泰达宏利活期友货币市场基金

2016 第二季度 报告

2016年6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:2016年7月19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7月15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、误导性陈述或重重大遗漏。

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2016年4月1日至2016年6月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利活期友货币
交易代码	001894
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月4日
报告期末基金份额总额	347,110,869.07份
投资目标	在有效控制风险、保持流动性的前提下,力争为基金份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上,分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势,并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,对基金资产组合进行积极管理。
业绩比较基准	同期七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的长期风险和收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	泰达宏利活期友货币A / 泰达宏利活期友货币B
下属分级基金的交易代码	001894 / 001895
报告期末下属分级基金的份额总额	17,347,888.55份 / 329,762,980.52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(2016年4月1日 - 2016年6月30日)	
	泰达宏利活期友货币A	泰达宏利活期友货币B
1. 本期已实现收益	103,563.71	3,006,321.61
2.本期利润	103,563.71	3,006,321.61
3.期末基金资产净值	17,347,888.55	329,762,980.52

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

泰达宏利活期友货币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	0.5733%	0.0029%	0.3366%	0.0000%	0.2367%	0.0029%

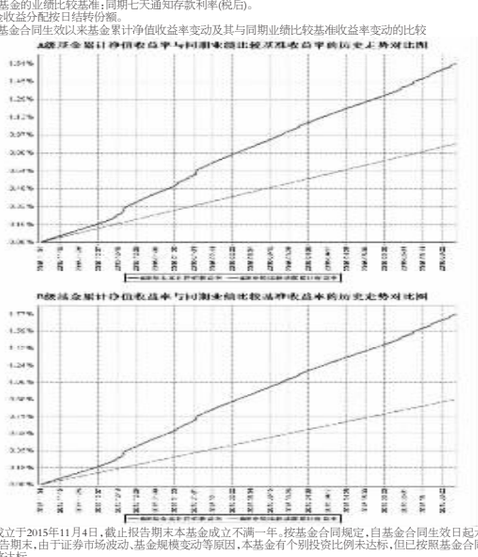
泰达宏利活期友货币B

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	0.6335%	0.0029%	0.3366%	0.0000%	0.2969%	0.0029%

注:1.本基金的业绩比较基准:同期七天通知存款利率(税后)。

2.本基金收益分配按日结转份额。

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



本基金成立于2015年11月4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,但已按照基金合同约定在规定时间内调整达标。

§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		
丁宇佳	基金经理	2015年11月4日	-	8	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月起先后担任固定收益部研究员、基金经理助理、基金经理;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。

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。本报告期内,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况共出现了 2次。2次涉及的投资组合一方均为按照量化策略进行投资,虽然买卖股票量少,但由于个股流动性较差,交易量小、致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%,未发现异常。在本报告期内也未发生因

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	357,734,071.13	85.12
	其中:债券	357,734,071.13	85.12
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	60,523,720.16	14.40
4	其他资产	2,002,621.27	0.48
5	合计	420,260,412.56	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	6.22	
	其中:买断式回购融资	-	
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	72,754,763.62	20.96
	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
1	2016年6月29日	25.75	大额赎回	2016年7月6日调整完毕
2	2016年6月30日	20.96	大额赎回	2016年7月6日调整完毕

注:调整期从正回购资金余额超过基金资产净值比例20%后的第一个交易日计算。

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	119
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	70

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	5.91	20.96
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	45.97	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	14.31	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	28.71	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	25.60	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	120.50	20.96

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	19,973,770.02	5.75
	其中:政策性金融债	19,973,770.02	5.75
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	89,916,788.97	25.90
6	中期票据	20,130,693.14	5.80
7	同业存单	227,712,819.00	65.60
8	其他	-	-
9	合计	357,734,071.13	103.06
10	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	111609082	16浦发CD082	500,000	49,784,853.46	14.34
2	111690945	16包商银行CD008	500,000	49,747,124.40	14.33
3	111508200	15中信CD200	500,000	49,663,820.44	14.31
4	041659010	16银川通联CP001	300,000	29,984,695.08	8.64
5	1182226	11首钢MTN1	200,000	20,130,693.14	5.80
6	041560113	15新城建CP002	200,000	19,989,589.88	5.76
7	160201	16国开01	200,000	19,973,770.02	5.75
8	011699933	16中建材SCP005	200,000	19,972,191.97	5.75
9	041569038	15环球租赁CP001	200,000	19,970,312.04	5.75
10	111693842	16吉林银行CD082	200,000	19,899,476.35	5.73

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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1471%
报告期内偏离度的最低值	0.0117%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0912%

