泰达宏利货币市场基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2015年4月22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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年4月20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。

本报告期为2015年1月1日起至2015年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利货币	
交易代码	162206	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年11月10日	
报告期末基金份额总额	948,140,373.35份	
投资目标	在确保本金安全性和基金财产流动性的基础上，力争为投资者获取超过业绩比较基准的收益。	
投资策略	本基金将在遵守投资纪律并有效管理风险的基础上，实施稳健的投资风格和谨慎的交易操作。以价值分析为基础，数量分析为支持，采用自上而下确定投资策略和自下而上个券选择的程序，运用供求分析、久期偏离、收益率曲线配置和类属配置等积极投资策略，实现基金资产的保值增值。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为税后一年期银行定期存款利率。	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期收益率和预期风险均低于股票、混合和债券型基金。	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B
下属分级基金的交易代码	162206	000700
报告期末下属分级基金的份额总额	220,078,973.58份	728,061,399.77份

§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（2015年1月1日 － 2015年3月31日）	
	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B
1. 本期已实现收益	2,746,202.02	5,849,834.34
2.本期利润	2,746,202.02	5,849,834.34
3.期末基金资产净值	220,078,973.58	728,061,399.77

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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰达宏利货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.1382%	0.0093%	0.6568%	0.0003%	0.4814%	0.0090%

本基金收益分配按月结转份额。

泰达宏利货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.1980%	0.0093%	0.6568%	0.0003%	0.5412%	0.0090%

本基金收益分配按月结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

本基金在建仓期结束时及本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		
胡振仓	本基金基金经理	2008年8月9日	-	12	金融学硕士；2003年7月至2005年4月就职于乌鲁木齐市商业银行，从事债券交易与研究工作，首席研究员；2006年3月至2006年6月就职于国联证券公司，从事债券交易工作，高级经理；2006年7月至2008年3月就职于益民基金管理有限公司，其中2006年7月至2006年11月任益民货币市场基金基金经理助理，2006年12月至2008年3月任益民货币市场基金基金经理；2008年4月加盟泰达宏利基金管理有限公司。12年证券从业经验，9年基金从业经验，具有基金从业资格。
丁宇佳	本基金基金经理	2015年3月26日	-	7	丁宇佳女士毕业于中央财经大学，理学学士。2008年7月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任交易部交易员，负责债券交易工作；2013年9月至2015年3月，担任固定收益部研究员，从事债券研究工作。

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。

2、我公司已于2015年3月28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》，丁宇佳女士自2015年3月26日起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，未发生任何利益输送的情况。

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

2015年1季度，美国经济数据走软，美联储态度较市场预期鸽派，加息时点有可能延后。欧洲经济在量化宽松之后略有好转。

国内经济下行压力不减。2月工业增加值增速创2009年6月以来新低，受内需不足的影响下，进口跌幅扩大，投资和消费数据也难觅亮点。3月PMI出现季节性反弹，但反弹力度较弱，宏观经济处于底部震荡状态。CPI同比增速继续下降，PPI同比跌幅扩大。在此背景下，国务院出台包括放松房地产政策在内的诸多稳增长措施，并加大财政投放力度。央行也在2月份进行了降准和降息操作，并多次下调逆回购利率，继续采用逆回购、中期借贷便利MLF等工具提供流动性。

债券市场方面，1季度债券收益率呈V型走势：1-2月债券市场继续走牛，主要源于经济不佳、央行全面放松的预期；2月春节后至3月份，流动性上受到春节因素影响、IPO冲击，资金利率有所上行，并叠加股市快速上涨拉升风险偏好、对地方债务供给压力的担忧，收益率大幅反弹。整体来看，利率债和高等级债券小幅上行，中低等级信用债小幅下行，信用利差有所收窄；短端收益率基本持平，长端略有上行，收益率曲线略陡峭化。

操作上，本基金继续采取谨慎策略，保持债券久期至中性水平，并配合较短久期的回购以及存款应对资金面冲击。由于规模缩减，本基金杠杆有所增加。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

