泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1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10月1日至2015年12月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利红利先锋混合
交易代码	162212
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月3日
报告期末基金份额总额	381,233,609.37份
投资目标	力争实现基金资产的长期稳定增值和基金的持续稳定分红。
投资策略	1.资产配置策略 基金投资股票资产的最低比例为基金资产的60%,最高为95%,投资于债券资产的比例最高为40%,最低为0%。 2.股票投资策略 本基金兼顾投资于具有持续分红特征及潜力的红利股和具有成长潜力特征的上市公司,其中投资于红利股的比例不低于基金股票资产的80%。红利股应具备本基金对红利股定量筛选标准中的一项或多项特征。 3.债券投资策略 对债券的投资将作为控制投资组合整体风险的重要手段之一,通过采用积极主动的投资策略,结合宏观经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,运用久期调整、凸度挖掘、信用分析、波动性交易、品种互换、回购套利等策略,权衡到期收益率与市场流动性,精选个券并构建和调整债券组合,在追求债券资产投资收益的同时兼顾流动性和安全性。 4.权证投资策略 本基金在确保与基金投资目标相一致的前提下,本着谨慎可控的原则,进行权证投资。
业绩比较基准	75%×标普中国A股红利机会指数收益率+25%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,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债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。
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(2015年10月1日 — 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	38,225,027.35
2.本期利润	88,489,102.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.2141
4.期末基金资产净值	582,283,811.38
5.期末基金份额净值	1.527

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

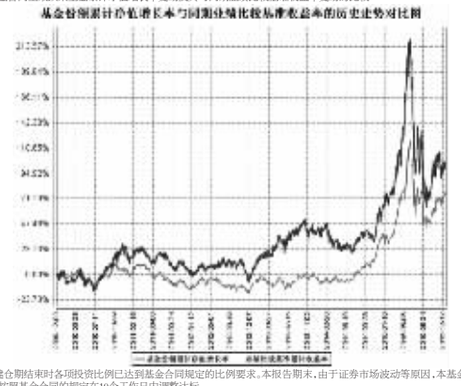
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	15.59%	2.37%	16.85%	1.20%	-1.26%	1.17%

本基金的业绩比较基准:75%×标普中国A股红利机会指数收益率+25%×上证国债指数收益率。

标普中国A 股红利机会指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的具有高红利特征、营利能力和利润增长率稳定且具有一定规模及流动性的股票作为样本股,以股息率的最大化及覆盖个股与行业的多样化为标准,使用股息率作为加权指标构建的指数。它可以综合反映沪深证券市场中高股息股票的整体状况和走势,比较符合本基金的投资策略和投资方向。

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权重而成,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



本基金在建仓期结束时各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。本报告期末,由于证券市场波动等原因,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		
邓艺颖	本基金基金经理	2015年4月3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、研究部副总监,现任投资副总监兼研究部总监;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 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾4季度市场的表现,10月份受国庆假期海外市场强劲表现,对美联储推迟加息及国内货币政策继续宽松的预期,以及A股市场新财富评选行情叠加十八届五中全会讨论十三五规划的刺激,二级市场表现强劲,创业板指数涨幅超过20%,部分个股涨幅接近50%。11月份,市场仍然维持强势反弹的态势,中小板、创业板指数反弹15%,其中传媒IP、体育、教育、VR、新能源汽车、券商等板块表现突出,整体呈现出高风险偏好的特征。12月份,市场表现最抢眼的当属保险系举牌上市公司,尤其是万科的股权之争,使得市场投资人对地产、零售、消费品等低估值蓝筹股的投资价值开始重新审视。

投资期内市场投资特征是市场依然很热,众多投资者回调便跃买,其中两个重要原因:1) A股存量资金体量较大使得市场呈现出高波动的特征,这使得自下而上选股得到的“正反馈”较为明显,且仍有一定的板块联动效应;2) 大家是拿着创业板相关资产,然后用上证指数来评估下行风险。另一个重要的市场特征是,大部分投资者不敢追高,向上大幅做多动能略显不足。存量加仓进程已进入后半段,主题快速轮动演绎也较为充分,我们的策略是坚持行业景气度比较和精选个股的配置思路,综合长期经济发展方向以及短期行业景气度排序,重点配置新能源汽车、VR、教育等为代表的具有长期发展前景的板块;结合行业景气度判断,加大了传媒、数字营销、医疗服务这些景气子板块的配置,同时减少在存业和主题之间频繁的切换。

