泰达宏利价值优化型稳定类行业证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期间为2013年7月1日至2013年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利稳定股票
交易代码	162203
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年4月25日
报告期末基金份额总额	264,756,140.91份
投资目标	本基金主要投资于稳定行业类别中内在价值被相对低估,并与同行业类别上市公司相比具有更高增长潜力的上市公司。在有效控制投资组合风险的前提下,为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采用“自上而下”的投资方法,具体体现在资产配置、行业配置和个股选择的全过程中。
业绩比较基准	65%×富时中国A600稳定行业指数+35%×上证国债指数。
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于较高风险的基金品种。
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,006,117.92
2.本期利润	31,359,982.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.1255
4.期末基金资产净值	201,306,831.84
5.期末基金份额净值	0.7603

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。

3.2 基金净值表现

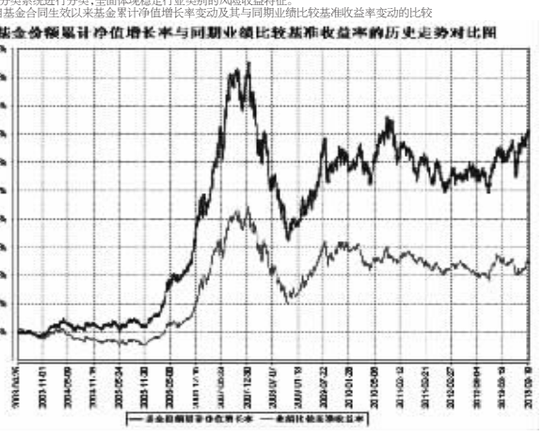
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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	19.39%	1.21%	8.03%	0.97%	11.36%	0.24%

注:本基金业绩比较基准:65%×富时中国A600稳定行业指数+35%×上证国债指数。上证国债指数选取的样本为在上海证券交易所上市交易的、除浮息债外的国债品种,样本国债的剩余期限分布均匀,收益率曲线较为完整、合理,而且参与主体丰富,竞价交易连续性更强,能反映出市场利率的瞬息变化,客观、真实地标示出利率市场整体的收益风险度。

富时中国A600稳定行业指数是从富时中国A600行业指数中重新归类而成,成份股按照全球公认并已广泛采用的富时指数全球行业分类系统进行分类,全面体现稳定行业类别的风险收益特征。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡涛	本基金基金经理	2009年6月13日	2013年8月30日	12	MBA,特许金融分析师(CFA);1999年7月至2000年7月就职于北京证券有限责任公司任投资银行部经理,2002年6月至2003年6月就职于中国国际金融有限公司任股票研究经理;2003年7月至2004年4月就职于长盛基金管理有限公司任研究员;2004年9月至2007年4月就职于友邦华泰基金管理有限公司任基金经理助理;2007年4月加盟泰达宏利基金管理有限公司,先后担任专户投资部副总经理、研究部研究主管等职务;10年基金从业经验,12年证券投资管理经验,具有基金从业资格。
焦云	本基金基金经理	2009年12月25日	-	9	金融学硕士:2004年8月至2007年4月就职于大成基金管理有限公司任研究员;2007年4月加入泰达宏利基金管理有限公司,先后担任研究员、研究主管;9年基金从业经验,9年证券投资管理经验,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做出决定的公告日期。

2. 我公司已于2013年9月3日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》。胡涛先生自2013年8月30日起不再担任本基金基金经理。

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 公平交易专项说明

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,没有发生利益输送、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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度,国内经济呈现复苏迹象,市场风格趋同。国内方面,在“保底增长”政策作用下,虽然内生需求仍然疲弱,但出现了企稳迹象,固定资产投资、消费均出现了回升态势,受益于国内经济增长复苏的信心,国际铁矿石、原油价格等出现反弹,同时生产领域出现一定程度的补库存行为。总体来看,继去年中期开始企业缩减固定资产投入到今年中期开始缩减费用,微观企业层面短暂的复苏在政策刺激下容易展开。

整体来看,3季度沪深指数与市场对经济的预期和最终验证一致,在6月份由于钱荒引起市场深幅回调之后,3季度市场稳定回升:最终上证指数上涨11.8%,深成指上涨12.6%。从行业看,TMT、商贸、旅游等相关板块表现较好;而白酒、电力等板块表现较弱。

操作上,本基金3季度根据经济形势及时转换思路,组合适度均衡化,取得了较好的收益。

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0.7603元,本报告期份额净值增长率为19.39%,同期业绩比较基准增长率为8.03%。

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4季度,我们认为由于基数的缘故,经济增速的预期差与3季度相比弱一些,4季度最重要的事件之一是三中全会对改革的指引,在投资上做适度的布局。同时,关注估值相对较低、预期较低的板块及个股的投资机会。

