

泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金 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。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 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

| | | |
|-----------------|-----------------|----------------|
| 基金简称 | 泰达宏利港股通股票 | |
| 基金主代码 | 004482 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017 年 5 月 17 日 | |
| 基金管理人 | 泰达宏利基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 45,193,489.12 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 泰达宏利港股通股票 A | 泰达宏利港股通股票 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 004482 | 004483 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 37,986,762.17 份 | 7,206,726.95 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，把握港股通及后续资本市场开放政策带来的机会，挖掘港股及 A 股市场的优质公司，力争为投资者获取超越业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | 本基金将通过全球宏观经济发展态势、区域经济发展情况、微观经济运行环境等可能影响内地及香港证券市场的重要因素的研究和预测，利用数量模型工具，分析和比较股票、货币市场工具等不同金融工具的风险收益特征，并以此为依据，对基金整体资产配置比例进行确定。同时，本基金将定期，或由于宏观经济重大变化不定期地进行资产配置比例调整，以保持基金资产配置的有效性。 |
| 业绩比较基准 | 恒生指数收益率（经人民币汇率调整）×95%+人民币活期存款利率×5%。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于较高风险、较高收益的产品。 |

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

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 基金级别 | 泰达宏利港股通股票 A | 泰达宏利港股通股票 C |
|---------------|-------------------------------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2018 年 1 月 1 日-2018 年 6 月 30 日) | 报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 6,002,842.11 | 1,653,679.15 |
| 本期利润 | -484,333.78 | -98,348.71 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0105 | -0.0071 |
| 本期基金份额净值增长率 | -1.98% | -2.18% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018 年 6 月 30 日) | |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1762 | 0.1653 |
| 期末基金资产净值 | 44,679,876.94 | 8,398,033.63 |
| 期末基金份额净值 | 1.1762 | 1.1653 |

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰达宏利港股通股票 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月 | -1.86% | 1.48% | -1.89% | 1.14% | 0.03% | 0.34% |
| 过去三个月 | 2.34% | 1.25% | 1.20% | 1.07% | 1.14% | 0.18% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|
| 过去六个月 | -1.98% | 1.52% | -2.22% | 1.25% | 0.24% | 0.27% |
| 过去一年 | 15.81% | 1.24% | 8.78% | 1.03% | 7.03% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.62% | 1.18% | 8.71% | 0.99% | 8.91% | 0.19% |

