

# 泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告 摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

本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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告期自 2016 年 9 月 29 日（基金合同生效日）起至 2016 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利创金混合	
基金主代码	003414	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 9 月 29 日	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	764,261,861.23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	泰达宏利创金混合 A	泰达宏利创金混合 C
下属分级基金的交易代码:	003414	003415
报告期末下属分级基金的份额总额	100,000,794.12 份	664,261,067.11 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金紧跟新常态下我国经济发展转型过程中各类投资机遇，基于大类资产配置策略，力争为投资者创造稳定的较高投资收益。
投资策略	本基金紧跟新常态下国民经济发展过程中各类投资机遇，结合国内外宏观经济发展趋势及各行业的发展前景，精选出具有长期竞争力和增长潜力的优质公司，力求在抵御各类风险的前提下获取超越平均水平的良好回报。
业绩比较基准	75%*中证全债指数收益率+25%*沪深 300 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈沛	陆志俊
	联系电话	010-66577808	95559
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-69-88888	95559
传真		010-66577666	021-62701216

## 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日	
	泰达宏利创金混合 A	泰达宏利创金混合 C
本期已实现收益	466,311.58	2,353,855.64
本期利润	80,460.03	-893,091.27
加权平均基金份额本期利润	0.0008	-0.0015
本期基金份额净值增长率	0.08%	0.01%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0008	0.0001
期末基金资产净值	100,081,259.39	664,296,182.14
期末基金份额净值	1.0008	1.0001

注：

1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；
2. 所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；
3. 期末可供分配利润等于期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰达宏利创金混合 A

阶段	份额净值增	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-------	------	------	--------	-----	-----

	长率①	增长率标准 差②	基准收益 率③	收益率标准 差④		
过去三个月	0.07%	0.06%	-0.89%	0.24%	0.96%	-0.18%
自基金合同 生效起至今	0.08%	0.06%	-0.68%	0.24%	0.76%	-0.18%

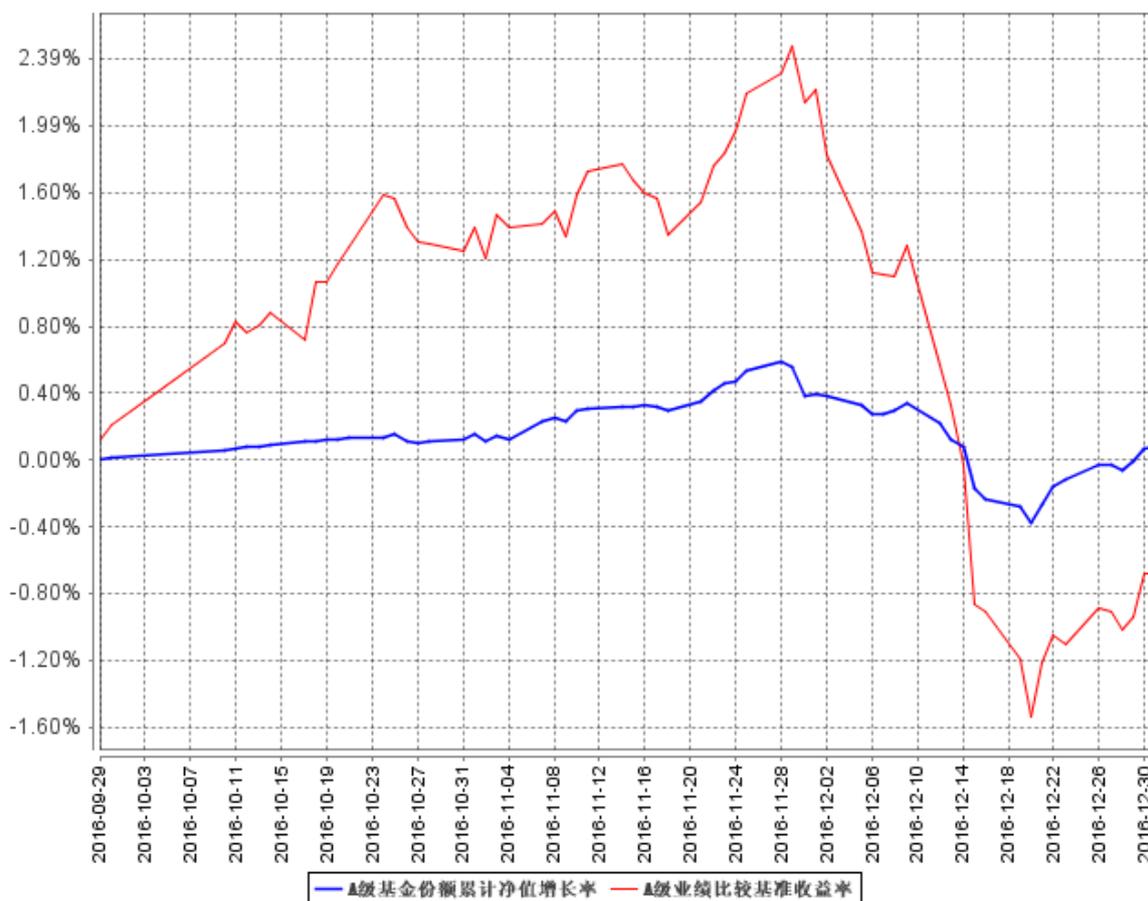
泰达宏利创金混合 C

阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益 率标准 差④	①-③	②-④
过去三个月	0.00%	0.06%	-0.89%	0.24%	0.89%	-0.18%
自基金合同 生效起至今	0.01%	0.06%	-0.68%	0.24%	0.69%	-0.18%