4.5 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1.527元,本报告期份额净值增长率为15.59%,同期业绩比较基准增长率为16.85%。

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	348,792,701.55	59.49
	其中:股票	348,792,701.55	59.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	235,510,001.04	40.17
8	其他资产	1,990,177.15	0.34
9	合计	586,292,879.74	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	148,842,652.67	25.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	17,474,652.60	3.00
F	批发和零售业	23,971,149.15	4.12
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	60,676,265.99	10.42
J	金融业	15,592,196.00	2.68
K	房地产业	41,980,587.03	7.21
L	租赁和商务服务业	19,597,824.00	3.37
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.02
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	20,547,981.90	3.53
S	综合	-	-
	合计	348,792,701.55	59.90

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	002407	多氟多	381,872	29,121,558.72	5.00
2	300310	宜通世纪	434,587	27,087,807.71	4.65
3	000638	万方发展	784,653	23,971,149.15	4.12
4	002709	天赐材料	285,419	23,661,235.10	4.06
5	300113	顺网科技	226,100	22,919,757.00	3.94
6	000718	苏宁环球	1,695,420	22,362,589.80	3.84
7	002343	禾欣股份	338,517	20,547,981.90	3.53
8	600735	新华锦	843,200	20,253,664.00	3.48
9	000526	银润投资	294,167	19,617,997.23	3.37
10	002712	思美传媒	153,108	19,597,824.00	3.37

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

本基金本报告期末投资于股指期货,该策略符合基金合同的规定。

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。

5.11.2

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	1,400,770.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	35,783.04
5	应收申购款	553,623.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,990,177.15

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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

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	417,922,397.18
报告期期间基金总申购份额	25,897,131.81
减:报告期期间基金总赎回份额	62,585,919.62
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	381,233,609.37

§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新增投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1.本公司于2015年12月4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》,聘任王彦杰先生为公司副总经理。

§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红利先锋混合型证券投资基金设立的文件;

2、《泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金基金合同》;

3、《泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《泰达宏利红利先锋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

基金投资者也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》)或登录本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
2016年1月22日

泰达宏利行业精选混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12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:2016年1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2016年1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10月1日至2015年12月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利行业混合
交易代码	162204
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年7月9日
报告期末基金份额总额	213,107,315.33份
投资目标	追求资本的长期持续增值,为投资者寻求高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	全面引进荷兰银行的投资管理流程,采用“自上而下”资产配置和行业类别与行业配置,“自下而上”精选股票的投资策略,主要投资于具有国际、国内竞争力比较优势和长期增值潜力的行业和企业的股票。
业绩比较基准	70%×富时中国A600指数收益率+30%×中债国债总指数(财富)
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于风险较高的基金品种
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	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10月1日 — 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-18,758,179.16
2.本期利润	131,602,218.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.6074
4.期末基金资产净值	837,892,664.72
5.期末基金份额净值	3.9318

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	18.04%	2.11%	12.97%	1.20%	5.07%	0.91%

本基金业绩比较基准:70%×富时中国A600指数收益率+30%×中债国债总指数(财富)。

富时中国A600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600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。

中债国债总指数(财富)是中央国债登记结算有限责任公司推出的中国国债总指数,该指数系基于全市场角度编制的指数,价格选取上更侧重于全国银行间债券市场,选样广泛,全面而细致反映债券市场变动。

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	2015年4月3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 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年4季度期间,宏观经济仍然缺乏亮点,政策从传统的需求刺激转向供给改革的讨论,资金成本进一步下降。在经历了2、3季度的剧烈调整后,风险偏好触底回升,整体股市在前半个季度有明显涨幅,后半个季度则进入横盘震荡。

本基金在季度初增加了计算机、传媒、服务业等行业的配置,季度末行业配置则相对均衡,仓位从激进转向中性偏乐观。

4.5 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3.9318元,本报告期份额净值增长率为18.04%,同期业绩比较基准增长率为12.97%。

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	727,636,191.65	86.33
	其中:股票	727,636,191.65	86.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	56,642,907.20	6.72
	其中:债券	56,642,907.20	6.72
	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	56,724,055.21	6.73
8	其他资产	1,823,039.13	0.22
9	合计	842,826,193.19	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	2,335.24	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	327,495,812.51	39.09
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	54,232,919.92	6.47
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	191,045,634.13	22.80
J	金融业	62,013,531.42	7.40
K	房地产业	15,609,282.00	1.86
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	50,895,376.40	6.07
S	综合	26,341,300.03	3.14
	合计	727,636,191.65	86.84

