

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 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。

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.....	11
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的真实、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.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47

§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	49
§9 开放式基金份额变动	49
§10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
§11 备查文件目录	53
11.1 备查文件目录.....	53
11.2 存放地点.....	53
11.3 查阅方式.....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	泰达宏利绝对混合
基金主代码	001896
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 11 月 17 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	372,388,286.83 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	灵活运用多种绝对收益策略，对冲各类系统性风险，力争为投资者实现稳定的投资收益
投资策略	本基金采用以市场中性投资策略为主以其他多种 Alpha 策略为辅构建多策略组合的多种绝对收益策略，通过利用股指期货和其他多种衍生品工具剥离系统性风险，力争实现稳定的绝对回报
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率+2%
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于绝对收益策略投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益

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@mfteda.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	北京市西城区复兴门内大街 1

	号英蓝国际金融中心南楼 三层	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	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	泰达宏利基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国 际金融中心南楼三层

§ 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, 896, 363. 08
本期利润	-6, 069, 705. 99
加权平均基金份额本期利润	-0. 0126
本期加权平均净值利润率	-1. 27%
本期基金份额净值增长率	-1. 30%
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	-3, 934, 267. 31
期末可供分配基金份额利润	-0. 0106
期末基金资产净值	368, 454, 019. 52
期末基金份额净值	0. 989
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	-1. 10%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益

2. 所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字

3. 对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数

3.2 基金净值表现

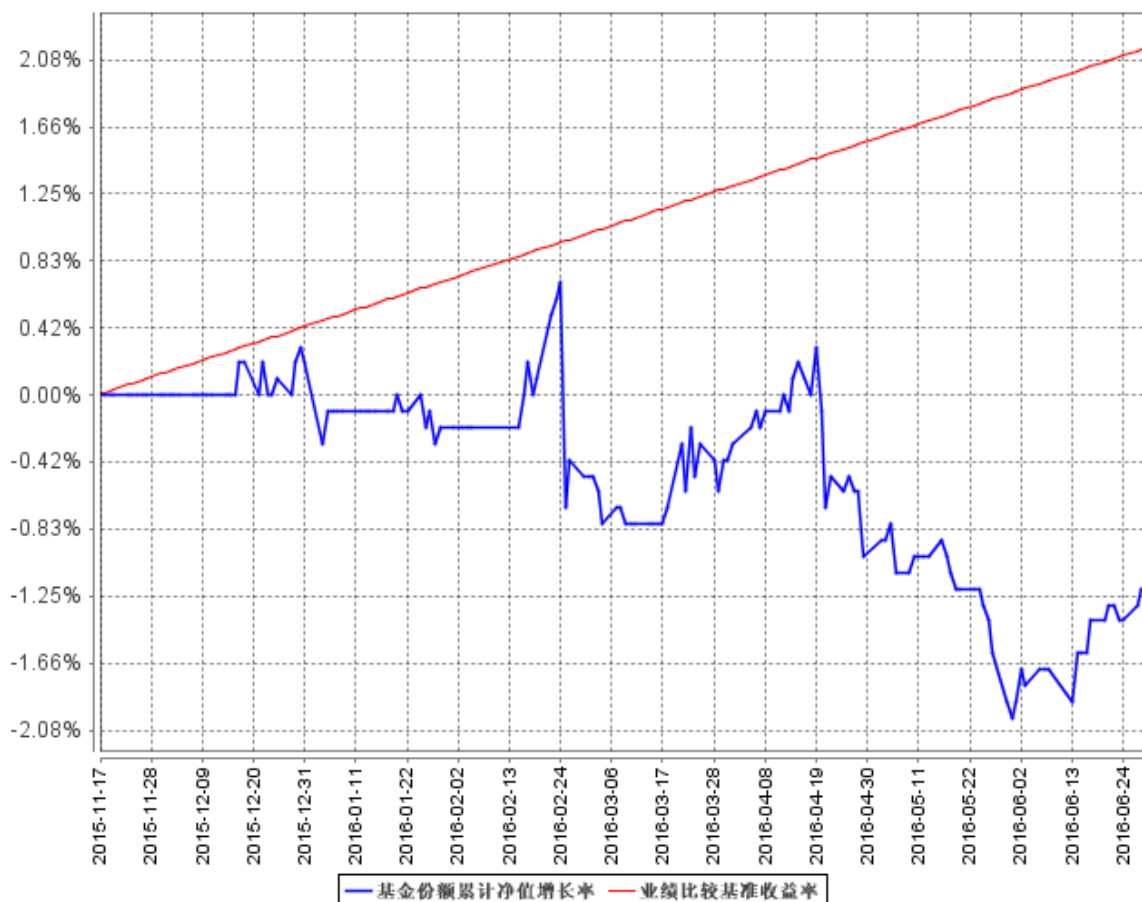
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.92%	0.12%	0.28%	0.01%	0.64%	0.11%
过去三个月	-0.70%	0.16%	0.86%	0.01%	-1.56%	0.15%
过去六个月	-1.30%	0.21%	1.73%	0.01%	-3.03%	0.20%
自基金合同生效起至今	-1.10%	0.19%	2.16%	0.01%	-3.26%	0.18%