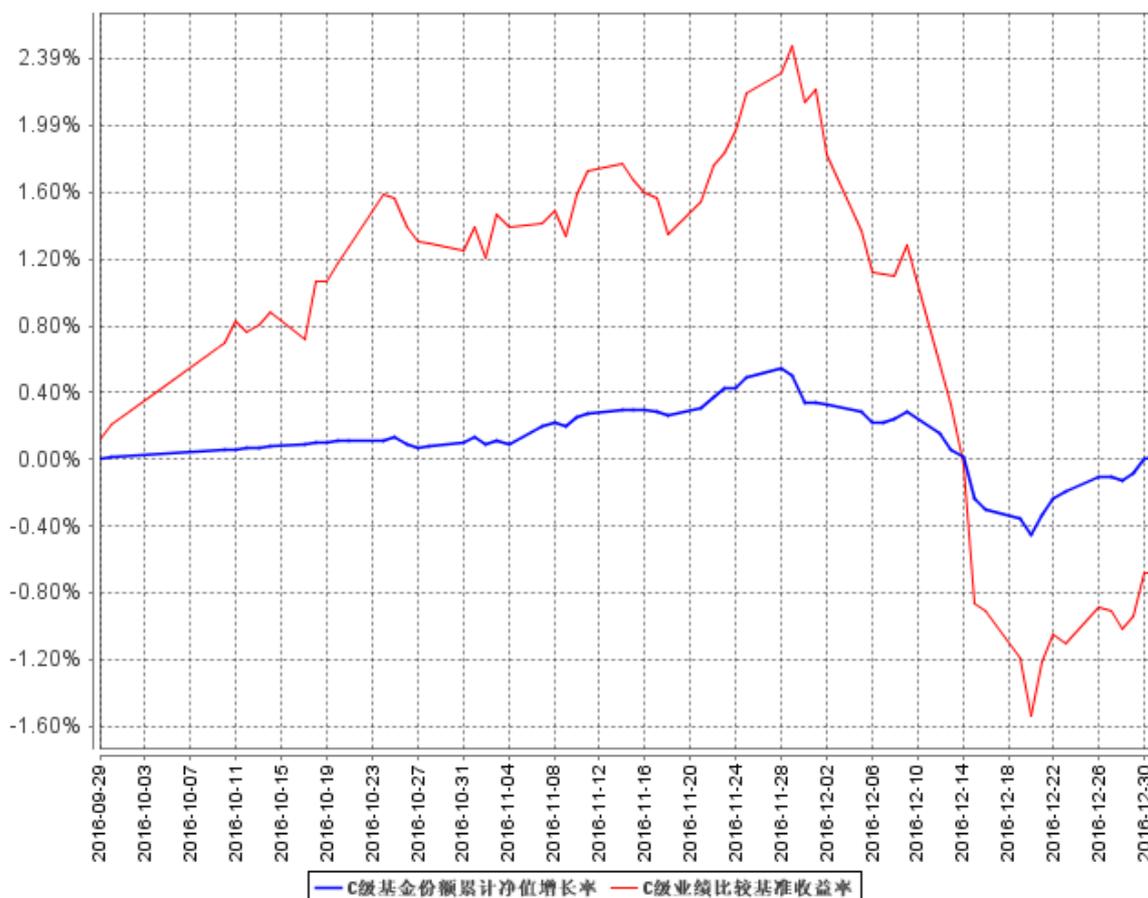
注：本基金业绩比较基准：中证全债指数收益率\*75%+沪深 300 指数收益率\*25%

