

# 泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资 基金 2016 年半年度报告摘要

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

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利新思路混合	
基金主代码	001419	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 16 日	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	584,989,486.55 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	泰达宏利新思路混合 A	泰达宏利新思路混合 B
下属分级基金的交易代码:	001419	002314
报告期末下属分级基金的份额总额	584,989,486.55 份	0.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金紧跟经济形势，深入挖掘市场机遇，力争实现基金资产的持续稳健增值
投资策略	本基金将采取主动的类别资产配置策略，注重风险与收益的平衡。本基金紧跟经济形势，深入挖掘市场机遇，力争实现基金资产的持续稳健增值
业绩比较基准	50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金

### 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	王永民
	联系电话	010-66594896
	电子邮箱	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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	泰达宏利新思路混合 A	泰达宏利新思路混合 B
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)	报告期(2016 年 1 月 25 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,953,393.28	-
本期利润	-7,977,631.04	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0162	-
本期基金份额净值增长率	1.77%	-
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0343	-
期末基金资产净值	605,048,982.73	-
期末基金份额净值	1.034	-

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。

4. 根据泰达宏利基金管理有限公司 2016 年 1 月 21 日发布的《关于泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金与泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金增加 B 类份额并修改基金合同和托管协议的公告》，泰达宏利基金管理有限公司决定自 2016 年 1 月 25 日起，对旗下泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金增加收取销售服务费的 B 类份额并相应修订基金合同和托管协议。截止至 2016 年 6 月 30 日本基金 B 级份额为零。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰达宏利新思路混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.49%	0.04%	0.09%	0.49%	0.40%	-0.45%
过去三个月	0.68%	0.06%	-0.72%	0.51%	1.40%	-0.45%
过去六个月	1.77%	0.11%	-6.85%	0.92%	8.62%	-0.81%
过去一年	3.40%	0.09%	-11.93%	1.15%	15.33%	-1.06%

自基金合同生效起至今	3.40%	0.09%	-18.18%	1.21%	21.58%	-1.12%
------------	-------	-------	---------	-------	--------	--------

泰达宏利新思路混合 B

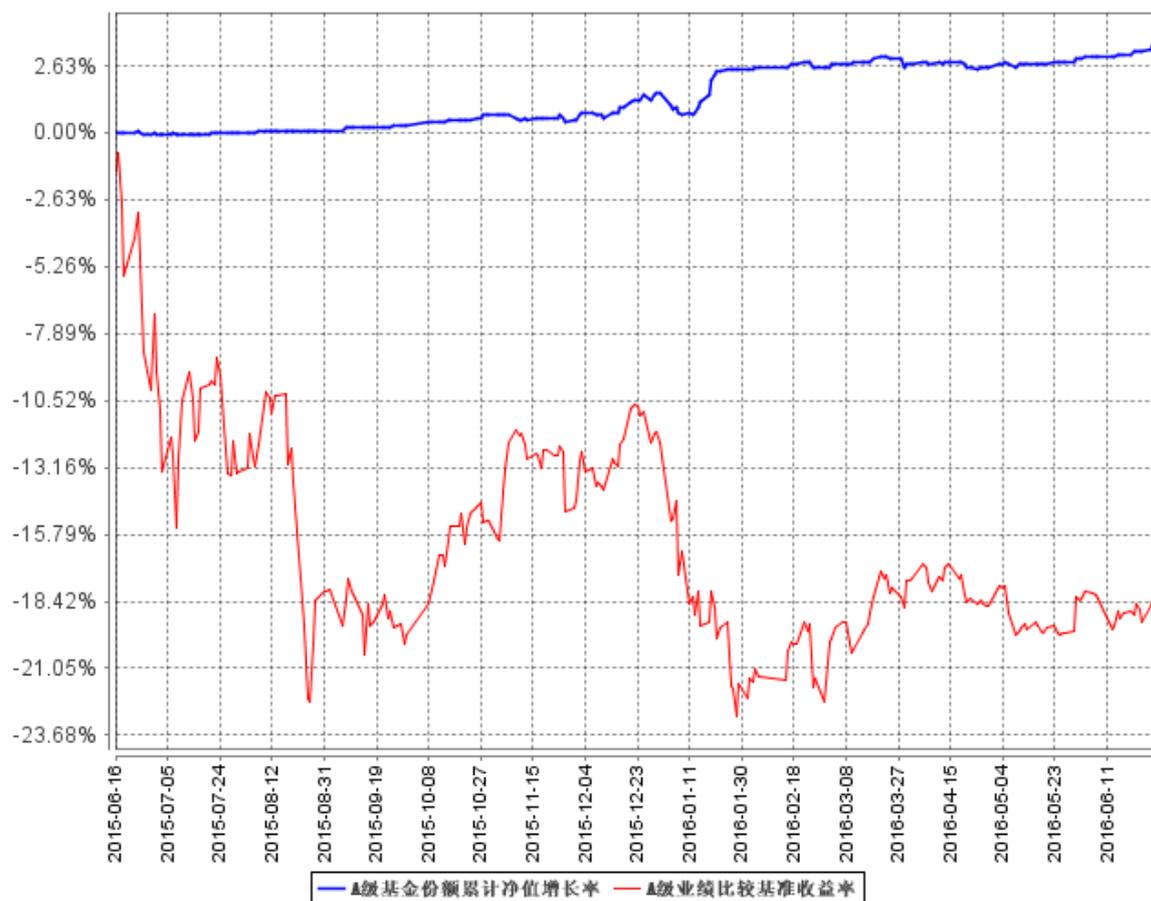
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.49%	0.04%	0.09%	0.49%	0.40%	-0.45%
过去三个月	0.68%	0.06%	-0.72%	0.51%	1.40%	-0.45%
自 2016 年 1 月 25 日至今	0.98%	0.06%	1.54%	0.76%	-0.56%	-0.70%

