当替代，以实现跟踪误差的有效控制		
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times 1 \text{ 年期定期存款利率（税后）}$		
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。		
下属分级基金的风险收益特征	泰达 500A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征	泰达 500B 份额具有高风险、高预期收益的特征	

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	
注册地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层	北京市西城区复兴门内大街 1 号	
办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层	北京市西城区复兴门内大街 1 号	
邮政编码	100033	100818	
法定代表人	弓劲梅	田国立	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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、基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-3, 898, 453. 66
本期利润	-3, 283, 766. 13
加权平均基金份额本期利润	-0. 0537
本期加权平均净值利润率	-6. 13%
本期基金份额净值增长率	-10. 04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	31, 632, 242. 23
期末可供分配基金份额利润	0. 4874

期末基金资产净值	60,964,787.72
期末基金份额净值	0.9393
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	106.83%

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

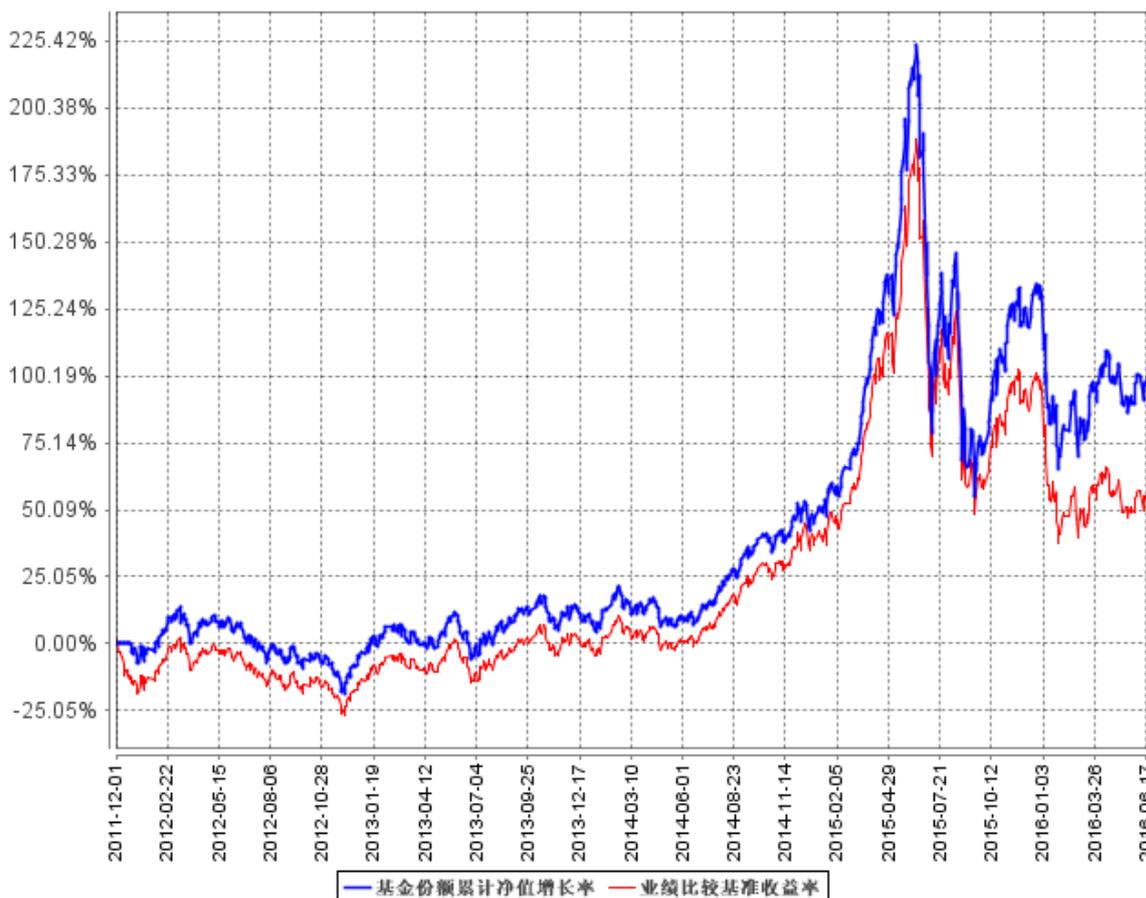
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.74%	1.40%	2.83%	1.47%	1.91%	-0.07%
过去三个月	4.44%	1.58%	-0.44%	1.57%	4.88%	0.01%
过去六个月	-10.04%	2.55%	-18.54%	2.43%	8.50%	0.12%
过去一年	-17.19%	3.08%	-29.53%	2.77%	12.34%	0.31%
过去三年	116.95%	2.18%	85.47%	2.03%	31.48%	0.15%
自基金合同生效起至今	106.83%	1.94%	59.17%	1.85%	47.66%	0.09%

