

泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金 （原泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金）2018 年半年度报告摘要

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 27 日

§1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金由原泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金转型而来。根据基金份额持有人大会决议，泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金于 2018 年 3 月 16 日转型成泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金。原泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金本报告期自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日止，泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金本报告期自 2018 年 3 月 16 日至 2018 年 6 月 30 日止。

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

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	泰达宏利沪深 300	
基金主代码	162213	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 3 月 16 日	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	139,687,468.41 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰达宏利沪深 300A	泰达宏利沪深 300C
下属分级基金的交易代码	162213	003548
报告期末下属分级基金的份额总额	138,620,298.45 份	1,067,169.96 份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	泰达宏利财富大盘指数	
基金主代码	162213	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 4 月 23 日	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	143,516,080.26 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰达宏利财富大盘指数 A	泰达宏利财富大盘指数 C
下属分级基金的交易代码	162213	003548
报告期末下属分级基金的份额总额	137,315,972.25 份	6,200,108.01 份

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对沪深 300 指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，力争获取超越标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，在控制与比较基准偏离风险的前提下，综合利用多种量化投资模型和指数增强技术，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高

	于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
--	----------------------

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	采用指数化投资策略，紧密跟踪中证财富大盘指数，力争获取与标的指数相似的投资收益，并力争将基金的日跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金采用指数完全复制方法，原则上按照标的指数成份股及其权重构建基金的投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整，以达到跟踪和复制指数的目的。但如遇特殊情况（如市场流动性不足、成份股被限制投资等）致使基金无法购得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理的方法进行适当替代，以使跟踪误差控制在限定范围内。
业绩比较基准	95%×中证财富大盘指数收益率+5%×同业存款利率。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰达宏利基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	袁静	王永民
	联系电话	010-66577513	010-66594896
	电子邮箱	irm@mfteda.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-698-8888	95566
传真		010-66577666	010-66594942

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http:// www.mfteda.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§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（转型后）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 3 月 16 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	
	泰达宏利沪深 300A	泰达宏利沪深 300C

本期已实现收益	-8,637,369.95	-211,051.04
本期利润	-24,303,986.27	-623,471.42
加权平均基金份额本期利润	-0.1765	-0.3059
本期加权平均净值利润率	-12.47%	-21.22%
本期基金份额净值增长率	-11.74%	-11.78%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 6 月 30 日	
期末可供分配利润	45,275,501.87	354,781.19
期末可供分配基金份额利润	0.3266	0.3325
期末基金资产净值	183,895,800.32	1,421,951.15
期末基金份额净值	1.3266	1.3325

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

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

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

3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日	
	泰达宏利财富大盘指数 A	泰达宏利财富大盘指数 C
本期已实现收益	511,609.99	-11,865.31
本期利润	-6,531,176.91	-527,251.10
加权平均基金份额本期利润	-0.0613	-0.1424
本期加权平均净值利润率	-3.98%	-9.27%
本期基金份额净值增长率	1.26%	1.28%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 3 月 15 日	
期末可供分配利润	69,073,703.62	3,165,118.96
期末可供分配基金份额利润	0.5030	0.5105
期末基金资产净值	206,389,675.87	9,365,226.97
期末基金份额净值	1.5030	1.5105

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

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

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

3.2 基金净值表现（转型后）

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

泰达宏利沪深 300A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	-5.68%	1.24%	-7.28%	1.22%	1.60%	0.02%
过去三个月	-7.28%	1.10%	-9.44%	1.08%	2.16%	0.02%
自基金转型 日起至今	-11.74%	1.11%	-13.59%	1.08%	1.85%	0.03%

