

重要提示

基金管理人承诺及重要提示：基金管理人承诺不存在虚假记载、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。
基金管理人承诺本报告所载数据不存在虚假记载、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。
基金管理人承诺本报告所载数据不存在虚假记载、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。

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Includes fields like 基金名称 (Fund Name), 基金代码 (Fund Code), 基金管理人 (Fund Manager), 基金托管人 (Fund Custodian), etc.

主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators), 本基金 (This Fund), 泰达宏利混合 (Taida Hongli Mixed), 泰达宏利混合 (Taida Hongli Mixed). Includes 本期已实现收益 (Realized Income), 本期利润 (Current Profit), etc.

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) 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际到持有人账户的赎回净收益将低于所列数字。

基金净值表现

Table with columns: 阶段 (Period), 净值增长率① (Net Return Rate), 净值增长率标准差② (Net Return Rate Std Dev), etc.

Table with columns: 阶段 (Period), 净值增长率① (Net Return Rate), 净值增长率标准差② (Net Return Rate Std Dev), etc.

Table with columns: 阶段 (Period), 净值增长率① (Net Return Rate), 净值增长率标准差② (Net Return Rate Std Dev), etc.

Table with columns: 阶段 (Period), 净值增长率① (Net Return Rate), 净值增长率标准差② (Net Return Rate Std Dev), etc.

注：1. 本基金合同于2016年07月13日生效。
2. 本基金基金的合同生效日、基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，但在建仓期间本基金各项资产配置比例符合基金合同的约定。

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：本基金合同于2016年07月13日生效。

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：本基金合同于2016年07月13日生效。

其他指标

Table with columns: 其他指标 (Other Indicators), 报告期 (2019-04-01至2019-06-30), 报告期 (2019-06-30).

基金管理人、基金托管人简介

Table with columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任职日期 (Start Date), 离任日期 (End Date), 证券从业年限 (Years of Experience), 说明 (Remarks).

注：证券从业年限是指从事中国证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关职业，非中任日期和离任日期均指在中国证监会备案的日期。

报告期内本基金净值变动情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守法律法规以及基金合同的约定，本基金运作符合法律法规，没有因违反法律法规而受到监管部门处罚的情况。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况
本基金管理人公平对待所管理的各基金和组合，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度。

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预警机制，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价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5%的情况。

报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观经济方面：二季度经济增速小幅下行，但总体保持平稳。从二季度来看，投资由于地产投资拖累有所回落，制造业投资保持韧性，增速有所下滑。消费由于受到疫情影响有所回落，但整体保持韧性。出口仍受全球贸易摩擦影响，增速有所回落。
货币政策方面：二季度货币政策保持稳健中性，流动性保持合理充裕。央行通过降准、降息等方式释放流动性，支持实体经济。
行业配置方面：二季度基金持仓主要集中在医药、食品饮料、电子、计算机、国防军工等行业。医药行业表现突出，食品饮料行业表现稳健。
基金运作方面：二季度基金运作符合合同约定，投资策略得到有效执行。基金管理人将根据市场变化及时调整投资策略，力争实现基金资产的长期增值。

报告期内基金的投资表现

截至本报告期末本基金累计基金份额净值为1.6535元。本报告期基金份额净值为1.6535元，本报告期基金份额净值为1.6535元。本报告期基金份额净值为1.6535元。

报告期内基金份额持有人数量或基金资产净值预警说明

本报告期末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况。

投资组合报告

Table with columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount in RMB), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets).

注：本基金报告期内未通过港股通交易投资港股。

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets).

注：本基金报告期内未通过港股通交易投资港股。

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table with columns: 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets).

注：本基金报告期内未通过港股通交易投资港股。

报告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

Table with columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets).

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债券投资明细

Table with columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (份) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets).

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权证投资明细

注：本基金报告期内未通过港股通交易投资港股。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in RMB), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in RMB), 风险说明 (Risk Description).

注：本基金报告期内未投资股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in RMB), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in RMB), 风险说明 (Risk Description).

注：本基金报告期内未投资国债期货。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况
本报告期末本基金前十名证券投资主体未出现监管部门立案调查的情况，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

声明基金投资的前十名投资是否超出基金合同约定的备选股票库
基金投资的前十名投资中，没有投资超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

其他资产构成

Table with columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount in RMB), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets).

报告期末持有的处于锁定期可转换债券明细
注：本基金本报告期末未持有处于锁定期的可转换债券。

报告期末前十名投资中存在流通受限情况的说明
注：本基金本报告期末前十名投资中不存在流通受限情况。

投资组合报告附注的其他文字描述部分
1. 由于计算买入的期间，分母之和合计为零导致存在误差。
2. 报告期内没有需要说明的证券投资处罚情况。

开放式基金份额变动

Table with columns: 项目 (Item), 泰达宏利混合 (Taida Hongli Mixed), 泰达宏利混合 (Taida Hongli Mixed), 泰达宏利混合 (Taida Hongli Mixed).

注：报告期内，基金管理人未运用固有资金认购、赎回或买卖本基金基金份额。

基金管理人持有本基金份额变动情况

Table with columns: 项目 (Item), 泰达宏利混合 (Taida Hongli Mixed), 泰达宏利混合 (Taida Hongli Mixed), 泰达宏利混合 (Taida Hongli Mixed).

注：报告期内，基金管理人未运用固有资金认购、赎回或买卖本基金基金份额。

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Method), 交易日期 (Transaction Date), 交易金额 (元) (Amount in RMB), 交易金额 (元) (Amount in RMB), 适用费率 (Applicable Rate).

注：报告期内，基金管理人未运用固有资金认购、赎回或买卖本基金基金份额。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with columns: 项目 (Item), 持有基金份额 (Number of Shares), 持有基金份额占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets), 发起份额总数 (Number of Shares), 发起份额占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets), 发起份额持有期限 (Initiation Share Holding Period).

注：报告期内，基金管理人持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table with columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例或市值占报告期末时点比例 (%) (Percentage of Net Assets at Reporting End), 持有份额 (Number of Shares), 持有份额 (Number of Shares), 持有份额 (Number of Shares), 持有份额 (Number of Shares), 持有份额 (Number of Shares), 持有份额 (Number of Shares).

注：报告期内，基金管理人持有基金份额比例达到或超过20%的情况

影响投资者决策的其他重要信息

无

备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰达宏利回报混合型证券投资基金注册的文件；
(二) 《泰达宏利回报混合型证券投资基金基金合同》；
(三) 《泰达宏利回报混合型证券投资基金招募说明书》；
(四) 《泰达宏利回报混合型证券投资基金托管协议》。

存放地点

基金管理人、基金托管人处。

查阅方式

投资者可通过指定信息披露网站《中国证券报》或泰达宏利基金管理人网站(www.htfund.com.cn)查阅。