货币A

截止报告期末，本基金份额净值为1.0000元，本报告期份额净值增长率为1.1382%，同期业绩比较基准增长率为0.6568%。

货币B

截止报告期末，本基金份额净值为1.0000元，本报告期份额净值增长率为1.1980%，同期业绩比较基准增长率为0.6568%。

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2015年2季度，美元升值可能拖累美国贸易数据，但美国经济可能仍将平稳增长。欧洲经济在量化宽松和欧元贬值的作用下有望维持复苏势头，中国出口将较为稳定。消费实际增速在“双十一”影响消退后有望保持平稳。降准降息、房地产放松政策可能会在2季度慢慢产生效果，投资增速下滑有望趋缓，但经济整体有可能仍将低位运行。

通胀预计略高于1季度水平，但央行货币政策仍然会保持中性，并继续运用多种手段从“量”和“价”上进行精细化管理，流动性整体无虞，但在IPO以及财政缴款、季末等时点上仍然有脉冲式冲击。整体来看，回购利率中枢可能低于1季度水平。

在收益率曲线仍然较为平坦的情况下，未来短端收益率大概率将随回购利率下行。不能忽视的是，利率市场化将进一步抬高银行负债成本，银行资产配置可能转向收益率更高的产品，收益率易上难下，信用利差可能进一步压缩。因此，2季度货币基金在充分防范信用风险的前提下，仍然将保持一定仓位的中低评级短融配置，利用高评级短融和短久期回购保持组合的流动性，加强波段操作。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日出现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 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	固定收益投资	709,423,605.66	62.80
	其中：债券	709,423,605.66	62.80
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	325,601,448.40	28.82
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	80,219,325.38	7.10
4	其他资产	14,384,525.78	1.27
5	合计	1,129,628,905.22	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	10.76	
	其中：买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	178,699,390.65	18.85
	其中：买断式回购融资	-	-

注：上表中，报表期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数，报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例（%）	原因	调整期

本基金本报告期末出现债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	126
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	157
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	104

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未出现超过180天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	38.60	18.85
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）-60天	15.81	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）-90天	2.11	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）-180天	15.84	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天（含）-397天（含）	45.26	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	117.62	18.85

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	摊余成本（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	49,947,482.10	5.27
	其中：政策性金融债	49,947,482.10	5.27
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	659,476,123.56	69.55
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	709,423,605.66	74.82
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	041460106	14海沧投资CP002	600,000	59,913,746.35	6.32
2	011599067	15中材SCP001	500,000	49,968,492.00	5.27
3	041456048	14华工科技CP001	500,000	49,903,788.87	5.26
4	011599079	15深投控SCP001	500,000	49,706,079.61	5.24
5	041456020	14美克CP002	400,000	40,124,478.03	4.23
6	041473007	14天富CP001	400,000	40,102,540.71	4.23
7	041560022	15新城建CP001	400,000	39,980,640.60	4.22
8	041477001	14蓝色光标CP001	300,000	30,041,727.46	3.17
9	071526001	15兴业证券CP001	300,000	29,996,446.58	3.16
10	041464073	14华宝科技CP001	300,000	29,990,096.34	3.16

5.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25（含）-0.5%间的次数	11
报告期内偏离度的最高值	0.3570%
报告期内偏离度的最低值	0.0302%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1981%

5.7 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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

5.8.2

本基金本报告期内未存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	12,058,156.99
4	应收申购款	2,311,368.79
5	其他应收款	15,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	14,384,525.78

5.8.5 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.报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B
报告期期初基金份额总额	251,294,109.86	544,131,088.40
报告期期间基金总申购份额	428,490,236.00	944,109,210.55
减：报告期期间基金总赎回份额	459,705,372.28	760,178,899.18
报告期期末基金份额总额	220,078,973.58	728,061,399.77