泰达宏利港股通股票 C

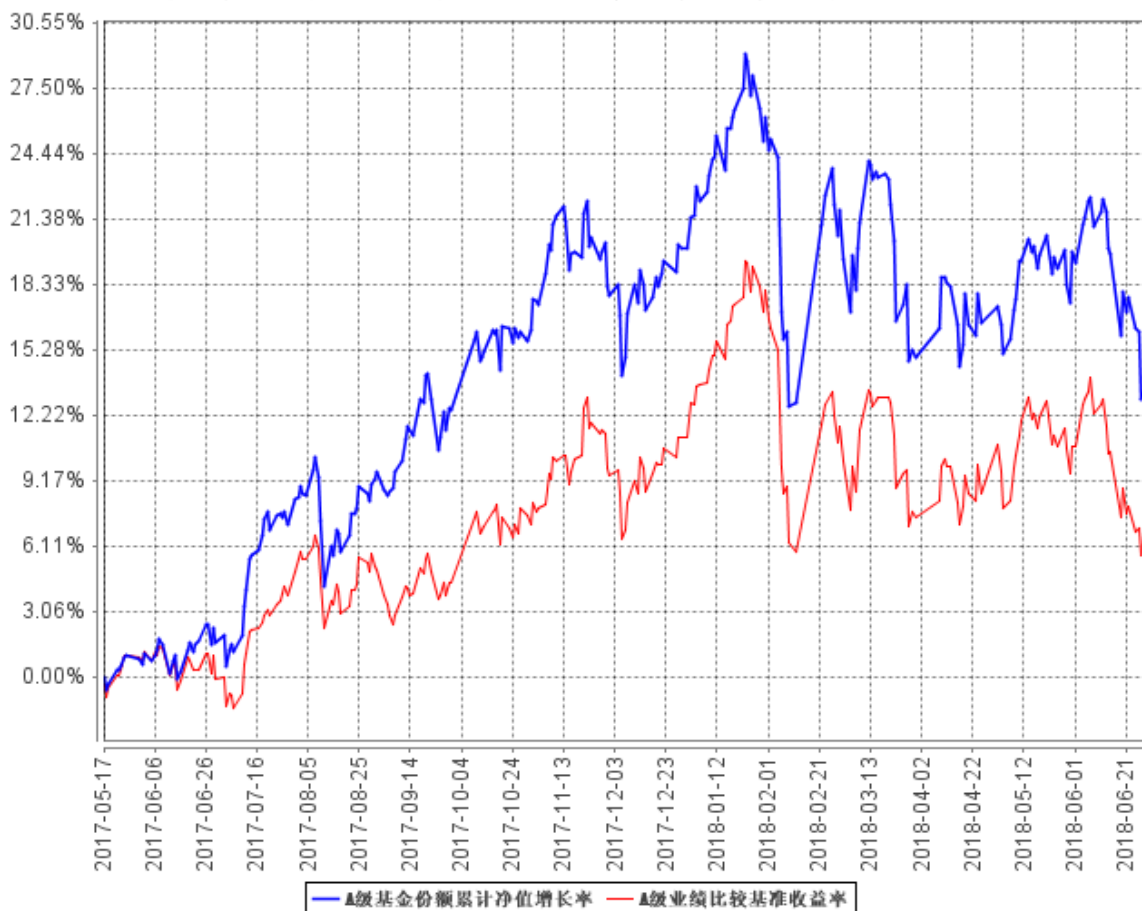
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月 | -1.89% | 1.48% | -1.89% | 1.14% | 0.00% | 0.34% |
| 过去三个月 | 2.26% | 1.25% | 1.20% | 1.07% | 1.06% | 0.18% |
| 过去六个月 | -2.18% | 1.52% | -2.22% | 1.25% | 0.04% | 0.27% |
| 过去一年 | 14.77% | 1.24% | 8.78% | 1.03% | 5.99% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | 16.53% | 1.18% | 8.71% | 0.99% | 7.82% | 0.19% |

注：本基金的业绩比较基准：恒生指数收益率（经人民币汇率调整）×95%+人民币活期存款利率×5%。

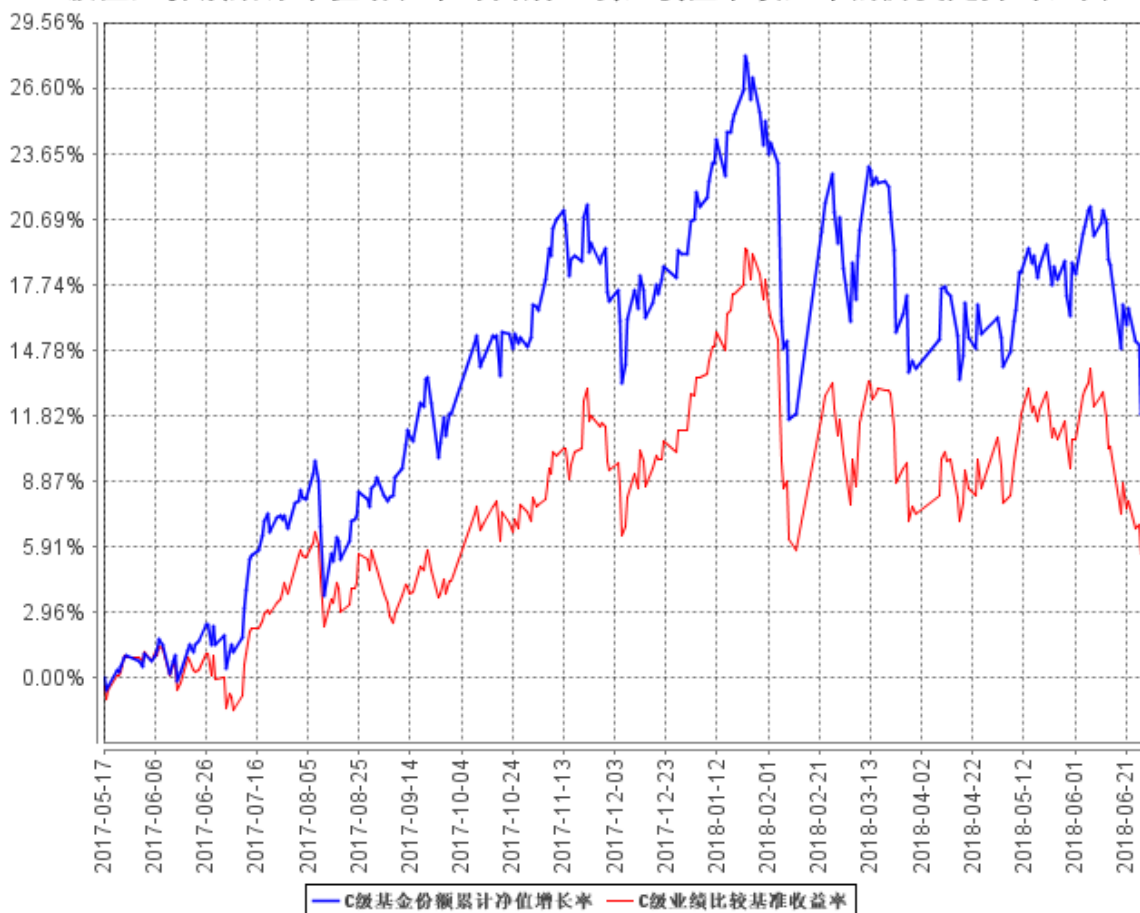
本基金为通过港股通机制投资于香港证券市场的股票型基金，恒生指数是香港市场存在历史最悠久的指数，是反映香港股票市场表现最具有代表性的综合指标，自推出至今一直获广泛使用。本基金管理人认为，以“恒生指数收益率（经人民币汇率调整）×95%+人民币同期活期存款利率×5%”作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金持有人理性判断本基金产品的风险收益特征。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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