注：1、本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率\*50%+中证综合债指数收益率\*50%

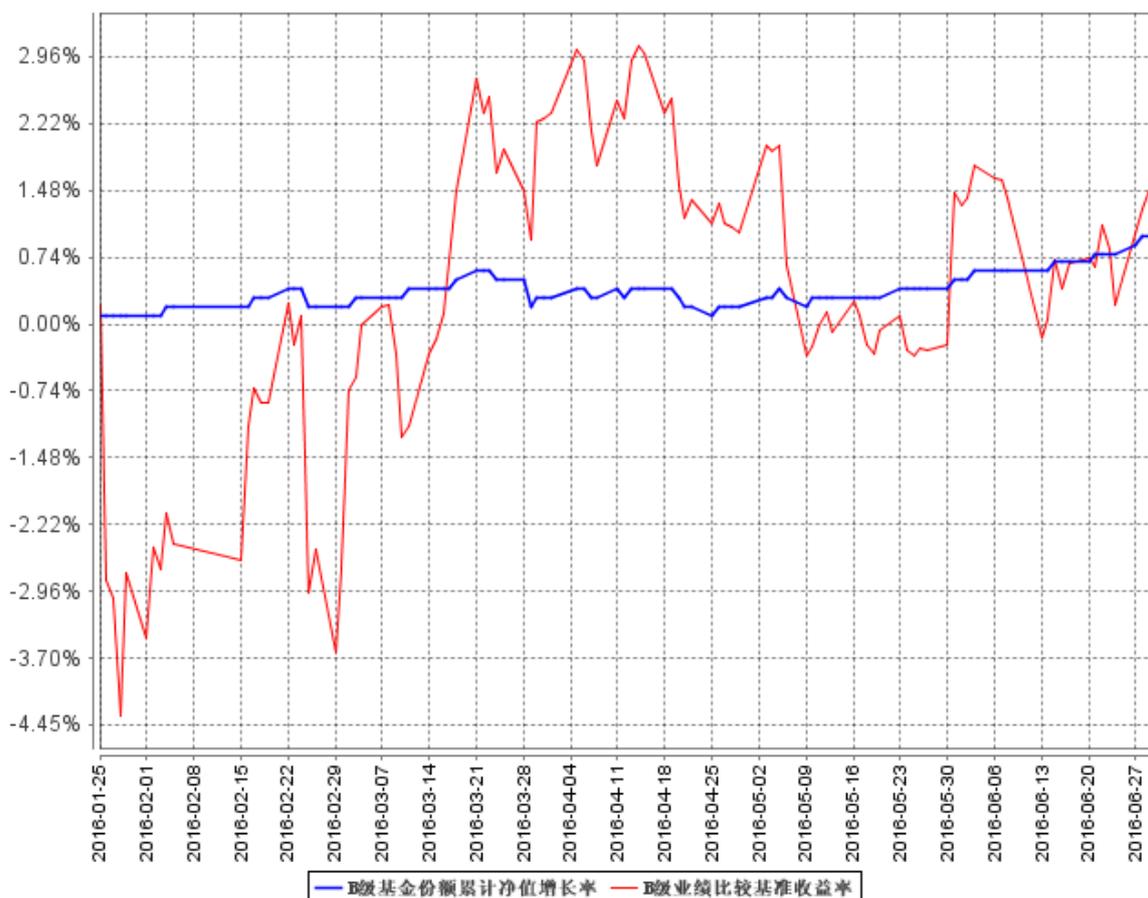
2、本基金 A 类份额成立于 2015 年 6 月 16 日，B 类份额成立于 2016 年 1 月 25 日

