泰达宏利货币市场基金

2015 第三季度 报告

2015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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月24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10月22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7月1日起至2015年9月30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	3,854,010,569.31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型、混合型和债券型基金。	
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	254,684,736.07份	3,599,325,833.24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7月1日 - 2015年9月30日)	
	泰达宏利货币A	泰达宏利货币B
1. 本期已实现收益	2,292,558.82	19,441,588.07
2.本期利润	2,292,558.82	19,441,588.07
3.期末基金资产净值	254,684,736.07	3,599,325,833.24

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	0.8195%	0.0054%	0.4795%	0.0003%	0.3400%	0.0051%

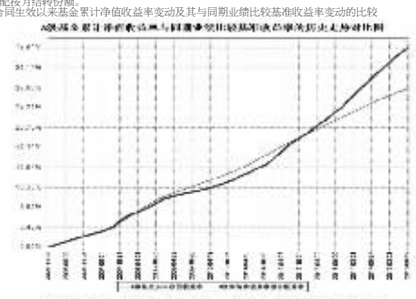
本基金收益分配按月结转份额。

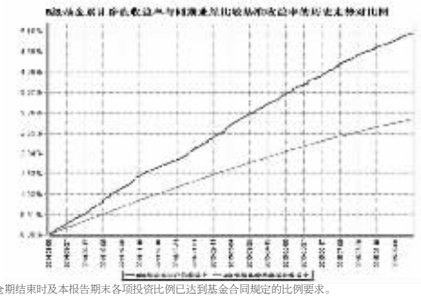
泰达宏利货币B

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	0.8802%	0.0054%	0.4795%	0.0003%	0.4007%	0.0051%

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		
丁宇佳	本基金基金经理	2015年3月26日	-	7	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2014年9月,担任固定收益部研究员,从事债券研究工作;2014年10月至2015年2月,担任固定收益部基金经理助理;具备7年基金从业经验,7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,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

三季度,海外方面,美国经济继续转好,9月美联储FOCM会议声明维持利率不变,加息预期和相关不确定性继续困扰全球市场。欧洲经济在二季度好转的基础上继续小幅上行。

国内经济仍然处于寻底阶段。生产资料价格逐步稳定,食品价格同比一度走强,但随着猪价回落整体走弱,通缩风险仍然存在。货币政策持续宽松,财政支出快速增加,但工业增速仍然较弱,投资和消费均未出现明显恢复。

股市在上半年连续上涨后出现大幅调整,管理层出台多项重大救市举措,投资者避险情绪上升。在降准降息的宽松货币政策环境下,债券收益率再次回到年初的低点,评级利差继续收窄。

报告期内,债券方面,我们维持适度的杠杆和久期,继续以信用债投资为主。股票市场方面,经过剧烈下跌后,股市估值水平大幅下降,不少公司股票甚至跌破净资产价格,我们在报告期以低仓位适度参与股市投资,提高了组合回报。

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1.4861元,本报告期份额净值增长率为2.22%,同期业绩比较基准增长率为-1.94%。

集利基金C

截止报告期末,本基金份额净值为1.4361元,本报告期份额净值增长率为2.12%,同期业绩比较基准增长率为-1.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国际经济方面,受金融市场动荡影响,三季度美联储未采取加息措施,但如果美国经济维持向好趋势,不排除四季度美联储加息可能。

国内经济仍将继续寻底,货币政策将维持平稳宽松,财政方面,可能加大通过国家开发银行的投资支出。总体看政策上仍然会积极对冲经济下行风险,但更多的起到托底作用。

四季度,在经济放缓背景下,企业信用风险继续上行,如果货币政策继续维持宽松,债券收益率仍将低位徘徊,因此,下一季度我们将在做好信用风险防范前提下,债券投资继续维持适度组合久期和杠杆,同时对股市波动保持谨慎。

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	2,993,396,121.09	70.00
	其中:债券	2,993,396,121.09	70.00
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	460,001,450.00	10.76
	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	791,619,913.80	18.51
4	其他资产	31,308,731.19	0.73
5	合计	4,276,326,216.08	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		15.87
	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	414,999,392.50	10.77
	其中:买断式回购融资	-	-

注:1.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

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	143
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	150
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	111

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	21.84	10.77
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	11.40	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.77	-
3	60天(含)-90天	7.00	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	28.90	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	40.99	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	110.15	10.77