基于上述判断,预计A股市场仍将呈现结构性机会。因此,本基金将维持仓位稳定,以成长确定、估值合理、景气度较高的成长性公司作为基本配置,并在合适的时候加仓估值低、基本面稳健、存在改变预期的个股。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	142,833,460.63	70.45
	其中:股票	142,833,460.63	70.45
2	固定收益投资	41,504,670.10	20.47
	其中:债券	41,504,670.10	20.47
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	17,461,339.56	8.61
6	其他资产	955,580.77	0.47
7	合计	202,755,051.06	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	24,839,916.40	12.34
B	采矿业	-	-
C	制造业	60,525,074.13	30.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,870,144.00	5.40
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,780,254.00	1.88
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,633,603.00	1.31
J	金融业	15,609,189.51	7.75
K	房地产业	-	-
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	14,140,280.66	7.02
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	5,204,286.36	2.59
S	综合	5,230,712.57	2.60
	合计	142,833,460.63	70.95

5.3 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000712	锦龙股份	521,600	10,870,144.00	5.40
2	000895	双汇发展	229,100	10,641,695.00	5.29
3	300070	碧水源	251,629	10,241,300.30	5.09
4	600705	中航投资	487,586	9,390,906.36	4.66
5	300024	机器人	202,432	8,894,862.08	4.42
6	300146	汤臣倍健	117,921	7,782,786.00	3.87
7	600108	亚盛集团	817,216	7,575,592.32	3.76
8	600597	光明乳业	307,446	7,252,651.14	3.60
9	000848	承德露露	215,849	6,261,779.49	3.11
10	600837	海通证券	497,065	6,218,283.15	3.09

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,546,500.00	0.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,391,000.00	19.57
	其中:政策性金融债	39,391,000.00	19.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	567,170.10	0.28
8	其他	-	-
9	合计	41,504,670.10	20.62

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120222	12国开22	200,000	19,418,000.00	9.65
2	130236	13国开36	100,000	9,987,000.00	4.96
3	120245	12国开45	100,000	9,986,000.00	4.96
4	010107	21国债(7)	15,000	1,546,500.00	0.77
5	113001	中行转债	5,670	567,170.10	0.28

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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,在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	156,028.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	726,724.30
5	应收申购款	72,827.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	955,580.77

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	567,170.10	0.28

5.10.5 报告期末前十名股票中在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情况。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	254,413,581.74
报告期期间基金总申购份额	31,970,341.14
减:报告期期间基金总赎回份额	21,627,781.97
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	264,756,140.91

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金设立的文件;

2.《泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金基金合同》;

3.《泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金招募说明书》;

4.《泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金托管协议》。

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资人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》)或登录基金管理人互联网网址(http://www.mfcteda.com)查阅。

泰达宏利基金管理有限公司
2013年10月25日

泰达宏利市值优选股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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2013年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期间为2013年7月1日至2013年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利市值优选股票
交易代码	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
报告期末基金份额总额	7,357,584,569.09份
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	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。 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。
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	本基金是股票型证券投资基金,其投资目标和投资策略决定了本基金属于高风险、高收益的基金产品,预期收益和风险高于混合型、债券型和货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	225,004,455.32
2.本期利润	942,253,226.44
3.加权平均基金份额本期利润	0.1255
4.期末基金资产净值	6,882,698,988.02
5.期末基金份额净值	0.9355

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。

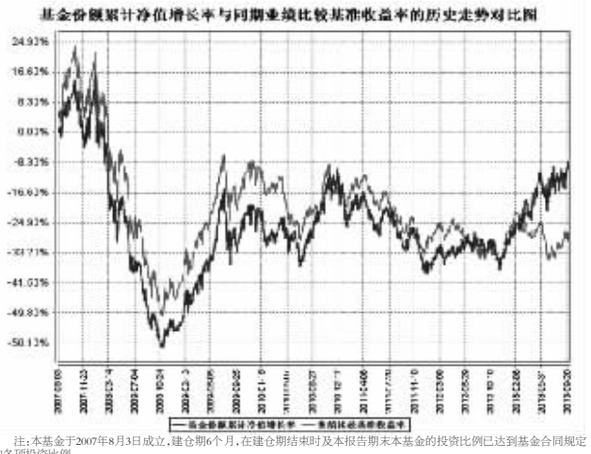
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	15.69%	1.76%	7.26%	1.07%	8.43%	0.69%

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市场中选取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



注:本基金于2007年8月3日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时及本报告期末本基金的投资比例已达到基金合同规定的各项投资比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴俊峰	本基金基金经理	2009年8月25日	-	8	硕士。2005年5月至2005年8月期间就职于国信证券经济研究所、任研究员。2005年8月加盟泰达宏利基金管理有限公司,先后担任研究员、研究主管等职务;8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做出决定的公告日期。