注：本基金业绩比较基准：一年期银行定期存款收益率(税后)+2%

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

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：本基金成立于 2015 年 11 月 17 日，截止报告期末本基金成立不满一年。按基金合同规定，自基金合同生效日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。

§ 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	2015 年 11 月 17 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，曾担任产品与金融工程部高级研究员、金融工程部副总经理，现担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	2015 年 11 月 20 日	-	6	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，历任投资管

					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

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。在对冲工具交易受限的客观环境下，股指期货持续处在大幅度贴水状况下，给对冲策略带来高企的对冲成本。

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 0.989 元，本报告期份额净值增长率为-1.30%，同期业绩比较基准增长率为 1.73%。

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，但是随着 A 股估值中枢的下行，以及 2 季度以来期货贴水持续收敛，如果整体贴水收敛持续，Alpha 策略将会有更大的操作空间，同时本基金将根据市场环境采用适当的多种绝对收益策略，努力增厚基金业绩。

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”）在对泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金（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：泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金
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	103,014,780.44	268,504,240.93
结算备付金		51,088,795.74	204,205,345.84
存出保证金		12,627,492.60	12,264,848.40
交易性金融资产	6.4.7.2	71,860,315.31	71,683,699.24

其中：股票投资		71,860,315.31	71,683,699.24
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	100,000,000.00	150,000,000.00
应收证券清算款		30,392,649.17	33,199,601.89
应收利息	6.4.7.5	728,407.66	112,847.74
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		369,712,440.92	739,970,584.04
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		-	117,942,372.23
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		300,407.83	526,824.69
应付托管费		75,101.94	131,706.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	693,967.65	449,973.59
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	188,943.98	7,883.10
负债合计		1,258,421.40	119,058,759.79
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	372,388,286.83	619,825,426.51
未分配利润	6.4.7.10	-3,934,267.31	1,086,397.74
所有者权益合计		368,454,019.52	620,911,824.25
负债和所有者权益总计		369,712,440.92	739,970,584.04

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.989 元，基金份额总额 372,388,286.83 份。

6.2 利润表

会计主体：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

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
一、收入		-402,498.78
1.利息收入		3,175,660.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,005,704.80
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		2,169,955.87
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,899,544.94
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-8,827,395.87
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	6,468,686.41
股利收益	6.4.7.16	459,164.52
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,173,342.91
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	494,728.40
减：二、费用		5,667,207.21
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,403,363.88
2. 托管费	6.4.10.2.2	600,840.89
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,468,823.66
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	194,178.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,069,705.99
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,069,705.99

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

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)	619,825,426.51	1,086,397.74	620,911,824.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,069,705.99	-6,069,705.99
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-247,437,139.68	1,049,040.94	-246,388,098.74
其中：1.基金申购款	241,697.86	-334.70	241,363.16
2.基金赎回款	-247,678,837.54	1,049,375.64	-246,629,461.90
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	372,388,286.83	-3,934,267.31	368,454,019.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

 刘建 傅国庆 王泉
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]1416号《关于准予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《泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,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619,680,093.68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1239号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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基金合同》于2015年11月17日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为619,825,426.51份基金份额,其中认购资金利息折合145,332.83

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《泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为依法发行或上市股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，包括股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)，股指期货、权证，债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金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)。本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。本基金在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率+2%。

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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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、债券投资和衍生工具(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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别的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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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 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	3,014,780.44
定期存款	100,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	100,000,000.00
其他存款	-
合计：	103,014,780.44

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	70,708,088.72	71,860,315.31	1,152,226.59
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	70,708,088.72	71,860,315.31	1,152,226.59

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	-58,718,760.00	-	-	
其中：股指期货投资	-58,718,760.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-58,718,760.00	-	-	

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
IC1612	中证500股指期货 IC1612 合约	-44	-49,774,560.00	-3,892,782.67
IF1612	沪深300股指期货 IF1612 合约	-10	-8,944,200.00	-280,188.00
总额合计				-4,172,970.67
减：可抵销期货暂收款				-4,172,970.67
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

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	100,000,000.00	-
合计	100,000,000.00	-

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	1,873.96
应收定期存款利息	344,166.48
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,343.60
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	21,839.12
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	358,184.50
合计	728,407.66

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	693,967.65
银行间市场应付交易费用	-
合计	693,967.65

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	-
预提费用	188,943.98
合计	188,943.98