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



注：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：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（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、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、泰达宏利多元回报债券型证券投资基金、泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型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， 金融工程部总经理	2012 年 8 月 14 日	2016 年 3 月 16 日	9	理学硕士；2007 年 7 月至 2008 年 12 月就职于工银瑞信基金管理有限公司；2008 年 12 月至 2011 年 7 月就职于嘉实基金管理有限公司；2011 年 7 月加盟泰达宏利基金管理有限公司，担任产品与金融工程部高级研究员；现任金融工程部总经理。具备 9 年基金从业经验，9 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
杨超	本基金基金经理	2014 年 10 月 13 日	-	6	毕业于英国威尔士斯旺西大学，数学与金融计算硕士。2010 年 5

					月加入建信基金管理有限公司，从事金融工程等工作，先后担任投资管理部助理研究员、初级研究员、基金经理助理等职务。2014 年 6 月加入泰达宏利基金管理有限公司。具备 6 年证券基金从业经验，6 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。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。本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况共出现了 2 次。2 次涉及的投

投资组合一方均为按照量化策略进行投资，虽然买卖股票量少，但由于个股流动性较差，交易量小，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%，未发现异常。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构处罚的情况。

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

上半年整体市场预期围绕在经济增速下行和企业盈利预期下降的情绪中，中小盘股票持续调整，整体估值水平不断下移，在供给侧改革的推进下，传统行业在局部有着结构性的行情，同时消费股和其他概念板块较为活跃，中证 500 指数上半年下跌 19.61%，基金业绩比较基准下跌 18.54%，本基金积极采用量化策略对组合进行优化管理，在市场大幅波动和结构性行情频繁切换的市场环境下积极调整，在把跟踪误差控制在较低水平的前提下，为基金创造了 8.50%的超额收益。

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 0.9393 元，本报告期份额净值增长率为-10.04%，同期业绩比较基准增长率为-18.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，整体宏观环境将围绕在供给侧改革的深入推进和新的经济增长点出现两大主线运行，同时全球经济环境也将面临更多的不确定性的冲击，本基金将恪守基金合同约定，持续积极管理跟踪误差。

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

根据本基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括中证 500、泰达 500A、泰达 500B）不进行收益分配。

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”）在对泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金（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：泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
----	-----	------------------------	--------------------------

资产:			
银行存款	6.4.7.1	4,735,512.78	2,762,424.42
结算备付金		1,641,312.82	220,452.88
存出保证金		964,827.40	170,743.52
交易性金融资产	6.4.7.2	52,657,792.61	48,544,358.75
其中: 股票投资		52,657,792.61	48,544,358.75
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,843,680.45	-
应收利息	6.4.7.5	1,744.47	690.32
应收股利		-	-
应收申购款		68,099.48	67,126.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		61,912,970.01	51,765,796.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		661,889.40	91,347.75
应付管理人报酬		49,221.00	44,311.06
应付托管费		9,844.21	8,862.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	146,739.92	111,937.88
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	80,487.76	129,044.95
负债合计		948,182.29	385,503.86
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	29,332,545.49	22,267,959.96
未分配利润	6.4.7.10	31,632,242.23	29,112,332.22
所有者权益合计		60,964,787.72	51,380,292.18
负债和所有者权益总计		61,912,970.01	51,765,796.04

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，中证 500 份额净值 0.9393 元，泰达 500A 份额净值 1.0246 元，泰达 500B 份额净值 0.8824 元； 基金份额总额 64,903,571.91 份，其中中证 500 份额 50,159,911.91 份，泰达 500A 份额 5,897,464.00 份，泰达 500B 份额 8,846,196.00 份。

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-2,483,871.51	67,739,265.67
1.利息收入		20,172.02	33,186.83
其中：存款利息收入	6.4.7.11	20,172.02	33,186.83
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）		-3,162,551.60	76,044,669.74
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,474,055.48	75,489,059.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	22,920.00	-
股利收益	6.4.7.16	288,583.88	555,610.33
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	614,687.53	-8,839,359.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	43,820.54	500,768.17
减：二、费用		799,894.62	2,309,898.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	265,477.79	624,377.32
2. 托管费	6.4.10.2.2	53,095.54	124,875.47
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	388,758.67	1,442,787.96
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	92,562.62	117,857.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,283,766.13	65,429,366.95

