

泰达宏利市值优选混合型证券投资基金 2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 27 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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况.....	45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
8.3 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.....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
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.....	59
8.7 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.....	59

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	59
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	59
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
8.12	投资组合报告附注	60
§9	基金份额持有人信息	61
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	61
§10	开放式基金份额变动	61
§11	重大事件揭示	62
11.1	基金份额持有人大会决议	62
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	62
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
11.4	基金投资策略的改变	62
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	62
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
11.8	其他重大事件	66
§12	备查文件目录	66
12.1	备查文件目录	66
12.2	存放地点	66
12.3	查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利市值优选混合型证券投资基金
基金简称	泰达宏利市值优选混合
基金主代码	162209
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 8 月 3 日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,400,176,318.59 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金兼顾大盘股和中小盘股，把握不同市值的股票在不同市场环境下的投资机会，投资于其中的优质股票，力争获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金将使用成功运用的MVPS模型来进行资产配置调整。MVPS模型主要考虑M（宏观经济环境）、V（价值）、P（政策）、S（市场气氛）四方面因素。MVPS模型作为本基金管理人持续一致的资产配置工具，通过定量和定性分析的有效结合判断未来市场的发展趋势，为本基金的资产配置提供支持。</p> <p>本基金股票资产比例最高可以达到95%，最低保持在60%以上，债券资产比例最高可以达到35%，最低为0%，并保持现金及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%，以保持基金资产流动性的要求。</p>
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	袁静	田青
	联系电话	010-66577513	010-67595096
	电子邮箱	irm@mfteda.com	tianqingl.zh@ccb.com

客户服务电话	400-698-8888	010-67595096
传真	010-66577666	010-66275853
注册地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100033	100033
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、证券日报
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住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
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、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	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	141,472,796.42	-390,530,932.17	1,592,276,075.96
本期利润	288,458,413.45	-531,919,259.17	1,281,780,156.50
加权平均基金份额本期利润	0.1687	-0.3143	0.5012
本期加权平均净值利润率	21.02%	-40.22%	45.83%
本期基金份额净值增长率	22.21%	-31.77%	15.54%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	-170,439,306.00	-508,169,304.70	83,874,157.88
期末可供分配基金份额利润	-0.1217	-0.2813	0.0534
期末基金资产净值	1,229,737,012.59	1,298,606,568.26	1,655,711,478.31
期末基金份额净值	0.8783	0.7187	1.0534
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末

基金份额累计净值增长率	-12.17%	-28.13%	5.34%
-------------	---------	---------	-------

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

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

3. 期末可供分配利润等于期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

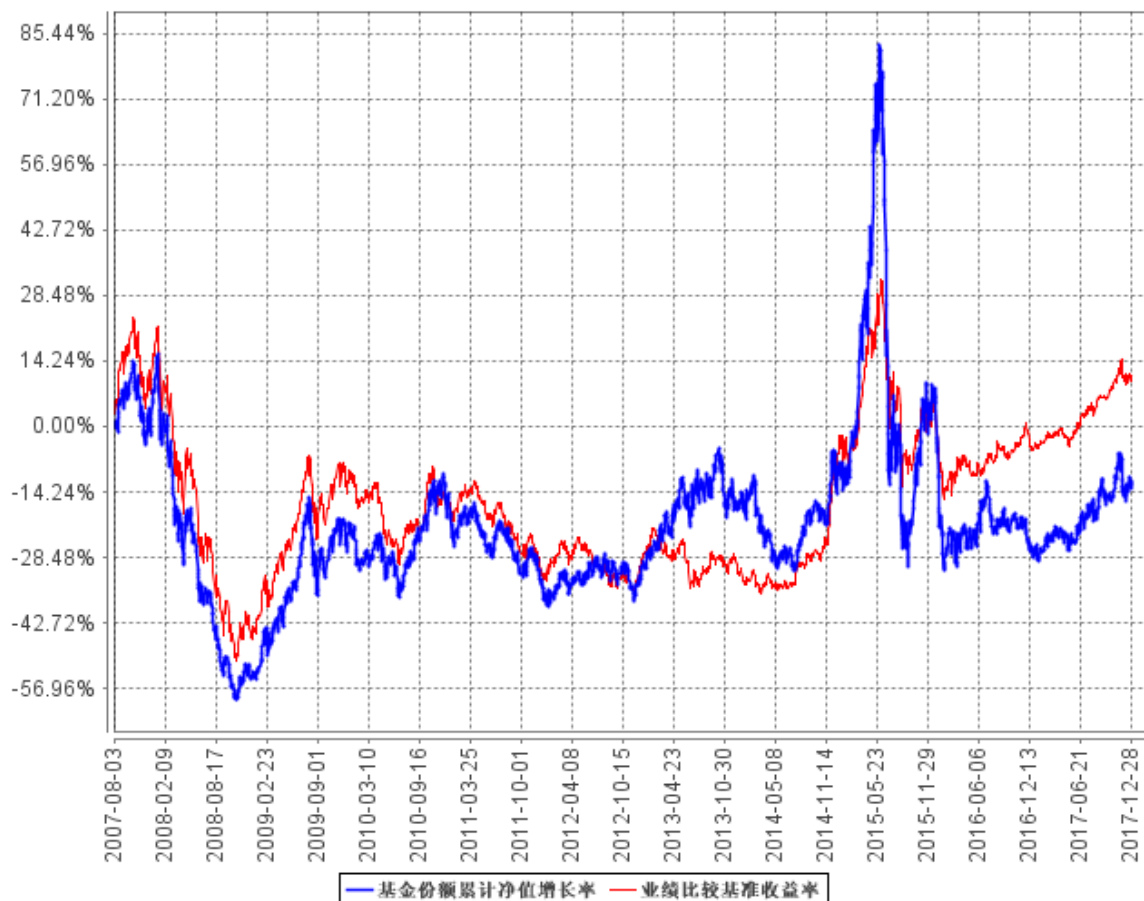
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.59%	1.34%	3.84%	0.60%	-0.25%	0.74%
过去六个月	9.06%	1.33%	7.49%	0.52%	1.57%	0.81%
过去一年	22.21%	1.17%	16.22%	0.48%	5.99%	0.69%
过去三年	-3.66%	2.24%	15.41%	1.26%	-19.07%	0.98%
过去五年	23.98%	1.98%	52.41%	1.16%	-28.43%	0.82%
自基金合同生效起至今	-12.17%	1.80%	10.55%	1.34%	-22.72%	0.46%

注：本基金的业绩比较基准：75%×沪深 300 指数收益率+25%×上证国债指数收益率。沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，该指数的指数样本覆盖了沪深两地市场八成左右的市值，具有良好的市场代表性。上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成，具有良好的市场代表性。