| 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 | | |
| 李安杰 | 本基金基金经理 | 2017 年 5 月 17 日 | - | 10 | 台湾成功大学财务金融硕士；CFA；2008 年 7 月至 2014 年 4 月，就职于国泰人寿保险股份有限公司，负责海外债券投资；2014 年 5 月至 2016 年 1 月，就职于国泰证券投资信托股份有限公司，担任台湾 |

| | | | | | |
|----|---------|------------------|---|---|---|
| | | | | | 地区国泰投信-新兴市场高收益债基金经理；2016 年 2 月加盟泰达宏利基金管理有限公司国际业务部，现任基金经理；具有 10 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。 |
| 师婧 | 本基金基金经理 | 2017 年 12 月 25 日 | - | 8 | 新加坡南洋理工大学理学硕士，2010 年 7 月至 2017 年 9 月，任职于新加坡辉立资本集团旗下的辉立证券，其中 2010 年 7 月至 2015 年 6 月担任高级全球股票交易员，负责参与全球 20 个国家和地区的股票交易；2015 年 7 月至 2017 年 9 月担任基金组合经理，主要负责中国香港地区以及亚洲二级市场的投资和全球大类资产的配置投资管理工作；2017 年 9 月加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于国际业务部，先后担任基金经理助理、基金经理等职；具有 8 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。 |

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。在本报告期内，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

受益于全球协同发展、南下资金快速增长，以及企业盈利提升等因素，2017 年恒生指数整体表现可谓顺风顺水；然而步入 2018 年，市场个别基金的表现则更依赖选股能力。受经济增长乏力，估值高企，去杠杆政策等多重因素影响，防御型的行业和个股更受投资者青睐。

截至 2018 年 6 月 29 日，年初至今香港恒生指数下跌 3.22%（港币计价）。汇率方面，年初至今人民币兑美元则贬值 1.75%，期间振幅达 9.33%。人民币兑港币则贬值了 1.33%。香港市场除了受全球外围市场影响，也越发被国内宏观经济变化的情绪所干扰，自 2014 年港股开通以后，港股和 A 股的联动性也较开通前有所增加。外围市场影响因素：1) 美国经济增长较其它区域更为明显，使得美联储于 3 月和 6 月分别加息 25 个百分点，美联储鹰派加息预期强烈，加之减税效应加速资本回流美国使得亚洲市场遇阻；2) 美元走强使得亚洲货币承压，亚洲货币兑美元均有不同程度的贬值，加重资本流出风险；3) 贸易战，白宫在签署“301 调查”后不断增加对中国出口征税的额度和种类。国内情绪影响因素：信贷紧缩，社融增速、GDP 增长、和消费增速皆出现不同幅度的放缓。在资金面方面，南下资金净流入量四、五、六月份皆呈现净流出。