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

（一）中国证监会核准泰达宏利货币市场基金设立的文件；

（二）《泰达宏利货币市场基金基金合同》；

（三）《泰达宏利货币市场基金招募说明书》；

（四）《泰达宏利货币市场基金托管协议》。

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

投资者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
2015年4月22日

泰达宏利中证500指数分级证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2015年4月22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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年4月20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2015年1月1日至2015年3月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利500指数分级		
场内简称	泰达500		
交易代码	162216		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011年12月1日		
报告期末基金份额总额	52,115,281.67份		
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证500指数，力争获取与标的指数相似的投资收益，并将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。		
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、成分股被限制投资等）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，以实现对跟踪误差的有效控制。		
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准：95%×中证500指数收益率+5%×1年期定期存款利率（税后）		
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。		
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		
下属分级基金简称	泰达稳健	泰达进取	泰达中证500
下属分级场内简称	泰达稳健	泰达进取	泰达500
下属分级基金交易代码	150053	150054	162216
下属分级基金报告期末基金份额总额	4,010,944.00份	6,016,416.00份	42,087,921.67份
下属分级基金的风险收益特征	泰达稳健份额具有低风险、收益相对稳定的特征	泰达进取份额具有高风险、高预期收益的特征	-

§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（2015年1月1日 － 2015年3月31日）
1.本期已实现收益	11,062,165.28
2.本期利润	30,244,477.39
3.加权平均基金份额本期利润	0.5150
4.期末基金资产净值	98,048,157.88
5.期末基金份额净值	1.8814

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	38.50%	1.26%	34.26%	1.28%	4.24%	-0.02%

本基金的业绩比较基准：中证500指数收益率＊95%+1年期定期存款利率＊5%。

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

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		
刘欣	本基金基金经理	2012年8月14日	-	8	理学硕士；2007年7月至2008年12月就职于工银瑞信基金管理有限公司；2008年12月至2011年7月就职于嘉实基金管理有限公司；2011年7月加盟泰达宏利基金管理有限公司，担任产品与金融工程部高级研究员。具备8年基金从业经验，8年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
杨超	本基金基金经理	2014年10月13日	-	5	杨超先生毕业于英国威尔士斯旺西大学，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，先后担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，担任基金经理助理一职。

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公告中披露的决定日期。

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 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

2015年一季度，以创业板为代表的小盘股持续创出新高，本基金运用量化管理策略在有效复制指数收益、控制跟踪误差的基础上，积极创造了4.24%的超额收益，增厚了基金业绩。

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1.8814元，本报告期份额净值增长率为38.50%，同期业绩比较基准增长率为34.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年全年，市场运行依然延续2014年“转型”“去杠杆”“消化产能”等几个核心逻辑，整体A股的估值在乐观预期的影响下，率先于赢利的改善，随着经济转型的不断深化，个股的基本面逻辑将不断被验证或证伪，本基金将一如既往履行基金合同约定，主动控制跟踪误差并积极创造超额收益。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日出现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 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	92,395,349.10	91.34
	其中：股票	92,395,349.10	91.34
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	5,640,784.84	5.58
7	其他资产	3,117,567.59	3.08
8	合计	101,153,701.53	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	396,680.00	0.40
B	采矿业	2,995,439.00	3.06
C	制造业	48,597,233.50	49.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,841,100.24	1.88
E	建筑业	1,431,708.48	1.46
F	批发和零售业	5,115,585.12	5.22
G	交通运输、仓储和邮政业	2,415,485.26	2.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,028,087.56	7.17
J	金融业	2,221,730.00	2.27
K	房地产业	7,783,618.30	7.94
L	租赁和商务服务业	1,533,412.00	1.56
M	科学研究和技术服务业	805,632.03	0.82
N	水利、环境和公共设施管理业	638,170.90	0.65
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	1,144,788.29	1.17
S	综合	671,709.72	0.69
	合计	84,620,380.40	86.30

5.2.2 报告期末积极投资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	采掘业	836,349.00	0.85
C	制造业	4,984,732.70	5.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	365,986.00	0.37
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	59,432.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	160,856.00	0.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	566,235.00	0.58
J	金融业	471,906.00	0.48
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	329,472.00	0.34
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	7,774,968.70	7.93