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

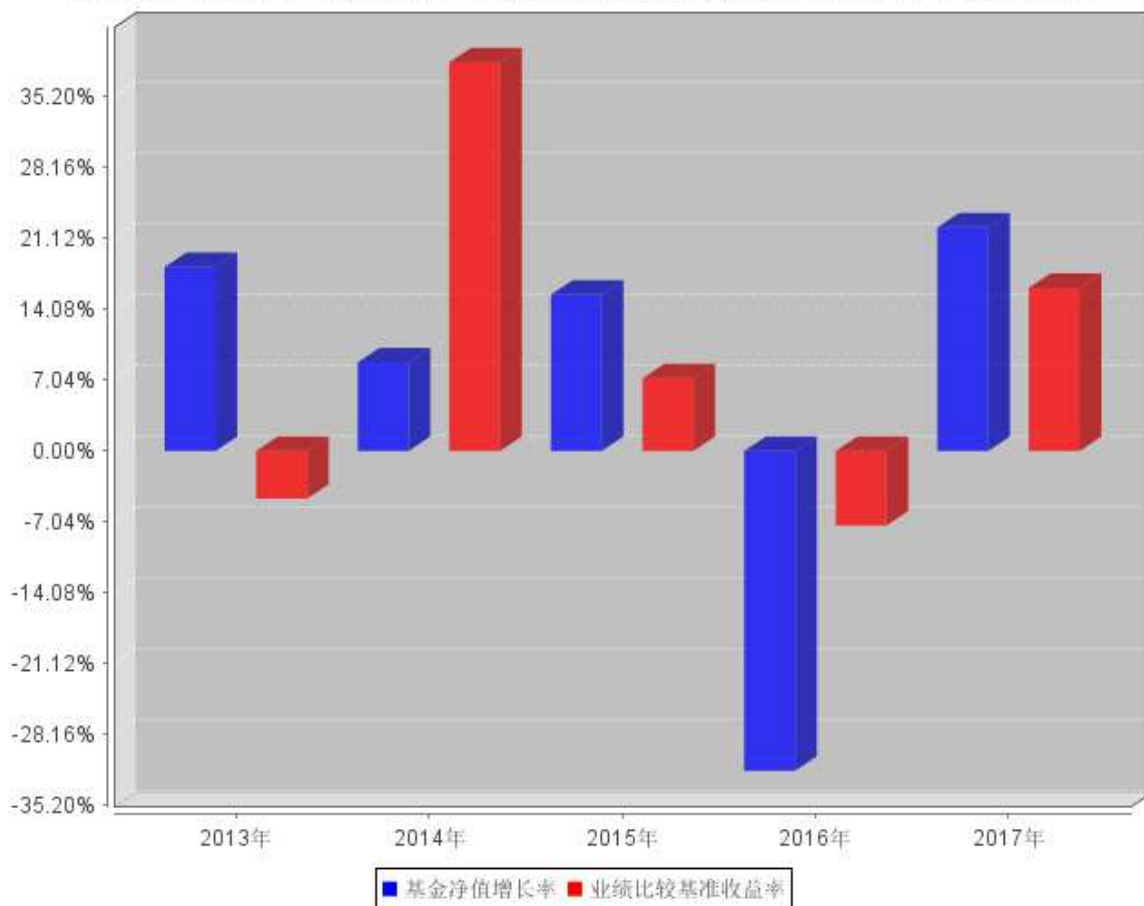
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金在建仓期末及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3 过去五年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

过去五年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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金近三年未进行利润分配。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、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利养老收益混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利活期友货币市场基金、泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、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、泰达宏利溢利债券型证券投资基金、泰达宏利恒利债券型证券投资基金、泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启迪灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启惠灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启明灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启泽灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利京天

宝货币市场基金、泰达宏利启富灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金、泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金、泰达宏利全能优选混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利交利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金在内的五十多只证券投资基金。

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		
张勋	本基金基金经理；研究部副总监	2015年4月3日	2017年2月28日	11	对外经济贸易大学管理学硕士；2006年7月至2009年6月就职于天相投资顾问有限公司，担任研究组长；2009年7月至2010年4月就职于东兴证券股份有限公司，担任研究组组长；2010年4月加入泰达宏利基金管理有限公司，曾担任研究员、高级研究员，现任研究部副总监。具备11年证券从业经验，11年证券投资基金管理经验，具有基金从业资格。
李坤元	本基金基金经理	2015年5月14日	-	11	南开大学金融学硕士；2006年7月至2007年5月，任职于申银万国证券股份有限公司，担任宏观策略部分分析师；2007年5月至2013年3月，任职于信达澳银基金管理有限公司，先后担任基金经理助理、基金经理；2013年4月至2014年10月，任职于东方基金管理有限公司，担任基金经理；2014年10月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理；具备11年证券

					从业经验，11 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
王鹏	本基金基金经理	2017 年 11 月 7 日	-	5	清华大学工学硕士；2012 年 7 月至 2014 年 3 月任职于中邮创业基金管理有限公司，担任 TMT 行业研究员；2014 年 3 月至 2015 年 6 月任职于上海磐信投资管理有限公司，担任电子行业研究员；2015 年 6 月，加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于研究部，先后担任研究员、基金经理等职；具有 5 年证券从业经验，具有基金从业资格。

注：1. 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。

2. 基金管理人已于 2017 年 11 月 29 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于基金经理休假事项的公告》，李坤元女士自 2017 年 12 月 1 日开始休产假，拟于 2018 年 4 月 5 日回岗履职。李坤元女士休假期间，本基金基金经理相关职责由共同管理该基金的基金经理王鹏先生履行。

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、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）基金管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，并经公司管理层审核签署后存档备查。基金管理人的监察稽核部定期对公平交易制度的执行和控制工作进行稽核。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控，风险管理部对可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，定期对各投资组合的交易行为进行整体分析评估，定期向风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。如发现疑似异常交易情况，相关投资组合经理对该交易情况进行合理性解释。监察稽核部定期对异常交易制度的执行和控制工作进行稽核。

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 7 次，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

2017 年，全球经济复苏超预期，中国经济表现出相当的韧性。经济的复苏带动消费，以食品饮料、家电为代表的消费板块全年表现抢眼。与此同时，国家在追求经济增长的同时提高对增长质量的要求，经济复苏+供给侧改革让周期龙头处于量价齐升的阶段，化工、有色等传统周期板块龙头表现同样抢眼。与之形成鲜明对比的是 TMT 等成长性行业，除了苹果产业链以及 5G 主题外，整体表现差强人意。

市场特征方面，在管理层从严监管、推进法制化建设的背景下，A 股市场一些偏离价值投资的市场特征被抑制，长期投资和价值投资的土壤正在形成，A 股港股/美股化趋势明显。与之相对应的，今年的市场：（1）龙头股被给予估值溢价，业绩为王、强者恒强；（2）由于业绩增速趋势向下，创业板的权重股成长性被证伪，创业板持续低迷；（3）波动率、换手率降低。预计 A 股美股化将是未来的长期趋势，优质的龙头企业也将越来越为市场所青睐。

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 0.8783 元，本报告期份额净值增长率为 22.21%，同期业绩比较基准增长率为 16.22%。

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 2018 年，在利率提升的大背景+金融监管去杠杆的背景下，投资人将更加重视投资标的即期业绩，各行业龙头仍然会占优。板块方面，受益于房地产政策放松+集中度提升的龙头房企、低估值的银行板块以及过去两年估值持续回归的部分 TMT 板块细分行业龙头出现投资机会的概率更大。

2018 年，基金管理人将在均衡配置的大思路下，配置成长和估值匹配的优质标的，同时增加资产负债表和现金流量表方面的考核。本组合会坚持中长期的投资理念，坚持基于深入基本面研究的投资方法，降低短期基于概念和博弈的操作，力争为基金持有人提供稳定的持续回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，基金管理人为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，督察长、监察稽核部、风险管理部定期与不定期的对基金的投资、交易、研发、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的监督检查。