### 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



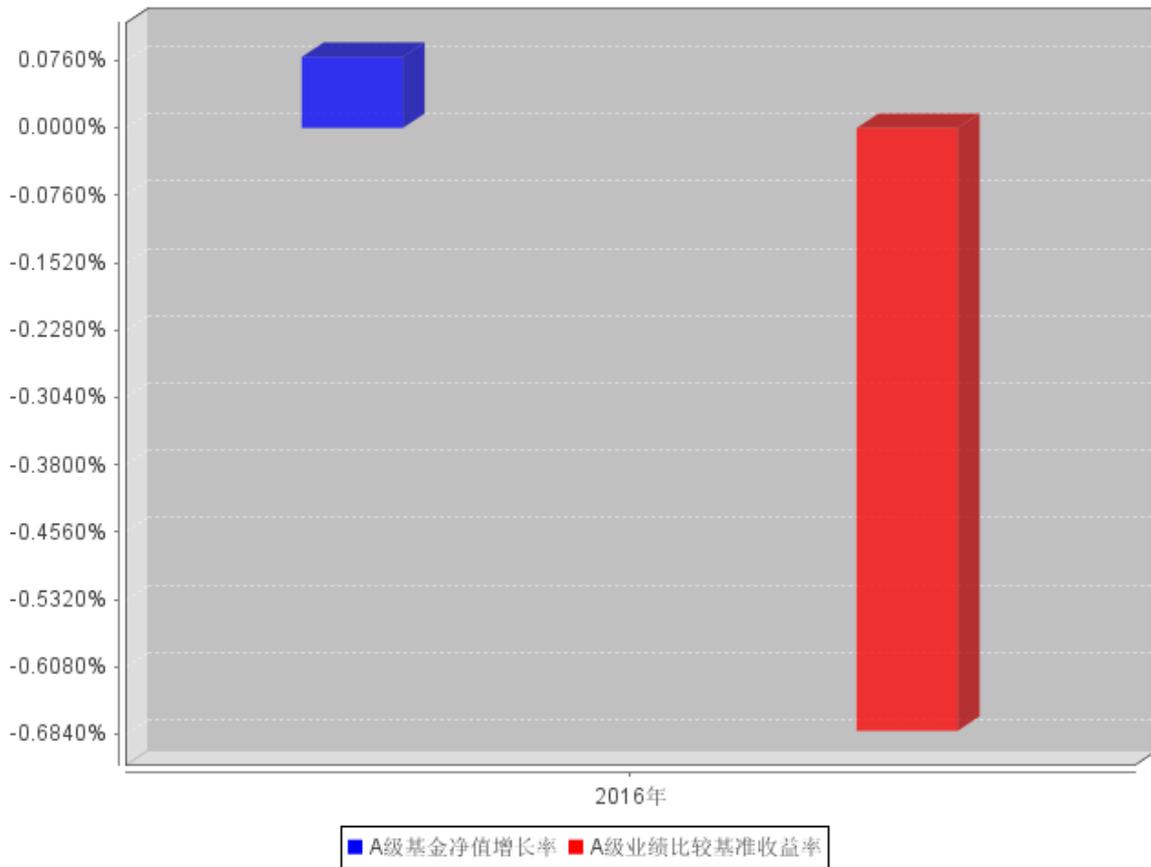
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



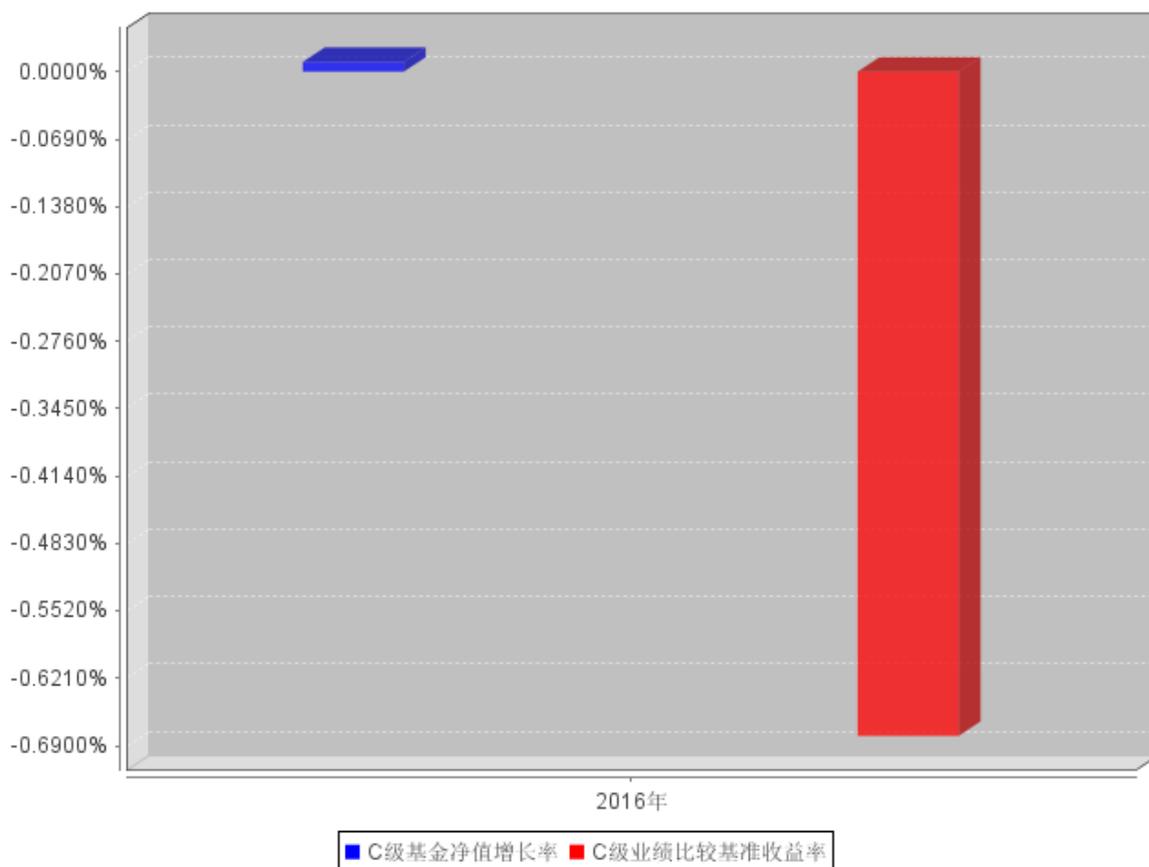
本基金成立于 2016 年 9 月 29 日，截止报告期末本基金成立不满一年。截止报告期末本基金仍在建仓期。