截至上半年，本基金 A 类份额自发行以来回报率为 17.62%。本基金在二、四、五月相较业绩比较基准均产生超额收益。对比 2017 年，本基金增配了银行、消费、医疗等防御行业，并降低房地产行业曝险，进而降低了组合的贝塔。面对市场波动，本基金仍秉持一贯的投资流程和纪律，利用严格执行行业选择和价值选股以降低贝塔，而非进行择时的降低仓位操作。此外本基金之行业配置亦相对均衡，并且坚持分散投资，避免过高的单一持股曝险。

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港股通股票 A 基金份额净值为 1.1762 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.98%；截至本报告期末泰达宏利港股通股票 C 基金份额净值为 1.1653 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.18%；同期业绩比较基准收益率为-2.22%。

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 年下半年，港股或仍将面临上述挑战，然而近期人行出台诸多流动性释放，下半年国内流动性或将较上半年更为宽松。此外近期相关单位及舆论亦对积极财政政策进行诸多讨论，因此无论是货币或财政政策皆有可能较上半年更为友善。

指数方面，经过半年的调整，恒生指数估值已回落到了历史均值以下水平。截至 7 月中，恒生指数 P/E 约 11.3 倍左右，而 P/B 则约 1.24 倍左右，且股息率亦达 3.83%。从基本面而言，企业盈利也较 2016 年的低点大幅回升，业绩增速虽较 2017 年有所回落，但 2018 年中报市场一般预估上市公司平均仍能维持 15%的增速。此外，由于诸多企业认为自身股票估值偏低，近期上市公司的回购操作增多，有望提升市场信心。展望下半年的操作，本基金将维持一贯的价值偏好，并且将着重负债率较低且具备持续盈利逻辑的标的。

在投资的大周期里，单一事件或连续的突发的黑天鹅、白天鹅和灰犀牛仅为市场的杂音，但往往促使非理性的追涨杀跌行为；而此类行为在今年则非常容易造成损失。本基金将秉持本公司严谨的投资流程和纪律，精选个股，并避开过多的短期交易行为。情绪面的短期影响亦容易造成板块和标的错杀行为，然而中长期而言，纪律的基本面选股方针将有利于本基金持续为投资人带来优异的超额收益。

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”）在对泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金

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 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 3,158,759.95 | 15,398,484.67 |
| 结算备付金 | - | 3,764,376.74 |
| 存出保证金 | - | 835,302.69 |
| 交易性金融资产 | 49,972,675.10 | 82,736,056.31 |
| 其中：股票投资 | 49,972,675.10 | 82,736,056.31 |
| 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 | 646.20 | 2,387.47 |
| 应收股利 | 253,131.83 | - |
| 应收申购款 | 53,188.25 | 2,563,371.51 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 53,438,401.33 | 105,299,979.39 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2018 年 6 月 30 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 | 10.57 | 7,747,264.20 |
| 应付赎回款 | 209,581.15 | 1,060,782.79 |
| 应付管理人报酬 | 67,780.21 | 104,557.55 |
| 应付托管费 | 11,296.68 | 17,426.25 |
| 应付销售服务费 | 2,156.18 | 5,550.43 |
| 应付交易费用 | 24,857.03 | 32,782.80 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |

| | | |
|---------------|---------------|----------------|
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 44,808.94 | 170,283.31 |
| 负债合计 | 360,490.76 | 9,138,647.33 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 45,193,489.12 | 80,284,483.32 |
| 未分配利润 | 7,884,421.45 | 15,876,848.74 |
| 所有者权益合计 | 53,077,910.57 | 96,161,332.06 |
| 负债和所有者权益总计 | 53,438,401.33 | 105,299,979.39 |

注：1、报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额总额 45,193,489.12 份，其中下属 A 类基金份额 37,986,762.17 份，C 类基金份额 7,206,726.95 份。下属 A 类基金份额净值 1.1762 元，C 类基金份额净值 1.1653 元。