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

5.3.1 报告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

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	000671	阳光城	79,501	1,594,790.06	1.63
2	600162	香江控股	162,867	1,530,949.80	1.56
3	300059	东方财富	34,860	1,450,176.00	1.48
4	600195	中牧股份	67,900	1,440,838.00	1.47
5	600376	首开股份	120,108	1,432,888.44	1.46
6	002249	大洋电机	148,402	1,421,691.16	1.45
7	002317	众生药业	54,085	1,378,626.65	1.41
8	600351	亚宝药业	104,448	1,292,021.76	1.32
9	000712	锦龙股份	31,900	1,262,602.00	1.29
10	000758	中色股份	59,900	1,211,777.00	1.24

5.3.2 报告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

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	002427	尤夫股份	77,410	1,259,460.70	1.28
2	300219	鸿利光电	45,600	882,360.00	0.90
3	601857	中国石油	71,300	836,349.00	0.85
4	000821	京山轻机	49,900	787,422.00	0.80
5	002202	金风科技	40,100	764,306.00	0.78

5.4 报告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。

5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金没有投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	60,270.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	965.95
5	应收申购款	3,056,331.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,117,567.59

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000671	阳光城	1,594,790.06	1.63	重大事项
2	300059	东方财富	1,450,176.00	1.48	重大事项
3	002249	大洋电机	1,421,691.16	1.45	重大事项
4	002317	众生药业	1,378,626.65	1.41	重大事项

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 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

项目	泰达稳健	泰达进取	泰达中证500
报告期期初基金份额总额	10,142,828.00	15,214,242.00	38,637,304.25
报告期期间基金总申购份额	-	-	6,006,261.07
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-	19,079,527.47
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-6,131,884.00	-9,197,826.00	16,523,883.82
报告期期末基金份额总额	4,010,944.00	6,016,416.00	42,087,921.67

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金的管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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中证500指数分级证券投资基金设立的文件；

2、《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金合同》；

3、《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金招募说明书》；

4、《泰达宏利中证500指数分级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
2015年4月22日

泰达宏利集利债券型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2015年4月22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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年4月20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2015年1月1日至2015年3月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利集利债券	
交易代码	162210	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年9月26日	
报告期末基金份额总额	786,403,616.15份	
投资目标	在有效控制风险及保持流动性基础上，力求实现基金财产稳定的当期收益和长期增值的综合目标。	
投资策略	（1）战略性资产配置策略：根据信心度对风险进行预估和分配，从而决定资产的分配。（2）固定收益类品种投资策略：利率预期分析策略形成对未来市场利率变动方向的预期；凸性挖掘策略形成对收益率曲线形状变化的预期判断；信用分析策略对发债企业进行深入的信用及财务分析；对于含权债券，波动性交易策略对其所隐含的期权进行合理定价，并根据其价格的波动水平获得该债券的期权调整利差；（3）股票投资策略：新股申购策略根据股票市场整体估值水平，发行定价水平及一级市场资金供求及资金成本关系，制定相应的新股认购策略；二级市场股票投资策略主要关注具有持续分红能力特征的优质上市企业，在符合基金整体资产配置及本基金整体投资风格的前提下，采用“自下而上”的个股精选策略。（4）权证投资策略：依据现代金融投资理论，计算权证的理论价值，结合对权证标的证券的基本面进行分析，评估权证投资价值。	
业绩比较基准	90%×上证国债指数收益率+10%×中证红利指数收益率。	
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	泰达宏利集利债券A	泰达宏利集利债券C
下属分级基金的交易代码	162210	162299
报告期末下属分级基金的份额总额	272,335,914.40份	514,067,701.75份
下属分级基金的风险收益特征	集利A属于具有较低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。	集利C属于具有较低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

§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（2015年1月1日 － 2015年3月31日）	
	泰达宏利集利债券A	泰达宏利集利债券C
1.本期已实现收益	33,563,576.56	38,834,187.07
2.本期利润	18,847,721.75	20,262,704.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.0596	0.0534
4.期末基金资产净值	367,128,676.60	670,968,383.11
5.期末基金份额净值	1.3481	1.3052

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

泰达宏利集利债券A

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	5.58%	0.86%	3.43%	0.18%	2.15%	0.68%