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

### A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



**C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图**



本基金合同生效日为 2016 年 9 月 29 日，2016 年度净值增长率的计算期间为 2016 年 9 月 29 日至 2016 年 12 月 31 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于 2016 年 9 月 29 日生效。根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金自成立以来到本报告期末未进行利润分配。目前无其他收益分配安排。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月，是中国首批合资基金管理公司之一。截至报告期末本公司股东及持股比例分别为：北方国际信托股份有限公司：51%；宏利资产管理（香港）有限公司：49%。

目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金（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、泰达宏利汇利债券型证券投资基金、泰达宏利量化增强股票型证券投资基金、泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利定宏混合型证券投资基金、泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利亚洲债券型证券投资基金、泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利京元宝货币市场基金在内的四十多只证券投资基金。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资团队全体人员的共同努力，力求实现基金财产的持续增值。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
丁宇佳	基金经理	2016 年 9 月 29 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	首席策略分析师、基金经理	2016 年 9 月 29 日	-	6	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。
傅浩	基金经理助理	2016 年 12 月 29 日	-	9	毕业于华中科技大学，理学硕士。2007 年 7 月至 2011 年 8 月，任职于东兴证券研究所，担任固定收益研究员；2011 年 8 月至 2013 年 4 月，任职于中邮证券资产管理分公司，担任投资主办人；2013 年 5 月至 2014 年 4 月，任职于民生证券股份有限公司，担任投资经理；2014 年 5 月至 2016 年 11 月，任职于中加基金管理有限公司固定收益部，担任投资经理一职；2016 年 11 月 29 日加入泰达宏利基金管理有限公司，担任固定收益部基金经理助理一职。具备 9 年证券投资从业经验，具有基金从业资格。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合

法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人建立了公平交易制度和内部控制流程，严格执行相关制度规定。在投资管理活动中，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会；在交易环节实行集中交易制度，交易部运用交易系统内的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令，确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保各投资组合享有公平的投资机会。

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控，风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估，向风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。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 30 次。30 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 年海外政治、经济黑天鹅事件不断，大宗交易见底回升，主要经济体通胀预期持续抬升，国际贸易和投资增长动力不足，受欧元区政治经济困局、贸易保护主义抬头、逆经济全球化趋势加剧等影响，全球经济复苏依旧缓慢且不均衡。面对复杂的国内外经济形势，在积极的财政政策、适应性的货币政策和推进供给侧结构性改革的背景下，国内经济企稳回升，保持平稳运行。

2016 年我国全年 GDP 达 74.4 万亿元，同比增长 6.7%，经济增速重回全球第一，实现了“十三五”时期良好开局。全年固定资产投资（不含农户）比上年名义增长 8.1%，缓中趋稳；全年社会消费品零售总额 332316 亿元，比上年名义增长 10.4%，消费升级类商品增长较快；全年进出口总额 243344 亿元，比上年下降 0.9%，降幅比上年收窄 6.1 个百分点；全年规模以上工业增加值实际增长 6.0%，规模以上工业企业实现利润总额同比增长 8.5%，工业生产平稳增长，企业效益明显好转；全年 CPI 上涨 2.0%，PPI 下降 1.4%，通胀温和上行；全年社会融资规模增量为 17.8 万亿元，新增人民币贷款 12.65 万亿元，货币信贷平稳增长，新增贷款同比多增。较为抢眼的是，全年最终消费支出对国内生产总值增长的贡献率为 64.6%，需求结构继续改善，第三产业增加值占国内生产总值的比重为 51.6%，比上年提高 1.4 个百分点，高于第二产业 11.8 个百分点，战略性新兴产业增加值比上年增长 10.5%，增速比规模以上工业高 4.5 个百分点，产业结构优化转型，新动能快速成长。

总体来看，2016 年我国经济发展的质量和效益有所提高，但投资、消费、外贸均是下降态势，显示经济企稳的基础并不牢固，此外，2016 年居民收入增幅扣除价格因素也低于 GDP 增幅，后续依赖消费拉动经济的动力也显不足。

经济平稳之下，资产市场表现分化，其中商品和房地产表现较好，股市低迷，债市结束长牛行情。

(1) 年初在“股灾”资金挤出、利率下行、购置税优惠等影响下，全国房地产市场开始了普涨，迎来本轮周期的高点，10 月以来各地政府密集出台调控政策，四季度房价走势渐趋平稳，但

全年成交规模创历史新高，城市分化态势延续。

(2) 2016 年多数商品在美元升值背景下收涨，涨幅最大的是煤、铁、钢等工业原材料，一方面是因为处于上游的国际供应商收缩产能，另一方面是我国供给侧改革的推动。年底 OPEC 再次达成减产协议，油价突破前期震荡区间，而金银等贵金属年内大起大落，全年累计表现平平；农产品中棉花和白糖价格上涨，但玉米和小麦继续下跌。

(3) 股市受上一年的股灾和年初熔断影响，全年表现平淡，其中上证综指表现好于创业板指，就行业而言，食品饮料、建筑材料表现较好，传媒、计算机、交运等跌幅在 20% 以上，表现弱势。

