

B062

信息披露disclosure

## 泰达宏利行业精选混合型证券投资基金

【2015】第三季度报告			
<b>基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司</b> <b>基金托管人:中国银行股份有限公司</b> <b>报告送出日期:2015年10月24日</b>			
<b>§1 重要提示</b> 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及其更新。 本报告财务资料未经审计。 本报告期间为2015年7月1日至2015年9月30日。			
<b>§2 基金产品概况</b>			
基金名称	泰达宏利行业混合		
交易代码	162204		
基金运作方式	契约开放式		
基金合同生效日	2004年7月9日		
报告期末基金份额总额	219,341,798.09份		
投资目标	追求资产的长期持续增长,为投资者寻求高于业绩比较基准的投资回报。		
投资策略	全面扫描宏观经济管理政策,采用“自上而下”资产配置和自下而上个股挖掘相结合,“自下而上”精选股票投资策略。主要投资于具有国内、国际竞争力和成长性强、长期增长潜力大的行业和企业的股票。		
业绩比较基准	70%×中国A股市场综合收益率+30%×中国国债指数(财富)		
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于中风险偏高的基金品种		
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		

### 3.1 主要财务指标

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	-202,644,289.69
2.本期利润	-356,430,444.45
3.加权平均基金份额本期利润	-1.6861
4.期末基金资产净值	730,613,689.85
5.期末基金份额净值	3.3000

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 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2015年7月1日～2015年9月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-202,644,289.69	
2.本期利润	-356,430,444.45	
3.加权平均基金份额本期利润	-1.6861	
4.期末基金资产净值	730,613,689.85	
5.期末基金份额净值	3.3000	

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 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	业绩比较基准收益率②	差额③	①-③	②-④
过去三个月	-31.81%	3.36%	-20.03%	2.27%	-11.01%

本基金业绩比较基准:70%×富时中国A600指数收益率+30%×中国国债总指数(财富)。  
富时中国A600指数是富时指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所总市值最大的600只股票并由中国国债总指数(财富)是中央国债登记结算有限责任公司推出的中国国债总指数,该指数系基于全国市场国债的指数,价格选上更重于全国银行间债券市场,选择广泛,全面而细致地反映债券市场变动。

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



注:上述净值表现为本基金本报告期末持有的全部资产。  
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细  
本基金本报告期末未持有贵金属。  
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。  
5.5 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
5.5.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
5.5.2 本基金投资股指期货的投资政策  
在报告期内,本基金未投资股指期货,该策略符合基金合同的规定。  
5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
5.10.1 在报告期内,本基金未投资国债期货,该策略符合基金合同的规定。  
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未投资国债期货持仓和损益明细。  
5.10.3 本报告期内国债期货投资政策和程序  
本报告期本基金没有投资国债期货。  
5.11 投资组合报告附注  
5.11.1

注:证券从属的含义遵从行业协会《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指公司相关公告中披露的日期。

#### 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时间	证券从业年限	说明
陈丹梅	本基金基金经理	2015年4月3日	8	曾任:中国人保人寿、招商证券、CFA,CPA,1997年进入泰达宏利基金管理有限公司,曾任泰达宏利基金研究主管、基金经理助理、基金经理等职务,具有多年证券基金从业经验,具备基金从业资格。

注:证券从属的含义遵从行业协会《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指公司相关公告中披露的日期。

#### 4.2 管理人对于报告期内本基金投资运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人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行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 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信息、投资建议和投资决策方面享有平等权利;严格执行投资管理制度和投资决策流程的隔离;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、可稽核、可持续;交易运作与交易系统中设置的公平交易功能并能按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令;对于部分融券—融券中购,非公平交易指令采取以公司名义进行的双边交易,交易按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配,确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数量统计、分析。在本报告期内,没有发生利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度,对异常交易行为进行事前、事中、事后的监控,风险管理部定期对投资组合的异常交易行为进行分析评估,向公司风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的异常行为分析报告。在本报告期内,本基金管理人旗下所有投资组合的同日反向交易成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的5%,在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

##### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

市场在6月份触底之后企稳,上证指数在3000到4000点之间震荡了约一个月时间,8月中旬以后,在人民币贬值预期以及全球股市连环下跌的驱动下,上证指数出现大幅反弹及2850点,但在3000至3200点区间内窄幅波动。

