泰达宏利信用合利定期开放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	泰达信用合利债券	
交易代码	000026	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年3月19日	
报告期末基金份额总额	937,309,531.67份	
投资目标	在追求基金资产安全的前提下，力争创造高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	封闭期内，本基金的固定收益类资产投资将主要采取信用策略，同时辅之以目标久期调整策略、收益率曲线策略、信用利差配置策略等，并且对于可转债、资产支持证券等特殊债券品种将采用针对性投资策略；开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。	
业绩比较基准	人民银行一年期银行定期存款基准利率税后收益率*1.2	
风险收益特征	本基金为纯债基金，属于证券市场中的较低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	泰达信用合利债券A	泰达信用合利债券B
下属分级基金的交易代码	000026	000027
报告期末下属分级基金的份额总额	916,373,622.85份	20,935,908.82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）	
	泰达信用合利债券A	泰达信用合利债券B
1.本期已实现收益	57,250,261.71	1,295,772.87
2.本期利润	28,307,981.78	631,919.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.0309	0.0302
4.期末基金资产净值	1,044,421,042.91	23,950,635.62
5.期末基金份额净值	1.140	1.144

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

泰达信用合利债券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	2.80%	0.18%	0.78%	0.01%	2.02%	0.17%

泰达信用合利债券B

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	2.69%	0.18%	0.78%	0.01%	1.91%	0.17%

注：本基金业绩比较基准：人民银行一年期银行定期存款基准利率收益率（税后）*1.2

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	2013年3月19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，担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。
胡振仓	本基金基金经理	2013年3月19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。

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，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1季度，美国经济总体弱于预期，但与欧洲黑天鹅频出及除德国之外疲弱的欧洲经济相比，支撑了强势美元。1季度美元指数最高上到100.4020，创了2003年以来的新高。美元大幅升值使得包括人民币在内大部分非美元货币承受较大的贬值压力。从国内经济看，GDP继续维持中高增速，PPI和CPI均大幅低于预期。政策上除放松了房地产政策和进一步增加财政支出之外，货币政策全面放松的迹象也比较明显，2月份全面降准，3月份再次降息，同时央行多次下调了公开市场逆回购利率。

总体而言1季度前期受益于政策宽松预期和短期供需结构改善等因素影响，债券收益率大幅下行，透支了部分政策预期。中长期利率债收益率创出近期新低，中低等级信用债收益率也基本回到中国证券登记结算公司发布《关于加强企业债券回购风险管理相关措施的通知》之前的水平，而短债则由于资金面阶段性紧张，维持相对较高的水平。1季度后期，中长期利率债收益率上行较为明显，相比前期低点收益率上行超过60bp。转债受益于股市的大幅上涨，在债券资产中表现最优，转债有所分化。

操作上，1季度本基金总体策略以降低久期和杠杆为主。在1季度收益率下降和转债上涨过程中，减持较多的中长期信用债，同时减持了部分转债，目前本基金杠杆较低，久期适中。转债操作上，由于对股市上涨估计不足，前期减持较多转债，错失了一些投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

信用合利A

截止报告期末，本基金份额净值为1.140元，本报告期份额净值增长率为2.80%，同期业绩比较基准增长率为0.78%。

信用合利B

截止报告期末，本基金份额净值为1.144元，本报告期份额净值增长率为2.69%，同期业绩比较基准增长率为0.78%。

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，经济低迷、通胀可控，货币政策继续维持定向宽松的可能性较大，债券面临区间波动的可能性较大。短期看，地方政府债务置换导致的地方政府一般债券和专项债券供给大增，而且可能面向市场发行成为影响债券市场一大主导因素。其次需密切关注居民、银行理财等主体大类资产配置的转变对传统债券资产的分流，同时关注IPO供给可能加剧短期资金波动的风险。

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	16,617,194.14	1.55
	其中：股票	16,617,194.14	1.55
2	固定收益投资	555,239,896.40	51.91
	其中：债券	555,239,896.40	51.91
	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	294,000,881.00	27.49
	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	183,103,314.85	17.12
7	其他资产	20,652,747.64	1.93
8	合计	1,069,614,034.03	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	4,881,194.14	0.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	-	-
J	金融业	11,736,000.00	1.10
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	-	-
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	16,617,194.14	1.56

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	601318	中国平安	150,000	11,736,000.00	1.10
2	600219	南山铝业	451,127	4,881,194.14	0.46