(4) 债市结束了 2014 年以来单边下行的牛市格局，进入宽幅震荡。纵观全年，央行的货币政策从数量型调控逐渐转向价格型调控，在公开市场操作频率也明显提高，通过引导资金价格，调节货币总闸门，资金面除个别时点波动外，整体维持在合理区间。1 至 4 月，货币信贷快速增长，房地产价格飙升，部分产能过剩行业信用债违约风险陆续爆发，财政部“营改增”税收政策出台，债市持续调整。5 至 10 月，在权威人士讲话、英国脱欧外部冲击、银行委外加杠杆、部分一二线城市房地产重启“限购限贷”等利好因素刺激下，债市大幅反弹，10 年国债收益率创下 2.64% 的新低，甚至出现所谓的“资产荒”。但 10 月中旬后，在全球央行货币政策适度转向、美国川普当选美元大幅走强、美债收益率上升等外部因素和国内大宗商品价格持续暴涨、基本面回稳、金融机构去杠杆等内部因素的合力下，债市利率急速上行，甚至一度出现交易违约，引发债市非理性下跌，10 年国债收益率上窜至 3.37%，创 2015 年 9 月以来新高，全年波动在 70bp 左右，同时 10 年国开收益率波动约 90bp。

报告期内，我们全年适度参与债券市场行情，采取防御为主的策略，重点配置了中高等级产业债和部分利率债，维持较低杠杆和短久期，进行深度的信用挖掘，精选个券，在获取较好票息收入的同时也分享了债市的阶段性收益机会。权益资产方面，除了积极参与新股的一级发行之外，在二级市场上也适度配置了低估值的大盘蓝筹股和受益于通胀回升、供给侧改革、政策支持等景气回升预期较高行业的个股。此外，基于对可转债估值泡沫的判断，我们主要参与了可转债的一级申购，极少参与二级投资，并择机参与公募可交换债的一级发行，获取了较好的绝对收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

##### 创金 A

截止报告期末，本基金份额净值为 1.0008 元，自成立以来的份额净值增长率为 0.08%，同期业绩比较基准增长率为 -0.68%。

##### 创金 C

截止报告期末，本基金份额净值为 1.0001 元，自成立以来的份额净值增长率为 0.01%，同期

业绩比较基准增长率为-0.68%。

#### 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 2017 年，我们认为基本上由于经济惯性使然，2017 年开年经济局势继续向好，但下行压力仍在，全年总体大概率平稳运行，通胀温和，一定阶段内基本面或将不是主导债市走向的最重要因素。政策调控之下地产和汽车销量放缓，房地产和工业对经济增长的拉动料将下滑，而且国际形势更为复杂（海外地缘政治冲突风险积聚、贸易保护抬头、主要发达经济体货币政策分化等），进出口贸易增长存在不确定性，基建或仍将承担托底的职能。全年物价水平将温和上涨，CPI 呈现“V”字走势，PPI 则前高后低，或于二季度开始出现拐点。

政策方面，2017 年淡化了经济增长目标，按照中央经济工作会议精神，将继续发挥积极财政政策和稳健货币政策的组合优势。财政政策稳增长任务弱化，未来更多服务于供给侧改革、民生等领域；而货币政策则定调为“稳健中性”，金融防风险成为政策重心，货币政策主动宽松的概率较小，资金面将延续紧平衡状态，时点性的流动性冲击依然不容忽视。

汇率方面，预计美联储将多次加息，双向波动的幅度将增强，人民币贬值预期将导致资金持续外流，国内债券市场利率恐承压上行。去杠杆、表外理财监管、抑制资产泡沫进一步落实推进，引发的链条传导，或对债市配置结构形成影响。

同时，我们认为 2017 年债市的潜在风险也值得重视。首先，信用违约概率提升：2016 年以来工业企业盈利的好转更多是受去产能导致的大宗商品价格上涨的推动，在需求没有改善的情况下，或将难以持续盈利；2017 年政策强调防风险，并将遏制房地产市场投机，商业银行对过剩产业和地产的资金支持力度将减弱，低评级发行人的再融资能力受限，将促发更多的违约事件。其次，监管政策的趋严：2017 年一季度表外理财将正式纳入 MPA 考核，并且不排除会有针对同业负债的监管政策出台，导致同业链条收缩，长远来看有利于降低金融市场风险，短期来看随着表外理财监管、去杠杆、抑制资产泡沫进一步落实推进，引发的链条传导，将对债市情绪和配置行为造成冲击。

债市经历 2016 年年末的暴跌之后，虽然提升了安全边际和优质品种的配置价值，但也需要一定的修复过程，目前看不到推动收益率快速下行的明确动能，我们对 2017 年债券市场整体上维持谨慎态度。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委

员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管基金运营的副总经理担任，成员包括但不限于督察长、主管投研的副总经理或投资总监、基金投资部、研究部、金融工程部、固定收益部、合规风控部门、基金运营部的主要负责人；委员会秘书由基金运营部负责人担任。所有人员均具有丰富的专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力。

基金经理参与估值委员会对相关停牌品种估值的讨论，发表相关意见和建议，但涉及停牌品种的基金经理不参与最终的投票表决。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

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

1、本报告期内本基金存在连续二十个工作日但未超过六十个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情形，报告期末，本基金基金份额持有人数量已超过两百人。

2、本报告期内本基金未出现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**

2016 年度，基金托管人在泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

## 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

2016 年度，泰达宏利基金管理有限公司在泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2016 年度，由泰达宏利基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 21824 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“泰达宏利创金混合基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是泰达宏利创金混合基金 的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称