本基金在二季度期间重点配置了养殖股和国企改革个股,的主要原因是,前期新三板业务和国企改革的公司未来仍将面临证的过程,在政策支持下还将向下游行业拓展,而养殖股和国企改革个股在景气周期、估值和估值方面有着较好的优势。本基金8月中旬仓位有所降低,但仍保持在8月下旬该波反弹下跌后大幅扩大,9月中旬之后,以创业板为代表的中小盘有一波小反弹,但主题切换较快,本基金参与较少,仓位没有明显增加。

##### 4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

截止本报告期末,本基金的净值为3.3309元,本报告份额净值增长率为-31.81%,同期业绩比较基准增长率为-20.80%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望  
展望未来季度,宏观的展望主要有如下三点:一是整体经济仍处复苏初期,不具备安全性;二是上市公司三季报业绩超预期较大,三季报业绩超预期个股,在前期业绩超预期个股中,可能涌现一些超预期个股,可以在震荡区间的较低位置适当介入。

4.6 报告期末基金持有人人数或基金资产净值预警说明  
本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

### §5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	494,824,226.66	68.25
2	基金投资	494,824,226.66	68.25
3	固定收益投资	89,664,140.70	12.21
4	其中:债券	89,664,140.70	12.21
5	货币资金	—	—
6	金融衍生品投资	—	—
7	买入返售金融资产	118,000,370.00	16.30
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	—	—
9	银行存款和拆出资金合计	38,789,630.87	5.19
8	其他资产	5,607,503.06	0.76
9	合计	746,885,893.28	100.00

泰达宏利基金管理有限公司  
2015年10月24日

## 信息披露

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	26,031,650.31	3.56
B	采矿业	4,321,599.09	0.59
C	制造业	243,440,142.37	33.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,740,600.00	2.70
E	建筑业	6,689,000.00	0.92
F	交通运输、仓储和邮政业	109,053,083.10	15.00
G	住宿和餐饮业	—	—
H	信息技术、软件和信息技术服务业	13,717,967.26	1.88
I	金融业	41,963,847.61	5.74
K	房地产业	20,902,560.03	2.86
L	租赁和商务服务业	8,387,287.00	1.15
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	36,564.00	0.01
合计		494,824,226.66	67.73

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例
1	601919	中国远洋	4,617,130	41,000,114.40	5.61
2	002094	比亚迪	503,196	35,507,631.95	4.87
3	601328	交通银行	5,137,871	31,238,256.68	4.28
4	601533	广联达	7,375,660	31,198,999.60	4.27
5	300186	大华农	703,024	28,400,430.48	3.87
6	300037	新洁能	1,028,453	25,715,236.34	3.52
7	000000	一汽轿车	1,667,826	24,121,489.26	3.30
8	000669	万向钱潮	1,199,900	23,264,062.00	3.18
9	600428	中远海运	2,002,970	21,872,432.48	2.99
10	600688	东方龙	1,514,400	21,686,205.00	2.97
4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合					
序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
1	国家债券	26,390,437.80	3.61		
2	央行票据	-	-		
3	金融债券	60,198,000.00	8.24		
4	其中:政策性金融债	60,198,000.00	8.24		
5	企业债券	-	-		
6	企业短期融资券	-	-		
7	中期票据	-	-		
8	可转债	3,079,711.90	0.42		
9	其他	-	-		
10	合计	89,664,149.70	12.27		

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160201	16国开11	600,000	60,198,000.00	8.24
2	010107	21国债	132,440	14,127,774.80	1.93
3	010303	03国债(3)	121,100	12,271,063.00	1.68
4	110031	前债转股	24,130	3,079,711.90	0.42

注:上述净值表现为本基金本报告期末持有的全部资产。  
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细  
本基金本报告期末未持有贵金属。  
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。  
5.5 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
5.5.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
5.5.2 本基金投资股指期货的投资政策  
在报告期内,本基金未投资股指期货,该策略符合基金合同的规定。  
5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
5.10.1 在报告期内,本基金未投资国债期货,该策略符合基金合同的规定。  
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未投资国债期货持仓和损益明细。  
5.10.3 本报告期内国债期货投资政策和程序  
本报告期本基金没有投资国债期货。  
5.11 投资组合报告附注  
5.11.1