注：上述股票明细为本基金本报告期末持有的全部股票。

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	181,780,366.40	17.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	324,223,000.00	30.35
7	可转债	49,236,530.00	4.61
8	其他	-	-
9	合计	555,239,896.40	51.97

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	101455002	14汉城投MTN001	500,000	56,460,000.00	5.28
2	1480245	14马城投债	500,000	52,675,000.00	4.93
3	101462008	14绵阳投控MTN002	500,000	52,500,000.00	4.91
4	101462015	14鄂西圈MTN001	500,000	51,625,000.00	4.83
5	101461018	14株城发MTN001	500,000	51,495,000.00	4.82

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

报告期内本基金投资的中国平安（601318），根据2014年12月8日中国证券监督管理委员会发布对该公司控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）的《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》〔2014〕103号，决定对平安证券给予警告，没收海联讯保荐业务收入400万元，没收承销股票违法所得2,867万元，并处以440万元罚款；同时对保荐人韩长风、霍永涛给予警告，并分别处以30万元罚款，撤销证券从业资格。

本基金管理人对该上市公司的投资经过内部严格的投资决策流程。在上述公告公布后，本基金管理人对该上市公司进行了进一步了解和分析，认为上述处罚措施不会对该上市公司的投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对该上市公司的投资判断未发生改变。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	176,401.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,476,346.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,652,747.64

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不存在流通受限情况。

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	泰达信用合利债券A	泰达信用合利债券B
报告期期初基金份额总额	916,373,622.85	20,935,908.82
报告期期间基金总申购份额	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	916,373,622.85	20,935,908.82

§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信用合利定期开放债券型证券投资基金设立的文件；
2、《泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
3、《泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
4、《泰达宏利信用合利定期开放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

泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

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	泰达宏利财富大盘指数
交易代码	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
报告期末基金份额总额	97,351,929.66份
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分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。
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

§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	20,305,439.36
2.本期利润	12,181,398.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.1029
4.期末基金资产净值	150,710,388.45
5.期末基金份额净值	1.5481

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	9.60%	1.95%	8.94%	1.98%	0.66%	-0.03%

注：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样，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。

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

本报告期末，由于证券市场波动、基金规模变动等原因，本基金有个别投资比例未达标，但已按照基金合同的规定在10个工作日内调整达标。

§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。

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

进入2015年以来，市场分化巨大，权重股表现相对滞后，创业板连续创出新高，反映出市场给与新兴产业，互联网等经济转型行业的溢价效应，本基金在报告期内严格遵守基金合同，利用量化手段有效复制指数，力争在控制跟踪误差的前提下积极创造超额收益。

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1.5481元，本报告期份额净值增长率为9.60%，同期业绩比较基准增长率为8.94%。

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，经济转型的基本面将不断接受市场的认识，整体经济转型的方式与结构将在2015年愈发明晰，自贸区、一带一路等概念主题仍将反复发酵，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	142,166,866.62	93.26
	其中：股票	142,166,866.62	93.26
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	7,303,421.73	4.79
7	其他资产	2,969,320.71	1.95
8	合计	152,439,609.06	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	-	-
B	采矿业	5,457,447.00	3.62
C	制造业	30,077,637.28	19.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,868,738.80	2.57
E	建筑业	11,837,752.73	7.85
F	批发和零售业	1,398,196.50	0.93
G	交通运输、仓储和邮政业	4,908,507.26	3.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,799,279.92	1.19
J	金融业	58,777,953.08	39.00
K	房地产业	10,532,061.69	6.99
L	租赁和商务服务业	59,202.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,183,652.28	0.79
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	163,660.00	0.11
	合计	130,064,088.54	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	-	-
C	制造业	4,343,249.10	2.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,080,666.00	1.38
E	建筑业	474,760.00	0.32
F	批发和零售业	1,703,252.98	1.13
G	交通运输、仓储和邮政业	429,825.00	0.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	494,403.00	0.33
J	金融业	542,246.00	0.36
K	房地产业	1,217,046.00	0.81
L	租赁和商务服务业	119,776.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	697,554.00	0.46
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	12,102,778.08	8.03

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	600016	民生银行	777,450	7,541,265.00	5.00
2	600000	浦发银行	423,342	6,684,570.18	4.44
3	601668	中国建筑	774,467	5,940,161.89	3.94
4	601318	中国平安	72,873	5,701,583.52	3.78
5	600036	招商银行	331,037	5,154,246.09	3.42
6	000002	万 科A	326,402	4,510,875.64	2.99
7	601398	工商银行	853,363	4,147,344.18	2.75
8	601166	兴业银行	208,001	3,818,898.36	2.53
9	601939	建设银行	567,334	3,460,737.40	2.30
10	601818	光大银行	713,858	3,376,548.34	2.24