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,283,766.13	65,429,366.95

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	22,267,959.96	29,112,332.22	51,380,292.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,283,766.13	-3,283,766.13
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）	7,064,585.53	5,803,676.14	12,868,261.67
其中：1.基金申购款	24,981,898.13	23,339,112.45	48,321,010.58
2.基金赎回款	-17,917,312.60	-17,535,436.31	-35,452,748.91
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）	29,332,545.49	31,632,242.23	60,964,787.72
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	60,539,775.99	28,054,978.63	88,594,754.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	65,429,366.95	65,429,366.95
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）	-19,197,494.81	-31,200,143.33	-50,397,638.14

其中：1.基金申购款	138,777,080.77	213,542,218.43	352,319,299.20
2.基金赎回款	-157,974,575.58	-244,742,361.76	-402,716,937.34
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）	41,342,281.18	62,284,202.25	103,626,483.43

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：

<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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金(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[2011]第 1338 号《关于核准泰达宏利中证 500 指数分级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《泰达宏利中证 500 指数分级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 1,435,113,080.87 元,业经普华永道中天会计师事务所普华永道中天验字(2011)第 466 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》于 2011 年 12 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,435,467,765.48 份基金份额,其中认购资金利息折合 354,684.61 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《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》和《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金的基金份额包括泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金之基础份额(简称“泰达中证 500 份额”)、泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额与泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金之进取收益类份额。根据本基金管理人 2015 年 6 月 25 日发布的《关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金变更场内基金简称的公告》,本基金自 2015 年 6 月 26 日起变更子份额的场内简称,泰达中证 500 之泰达稳健份额的简称由泰达稳健份额变更为泰达 500A 份额,泰达中证 500 之泰达进取份额的简称由泰达进取份额变更为泰达 500B 份额。其中,泰达 500A 份额、泰达 500B 份额的基金份额配比始终保持

4:6 的比率不变。本基金通过场外、场内两种方式公开发售。本基金发售结束后，投资者场外认购的全部份额将确认为泰达中证 500 份额；投资者场内认购的全部将按 4:6 的比率自动分离为预期收益与风险不同的两种份额类别，即泰达 500A 份额和泰达 500B 份额。两类基金份额的基金资产合并运作。泰达中证 500 份额只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。泰达 500A 份额和泰达 500B 份额只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。本基金在每个工作日按基金合同约定的净值计算规则对泰达 500A 份额和泰达 500B 份额分别进行参考净值计算，本基金净资产优先确保泰达 500A 份额的本金及泰达 500A 份额累计约定日应得收益；本基金在优先确保泰达 500A 份额的本金及累计约定日应得收益后的剩余净资产计为泰达 500B 份额的净资产。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2011]第 379 号文审核同意，本基金泰达 500A 份额 74,125,804.00 份，泰达 500B 份额 111,188,706.00 份，于 2011 年 12 月 22 日在深交所挂牌交易。未上市交易的泰达中证 500 份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后，选择将泰达中证 500 份额拆分为泰达 500A 份额和泰达 500B 份额后即可上市流通。

在泰达 500A 份额、泰达中证 500 份额存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日，本基金将根据基金合同的规定进行基金的定期份额折算。在基金份额折算前与折算后，泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的份额配比保持 4:6 的比例。对于泰达 500A 份额期末的约定应得收益，即泰达 500A 份额每个会计年度 12 月 31 日份额参考净值超出 1.0000 元部分，将折算为泰达中证 500 份额的场内份额分配给泰达 500A 份额持有人。除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行不定期份额折算，即：当泰达中证 500 份额净值大于或等于 2.0000 元；当泰达 500B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元。当泰达中证 500 份额的基金份额净值大于或等于 2.0000 元后，本基金将分别对泰达 500A 份额、泰达 500B 份额和泰达中证 500 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的比例为 4:6，份额折算后泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的参考净值以及泰达中证 500 份额的基金份额净值均调整为 1.0000 元。当泰达 500B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元后，本基金将分别对泰达 500A 份额、泰达 500B 份额和泰达中证 500 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的比例为 4:6，份额折算后泰达中证 500 份额净值、泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.0000 元。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本金的投资目标是紧密跟踪中证 500 指数，力争获取与标的指数相似的投资收益。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、

新股、固定收益产品、货币市场工具、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)占基金资产的比例为 85%-100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；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。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times 1 \text{ 年期定期存款利率 (税后)}$ 。

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 8 月 29 日批准报出。

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》、《泰达宏利中证 500 指数分级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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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