同时，公司制定了具体严格的投资授权流程与权限；在证券投资交易前由研究部门建立可供投资的基础库并定期进行全面维护更新和适时对个股进行维护更新，通过信息技术建立多级投资交易预警系统，并把禁选股票排除在交易系统之外；设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；引入外方股东在风险控制方面的先进经验，完善公司风险管理指标及流程，监控公司各项业务的运作状况和风险程度；独立于各业务部门的内部监察人员日常对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报公司董事会及外部监管部门。

4.7 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。公司估值委员会主任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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及本基金实际运作的情况，本基金于本报告期内未进行利润分配，目前无其他收益分配安排。

4.9 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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(2018)第 21199 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	泰达宏利市值优选混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了泰达宏利市值优选混合型证券投资基金（以下简称“泰达宏利市值优选混合基金”）的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度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。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为，后附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券监督管理委员会（以下简称“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，公允反映了泰达宏利市值优选混合基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于泰达宏利市值优选混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	泰达宏利市值优选混合基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限责任公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和

	<p>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财务报表，使其实现公允反映，并设计、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> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估泰达宏利市值优选混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算泰达宏利市值优选混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督泰达宏利市值优选混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对泰达宏利市值优选混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确</p>

	<p>定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致泰达宏利市值优选混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
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)
注册会计师的姓名	单峰 庞伊君
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2018 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利市值优选混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	22,949,560.15	33,088,016.03
结算备付金		3,735,114.50	18,079,643.77
存出保证金		684,388.07	1,705,457.81
交易性金融资产	7.4.7.2	1,218,085,029.68	1,228,390,353.95
其中：股票投资		1,138,283,331.88	1,168,492,353.95
基金投资		-	-
债券投资		79,801,697.80	59,898,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-

应收证券清算款		-	28,228,389.75
应收利息	7.4.7.5	1,907,047.16	1,010,456.51
应收股利		-	-
应收申购款		16,673.16	295,626.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,247,377,812.72	1,310,797,944.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		12,253,524.60	-
应付赎回款		415,595.22	591,756.56
应付管理人报酬		1,552,644.09	1,705,405.12
应付托管费		258,774.02	284,234.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,656,140.05	9,104,844.34
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	504,122.15	505,136.30
负债合计		17,640,800.13	12,191,376.48
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,400,176,318.59	1,806,775,872.96
未分配利润	7.4.7.10	-170,439,306.00	-508,169,304.70
所有者权益合计		1,229,737,012.59	1,298,606,568.26
负债和所有者权益总计		1,247,377,812.72	1,310,797,944.74

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8783 元，基金份额总额 1,400,176,318.59 份。

7.2 利润表

会计主体：泰达宏利市值优选混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017年1月1日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日

一、收入		338,773,344.04	-441,962,681.92
1. 利息收入		2,459,529.67	1,339,537.10
其中：存款利息收入	7.4.7.11	304,148.16	1,236,782.34
债券利息收入		2,152,542.26	68,739.72
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,839.25	34,015.04
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		189,140,610.23	-302,121,191.08
其中：股票投资收益	7.4.7.12	173,531,223.94	-309,399,351.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	202,020.00	-150,800.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	15,407,366.29	7,428,960.64
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	146,985,617.03	-141,388,327.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	187,587.11	207,299.06
减：二、费用		50,314,930.59	89,956,577.25
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	20,561,308.71	19,843,465.58
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,426,884.87	3,307,244.25
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	25,742,547.79	66,214,694.24
5. 利息支出		422.72	-
其中：卖出回购金融资产支出		422.72	-
6. 其他费用	7.4.7.20	583,766.50	591,173.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		288,458,413.45	-531,919,259.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		288,458,413.45	-531,919,259.17

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利市值优选混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,806,775,872.96	-508,169,304.70	1,298,606,568.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	288,458,413.45	288,458,413.45
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）	-406,599,554.37	49,271,585.25	-357,327,969.12
其中：1. 基金申购款	31,653,255.30	-6,032,719.06	25,620,536.24
2. 基金赎回款	-438,252,809.67	55,304,304.31	-382,948,505.36
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,400,176,318.59	-170,439,306.00	1,229,737,012.59
项目	上年度可比期间 2016年1月1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）	1,571,837,320.43	83,874,157.88	1,655,711,478.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-531,919,259.17	-531,919,259.17
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）	234,938,552.53	-60,124,203.41	174,814,349.12
其中：1. 基金申购款	512,469,131.91	-111,400,744.97	401,068,386.94
2. 基金赎回款	-277,530,579.38	51,276,541.56	-226,254,037.82
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）	1,806,775,872.96	-508,169,304.70	1,298,606,568.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰达宏利市值优选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”,原泰达荷银市值优选股票型证券投资基金,后更名为泰达宏利市值优选股票型证券投资基金)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]第204号《关于同意泰达荷银市值优选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由泰达荷银基金管理有限公司(于2010年3月9日更名为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《泰达荷银市值优选股票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11,867,940,890.99元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2007)第101号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达荷银市值优选股票型证券投资基金基金合同》于2007年8月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为11,868,700,887.87份基金份额,其中认购资金利息折合759,996.88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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据本基金的基金管理人2010年3月17日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于变更公司旗下公募基金名称的公告》,本基金自公告发布之日起更名为泰达宏利市值优选股票型证券投资基金。根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,泰达宏利市值优选股票型证券投资基金于2015年7月30日公告后更名为泰达宏利市值优选混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利市值优选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国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、可转债、央行票据、短期融资券、回购、权证、资产支持证券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金资产配置的比例范围是:股票资产占基金资产的60%-95%,债券资产占基金资产的0%-35%,权证占基金资产净值的0%-3%,资产支持证券占基金资产净值的0%-20%,并保持现金或者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%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。

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 2018 年 3 月 29 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》、《泰达宏利市值优选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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度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。

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, 包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行

调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

（1）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于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）于2017年12月5日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部

分确认为估值增值。自 2017 年 12 月 5 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(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)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的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所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，本基金自 2017 年 12 月 5 日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	22,949,560.15	33,088,016.03
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	22,949,560.15	33,088,016.03

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		998,175,998.97	1,138,283,331.88	140,107,332.91
贵金属投资-金交所 黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	29,421,884.79	29,951,697.80	529,813.01
	银行间市场	49,864,500.00	49,850,000.00	-14,500.00
	合计	79,286,384.79	79,801,697.80	515,313.01
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,077,462,383.76	1,218,085,029.68	140,622,645.92
项目		上年度末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,174,955,345.06	1,168,492,353.95	-6,462,991.11
贵金属投资-金交所 黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	59,797,980.00	59,898,000.00	100,020.00
	合计	59,797,980.00	59,898,000.00	100,020.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,234,753,325.06	1,228,390,353.95	-6,362,971.11

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	5,256.80	7,210.73
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	1,848.88	8,949.38
应收债券利息	1,899,602.78	993,452.05
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.01	0.10
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	338.69	844.25
合计	1,907,047.16	1,010,456.51

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,656,140.05	9,103,994.34
银行间市场应付交易费用	-	850.00
合计	2,656,140.05	9,104,844.34