泰达宏利集利债券C

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	5.47%	0.86%	3.43%	0.18%	2.04%	0.68%

本基金业绩比较基准：90%×上证国债指数收益率+10%×中证红利指数收益率

本基金采用上证国债指数及中证红利指数衡量基金的投资业绩，其主要原因如下：

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。

中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市、现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的股票作为样本股，综合反映沪深证券市场高股息股票的整体状况和走势。

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

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		
卓若伟	本基金基金经理，固定收益部总经理	2012年5月22日	-	10	经济学硕士，毕业于厦门大学计统系；2004年7月至2006年9月任职于厦门市商业银行资金营运部，从事债券交易与研究工作；2006年10月至2009年5月就职于建信基金管理有限公司专户投资部任投资经理；2009年5月起就职于诺安基金管理有限公司，任基金经理助理；2009年9月至2011年12月任诺安增利债券型证券投资基金基金经理；2011年12月加入泰达宏利基金管理有限公司，任固定收益部副总经理；2013年7月5日至今担任泰达宏利基金管理有限公司固定收益部总经理；具备10年基金从业经验，具有基金从业资格。
熊壮	本基金基金经理	2013年5月27日	-	7	金融学硕士；2008年7月至2012年11月任职于中国国际金融有限公司固定收益部，从事债券研究与投资交易工作；2012年11月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任固定收益部基金经理助理；具备7年证券投资管理经验，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公告中披露的决定日期。

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 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

1季度，美国经济数据走软，美联储态度较市场预期鸽派，加息时点有可能延后。欧洲经济在量化宽松之后略有好转。

国内经济继续疲软。工业增加值、消费、制造业投资增速进一步下滑，房地产销售再次出现下滑，降准降息作用不明显，政府进一步采取了降低首付比例、缩短营业税免征期等措施，支持居民自住和改善性住房需求，稳定房地产市场。受内需不足影响，进口跌幅扩大。食品涨幅低于季节性，居民消费价格指数CPI同比增速继续下降，PPI同比跌幅扩大。表外融资低迷，但贷款数据好转，M2企稳，可能跟地方政府融资平台清理有关，值得关注。

针对经济增长、通胀均出现下滑的局面，央行采取了全面降息、降准等措施，多次下调逆回购利率，继续采用逆回购，中期借贷便利MLF来提供流动性，以期降低社会融资成本和提振经济，但央行仍然表示稳健货币政策取向不会改变。受IPO、春节因素影响，1季度资金利率中枢同比、环比反而出现上升。

债券市场震荡剧烈，1、2月因经济不佳，央行降准降息，债市收益率大幅下行，但3月份受地方政府债置换、地产政策放松等影响又大幅反弹。全季来看，利率债和高等级债券收益率上行，中低等级信用债收益率下行，收益率曲线略有变陡。虽然经济低迷，但股市在货币、财政、地产等各种利好政策作用下继续上涨。

报告期内，我们认为，基本面对债市仍然有利，收益率大幅上行风险不大，但收益率曲线过于平坦，中长期债券对利好反应较为充分，风险增加，我们适当降低了债券杠杆和久期，主要持有信用债，以获取票息为主，较好地规避了利率反弹的风险。从资产轮动的角度考虑，在去年下半年以来的股市上涨行情中，我们维持了适度的转债和股票仓位，积极参与权益类行情，由于大类资产配置策略基本符合市场节奏，报告期内获得了相对满意的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

集利基金A

截止报告期末，本基金份额净值为1.3481元，本报告期份额净值增长率为5.58%，同期业绩比较基准增长率为3.43%。

集利基金C

截止报告期末，本基金份额净值为1.3052元，本报告期份额净值增长率为5.47%，同期业绩比较基准增长率为3.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2季度，美元升值可能抑制美国贸易数据，但美国经济可能仍将平稳增长。欧洲经济在量化宽松和欧元贬值的作用下有望维持复苏势头，中国出口将较为稳定。消费实际增速在“双十一”影响消退后有望保持平稳。降准降息、房地产放松政策可能会在2季度慢慢产生效果，投资增速下滑有望趋缓，但经济整体有可能仍将低位运行。通胀预计略高于1季度水平。央行货币政策名义上保持中性稳健，但针对经济疲弱，可能仍会采取适度宽松措施。