本报告期内本基金无会计政策的变更。

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

本报告期内本基金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》[适用于

CEF)/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》[适用于 OEF]、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	4,735,512.78
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	4,735,512.78

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	52,808,594.21	52,657,792.61	-150,801.60
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	52,808,594.21	52,657,792.61	-150,801.60

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	4,696,160.00	-	-	
其中：股指期货投资	4,696,160.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	4,696,160.00	-	-	

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况如下所示(买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示)：

代码	名称	持仓量(买/卖) (单位：手)	合约市值	公允价值变动
IC1609	中证500股指期货 IC1609 合约	4	4,696,160.00	324,120.00
总额合计				324,120.00
减：可抵销期货暂收款				324,120.00
期货投资净额				-

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末买入返售金融资产无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	983.91
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	93.52
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.12
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	666.92
合计	1,744.47

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	146,739.92
银行间市场应付交易费用	-
合计	146,739.92

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,469.88

预提费用	75,087.74
指数使用费	2,930.14
合计	80,487.76

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,434,460.99	22,267,959.96
本期申购	246,902.90	113,512.48
本期赎回(以“-”号填列)	-153,989.96	-70,796.18
2016 年 1 月 4 日 基金拆分/份额折算前	48,527,373.93	22,310,676.26
基金拆分/份额折算变动份额	838,715.49	-
本期申购	55,025,673.18	24,868,385.65
本期赎回(以“-”号填列)	-39,488,190.69	-17,846,516.42
本期末	64,903,571.91	29,332,545.49

注：（1）根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金于 2016 年 1 月 4 日进行了定期折算，详情请见泰达宏利基金管理有限公司发布的相关份额折算公告。

（2）截至 2016 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 16,852,658.00 份，其中泰达中证 500 基金 2,108,998.00 份，泰达 500A 5,897,464.00 份，泰达 500B 8,846,196.00 份；托管在场外未上市交易的中证 500 的基金份额为 48,050,913.91 份。泰达中证 500 份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。泰达 500A 份额和泰达 500B 份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	29,388,707.59	-276,375.37	29,112,332.22
本期利润	-3,898,453.66	614,687.53	-3,283,766.13
本期基金份额交易产生的变动数	8,768,539.22	-2,964,863.08	5,803,676.14
其中：基金申购款	29,887,101.29	-6,547,988.84	23,339,112.45
基金赎回款	-21,118,562.07	3,583,125.76	-17,535,436.31

本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,258,793.15	-2,626,550.92	31,632,242.23

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	14,047.75
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,716.51
其他	4,407.76
合计	20,172.02

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	125,244,804.87
减：卖出股票成本总额	128,718,860.35
买卖股票差价收入	-3,474,055.48

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回贵金属差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购贵金属差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
权证投资收益	-
股指期货-投资收益	22,920.00

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	288,583.88
基金投资产生的股利收益	-
合计	288,583.88

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	290,567.53
——股票投资	290,567.53
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	324,120.00
——权证投资	-
——期货投资	324,120.00
3. 其他	-
合计	614,687.53

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	43,820.54
合计	43,820.54

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	388,758.67
银行间市场交易费用	-
合计	388,758.67

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	32,820.06
信息披露费	12,432.42
其他	200.00
上市费	29,835.26
指数使用费	5,309.48
银行间账户维护费	9,000.00

银行费用	2,965.40
合计	92,562.62

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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、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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	265,477.79	624,377.32
其中：支付销售机构的客户维护费	86,627.93	91,685.93

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 1.0% 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 1.0% / 当年天数。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	53,095.54	124,875.47

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 0.2% 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 0.2% / 当年天数。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 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	4,735,512.78	14,047.75	4,947,894.04	25,947.09
------	--------------	-----------	--------------	-----------

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。

6.4.10.6 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均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

在存续期内，本基金(包括泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额、泰达 500B 份额)不进行收益分配。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新股或增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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
300032	金龙机电	2016年6月28日	重大事项	20.10	2016年7月7日	19.80	42,000	732,886.70	844,200.00	-
000948	南天信息	2016年6月28日	重大事项	19.31	2016年7月12日	21.00	26,200	432,167.39	505,922.00	-
600654	中安消	2016年5月19日	重大事项	18.54	2016年8月8日	20.39	24,800	791,222.18	459,792.00	-
000718	苏宁环球	2016年1月4日	重大事项	9.91	2016年7月18日	11.78	7,880	57,515.46	78,090.80	-
300184	力源信息	2016年3月4日	重大事项	11.03	-	-	4,900	89,964.00	54,047.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只股票型指数投资基金，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约