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	000821	京山轻机	97,800	1,543,284.00	1.02
2	002427	尤夫股份	86,930	1,414,351.10	0.94
3	000600	建投能源	85,800	1,144,572.00	0.76
4	000608	阳光股份	152,900	938,806.00	0.62
5	002039	黔源电力	53,600	871,536.00	0.58

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

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。

5.10 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

报告期内本基金投资的中国平安（601318），根据2014年12月8日中国证券监督管理委员会发布对该公司控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）的《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》〔2014〕103号，决定对平安证券给予警告，没收海联讯保荐业务收入400万元，没收承销股票违法所得2,867万元，并处以440万元罚款；同时对保荐人韩长风、霍永涛给予警告，并分别处以30万元罚款，撤销证券从业资格。

本基金管理人对该上市公司的投资经过内部严格的投资决策流程。在上述公告公布后，本基金管理人对该上市公司进行了进一步了解和分析，认为上述处罚措施不会对该上市公司的投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对该上市公司的投资判断未发生改变。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	95,896.80
2	应收证券清算款	975,914.42
3	应收股利	-
4	应收利息	1,722.81
5	应收申购款	1,895,786.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,969,320.71

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

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。

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

报告期期初基金份额总额	126,131,285.68
报告期期间基金总申购份额	40,633,319.99
减：报告期期间基金总赎回份额	69,412,676.01
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	97,351,929.66

§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财富大盘指数证券投资基金设立的文件；
2、《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》；
3、《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金招募说明书》；
4、《泰达宏利中证财富大盘指数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

泰达宏利首选企业股票型证券投资基金

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	泰达宏利首选企业股票
交易代码	162208
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年12月1日
报告期末基金份额总额	594,987,600.61份
投资目标	集中投资于行业中的首选企业，分享中国经济的高速增长和自主创新，力争获取长期稳定的资本增值。
投资策略	本基金投资于各个行业中的首选企业并集中持有，充分分享各个首选企业在行业中的优势所带来的超额回报。本基金采用灵活配置和自下而上相结合的投资管理模式，挑选出当前景气行业（如果行业内部差异性较大，将对行业进行进一步细分），借助泰达宏利首选企业评级标准，挑选出各行业中的首选企业，构建股票投资组合。原则上，从每个细分行业中挑选出来的企业不超过三家。
业绩比较基准	90%×富时中国A200指数收益率+10%×同业存款利率。
风险收益特征	本基金属于高风险的证券投资基金，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	中国农业银行股份有限公司

§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（2015年1月1日－2015年3月31日）
1.本期已实现收益	107,500,074.88
2.本期利润	275,860,876.93
3.加权平均基金份额本期利润	0.4386
4.期末基金资产净值	1,127,234,012.67
5.期末基金份额净值	1.8946

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	30.71%	1.70%	10.82%	1.75%	19.89%	-0.05%

本基金的业绩比较基准：90%×富时中国A200指数收益率+10%×同业存款利率。

富时中国A200指数是富时指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所总市值最大的200只股票并以流通股本加权的股票指数，具有良好的市场代表性。因此，本基金选择富时中国A200指数衡量股票投资部分的业绩。

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		
张勋	本基金基金经理	2014年11月21日	-	9	张勋先生毕业于对外经济贸易大学，管理学硕士。2006年7月至2009年6月就职于天相投资顾问有限公司，负责交运行业研究，担任研究大组组长；2009年7月至2010年4月，就职于东兴证券股份有限责任公司，负责交运行业研究，担任研究大组组长；2010年4月加盟泰达宏利基金管理有限公司，负责农业、旅游、交运、轻工研究，历任研究员、高级研究员。

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

虽然有去年4季度的降息打底、并且1季度进一步降准，但国内经济总体偏软的格局依然没有改变，从1季度经济数据来看，PPI、工业增加值均不理想，通缩压力加大。在此背景下，一路一带、互联网+、国企改革、自贸区等助力中国经济转型的战略性布局逐步展开，并在各个层面达成一致意见，转型力度、决心及带来的民众信心空前高涨。从国际形势来看，大宗商品在美元强势下继续保持弱势格局，新兴国家经济面临挑战，发达国家经济平稳运行，去年焦点的地缘政治格局在表象上暂时被经济问题困扰所替代。受上述因素影响，A股市场1季度并没有像之前市场预期的大盘股风格为主，反而是以代表新兴经济的各种“互联网+”板块表现最为抢眼。