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。

4.3 公平交易专项说明

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,没有发生利益输送、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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度,国内经济呈现复苏迹象,市场风格趋同。国内方面,在“保底增长”政策作用下,虽然内生需求仍然疲弱,但出现了企稳迹象,固定资产投资、消费均出现了回升态势,受益于国内经济增长复苏的信心,国际铁矿石、原油价格等出现反弹,同时生产领域出现一定程度的补库存行为。总体来看,继去年中期开始企业缩减固定资产投入到今年中期开始缩减费用,微观企业层面短暂的复苏在政策刺激下容易展开。

整体来看,3季度沪深指数与市场对经济的预期和最终验证一致,在6月份由于钱荒引起市场深幅回调之后,3季度市场稳定回升:最终上证指数上涨11.8%,深成指上涨12.6%。从行业看,TMT、商贸、旅游等相关板块表现较好;而白酒、电力等板块表现较弱。

操作上,本基金3季度根据经济形势及时转换思路,组合适度均衡化,取得了较好的收益。

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0.9355元,本报告期份额净值增长率为15.69%,同期业绩比较基准增长率为7.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然三季度以来的一些经济数据有企稳回升的迹象,但投资者对四季度之后的经济走势并未明确预期,这使得金融、地产以及传统周期性行业很难出现趋势性机会。中国经济结构转型和改革必须向前推进已经成为共识,因此寻找相应的受益行业和个股是主线,本基金将继续坚持对这类机会进行深入挖掘并集中投资,预计四季度整个市场的风格依然会以成长股为主,但波动会加大,本基金将适当对组合进行平衡,以稳定组合收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,418,448,641.65	92.85
	其中:股票	6,418,448,641.65	92.85
2	固定收益投资	179,550,000.00	2.60
	其中:债券	179,550,000.00	2.60
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	248,922,097.18	3.60
6	其他资产	66,038,998.44	0.96
7	合计	6,912,959,737.27	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	3,979,944,597.94	57.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	119,658,000.00	1.74
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,180,500,558.25	17.15
J	金融业	15,728,000.00	0.23
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	92,794,827.19	1.35
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	337,918,872.50	4.91
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	691,903,785.77	10.05
S	综合	-	-
	合计	6,418,448,641.65	93.25

5.3 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002415	海康威视	22,000,000	580,800,000.00	8.44
2	002236	大华股份	11,499,902	524,165,533.16	7.62
3	002450	康得新	19,362,794	464,319,800.12	6.75
4	002241	歌尔声学	10,784,519	455,969,463.32	6.62
5	600887	伊利股份	9,499,662	424,444,898.16	6.17
6	300027	华谊兄弟	5,000,000	389,400,000.00	5.66
7	300070	碧水源	8,302,675	337,918,872.50	4.91
8	600637	百视通	6,449,617	337,637,449.95	4.91
9	000538	云南白药	2,665,902	312,070,488.12	4.53
10	600535	天士力	5,999,857	270,113,562.14	3.92

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	179,550,000.00	2.61
	其中:政策性金融债	179,550,000.00	2.61
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	179,550,000.00	2.61

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130201	13国开01	1,800,000	179,550,000.00	2.61

注:以上为本基金本报告期末持有的全部债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

基金投资前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,021,550.53
2	应收证券清算款	59,452,818.39
3	应收股利	-
4	应收利息	4,405,763.22
5	应收申购款	158,866.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,038,998.44

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中在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情况。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	7,394,446,660.63
报告期期间基金总申购份额	464,206,425.28
减:报告期期间基金总赎回份额	501,068,516.82
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	7,357,584,569.09

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准泰达宏利市值优选股票型证券投资基金设立的文件;

2.《泰达宏利市值优选股票型证券投资基金基金合同》;

3.《泰达宏利市值优选股票型证券投资基金招募说明书》;

4.《泰达宏利市值优选股票型证券投资基金托管协议》。

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资人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》)或登录基金管理人互联网网址(http://www.mfcteda.com)查阅。

泰达宏利基金管理有限公司
2013年10月25日

泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期间为2013年7月1日至2013年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利成长股票
交易代码	162201
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年4月25日
报告期末基金份额总额	1,203,089,375.76份
投资目标	本基金主要投资于成长行业类别中内在价值被相对低估,并与同行业类别上市公司相比具有更高增长潜力的上市公司。在有效控制投资组合风险的前提下,为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采用“自上而下”的投资方法,具体体现在资产配置、行业配置和个股选择的全过程中。
业绩比较基准	65%×富时中国A600成长行业指数+35%×上证国债指数。
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于较高风险的基金品种。
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	170,245,228.69
2.本期利润	343,028,749.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.2701
4.期末基金资产净值	1,649,631,770.08
5.期末基金份额净值	1.3712

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 |