风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感

性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,735,512.78	-	-	-	4,735,512.78
结算备付金	1,641,312.82	-	-	-	1,641,312.82
存出保证金	964,827.40	-	-	-	964,827.40
交易性金融资产	-	-	-	52,657,792.61	52,657,792.61
应收证券清算款	-	-	-	1,843,680.45	1,843,680.45
应收利息	-	-	-	1,744.47	1,744.47
应收申购款	-	-	-	68,099.48	68,099.48
资产总计	7,341,653.00	-	-	54,571,317.01	61,912,970.01
负债					
应付赎回款	-	-	-	661,889.40	661,889.40
应付管理人报酬	-	-	-	49,221.00	49,221.00
应付托管费	-	-	-	9,844.21	9,844.21
应付交易费用	-	-	-	146,739.92	146,739.92
其他负债	-	-	-	80,487.76	80,487.76
负债总计	-	-	-	948,182.29	948,182.29
利率敏感度缺口	7,341,653.00	-	-	53,623,134.72	60,964,787.72
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,762,424.42	-	-	-	2,762,424.42
结算备付金	220,452.88	-	-	-	220,452.88
存出保证金	170,743.52	-	-	-	170,743.52
交易性金融资产	-	-	-	48,544,358.75	48,544,358.75
应收利息	-	-	-	690.32	690.32
应收申购款	3,181.51	-	-	63,944.64	67,126.15
资产总计	3,156,802.33	-	-	48,608,993.71	51,765,796.04

负债					
应付赎回款	-	-	-	91,347.75	91,347.75
应付管理人报酬	-	-	-	44,311.06	44,311.06
应付托管费	-	-	-	8,862.22	8,862.22
应付交易费用	-	-	-	111,937.88	111,937.88
其他负债	-	-	-	129,044.95	129,044.95
负债总计	-	-	-	385,503.86	385,503.86
利率敏感度缺口	3,156,802.33	-	-	-48,223,489.85	51,380,292.18

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2015 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合中股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)占基金资产的比例为 85%-100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%，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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	52,657,792.61	86.37	48,544,358.75	94.48
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	52,657,792.61	86.37	48,544,358.75	94.48

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	3,560,000.00	2,590,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-3,560,000.00	-2,590,000.00

6.4.14 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	52,657,792.61	85.05
	其中：股票	52,657,792.61	85.05
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	6,376,825.60	10.30
7	其他各项资产	2,878,351.80	4.65
8	合计	61,912,970.01	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	917,769.98	1.51
B	采矿业	701,781.00	1.15
C	制造业	33,223,593.03	54.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	909,618.00	1.49
E	建筑业	219,685.00	0.36
F	批发和零售业	3,071,705.00	5.04
G	交通运输、仓储和邮政业	1,179,967.00	1.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,768,661.40	4.54
J	金融业	690,642.00	1.13
K	房地产业	4,244,364.50	6.96
L	租赁和商务服务业	93,681.90	0.15
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	198,975.00	0.33
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	248,571.00	0.41
S	综合	-	-
	合计	48,469,014.81	79.50

7.2.2 期末积极投资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	采掘业	-	-
C	制造业	2,549,655.00	4.18
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	561,840.00	0.92
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	965,714.00	1.58
J	金融业	-	-
K	房地产业	78,090.80	0.13
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	33,478.00	0.05
	合计	4,188,777.80	6.87

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600978	宜华生活	82,000	913,480.00	1.50
2	002221	东华能源	74,100	903,279.00	1.48
3	600079	人福医药	53,200	892,164.00	1.46
4	000031	中粮地产	92,050	868,031.50	1.42
5	600525	长园集团	62,180	861,193.00	1.41
6	000066	长城电脑	67,300	858,075.00	1.41
7	601012	隆基股份	65,600	856,080.00	1.40
8	600755	厦门国贸	107,300	853,035.00	1.40