综上，2季度基本面对债市仍然有利，但宽货币逐步转为宽信贷、房地产和财政政策逐步发力、猪价等食品价格上涨是否持续的风险需要关注。目前收益率曲线仍较平坦，随着回购利率下行，未来可能会逐步陡峭化。利率市场化将抬高银行负债成本，银行资产配置可能转向收益率更高的资产，信用利差有可能会进一步压缩，但信用风险值得重视。未来我们将适当控制杠杆和久期，以信用债为主要投资品种，在经济不景气的情况下，防范好信用风险。股市经过前期大幅上涨，估值分化明显，震荡风险加大，我们对股票和可转债的投资将更为灵活，加强波段操作。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日出现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 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	204,700,923.15	17.17
	其中：股票	204,700,923.15	17.17
2	固定收益投资	948,960,820.62	79.58
	其中：债券	948,960,820.62	79.58
	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	13,923,118.88	1.17
7	其他资产	24,823,404.77	2.08
8	合计	1,192,408,267.42	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	143,178,194.00	13.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	27,650.00	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	8,041,029.21	0.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,280.00	0.00
J	金融业	24,254,341.94	2.34
K	房地产业	29,191,428.00	2.81
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	-	-
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	204,700,923.15	19.72

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	600219	南山铝业	7,507,150	81,227,363.00	7.82
2	000024	招商地产	886,200	29,191,428.00	2.81
3	002521	齐峰新材	1,918,764	26,881,883.64	2.59
4	600802	福建水泥	2,132,376	24,756,885.36	2.38
5	600109	国金证券	949,661	24,254,341.94	2.34
6	002408	齐翔腾达	500,100	10,312,062.00	0.99
7	600106	重庆路桥	1,076,443	8,041,029.21	0.77
8	603030	全筑股份	1,000	27,650.00	0.00
9	300431	暴风科技	500	8,280.00	0.00

注：以上为本基金本报告期末持有的全部股票投资。

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	212,351,800.00	20.46
	其中：政策性金融债	212,351,800.00	20.46
4	企业债券	278,458,212.40	26.82
5	企业短期融资券	159,948,000.00	15.41
6	中期票据	118,592,000.00	11.42
7	可转债	179,610,808.22	17.30
8	其他	-	-
9	合计	948,960,820.62	91.41

5.5 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

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	110023	民生转债	590,660	81,079,898.20	7.81
2	140207	14国开07	800,000	80,024,000.00	7.71
3	140429	14农发29	700,000	70,021,000.00	6.75
4	124432	13襄建投	600,000	62,064,000.00	5.98
5	124029	12玉城投	500,010	50,621,012.40	4.88

5.6 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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

本报告期本基金没有投资国债期货。

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	511,550.31
2	应收证券清算款	5,448,987.00
3	应收股利	-
4	应收利息	17,759,703.85
5	应收申购款	1,103,163.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,823,404.77

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	110023	民生转债	81,079,898.20	7.81
2	128005	齐翔转债	47,057,551.22	4.53
3	128008	齐峰转债	26,797,973.60	2.58
4	110028	冠城转债	24,675,385.20	2.38

5.10.5 报告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

项目	泰达宏利集利债券A	泰达宏利集利债券C
报告期期初基金份额总额	351,784,884.24	407,757,353.86
报告期期间基金总申购份额	106,029,928.59	293,246,998.49
减：报告期期间基金总赎回份额	185,478,898.43	186,936,650.60
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	272,335,914.40	514,067,701.75

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,987,015.58
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,987,015.58
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.27

本基金的管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金新增投资本基金。

§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集利债券型证券投资基金设立的文件；

2、《泰达宏利集利债券型证券投资基金基金合同》；

3、《泰达宏利集利债券型证券投资基金招募说明书》；

4、《泰达宏利集利债券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
2015年4月22日