	<p>“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;</p> <p>(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为,上述泰达宏利创金混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了泰达宏利创金混合基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	单峰   庞伊君
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体:泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日
资产:	

银行存款	1,846,076.02
结算备付金	235,424.40
存出保证金	17,869.30
交易性金融资产	857,802,089.11
其中：股票投资	59,764,089.11
基金投资	-
债券投资	798,038,000.00
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	-
应收证券清算款	-
应收利息	4,333,587.38
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	864,235,046.21
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016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	98,879,651.68
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	436,008.38
应付托管费	109,002.09
应付销售服务费	192,576.52
应付交易费用	110,721.59
应交税费	-
应付利息	19,644.42
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	110,000.00
负债合计	99,857,604.68
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	764,261,861.23
未分配利润	115,580.30
所有者权益合计	764,377,441.53
负债和所有者权益总计	864,235,046.21

注：

1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 764,261,861.23 份，其中 A 类基金份额净值 1.0008 元，基金份额总额 100,000,794.12 份； C 类基金份额净值 1.0001 元，基金份额总额 664,261,067.11 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期
	2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	1,286,726.59
1.利息收入	4,534,160.50
其中：存款利息收入	1,521,606.36
债券利息收入	2,571,466.98
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	441,087.16
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	385,363.71
其中：股票投资收益	399,763.71
基金投资收益	-
债券投资收益	-14,400.00
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	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-3,632,798.46
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	0.84
<b>减：二、费用</b>	2,099,357.83
1. 管理人报酬	1,054,071.20
2. 托管费	263,517.78
3. 销售服务费	450,690.12
4. 交易费用	138,360.96
5. 利息支出	79,243.34
其中：卖出回购金融资产支出	79,243.34
6. 其他费用	113,474.43

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-812,631.24
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-812,631.24

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	465,207,135.03	-	465,207,135.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-812,631.24	-812,631.24
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）	299,054,726.20	928,211.54	299,982,937.74
其中：1. 基金申购款	399,206,552.69	798,415.36	400,004,968.05
2. 基金赎回款	-100,151,826.49	129,796.18	-100,022,030.31
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）	764,261,861.23	115,580.30	764,377,441.53

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

泰达宏利创金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[2016]2140号《关于准予泰达宏利创金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《泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币465,199,700.00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(2016)第1253号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年9月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为465,207,135.03份基金份额,其中认购资金利息折合7,435.03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,基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

根据《泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金自募集期起根据认购、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用的,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择认购、申购某一类别的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利创金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(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、超短期融资券、短期融资券、中期票据、次级债券、可交换债券、可转债及分离交易可转债)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、同业存单、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 75%X 中证全债指数收益率+25%X 沪深 300 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 2017 年 3 月 30 日批准报出。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券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。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。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期

权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 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计字[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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》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。对证券投资基金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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	1,846,076.02
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,846,076.02

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	59,927,573.17	59,764,089.11	-163,484.06	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	801,507,314.40	798,038,000.00	-3,469,314.40
	合计	801,507,314.40	798,038,000.00	-3,469,314.40
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	861,434,887.57	857,802,089.11	-3,632,798.46	

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未进行买断式逆回购交易。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	246.53
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	106.00
应收债券利息	4,333,226.75
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	8.10
合计	4,333,587.38

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	100,119.65
银行间市场应付交易费用	10,601.94
合计	110,721.59

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	110,000.00
合计	110,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰达宏利创金混合 A		
项目	本期 2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额

基金合同生效日	99,999,000.00	99,999,000.00
本期申购	1,893.19	1,893.19
本期赎回（以“-”号填列）	-99.07	-99.07
- 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	100,000,794.12	100,000,794.12

泰达宏利创金混合 C		
项目	本期 2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	365,208,135.03	365,208,135.03
本期申购	399,204,659.50	399,204,659.50
本期赎回（以“-”号填列）	-100,151,727.42	-100,151,727.42
- 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	664,261,067.11	664,261,067.11

注：

1. 本基金自 2016 年 9 月 26 日至 2016 年 9 月 27 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 465,199,700.00 元(其中 A 类基金份额 99,999,000.00 元，C 类基金份额 365,200,700.00 元)。根据《泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 7,435.03 元，在本基金成立后折算为 7,435.03 份基金份额(全部为 C 类基金份额)，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金开放申购、赎回及定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于 2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 10 月 27 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务和定期定额投资业务自 2016 年 10 月 28 日起开始办理。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

泰达宏利创金混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	466,311.58	-385,851.55	80,460.03
本期基金份额交易	5.95	-0.71	5.24

产生的变动数			
其中：基金申购款	6.33	-1.47	4.86
基金赎回款	-0.38	0.76	0.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	466,317.53	-385,852.26	80,465.27

泰达宏利创金混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,353,855.64	-3,246,946.91	-893,091.27
本期基金份额交易产生的变动数	242,766.74	685,439.56	928,206.30
其中：基金申购款	627,559.47	170,851.03	798,410.50
基金赎回款	-384,792.73	514,588.53	129,795.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,596,622.38	-2,561,507.35	35,115.03

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日
活期存款利息收入	26,041.97
定期存款利息收入	1,486,541.67
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	985.63
其他	8,037.09
合计	1,521,606.36