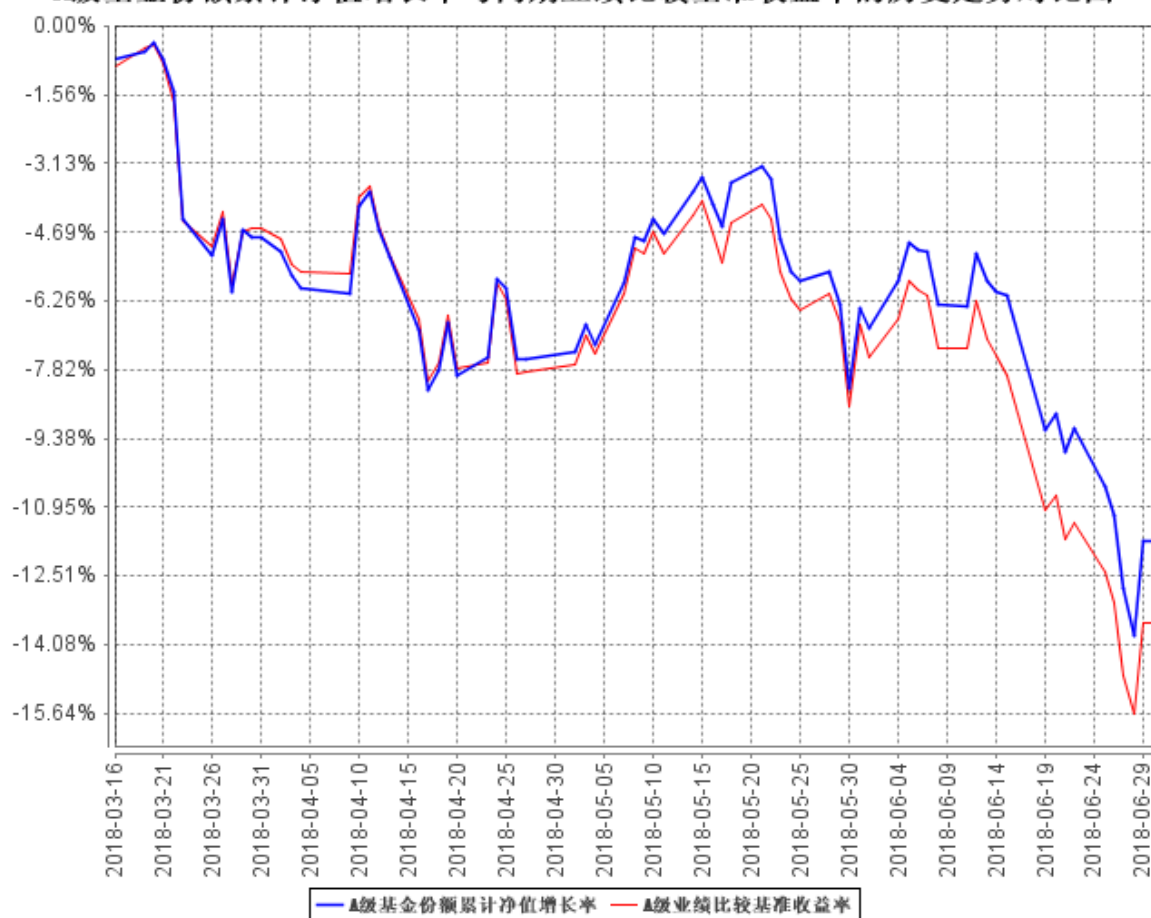
泰达宏利沪深 300C

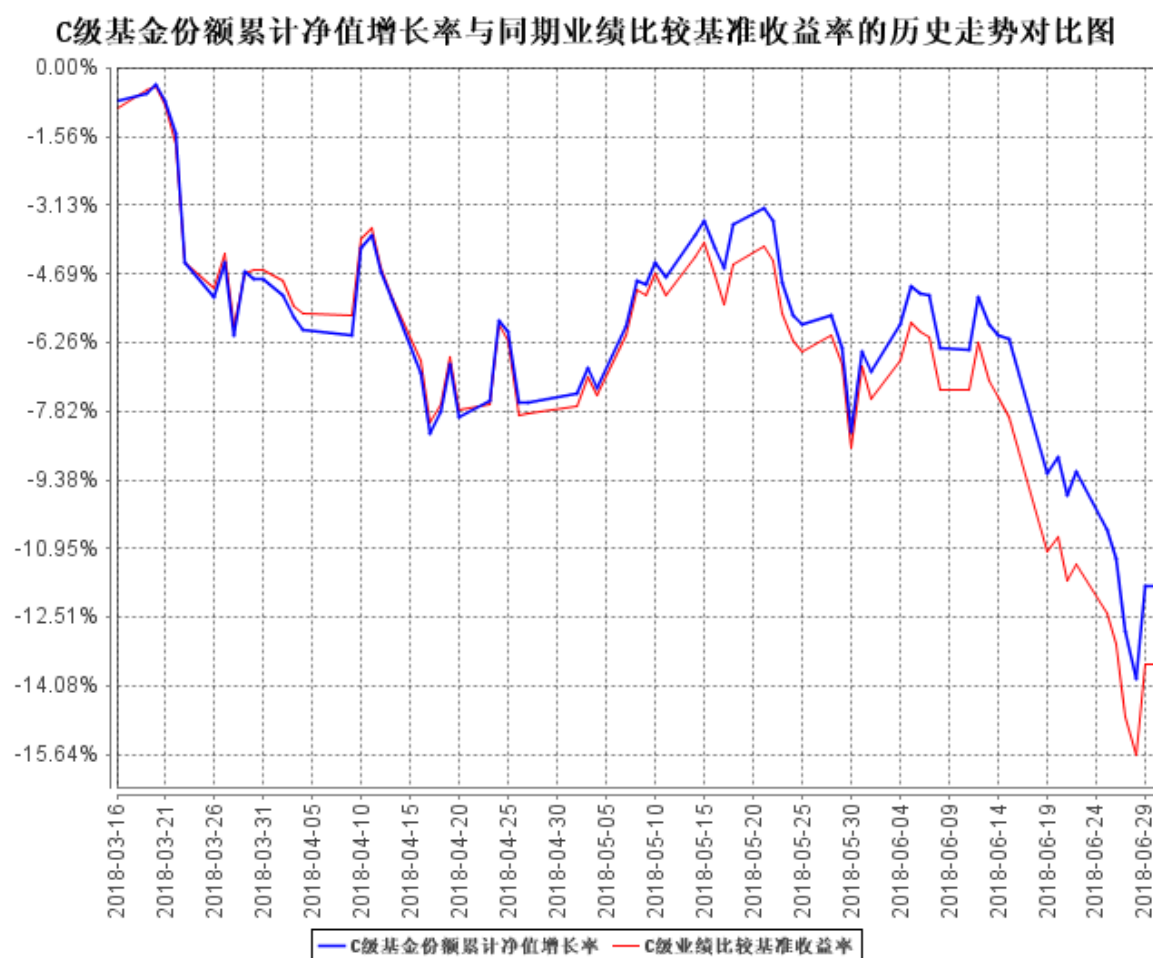
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	-5.70%	1.24%	-7.28%	1.22%	1.58%	0.02%
过去三个月	-7.32%	1.10%	-9.44%	1.08%	2.12%	0.02%
自基金转型 日起至今	-11.78%	1.11%	-13.59%	1.08%	1.81%	0.03%

注：本基金业绩比较基准：95%×沪深 300 指数收益率+5%×同业存款利率。

3.2.2 自基金转型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





注：本基金于 2018 年 3 月 16 日转型，截止报告期末本基金仍在建仓期。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

泰达宏利财富大盘指数 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	① ③	② ④
2018.1.1- 2018.3.15	1.26%	1.12%	1.71%	1.16%	-0.45%	-0.04%
2017.7.1- 2018.3.15	12.43%	0.78%	9.93%	0.80%	2.50%	-0.02%
2015.7.1- 2018.3.15	13.46%	1.37%	2.68%	1.30%	10.78%	0.07%
自基金合同 生效起至 2018.3.15	114.32%	1.37%	56.23%	1.37%	58.09%	0.00%

泰达宏利财富大盘指数 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	③ ③	④ ④
2018.1.1- 2018.3.15	1.28%	1.12%	1.71%	1.16%	-0.43%	-0.04%
2017.7.1- 2018.3.15	12.75%	0.78%	9.93%	0.80%	2.82%	-0.02%
自基金合同 生效起至 2018.3.15	25.70%	0.70%	19.46%	0.72%	6.24%	-0.02%