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	49,828,376.70	1.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	329,287,516.73	8.54
	其中:政策性金融债	329,287,516.73	8.54
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,170,834,167.14	56.33
6	中期票据	50,083,643.16	1.30
7	同业存单	393,362,417.36	10.21
8	其他	-	-
9	合计	2,993,396,121.09	77.67
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	29,633,230.51	0.77

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	111510314	15兴业CD314	2,000,000	196,707,356.83	5.10
2	111509220	15浦发CD220	2,000,000	196,655,060.53	5.10
3	041560053	15贵州高速CP001	1,800,000	180,368,515.41	4.68
4	041563006	15首钢CP001	1,000,000	100,239,072.57	2.60
5	071502007	15国泰君安CP007	1,000,000	99,978,603.21	2.59
6	011514006	15中粮SCP006	1,000,000	99,957,022.96	2.59
7	011599710	15厦国贸SCP008	1,000,000	99,955,237.79	2.59
8	011586009	15光明SCP009	1,000,000	99,951,189.96	2.59
9	150416	15农发16	1,000,000	99,924,802.86	2.59
10	011530003	15中海运SCP003	1,000,000	99,923,633.86	2.59

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	64
报告期内偏离度的最高值	0.4111%
报告期内偏离度的最低值	0.2477%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.3301%

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本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	31,292,131.19
4	应收申购款	1,600.00
5	其他应收款	15,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	31,308,731.19

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	189,071,303.69	1,518,292,907.41
报告期期间基金总申购份额	641,683,034.26	4,310,898,349.70
减:报告期期间基金总赎回份额	576,069,601.88	2,229,865,423.87
报告期期末基金份额总额	254,684,736.07	3,599,325,833.24

§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 影响投资者决策的其他重要信息

本公司于2015年8月15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》,聘任刘建先生为公司总经理。

§9 备查文件目录

9.1 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》。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 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10月24日

泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月24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10月22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7月1日至2015年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达转型机遇股票
交易代码	000828
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年11月18日
报告期末基金份额总额	159,313,975.90份
投资目标	在严控风险的基础上,通过积极、主动的管理,深度挖掘中国经济转型中产生的各类投资机遇,力争为投资者获取超越绩比较基准的收益。
投资策略	以中国经济转型过程中产生的各类投资机遇作为主线,并通过"自上而下"和"自下而上"相结合的方法构建基金资产组合。一方面,本基金在对国内外宏观经济发展趋势、相关政策深入研究的基础上,从"自上而下"的角度对大类资产进行优化配置,并优选受益行业;另一方面,本基金凭借多年来不断积累形成的选股框架,从商业模式、市场前景、竞争壁垒、财务状况等方面出发,以"自下而上"的视角精选出具有长期竞争力和增长潜力的优质公司,力求在抵御各类风险的前提下获取超越平均水平的良好回报。
业绩比较基准	85%×中证800指数收益率+15%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中的高风险品种,其长期预期收益及预期风险均高于混合型、债券型和货币基金
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7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-52,206,282.89
2.本期利润	-70,088,718.19
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4142
4.期末基金资产净值	128,997,166.86
5.期末基金份额净值	0.810

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	-31.06%	3.87%	-24.84%	2.90%	-6.22%	0.97%

本基金业绩比较基准:中证800指数收益率*85%+中证综合债指数收益率*15%

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

本基金成立于2014年11月18日,截止报告期末本基金成立不满一年,按基金合同规定,自基金合同生效日起六个月内为建仓期。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		
吴华	本基金基金经理	2014年11月18日	-	11	金融学硕士;2004年6月至2006年3月就职于易方达基金管理有限公司,担任宏观策略分析员职务;2006年4月至2011年4月就职于中国国际金融有限公司,先后就职于研究部、资产管理部、担任经理、副总经理等职位;2011年5月加入泰达宏利基金管理有限公司,担任研究部首席策略师;2013年9月至今担任国际投资部副总经理兼首席策略分析师;具备11年证券从业经验,11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 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

国内经济仍然处于寻底阶段。生产资料价格逐步稳定,食品价格同比一度走强,但随着猪价回落整体走弱,通缩风险仍然存在。货币政策持续宽松,财政支出快速增加,但工业增速仍然较弱,投资和消费均未出现明显恢复。

股市在上半年连续上涨后出现大幅调整,管理层出台多项重大救市举措,投资者避险情绪上升。在降准降息的宽松货币政策环境下,债券收益率再次回到年初的低点,评级利差继续收窄。