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出股票成交总额	24,181,192.44
减：卖出股票成本总额	23,781,428.73
买卖股票差价收入	399,763.71

#### 7.4.7.13 债券投资收益

### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	-14,400.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-14,400.00

### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	100,000,000.00
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	97,817,800.00
减：应收利息总额	2,196,600.00
买卖债券差价收入	-14,400.00

### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末未有债券投资收益-赎回差价收入。

### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末未有债券投资收益-申购差价收入。

### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末未有资产支持证券投资收益。

### 7.4.7.14 贵金属投资收益

#### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末未有贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期未有买卖贵金属差价收入。

#### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期未有贵金属投资赎回差价收入。

#### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未有贵金属投资申购差价收入。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未有衍生工具收益-买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期未有衍生工具收益-其他投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期未有股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-3,632,798.46
——股票投资	-163,484.06
——债券投资	-3,469,314.40
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-3,632,798.46

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日
基金赎回费收入	0.84
合计	0.84

注：本基金的赎回费率按持有期间递减。对于 A 类基金份额，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。对于 C 类基金份额，对持续持有期少于 30 日的投资人收取不低于 0.5% 的赎回费，并全部归入基金资产；对持续持有期在 30 日及以上的，赎回费不归入基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	133,835.96
银行间市场交易费用	4,525.00
合计	138,360.96

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00
信息披露费	50,000.00
银行费用	3,474.43
合计	113,474.43

#### 7.4.8 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金代销机构
北方国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
宏利资产管理(香港)有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行股票交易。

##### 7.4.9.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行债券交易。

### 7.4.9.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行债券回购交易。

### 7.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行权证交易。

### 7.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

## 7.4.9.2 关联方报酬

### 7.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,054,071.20
其中：支付销售机构的客户维护费	25.25

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 0.60% 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 0.60% / 当年天数。

### 7.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	263,517.78

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 0.15% / 当年天数。

### 7.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利创金混合 A	泰达宏利创金混合 C	合计
泰达宏利基金管理有限 公司	-	450,605.34	450,605.34
合计	-	450,605.34	450,605.34

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泰达宏利基金管理有限公司，再由泰达宏利基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 X 0.30% / 当年天数。

### 7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

### 7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

### 7.4.9.5 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 9 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	1,846,076.02	26,041.97

注：

1. 本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按约定利率计息。
2. 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2016 年 12 月 31 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

### 7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 7.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

### 7.4.10 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.10.1 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

7.4.10.1.1 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
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
300586	美联新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 4 日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回

购证券款余额 98,879,651.68 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
111612172	16 北京银行 CD172	2017 年 1 月 4 日	98.17	800,000	78,536,000.00
011698832	16 中电投 SCP016	2017 年 1 月 4 日	99.68	320,000	31,897,600.00
合计				1,120,000	110,433,600.00

#### 7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

#### 7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 59,633,174.10 元，属于第二层次的余额为 798,168,915.01 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	59,764,089.11	6.92
	其中：股票	59,764,089.11	6.92
2	固定收益投资	798,038,000.00	92.34
	其中：债券	798,038,000.00	92.34
	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	2,081,500.42	0.24
7	其他各项资产	4,351,456.68	0.50
8	合计	864,235,046.21	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	950,895.00	0.12
C	制造业	1,837,026.38	0.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,596,000.00	0.21

E	建筑业	15,592.23	0.00
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	-	-
J	金融业	48,261,441.50	6.31
K	房地产业	7,103,134.00	0.93
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	59,764,089.11	7.82

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601398	工商银行	3,423,900	15,099,399.00	1.98
2	601288	农业银行	3,484,670	10,802,477.00	1.41
3	601939	建设银行	1,902,500	10,349,600.00	1.35
4	000001	平安银行	674,695	6,139,724.50	0.80
5	600048	保利地产	555,200	5,068,976.00	0.66
6	600030	中信证券	242,100	3,888,126.00	0.51
7	600266	北京城建	152,600	2,034,158.00	0.27
8	601377	兴业证券	259,100	1,982,115.00	0.26

9	000539	粤电力 A	300,000	1,596,000.00	0.21
10	000858	五 粮 液	31,100	1,072,328.00	0.14

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	000001	平安银行	16,598,002.00	2.17
2	601398	工商银行	15,199,221.00	1.99
3	601288	农业银行	10,999,771.50	1.44
4	601939	建设银行	10,199,262.00	1.33
5	600048	保利地产	5,138,543.00	0.67
6	000539	粤电力 A	5,098,209.80	0.67
7	000725	京东方 A	4,999,773.00	0.65
8	000402	金 融 街	4,999,658.00	0.65
9	600030	中信证券	3,998,580.00	0.52
10	601377	兴业证券	1,999,252.00	0.26
11	600266	北京城建	1,998,760.41	0.26
12	000858	五 粮 液	1,095,862.00	0.14
13	601958	金铂股份	999,100.71	0.13
14	002831	裕同科技	81,592.63	0.01
15	603877	太平鸟	67,734.00	0.01
16	603298	杭叉集团	46,131.47	0.01
17	603218	日月股份	39,482.80	0.01
18	603035	常熟汽饰	24,179.04	0.00
19	603886	元祖股份	22,768.56	0.00
20	300582	英飞特	20,181.15	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。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净
----	------	------	----------	----------