2、本财务报表的实际对比期间为 2017 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2017 年 5 月 17 日(基金合同生效 日)至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|--|--|
| 一、收入 | 277,178.12 | 5,198,212.73 |
| 1.利息收入 | 23,882.43 | 70,864.48 |
| 其中：存款利息收入 | 23,882.43 | 70,864.48 |
| 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） | 8,313,631.62 | 1,848,609.42 |
| 其中：股票投资收益 | 7,774,575.86 | 51,751.45 |
| 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 | 539,055.76 | 1,796,857.97 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -8,239,203.75 | 3,278,738.83 |

| | | |
|----------------------------|--------------------|---------------------|
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 178,867.82 | - |
| 减：二、费用 | 859,860.61 | 1,108,115.21 |
| 1. 管理人报酬 | 534,757.62 | 481,474.19 |
| 2. 托管费 | 89,126.24 | 80,245.70 |
| 3. 销售服务费 | 24,876.89 | 30,965.88 |
| 4. 交易费用 | 163,311.22 | 480,386.29 |
| 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 | 47,788.64 | 35,043.15 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -582,682.49 | 4,090,097.52 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -582,682.49 | 4,090,097.52 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 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） | 80,284,483.32 | 15,876,848.74 | 96,161,332.06 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润） | - | -582,682.49 | -582,682.49 |
| 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） | -35,090,994.20 | -7,409,744.80 | -42,500,739.00 |
| 其中：1. 基金申购款 | 24,152,087.28 | 5,132,042.89 | 29,284,130.17 |
| 2. 基金赎回款 | -59,243,081.48 | -12,541,787.69 | -71,784,869.17 |
| 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) | 45,193,489.12 | 7,884,421.45 | 53,077,910.57 |
| 项目 | 上年度可比期间 2017年5月17日(基金合同生效日)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) | 263,803,179.74 | - | 263,803,179.74 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 4,090,097.52 | 4,090,097.52 |
| 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) | - | - | - |
| 其中: 1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 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) | 263,803,179.74 | 4,090,097.52 | 267,893,277.26 |

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

泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]299号《关于准予泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金注册的批复》核准,由泰达宏利基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利港股通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人民币263,652,878.47元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第148号验资报告予以验证。经

向中国证监会备案，《泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金基金合同》于 2017 年 5 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 263,803,179.74 份基金份额，其中认购资金利息折合 150,301.27 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《泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金基金合同》和《泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金自募集期起根据预期收益与预期风险以及认购费、申购费、赎回费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中，在投资人认购、申购时收取认购、申购费，但不再从本类别基金财产中计提销售服务费的一类基金份额，称为 A 类基金份额；在投资人认购、申购时不收取认购、申购费，但从本类别基金财产中计提销售服务费的一类基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择认购、申购某一类别的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利港股通优选股票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，包括内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票、国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、银行存款、债券回购、同业存单、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。因投资港股通标的股票而获配的权证，本基金将根据其价值做出投资决策。本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%(其中投资于国内依法发行上市股票占基金资产的比例为 0%~15%，投资于港股通标的股票占基金资产的比例为 80%~95%)；现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为恒生指数收益率(经人民币汇率调整)×95%+人民币活期存款利率×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 8 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》、《泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金 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 年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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的说明

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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政

策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 |

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6月30日 | 上年度可比期间 2017年5月17日(基金合同生效日) 至2017年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 534,757.62 | 481,474.19 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 178,043.43 | 227,686.65 |

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 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

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6月30日 | 上年度可比期间 2017年5月17日(基金合同生效日) 至2017年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 89,126.24 | 80,245.70 |

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 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6月30日 | | |
|----------------|---|-------------|----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 泰达宏利港股通股票 A | 泰达宏利港股通股票 C | 合计 |
| 泰达宏利基金管理有限公司 | - | 6,782.88 | 6,782.88 |
| 中国银行股份有限公司 | - | - | - |
| 合计 | - | 6,782.88 | 6,782.88 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2017年5月17日(基金合同生效日)至2017年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 泰达宏利港股通股票 A | 泰达宏利港股通股票 C | 合计 |
| 泰达宏利基金管理有限 | - | 4,044.56 | 4,044.56 |

| | | | |
|------------|---|----------|----------|
| 公司 | | | |
| 中国银行股份有限公司 | - | - | - |
| 合计 | - | 4,044.56 | 4,044.56 |

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

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自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自有资金投资本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2017 年 5 月 17 日(基金合同生效日) 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 | 3,158,759.95 | 19,068.50 | 16,046,511.72 | 40,787.33 |

