泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金

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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	泰达宏利成长混合
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	689,307,506.60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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-511,881,528.65
2.本期利润	-359,039,885.07
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5220
4.期末基金资产净值	942,743,400.60
5.期末基金份额净值	1.3677

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

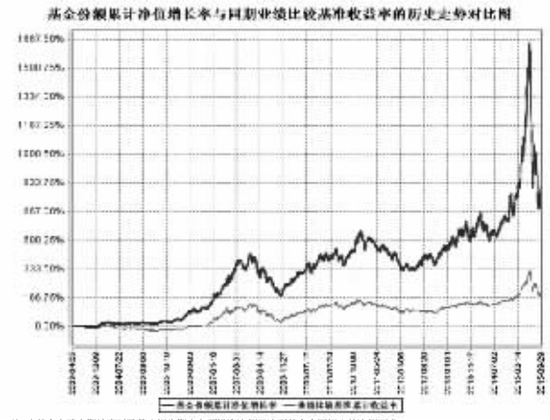
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-27.75%	3.87%	-19.79%	2.32%	-7.96%	1.55%

本基金业绩比较基准:65%×富时中国A600成长行业指数+35%×上证国债指数。

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成长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,全面体现成长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		
周瑞凯	本基金基金经理	2015年5月14日	-	5	2010年7月加入泰达宏利基金管理有限公司,任职于研究部,负责建筑建材、传媒互联网行业研究,曾先后担任助理研究员、研究员、高级研究员等职务;5年证券从业经验,5年证券投资管理经验,具有基金从业资格。
邓艺颖	本基金基金经理	2015年8月11日	-	10	金融学硕士;2004年5月至2005年4月就职于中国工商银行广东省分行公司业务部;2005年4月加盟泰达宏利基金管理有限公司,先后担任交易部交易员、固定收益部研究员、研究部总监业务助理兼研究员、研究部副总监;具备10年基金从业经验,10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业绩分析

2015年三季度,股票市场呈现持续大幅度的调整,7、8月下跌幅度均超过10%,9月下跌幅度有所放缓。核心的驱动因素在于大量的杠杆资金包括场外配资和场内融资呈现持续的净流出,一度在7月份引发了整体市场的流动性风险;后续国家队及时出手化解了流动性风险,但由于前期市场积累的估值泡沫过大、叠加汇率市场的波动,市场在国家队救市后仍呈现了趋势性的下跌。

本基金在操作中,尽管及时进行了减仓和调仓操作,但受仓位下限的影响整体净值仍遭受了较大幅度的回撤。

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1.3677元,本报告期份额净值增长率为-27.75%,同期业绩比较基准增长率为-19.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,市场在经过三季度大幅去杠杆和去泡沫以后,整体流动性环境及投资者风险偏好都将处于相对均衡的状态,继续大幅下行的风险不大;但考虑到整体经济仍处于下行的趋势、大部分行业的盈利增长仍面临压力,我们看好市场的结构性机会。

本基金将兼顾流动性和确定性,重点布局三方面的投资机会:1.雾霾治理;2.技术进步带来的行业机会,比如精准医疗等;3.政策和政策红利,比如国企改革和十三五规划等。

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	权益投资	703,576,238.18	70.41
	其中:股票	703,576,238.18	70.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	201,810,000.00	20.20
	其中:债券	201,810,000.00	20.20
	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	64,706,092.08	6.48
8	其他资产	29,108,456.66	2.91
9	合计	999,200,786.92	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	407,002,712.19	43.17
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	62,042,413.44	6.58
G	交通运输、仓储和邮政业	45,600,994.47	4.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	130,688,994.17	13.86
J	金融业	-	-
K	房地产业	22,460,492.21	2.38
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	35,780,631.70	3.80
S	综合	-	-
	合计	703,576,238.18	74.63

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	300207	欣旺达	2,812,178	70,248,206.44	7.45
2	002407	多氟多	1,370,800	50,102,740.00	5.31
3	002594	比亚迪	827,012	49,628,990.12	5.26
4	300016	北陆药业	1,736,600	46,454,050.00	4.93
5	002462	嘉事堂	1,265,208	46,407,829.44	4.92
6	300171	东富龙	2,272,055	45,872,790.45	4.87
7	600446	金证股份	1,644,411	41,784,483.51	4.43
8	000802	北京文化	1,562,473	35,780,631.70	3.80
9	000917	电广传媒	1,702,243	32,853,289.90	3.48
10	300101	振芯科技	1,490,800	32,350,360.00	3.43

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	100,320,000.00	10.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	101,490,000.00	10.77
	其中:政策性金融债	101,490,000.00	10.77
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	201,810,000.00	21.41