9	600366	宁波韵升	35,500	847,385.00	1.39
10	300032	金龙机电	42,000	844,200.00	1.38
11	600537	亿晶光电	109,300	842,703.00	1.38
12	600594	益佰制药	52,600	840,548.00	1.38
13	000021	深科技	76,053	837,343.53	1.37
14	600487	亨通光电	66,500	836,570.00	1.37
15	002368	太极股份	23,500	834,955.00	1.37
16	600073	上海梅林	72,900	834,705.00	1.37
17	000667	美好集团	232,400	829,668.00	1.36
18	600176	中国巨石	86,580	828,570.60	1.36
19	600635	大众公用	136,600	823,698.00	1.35
20	600565	迪马股份	124,100	801,686.00	1.31
21	000656	金科股份	208,000	794,560.00	1.30
22	002078	太阳纸业	162,400	792,512.00	1.30
23	600409	三友化工	117,100	789,254.00	1.29
24	000786	北新建材	86,900	789,052.00	1.29
25	600289	亿阳信通	55,800	780,642.00	1.28
26	600765	中航重机	53,500	780,030.00	1.28
27	603198	迎驾贡酒	32,600	779,466.00	1.28
28	000028	国药一致	11,800	768,180.00	1.26
29	002503	搜于特	61,100	758,862.00	1.24
30	002714	牧原股份	14,966	756,231.98	1.24
31	600216	浙江医药	56,300	742,597.00	1.22
32	600835	上海机电	38,570	740,158.30	1.21
33	600388	龙净环保	58,900	739,784.00	1.21
34	600026	中海发展	124,500	734,550.00	1.20
35	002001	新和成	34,400	726,872.00	1.19
36	002242	九阳股份	38,800	705,384.00	1.16
37	002002	鸿达兴业	37,400	703,120.00	1.15
38	000563	陕国投 A	125,800	690,642.00	1.13
39	002308	威创股份	41,000	673,630.00	1.10
40	600351	亚宝药业	65,300	654,959.00	1.07
41	601777	力帆股份	55,600	654,412.00	1.07
42	600240	华业资本	64,300	644,286.00	1.06
43	600143	金发科技	99,200	638,848.00	1.05
44	000030	富奥股份	88,900	637,413.00	1.05
45	002238	天威视讯	40,420	584,877.40	0.96
46	002466	天齐锂业	13,060	557,531.40	0.91
47	000810	创维数字	28,600	516,802.00	0.85

48	603766	隆鑫通用	24,600	497,412.00	0.82
49	603589	口子窖	13,300	481,593.00	0.79
50	002602	世纪华通	25,800	478,074.00	0.78
51	600651	飞乐音响	37,300	472,218.00	0.77
52	600517	置信电气	46,600	443,166.00	0.73
53	600481	双良节能	70,500	403,965.00	0.66
54	600970	中材国际	60,550	381,465.00	0.63
55	600971	恒源煤电	67,500	372,600.00	0.61
56	600422	昆药集团	26,600	362,824.00	0.60
57	000703	恒逸石化	36,700	362,229.00	0.59
58	002311	海大集团	22,514	355,045.78	0.58
59	002309	中利科技	19,400	347,454.00	0.57
60	600879	航天电子	21,700	338,086.00	0.55
61	002276	万马股份	17,000	336,770.00	0.55
62	600498	烽火通信	13,700	332,636.00	0.55
63	002640	跨境通	18,700	329,494.00	0.54
64	601001	大同煤业	61,300	329,181.00	0.54
65	002551	尚荣医疗	13,759	321,685.42	0.53
66	300274	阳光电源	13,000	317,200.00	0.52
67	000900	现代投资	46,900	316,106.00	0.52
68	002345	潮宏基	31,200	305,136.00	0.50
69	600503	华丽家族	31,700	290,689.00	0.48
70	002342	巨力索具	49,200	285,360.00	0.47
71	002390	信邦制药	30,500	281,820.00	0.46
72	601801	皖新传媒	21,300	248,571.00	0.41
73	002439	启明星辰	9,300	240,219.00	0.39
74	300010	立思辰	11,000	230,780.00	0.38
75	002489	浙江永强	27,400	217,008.00	0.36
76	600329	中新药业	12,200	210,694.00	0.35
77	600201	生物股份	6,800	185,844.00	0.30
78	002310	东方园林	7,000	167,440.00	0.27
79	600292	远达环保	12,900	163,443.00	0.27
80	002505	大康农业	41,420	161,538.00	0.26
81	002332	仙琚制药	13,500	151,200.00	0.25
82	600125	铁龙物流	20,300	129,311.00	0.21
83	000513	丽珠集团	2,500	115,275.00	0.19
84	002426	胜利精密	11,500	113,275.00	0.19
85	000612	焦作万方	15,700	112,098.00	0.18
86	000748	长城信息	5,600	109,872.00	0.18