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	619,825,426.51	619,825,426.51
本期申购	241,697.86	241,697.86
本期赎回(以“-”号填列)	-247,678,837.54	-247,678,837.54
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	372,388,286.83	372,388,286.83

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

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	1,933,798.91	-847,401.17	1,086,397.74
本期利润	-3,896,363.08	-2,173,342.91	-6,069,705.99
本期基金份额交易产生的变动数	422,388.67	626,652.27	1,049,040.94
其中：基金申购款	-70.11	-264.59	-334.70
基金赎回款	422,458.78	626,916.86	1,049,375.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,540,175.50	-2,394,091.81	-3,934,267.31

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
定期存款利息收入	344,166.48
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	110,252.47
其他	298,345.67
合计	1,005,704.80

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	798,025,403.35
减：卖出股票成本总额	806,852,799.22
买卖股票差价收入	-8,827,395.87

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	6,468,686.41

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	459,164.52
基金投资产生的股利收益	-
合计	459,164.52

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	1,286,723.50
——股票投资	1,286,723.50
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-3,460,066.41
——权证投资	-
——期货投资	-3,460,066.41
3. 其他	-
合计	-2,173,342.91

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	494,351.99
基金转换费收入	376.41
合计	494,728.40

注：1、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。

2、本基金的基金转换费用中的赎回费的 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	2,468,823.66
银行间市场交易费用	-
合计	2,468,823.66

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	31,882.76
信息披露费	149,178.12
账户维护费	4,500.00
银行费用	8,217.90
其他	400.00
合计	194,178.78

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、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。

6.4.10 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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,403,363.88
其中：支付销售机构的客户维护费	548,936.85

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 1.00% 的费率计提，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 1.00% / 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 2016年1月1日至2016年6月30日	
	当期发生的基金应支付的托管费	600,840.89

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。

6.4.10.3 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

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金合同生效日（2015年11月17日）持有的基金份额	10,000,800.00
期初持有的基金份额	10,000,800.00	
期间申购/买入总份额	0.00	
期间因拆分变动份额	0.00	
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	
期末持有的基金份额	10,000,800.00	
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.6856%	

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额；

2. 本基金管理人投资本基金时所适用的费率为本基金基金合同中约定的费率。

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 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	3,014,780.44	252,940.18

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	3,013	39,108.74	39,108.74	-
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	-

6.4.12.2 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
600654	中安消	2016年5月19日	重大事项	18.54	2016年8月8日	20.39	44,200	1,133,462.02	819,468.00	-
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	39,400	692,948.80	791,940.00	-

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	33,000	575,659.03	637,230.00	-
002319	乐通股份	2016年6月2日	重大事项	17.28	-	-	24,100	399,043.47	416,448.00	-
600734	实达集团	2016年4月20日	重大事项	14.60	-	-	26,751	357,944.72	390,564.60	-
600511	国药股份	2016年2月18日	重大事项	27.42	2016年8月4日	30.16	11,900	321,514.00	326,298.00	-
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	10,538	36,566.86	220,454.96	-
002555	三七互娱	2016年3月10日	重大事项	18.10	2016年8月16日	19.91	9,278	157,824.90	167,931.80	-
002129	中环股份	2016年4月25日	重大事项	8.29	-	-	16,600	144,461.00	137,614.00	-
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	12,400	163,137.00	122,884.00	-
600019	宝钢股份	2016年6月27日	重大事项	4.90	-	-	19,100	99,821.00	93,590.00	-
002465	海格通信	2016年6月13日	重大事项	12.44	-	-	7,300	95,636.41	90,812.00	-
000651	格力电器	2016年2月22日	重大事项	19.22	-	-	3,500	66,472.00	67,270.00	-

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

本基金为特殊的混合型基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于绝对收益策略投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。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灵活运用多种绝对收益策略，对冲各类系统性风险，力争为投资者实现稳定的投资收益。

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，定期存款存放在上海银行股份有限公司，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，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计

及汇总。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有债券(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。封闭期内，本基金的流动性风险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。开放期内，本基金的流动性风险还来自于基金份额持有人可要求赎回其持有的基金份额。

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，因此除附注中列示的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，本基金所承担的其他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、存出保证金及债券投资等。

