

## 泰达宏利改革动力量化策略灵活配置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

§ 1 重要提示  
基金管理人、基金托管人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和连带的法律责任。  
本基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定，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。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期为2015年4月1日至2015年6月30日。

§ 2 基金产品概况

基金简称 泰达宏利改革动力混合

交易代码 000107

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2015年2月11日

报告期末基金份额总额 923,326,164.97份

投资目标 本基金主要投资于大类资产配置策略，同时深入研究各项改革过程中带来的投资机会，采用不同行业轮动策略，力争实现基金净值的长期稳定增长。

投资策略 本基金将通过深入研究各项改革政策，把握改革进程中带来的投资机会，通过行业轮动策略，力争实现基金净值的长期稳定增长。

业绩比较基准 50%×沪深300指数收益率+50%×证得综合债指数收益率

风险收益特征 本基金为混合型基金，具有较高风险、较高收益的特征，其风险和收益水平高于股票型基金，低于债券型基金和货币市场基金。

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

(单位:人民币元)

主要财务指标 报告期:2015年4月1日—2015年6月30日

1.本期已实现收益 637,444.82945

2.本期利润 371,726,653.84

3.加权平均基金份额本期利润 0.2711

4.期末基金份额净值 1,340,937,177.69

5.期末基金份额总值 1,452

注:1.经本基金2015年3月31日基金本期累计收入、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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。  
2.上述基金业绩指标均不包含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将低于所列数据。

3.2 基金的财务指标

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

(单位:人民币元)

阶段 净值增长(%) ① 净值增长(%) ② 业绩比较基准收益 ③ 业绩比较基准收益率 ④ 单位净值至①

过去三个月 22.64% -6.74% 1.31% 15.90% 1.54%

本基金的业绩比较基准的沪深300指数收益率\*50%+证得综合债指数收益率\*50%

3.2.2 本基金合同生效以来至最近一期定期报告的期间内每一季度的季度收益率与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期:2015年4月1日—2015年6月30日

1.本期已实现收益 637,444.82945

2.本期利润 371,726,653.84

3.加权平均基金份额本期利润 0.2711

4.期末基金份额净值 1,340,937,177.69

5.期末基金份额总值 1,452

注:1.经本基金2015年3月31日基金本期累计收入、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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。  
2.上述基金业绩指标均不包含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将低于所列数据。

3.2.3 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

(单位:人民币元)

阶段 净值增长(%) ① 净值增长(%) ② 业绩比较基准收益 ③ 业绩比较基准收益率 ④ 单位净值至①

过去三个月 22.64% -6.74% 1.31% 15.90% 1.54%

本基金的业绩比较基准的沪深300指数收益率\*50%+证得综合债指数收益率\*50%

3.2.4 本基金合同生效以来至最近一期定期报告的期间内每一季度的季度收益率与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期:2015年4月1日—2015年6月30日

1.本期已实现收益 637,444.82945

2.本期利润 371,726,653.84

3.加权平均基金份额本期利润 0.2711

4.期末基金份额净值 1,340,937,177.69

5.期末基金份额总值 1,452

注:1.经本基金2015年3月31日基金本期累计收入、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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。  
2.上述基金业绩指标均不包含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将低于所列数据。

3.2.5 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

(单位:人民币元)

阶段 净值增长(%) ① 净值增长(%) ② 业绩比较基准收益 ③ 业绩比较基准收益率 ④ 单位净值至①

过去三个月 22.64% -6.74% 1.31% 15.90% 1.54%

本基金的业绩比较基准的沪深300指数收益率\*50%+证得综合债指数收益率\*50%

3.2.6 本基金合同生效以来至最近一期定期报告的期间内每一季度的季度收益率与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期:2015年4月1日—2015年6月30日

1.本期已实现收益 637,444.82945

2.本期利润 371,726,653.84

3.加权平均基金份额本期利润 0.2711

4.期末基金份额净值 1,340,937,177.69

5.期末基金份额总值 1,452

注:1.经本基金2015年3月31日基金本期累计收入、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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。  
2.上述基金业绩指标均不包含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将低于所列数据。