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	122.15	1,136.30
预提费用	504,000.00	504,000.00
合计	504,122.15	505,136.30

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,806,775,872.96	1,806,775,872.96
本期申购	31,653,255.30	31,653,255.30
本期赎回 (以“-”号填列)	-438,252,809.67	-438,252,809.67
- 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	1,400,176,318.59	1,400,176,318.59

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	172,560,903.89	-680,730,208.59	-508,169,304.70
本期利润	141,472,796.42	146,985,617.03	288,458,413.45
本期基金份额交易产生的变动数	-53,188,758.61	102,460,343.86	49,271,585.25
其中：基金申购款	3,558,582.84	-9,591,301.90	-6,032,719.06
基金赎回款	-56,747,341.45	112,051,645.76	55,304,304.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	260,844,941.70	-431,284,247.70	-170,439,306.00

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	153,407.47	913,714.30
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	132,782.99	283,010.36
其他	17,957.70	40,057.68
合计	304,148.16	1,236,782.34

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 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年12月31日
卖出股票成交总额	8,588,074,355.65	21,758,568,792.92
减：卖出股票成本总额	8,414,543,131.71	22,067,968,144.64
买卖股票差价收入	173,531,223.94	-309,399,351.72

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 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1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	202,020.00	-150,800.00
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	202,020.00	-150,800.00

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 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1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	61,530,000.00	50,578,306.16
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	59,797,980.00	49,870,750.00
减：应收利息总额	1,530,000.00	858,356.16
买卖债券差价收入	202,020.00	-150,800.00

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均未有衍生工具收益-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

本基金本报告期及上年度可比期间均未有衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	15,407,366.29	7,428,960.64
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	15,407,366.29	7,428,960.64

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	146,985,617.03	-141,388,327.00
——股票投资	146,570,324.02	-141,488,347.00
——债券投资	415,293.01	100,020.00
——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	146,985,617.03	-141,388,327.00

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	185,726.66	204,317.56
基金转换费收入	1,860.45	2,981.50
其他	-	-
合计	187,587.11	207,299.06

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	25,742,122.79	66,213,844.24
银行间市场交易费用	425.00	850.00
合计	25,742,547.79	66,214,694.24

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	124,000.00	124,000.00
信息披露费	380,000.00	380,000.00
其他	1,400.00	1,400.00
债券账户维护费	36,000.00	36,000.00
银行费用	42,366.50	49,773.18
合计	583,766.50	591,173.18

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,561,308.71	19,843,465.58
其中：支付销售机构的客户维护费	3,436,005.55	3,566,110.34

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 1.50%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×1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,426,884.87	3,307,244.25

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016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
建行北碚支行营业部	49,411.24	0.0035%	49,411.24	0.0027%

7.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	22,949,560.15	153,407.47	33,088,016.03	913,714.30

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：)	期末成本总额	期末估值总额	备注

				类型			股)			
300664	鹏鹞环保	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017年12月25日	2018年1月3日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
002466	天齐锂业	2017年12月26日	2018年1月3日	配股流通受限	11.06	53.21	45,319	501,228.14	2,411,423.99	-

7.4.12.2 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
600903	贵州燃气	2017年12月28日	重大事项	16.86	2018年1月2日	16.01	3,928	8,680.88	66,226.08	-
300730	科创信息	2017年12月25日	重大事项	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	重大事项	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-
600525	长园集团	2017年12月25日	重大事项	15.79	2018年1月10日	17.30	6	105.89	94.74	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

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

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约

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

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

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.33%(2016 年 12 月 31 日：未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券)。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2017 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，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的投资品种比例等。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本基金所持证券在证券交易所上市，或者可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	22,949,560.15	-	-	-	22,949,560.15
结算备付金	3,735,114.50	-	-	-	3,735,114.50
存出保证金	684,388.07	-	-	-	684,388.07
交易性金融资产	75,703,420.00	-4,098,277.80	1,138,283,331.88	-	1,218,085,029.68
应收利息	-	-	-	1,907,047.16	1,907,047.16
应收申购款	198.81	-	-	16,474.35	16,673.16

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	103,072,681.53	-	-4,098,277.80	1,140,206,853.39	1,247,377,812.72
负债					
应付证券清算款	-	-	-	12,253,524.60	12,253,524.60
应付赎回款	-	-	-	415,595.22	415,595.22
应付管理人报酬	-	-	-	1,552,644.09	1,552,644.09
应付托管费	-	-	-	258,774.02	258,774.02
应付交易费用	-	-	-	2,656,140.05	2,656,140.05
其他负债	-	-	-	504,122.15	504,122.15
负债总计	-	-	-	17,640,800.13	17,640,800.13
利率敏感度缺口	103,072,681.53	-	-4,098,277.80	1,122,566,053.26	1,229,737,012.59
上年度末 2016 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	33,088,016.03	-	-	-	33,088,016.03
结算备付金	18,079,643.77	-	-	-	18,079,643.77
存出保证金	1,705,457.81	-	-	-	1,705,457.81
交易性金融资产	59,898,000.00	-	-	-1,168,492,353.95	1,228,390,353.95
应收证券清算款	-	-	-	28,228,389.75	28,228,389.75
应收利息	-	-	-	1,010,456.51	1,010,456.51
应收申购款	-	-	-	295,626.92	295,626.92
资产总计	112,771,117.61	-	-	-1,198,026,827.13	1,310,797,944.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	591,756.56	591,756.56
应付管理人报酬	-	-	-	1,705,405.12	1,705,405.12
应付托管费	-	-	-	284,234.16	284,234.16
应付交易费用	-	-	-	9,104,844.34	9,104,844.34
其他负债	-	-	-	505,136.30	505,136.30
负债总计	-	-	-	12,191,376.48	12,191,376.48
利率敏感度缺口	112,771,117.61	-	-	-1,185,835,450.65	1,298,606,568.26

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 6.49%(2016 年 12 月 31 日：4.61%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2016 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，债券投资比例为基金资产的 0%-35%，权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%，资产支持证券投资比例为基金资产净值的 0%-20%，现金或者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%。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,138,283,331.88	92.56	1,168,492,353.95	89.98
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	1,138,283,331.88	92.56	1,168,492,353.95	89.98

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2017年12月31日）	上年度末（2016年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	83,910,000.00	73,440,000.00
业绩比较基准下降 5%	-83,910,000.00	-73,440,000.00	

7.4.14 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 2017 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 1,138,068,502.86 元，属于第二层次的余额为 80,016,526.82 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 1,101,584,667.06 元，第二层次 126,805,686.89 元，无第三层次)。

(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 2017 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(2016 年 12 月 31

日：同)。

(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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，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	1,138,283,331.88	91.25
	其中：股票	1,138,283,331.88	91.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	79,801,697.80	6.40
	其中：债券	79,801,697.80	6.40
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	26,684,674.65	2.14
8	其他各项资产	2,608,108.39	0.21
9	合计	1,247,377,812.72	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	21,306,705.20	1.73
B	采矿业	111.54	0.00
C	制造业	773,928,166.95	62.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	584,348.18	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	82,486.26	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	22,875,057.01	1.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,214,368.64	5.06
J	金融业	202,382,797.36	16.46
K	房地产业	34,149,351.84	2.78
L	租赁和商务服务业	68,010.88	0.01
M	科学研究和技术服务业	415,844.04	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	988,699.20	0.08
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	19,287,384.78	1.57
S	综合	-	-
	合计	1,138,283,331.88	92.56