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	140347	14进出47	500,000	51,300,000.00	5.44
2	019506	15国债06	500,000	50,220,000.00	5.33
3	150202	15国开02	500,000	50,190,000.00	5.32
4	019509	15国债09	500,000	50,100,000.00	5.31

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

本基金本报告期末投资于股指期货,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

报告期内本基金投资的欣旺达(300207)于2015年7月14日发布《关于收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告》,该公司控股股东王明旺及一致行动人新余市欣明达投资有限公司涉嫌信息披露违规、控股股东王威因减持公司股份涉嫌信息披露违规,分别收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(深证调查通字15087、15088、15089号)。欣旺达于2015年8月21日发布《中国证监会依法严厉查处上市公司大股东及实际控制人违法减持案件》公告,中国证监会拟对该上市公司的实际控制人王明旺进行处罚。

基金管理人分析认为,欣旺达7月份被监管部门立案调查的原因是实际控制人涉嫌信息披露违规,体现了该公司此前在内部管理方面存在的漏洞与不足,但公司自查及改正的态度是端正的,后续处理的情况也基本明朗,该事件不会影响公司后续经营活动的正常开展。我们判断公司本身的经营趋势向好,收入和利润持续快速增长,公司在电子产业和新能源车方向都有快速的业务成长,在前沿业务储能方面也有业务储备,公司整体呈现良好的发展态势。与此同时,公司实际控制人也在三季度持续进行了增持活动,体现了管理层对上市公司的信心。因此,基金管理人经审慎分析,在本报告期内继续保持对其的投资。

本基金投资的其余前九名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	2,248,901.88
2	应收证券清算款	23,436,282.89
3	应收股利	-
4	应收利息	2,820,373.33
5	应收申购款	602,898.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,108,456.66

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	600446	金证股份	41,784,483.51	4.43	重大事项
2	000917	电广传媒	32,853,289.90	3.48	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	641,793,140.90
报告期期间基金总申购份额	262,113,261.34
减:报告期期间基金总赎回份额	214,598,895.64
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	689,307,506.60

§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

1.本公司于2015年7月22日发布《关于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变更基金名称、基金类型以及修订基金同部分条款的公告》,基金名称由“泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金”变更为“泰达宏利价值优化型稳定类行业混合型证券投资基金”,基金简称相应变更,基金合同当事人权利义务关系未发生变化。

2.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价值优化型成长类行业混合型证券投资基金、周期类行业混合型证券投资基金、稳定类行业混合型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混合型证券投资基金、周期类行业混合型证券投资基金、稳定类行业混合型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混合型证券投资基金、周期类行业混合型证券投资基金、稳定类行业混合型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混合型证券投资基金、周期类行业混合型证券投资基金、稳定类行业混合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

泰达宏利价值优化型稳定类行业混合型证券投资基金

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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	泰达宏利稳定混合
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	124,547,608.29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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-29,067,008.44
2.本期利润	-47,679,111.06
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3750
4.期末基金资产净值	119,066,369.71
5.期末基金份额净值	0.9560

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

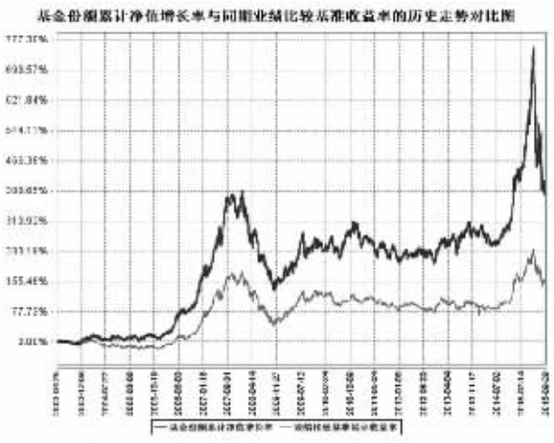
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-27.40%	3.04%	-18.26%	1.92%	-9.14%	1.12%

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



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		
陈丹琳	本基金基金经理	2014年1月6日	-	8	毕业于中国人民大学,经济学硕士,CFA、CPA;2007年7月加入泰达宏利基金管理有限公司,曾担任研究员、研究主管、研究部总经理助理等职务;具备8年证券投资管理经验,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

市场在6月份暴跌之后企稳,上证综指在3600到4000之间震荡了约一个月时间,8月中旬以后,在人民币贬值预期以及全球股市连环下跌的促发下,上证综指快速向下触及2850点后在3000到3200点区间内窄幅波动。

本基金在3季度前期重点配置了养殖股和国企改革标的,主要理由是,前期疯狂炒作故事和概念的公司未来仍将面临证伪的过程,市值和估值压缩空间很大,而养殖股和国企改革标的在景气周期、估值和催化剂方面有较好的优势。但考虑到整体市场在政策底之后有寻找市场底的过程,因此本基金整体仓位一直较低。9月中旬之后,以创业板为代表的中小盘有一波小反弹,但主题切换较快,本基金参与较少。

