

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10月24日
§ 1 重要提示
基金管理人的董事会及监事会在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的规定，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例行报告，确认报告的内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
基金合同由基金管理人和基金托管人订立，并由基金管理人负责解释。
基金的名称并不表示未来表现，投资风险，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。
本基金的财务资料未经审计。
报告期为2015年7月1日至2015年9月30日。

泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金

2015年第3季度报告

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。

3.3 其他指标

单位：人民币元

基金简称	泰达宏利聚利分级债券
交易代码	162219
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年10月13日
报告期末基金份额总额	1,682,104,870.50份
投资目标	本基金主要投资于固定收益证券，在合理控制风险的基础上，通过积极主动管理，力求为基金资产的长期稳定增值。
投资策略	从长期和中期两个维度，通过深入研究，把握宏观经济运行趋势，结合对不同券种的收益率预期，精选投资品种，力争在控制风险的前提下，为投资者创造稳定的、力争超越业绩基准的收益。
业绩比较基准	中债企业债全价指数收益率×90%+国债债全价指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为低风险产品，预期风险和预期回报率高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。
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	泰达宏利聚利A
下属分级基金的交易代码	160034
报告期末下属分级基金的份额总额	1,107,473,410.47份
报告期末下属分级基金的资产净值	474,631,460.03元
下属分级基金的风险收益特征	聚利A 分级份额表现低风险、收益相对稳定的特征
对报告期的说明	§ 3 安全性好、流动性强、基金净值表现

3.4 主要财务指标

单位：人民币元

3.4.1 主要财务指标

报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

3.4.2 本期现金收入

32,320,070.00

3.4.3 本期利润

-3,150,177.00

3.4.4 加权平均基金份额本期利润

-0.0020

3.4.5 期末基金资产净值

2,342,517,729.07

3.4.6 期末基金份额净值

1.481

3.4.7 期末可供分配基金份额利润

0.0000

3.4.8 期末基金资产净值增长率

与同期业绩比较基准增长率持平

3.4.9 期末基金份额净值增长率标准差

0.00%

3.4.10 期末基金资产净值增长率业绩基准差

① - ③

② - ④

3.4.11 期末基金份额净值增长率差值

-1.16%

3.4.12 期末基金份额净值增长率差值标准差

0.15%

注：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。

4.2 财务人员对报告本期基金运作情况的说明

本基金在报告期内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情况。

本基金在报告期内未发生重大关联交易。

本基金在报告期内未发生重大关联交易。