报告期内,债券方面,我们维持适度的杠杆和久期,继续以信用债投资为主。股票市场方面,经过剧烈下跌后,股市估值水平大幅下降,不少公司股票甚至跌破净资产价格,我们在报告期以低仓位适度参与股市投资,提高了组合回报。

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0.810元,本报告期份额净值增长率为-31.06%,同期业绩比较基准增长率为-24.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场的两轮下跌主要有如下几个原因:1)人民币汇率形成机制的改革引发了人民币大幅度贬值和资本外流的预期。2)预期美联储加息会引发中国经济更大的风险。3)监管部门清理伞型信托等配资工具。4)担忧货币政策和财政政策会滞后于形势。5)一个长期的因素是经济增速的持续下行。

到目前为止,这几个因素都有改善。1)资本外流的速度受到明显抑制,美国和中国签订货币互换协议会增强人民币币值的稳定性。2)考虑到中国金融市场政策对金融的影响,美联储暂缓加息。美国的态度很合作,避免了人民币币值失控性贬值的可能性。3)监管部门清理配资的工作采取了"一刀切的方式,并且整体清理已经进入尾声,对市场的负向影响已经不大。4)央行及时降准降息。流动性宽松的格局得以维持,未来基建投资力度也可能加大,不利因素是,经济下行的趋势并没有改变。

综合来看,短期市场下跌的因素大部分消失。市场有望结束大幅度下跌的格局。但经济下滑的趋势并没有扭转,所以市场的风险偏好很难在短期内明显提升。虽然不排除市场可能因为前期下跌太多后出现反弹,但中期趋势依然不明朗,但市场经历了两轮大幅度的调整后,市场的风险已经得到较大的释放,部分股票已经出现了一定的投资价值。基于此,本基金投资计划以长线的投资眼光和长期持有的操作来审视市场的机会。本基金倾向于考虑具有如下特征的投资标的:1)行业景气度持续改善。2)公司质地优选;3)有业绩支撑,估值合理。如果悲观国企改革和资产注入等预期,估值要求可以适度放宽。行业上看好医药、新能源汽车、军工、农业和数字营销。

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)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	117,084,355.90	88.25
	其中:股票	117,084,355.90	88.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,067,000.00	7.59
	其中:债券	10,067,000.00	7.59
	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	1,544,647.89	1.16
8	其他资产	3,982,858.25	3.00
9	合计	132,678,862.04	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	5,121,439.00	3.97
B	采矿业	-	-
C	制造业	80,245,204.46	62.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,588,469.00	2.01
E	建筑业	8,948,545.90	6.94
F	批发和零售业	10,077,965.72	7.81
G	交通运输、仓储和邮政业	2,235,144.60	1.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,222,822.22	4.05
J	金融业	999,649.00	0.77
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	1,645,116.00	1.28
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	117,084,355.90	90.77

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	603111	康尼机电	459,771	12,243,701.73	9.49
2	000858	五粮液	342,190	7,411,835.40	5.75
3	002339	积成电子	385,480	6,942,494.80	5.38
4	000090	天健集团	454,714	6,525,145.90	5.06
5	603456	九洲药业	128,678	6,118,638.90	4.74
6	600372	中航电子	269,800	5,986,862.00	4.64
7	600276	恒瑞医药	116,436	5,378,178.84	4.17
8	002358	森源电气	414,462	5,350,704.42	4.15
9	600050	中国联通	869,022	5,222,822.22	4.05
10	600038	中直股份	93,831	3,983,125.95	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,067,000.00	7.80
	其中:政策性金融债	10,067,000.00	7.80
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,067,000.00	7.80

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	150206	15国开06	100,000	10,067,000.00	7.80

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

本基金本报告期末投资于国债期货。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

本基金本报告期没有投资国债期货。

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,在报告编制日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	1,131,634.96
2	应收证券清算款	2,657,028.69
3	应收股利	-
4	应收利息	191,707.85
5	应收申购款	2,486.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,982,858.25

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	000858	五粮液	7,411,835.40	5.75	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

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	314,656,889.31	581,556,414.54
报告期期间基金总申购份额	114,310,137.89	315,536,193.85
减:报告期期间基金总赎回份额	168,936,292.06	512,755,360.63
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	260,030,735.14	384,337,247.76

§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 影响投资者决策的其他重要信息

本公司于2015年8月15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》,聘任刘建先生为公司总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金设立的文件;
2、《泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金基金合同》;
3、《泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金招募说明书》;
4、《泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金托管协议》。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 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10月24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10月24日

泰达宏利集利债券型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30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10月22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7月1日至2015年9月30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	644,367,982.90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