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0.9560元,本报告期份额净值增长率为-27.40%,同期业绩比较基准增长率为-18.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来季度,悲观的因素主要有如下三点:一是整体估值仍然偏高,不具备安全性;二是上市公司三季报低于预期的概率较大;三是宏观经济可能没有明显起色;乐观的因素是从债券市场的情况看,流动性非常宽裕,信用债利差被压到了极限,因此我们认为市场大幅下行空间不大,可能出现一些局部热点,可以在震荡区间的较低位置适当介入。

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	权益投资	73,720,661.71	61.37
	其中:股票	73,720,661.71	61.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,092,000.00	25.05
	其中:债券	30,092,000.00	25.05
	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	11,641,309.66	9.69
8	其他资产	4,668,392.87	3.89
9	合计	120,122,364.24	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	5,711,102.80	4.80
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,823,505.17	9.93
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	18,709,492.10	15.71
G	交通运输、仓储和邮政业	14,855,116.44	12.48
H	住宿和餐饮业	6,848,424.00	5.75
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,264,724.00	1.90
J	金融业	2,840,974.16	2.39
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	10,651,371.60	8.95
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	15,951.44	0.01
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	73,720,661.71	61.92

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	002183	怡亚通	163,440	7,091,661.60	5.96
2	300186	大华农	186,550	6,454,630.00	5.42
3	601919	中国远洋	663,900	5,895,432.00	4.95
4	601333	广深铁路	1,182,300	5,001,129.00	4.20
5	600058	五矿发展	183,000	4,723,230.00	3.97
6	002589	瑞康医药	129,826	4,134,958.10	3.47
7	600428	中远航运	362,300	3,956,316.00	3.32
8	000524	岭南控股	199,800	3,736,260.00	3.14
9	601933	永辉超市	358,400	3,637,760.00	3.06
10	600138	中青旅	177,100	3,559,710.00	2.99

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	10,020,000.00	8.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,072,000.00	16.86
	其中:政策性金融债	20,072,000.00	16.86
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	30,092,000.00	25.27

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	150301	15进出01	200,000	20,072,000.00	16.86
2	019509	15国债09	100,000	10,020,000.00	8.42

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

本基金本报告期末投资于股指期货,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

报告期内本基金投资的欣旺达(300207)于2015年7月14日发布《关于收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告》,该公司控股股东王明旺及一致行动人新余市欣明达投资有限公司涉嫌信息披露违规、控股股东王威因减持公司股份涉嫌信息披露违规,分别收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(深证调查通字15087、15088、15089号)。欣旺达于2015年8月21日发布《中国证监会依法严厉查处上市公司大股东及实际控制人违法减持案件》公告,中国证监会拟对该上市公司的实际控制人王明旺进行处罚。

基金管理人分析认为,欣旺达7月份被监管部门立案调查的原因是实际控制人涉嫌信息披露违规,体现了该公司此前在内部管理方面存在的漏洞与不足,但公司自查及改正的态度是端正的,后续处理的情况也基本明朗,该事件不会影响公司后续经营活动的正常开展。我们判断公司本身的经营趋势向好,收入和利润持续快速增长,公司在电子产业和新能源车方向都有快速的业务成长,在前沿业务储能方面也有业务储备,公司整体呈现良好的发展态势。与此同时,公司实际控制人也在三季度持续进行了增持活动,体现了管理层对上市公司的信心。因此,基金管理人经审慎分析,在本报告期内继续保持对其的投资。

本基金投资的其余前九名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	287,886.91
2	应收证券清算款	3,756,246.53
3	应收股利	-
4	应收利息	612,200.79
5	应收申购款	12,058.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,668,392.87

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	002183	怡亚通	7,091,661.60	5.96	重大事项
2	601919	中国远洋	5,895,432.00	4.95	重大事项
3	600058	五矿发展	4,723,230.00	3.97	重大事项
4	002589	瑞康医药	4,134,958.10	3.47	重大事项
5	600428	中远航运	3,956,316.00	3.32	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	135,997,099.82
报告期期间基金总申购份额	6,793,183.54
减:报告期期间基金总赎回份额	18,242,675.07
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	124,547,608.29

§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

1.本公司于2015年7月22日发布《关于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变更基金名称、基金类型以及修订基金同部分条款的公告》,基金名称由“泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金”变更为“泰达宏利价值优化型稳定类行业混合型证券投资基金”,基金简称相应变更,基金合同当事人权利义务关系未发生变化。

2.本公司于2015年8月15日发布《