3.2.7 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

(单位:人民币元)

阶段 净值增长(%) ① 净值增长(%) ② 业绩比较基准收益 ③ 业绩比较基准收益率 ④ 单位净值至①

过去三个月 22.64% -6.74% 1.31% 15.90% 1.54%

本基金的业绩比较基准的沪深300指数收益率\*50%+证得综合债指数收益率\*50%

3.2.8 本基金合同生效以来至最近一期定期报告的期间内每一季度的季度收益率与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期:2015年4月1日—2015年6月30日

1.本期已实现收益 637,444.82945

2.本期利润 371,726,653.84

3.加权平均基金份额本期利润 0.2711

4.期末基金份额净值 1,340,937,177.69

5.期末基金份额总值 1,452

注:1.经本基金2015年3月31日基金本期累计收入、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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。  
2.上述基金业绩指标均不包含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将低于所列数据。

3.2.9 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

(单位:人民币元)

阶段 净值增长(%) ① 净值增长(%) ② 业绩比较基准收益 ③ 业绩比较基准收益率 ④ 单位净值至①

过去三个月 22.64% -6.74% 1.31% 15.90% 1.54%

本基金的业绩比较基准的沪深300指数收益率\*50%+证得综合债指数收益率\*50%

3.2.10 本基金合同生效以来至最近一期定期报告的期间内每一季度的季度收益率与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期:2015年4月1日—2015年6月30日

1.本期已实现收益 637,444.82945

2.本期利润 371,726,653.84

3.加权平均基金份额本期利润 0.2711

4.期末基金份额净值 1,340,937,177.69

5.期末基金份额总值 1,452

注:1.经本基金2015年3月31日基金本期累计收入、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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。  
2.上述基金业绩指标均不包含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将低于所列数据。

3.2.11 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

(单位:人民币元)

阶段 净值增长(%) ① 净值增长(%) ② 业绩比较基准收益 ③ 业绩比较基准收益率 ④ 单位净值至①

过去三个月 22.64% -6.74% 1.31% 15.90% 1.54%

本基金的业绩比较基准的沪深300指数收益率\*50%+证得综合债指数收益率\*50%

3.2.12 本基金合同生效以来至最近一期定期报告的期间内每一季度的季度收益率与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期:2015年4月1日—2015年6月30日

1.本期已实现收益 637,444.82945

2.本期利润 371,726,653.84

3.加权平均基金份额本期利润 0.2711

4.期末基金份额净值 1,340,937,177.69

5.期末基金份额总值 1,452

注:1.经本基金2015年3月31日基金本期累计收入、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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。  
2.上述基金业绩指标均不包含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将低于所列数据。

3.2.13 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

(单位:人民币元)

阶段 净值增长(%) ① 净值增长(%) ② 业绩比较基准收益 ③ 业绩比较基准收益率 ④ 单位净值至①

过去三个月 22.64% -6.74% 1.31% 15.90% 1.54%

本基金的业绩比较基准的沪深300指数收益率\*50%+证得综合债指数收益率\*50%

3.2.14 本基金合同生效以来至最近一期定期报告的期间内每一季度的季度收益率与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期:2015年4月1日—2015年6月30日

1.本期已实现收益 637,444.82945

2.本期利润 371,726,653.84

3.加权平均基金份额本期利润 0.2711

4.期末基金份额净值 1,340,937,177.69

5.期末基金份额总值 1,452

注:1.经本基金2015年3月31日基金本期累计收入、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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。  
2.上述基金业绩指标均不包含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将低于所列数据。

3.2.15 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

(单位:人民币元)

阶段 净值增长(%) ① 净值增长(%) ② 业绩比较基准收益 ③ 业绩比较基准收益率 ④ 单位净值至①

过去三个月 22.64% -6.74% 1.31% 15.90% 1