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,在报告编制日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	1,972,611.27
4	应收申购款	30,010.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,002,621.27

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	泰达宏利活期友货币A	泰达宏利活期友货币B
报告期期初基金份额总额	23,345,560.95	568,398,573.08
报告期期间基金总申购份额	7,558,476.31	220,157,206.12
报告期期间基金总赎回份额	13,556,148.71	458,792,798.68
报告期期末基金份额总额	17,347,888.55	329,762,980.52

§7 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、《泰达宏利活期友货币市场基金基金合同》;

2、《泰达宏利活期友货币市场基金托管协议》;

3、《泰达宏利活期友货币市场基金招募说明书》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、基托管人业务资格批件、营业执照;

6、中国证监会要求的其他文件。

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
2016年7月19日

泰达宏利市值优选混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月19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7月15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2016年4月1日至2016年6月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利市值优选混合
交易代码	162209
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年8月3日
报告期末基金份额总额	1,590,574,100.06份
投资目标	本基金兼顾大盘股和中小盘股,把握不同市值的股票在不同市场环境下的投资机会,投资于其中的优质股票,力争获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将使用成功运用的MVPS模型来进行资产配置调整。MVPS模型主要考虑M(宏观经济环境)、V(价值)、P(政策)、S(市场气氛)四方面因素。MVPS模型作为本基金管理人持续一致的资产配置工具,通过定量和定性分析的有效结合判断未来市场的发展趋势,为本基金的资产配置提供支持。 本基金股票资产比例最高可以达到95%,最低保持在60%以上,债券资产比例最高可以达到35%,最低为0%,并保持现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,以保持基金资产流动性的要求。
业绩比较基准	75%×沪深300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(2016年4月1日 - 2016年6月30日)
1.本期已实现收益	118,832,975.32
2.本期利润	115,797,111.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0699
4.期末基金资产净值	1,316,221,320.88
5.期末基金份额净值	0.8275

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

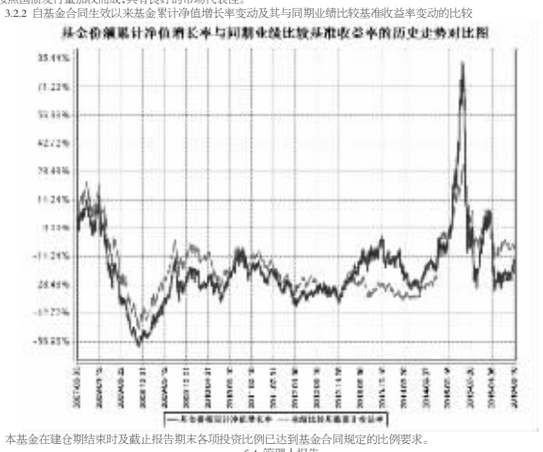
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	8.57%	1.76%	-1.28%	0.76%	9.85%	1.00%

本基金的业绩比较基准:75%×沪深300 指数收益率+25%×上证国债指数收益率。

沪深300 指数是由上海和深圳证券市场中选取300 只A 股作为样本编制而成的成份股指数,该指数的指数样本覆盖了沪深两地市场八成左右的市值,具有良好的市场代表性。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。

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	2015年4月3日	-	10	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,担任研究组长;2009年7月至2010年4月就职于东兴证券股份有限公司,担任研究组长;2010年4月加入泰达宏利基金管理有限公司,曾担任研究员、高级研究员,现任研究部副总监;具备10年证券从业经验,10年证券投资管理经验,具有基金从业资格。
李坤元	本基金基金经理	2015年5月14日	-	10	金融学硕士,2006年7月至2007年5月,任职于申银万国证券股份有限公司,担任发现策略部分析师;2007年5月至2013年3月,任职于信达澳银基金管理有限公司,先后担任基金经理助理、基金经理;2013年4月至2014年10月,任职于东方基金管理有限公司,担任基金经理;2014年10月加入泰达宏利基金管理有限公司。具备10年证券从业经验,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。本报告期内,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况共出现了 2次。2次涉及的投资组合一方均为按照量化策略进行投资,虽然买卖股票量少,但由于个股流动性较差,交易量小、致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%,未发现异常。在本报告期内也未发生因相比1季度,投资人理念相对稳定。

本基金根据经济预期的调整情况,在2季度及时减仓受经济影响较大的传统周期板块,增配新能源汽车产业链、食品饮料、电子等板块,超配新能源汽车、贵金属,相对于1季度业绩有所好转。

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0.8275元,本报告期份额净值增长率为8.57%,同期业绩比较基准增长率为-1.28%。