### 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

A 级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



**B级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 A 类份额成立于 2015 年 6 月 16 日，B 类份额成立于 2016 年 1 月 25 日。本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月，是中国首批合资基金管理公司之一。截至报告期末本公司股东及持股比例分别为：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		
丁宇佳	本基金基金经理	2015年6月16日	-	8	理学学士；2008年7月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任交易部交易员，负责债券交易工作；2013年9月起先后担任固定收益部研究员、基金经理助理、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。
庄腾飞	本基金基金经理助理；首席策略分析师	2015年11月6日	-	6	经济学硕士；2010年7月加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于研究部，负责宏观经济、策略研究及金融、地产行业研究，曾先后担任助理研究员、研究员、高级研究员等职务，现任基金经理兼首席策略分析师；具备6年基金从业经验，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合规守信情况的说明

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

2016 年上半年，全球经济延续了低速复苏态势：美国二季度就业和消费数据稳健，英国脱欧事件延缓了美国加息的步伐，稳定的国内经济继续推动 CPI 缓慢上行，实体经济表现良好；日本继续维持负利率和量化宽松政策，但升值压力使出口抗压；英国脱欧事件给欧洲慢复苏蒙上了阴影；新兴经济体基本面仍不乐观，但资本流出压力有所减小。

国内经济高频数据出现一定程度改善，经济呈弱企稳迹象。工业需求前景没有大幅改善，但发电数据有所改善，PPI 降幅收敛，第三产业发展平稳，服务业 PMI 向好。固定资产投资增速出现下滑，房地产销售火爆，但对制造业和建筑业的拉动存在一定滞后，基建继续承压。内需仍维持低迷，外需在欧洲金融体系不稳定的背景下存在不确定性。蔬菜价格下跌，猪肉价格涨幅缩小，居民消费价格指数 CPI 保持低位震荡。表外融资低迷，贷款有所恢复，但 M2 和社融数据受同比基数偏高的影响可能继续回落。

在供给侧改革与稳增长的背景下，央行继续采取了 MLF、PSL 和公开市场逆回购操作日常化等操作来提供流动性，以期降低社会融资成本、稳定资金面和提振经济，短期内央行中性偏宽松的货币政策不会改变。人民币汇率继续面临贬值压力，但外汇储备下降幅度很小。

债券市场整体呈现慢牛格局，4 月信用事件爆发成为收益率全面回调的导火索，信用利差有所扩大。但期限利差一直处于收窄态势，收益率曲线趋平。股票大幅震荡下行同样维持震荡格局，目前呈边际企稳，转债随正股弱势调整，二级市场机会不大。