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	103,014,780.44	-	-	-	103,014,780.44
结算备付金	51,088,795.74	-	-	-	51,088,795.74
存出保证金	12,627,492.60	-	-	-	12,627,492.60
交易性金融资产	-	-	-	71,860,315.31	71,860,315.31
买入返售金融资产	100,000,000.00	-	-	-	100,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	30,392,649.17	30,392,649.17
应收利息	-	-	-	728,407.66	728,407.66
资产总计	266,731,068.78	-	-	102,981,372.14	369,712,440.92
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	300,407.83	300,407.83
应付托管费	-	-	-	75,101.94	75,101.94
应付交易费用	-	-	-	693,967.65	693,967.65
其他负债	-	-	-	188,943.98	188,943.98
负债总计	-	-	-	1,258,421.40	1,258,421.40
利率敏感度缺口	266,731,068.78	-	-	-101,722,950.74	368,454,019.52
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	268,504,240.93	-	-	-	268,504,240.93
结算备付金	204,205,345.84	-	-	-	204,205,345.84
存出保证金	12,264,848.40	-	-	-	12,264,848.40
交易性金融资产	-	-	-	71,683,699.24	71,683,699.24
买入返售金融资产	150,000,000.00	-	-	-	150,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	33,199,601.89	33,199,601.89
应收利息	-	-	-	112,847.74	112,847.74
资产总计	634,974,435.17	-	-	104,996,148.87	739,970,584.04
负债					
应付证券清算款	-	-	-	117,942,372.23	117,942,372.23
应付管理人报酬	-	-	-	526,824.69	526,824.69
应付托管费	-	-	-	131,706.18	131,706.18

应付交易费用	-	-	-	449,973.59	449,973.59
其他负债	-	-	-	7,883.10	7,883.10
负债总计	-	-	-	119,058,759.79	119,058,759.79
利率敏感度缺口	634,974,435.17	-	-	-14,062,610.92	620,911,824.25

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资产(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，自上而下决定债券组合久期、期限结构配置及债券类别配置；同时在严谨深入的信用分析基础上，综合考量企业债券的信用评级以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，自下而上地精选具有较高投资价值的个券。同时，本基金深度关注股票市场的运行状况与相应风险收益特征，在严格控制基金资产运作风险的基础上，把握投资机会。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。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 0%-95%，投资于债券、债券回购、货币市场工具、银行存款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不低于基金资产的 5%，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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	公允价值	占基金资

		资产净 值比例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	71,860,315.31	19.50	71,683,699.24	11.54
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	71,860,315.31	19.50	71,683,699.24	11.54

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-		
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%	870,000.00	200,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-870,000.00	-200,000.00

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	71,860,315.31	19.44
	其中：股票	71,860,315.31	19.44
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	100,000,000.00	27.05
	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	154,103,576.18	41.68
7	其他各项资产	43,748,549.43	11.83
8	合计	369,712,440.92	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,473,252.40	0.40
B	采矿业	672,431.00	0.18
C	制造业	43,680,181.35	11.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,746,763.00	0.47
E	建筑业	1,450,262.96	0.39
F	批发和零售业	5,835,934.11	1.58
G	交通运输、仓储和邮政业	1,984,401.00	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,024,683.90	1.09
J	金融业	4,650,476.25	1.26
K	房地产业	4,187,363.00	1.14
L	租赁和商务服务业	250,482.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	742,401.24	0.20
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	1,012,050.00	0.27
S	综合	129,507.00	0.04
	合计	71,860,315.31	19.50

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	002221	东华能源	75,500	920,345.00	0.25
2	600525	长园集团	61,620	853,437.00	0.23
3	600978	宜华生活	76,500	852,210.00	0.23
4	601012	隆基股份	65,187	850,690.35	0.23
5	000667	美好集团	232,200	828,954.00	0.22
6	000031	中粮地产	87,300	823,239.00	0.22
7	600654	中安消	44,200	819,468.00	0.22
8	600176	中国巨石	84,577	809,401.89	0.22
9	002001	新和成	38,300	809,279.00	0.22
10	300032	金龙机电	39,400	791,940.00	0.21
11	000021	深科技	71,000	781,710.00	0.21
12	600594	益佰制药	48,600	776,628.00	0.21
13	000656	金科股份	202,600	773,932.00	0.21
14	002466	天齐锂业	18,040	770,127.60	0.21
15	600755	厦门国贸	96,100	763,995.00	0.21
16	600487	亨通光电	60,700	763,606.00	0.21
17	600216	浙江医药	57,300	755,787.00	0.21
18	600366	宁波韵升	31,400	749,518.00	0.20
19	000612	焦作万方	104,700	747,558.00	0.20
20	600240	华业资本	74,200	743,484.00	0.20
21	002503	搜于特	59,600	740,232.00	0.20
22	600409	三友化工	109,000	734,660.00	0.20
23	600537	亿晶光电	93,300	719,343.00	0.20
24	000028	国药一致	11,000	716,100.00	0.19
25	600073	上海梅林	62,500	715,625.00	0.19
26	000563	陕国投A	129,300	709,857.00	0.19
27	002078	太阳纸业	144,600	705,648.00	0.19
28	000810	创维数字	39,000	704,730.00	0.19
29	002714	牧原股份	13,900	702,367.00	0.19
30	600651	飞乐音响	55,300	700,098.00	0.19
31	002696	百洋股份	36,200	692,868.00	0.19
32	002002	鸿达兴业	36,700	689,960.00	0.19
33	000599	青岛双星	100,100	688,688.00	0.19
34	002006	精功科技	50,900	688,677.00	0.19
35	600835	上海机电	35,800	687,002.00	0.19