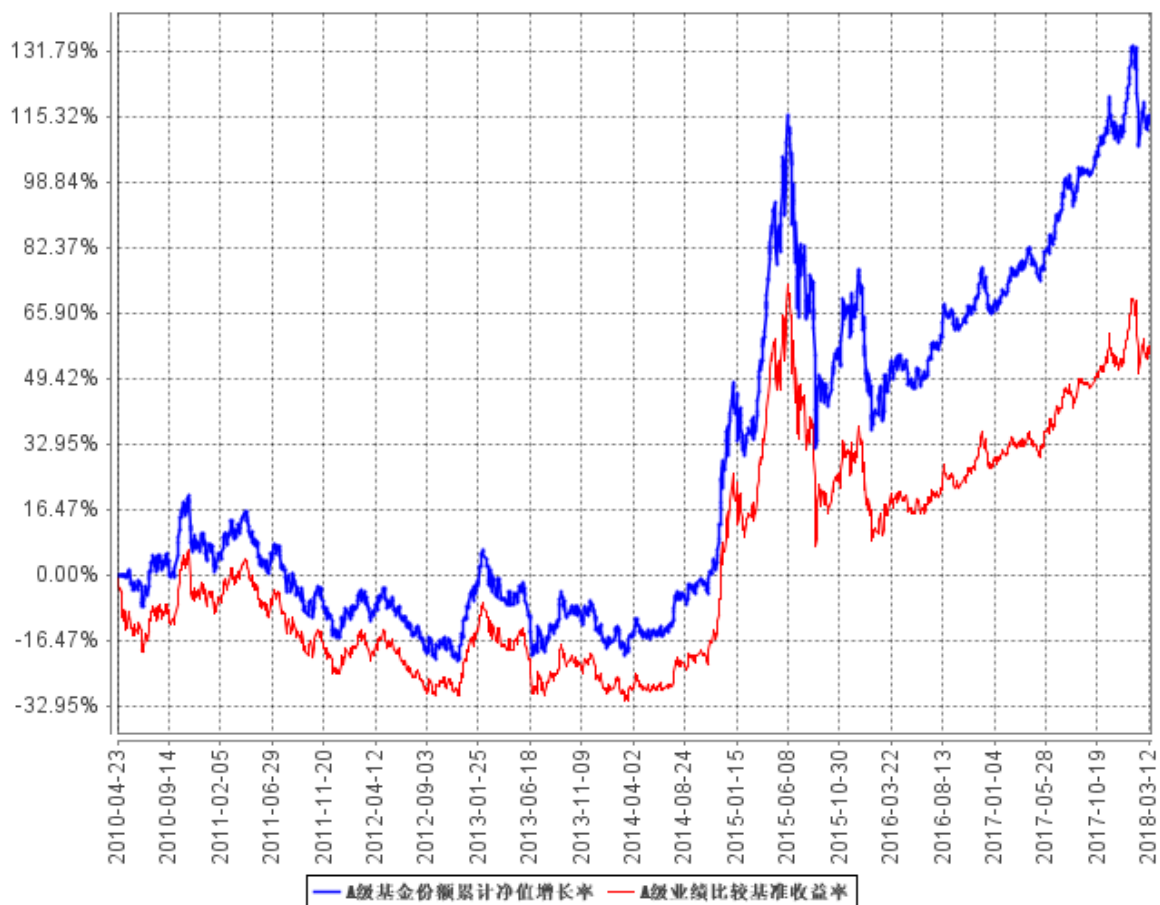
注：1. 本基金业绩比较基准：95%×中证财富大盘指数收益率+5%×同业存款利率。

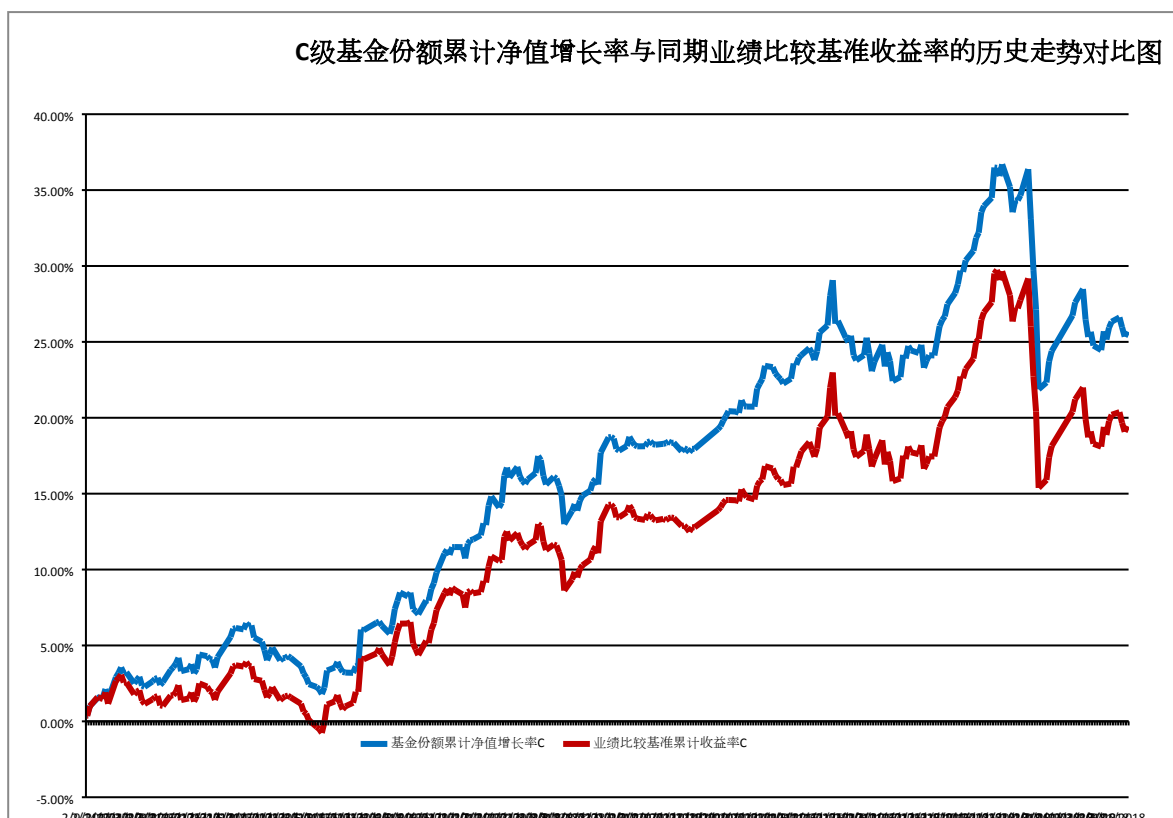
本基金股票资产的跟踪标的指数为中证财富大盘指数。中证财富大盘指数是由中证指数有限公司编制并开发的中国 A 股市场指数。该指数按照上市公司创造财富能力的大小进行选择，挑选最具创造财富能力的 300 家 A 股上市公司作为样本；此外该指数在加权方式上亦有所创新，不同于一般的市值加权指数，该指数样本个股的权重配置将与其创造财富能力的大小相适应，从而打破市值指数中价格与权重过于紧密的联系，预防个股权重由于价格的非理性波动而大起大落，提高了个股权重配置的稳定性。指数的表现综合反映了中国经济增长过程中核心企业真实的财富增长情况。

2. 本基金 A 类份额成立于 2010 年 4 月 23 日，C 类份额成立于 2017 年 2 月 9 日。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