报告期内，我们认为，基本面对债市仍然有利，但收益率存在一定波动风险，同时信用风险事件频发，违约主体的性质和行业越发分散化，我们适当降低了债券杠杆并维持中短久期，精选信用债，严防信用风险事件。从资产轮动的角度考虑，我们维持了较低的转债和股票仓位，同时积极参与新股网下申购，报告期内获得了相对满意的回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

##### 新思路 A

截止报告期末，本基金份额净值为 1.034 元，本报告期的份额净值增长率为 1.77%，同期业绩比较基准增长率为-6.85%。

##### 新思路 B

截止报告期末，本基金份额净值为 1.034 元，成立以来的份额净值增长率为 0.98%，同期业绩比较基准增长率为 1.54%。

#### 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 2016 年下半年，欧洲经济仍存在很大不确定性，美元、日元升值会带来人民币被动贬值，中国经济可能继续维持弱企稳，CPI 和 PPI 可能继续上行，但幅度可控。公开市场操作仍然是呵护流动性的主要手段，降准降息操作概率不大。同时由于绝对收益率偏低，机构加杠杆行为严重，事件性冲击导致的资金紧张容易被放大。

目前债券收益率曲线极度平坦，本基金在下半年将维持谨慎的投资策略，并灵活的采取杠杆

操作，同时根据各类属资产风险收益特征的横向比较来进行结构性调整。2016 年以来信用违约事件频发，我们将加强信用研究，高度重视信用风险，积极参与股票打新获取绝对收益，同时把握股票和转债市场契机，力求在控制风险的基础上通过积极的主动管理为持有人贡献超额回报。

#### 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

根据本基金基金合同及基金的实际运作情况，本基金于本报告期内未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰达宏利新思路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：泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	5,247,547.57	309,334,876.53
结算备付金	1,093,868.39	2,961,546.90
存出保证金	266,524.08	204,661.59
交易性金融资产	594,162,033.23	625,749,422.38
其中：股票投资	23,033,033.23	101,619,422.38
基金投资	-	-
债券投资	571,129,000.00	524,130,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	674,001,811.00
应收证券清算款	413,465.11	98,753,748.05
应收利息	4,887,564.10	5,840,090.08
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	606,071,002.48	1,716,846,156.53
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
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	337,281.39	1,233,537.20
应付管理人报酬	347,055.58	1,253,762.49
应付托管费	123,948.40	447,772.32
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	14,830.22	395,886.10
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	198,904.16	63,926.08
负债合计	1,022,019.75	3,394,884.19
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	584,989,486.55	1,686,199,350.90
未分配利润	20,059,496.18	27,251,921.44
所有者权益合计	605,048,982.73	1,713,451,272.34
负债和所有者权益总计	606,071,002.48	1,716,846,156.53

注：1、报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.034 元，基金份额总额 584,989,486.55 份，其中下属 A 类基金份额 584,989,486.55 份，B 类基金份额 0 份。下属 A 类基金份额净值 1.034 元，B 类基金份额净值 1.034 元。

2、本基金于 2015 年 6 月 16 日基金合同生效。

## 6.2 利润表

会计主体：泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 6 月 16 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	-4,349,411.71	695,198.20
1.利息收入	6,125,919.13	1,035,921.66
其中：存款利息收入	438,582.25	639,016.11
债券利息收入	4,793,208.95	26,235.61
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	894,127.93	370,669.94
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-1,033,526.94	-
其中：股票投资收益	-3,284,475.80	-
基金投资收益	-	-

债券投资收益	1,992,997.48	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	257,951.38	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-9,931,024.32	-360,034.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	489,220.42	19,310.83
<b>减：二、费用</b>	<b>3,628,219.33</b>	<b>418,713.47</b>
1. 管理人报酬	1,769,672.73	300,643.72
2. 托管费	632,025.97	75,160.94
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	774,980.29	24,274.66
5. 利息支出	218,851.03	-
其中：卖出回购金融资产支出	218,851.03	-
6. 其他费用	232,689.31	18,634.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-7,977,631.04</b>	<b>276,484.73</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-7,977,631.04</b>	<b>276,484.73</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金