36	600351	亚宝药业	68,100	683,043.00	0.19
37	000513	丽珠集团	14,634	674,773.74	0.18
38	002460	赣锋锂业	19,970	667,996.50	0.18
39	600329	中新药业	38,544	665,654.88	0.18
40	600297	广汇汽车	76,101	662,839.71	0.18
41	000066	长城电脑	51,800	660,450.00	0.18
42	603198	迎驾贡酒	27,500	657,525.00	0.18
43	002242	九阳股份	35,700	649,026.00	0.18
44	000948	南天信息	33,000	637,230.00	0.17
45	601002	晋亿实业	72,400	629,880.00	0.17
46	000890	法尔胜	59,200	626,928.00	0.17
47	600522	中天科技	62,500	612,500.00	0.17
48	002345	潮宏基	62,100	607,338.00	0.16
49	002483	润邦股份	52,400	604,696.00	0.16
50	300274	阳光电源	24,700	602,680.00	0.16
51	600039	四川路桥	152,800	602,032.00	0.16
52	600079	人福医药	33,800	566,826.00	0.15
53	603589	口子窖	15,400	557,634.00	0.15
54	000681	视觉中国	22,800	539,220.00	0.15
55	603766	隆鑫通用	26,632	538,499.04	0.15
56	600026	中海发展	89,900	530,410.00	0.14
57	002573	清新环境	31,297	529,545.24	0.14
58	002551	尚荣医疗	22,150	517,867.00	0.14
59	002308	威创股份	31,400	515,902.00	0.14
60	002311	海大集团	32,600	514,102.00	0.14
61	600635	大众公用	85,200	513,756.00	0.14
62	601318	中国平安	15,855	507,994.20	0.14
63	002276	万马股份	25,637	507,868.97	0.14
64	600422	昆药集团	36,100	492,404.00	0.13
65	002368	太极股份	13,500	479,655.00	0.13
66	600765	中航重机	32,800	478,224.00	0.13
67	600289	亿阳信通	33,500	468,665.00	0.13
68	000786	北新建材	49,100	445,828.00	0.12
69	601777	力帆股份	37,500	441,375.00	0.12
70	002342	巨力索具	74,800	433,840.00	0.12
71	002267	陕天然气	40,900	429,450.00	0.12
72	002319	乐通股份	24,100	416,448.00	0.11
73	002238	天威视讯	28,680	414,999.60	0.11
74	600143	金发科技	63,000	405,720.00	0.11

75	000939	凯迪生态	43,900	392,905.00	0.11
76	600734	实达集团	26,751	390,564.60	0.11
77	600016	民生银行	43,300	386,669.00	0.10
78	600498	烽火通信	15,900	386,052.00	0.10
79	000703	恒逸石化	38,900	383,943.00	0.10
80	300118	东方日升	20,000	377,200.00	0.10
81	002487	大金重工	42,300	374,355.00	0.10
82	600971	恒源煤电	66,500	367,080.00	0.10
83	000671	阳光城	60,800	361,152.00	0.10
84	300043	互动娱乐	25,300	358,501.00	0.10
85	600531	豫光金铅	42,700	356,545.00	0.10
86	600704	物产中大	37,830	354,088.80	0.10
87	002721	金一文化	17,900	346,007.00	0.09
88	600511	国药股份	11,900	326,298.00	0.09
89	600826	兰生股份	11,800	308,924.00	0.08
90	600970	中材国际	48,050	302,715.00	0.08
91	601328	交通银行	53,700	302,331.00	0.08
92	300010	立思辰	14,400	302,112.00	0.08
93	603003	龙宇燃油	15,500	296,980.00	0.08
94	600030	中信证券	17,700	287,271.00	0.08
95	002602	世纪华通	15,100	279,803.00	0.08
96	601000	唐山港	70,100	271,988.00	0.07
97	002640	跨境通	15,200	267,824.00	0.07
98	600270	外运发展	15,000	262,350.00	0.07
99	300315	掌趣科技	24,400	255,956.00	0.07
100	002309	中利科技	14,200	254,322.00	0.07
101	002281	光迅科技	3,700	237,540.00	0.06
102	002489	浙江永强	29,600	234,432.00	0.06
103	002536	西泵股份	15,300	230,877.00	0.06
104	600415	小商品城	37,000	228,660.00	0.06
105	000488	晨鸣纸业	28,700	227,878.00	0.06
106	002310	东方园林	9,400	224,848.00	0.06
107	600757	长江传媒	26,600	223,174.00	0.06
108	002463	沪电股份	42,200	222,816.00	0.06
109	601611	中国核建	10,538	220,454.96	0.06
110	600787	中储股份	29,400	218,442.00	0.06
111	600517	置信电气	22,700	215,877.00	0.06
112	600122	宏图高科	16,000	214,080.00	0.06
113	601872	招商轮船	45,500	212,940.00	0.06