注：本基金 A 类份额成立于 2010 年 4 月 23 日，C 类份额成立于 2017 年 2 月 9 日。本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金（LOF）、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基金、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金、泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金、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、泰达宏利宏达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、泰达宏利改革力量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、泰达宏利

金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利绩优增长灵活配置混合型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（转型后）

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		
杨超	本基金基金经理	2018 年 3 月 16 日	—	8	英国南威尔士大学数学与金融计算硕士；2010 年 5 月加入建信基金管理有限公司，从事金融工程等工作，历任投资管理部助理研究员、初级研究员、基金经理助理等职务；2014 年 6 月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理助理，现任基金经理。具备 8 年证券基金从业经验，8 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
曹龙洁	本基金基金经理助理	2018 年 3 月 16 日	2018 年 6 月 26 日	3	北京理工大学工学硕士；2007 年 4 月至 2015 年 9 月就职于欧鹏(OpenTV)互动电视软件有限公司；2015 年 9 月加盟泰达宏利基金管理有限公司，曾担任金融工程部研究员、基金经理助理等职；具备 3 年基金从业经验，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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
杨超	本基金基金经理	2014 年 10 月 13 日	2018 年 3 月 15 日	8	英国南威尔士大学数学与金融计算硕士；2010 年 5 月加入建信基金管理有限公司，从事金融工程等工作，历任投资管理部助理研究员、初

					级研究员、基金经理助理等职务；2014 年 6 月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理助理，现任基金经理。具备 8 年证券基金从业经验，8 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
曹龙洁	本基金基金经理助理	2017 年 4 月 21 日	2018 年 3 月 15 日	3	北京理工大学工学硕士；2007 年 4 月至 2015 年 9 月就职于欧鹏(OpenTV)互动电视软件有限公司；2015 年 9 月加盟泰达宏利基金管理有限公司，曾担任金融工程部研究员，现担任金融工程部基金经理助理；具备 3 年基金从业经验，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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度和流程，并严格执行制度的规定。在投资管理活动中，本基金管理人公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会；严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离；在交易环节实行集中交易制度，并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数量统计、分析。在本报告期内，未发现利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后

的监控，风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估，向公司风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合的同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该证券当日成交量的 5%。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

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

在上半年完成产品转型后，依照新产品合同及相关投资约束积极构建组合，通过量化策略对业绩比较基准进行增强操作。运作期间整体市场成交量不断萎缩，市场上半年热点在医药，消费股和电子科创类个股之间频繁切换，其他板块均有不同幅度的下跌。市场分化依然巨大，同时“去杠杆”期间面临经济增速下行的担忧下，整体系统性估值持续收缩，本基金恪守基金合同，积极构建风险模型和 Alpha 模型，在承担相对于业绩比较基准之外有限的风险预算下，积极朝 Alpha 因子暴露，同时严格优化交易过程，降低申购赎回和组合调整带来的冲击，为持有人创造了一定超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达宏利沪深 300A 基金份额净值为 1.3266 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.74%；截至本报告期末泰达宏利沪深 300C 基金份额净值为 1.3325 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.78%；同期业绩比较基准收益率为-13.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年宏观经济，在杠杆收缩的时间窗口中，经济政策或将平衡经济增速和去杠杆的节奏和结构，使得场内流动性或将有缓解机会，而财政政策或将也将在三季度有所作为，边际上或将给市场阶段性机会。更长期看，市场依然在寻找中国经济的新增长点，以及是否有相应的政策制度匹配，市场整体估值或将围绕该逻辑不断平衡。

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主任，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

根据本基金基金合同及基金的实际运作情况，本基金于本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 6 月 30 日
资 产：	
银行存款	10,397,023.78
结算备付金	759,888.29
存出保证金	76,304.02
交易性金融资产	174,476,490.38
其中：股票投资	174,476,490.38
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	2,125.88
应收股利	-
应收申购款	247,367.33
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	185,959,199.68
负债和所有者权益	本期末 2018 年 6 月 30 日
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	147,173.29
应付管理人报酬	103,141.89
应付托管费	19,041.59
应付销售服务费	355.94
应付交易费用	296,501.73
应交税费	-

应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	75,233.77
负债合计	641,448.21
所有者权益：	
实收基金	139,687,468.41
未分配利润	45,630,283.06
所有者权益合计	185,317,751.47
负债和所有者权益总计	185,959,199.68

注：1、报告截止日 2018 年 06 月 30 日，基金份额总额 139,687,468.41 份，其中下属 A 类基金份额 138,620,298.45 份，C 类基金份额 1,067,169.96 份。下属 A 类基金份额净值 1.3266 元，C 类基金份额净值 1.3325 元。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 3 月 16 日(基金转型日)至 2018 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2018 年 3 月 16 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 3 月 16 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	-23,712,671.17
1. 利息收入	25,984.47
其中：存款利息收入	25,984.47
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-7,679,578.36
其中：股票投资收益	-9,049,230.89
基金投资收益	-
债券投资收益	-
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	1,369,652.53
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-16,079,036.70
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	19,959.42
减：二、费用	1,214,786.52
1. 管理人报酬	376,651.21
2. 托管费	69,535.60
3. 销售服务费	2,537.03
4. 交易费用	710,794.85
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 税金及附加	-
7. 其他费用	55,267.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-24,927,457.69
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-24,927,457.69

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2018 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	143,516,080.26	72,238,822.58	215,754,902.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-24,927,457.69	-24,927,457.69
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）	-3,828,611.85	-1,681,081.83	-5,509,693.68
其中：1. 基金申购款	12,185,348.53	5,078,695.94	17,264,044.47
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-16,013,960.38	-6,759,777.77	-22,773,738.15
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）	139,687,468.41	45,630,283.06	185,317,751.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金(原名为泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金,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[2010]第 176 号《关于核准泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金募集的批复》核准,由泰达宏利基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,165,036,951.93 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(2010)第 092 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》于 2010 年 4 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,165,158,636.81 份基金份额,其中认购资金利息折合 121,684.88 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,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《关于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、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金与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修改基金合同及托管协议的公告》并报证监会备案,本基金于 2017 年 2 月 9 日起按照投资者的申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用,称为 A 类基金份额;不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,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。本基金的原有基金份额全部自动划归为该基金 A 类基金份额类别, A 类基金份额的各项业务规则与原基金合同相同。

根据本基金基金份额持有人大会表决通过的《关于泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金转型及法律文件修改的议案》及《关于泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,自 2018 年 3 月 16 日起,本基金正式实施基金转型,内容包括调整投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、投资限制、收益分配原则、基金的估值、基金的费用、申购赎回以及修订基金合同、托管协议、招募说明书等,并更名