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）	1,686,199,350.90	27,251,921.44	1,713,451,272.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-7,977,631.04	-7,977,631.04
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	-1,101,209,864.35	785,205.78	-1,100,424,658.57

列)			
其中：1.基金申购款	536,202,924.82	15,009,212.20	551,212,137.02
2.基金赎回款	-1,637,412,789.17	-14,224,006.42	-1,651,636,795.59
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）	584,989,486.55	20,059,496.18	605,048,982.73
项目	上年度可比期间 2015年6月16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）	631,166,366.75	-	631,166,366.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	276,484.73	276,484.73
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）	313,049,938.33	-7.18	313,049,931.15
其中：1.基金申购款	315,598,933.43	-1,824.53	315,597,108.90
2.基金赎回款	-2,548,995.10	1,817.35	-2,547,177.75
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）	944,216,305.08	276,477.55	944,492,782.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
刘建

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
傅国庆

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
王泉

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

泰达宏利新思路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]1013号《关于核准泰达宏利新思路灵活配置混合

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《泰达宏利新思路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 631,071,583.34 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 708 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 631,166,366.75 份基金份额，其中认购资金利息折合 94,783.41 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”)。

经与托管行协商一致并报中国证监会备案，本基金自 2016 年 1 月 25 日起增加收取销售服务费的 B 类份额，本基金的原有基金份额全部自动划归为该基金 A 类基金份额类别，A 类份额的各项业务规则与原基金合同相同。详情参见管理人于 2016 年 1 月 21 日发布的《关于泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金与泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金增加 B 类份额并修改基金合同和托管协议的公告》。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金的业绩比较基准为 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 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》、《泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会

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 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策的变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计的变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》[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 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期没有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30 日	上年度可比期间 2015年6月16日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,769,672.73	300,643.72
其中：支付销售机构的客户维护费	173,648.71	51,723.27

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 0.70%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 0.70% / 当年天数。上述相关费用包含实际支付金额和税金。自本基金合同生效日起，本基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提；自 2015 年 10 月 22 日起，本基金管理人报酬调整为按前一日基金资产净值 0.70%的年费率计提。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30 日	上年度可比期间 2015年6月16日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	632,025.97	75,160.94

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

泰达宏利新思路混合A				
关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
泰达宏利基金- 中银国际专户 2 号资产管理计划	0.00	0.0000%	372,359,359.36	22.0828%
泰达宏利基金- 中银国际专户 5 号资产管理计划	0.00	0.0000%	600,587,587.59	35.6178%
泰达宏利基金- 中银国际专户 6 号资产管理计划	0.00	0.0000%	600,587,587.59	35.6178%

注：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。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年6月16日(基金合同生效日)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	5,247,547.57	69,100.50	284,920,466.44	202,511.71

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，活期存款按银行同业利率计息，定期存款按协议利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

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

#### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016 年 6 月 24 日	2016 年 7 月 6 日	新股流通受限	12.98	12.98	5,040	65,419.20	65,419.20	-
603016	新宏泰	2016 年 6 月 23 日	2016 年 7 月 1 日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016 年 6 月 30 日	2016 年 7 月 8 日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016 年 6 月 29 日	2016 年 7 月 7 日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

#### 6.4.9.2 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
601611	中国核建	2016 年 6 月 30 日	临时停牌	20.92	2016 年 7 月 1 日	23.01	17,042	59,135.74	356,518.64	-

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

##### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	23,033,033.23	3.80
	其中：股票	23,033,033.23	3.80
2	固定收益投资	571,129,000.00	94.23
	其中：债券	571,129,000.00	94.23
	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	6,341,415.96	1.05
7	其他各项资产	5,567,553.29	0.92
8	合计	606,071,002.48	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,623,229.39	0.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,041,593.84	0.34
E	建筑业	1,792,546.64	0.30
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,310,107.40	0.22
J	金融业	13,567,029.84	2.24
K	房地产业	2,678,400.02	0.44
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	23,033,033.23	3.81