注:证券从属的含义遵从行业协会《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指公司相关公告中披露的日期。  
4.2 管理人对于报告期内本基金投资运作遵规守信情况的说明  
本报告期内,本基金管理人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行为。

4.3 公平交易专项说明  
4.3.1 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信息、投资建议和投资决策方面享有平等权利;严格执行投资管理制度和投资决策流程的隔离;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、可稽核、可持续;交易运作与交易系统中设置的公平交易功能并能按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令;对于部分融券—融券中购,非公平交易指令采取以公司名义进行的双边交易,交易按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配,确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数量统计、分析。在本报告期内,没有发生利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明  
本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度,对异常交易行为进行事前、事中、事后的监控,风险管理部定期对投资组合的异常交易行为进行分析评估,向公司风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的异常行为分析报告。在本报告期内,本基金管理人旗下所有投资组合的同日反向交易成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的5%,在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
市场在6月份触底之后企稳,上证指数在3000到4000点之间震荡了约一个月时间,8月中旬以后,在人民币贬值预期以及全球股市连环下跌的驱动下,上证指数出现大幅反弹及2850点,但在3000至3200点区间内窄幅波动。

本基金在二季度期间重点配置了养殖股和国企改革个股,的主要原因是,前期新三板业务和国企改革的公司未来仍将面临证的过程,在政策支持下还将向下游行业拓展,而养殖股和国企改革个股在景气周期、估值和估值方面有着较好的优势。本基金8月中旬仓位有所降低,但仍保持在8月下旬该波反弹下跌后大幅扩大,9月中旬之后,以创业板为代表的中小盘有一波小反弹,但主题切换较快,本基金参与较少,仓位没有明显增加。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
截止本报告期末,本基金的净值为3.3309元,本报告份额净值增长率为-31.81%,同期业绩比较基准增长率为-20.80%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望  
展望未来季度,宏观的展望主要有如下三点:一是整体经济仍处复苏初期,不具备安全性;二是上市公司三季报业绩超预期较大,三季报业绩超预期个股,在前期业绩超预期个股中,可能涌现一些超预期个股,可以在震荡区间的较低位置适当介入。

4.6 报告期末基金持有人人数或基金资产净值预警说明  
本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

4.7 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.8 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.9 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.10 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.11 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.12 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.13 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.14 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.15 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.16 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.17 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.18 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.19 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.20 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.21 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.22 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.23 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.24 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.25 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.26 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.27 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.28 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.29 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.30 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.31 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.32 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.33 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.34 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.35 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.36 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.37 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.38 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.39 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.40 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.41 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.42 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.43 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.44 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.45 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.46 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.47 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.48 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.49 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.50 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.51 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.52 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.53 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.54 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.55 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.56 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.57 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.58 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.59 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.60 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.61 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.62 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.63 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.64 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.65 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.66 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.67 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.68 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.69 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.70 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.71 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.72 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.73 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.74 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.75 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.76 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.77 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.78 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.79 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.80 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.81 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

4.82 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.83 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
4.84 基金管理人持有本基金基金份额变动情况  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

## 泰达宏利中证500指数分级证券投资基金

# 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及其更新。  
本报告财务资料未经审计。  
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

基金简称	泰达宏利中证500指数分级证券投资基金
交易代码	162216
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月13日
报告期末基金份额总额	631,437,499.06份
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证500指数,力争获取与标的指数相仿的投资收益,并通过对标的指数的有效跟踪,力求实现长期稳定的超额收益。本基金对标的指数的跟踪目标是:本基金对标的指数的跟踪误差控制在年化跟踪误差率不超过2%以内。
投资策略	本基金采用完全复制法,即按照标的指数的构成及其权重来构建基金的投资组合,并随着标的指数的变化进行相应调整,以期实现跟踪标的指数的目标。本基金的投资范围包括:中证500指数成份股、备选成份股、国内依法发行上市的其他股票(包括中小板、创业板股票)、国内依法发行上市的其他债券(包括国债、金融债、企业债、可转债、分离交易可转债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、中小企业私募债、证券公司短期融资券、超短期融资券、中期票据、短期融资券、中期票据、资产支持证券、