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	300310	宜通世纪	675,803	42,122,800.99	5.03
2	000783	长江证券	3,272,135	40,639,916.70	4.85
3	300188	美亚柏科	758,108	38,436,075.60	4.59
4	002292	奥飞动漫	736,700	38,094,757.00	4.55
5	300144	宋城演艺	1,126,304	31,874,403.20	3.80
6	300275	梅安森	824,670	30,017,988.00	3.58
7	002407	多氟多	365,896	27,903,228.96	3.33
8	300031	宝通科技	870,100	27,321,140.00	3.26
9	600701	工大高新	1,098,971	26,298,376.03	3.14
10	002123	荣信股份	1,002,489	25,713,842.85	3.07

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	23,422,868.00	2.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,087,000.00	3.59
	其中:政策性金融债	30,087,000.00	3.59
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,133,039.20	0.37
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	56,642,907.20	6.76

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	150211	15国开11	300,000	30,087,000.00	3.59
2	010303	03国债(3)	121,100	12,579,868.00	1.50
3	010107	21国债(7)	100,000	10,843,000.00	1.29
4	110031	航信转债	24,130	3,133,039.20	0.37

注:上述债券明细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。

5.11.2

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	398,137.96
2	应收证券清算款	2,169,145.62
3	应收股利	-
4	应收利息	6,305,557.51
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,872,841.09

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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

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	219,341,798.80
报告期期间基金总申购份额	2,890,387.66
减:报告期期间基金总赎回份额	9,124,871.13
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	213,107,315.33

§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12月4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》,聘任王彦杰先生为公司副总经理。

§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行业精选证券投资基金设立的文件;

2、《泰达宏利行业精选证券投资基金基金合同》;

3、《泰达宏利行业精选证券投资基金招募说明书》;

4、《泰达宏利行业精选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
2016年1月22日

泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12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:华夏银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1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10月1日至2015年12月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利创盈混合
交易代码	001141
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月30日
报告期末基金份额总额	2,693,277,868.99份
投资目标	在有效控制风险的基础上,通过主动管理,力争创造高于业绩比较基准的投资收益
投资策略	本基金管理人充分发挥自身的研究优势,将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合。在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,自上而下决定债券组合久期、期限结构配置及债券类别配置;同时在严谨深入的信用分析基础上,综合考量企业债券的信用评级以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,自下而上地精选具有较高投资价值的个券。同时,本基金深度关注股票市场的运行状况与相应风险收益特征,在严格控制基金资产运作风险的基础上,把握投资机会
业绩比较基准	中债总财富总指数+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金,在证券投资基金中属于较高风险的品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金、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	华夏银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	泰达宏利创盈混合A / 泰达宏利创盈混合B
下属分级基金的交易代码	001141 / 001142
报告期末下属分级基金的份额总额	272,806,199.76份 / 2,420,471,669.23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10月1日 — 2015年12月31日)	
	泰达宏利创盈混合A	泰达宏利创盈混合B
1. 本期已实现收益	1,645,211.92	4,180,041.40
2. 本期利润	2,127,954.09	10,126,368.41
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0059	0.0071
4. 期末基金资产净值	285,035,284.57	2,502,998,955.80
5. 期末基金份额净值	1.045	1.034

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

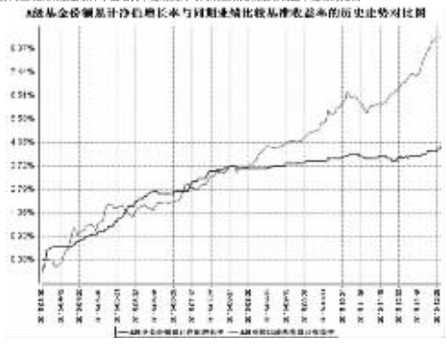
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰达宏利创盈混合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	0.58%	0.05%	3.61%	0.11%	-3.03%	-0.06%

泰达宏利创盈混合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	0.49%	0.04%	3.61%	0.11%	-3.12%	-0.07%

本基金业绩比较基准:中债总财富总指数+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