### 7.2.2 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601398	工商银行	1,240,726	5,508,823.44	0.91
2	000001	平安银行	584,332	5,083,688.40	0.84
3	000539	粤电力A	406,692	2,041,593.84	0.34
4	000656	金科股份	469,139	1,792,110.98	0.30
5	600030	中信证券	79,800	1,295,154.00	0.21
6	600037	歌华有线	81,500	1,239,615.00	0.20
7	000776	广发证券	69,900	1,171,524.00	0.19
8	600060	海信电器	61,400	1,085,552.00	0.18
9	601668	中国建筑	186,390	991,594.80	0.16
10	000402	金融街	91,182	886,289.04	0.15

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本公司网站的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601398	工商银行	55,580,625.23	3.24
2	000001	平安银行	32,997,682.00	1.93
3	000725	京东方 A	29,999,863.00	1.75
4	601328	交通银行	29,987,616.63	1.75
5	000539	粤电力 A	18,996,757.32	1.11
6	000656	金科股份	16,999,095.00	0.99
7	000402	金融街	9,999,343.27	0.58
8	000959	首钢股份	1,999,873.00	0.12
9	601668	中国建筑	1,999,866.00	0.12
10	600755	厦门国贸	1,998,497.00	0.12
11	000776	广发证券	1,797,988.36	0.10
12	600030	中信证券	1,297,726.87	0.08
13	600037	歌华有线	1,197,139.00	0.07
14	600060	海信电器	998,224.00	0.06
15	601288	农业银行	499,905.00	0.03
16	600170	上海建工	498,972.00	0.03
17	002797	第一创业	79,119.04	0.00
18	601966	玲珑轮胎	65,419.20	0.00
19	603868	飞科电器	59,372.79	0.00
20	601611	中国核建	59,135.74	0.00

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。

### 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	601398	工商银行	49,999,998.78	2.92
2	601328	交通银行	29,802,362.68	1.74
3	000725	京东方 A	29,783,227.00	1.74

4	000001	平安银行	27,491,499.60	1.60
5	000539	粤电力 A	16,640,945.97	0.97
6	000656	金科股份	16,081,952.76	0.94
7	600755	厦门国贸	15,667,860.22	0.91
8	600138	中青旅	13,203,009.15	0.77
9	002029	七匹狼	10,780,235.43	0.63
10	300193	佳士科技	10,056,707.83	0.59
11	000402	金融街	9,001,705.75	0.53
12	300147	香雪制药	8,704,896.58	0.51
13	601336	新华保险	7,276,071.35	0.42
14	300356	光一科技	6,205,213.36	0.36
15	000728	国元证券	3,830,567.84	0.22
16	002521	齐峰新材	2,907,556.94	0.17
17	000959	首钢股份	2,129,874.54	0.12
18	603508	思维列控	1,842,751.40	0.11
19	300496	中科创达	1,459,820.00	0.09
20	603999	读者传媒	1,017,649.80	0.06

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	207,681,362.41
卖出股票收入（成交）总额	274,761,234.15

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	39,996,000.00	6.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,503,000.00	8.35
	其中：政策性金融债	50,503,000.00	8.35
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	479,744,000.00	79.29
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	886,000.00	0.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	571,129,000.00	94.39

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	041663004	16 首钢 CP002	600,000	59,772,000.00	9.88
2	011699510	16 光明 SCP004	500,000	50,035,000.00	8.27
3	011699652	16 百业源 SCP001	500,000	50,030,000.00	8.27
4	011699442	16 广物控股 SCP002	500,000	50,025,000.00	8.27
5	011699453	16 新兴际华 SCP002	500,000	49,990,000.00	8.26

