

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司  
基金托管人:交通银行股份有限公司

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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金财产净值的计算，遵循本基金合同的规定，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的内容，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摘要。

本报告财务数据未经审计。

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

基金名称 泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金

交易代码 162201

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2003年4月14日

报告期末基金份额总额 689,307,500.00份

本基金主要投资于成长行业类别中价值被低估和被低估，并与同行企业相比具有更明显增长潜力的上市公司。在有效控制投资组合风险的前提下，为基金的持有人提供长期稳定的回报。

投资策略 本基金采用“自下而上”的投资方法，具体体现在资产配置、行业配置和个股选择的企

业绩效基准 65%×上证A股行业指数+35%×上证国债指数。

风险收益特征 本基金在证券投资基金中属于较高风险的基金品种。

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 交通银行股份有限公司

\$ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标 单位:人民币元

报告期( 2015年7月1日 - 2015年9月30日 )

1.本期利润 -511,881,520.00

-359,039,085.07

-520,400.00

-0.02%

942,743,400.00

-1,397.00

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③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -27.75% 3.04% 65% × 上证A股行业指数 + 35% × 上证国债指数

本基金业绩比较基准:65%×上证A股行业指数+35%×上证国债指数。

上证国债指数选取的样本为在上海证券交易所上市的,除停牌外的国债品种,样本公司债的剩余期限分布均匀,收益率曲线较为平整,而且参与主体丰富,竞价交易连续性更强,能反映出市场利率的变化情况,客观、真实地显示出利率市场化程度的收益风险。

富时中国A600行业指数由60家行业指数中重新归类而成,成份股按照全球公认并广泛采用的指数分类标准进行分类,全面体现行业类别的风险收益特征。

3.2.2 自基金合同生效以来以同类基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金合同生效以来以同类基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的企

业绩效基准 65%×上证A股行业指数+35%×上证国债指数。

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

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -27.75% 3.04% 65% × 上证A股行业指数 + 35% × 上证国债指数

本基金业绩比较基准:65%×上证A股行业指数+35%×上证国债指数。

上证国债指数选取的样本为在上海证券交易所上市的,除停牌外的国债品种,样本公司债的剩余期限分布均匀,收益率曲线较为平整,而且参与主体丰富,竞价交易连续性更强,能反映出市场利率的变化情况,客观、真实地显示出利率市场化程度的收益风险。

富时中国A600行业指数由60家行业指数中重新归类而成,成份股按照全球公认并广泛采用的指数分类标准进行分类,全面体现行业类别的风险收益特征。

3.2.4 基金合同生效以来以同类基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金合同生效以来以同类基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的企

业绩效基准 65%×上证A股行业指数+35%×上证国债指数。

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

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -27.75% 3.04% 65% × 上证A股行业指数 + 35% × 上证国债指数

本基金业绩比较基准:65%×上证A股行业指数+35%×上证国债指数。

上证国债指数选取的样本为在上海证券交易所上市的,除停牌外的国债品种,样本公司债的剩余期限分布均匀,收益率曲线较为平整,而且参与主体丰富,竞价交易连续性更强,能反映出市场利率的变化情况,客观、真实地显示出利率市场化程度的收益风险。

富时中国A600行业指数由60家行业指数中重新归类而成,成份股按照全球公认并广泛采用的指数分类标准进行分类,全面体现行业类别的风险收益特征。

3.2.6 基金合同生效以来以同类基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金合同生效以来以同类基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的企

业绩效基准 65%×上证A股行业指数+35%×上证国债指数。

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

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -27.75% 3.04% 65% × 上证A股行业指数 + 35% × 上证国债指数

本基金业绩比较基准:65%×上证A股行业指数+35%×上证国债指数。

上证国债指数选取的样本为在上海证券交易所上市的,除停牌外的国债品种,样本公司债的剩余期限分布均匀,收益率曲线较为平整,而且参与主体丰富,竞价交易连续性更强,能反映出市场利率的变化情况,客观、真实地显示出利率市场化程度的收益风险。

富时中国A600行业指数由60家行业指数中重新归类而成,成份股按照全球公认并广泛采用的指数分类标准进行分类,全面体现行业类别的风险收益特征。

3.2.8 基金合同生效以来以同类基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金合同生效以来以同类基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的企

业绩效基准 65%×上证A股行业指数+35%×上证国债指数。

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

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -27.75% 3.04% 65% × 上证A股行业指数 + 35% × 上证国债指数