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	1,019,059,276.59	76.61
	其中:股票	1,019,059,276.59	76.61
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	115,942,633.52	8.72
8	其他资产	195,253,867.58	14.68
9	合计	1,330,255,777.69	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	2,885,815.36	0.22
B	采矿业	101,917,641.18	7.74
C	制造业	592,756,095.26	45.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	480.48	0.00
E	建筑业	905,065.37	0.07
F	批发和零售业	41,510,099.25	3.15
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	172,650,021.08	13.12
J	金融业	39,834,391.82	3.03
K	房地产业	8,994,568.04	0.68
L	租赁和商务服务业	1,533,839.35	0.12
M	科学研究和技术服务业	136,807.85	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	11,770,003.00	0.89
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	44,164,448.55	3.36
S	综合	-	-
	合计	1,019,059,276.59	77.42

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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	300073	当升科技	1,014,536	67,913,039.84	5.16
2	600547	山东黄金	1,308,700	50,921,517.00	3.87
3	000568	泸州老窖	1,378,032	40,927,550.40	3.11
4	600571	信雅达	717,000	39,521,040.00	3.00
5	603799	华友钴业	1,044,700	38,862,840.00	2.95
6	300465	高伟达	499,181	37,508,460.34	2.85
7	300014	亿纬锂能	756,847	32,688,221.93	2.48
8	300365	恒华科技	599,896	27,445,242.00	2.09
9	000957	中通客车	598,653	27,178,846.20	2.06
10	600595	中孚实业	4,768,100	26,892,084.00	2.04

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	2,149,669.59
2	应收证券清算款	192,974,182.51
3	应收股利	-
4	应收利息	28,620.13
5	应收申购款	101,395.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	195,253,867.58

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在在流通受限情况。

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	1,612,450,437.93
报告期期间基金总申购份额	153,744,907.82
减:报告期期间基金总赎回份额	175,621,245.69
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	1,590,574,100.06

§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市值优选混合型证券投资基金设立的文件;

2、《泰达宏利市值优选混合型证券投资基金基金合同》;

3、《泰达宏利市值优选混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《泰达宏利市值优选混合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》、《证券日报》)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7月19日

泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6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:2016年7月19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7月15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2016年4月1日至2016年6月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利瑞利债券	
交易代码	000387	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年11月14日	
报告期末基金份额总额	456,799,165.21份	
投资目标	本基金主要投资于固定收益证券,在合理控制信用风险的基础上,通过积极主动的管理,力求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	从利率、信用等角度深入挖掘信用债市场投资机会,在有效控制流动性风险及信用风险等风险的前提下,力争创造稳健收益。	
业绩比较基准	中债综合指数收益率(全价)	
风险收益特征	本基金为较低风险品种,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	泰达宏利瑞利债券A	泰达宏利瑞利债券B
下属分级基金的交易代码	000387	000388
报告期末下属分级基金的份额总额	54,242,852.49份	402,556,312.72份
下属分级基金的风险收益特征	瑞利A 为低预期风险、预期收益相对稳定的基金份额	瑞利B 为中高预期风险、预期收益相对较高的基金份额

§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(2016年4月1日 - 2016年6月30日)
1.本期已实现收益	11,717,509.22
2.本期利润	1,135,773.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0024
4.期末基金资产净值	470,451,817.87
5.期末基金份额净值	1.030

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。

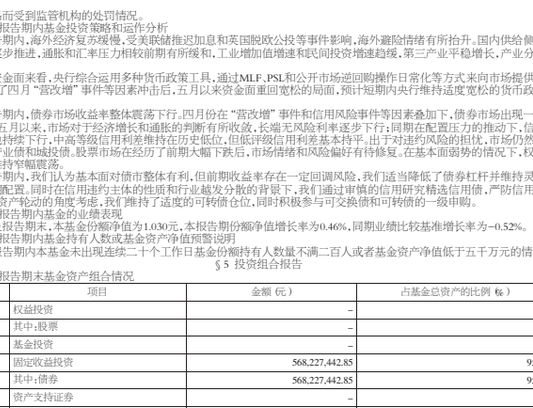
3.2 基金净值表现

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	0.46%	0.09%	-0.52%	0.07%	0.98%	0.02%

注:本基金的业绩比较基准:中债综合指数收益率(全价)

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		
卓若伟	本基金基金经理、固定收益部总监	2013年11月14日	-	12	经济学硕士: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,曾担任固定收益部副总经理、总经理,现任固定收益部总监;具备10年基金从业经验,12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