为“泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利沪深 300 指数增强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、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债券、可交换债券、可转债及分离交易可转债及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、资产支持证券、股指期货、货币市场工具、权证、同业存单及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中投资于股票组合的比例不低于基金资产的 80%，投资组合中投资于沪深 300 指数成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。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，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的相关规定。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+同业存款利率 $\times$ 5%。

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 08 月 27 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(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》、《泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 3 月 16 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 3 月 16 日(合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策的变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计的变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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》、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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

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

本基金本报告期没有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 16 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	376,651.21
其中：支付销售机构的客户维护费	2,536.97

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 0.65% 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 × 0.65% / 当年天数。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 16 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	69,535.60

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.12% 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 × 0.12% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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 2018 年 3 月 16 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利沪深 300A	泰达宏利沪深 300C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	1,197.99	1,197.99
合计	-	1,197.99	1,197.99

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 类基金基金份额销售服务费 = C 类基金基金份额前一日基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

泰达宏利沪深 300A		
关联方名称	本期末 2018 年 3 月 16 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
北方国际信托股份有限公司	12,368,730.29	8.9227%

本基金管理人之外的其他关联方投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 3 月 16 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	10,397,023.78	23,257.93

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	说明
603693	江苏新能	2018 年 6 月 25 日	2018 年 7 月 3 日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	—
603706	东方环宇	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	—
603105	芯能科技	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	—

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601390	中国中铁	2018 年 5 月 7 日	重大事项	6.43	2018 年 8 月 20 日	7.25	482,600	4,043,766.89	3,103,118.00	—
000666	经纬纺机	2018 年 3 月 12 日	重大事项	18.08	—	—	119,188	2,367,757.42	2,154,919.04	—
000415	渤海金控	2018 年 1 月 17 日	重大事项	5.25	2018 年 7 月 17 日	5.26	193,800	1,305,358.43	1,017,450.00	—
002450	康得新	2018 年 6 月 4 日	重大事项	17.08	—	—	55,300	1,409,121.29	944,524.00	—
601727	上海电	2018	重大事	6.34	2018	5.71	104,900	620,911.33	665,066.00	—

	气	年	项		年 8 月					
		6 月			7 日					
		6 日								
300266	兴源环境	2018 年 2 月 5 日	重大事项	16.67	2018 年 7 月 2 日	17.99	8,200	215,949.73	136,694.00	

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

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 and 评估，并通过相应决策，将风险控制在此可承受的范围内。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 3 月 15 日（基金转型前最后一日）

资 产	本期末 2018 年 3 月 15 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	14,734,564.95	6,099,730.52
结算备付金	150,374.36	238,665.41
存出保证金	40,651.35	101,003.38
交易性金融资产	201,347,361.64	96,133,246.23

其中：股票投资	201,347,361.64	96,133,246.23
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持 证券投资	-	-
贵金属投 资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资 产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	20,589.55	1,302.31
应收股利		-
应收申购款	287,900.65	219,183.77
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计	216,581,442.50	102,793,131.62
负债和所有者权 益	本期末 2018 年 3 月 15 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资 产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款	428,509.58	144,976.63
应付管理人报酬	57,810.99	56,522.37
应付托管费	10,672.78	10,434.89
应付销售服务费	1,146.06	284.10
应付交易费用	157,432.40	227,313.42
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	170,967.85	142,947.83
负债合计	826,539.66	582,479.24
所有者权益：		
实收基金	143,516,080.26	68,857,525.13
未分配利润	72,238,822.58	33,353,127.25
所有者权益合计	215,754,902.84	102,210,652.38
负债和所有者权 益总计	216,581,442.50	102,793,131.62

注：1、报告截止日 2018 年 03 月 15 日，基金份额总额 143,516,080.26 份，其中下属 A 类基金份额 137,315,972.25 份，C 类基金份额 6,200,108.01 份。下属 A 类基金份额净值 1.5030 元，C 类基金份额净值 1.5105 元。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日。自 2018 年 3 月 16 日起，泰达宏利财富大盘指数证券投资基金转型为泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金。

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利财富大盘指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日（基金转型前最后一日）

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入	-6,544,042.64	22,037,809.03
1. 利息收入	19,287.24	29,380.41
其中：存款利息收入	19,287.24	29,348.94
债券利息收入	-	31.47
资产支持证券利 息收入	-	-
买入返售金融资 产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）	967,910.22	10,166,764.48
其中：股票投资收益	978,121.59	8,272,241.02
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	10,164.13
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	-10,211.37	1,884,359.33
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填列）	-7,558,172.69	11,825,500.09
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	26,932.59	16,164.05

减：二、费用	514,385.37	984,553.05
1. 管理人报酬	227,309.94	388,383.60
2. 托管费	41,964.92	71,701.57
3. 销售服务费	3,625.87	288.83
4. 交易费用	201,293.77	433,489.08
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	40,190.87	90,689.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-7,058,428.01	21,053,255.98
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-7,058,428.01	21,053,255.98

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日（基金转型前最后一日）

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 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）	68,857,525.13	33,353,127.25	102,210,652.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		-7,058,428.01	-7,058,428.01
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）	74,658,555.13	45,944,123.34	120,602,678.47
其中：1. 基金申购款	91,044,934.41	54,997,190.97	146,042,125.38
2. 基金赎回款	-16,386,379.28	-9,053,067.63	-25,439,446.91
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	143,516,080.26	72,238,822.58	215,754,902.84

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	75,763,836.45	12,551,804.44	88,315,640.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,053,255.98	21,053,255.98
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）	83,167,744.67	19,930,673.21	103,098,417.88
其中：1.基金申购款	95,385,015.09	23,023,233.87	118,408,248.96
2.基金赎回款	-12,217,270.42	-3,092,560.66	-15,309,831.08
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）	158,931,581.12	53,535,733.63	212,467,314.75

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金(原名为泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金,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[2010]第 176 号《关于核准泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金募集的批复》核准,由泰达宏利基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,165,036,951.93 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(2010)第 092 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》于 2010 年 4 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为

1,165,158,636.81 份基金份额，其中认购资金利息折合 121,684.88 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，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《关于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、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金与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修改基金合同及托管协议的公告》并报证监会备案，本基金于 2017 年 2 月 9 日起按照投资者的申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，称为 A 类基金份额；不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，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。本基金的原有基金份额全部自动划归为该基金 A 类基金份额类别，A 类基金份额的各项业务规则与原基金合同相同。

