

泰达宏利养老保险混合型证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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7月20日

基金管理人的董事会及监事会对本基金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7月16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页,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。

本报告期利润为2015年4月1日至2015年6月30日。

§ 2 基金产品概况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	26,048,195.82	0.19
其中:股票	26,048,195.82	0.19	
2	固定收益投资	1,933,061,503.00	13.93
其中:债券	1,933,061,503.00	13.93	
货币市场基金	-	-	
3	黄金类投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	1,239,804,182.70	8.94
其中:质押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	10,628,014,491.98	76.60
7	其他资产	47,422,789.04	0.34
8	合计	13,874,351,153.54	100.00

投资目标 在严格控制风险的前提下,通过积极主动的管理,力争为基金份额持有人创造高于基准的稳定收益。

投资策略 本基金研究分析与积极主动的主动风格相结合,在分析和判断的基础上,通过资产配置,结合对宏观经济、政策环境、行业趋势的深入研究,决定基金的长期投资策略,同时根据股票、债券等类别资产的预期收益率,综合考虑各类资产的流动性和相关性,在严格控制风险的前提下,精选具有投资价值的股票、债券等金融工具,在严格控制基金净值波动风险的基础上,把握投资机会。

业绩比较基准 上证综合指数×60%+中债综合指数×40%

风险收益特征 本基金是混合型基金,在所有基金中属于中等风险的品种,其预期平均风险和预期平均收益水平居于股票基金、高收益货币基金和债券基金之间,但不保证基金一定盈利。

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 泰达宏利泰盈混合A 泰达宏利泰盈混合B

基金代码 000507 000508

报告期末下属分级基金的份额总额 3,724,903,566.56份 8,214,907,555.62份

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元 报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

泰达宏利泰盈混合A 泰达宏利泰盈混合B

1.本期已实现收益 124,245.30,10 215,894,434.93

2.本期利润 148,280,157.33 195,066,999.63

3.加权平均基金份额本期利润 0.0473 0.0494

4.期末基金资产净值 4,333,078,482.66 9,498,434,714.10

5.期末基金份额净值 1.156

注:1.本公司定期披露本基金利润收入、投资收益,其他收入(不含公允价值变动收益)和相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期的未实现收益。

2.所列基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金时产生的费用,计入摊薄后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金简称的含义

3.2.1 本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 泰达宏利养老保险混合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 4.21% 0.07% 1.07% 0.01% 3.14% 0.06%

3.2.2 百基德同生混合以现金计价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 4.05% 0.07% 1.07% 0.01% 2.98% 0.06%

3.2.3 泰达宏利泰盈混合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 4.21% 0.07% 1.07% 0.01% 3.14% 0.06%

3.2.4 泰达宏利泰盈混合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 4.05% 0.07% 1.07% 0.01% 2.98% 0.06%

3.2.5 泰达宏利养老保险混合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 4.21% 0.07% 1.07% 0.01% 3.14% 0.06%

3.2.6 泰达宏利养老保险混合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 4.05% 0.07% 1.07% 0.01% 2.98% 0.06%

3.2.7 泰达宏利泰盈混合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 4.21% 0.07% 1.07% 0.01% 3.14% 0.06%

3.2.8 泰达宏利泰盈混合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 4.05% 0.07% 1.07% 0.01% 2.98% 0.06%

3.2.9 泰达宏利养老保险混合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 4.21% 0.07% 1.07% 0.01% 3.14% 0.06%

3.2.10 泰达宏利养老保险混合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 4.05% 0.07% 1.07% 0.01% 2.98% 0.06%

3.2.11 泰达宏利泰盈混合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 4.21% 0.07% 1.07% 0.01% 3.14% 0.06%

3.2.12 泰达宏利泰盈混合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 4.05% 0.07% 1.07% 0.01% 2.98% 0.06%

3.2.13 泰达宏利养老保险混合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 4.21% 0.07% 1.07% 0.01% 3.14% 0.06%

3.2.14 泰达宏利养老保险混合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 4.05% 0.07% 1.07% 0.01% 2.98% 0.06%

3.2.15 泰达宏利泰盈混合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 4.21% 0.07% 1.07% 0.01% 3.14% 0.06%

3.2.16 泰达宏利泰盈混合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 4.05% 0.07% 1.07% 0.01% 2.98% 0.06%

3.2.17 泰达宏利养老保险混合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 4.21% 0.07% 1.07% 0.01% 3.14% 0.06%

3.2.18 泰达宏利养老保险混合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 4.05% 0.07% 1.07% 0.01% 2.98% 0.06%

3.2.19 泰达宏利养老保险混合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 4.21% 0.07% 1.07% 0.01% 3.14% 0.06%

3.2.20 泰达宏利养老保险混合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 4.05% 0.07% 1.07% 0.01% 2.98% 0.06%

3.2.21 泰达宏利养老保险混合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 4.21% 0.07% 1.07% 0.01% 3.14% 0.06%

3.2.22 泰达宏利养老保险混合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 4.05% 0.07% 1.07% 0.01% 2.98% 0.06%

3.2.23 泰达宏利养老保险混合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 4.21% 0.07% 1.07% 0.01% 3.14% 0.06%

3.2.24 泰达宏利养老保险混合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 4.05% 0.07% 1.07% 0.01% 2.98% 0.06%

3.2.25 泰达宏利养老保险混合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 4.21% 0.07% 1.07% 0.01% 3.14% 0.06%

3.2.26 泰达宏利养老保险混合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 4.05% 0.07% 1.07% 0.01% 2.98% 0.06%

3.2.27 泰达宏利养老保险混合A