87	300043	互动娱乐	7,300	103,441.00	0.17
88	000488	晨鸣纸业	13,000	103,220.00	0.17
89	600536	中国软件	3,900	97,188.00	0.16
90	002400	省广股份	6,630	93,681.90	0.15
91	600729	重庆百货	3,500	86,800.00	0.14
92	000939	凯迪生态	9,600	85,920.00	0.14
93	600122	宏图高科	5,300	70,914.00	0.12
94	600872	中炬高新	5,400	66,636.00	0.11
95	600298	安琪酵母	3,100	55,304.00	0.09
96	600528	中铁二局	4,500	52,245.00	0.09
97	000501	鄂武商 A	2,900	45,501.00	0.07
98	002271	东方雨虹	2,100	36,183.00	0.06
99	002573	清新环境	2,100	35,532.00	0.06
100	600522	中天科技	3,500	34,300.00	0.06
101	002004	华邦健康	3,000	27,390.00	0.04
102	000671	阳光城	2,600	15,444.00	0.03
103	600335	国机汽车	1,100	12,331.00	0.02
104	000988	华工科技	200	4,010.00	0.01
105	600120	浙江东方	100	2,171.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000890	法尔胜	62,900	666,111.00	1.09
2	002460	赣锋锂业	18,200	608,790.00	1.00
3	002006	精功科技	40,300	545,259.00	0.89
4	600297	广汇汽车	58,300	507,793.00	0.83
5	000948	南天信息	26,200	505,922.00	0.83
6	600654	中安消	24,800	459,792.00	0.75
7	002721	金一文化	16,700	322,811.00	0.53
8	002487	大金重工	22,300	197,355.00	0.32
9	002743	富煌钢构	9,800	141,316.00	0.23
10	000718	苏宁环球	7,880	78,090.80	0.13
11	603011	合锻智能	4,800	55,488.00	0.09
12	300184	力源信息	4,900	54,047.00	0.09
13	600784	鲁银投资	3,800	33,478.00	0.05
14	600531	豫光金铅	1,500	12,525.00	0.02

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	600176	中国巨石	1,796,009.40	3.50
2	600537	亿晶光电	1,732,965.00	3.37
3	002221	东华能源	1,681,015.00	3.27
4	600416	湘电股份	1,511,827.04	2.94
5	600651	飞乐音响	1,478,598.00	2.88
6	600409	三友化工	1,446,493.00	2.82
7	000939	凯迪生态	1,443,338.00	2.81
8	002203	海亮股份	1,442,052.60	2.81
9	002078	太阳纸业	1,401,557.90	2.73
10	002238	天威视讯	1,335,798.00	2.60
11	600026	中海发展	1,305,115.00	2.54
12	600978	宜华生活	1,257,361.00	2.45
13	002466	天齐锂业	1,251,366.63	2.44
14	600869	智慧能源	1,220,311.20	2.38
15	000890	法尔胜	1,196,287.25	2.33
16	000566	海南海药	1,188,433.00	2.31
17	600525	长园集团	1,173,692.00	2.28
18	000667	美好集团	1,134,320.00	2.21
19	600062	华润双鹤	1,117,618.00	2.18
20	600201	生物股份	1,109,313.00	2.16
21	600079	人福医药	1,103,874.00	2.15
22	600503	华丽家族	1,082,236.00	2.11
23	600743	华远地产	1,074,884.00	2.09
24	600635	大众公用	1,055,652.00	2.05

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。

7.4.2 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	000758	中色股份	1,757,897.54	3.42
2	002203	海亮股份	1,697,494.72	3.30
3	600416	湘电股份	1,631,457.79	3.18
4	600537	亿晶光电	1,558,930.04	3.03
5	600869	智慧能源	1,457,981.00	2.84
6	000939	凯迪生态	1,438,746.39	2.80
7	600176	中国巨石	1,399,535.65	2.72
8	600458	时代新材	1,293,009.00	2.52
9	600704	物产中大	1,256,004.91	2.44
10	002396	星网锐捷	1,228,158.05	2.39
11	600094	大名城	1,227,825.00	2.39
12	000650	仁和药业	1,224,239.32	2.38
13	600132	重庆啤酒	1,211,619.23	2.36
14	002191	劲嘉股份	1,197,619.13	2.33
15	002466	天齐锂业	1,180,397.00	2.30
16	002371	七星电子	1,159,665.20	2.26
17	300088	长信科技	1,144,345.00	2.23
18	000566	海南海药	1,140,772.17	2.22
19	600062	华润双鹤	1,134,774.73	2.21
20	600757	长江传媒	1,103,727.00	2.15
21	600260	凯乐科技	1,089,700.00	2.12
22	000667	美好集团	1,086,823.72	2.12
23	600337	美克家居	1,084,534.12	2.11
24	600743	华远地产	1,068,593.50	2.08
25	002078	太阳纸业	1,042,614.00	2.03
26	600651	飞乐音响	1,041,591.10	2.03