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	600519	贵州茅台	96,082	67,016,234.18	5.45
2	000858	五粮液	794,935	63,499,407.80	5.16
3	601318	中国平安	869,688	60,860,766.24	4.95
4	600036	招商银行	1,955,394	56,745,533.88	4.61
5	601336	新华保险	552,500	38,785,500.00	3.15
6	002415	海康威视	961,108	37,483,212.00	3.05
7	300136	信维通信	694,192	35,195,534.40	2.86
8	000002	万科A	1,099,464	34,149,351.84	2.78
9	601636	旗滨集团	5,391,920	33,645,580.80	2.74
10	300628	亿联网络	249,994	33,324,200.20	2.71
11	002583	海能达	1,641,993	30,393,290.43	2.47
12	300296	利亚德	1,510,852	29,446,505.48	2.39
13	000333	美的集团	507,530	28,132,387.90	2.29
14	601398	工商银行	3,993,706	24,760,977.20	2.01
15	600183	生益科技	1,428,666	24,658,775.16	2.01
16	600703	三安光电	965,163	24,505,488.57	1.99
17	600276	恒瑞医药	355,168	24,499,488.64	1.99
18	002035	华帝股份	809,928	24,411,229.92	1.99
19	000063	中兴通讯	668,411	24,303,423.96	1.98
20	600438	通威股份	1,944,241	23,544,758.51	1.91
21	002245	澳洋顺昌	2,229,500	22,852,375.00	1.86
22	002078	太阳纸业	2,402,434	22,294,587.52	1.81
23	000651	格力电器	497,700	21,749,490.00	1.77
24	000910	大亚圣象	943,400	21,603,860.00	1.76
25	000998	隆平高科	828,410	21,306,705.20	1.73
26	601601	中国太保	512,500	21,227,750.00	1.73
27	002174	游族网络	951,755	21,224,136.50	1.73
28	002343	慈文传媒	532,000	18,944,520.00	1.54
29	002466	天齐锂业	347,735	18,502,979.35	1.50
30	002456	欧菲科技	830,500	17,099,995.00	1.39
31	002157	正邦科技	2,933,600	16,809,528.00	1.37
32	600690	青岛海尔	863,000	16,258,920.00	1.32
33	002460	赣锋锂业	223,015	16,001,326.25	1.30
34	000661	长春高新	77,000	14,091,000.00	1.15
35	000488	晨鸣纸业	843,782	14,065,845.94	1.14
36	000725	京东方A	2,208,146	12,785,165.34	1.04
37	002624	完美世界	378,000	12,647,880.00	1.03
38	002384	东山精密	436,597	12,425,550.62	1.01

39	002555	三七互娱	564,708	11,599,102.32	0.94
40	300365	恒华科技	343,293	10,865,223.45	0.88
41	300065	海兰信	475,200	8,658,144.00	0.70
42	601233	桐昆股份	359,966	8,095,635.34	0.66
43	002294	信立泰	172,500	7,795,275.00	0.63
44	002812	创新股份	72,157	7,424,955.30	0.60
45	603826	坤彩科技	474,196	7,297,876.44	0.59
46	600563	法拉电子	125,400	6,371,574.00	0.52
47	002829	星网宇达	228,850	6,217,854.50	0.51
48	002572	索菲亚	162,400	5,976,320.00	0.49
49	300588	熙菱信息	196,305	5,712,475.50	0.46
50	600867	通化东宝	135,400	3,099,306.00	0.25
51	300595	欧普康视	22,500	1,139,625.00	0.09
52	000888	峨眉山A	88,800	956,376.00	0.08
53	600025	华能水电	94,713	501,978.90	0.04
54	300676	华大基因	1,847	384,176.00	0.03
55	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.02
56	002766	索菱股份	15,227	215,462.05	0.02
57	300685	艾德生物	2,000	181,340.00	0.01
58	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.01
59	601019	山东出版	12,630	162,548.10	0.01
60	603260	合盛硅业	2,796	158,645.04	0.01
61	603612	索通发展	2,338	116,736.34	0.01
62	603659	璞泰来	2,012	111,303.84	0.01
63	002918	蒙娜丽莎	1,512	84,218.40	0.01
64	300708	聚灿光电	2,742	83,740.68	0.01
65	603533	掌阅科技	1,691	76,636.12	0.01
66	600933	爱柯迪	4,860	74,698.20	0.01
67	002913	奥士康	1,442	69,172.74	0.01
68	603106	恒银金融	2,786	68,953.50	0.01
69	603648	畅联股份	3,196	68,010.88	0.01
70	600019	宝钢股份	7,870	67,996.80	0.01
71	603466	风语筑	1,247	67,612.34	0.01
72	300691	联合光电	808	66,918.56	0.01
73	600196	复星医药	1,496	66,572.00	0.01
74	600903	贵州燃气	3,928	66,226.08	0.01
75	300709	精研科技	865	62,565.45	0.01
76	002906	华阳集团	2,742	61,749.84	0.01
77	603619	中曼石油	1,760	61,212.80	0.00

78	603103	横店影视	2,021	57,638.92	0.00
79	603661	恒林股份	830	56,855.00	0.00
80	300723	一品红	1,561	56,008.68	0.00
81	002905	金逸影视	1,539	55,065.42	0.00
82	603605	珀莱雅	1,909	54,826.48	0.00
83	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.00
84	300700	岱勒新材	833	54,061.70	0.00
85	002902	铭普光磁	1,270	54,000.40	0.00
86	603305	旭升股份	1,351	51,405.55	0.00
87	002908	德生科技	1,751	50,638.92	0.00
88	300719	安达维尔	1,898	49,765.56	0.00
89	603365	水星家纺	2,111	48,785.21	0.00
90	603890	春秋电子	1,126	47,438.38	0.00
91	601086	国芳集团	5,799	47,435.82	0.00
92	002820	桂发祥	1,772	45,859.36	0.00
93	300726	宏达电子	1,548	44,737.20	0.00
94	603507	振江股份	1,093	43,938.60	0.00
95	603937	丽岛新材	1,662	43,610.88	0.00
96	603916	苏博特	2,450	42,042.00	0.00
97	603083	剑桥科技	877	41,473.33	0.00
98	603363	傲农生物	2,486	41,068.72	0.00
99	300718	长盛轴承	1,017	40,954.59	0.00
100	000596	古井贡酒	600	39,402.00	0.00
101	300713	英可瑞	455	38,629.50	0.00
102	603278	大业股份	1,624	37,498.16	0.00
103	002903	宇环数控	928	37,138.56	0.00
104	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.00
105	300711	广哈通信	1,347	36,220.83	0.00
106	002917	金奥博	1,090	35,643.00	0.00
107	603711	香飘飘	1,318	35,019.26	0.00
108	002910	庄园牧场	1,696	34,937.60	0.00
109	603912	佳力图	1,226	34,609.98	0.00
110	603970	中农立华	1,046	34,141.44	0.00
111	300730	科创信息	821	34,112.55	0.00
112	603856	东宏股份	1,619	33,302.83	0.00
113	603685	晨丰科技	932	32,769.12	0.00
114	603809	豪能股份	900	32,436.00	0.00
115	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.00
116	300712	永福股份	1,279	31,668.04	0.00