				值比例 (%)
1	000001	平安银行	10,439,987.04	1.37
2	000725	京东方 A	5,392,112.16	0.71
3	000402	金融街	4,762,776.00	0.62
4	000539	粤电力 A	3,586,317.24	0.47

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

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	83,709,001.90
卖出股票收入（成交）总额	24,181,192.44

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

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,925,000.00	6.53
	其中：政策性金融债	49,925,000.00	6.53
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	417,854,000.00	54.67
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	330,259,000.00	43.21
9	其他	-	-
10	合计	798,038,000.00	104.40

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	111680989	16 杭州银行 CD190	1,000,000	97,970,000.00	12.82
2	011609008	16 国电集 SCP008	800,000	79,632,000.00	10.42
3	011611010	16 大唐集 SCP010	800,000	79,568,000.00	10.41
4	041654069	16 大秦铁路 CP002	800,000	79,440,000.00	10.39
5	111612172	16 北京银行 CD172	800,000	78,536,000.00	10.27

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

#### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

在报告期内，本基金未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

## 8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.12.1 本期国债期货投资政策

在报告期内，本基金未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

### 8.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

### 8.12.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

报告期内本基金投资的兴业证券（601377）于 2016 年 7 月 28 日发布收到证监会行政处罚决定书。兴业证券在推荐欣泰电气申请首次公开发行股票并在创业板上市过程中，未遵守业务规则和行业规范，未勤勉尽责地对欣泰电气 IPO 申请文件进行审慎核查，出具的《兴业证券股份有限公司关于丹东欣泰电气股份有限公司首次公开发行股票并在创业板上市之发行保荐书》和《兴业证券股份有限公司关于丹东欣泰电气股份有限公司之 2012 年度财务报告专项检查自查工作报告》存在虚假记载；在欣泰电气公开发行股票过程中，公司作为主承销商，未审慎核查公开发行募集文件的真实性和准确性，未发现《丹东欣泰电气股份有限公司首次公开发行股票并在创业板上市招股意向书》和《丹东欣泰电气股份有限公司首次公开发行股票并在创业板上市招股说明书》中涉及欣泰电气应收账款、流动资产和经营活动产生的现金流量净额等项目的财务数据存在虚假记载。证监会决定对公司给予警告，没收保荐业务收入 1,200 万元，并处以 2,400 万元罚款；没收承销股票违法所得 2,078 万元，并处以 60 万元罚款。

本基金管理人在投资兴业证券前严格执行了对上市公司的调研、内部研究推荐、投资计划审

批等相关投资决策流程。上述股票根据股票池审批流程进入本基金备选库，由研究员跟踪并分析。上述事件发生后，本基金管理人对上市公司进行了进一步了解和他分析，认为上述事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响，因此，没有改变本基金管理人对该上市公司的投资判断。

本基金投资的其余前九名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	17,869.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,333,587.38
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,351,456.68

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
泰 达 宏 利 创 金 混 合 A	74	1,351,362.08	99,999,000.00	100.00%	1,794.12	0.00%
泰 达 宏 利 创 金 混 合 C	209	3,178,282.62	664,209,021.80	99.99%	52,045.31	0.01%
合计	283	2,700,571.95	764,208,021.80	99.99%	53,839.43	0.01%

注：1、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）；

2、截止本报告期末，本基金机构投资者占比较高，请投资者关注相关风险。

### 9.3 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	泰达宏利创金混合 A	376.06	0.0004%
	泰达宏利创金混合 C	1,498.22	0.0002%
	合计	1,874.28	0.0002%

### 9.4 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	泰达宏利创金混合 A	0
	泰达宏利创金混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达宏利创金混合 A	0
	泰达宏利创金混合 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达宏利创金混合 A	泰达宏利创金混合 C
基金合同生效日（2016 年 9 月 29 日）基金份额总额	99,999,000.00	365,208,135.03
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,893.19	399,204,659.50
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	99.07	100,151,727.42
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	100,000,794.12	664,261,067.11

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2016 年 12 月，基金管理人职工代表大会决议公布：廖仁勇、葛文娜担任公司新一届监事会职工监事，王泉、邓艺颖不再担任职工监事。监事会其余成员保持不变。

2、2016 年 12 月，基金管理人股东会决议：刁锋担任公司新一届董事会董事，孙泉不再担任董事；张建强、查卡拉·西索瓦、樸睿波担任新一届董事会独立董事，汪丁丁、周小明、杜英华不再担任独立董事。董事会其余成员保持不变。

3、本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用为人民币 60,000 元，该审计机构对本基金提供审计服务的连续年限为 1 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、本基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	1	36,774,267.44	34.21%	34,247.72	34.21%	-
国泰君安	1	35,533,077.62	33.05%	33,091.99	33.05%	-
湘财证券	4	35,197,842.80	32.74%	32,779.94	32.74%	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

东兴证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-

注：（一）2016 年本基金交易单元均为新增。

（二）交易单元选择的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- （1）经营规范，有较完备的内控制度；
- （2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要；
- （3）能为基金管理人提供高质量的研究咨询服务。

**11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源	-	-	12,000,000.00	47.06%	-	-
国泰君安	-	-	3,500,000.00	13.73%	-	-
湘财证券	-	-	10,000,000.00	39.22%	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

东兴证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

泰达宏利基金管理有限公司  
2017 年 3 月 30 日