

泰达宏利行业精选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法律责任。

本基金托管人中国银行股份有限公司承诺以诚实信用、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。

本报告书财务资料未经审计。

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	泰达宏利行业混合
交易代码	162204
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年7月8日
报告期末基金总资产	19,341,798,000
投资目标	追求资产的长期持续增值，为投资者寻求高收益而较低风险的资产组合。
投资策略	全面引进先进的风险管理流程，实现“上有所得”资产配置和“下有所值”的风险管理，从而达到“上有所得”和“下有所值”的双重效果。
业绩比较基准	70% * 中证A股指数收益率+30% * 中债国债总指数(财富)
风险收益特征	本基金属于股票型基金，属于风险较高的基金品种。
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

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	-202,444,289.68
2.本期利润	-366,439,444.45
3.加权平均基金份额本期利润	-1.1561
4.期末基金资产净值	730,813,689.85
5.期末基金份额净值	3.3309

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.所列数据不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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	业绩比较基准收益率调整系数③	差额④=①-②	差额标准差⑤
过去三个月	-31.81%	-2030%	2.27%	-11.01%	1.08%

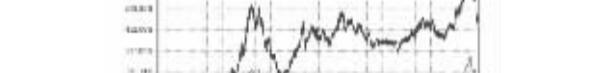
本基金业绩比较基准:70% * 资产配置指数 + 30% * 中债国债总指数(财富)。

富时A股指数是资产配置指数公司编制的综合指数，包含沪深两市流通市值最大的600只股票并以流通股加权的股价指数，具有良好的市场代表性。

中债国债总指数(财富)是中央国债登记结算公司编制的综合国债总指数，该指数系基于全市场交易的国债，价格选取上更广泛，更能反映国债市场的整体走势。

3.2.2 自基金成立以来绩效评价指标的简要说明

3.2.2.1 本报告期内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

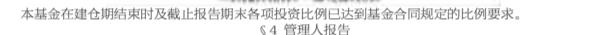


注:1.本基金每份收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所列数据不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2.3 基金净值表现

3.2.3.1 本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



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.所列数据不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2.3.2 本基金成立以来绩效评价指标的简要说明

3.2.3.2.1 本报告期内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



注:1.本基金每份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.所列数据不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2.3.3 基金净值表现

3.2.3.3.1 本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

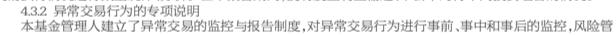


注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所列数据不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2.3.4 基金净值表现

3.2.3.4.1 本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

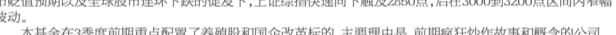


注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所列数据不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2.3.5 基金净值表现

3.2.3.5.1 本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

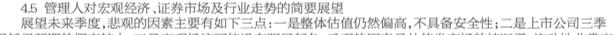


注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所列数据不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2.3.6 基金净值表现

3.2.3.6.1 本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

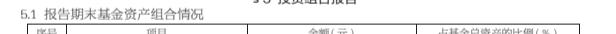


注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所列数据不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2.3.7 基金净值表现

3.2.3.7.1 本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



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.所列数据不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2.3.8 基金净值表现

3.2.3.8.1 本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



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.所列数据不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2.3.9 基金净值表现

3.2.3.9.1 本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

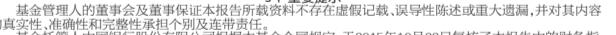


注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所列数据不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2.3.10 基金净值表现

3.2.3.10.1 本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

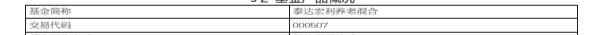


注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所列数据不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2.3.11 基金净值表现

3.2.3.11.1 本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



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.所列数据不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2.3.12 基金净值表现

3.2.3.12.1 本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

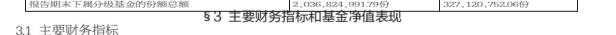


注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所列数据不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2.3.13 基金净值表现

3.2.3.13.1 本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

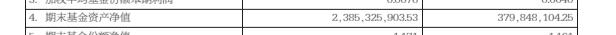


注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所列数据不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2.3.14 基金净值表现

3.2.3.14.1 本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



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.所列数据不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2.3.15 基金净值表现

3.2.3.15.1 本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