117	603848	好太太	1,377	31,244.13	0.00
118	300731	科创新源	808	30,914.08	0.00
119	603289	泰瑞机器	1,596	30,403.80	0.00
120	300729	乐歌股份	941	30,187.28	0.00
121	603607	京华激光	734	29,873.80	0.00
122	002898	赛隆药业	1,464	29,426.40	0.00
123	603917	合力科技	1,022	29,014.58	0.00
124	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.00
125	300727	润禾材料	870	28,701.30	0.00
126	603922	金鸿顺	1,023	28,674.69	0.00
127	002909	集泰股份	1,298	28,517.06	0.00
128	300721	怡达股份	745	28,496.25	0.00
129	300705	九典制药	1,073	28,048.22	0.00
130	603722	阿科力	707	27,954.78	0.00
131	002907	华森制药	1,479	27,864.36	0.00
132	300716	国立科技	948	24,572.16	0.00
133	300618	寒锐钴业	100	23,577.00	0.00
134	603829	洛凯股份	1,281	23,160.48	0.00
135	603683	晶华新材	1,095	22,776.00	0.00
136	603813	原尚股份	741	22,682.01	0.00
137	603110	东方材料	847	22,420.09	0.00
138	002864	盘龙药业	781	22,375.65	0.00
139	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.00
140	300450	先导智能	377	21,477.69	0.00
141	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.00
142	603499	翔港科技	812	20,097.00	0.00
143	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.00
144	300699	光威复材	292	19,137.68	0.00
145	002923	润都股份	954	16,227.54	0.00
146	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.00
147	000513	丽珠集团	220	14,619.00	0.00
148	300684	中石科技	827	11,528.38	0.00
149	603655	朗博科技	880	8,184.00	0.00
150	000538	云南白药	63	6,412.77	0.00
151	300477	合纵科技	175	3,813.25	0.00
152	002709	天赐材料	76	3,495.24	0.00
153	601012	隆基股份	74	2,696.56	0.00
154	300663	科蓝软件	93	1,977.18	0.00
155	002439	启明星辰	56	1,307.60	0.00

156	002805	丰元股份	35	1,023.75	0.00
157	601108	财通证券	51	937.38	0.00
158	601933	永辉超市	90	909.00	0.00
159	300166	东方国信	70	878.50	0.00
160	600808	马钢股份	200	826.00	0.00
161	002142	宁波银行	38	676.78	0.00
162	601688	华泰证券	38	655.88	0.00
163	603527	众源新材	21	628.74	0.00
164	300214	日科化学	43	217.58	0.00
165	600096	云天化	20	143.20	0.00
166	000983	西山煤电	11	111.54	0.00
167	600525	长园集团	6	94.74	0.00
168	600884	杉杉股份	4	77.52	0.00
169	600566	济川药业	1	38.15	0.00
170	002340	格林美	1	7.19	0.00

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	300628	亿联网络	106,050,514.66	8.17
2	600029	南方航空	103,553,006.81	7.97
3	601699	潞安环能	102,361,617.19	7.88
4	000333	美的集团	95,466,651.98	7.35
5	002460	赣锋锂业	91,618,904.71	7.06
6	002008	大族激光	90,043,531.45	6.93
7	600176	中国巨石	89,739,452.03	6.91
8	002415	海康威视	89,016,604.50	6.85
9	000651	格力电器	85,528,359.05	6.59
10	000568	泸州老窖	85,173,394.40	6.56
11	601398	工商银行	80,607,230.00	6.21
12	601318	中国平安	77,268,085.84	5.95
13	600703	三安光电	77,004,626.39	5.93
14	002635	安洁科技	73,534,281.44	5.66
15	601668	中国建筑	73,113,648.61	5.63
16	600028	中国石化	71,266,803.90	5.49

17	601288	农业银行	69,909,403.00	5.38
18	000002	万科A	68,287,002.48	5.26
19	000858	五粮液	68,146,947.66	5.25
20	601336	新华保险	67,847,906.04	5.22
21	603993	洛阳钼业	67,577,638.70	5.20
22	000983	西山煤电	66,409,126.13	5.11
23	600110	诺德股份	66,221,676.94	5.10
24	300588	熙菱信息	66,006,076.48	5.08
25	002829	星网宇达	64,585,562.51	4.97
26	601933	永辉超市	60,486,640.00	4.66
27	000928	中钢国际	59,837,819.97	4.61
28	002466	天齐锂业	58,214,776.75	4.48
29	002456	欧菲科技	56,837,058.30	4.38
30	300296	利亚德	56,607,926.99	4.36
31	002573	清新环境	55,429,860.74	4.27
32	002572	索菲亚	54,845,404.95	4.22
33	600438	通威股份	54,471,126.80	4.19
34	600801	华新水泥	53,559,440.65	4.12
35	601601	中国太保	53,120,539.56	4.09
36	601111	中国国航	52,296,158.00	4.03
37	601117	中国化学	52,101,886.88	4.01
38	601186	中国铁建	50,776,022.11	3.91
39	600690	青岛海尔	49,522,194.55	3.81
40	300083	劲胜智能	48,925,204.10	3.77
41	000596	古井贡酒	48,462,571.11	3.73
42	600549	厦门钨业	48,417,627.96	3.73
43	000709	河钢股份	48,333,227.87	3.72
44	000423	东阿阿胶	48,079,128.40	3.70
45	600009	上海机场	47,955,324.26	3.69
46	600036	招商银行	47,103,030.07	3.63
47	000933	神火股份	47,080,241.00	3.63
48	601628	中国人寿	46,376,076.15	3.57
49	000488	晨鸣纸业	45,613,306.08	3.51
50	000063	中兴通讯	45,478,529.47	3.50
51	600295	鄂尔多斯	45,468,043.03	3.50
52	600019	宝钢股份	45,383,471.78	3.49

53	300136	信维通信	44,678,102.40	3.44
54	002050	三花智控	43,974,153.32	3.39
55	002236	大华股份	43,755,075.35	3.37
56	601012	隆基股份	42,217,042.40	3.25
57	000001	平安银行	42,065,745.75	3.24
58	603186	华正新材	42,021,580.14	3.24
59	600196	复星医药	41,692,184.77	3.21
60	600884	杉杉股份	41,551,251.32	3.20
61	601688	华泰证券	40,408,689.32	3.11
62	600507	方大特钢	40,210,075.90	3.10
63	600309	万华化学	40,164,841.69	3.09
64	000538	云南白药	39,914,477.51	3.07
65	002841	视源股份	39,903,068.76	3.07
66	002850	科达利	39,884,408.91	3.07
67	600373	中文传媒	39,351,802.98	3.03
68	002035	华帝股份	39,237,208.18	3.02
69	600760	中航黑豹	38,947,441.38	3.00
70	002439	启明星辰	38,549,436.54	2.97
71	300581	晨曦航空	38,430,791.58	2.96
72	002340	格林美	37,653,865.46	2.90
73	600054	黄山旅游	37,310,833.96	2.87
74	002812	创新股份	36,801,958.80	2.83
75	603816	顾家家居	36,581,009.95	2.82
76	000921	海信科龙	36,524,954.63	2.81
77	300450	先导智能	36,462,173.60	2.81
78	601800	中国交建	36,392,295.20	2.80
79	002709	天赐材料	36,330,947.41	2.80
80	000970	中科三环	36,009,066.40	2.77
81	002479	富春环保	35,929,548.42	2.77
82	600567	山鹰纸业	35,833,777.00	2.76
83	600409	三友化工	35,271,508.42	2.72
84	600348	阳泉煤业	34,770,448.94	2.68
85	300137	先河环保	34,681,742.00	2.67
86	000725	京东方A	34,340,757.00	2.64
87	002078	太阳纸业	34,181,614.78	2.63
88	601166	兴业银行	34,004,969.30	2.62