根据本基金基金份额持有人大会表决通过的《关于泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金转型及法律文件修改的议案》及《关于泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2018 年 3 月 16 日起，本基金正式实施基金转型，内容包括调整投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、投资限制、收益分配原则、基金的估值、基金的费用、申购赎回以及修订基金合同、托管协议、招募说明书等，并更名为“泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪中证财富大盘指数，力争获取与标的指数相似的投资收益，并力争将基金的日跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差不超过 4%；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、债券、货币市场工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中投资于股票组合的比例不低于基金资产的 90%，投资组合中投资于中证财富大盘指数成份股的资产不低于股票资产的 90%，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证财富大盘指数收益率} + 5\% \times \text{同业存款利率}$ 。

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 2018 年 08 月 27 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券

投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(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》、《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日(基金合同失效前日)止期间的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 2018 年 3 月 15 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策的变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计的变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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》、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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规

和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

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

本基金本报告期没有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
北方国际信托股份有限公司	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	227,309.94	388,383.60
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	3,625.77	81,542.46

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 0.65% 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 × 0.65% / 当年天数。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	41,964.92	71,701.57

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.12% 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 × 0.12% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利财富大盘 指数 A	泰达宏利财富大盘 指数 C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	2,685.29	2,685.29
合计	-	2,685.29	2,685.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利财富大盘 指数 A	泰达宏利财富大盘 指数 C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	0.69	0.69
合计	-	0.69	0.69

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 类基金基金份额销售服务费 = C 类基金基金份额前一日基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

泰达宏利财富大盘指数 A				
关联方名称	本期末 2018 年 3 月 15 日		上年度末 2017 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
北方国际信 托股份有限 公司	12,368,730.29	9.0075%	0.00	0.0000%

本基金管理人之外的其他关联方投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	14,734,564.95	14,886.54	11,061,444.78	25,643.46

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2018 年 3 月 15 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新股或增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

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
000666	经纬纺 机	2018 年 3 月 12 日	重大事 项	18.29	-	-	119,188	2,367,757.42	2,179,948.52	-
000415	渤海金	2018 年	重大事	5.84	2018	5.26	193,800	1,305,358.43	1,131,792.00	-

	控	1 月 17 日	项		年 7 月 17 日					
002450	康得新	2018 年 2 月 5 日	重大事 项	19.78	2018 年 4 月 27 日	20.01	55,300	1,409,121.29	1,093,834.00	
600682	南京新 百	2018 年 2 月 2 日	重大事 项	33.28	2018 年 6 月 7 日	29.95	25,000	943,147.00	832,000.00	
600157	永泰能 源	2017 年 11 月 21 日	重大事 项	3.36	2018 年 4 月 4 日	3.03	84,500	306,156.81	283,920.00	
300266	兴源环 境	2018 年 2 月 5 日	重大事 项	19.99	2018 年 7 月 2 日	17.99	8,200	215,949.73	163,918.00	
600309	万华化 学	2017 年 12 月 5 日	重大事 项	36.14	2018 年 6 月 4 日	40.08	400	14,352.47	14,456.00	

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告（转型后）

7.3 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	174,476,490.38	93.83
	其中：股票	174,476,490.38	93.83
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	11,156,912.07	6.00
8	其他各项资产	325,797.23	0.18
9	合计	185,959,199.68	100.00

7.4 期末按行业分类的股票投资组合

7.4.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	6,920,594.00	3.73
C	制造业	62,393,672.94	33.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,663,269.00	1.98
E	建筑业	5,832,653.48	3.15
F	批发和零售业	382,764.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	4,198,289.00	2.27
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,698,667.00	3.61
J	金融业	53,456,610.07	28.85
K	房地产业	5,796,081.20	3.13
L	租赁和商务服务业	4,158,065.40	2.24
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	897,092.00	0.48
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	760,760.00	0.41
S	综合	—	—

	合计	155,158,518.09	83.73
--	----	----------------	-------

7.4.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	485,808.00	0.26
C	制造业	12,321,072.70	6.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.04
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	3,256,948.00	1.76
G	交通运输、仓储和邮政业	297,118.00	0.16
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	910,364.00	0.49
J	金融业	—	—
K	房地产业	1,757,181.60	0.95
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	217,920.14	0.12
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	19,317,972.29	10.42

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.1 指数投资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	601318	中国平安	224,195	13,133,343.10	7.09

2	600036	招商银行	266,967	7,058,607.48	3.81
3	600519	贵州茅台	9,616	7,033,719.36	3.80
4	000651	格力电器	138,200	6,516,130.00	3.52
5	002415	海康威视	136,400	5,064,532.00	2.73
6	601169	北京银行	714,196	4,306,601.88	2.32
7	600104	上汽集团	116,200	4,065,838.00	2.19
8	600276	恒瑞医药	52,766	3,997,552.16	2.16
9	600518	康美药业	173,300	3,965,104.00	2.14
10	000858	五 粮 液	52,100	3,959,600.00	2.14

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

7.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000078	海王生物	557,700	2,682,537.00	1.45
2	000666	经纬纺机	119,188	2,154,919.04	1.16
3	600566	济川药业	37,700	1,816,763.00	0.98
4	600525	长园集团	158,300	1,673,231.00	0.90
5	600160	巨化股份	217,230	1,590,123.60	0.86

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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	000776	广发证券	5,909,750.31	3.19
2	601888	中国国旅	5,829,314.00	3.15
3	000651	格力电器	5,626,842.00	3.04
4	002415	海康威视	5,606,686.00	3.03
5	600519	贵州茅台	5,342,359.00	2.88
6	600276	恒瑞医药	5,183,024.51	2.80
7	603993	洛阳钼业	4,472,698.69	2.41
8	000858	五 粮 液	4,195,138.00	2.26

9	000786	北新建材	4,013,923.50	2.17
10	002027	分众传媒	3,966,338.93	2.14
11	000413	东旭光电	3,738,047.00	2.02
12	601857	中国石油	3,686,294.00	1.99
13	600029	南方航空	3,601,629.00	1.94
14	600705	中航资本	3,560,322.51	1.92
15	300136	信维通信	3,435,392.00	1.85
16	001979	招商蛇口	3,381,769.37	1.82
17	002466	天齐锂业	3,337,582.01	1.80
18	600406	国电南瑞	3,316,184.50	1.79
19	600487	亨通光电	3,141,955.00	1.70
20	600160	巨化股份	3,101,485.10	1.67