114	600292	远达环保	16,800	212,856.00	0.06
115	600900	长江电力	17,000	212,330.00	0.06
116	002332	仙琚制药	18,700	209,440.00	0.06
117	601668	中国建筑	39,200	208,544.00	0.06
118	000858	五粮液	6,300	204,939.00	0.06
119	600808	马钢股份	83,400	200,994.00	0.05
120	600048	保利地产	22,900	197,627.00	0.05
121	601818	光大银行	49,700	186,872.00	0.05
122	000001	平安银行	21,120	183,744.00	0.05
123	600276	恒瑞医药	4,560	182,901.60	0.05
124	600015	华夏银行	17,600	174,064.00	0.05
125	600999	招商证券	10,400	171,600.00	0.05
126	603011	合锻智能	14,700	169,932.00	0.05
127	002363	隆基机械	13,000	169,260.00	0.05
128	002555	三七互娱	9,278	167,931.80	0.05
129	601601	中国太保	6,200	167,648.00	0.05
130	600312	平高电气	10,700	167,562.00	0.05
131	600887	伊利股份	10,000	166,700.00	0.05
132	601939	建设银行	35,000	166,250.00	0.05
133	600109	国金证券	12,300	165,804.00	0.04
134	601766	中国中车	17,800	163,226.00	0.04
135	601288	农业银行	50,500	161,600.00	0.04
136	601398	工商银行	35,400	157,176.00	0.04
137	600271	航天信息	6,600	157,080.00	0.04
138	000063	中兴通讯	10,900	156,306.00	0.04
139	002594	比亚迪	2,500	152,525.00	0.04
140	600383	金地集团	14,400	149,184.00	0.04
141	600690	青岛海尔	16,600	147,408.00	0.04
142	002074	国轩高科	3,700	146,039.00	0.04
143	600611	大众交通	20,400	138,924.00	0.04
144	002129	中环股份	16,600	137,614.00	0.04
145	600816	安信信托	8,100	136,647.00	0.04
146	601788	光大证券	8,000	135,520.00	0.04
147	000963	华东医药	2,000	134,800.00	0.04
148	601233	桐昆股份	12,400	134,664.00	0.04
149	600626	申达股份	12,900	133,128.00	0.04
150	000650	仁和药业	16,100	131,376.00	0.04
151	600784	鲁银投资	14,700	129,507.00	0.04
152	601998	中信银行	22,800	129,276.00	0.04

153	002008	大族激光	5,600	127,904.00	0.03
154	601127	小康股份	5,297	126,439.39	0.03
155	600705	中航资本	21,400	125,832.00	0.03
156	000718	苏宁环球	12,400	122,884.00	0.03
157	601390	中国中铁	17,600	122,672.00	0.03
158	002304	洋河股份	1,700	122,264.00	0.03
159	000917	电广传媒	7,000	115,710.00	0.03
160	600643	爱建集团	11,800	115,286.00	0.03
161	600872	中炬高新	9,300	114,762.00	0.03
162	600536	中国软件	4,600	114,632.00	0.03
163	000988	华工科技	5,700	114,285.00	0.03
164	600094	大名城	12,000	114,000.00	0.03
165	000776	广发证券	6,500	108,940.00	0.03
166	600062	华润双鹤	5,700	103,854.00	0.03
167	300144	宋城演艺	4,100	102,131.00	0.03
168	300251	光线传媒	8,600	99,416.00	0.03
169	300162	雷曼股份	4,500	98,955.00	0.03
170	002597	金禾实业	7,300	98,331.00	0.03
171	601018	宁波港	19,600	97,020.00	0.03
172	600100	同方股份	6,400	95,744.00	0.03
173	000768	中航飞机	4,800	94,512.00	0.03
174	600019	宝钢股份	19,100	93,590.00	0.03
175	600886	国投电力	14,000	92,400.00	0.03
176	002465	海格通信	7,300	90,812.00	0.02
177	000166	申万宏源	10,425	87,674.25	0.02
178	600795	国电电力	29,900	87,607.00	0.02
179	600298	安琪酵母	4,700	83,848.00	0.02
180	600221	海南航空	26,300	83,371.00	0.02
181	000709	河钢股份	29,700	82,269.00	0.02
182	601898	中煤能源	15,300	78,948.00	0.02
183	601111	中国国航	11,400	77,064.00	0.02
184	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.02
185	600028	中国石化	16,100	75,992.00	0.02
186	600481	双良节能	13,100	75,063.00	0.02
187	600335	国机汽车	6,600	73,986.00	0.02
188	002228	合兴包装	12,900	71,724.00	0.02
189	601186	中国铁建	7,200	71,712.00	0.02
190	002142	宁波银行	4,800	70,944.00	0.02
191	000651	格力电器	3,500	67,270.00	0.02