89	300274	阳光电源	33,794,217.12	2.60
90	601231	环旭电子	33,383,459.19	2.57
91	002157	正邦科技	33,035,367.04	2.54
92	601888	中国国旅	32,861,395.30	2.53
93	002142	宁波银行	32,746,426.56	2.52
94	600525	长园集团	32,599,544.71	2.51
95	300166	东方国信	32,423,243.34	2.50
96	002027	分众传媒	32,199,213.16	2.48
97	000059	华锦股份	32,051,280.12	2.47
98	002805	丰元股份	31,957,934.30	2.46
99	000968	蓝焰控股	31,722,374.76	2.44
100	600141	兴发集团	31,488,133.10	2.42
101	601636	旗滨集团	31,403,160.02	2.42
102	002583	海能达	30,617,922.60	2.36
103	603039	泛微网络	30,470,950.60	2.35
104	600030	中信证券	30,141,999.00	2.32
105	000786	北新建材	30,103,324.56	2.32
106	000069	华侨城A	29,999,931.70	2.31
107	600015	华夏银行	29,123,772.13	2.24
108	600585	海螺水泥	28,779,539.00	2.22
109	600583	海油工程	28,548,467.14	2.20
110	002310	东方园林	28,261,442.95	2.18
111	002475	立讯精密	27,957,130.30	2.15
112	001979	招商蛇口	27,707,993.72	2.13
113	600011	华能国际	27,673,354.12	2.13
114	300214	日科化学	27,548,499.63	2.12
115	300308	中际旭创	27,170,210.00	2.09
116	603626	科森科技	26,954,867.45	2.08
117	600500	中化国际	26,720,928.09	2.06
118	002624	完美世界	26,671,974.62	2.05
119	002051	中工国际	26,666,493.76	2.05
120	000963	华东医药	26,505,722.38	2.04
121	600428	中远海特	26,249,802.28	2.02
122	000513	丽珠集团	26,237,780.72	2.02
123	300600	瑞特股份	26,235,431.88	2.02
124	002244	滨江集团	26,163,926.14	2.01

125	002564	天沃科技	26,156,110.58	2.01
126	000039	中集集团	26,086,001.30	2.01

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

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	000568	泸州老窖	145,055,031.52	11.17
2	600028	中国石化	118,257,787.49	9.11
3	600029	南方航空	104,927,744.65	8.08
4	601699	潞安环能	103,492,131.78	7.97
5	002008	大族激光	96,277,964.86	7.41
6	002460	赣锋锂业	95,050,151.92	7.32
7	000928	中钢国际	87,443,802.57	6.73
8	600176	中国巨石	86,148,290.47	6.63
9	000651	格力电器	79,111,278.76	6.09
10	601933	永辉超市	76,610,361.08	5.90
11	601117	中国化学	75,669,870.68	5.83
12	000333	美的集团	75,618,631.86	5.82
13	002635	安洁科技	71,098,887.15	5.48
14	601668	中国建筑	70,619,491.74	5.44
15	002415	海康威视	70,288,394.78	5.41
16	603993	洛阳钼业	70,194,251.00	5.41
17	601288	农业银行	69,933,306.08	5.39
18	000858	五粮液	68,295,304.06	5.26
19	300628	亿联网络	65,797,646.00	5.07
20	000983	西山煤电	64,204,387.00	4.94
21	601166	兴业银行	64,002,992.90	4.93
22	600110	诺德股份	59,593,130.30	4.59
23	600703	三安光电	59,352,783.86	4.57
24	002466	天齐锂业	58,648,446.64	4.52
25	300588	熙菱信息	58,252,026.31	4.49
26	601398	工商银行	57,176,571.16	4.40
27	000059	华锦股份	57,172,301.87	4.40
28	002572	索菲亚	56,260,086.93	4.33

29	601012	隆基股份	55,810,500.52	4.30
30	002829	星网宇达	55,463,063.00	4.27
31	002573	清新环境	55,227,165.36	4.25
32	601111	中国国航	54,958,448.72	4.23
33	000596	古井贡酒	52,036,864.62	4.01
34	002841	视源股份	51,966,198.78	4.00
35	600519	贵州茅台	51,874,967.30	3.99
36	600801	华新水泥	51,761,058.35	3.99
37	601186	中国铁建	49,295,610.41	3.80
38	000933	神火股份	48,785,452.01	3.76
39	002050	三花智控	48,681,878.85	3.75
40	600009	上海机场	48,561,258.83	3.74
41	601688	华泰证券	47,760,315.36	3.68
42	000423	东阿阿胶	47,559,126.92	3.66
43	002236	大华股份	47,381,857.72	3.65
44	601800	中国交建	47,196,853.63	3.63
45	600549	厦门钨业	47,148,469.00	3.63
46	600760	中航黑豹	46,909,091.80	3.61
47	300083	劲胜智能	46,598,124.60	3.59
48	601628	中国人寿	46,104,182.94	3.55
49	600295	鄂尔多斯	46,060,165.27	3.55
50	000709	河钢股份	45,996,383.79	3.54
51	600500	中化国际	45,974,985.38	3.54
52	601318	中国平安	45,423,223.58	3.50
53	600409	三友化工	44,910,538.76	3.46
54	603186	华正新材	44,762,821.94	3.45
55	000830	鲁西化工	44,606,221.36	3.43
56	002410	广联达	44,477,618.19	3.43
57	002340	格林美	43,485,416.04	3.35
58	000001	平安银行	43,463,513.53	3.35
59	000786	北新建材	43,101,691.92	3.32
60	601169	北京银行	42,995,331.04	3.31
61	300581	晨曦航空	42,504,866.10	3.27
62	600019	宝钢股份	42,184,026.83	3.25
63	600507	方大特钢	42,085,687.72	3.24
64	002564	天沃科技	41,772,010.74	3.22
65	600884	杉杉股份	41,714,412.74	3.21
66	600373	中文传媒	41,115,470.06	3.17