本基金业绩比较基准:65%×上证A股行业指数+35%×上证国债指数。

上证国债指数选取的样本为在上海证券交易所上市的,除停牌外的国债品种,样本公司债的剩余期限分布均匀,收益率曲线较为平整,而且参与主体丰富,竞价交易连续性更强,能反映出市场利率的变化情况,客观、真实地显示出利率市场化程度的收益风险。

富时中国A600行业指数由60家行业指数中重新归类而成,成份股按照全球公认并广泛采用的指数分类标准进行分类,全面体现行业类别的风险收益特征。

3.2.10 基金合同生效以来以同类基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金合同生效以来以同类基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的企

业绩效基准 65%×上证A股行业指数+35%×上证国债指数。

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

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -27.75% 3.04% 65% × 上证A股行业指数 + 35% × 上证国债指数

本基金业绩比较基准:65%×上证A股行业指数+35%×上证国债指数。

上证国债指数选取的样本为在上海证券交易所上市的,除停牌外的国债品种,样本公司债的剩余期限分布均匀,收益率曲线较为平整,而且参与主体丰富,竞价交易连续性更强,能反映出市场利率的变化情况,客观、真实地显示出利率市场化程度的收益风险。

富时中国A600行业指数由60家行业指数中重新归类而成,成份股按照全球公认并广泛采用的指数分类标准进行分类,全面体现行业类别的风险收益特征。

3.2.12 基金合同生效以来以同类基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金合同生效以来以同类基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的企

业绩效基准 65%×上证A股行业指数+35%×上证国债指数。

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

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -27.75% 3.04% 65% × 上证A股行业指数 + 35% × 上证国债指数

本基金业绩比较基准:65%×上证A股行业指数+35%×上证国债指数。

上证国债指数选取的样本为在上海证券交易所上市的,除停牌外的国债品种,样本公司债的剩余期限分布均匀,收益率曲线较为平整,而且参与主体丰富,竞价交易连续性更强,能反映出市场利率的变化情况,客观、真实地显示出利率市场化程度的收益风险。

富时中国A600行业指数由60家行业指数中重新归类而成,成份股按照全球公认并广泛采用的指数分类标准进行分类,全面体现行业类别的风险收益特征。

3.2.14 基金合同生效以来以同类基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金合同生效以来以同类基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的企

业绩效基准 65%×上证A股行业指数+35%×上证国债指数。

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

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -27.75% 3.04% 65% × 上证A股行业指数 + 35% × 上证国债指数

本基金业绩比较基准:65%×上证A股行业指数+35%×上证国债指数。

上证国债指数选取的样本为在上海证券交易所上市的,除停牌外的国债品种,样本公司债的剩余期限分布均匀,收益率曲线较为平整,而且参与主体丰富,竞价交易连续性更强,能反映出市场利率的变化情况,客观、真实地显示出利率市场化程度的收益风险。

富时中国A600行业指数由60家行业指数中重新归类而成,成份股按照全球公认并广泛采用的指数分类标准进行分类,全面体现行业类别的风险收益特征。

3.2.16 基金合同生效以来以同类基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金合同生效以来以同类基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的企

业绩效基准 65%×上证A股行业指数+35%×上证国债指数。

3.2.17 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③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -27.75% 3.04% 65% × 上证A股行业指数 + 35% × 上证国债指数

本基金业绩比较基准:65%×上证A股行业指数+35%×上证国债指数。

上证国债指数选取的样本为在上海证券交易所上市的,除停牌外的国债品种,样本公司债的剩余期限分布均匀,收益率曲线较为平整,而且参与主体丰富,竞价交易连续性更强,能反映出市场利率的变化情况,客观、真实地显示出利率市场化程度的收益风险。

富时中国A600行业指数由60家行业指数中重新归类而成,成份股按照全球公认并广泛采用的指数分类标准进行分类,全面体现行业类别的风险收益特征。

3.2.18 基金合同生效以来以同类基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金合同生效以来以同类基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的企

业绩效基准 65%×上证A股行业指数+35%×上证国债指数。

3.2.19 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③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -27.75% 3.04% 65% × 上证A股行业指数 + 35% × 上证国债指数

本基金业绩比较基准:65%×上证A股行业指数+35%×上证国债指数。

上证国债指数选取的样本为在上海证券交易所上市的,除停牌外的国债品种,样本公司债的剩余期限分布均匀,收益率曲线较为平整,而且参与主体丰富,竞价交易连续性更强,能反映出市场利率的变化情况,客观、真实地显示出利率市场化程度的收益风险。

富时中国A600行业指数由60家行业指数中重新归类而成,成份股按照全球公认并广泛采用的指数分类标准进行分类,全面体现行业类别的风险收益特征。

3.2.20 基金合同生效以来以同类基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金合同生效以来以同类基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的企

业绩效基准