整体来看，1季度上证指数上涨1.03%，深成指上涨1.1%，大小盘风格再度切换，小盘股风格显著跑赢大盘股风格，与年初市场的预期显著相左。从板块表现来看，市场体现为典型的牛市格局，除银行、非银金融和食品饮料板块外，其他板块整体收益较高，尤其代表新经济或者向新经济转型的TMT、纺织轻工等板块，更是取得超过50%的板块涨幅。

操作上，本基金1季度改变策略，从去年4季度的以大盘蓝筹为主调整为均衡配置，减仓以金融为代表的大蓝筹板块，以追求个股阿尔法投资为操作原则，在各个细分板块配置具备成长能力和催化剂的个股（包括但不限于改革预期、转型预期、成长预期等），适度加仓医药、电气设备、传统行业触网等配置。

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1.8946元，本报告期份额净值增长率为30.71%，同期业绩比较基准增长率为10.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们预计从中线视角看，以下几个方面不会发生太大的变化：1）经济整体走势不会太好，从“保增长”到“稳增长”的高层表述代表了趋势；2）货币释放带来的流动性仍将继续；3）居民财富搬家棋到中盘，未来仍将继续；4）中国资本市场继续转型，成为鼓励新经济发展的重要阵地。

从未来配置的角度看，中国目前正处在从大国向强国迈进的关键阶段，进一步“改善生产关系”和“改善生产力”将是中国当前面临的最大任务，落实到投资上就是“互联网+”、“国企改革”、“工业4.0”三个重要方面，这将成为未来几年A股的投资主体。A股未来最大的风险因素，一是流动性从宽松变成收缩，一是管理层对市场看法发生变化。

基于上述判断，本基金2季度基本策略是保持较高仓位，维持当前均衡配置为主的投资思路，配置上以个股阿尔法为核心策略，在选股过程中加强在国企改革、一路一带、工业4.0、互联网+等方面的权重考量。

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	1,052,653,228.66	92.38
	其中：股票	1,052,653,228.66	92.38
2	固定收益投资	59,246,232.00	5.20
	其中：债券	59,246,232.00	5.20
	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	4,104,815.50	0.36
7	其他资产	23,535,515.76	2.07
8	合计	1,139,539,791.92	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	15,033,045.84	1.33
B	采矿业	-	-
C	制造业	473,867,709.33	42.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	51,305,151.94	4.55
G	交通运输、仓储和邮政业	69,488,119.80	6.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	91,215,576.85	8.09
J	金融业	264,729,882.66	23.48
K	房地产业	57,517,979.04	5.10
L	租赁和商务服务业	20,655,056.00	1.83
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	8,840,707.20	0.78
	合计	1,052,653,228.66	93.38

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	600125	铁龙物流	5,959,530	69,488,119.80	6.16
2	000783	长江证券	3,798,670	60,322,879.60	5.35
3	300318	博晖创新	1,617,040	54,170,840.00	4.81
4	601336	新华保险	923,736	48,967,245.36	4.34
5	601688	华泰证券	1,584,769	47,717,394.59	4.23
6	300005	探路者	1,535,183	45,226,491.18	4.01
7	600153	建发股份	2,681,780	37,786,280.20	3.35
8	601166	兴业银行	1,841,700	33,813,612.00	3.00
9	000024	招商地产	1,020,566	33,617,444.04	2.98
10	600271	航天信息	639,600	33,233,616.00	2.95

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	59,246,232.00	5.26
	其中：政策性金融债	59,246,232.00	5.26
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	59,246,232.00	5.26

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	140327	14进出27	400,000	40,008,000.00	3.55
2	018001	国开1301	187,800	19,238,232.00	1.71

注：以上为本基金本报告期末持有的全部债券投资。

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	493,319.44
2	应收证券清算款	20,862,838.67
3	应收股利	-
4	应收利息	1,999,173.17
5	应收申购款	180,184.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,535,515.76

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

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	600271	航天信息	33,233,616.00	2.95	重大事项

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

报告期期初基金份额总额	654,850,093.79
报告期期间基金总申购份额	5,771,396.73
减：报告期期间基金总赎回份额	65,633,889.91
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	594,987,600.61

§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首选企业股票型证券投资基金设立的文件；
2、《泰达宏利首选企业股票型证券投资基金基金合同》；
3、《泰达宏利首选企业股票型证券投资基金招募说明书》；
4、《泰达宏利首选企业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
2015年4月22日