

## 泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金

[2015] 第三季度报告

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司  
基金托管人:中国建设银行股份有限公司  
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、监事、高级管理人员不存在虚假记载、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，更详细地了解本基金。

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	泰达宏利蓝筹混合
交易代码	000267
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月3日
报告期末基金份额总额	311,562,219.19份

投资目标 在严控风险的基础上，通过积极、主动的管理，精选行业优良、收益稳定的上市公司股票，力争在有效控制风险的前提下，实现基金资产的长期增值。

投资策略 本基金在充分把握投资人研究趋势、择股、选股的方法上，结合公司所处的产业链位置，通过“自上而下”和“自下而上”两个角度，综合分析宏观经济、行业政策、公司基本面、估值水平、资金面等多方面的因素，精选具有较好成长性的上市公司股票，力求在有效控制风险的前提下，实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准 沪深300指数收益率\*60%+上证国债指数收益率\*40%

风险收益特征 本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较低预期收益的特征。其风险和预期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 中国建设银行股份有限公司

§ 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7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -89,211,676.46

2.本期利润 -63,167,498.66

3.期初至报告期末基金期间利润 -1,073.09

4.期末基金资产净值 215,008,312.13

5.期末基金份额净值 0.6900

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。

3.2.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率为及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -19.68% 2.95% -16.88% 2.00% -3.18% 0.09%

本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率\*60%+上证国债指数收益率\*40%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图示见附录部分。

注:本基金成立于2015年6月3日，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期。截止报告期末，本基金仍在建仓期。

§ 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

陈丹琳 基金经理 2015年6月3日 - 8 济南大学硕士，毕业于中国农业大学；2007年7月加入泰达宏利基金管理有限公司，历任研究员、总经理助理兼基金经理等职务；2010年1月起担任泰达宏利蓝筹价值混合型基金基金经理；2011年1月起担任泰达宏利价值增长混合型基金基金经理；2012年1月起担任泰达宏利价值增长混合型基金基金经理；2013年1月起担任泰达宏利价值增长混合型基金基金经理；2014年1月起担任泰达宏利蓝筹价值混合型基金基金经理。

注:证券从业的含义遵从《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以公司公告为准。

4.2 管理人对报告期内基金运作合规性情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守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情况。

4.3 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机会、投资建议和投资决策方面享有平等机会；严格执行投资管理制度和行为交易限制的隔离，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、可稽查，保证公平交易制度的严格执行。对于同一品种的一级市场申购、非公开发行股票申购等大宗交易行为，按照公平交易制度的规定执行；对于同一品种的二级市场买卖、非公开发行股票申购等大宗交易行为，按照公平交易制度的规定执行；对于不同品种的一级市场申购、非公开发行股票申购等大宗交易行为，按照公平交易制度的规定执行；对于不同品种的二级市场买卖，按照公平交易制度的规定执行。

4.4 报告期内基金的经营策略和运作说明

4.4.1 根据报告期内基金的经营策略和运作说明

本基金在股票仓位下降的促发下，上证综指跌幅达29.8%，而在3000点到2000点区间内窄幅波动，从而导致本基金净值有所波动。

4.4.2 报告期内基金的经营策略和运作说明

本基金在10月份上证综指下跌的情况下，对股票仓位进行了最低，随后配置了新兴产业和国企改革的主线，前期疯狂炒作的题材股在未来的回调过程中，市值和估值压制作用明显。

4.4.3 公司管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本基金管理人认为，目前的经济环境、证券市场及行业走势的判断。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本基金管理人认为，目前的经济环境、证券市场及行业走势的判断。

4.6 报告期内基金净值预测说明

4.6.1 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.2 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.3 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.4 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.5 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.6 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.7 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.8 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.9 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.10 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.11 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.12 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.13 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.14 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.15 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.16 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.17 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.18 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.19 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.20 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.21 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.22 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.23 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.24 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.25 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.26 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.27 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.28 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.29 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.30 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.31 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.32 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.33 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.34 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.35 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.36 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.37 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.38 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.39 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.40 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.41 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.42 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.43 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.44 报告期内基金净值预测说明

本基金在股票仓位下降的情况下，预计未来收益将有所波动。

4.6.45 报