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	600016	民生银行	8,060,935.00	4.35
2	601288	农业银行	5,965,155.00	3.22
3	601166	兴业银行	5,330,963.00	2.88
4	600015	华夏银行	4,571,873.60	2.47
5	601328	交通银行	4,418,912.00	2.38
6	000050	深天马 A	4,013,964.00	2.17
7	601012	隆基股份	3,845,515.00	2.08
8	601888	中国国旅	3,671,300.28	1.98
9	000413	东旭光电	3,612,957.00	1.95
10	600487	亨通光电	3,270,972.00	1.77
11	300136	信维通信	3,163,360.00	1.71
12	000002	万科 A	3,076,600.40	1.66
13	600019	宝钢股份	2,995,135.52	1.62
14	601398	工商银行	2,977,904.00	1.61
15	000537	广宇发展	2,961,862.12	1.60
16	002602	世纪华通	2,957,354.96	1.60
17	600406	国电南瑞	2,926,555.80	1.58
18	600000	浦发银行	2,854,342.60	1.54

19	600489	中金黄金	2,851,530.26	1.54
20	600277	亿利洁能	2,827,538.96	1.53

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	232,776,552.74
卖出股票收入（成交）总额	234,519,156.41

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的招商银行（600036）于 2018 年 2 月 12 日被银保监会做出行政处罚决定。招商银行因（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。

基金管理人分析认为，我们判断公司发展战略清晰，公司整体呈现良好的发展态势。因此，基金管理人经审慎分析，在本报告期内继续保持对其的投资。

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。

7.12.2

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	76,304.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,125.88
5	应收申购款	247,367.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	325,797.23

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000666	经纬纺机	2,154,919.04	1.16	重大事项

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1. 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；
2. 本节报告期内指 2018 年 3 月 16 日至 2018 年 6 月 30 日，报告期末指 2018 年 6 月 30 日。

§7 投资组合报告（转型前）

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	201,347,361.64	92.97
	其中：股票	201,347,361.64	92.97
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	14,884,939.31	6.87
7	其他资产	349,141.55	0.16
8	合计	216,581,442.50	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,349,597.00	2.48
C	制造业	50,772,541.08	23.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,604,390.00	2.60
E	建筑业	9,871,035.66	4.58
F	批发和零售业	785,174.00	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	4,767,346.00	2.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,906,295.00	1.35
J	金融业	95,034,367.46	44.05
K	房地产业	13,692,906.52	6.35
L	租赁和商务服务业	1,667,989.00	0.77
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	115,089.00	0.05
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	190,566,730.72	88.33

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	443,610.00	0.21
C	制造业	4,902,577.08	2.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,170,527.84	1.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	832,000.00	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	1,212,228.00	0.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术	74,000.00	0.03

	术服务业		
J	金融业	-	-
K	房地产业	977,712.00	0.45
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	163,918.00	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	4,058.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	10,780,630.92	5.00

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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	601318	中国平安	208,995	14,732,057.55	6.83
2	600036	招商银行	328,867	10,037,020.84	4.65
3	601328	交通银行	1,340,791	8,634,694.04	4.00
4	601288	农业银行	1,962,723	8,106,045.99	3.76
5	600016	民生银行	968,500	8,096,660.00	3.75
6	601398	工商银行	1,022,515	6,605,446.90	3.06
7	601166	兴业银行	318,316	5,627,826.88	2.61
8	601169	北京银行	759,096	5,480,673.12	2.54
9	000002	万科 A	159,022	5,193,658.52	2.41
10	600015	华夏银行	494,388	4,578,032.88	2.12

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

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000883	湖北能源	467,914	2,133,687.84	0.99
2	600277	亿利洁能	248,700	1,457,382.00	0.68
3	601238	广汽集团	62,900	1,410,847.00	0.65
4	600350	山东高速	200,700	1,212,228.00	0.56
5	600682	南京新百	25,000	832,000.00	0.39

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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	7,795,349.00	7.63
2	601318	中国平安	7,450,033.00	7.29
3	600016	民生银行	5,793,737.00	5.67
4	601328	交通银行	4,834,487.00	4.73
5	600030	中信证券	4,780,792.00	4.68
6	601288	农业银行	4,526,507.00	4.43
7	601398	工商银行	3,857,166.00	3.77
8	601169	北京银行	3,304,859.00	3.23
9	000002	万 科 A	3,211,510.00	3.14
10	601390	中国中铁	3,205,149.61	3.14
11	601998	中信银行	3,089,958.00	3.02
12	600015	华夏银行	3,033,604.00	2.97
13	600606	绿地控股	2,845,586.00	2.78
14	600019	宝钢股份	2,796,023.00	2.74
15	000100	TCL 集团	2,721,607.00	2.66
16	000671	阳 光 城	2,621,496.00	2.56
17	600115	东方航空	2,497,814.08	2.44
18	601628	中国人寿	2,342,715.35	2.29
19	600688	上海石化	2,258,631.00	2.21
20	600519	贵州茅台	2,225,573.00	2.18
21	000666	经纬纺机	2,217,398.54	2.17

22	601939	建设银行	2,164,430.45	2.12
----	--------	------	--------------	------

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601818	光大银行	2,075,034.00	2.03
2	600482	中国动力	1,730,462.80	1.69
3	600166	福田汽车	1,488,086.00	1.46
4	601229	上海银行	1,286,842.00	1.26
5	600029	南方航空	1,252,238.00	1.23
6	600837	海通证券	1,232,834.00	1.21
7	000776	广发证券	995,105.48	0.97
8	601006	大秦铁路	970,645.00	0.95
9	600173	卧龙地产	870,593.00	0.85
10	000553	沙隆达 A	820,620.68	0.80
11	000631	顺发恒业	776,813.00	0.76
12	600606	绿地控股	736,298.00	0.72
13	000651	格力电器	657,908.00	0.64
14	000725	京东方 A	549,298.00	0.54
15	000709	河钢股份	536,148.00	0.52
16	600066	宇通客车	534,963.00	0.52
17	600009	上海机场	528,196.00	0.52
18	601088	中国神华	488,157.00	0.48
19	000768	中航飞机	484,070.00	0.47
20	600567	山鹰纸业	430,026.00	0.42

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	140,653,959.27
卖出股票收入（成交）总额	28,859,792.76

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的招商银行（600036）于 2018 年 2 月 12 日被银保监会做出行政处罚决定。招商银行因（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；

（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。

基金管理人分析认为，我们判断公司发展战略清晰，公司整体呈现良好的发展态势。因此，基金管理人经审慎分析，在本报告期内继续保持对其的投资。

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。

7.12.2

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	40,651.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,589.55
5	应收申购款	287,900.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	349,141.55

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600682	南京新百	832,000.00	0.39	重大事项

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1. 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；
2. 本节报告期内指 2018 年 3 月 16 日至 2018 年 6 月 30 日，报告期末指 2018 年 6 月 30 日。