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	132,541,726.68
卖出股票收入（成交）总额	125,244,804.87

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序的所有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

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
IC1609	中证 500 股指期货 IC1609 合约	4	4,696,160.00	324,120.00	-
公允价值变动总额合计(元)					324,120.00
股指期货投资本期收益(元)					22,920.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					324,120.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

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

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	964,827.40
2	应收证券清算款	1,843,680.45
3	应收股利	-
4	应收利息	1,744.47
5	应收申购款	68,099.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,878,351.80

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

7.12.5.1 期末指数投资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	300032	金龙机电	844,200.00	1.38	重大事项

7.12.5.2 期末积极投资前五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	000948	南天信息	505,922.00	0.83	重大事项

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 500A	228	25,866.07	145,048.00	2.46%	5,752,416.00	97.54%
泰达 500B	822	10,761.80	132.00	0.00%	8,846,064.00	100.00%
泰达中证 500	6,779	7,399.31	316,285.69	0.63%	49,843,626.22	99.37%
合计	7,829	8,290.15	461,465.69	0.71%	64,442,106.22	99.29%

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 期末上市基金前十名持有人

泰达 500A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	黄松友	2,549,406.00	43.23%
2	张守玉	790,960.00	13.41%
3	陈海东	634,300.00	10.76%
4	冯建霖	325,445.00	5.52%
5	张润强	139,244.00	2.36%
6	谭文英	117,800.00	2.00%
7	甘遵义	103,480.00	1.75%

8	夏南凯	100,288.00	1.70%
9	郑志坤	77,128.00	1.31%
10	谭莲英	60,000.00	1.02%

泰达 500B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	杨武臣	246,100.00	2.78%
2	罗永祥	200,000.00	2.26%
3	何健	180,000.00	2.03%
4	魏振水	165,800.00	1.87%
5	高国威	162,814.00	1.84%
6	钟廷修	160,000.00	1.81%
7	赵印	137,065.00	1.55%
8	傅新彩	136,280.00	1.54%
9	孟京	128,292.00	1.45%
10	董晓庄	125,700.00	1.42%

持有人为本基金场内持有人。

8.3 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 500A	0.00	0.0000%
	泰达 500B	0.00	0.0000%
	泰达中证 500	37,990.09	0.0757%
	合计	37,990.09	0.0585%

8.4 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 500A	0
	泰达 500B	0
	泰达中证 500	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达 500A	0
	泰达 500B	0
	泰达中证 500	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达 500A	泰达 500B	泰达中证 500
基金合同生效日(2011 年 12 月 1 日)	74,125,804.00	111,188,706.00	1,250,153,255.48
基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	6,289,500.00	9,434,250.00	32,710,710.99
本报告期基金总申购份额	-	-	55,272,576.08
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	39,642,180.65
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-392,036.00	-588,054.00	1,818,805.49
本报告期末基金份额总额	5,897,464.00	8,846,196.00	50,159,911.91

注：拆分变动份额含本基金三级份额之间的配对转换份额和基金份额折算后的调整份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未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、本报告期内基金管理人未发生重大的人事变动。
- 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

本报告期内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

本报告期内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. 本报告期基金管理人未受到任何稽查或处罚。

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	
中金公司	2	134,561,767.30	52.20%	125,318.81	52.20%	-
银河证券	2	75,172,668.95	29.16%	70,009.89	29.16%	-
招商证券	1	42,699,590.20	16.56%	39,764.46	16.56%	-
华林证券	2	5,352,505.10	2.08%	4,984.05	2.08%	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-

中信证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

(一) 本基金本报告期新增华林证券、东北证券交易单元；撤销南京证券、东海证券交易单元。

(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

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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金之泰达 500A 基金份额 2016 年上半年度约定年基准收益率公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 1 月 5 日
2	《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间泰达 500A 份额停复牌的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 1 月 5 日
3	《关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 1 月 6 日
4	《关于泰达 500A 份额定期份额折算后次日前收盘价调整公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 1 月 6 日
5	《泰达宏利基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 3 月 18 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

11.3 查阅方式

基金投资者可在营业时间免费查阅，或基金投资者也可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》、《证券日报》）或登陆本基金管理人互联网网址（<http://www.mfcteda.com>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泰达宏利基金管理有限公司：客户服务中心电话：400-698-8888（免长话费）或 010-66555662，网址：<http://www.mfcteda.com>。

泰达宏利基金管理有限公司
2016 年 8 月 29 日