192	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.02
193	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.02
194	600519	贵州茅台	200	58,384.00	0.02
195	000538	云南白药	900	57,870.00	0.02
196	002042	华孚色纺	5,400	55,836.00	0.02
197	600688	上海石化	9,100	55,510.00	0.02
198	601933	永辉超市	13,400	55,342.00	0.02
199	300067	安诺其	6,400	53,696.00	0.01
200	300104	乐视网	1,000	52,910.00	0.01
201	002477	雏鹰农牧	8,700	51,939.00	0.01
202	600188	兖州煤业	4,600	50,324.00	0.01
203	000501	鄂武商 A	3,200	50,208.00	0.01
204	600694	大商股份	1,300	50,076.00	0.01
205	002025	航天电器	2,000	49,380.00	0.01
206	600850	华东电脑	1,690	48,486.10	0.01
207	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.01
208	000785	武汉中商	4,100	45,715.00	0.01
209	600350	山东高速	8,600	45,580.00	0.01
210	000552	靖远煤电	12,700	44,704.00	0.01
211	002236	大华股份	3,400	44,540.00	0.01
212	000900	现代投资	6,500	43,810.00	0.01
213	600196	复星医药	2,300	43,746.00	0.01
214	002743	富煌钢构	2,900	41,818.00	0.01
215	002202	金风科技	2,700	40,851.00	0.01
216	002271	东方雨虹	2,300	39,629.00	0.01
217	601966	玲珑轮胎	3,013	39,108.74	0.01
218	600153	建发股份	3,200	38,400.00	0.01
219	300271	华宇软件	2,000	37,840.00	0.01
220	000627	天茂集团	4,600	35,558.00	0.01
221	000762	西藏矿业	1,400	34,608.00	0.01
222	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.01
223	600201	生物股份	1,200	32,796.00	0.01
224	600729	重庆百货	1,300	32,240.00	0.01
225	002645	华宏科技	1,200	31,680.00	0.01
226	601801	皖新传媒	2,700	31,509.00	0.01
227	300233	金城医药	1,200	31,068.00	0.01
228	600566	济川药业	1,200	30,888.00	0.01
229	600606	绿地控股	2,700	29,214.00	0.01
230	300498	温氏股份	720	26,078.40	0.01

231	600889	南京化纤	2,400	25,872.00	0.01
232	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
233	002642	荣之联	900	23,679.00	0.01
234	600879	航天电子	1,430	22,279.40	0.01
235	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
236	000540	中天城投	3,100	19,313.00	0.01
237	002201	九鼎新材	1,300	18,499.00	0.01
238	000863	三湘股份	2,000	18,400.00	0.00
239	600027	华电国际	3,700	18,315.00	0.00
240	002668	奥马电器	300	18,261.00	0.00
241	600485	信威集团	1,000	17,840.00	0.00
242	601088	中国神华	1,200	16,884.00	0.00
243	600373	中文传媒	800	16,600.00	0.00
244	601718	际华集团	2,100	16,044.00	0.00
245	000839	中信国安	700	14,917.00	0.00
246	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
247	002183	怡亚通	900	12,888.00	0.00
248	300207	欣旺达	500	12,835.00	0.00
249	600741	华域汽车	800	11,208.00	0.00
250	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
251	300063	天龙集团	300	8,934.00	0.00
252	601238	广汽集团	300	7,047.00	0.00
253	600000	浦发银行	440	6,850.80	0.00
254	601600	中国铝业	1,700	6,409.00	0.00
255	600703	三安光电	300	5,991.00	0.00
256	600064	南京高科	400	5,980.00	0.00
257	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
258	600837	海通证券	300	4,626.00	0.00
259	600547	山东黄金	100	3,891.00	0.00
260	600377	宁沪高速	300	2,502.00	0.00

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	600704	物产中大	9,515,658.90	1.53