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 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.9.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|---------------------|------|-----------------|-----------------|---------|------|--------|--------------|--------|------------|--------------|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 01988 | 民生银行 | 2018 年 6 月 25 日 | 2018 年 7 月 30 日 | 转增股流通受限 | - | 4.73 | 50,600 | - | 239,327.42 | 每 10 股转增 2 股 |

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|---------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 49,972,675.10 | 93.51 |
| | 其中：股票 | 49,972,675.10 | 93.51 |
| 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 | 3,158,759.95 | 5.91 |
| 8 | 其他各项资产 | 306,966.28 | 0.57 |
| 9 | 合计 | 53,438,401.33 | 100.00 |

注：上表权益投资中通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 49,972,675.10，占基金资产净值比例为 94.15%。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票资产。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|-----------|---------------|--------------|
| A 基础材料 | - | - |
| B 消费者非必需品 | 6,954,672.89 | 13.10 |
| C 消费者常用品 | - | - |
| D 能源 | 2,676,252.33 | 5.04 |
| E 金融 | 18,941,684.03 | 35.69 |
| F 医疗保健 | 5,312,727.20 | 10.01 |
| G 工业 | 4,305,581.02 | 8.11 |
| H 信息技术 | 11,009,545.48 | 20.74 |
| I 电信服务 | - | - |
| J 公用事业 | 772,212.15 | 1.45 |
| K 房地产 | - | - |
| 合计 | 49,972,675.10 | 94.15 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-------|-------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 00700 | 腾讯控股 | 13,700 | 4,548,575.09 | 8.57 |
| 2 | 00005 | 汇丰控股 | 53,200 | 3,301,174.91 | 6.22 |
| 3 | 00939 | 建设银行 | 516,000 | 3,154,037.10 | 5.94 |
| 4 | 01347 | 华虹半导体 | 137,000 | 3,112,851.67 | 5.86 |
| 5 | 01398 | 工商银行 | 599,000 | 2,964,449.20 | 5.59 |
| 6 | 00388 | 香港交易所 | 13,300 | 2,646,322.28 | 4.99 |
| 7 | 01299 | 友邦保险 | 41,400 | 2,394,437.72 | 4.51 |

| | | | | | |
|----|-------|------------|---------|--------------|------|
| 8 | 01177 | 中国生物制药 | 207,000 | 2,101,241.27 | 3.96 |
| 9 | 01970 | IMAX CHINA | 94,000 | 1,894,108.46 | 3.57 |
| 10 | 02018 | 瑞声科技 | 20,000 | 1,863,251.00 | 3.51 |

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 | 01347 | 华虹半导体 | 2,789,993.40 | 2.90 |
| 2 | 00338 | 上海石油化工股份 | 1,989,893.75 | 2.07 |
| 3 | 01988 | 民生银行 | 1,986,371.08 | 2.07 |
| 4 | 02331 | 李宁 | 1,935,225.10 | 2.01 |
| 5 | 01316 | 耐世特 | 1,849,785.14 | 1.92 |
| 6 | 01970 | IMAX CHINA | 1,832,686.68 | 1.91 |
| 7 | 00368 | 中外运航运 | 1,769,049.86 | 1.84 |
| 8 | 00656 | 复星国际 | 1,558,249.36 | 1.62 |
| 9 | 03888 | 金山软件 | 1,543,965.63 | 1.61 |
| 10 | 03933 | 联邦制药 | 1,307,586.96 | 1.36 |
| 11 | 00371 | 北控水务集团 | 1,263,889.11 | 1.31 |
| 12 | 02386 | 中石化炼化工程 | 1,180,743.20 | 1.23 |
| 13 | 01666 | 同仁堂科技 | 1,179,883.54 | 1.23 |
| 14 | 01569 | 民生教育 | 1,108,035.15 | 1.15 |
| 15 | 00921 | 海信科龙 | 1,086,664.52 | 1.13 |
| 16 | 00874 | 白云山 | 983,356.25 | 1.02 |