## 7.7 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。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内本基金投资的广发证券（000776）于 2015 年 9 月 12 日发布《关于收到中国证券监督管理委员会行政处罚事先告知书的公告》，2015 年 8 月 24 日，该公司收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《调查通知书》（鄂证调查字 2015023 号）。因公司涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司立案调查（详见公司 2015-135 号公告）。该公司在 2015 年 7 月 12 日证监会发布《关于清理整顿违法从事证券业务活动的意见》（证监会公告[2015]19 号）之后，仍未采取有效措施严格审查客户身份的真实性，未切实防范客户借用证券交易通道违规从事交易活动，新增下挂子账户 99 个，性质恶劣、情节严重。依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定，中国证监会拟对该上市公司处罚：一、对广发证券责令整改，给予警告，没收违法所得 6,805,135.75 元，并处以 20,415,407.25 元罚款；二、对王新栋给予警告，并处以 10 万元罚款；三、对林建何给予警告，并处以 10 万元罚款；四、对梅纪元给予警告，并处以 10 万元罚款；五、对周翔给予警告，并处以 10 万元罚款。

基金管理人分析认为，广发证券 9 月份被监管部门立案调查的原因是未按要求采集客户交易终端信息，未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性，未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息。体现了该公司此前在内部管理方面存在的漏洞与不足，但公司自查及改正的态度是端正的，后续处理的情况也基本明朗，该事件不会影响公司后续经营活动的正常开展。我们判断公司本身的经营趋势向好，收入和利润持续快速增长，公司在经纪、投行以及资本中介等方向都有快速的业务成长，整体呈现良好的发展态势。因此，基金管理人经审慎分析，在本报告期内继续保持对其的投资。

报告期内本基金投资的前十名证券发行主体中的其余九名本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 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	266,524.08
2	应收证券清算款	413,465.11
3	应收股利	-
4	应收利息	4,887,564.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,567,553.29

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
泰达宏利新思路混合 A	1,146	510,462.03	515,017,509.72	88.04%	69,971,976.83	11.96%
泰达宏利	-	-	-	-	-	-

新思路混合 B						
合计	1,146	510,462.03	515,017,509.72	88.04%	69,971,976.83	11.96%

注：期末 B 级基金总份额为 0。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	泰达宏利新思路混合 A	0.00	0.0000%
	泰达宏利新思路混合 B	-	-
	合计	0.00	0.0000%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泰达宏利新思路混合 A	0
	泰达宏利新思路混合 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达宏利新思路混合 A	0
	泰达宏利新思路混合 B	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达宏利新思路混合 A	泰达宏利新思路混合 B
基金合同生效日（2015 年 6 月 16 日）基金份额总额	631,166,366.75	-
本报告期期初基金份额总额	1,686,199,350.90	-

本报告期基金总申购份额	536,202,924.82	-
减:本报告期基金总赎回份额	1,637,412,789.17	-
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	584,989,486.55	-

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，基金份额持有人大会表决投票时间为 2016 年 7 月 7 日至 2016 年 7 月 20 日 17:00 止，会议审议通过《关于调整泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金管理费率的议案》，根据基金份额持有人大会通过的议案及方案说明，本基金管理费率自 2016 年 7 月 25 日起由 0.70%/年下调至 0.60%/年。详见本公司于 2016 年 6 月 20 日至 2016 年 7 月 23 日在指定媒体以及官网上发布的系列相关公告。

### 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

本报告期内基金管理人、托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1. 本报告期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	
中信建投	2	260,885,341.90	54.17%	242,962.84	54.17%	-
光大证券	1	215,213,103.94	44.69%	200,428.10	44.69%	-
中信证券	2	3,710,645.31	0.77%	3,455.70	0.77%	-
广发证券	2	1,418,897.46	0.29%	1,321.47	0.29%	-
华林证券	2	229,283.42	0.05%	213.52	0.05%	-
中山证券	1	153,135.80	0.03%	142.62	0.03%	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-

注：（一）2016 年上半年本基金新增华林证券、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**

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
中信建投	2,968,229.65	2.97%	130,500,000.00	6.24%	-	-
光大证券	97,125,002.80	97.03%	1,710,200,000.00	81.80%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	182,800,000.00	8.74%	-	-
华林证券	-	-	67,300,000.00	3.22%	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-

泰达宏利基金管理有限公司  
2016 年 8 月 29 日