2	000667	美好集团	9,256,469.07	1.49
3	600978	宜华生活	9,005,721.84	1.45
4	600026	中海发展	8,094,225.37	1.30
5	002203	海亮股份	7,510,420.41	1.21
6	000031	中粮地产	7,306,179.37	1.18
7	002221	东华能源	7,025,819.41	1.13
8	000078	海王生物	6,573,845.73	1.06
9	600651	飞乐音响	6,234,446.00	1.00
10	002191	劲嘉股份	6,161,267.40	0.99
11	600765	中航重机	6,155,237.92	0.99
12	603589	口子窖	6,084,522.01	0.98
13	600094	大名城	6,073,258.59	0.98
14	000919	金陵药业	5,796,997.66	0.93
15	600079	人福医药	5,636,110.41	0.91
16	000758	中色股份	5,561,231.14	0.90
17	002466	天齐锂业	5,548,672.00	0.89
18	600260	凯乐科技	5,503,872.53	0.89
19	600850	华东电脑	5,286,572.25	0.85
20	600487	亨通光电	5,206,231.50	0.84

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	600704	物产中大	9,834,199.33	1.58
2	000667	美好集团	9,333,767.13	1.50
3	600978	宜华生活	7,989,981.37	1.29
4	002203	海亮股份	7,288,689.29	1.17
5	600094	大名城	7,158,197.07	1.15
6	600026	中海发展	7,154,400.15	1.15
7	000031	中粮地产	6,976,319.73	1.12
8	600260	凯乐科技	6,811,977.08	1.10
9	000758	中色股份	6,800,991.22	1.10
10	002191	劲嘉股份	6,487,045.96	1.04
11	000078	海王生物	6,411,735.74	1.03

12	002221	东华能源	6,346,260.56	1.02
13	600765	中航重机	6,271,414.24	1.01
14	000919	金陵药业	5,881,616.82	0.95
15	603589	口子窖	5,639,301.39	0.91
16	600850	华东电脑	5,599,717.65	0.90
17	600487	亨通光电	5,386,423.56	0.87
18	600651	飞乐音响	5,361,225.37	0.86
19	002396	星网锐捷	5,180,796.20	0.83
20	002179	中航光电	4,928,828.18	0.79

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	805,742,691.79
卖出股票收入（成交）总额	798,025,403.35

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/	合约市值（元）	公允价值变动	风险说明
----	----	--------	---------	--------	------

		卖)		(元)	
IC1612	中证 500 股指期货 IC1612 合约	-44	-49,774,560.00	-3,892,782.67	-
IF1612	沪深 300 股指期货 IF1612 合约	-10	-8,944,200.00	-280,188.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					-4,172,970.67
股指期货投资本期收益 (元)					6,468,686.41
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-3,460,066.41

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金采用股指期货套利的对冲策略寻找和发现市场中资产定价的偏差,捕捉绝对收益机会。股指期货套利策略是指积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系,进行套利,以获取绝对收益。股指期货套利包括以下两种方式:

①期现套利

期现套利过程中,由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动,套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

②跨期套利

跨期套利过程中,不同期货合约之间的价差不断变动,套利交易通过捕捉合约间价差进而获利。

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	12,627,492.60
2	应收证券清算款	30,392,649.17
3	应收股利	-
4	应收利息	728,407.66
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,748,549.43

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

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	600654	中安消	819,468.00	0.22	重大事项
2	300032	金龙机电	791,940.00	0.21	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

持有人户数	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	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
2,245	165,874.52	133,720,160.28	35.91%	238,668,126.55	64.09%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	30,911.52	0.0083%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和相关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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,800.00	2.12	10,000,800.00	2.12	三年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金经理等人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金管理人股东	0.00	0.00	0.00	0.00	-
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	-
合计	10,000,800.00	2.12	10,000,800.00	2.12	-

注：本基金的管理人及关联人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2015 年 11 月 17 日) 基金份额总额	619,825,426.51
-------------------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	619,825,426.51
本报告期基金总申购份额	241,697.86
减:本报告期基金总赎回份额	247,678,837.54
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期末基金份额总额	372,388,286.83

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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	股票交易	应支付该券商的佣金
------	------	-----------

	交易单元 数量	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	备注
华泰证券	2	462,681,518.72	28.87%	430,890.61	28.87%	-
兴业证券	1	456,835,600.03	28.50%	425,455.26	28.50%	-
中信建投	2	334,891,910.13	20.89%	311,887.88	20.89%	-
申万宏源	2	253,392,730.43	15.81%	235,982.27	15.81%	-
广发证券	2	51,728,653.51	3.23%	48,177.86	3.23%	-
华林证券	2	39,102,042.14	2.44%	36,417.98	2.44%	-
中山证券	1	4,168,021.18	0.26%	3,881.93	0.26%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	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	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告新增华林证券、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
华泰证券	-	-	9,296,500,000.00	61.23%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	2,933,000,000.00	19.32%	-	-
广发证券	-	-	2,205,400,000.00	14.53%	-	-
华林证券	-	-	385,000,000.00	2.54%	-	-
中山证券	-	-	362,000,000.00	2.38%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

财达证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

§ 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》、《证券时报》、《上海证券报》）或登录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