67	000538	云南白药	41,074,417.90	3.16
68	600309	万华化学	40,360,713.82	3.11
69	002475	立讯精密	39,486,972.10	3.04
70	002439	启明星辰	39,483,595.90	3.04
71	600196	复星医药	38,590,774.00	2.97
72	600426	华鲁恒升	38,266,106.81	2.95
73	601336	新华保险	38,139,984.90	2.94
74	600054	黄山旅游	36,895,384.12	2.84
75	601888	中国国旅	36,754,416.30	2.83
76	002479	富春环保	36,704,742.76	2.83
77	600348	阳泉煤业	36,649,606.44	2.82
78	600690	青岛海尔	36,334,407.43	2.80
79	000002	万科A	36,084,342.39	2.78
80	000063	中兴通讯	36,012,706.21	2.77
81	000400	许继电气	35,983,590.93	2.77
82	002456	欧菲科技	35,826,898.62	2.76
83	000338	潍柴动力	35,469,288.15	2.73
84	000970	中科三环	35,096,258.75	2.70
85	603816	顾家家居	34,929,491.48	2.69
86	600141	兴发集团	34,638,708.18	2.67
87	600525	长园集团	34,395,454.16	2.65
88	300274	阳光电源	33,955,074.24	2.61
89	300450	先导智能	33,713,483.31	2.60
90	002850	科达利	33,676,559.79	2.59
91	300137	先河环保	33,675,002.42	2.59
92	600567	山鹰纸业	33,180,495.00	2.56
93	601231	环旭电子	33,107,602.80	2.55
94	000488	晨鸣纸业	32,827,309.12	2.53
95	000898	鞍钢股份	32,806,848.97	2.53
96	000921	海信科龙	32,479,926.27	2.50
97	002709	天赐材料	32,213,374.28	2.48
98	600258	首旅酒店	32,107,040.09	2.47
99	002142	宁波银行	31,985,751.60	2.46
100	600030	中信证券	31,458,875.50	2.42
101	601601	中国太保	31,024,506.00	2.39
102	300166	东方国信	31,023,577.99	2.39
103	600585	海螺水泥	30,782,263.00	2.37
104	600438	通威股份	30,433,920.69	2.34

105	600015	华夏银行	30,325,502.35	2.34
106	000049	德赛电池	30,298,150.94	2.33
107	000968	蓝焰控股	30,254,518.58	2.33
108	002812	创新股份	30,144,648.65	2.32
109	600598	北大荒	29,648,382.51	2.28
110	002027	分众传媒	29,538,626.59	2.27
111	600068	葛洲坝	29,061,026.00	2.24
112	000725	京东方 A	28,992,349.56	2.23
113	603039	泛微网络	28,348,674.30	2.18
114	600547	山东黄金	28,279,844.76	2.18
115	600428	中远海特	28,151,920.18	2.17
116	601333	广深铁路	27,864,717.48	2.15
117	600011	华能国际	27,823,186.61	2.14
118	000069	华侨城 A	27,718,862.43	2.13
119	600740	山西焦化	27,349,388.00	2.11
120	601666	平煤股份	27,238,104.52	2.10
121	002805	丰元股份	27,216,427.67	2.10
122	002310	东方园林	27,162,052.16	2.09
123	600583	海油工程	27,021,326.48	2.08
124	000963	华东医药	26,503,826.92	2.04
125	600889	南京化纤	26,252,858.90	2.02
126	300136	信维通信	26,237,158.99	2.02
127	000975	银泰资源	26,162,342.10	2.01
128	000792	盐湖股份	26,162,145.90	2.01
129	600282	南钢股份	26,136,805.66	2.01

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,237,763,785.62
卖出股票收入（成交）总额	8,588,074,355.65

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	12,981,800.00	1.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	62,721,620.00	5.10
	其中：政策性金融债	62,721,620.00	5.10
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	4,098,277.80	0.33
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	79,801,697.80	6.49

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	170408	17 农发 08	500,000	49,850,000.00	4.05
2	019557	17 国债 03	130,000	12,981,800.00	1.06
3	108601	国开 1703	129,000	12,871,620.00	1.05
4	113015	隆基转债	21,580	2,555,287.80	0.21
5	110040	生益转债	14,250	1,542,990.00	0.13

注：以上为本基金报告期末持有的全部债券投资。

8.7 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。

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 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

8.12.2

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	684,388.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,907,047.16
5	应收申购款	16,673.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,608,108.39

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

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
68,323	20,493.48	9,393,591.96	0.67%	1,390,782,726.63	99.33%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	52,579.49	0.0038%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年8月3日）基金份额总额	11,868,700,887.87
本报告期期初基金份额总额	1,806,775,872.96
本报告期基金总申购份额	31,653,255.30
减：本报告期基金总赎回份额	438,252,809.67

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	1,400,176,318.59

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。
2、2017年9月1日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、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

本报告期内本基金无投资策略的变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用为人民币 12.40 万元，该审计机构对本基金提供审计服务的连续年限为 11 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、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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

	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	
长江证券	3	2,426,823,660.48	14.43%	2,260,103.69	14.43%	-
国金证券	1	1,488,738,435.57	8.85%	1,386,457.37	8.85%	-
华泰证券	2	1,387,819,962.66	8.25%	1,292,476.66	8.25%	-
华创证券	1	1,346,295,830.31	8.01%	1,253,806.10	8.01%	-
中泰证券	2	1,140,904,122.49	6.78%	1,062,525.52	6.78%	-
银河证券	2	1,116,022,879.02	6.64%	1,039,353.07	6.64%	-
光大证券	1	1,093,957,292.78	6.50%	1,018,802.82	6.50%	-
兴业证券	1	825,385,337.20	4.91%	768,680.84	4.91%	-
长城证券	1	768,418,751.12	4.57%	715,628.13	4.57%	-
海通证券	1	713,665,542.62	4.24%	664,636.57	4.24%	-
东方证券	2	676,609,569.19	4.02%	630,121.21	4.02%	-
中信证券	4	562,876,263.84	3.35%	524,206.45	3.35%	-
财富证券	1	529,694,038.27	3.15%	493,304.87	3.15%	-
东兴证券	2	497,922,385.10	2.96%	463,715.06	2.96%	-
平安证券	1	495,176,654.88	2.94%	461,157.41	2.94%	-
广发证券	1	367,948,890.62	2.19%	342,669.89	2.19%	-
中银国际	4	345,509,997.63	2.05%	321,772.76	2.05%	-
万联证券	1	336,020,662.75	2.00%	312,935.64	2.00%	-
民生证券	1	270,689,382.75	1.61%	252,092.62	1.61%	-
川财证券	1	205,706,444.06	1.22%	191,573.89	1.22%	-
招商证券	2	128,524,952.09	0.76%	119,694.61	0.76%	-
安信证券	3	92,619,323.35	0.55%	86,256.99	0.55%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	3	-	-	-	-	-

国信证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

(一) 2017 年本基金新增川财证券、中银国际证券交易单元；撤销中投证券交易单元。

(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
长江证券	1,494,391.30	5.78%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	2,985,900.00	11.56%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	2,000,000.00	16.00%	-
长城证券	6,976,900.00	27.00%	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-
中信证券	1,947,678.50	7.54%	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-
中银国际	2,994,600.00	11.59%	10,500,000.00	84.00%	-
万联证券	9,439,414.99	36.53%	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《泰达宏利基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站	2017 年 3 月 1 日
2	《泰达宏利基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站	2017 年 11 月 8 日
3	《泰达宏利基金管理有限公司关于基金经理休假事项的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司网站	2017 年 11 月 29 日

§ 12 备查文件目录

12.1 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、营业执照；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 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》、《证券日报》）或登陆本基金管理人互联网网址

(<http://www.mfcteda.com>) 查阅。

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

泰达宏利基金管理有限公司

2018 年 3 月 29 日