§8 基金份额持有人信息（转型后）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
泰达宏利沪深 300A	12,958	10,697.66	68,030,221.21	49.08%	70,590,077.24	50.92%
泰达宏利沪深 300C	396	2,694.87	0.00	0.00%	1,067,169.96	100.00%
合计	13,354	10,460.35	68,030,221.21	48.70%	71,657,247.20	51.30%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末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	泰达宏利沪深 300A	72,635.51	0.0524%
	泰达宏利	335.78	0.0315%

	沪深 300C		
	合计	72,971.29	0.0522%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泰达宏利沪深 300A	0
	泰达宏利沪深 300C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达宏利沪深 300A	0
	泰达宏利沪深 300C	0
	合计	0

§8 基金份额持有人信息（转型前）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
泰达宏利财富大盘指数 A	17,187	7,989.53	68,030,221.21	49.54%	69,285,751.04	50.46%
泰达宏利财富大盘指数 C	434	14,285.96	4,985,044.87	80.40%	1,215,063.14	19.60%
合计	17,621	8,144.60	73,015,266.08	50.88%	70,500,814.18	49.12%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末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	泰达宏利财富大盘指数 A	70,271.44	0.0512%
	泰达宏利财富大盘指数 C	335.78	0.0054%
	合计	70,607.22	0.0492%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

项目	泰达宏利沪深 300A	泰达宏利沪深 300C
基金合同生效日基金份额总额	137,315,972.25	6,200,108.01
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	11,848,815.91	336,532.62
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总	10,544,489.71	5,469,470.67

赎回份额		
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）	-	-
本报告期期末基金份额总额	138,620,298.45	1,067,169.96

注：上述基金合同生效日的基金份额总额为基金转型起始日（2018 年 3 月 16 日）的基金份额总额。

§ 9 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

项目	泰达宏利财富大盘指数 A	泰达宏利财富大盘指数 C
基金合同生效日基金份额总额	1,165,158,636.81	-
本报告期期初基金份额总额	68,107,120.79	750,404.34
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	84,585,568.61	6,459,365.80
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	15,376,717.15	1,009,662.13
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）	-	-
本报告期期末基金份额总额	137,315,972.25	6,200,108.01

§10 重大事件揭示

10.5 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会表决投票时间为 2018 年 2 月 8 日起至 2018 年 3 月 4 日 17:00 止。本次基金份额持有人大会于 2018 年 3 月 5 日表决通过了《关于泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金转型及法律文件修改的议案》。根据持有

人大会通过的议案及方案说明，本基金自 2018 年 3 月 16 日起实施转型。

10.6 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、本公司于 2018 年 4 月 28 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，张萍女士因个人健康原因辞去公司督察长职务，由公司总经理刘建先生于 4 月 28 日起代为履行公司督察长职务。

2、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.7 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、本基金托管人、基金托管业务的诉讼事项。

10.8 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

10.9 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.10 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1. 本报告期基金管理人未受到任何稽查或处罚。

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

10.11 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

10.11.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	2	132,625,911.57	28.40%	123,517.44	28.40%	-
光大证券	1	89,643,297.34	19.20%	83,486.73	19.20%	-

东方证券	3	61,467,002.60	13.16%	57,244.66	13.16%	—
太平洋	2	52,035,317.69	11.14%	48,460.61	11.14%	—
渤海证券	1	41,160,761.33	8.82%	38,333.19	8.82%	—
天风证券	1	32,527,413.99	6.97%	30,292.54	6.97%	—
方正证券	1	24,088,160.35	5.16%	22,433.70	5.16%	—
东方财富	1	22,576,759.06	4.84%	21,025.58	4.84%	—
国泰君安	1	10,802,215.33	2.31%	10,060.18	2.31%	—
华泰证券	2	—	—	—	—	—
招商证券	1	—	—	—	—	—
中泰证券	1	—	—	—	—	—
兴业证券	1	—	—	—	—	—
国金证券	1	—	—	—	—	—
天源证券	1	—	—	—	—	—
东亚前海	1	—	—	—	—	—
新时代证券	1	—	—	—	—	—
国联证券	1	—	—	—	—	—
华林证券	2	—	—	—	—	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—
银河证券	2	—	—	—	—	—
长城证券	2	—	—	—	—	—
东吴证券	1	—	—	—	—	—
西南证券	2	—	—	—	—	—
安信证券	1	—	—	—	—	—
广发证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	—	—	—	—	—
长江证券	1	—	—	—	—	—
中信证券	2	—	—	—	—	—
申万宏源	2	—	—	—	—	—
中银国际	2	—	—	—	—	—
财富证券	2	—	—	—	—	—
江海证券	1	—	—	—	—	—
中山证券	1	—	—	—	—	—
东北证券	2	—	—	—	—	—
财达证券	1	—	—	—	—	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—

(一) 本基金本报告期内(2018 年 3 月 16 日至 2018 年 6 月 30 日)新增长江证券交易席位;

(二) 交易席位选择的标准和程序:

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席位, 选择的

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

10.11.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期末通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券	1	97,703,152.86	57.80%	90,991.35	57.80%	-
兴业证券	1	18,736,280.65	11.08%	17,449.31	11.08%	-
中信建投	2	16,251,019.42	9.61%	15,134.07	9.61%	-
东方证券	3	12,716,092.54	7.52%	11,842.09	7.52%	-
中信证券	2	9,742,059.21	5.76%	9,072.48	5.76%	-
太平洋	2	6,338,663.70	3.75%	5,903.22	3.75%	-
光大证券	1	5,393,040.64	3.19%	5,022.31	3.19%	-
东方财富	1	2,166,303.02	1.28%	2,017.57	1.28%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-

银河证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

(一) 本基金本报告期内 (2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 15 日) 未新增、撤销席位;

(二) 交易席位选择的标准和程序:

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席位, 选择的标准是:

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期末通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况

	序号	持有基金份额比例 达到或者超过 20%的时间区间	期初 份额	申购 份额	赎回 份额	持有份额	份额占 比
机构	1	20180130- 20180630	0.00	55,661,450.92	0.00	55,661,450.92	39.85%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，易发生巨额赎回的情况，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

报告期内，申购份额含红利再投资份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内，根据本基金基金份额持有人大会表决通过的《关于泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金转型及法律文件修改的议案》及《关于泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2018 年 3 月 16 日起，本基金正式实施转型，内容调整包括投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、投资限制、收益分配原则、基金的估值、基金的费用、申购赎回以及修订基金合同、托管协议、招募说明书等，并更名为“泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金”。

泰达宏利基金管理有限公司

2018 年 8 月 27 日