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 | 00883 | 中国海洋石油 | 3,777,777.43 | 3.93 |

| | | | | |
|----|-------|-------------|--------------|------|
| 2 | 02318 | 中国平安 | 3,293,964.88 | 3.43 |
| 3 | 01109 | 华润置地 | 3,245,269.00 | 3.37 |
| 4 | 01113 | 长实集团 | 2,917,983.16 | 3.03 |
| 5 | 00384 | 中国燃气 | 2,893,794.32 | 3.01 |
| 6 | 03993 | 洛阳钼业 | 2,681,413.54 | 2.79 |
| 7 | 02331 | 李宁 | 2,519,972.37 | 2.62 |
| 8 | 06808 | 高鑫零售 | 2,514,765.19 | 2.62 |
| 9 | 00371 | 北控水务集团 | 2,345,828.24 | 2.44 |
| 10 | 01888 | 建滔积层板 | 2,344,180.36 | 2.44 |
| 11 | 01044 | 恒安国际 | 2,254,382.22 | 2.34 |
| 12 | 00006 | 电能实业 | 2,178,409.34 | 2.27 |
| 13 | 01972 | 太古地产 | 2,015,265.55 | 2.10 |
| 14 | 00338 | 上海石油化工股份 | 1,971,441.57 | 2.05 |
| 15 | 00762 | 中国联通 | 1,965,396.93 | 2.04 |
| 16 | 01177 | 中国生物制药 | 1,946,442.28 | 2.02 |
| 17 | 00425 | 敏实集团 | 1,942,251.99 | 2.02 |
| 18 | 01398 | 工商银行 | 1,935,330.18 | 2.01 |
| 19 | 00981 | 中芯国际 | 1,882,786.92 | 1.96 |
| 20 | 00522 | ASM PACIFIC | 1,662,287.42 | 1.73 |

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 | 25,365,378.73 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 57,664,132.05 |

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前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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。

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

本报告期本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|----|
| 1 | 存出保证金 | - |

| | | |
|---|---------|------------|
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 253,131.83 |
| 4 | 应收利息 | 646.20 |
| 5 | 应收申购款 | 53,188.25 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 306,966.28 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额 级别 | 持有人 户数(户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|-----------------------------|--------------|---------------|--------------|--------|---------------|---------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 泰达 宏利 港股 通股 票 A | 2,342 | 16,219.80 | 9,316,127.83 | 24.52% | 28,670,634.34 | 75.48% |
| 泰达 宏利 港股 通股 | 1,168 | 6,170.14 | 0.00 | 0.00% | 7,206,726.95 | 100.00% |

| | | | | | | |
|-----|-------|-----------|--------------|--------|---------------|--------|
| 票 C | | | | | | |
| 合计 | 3,510 | 12,875.64 | 9,316,127.83 | 20.61% | 35,877,361.29 | 79.39% |

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 | 泰达宏利港股通股票 A | 69,206.41 | 0.1822% |
| | 泰达宏利港股通股票 C | 46,535.29 | 0.6457% |
| | 合计 | 115,741.70 | 0.2561% |

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 | 泰达宏利港股通股票 A | 0~10 |
| | 泰达宏利港股通股票 C | 0 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 泰达宏利港股通股票 A | 0 |
| | 泰达宏利港股通股票 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 泰达宏利港股通股票 A | 泰达宏利港股通股票 C |
|----------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日（2017 年 5 月 17 日）基金 | 178,960,760.25 | 84,842,419.49 |

| | | |
|--------------------------|---------------|---------------|
| 份额总额 | | |
| 本报告期期初基金份额总额 | 60,145,538.45 | 20,138,944.87 |
| 本报告期基金总申购份额 | 13,600,314.81 | 10,551,772.47 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 35,759,091.09 | 23,483,990.39 |
| 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 | 37,986,762.17 | 7,206,726.95 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管人、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中信证券 | 1 | 83,029,510.78 | 100.00% | 66,423.37 | 100.00% | - |
| 天风证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：（一）本基金本报告期无新增、撤销交易单元。

（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。

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 | 20180608-20180630 | 9,316,127.83 | 0.00 | 0.00 | 9,316,127.83 | 20.61% |
| 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

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）以及相关基金合同和托管协议的有关规定，经与各基金托管人协商一致，并履行了必要程序，本基金管理人对本基金基金合同和托管协议进行修改。另外，根据《流动性风险管理规定》相关规定，自 2018 年 3 月 31 日起，本管理人对持续持有期少于 7 日的除货币市场基金外的基金赎回申请，收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。转换业务涉及的转出基金赎回费率等事项按上述规则进行调整。详情请见基金管理人 2018 年 3 月 24 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下 51 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告》以及更新后的基金合同与托管协议。

泰达宏利基金管理有限公司
2018 年 8 月 27 日