

## 泰达宏利新起点灵活配置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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金管理人和中国银行股份有限公司根据基金合同约定，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	泰达宏利新起点混合
交易代码	000264
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月14日
报告期末基金份额总额	3,789,693,196.76份
投资目标	本基金采取类属资产配置策略，同时深入研究各类型资产的投机机会，力争在基金总资产的长期稳定增长的基础上，实现基金资产的中长期资本增值。
投资策略	本基金将通过资产配置策略，在遵循风险收益的中性原则下，本基金将结合具有较低波动性的债券品种和货币市场工具，力求实现基金资产的长期稳定增长。
业绩比较基准	30%×沪深300指数收益率+70%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。其风险收益特征低于股票型基金，高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		36,944,783.60
2.本期利润		33,747,003.30
3.加权平均基金份额本期利润		0.0066
4.期末基金份额净值		3,989,694,653.50
5.期末基金资产净值		1,022

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.本基金的业绩指标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字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金本期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

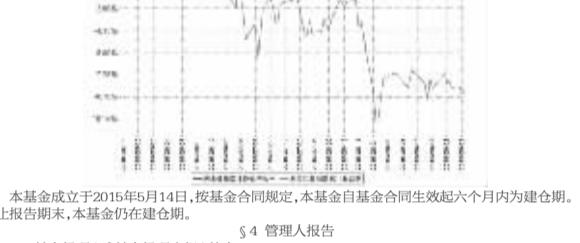
阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.05% -7.28% 1.00% -7.97% -7.97% -0.97%

注:本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率\*70%+中证综合债指数收益率\*30%

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

泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金净值增长率与业绩比较基准收益率比较图



本基金成立于2015年6月14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(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
卓君伟	本基金基金经理,固定收益部总监	2015年6月16日 -	10

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的有关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关部门披露的日期。

4.2 管理人对报告期内基金运作合规性情况的说明

本基金管理人严格按照法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金持有人利益的行为。

4.3 公司治理情况的说明

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，本基金管理人对处于不同投资组合，确保各投资组合享有获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等地位，严格执行投资管理制度和操作流程，以实现投资决策的公平、公正。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本基金管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明。

4.5 报告期内基金的估值政策和程序

本基金管理人对报告期内基金的估值政策和程序说明。

4.6 报告期内基金的费用情况

本基金管理人对报告期内基金的费用情况说明。

4.7 报告期内基金的税收情况

本基金管理人对报告期内基金的税收情况说明。

4.8 影响投资者决策的其他重要信息

1.本公司于2015年6月15日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，聘任刘健先生为公司总经理。

2.4.1 报告期内基金的估值政策和运作分析

三季末，海外市场，美国经济继续好转，9月美联储FOMC会议声明维持利率不变，加息预期和相关不确定性继续困扰全球市场。欧洲经济第二季度好于预期，但随着猪价回落整体走弱，通胀仍然存在。货币政策持续宽松，财政支出快速增加，但工业增速仍然较弱，投资和消费均未出现明显恢复。

国内股市仍然处于底部震荡，生产资料价格逐步走低，商品价格同比一度走强，但随着猪价回落

整体走弱，通胀仍然存在。货币政策持续宽松，财政支出快速增加，但工业增速仍然较弱，投资和消费均未出现明显恢复。

股市上半年上涨后出现大幅回调，管理层出台多项救市举措，投资者谨慎情绪上升。

在准备期内，我们谨慎对待权益市场，以适度的仓位和长期投资债券市场，较好地规避了权益市场的剧烈波动。

4.8.2 报告期内基金的估值政策

本基金管理人对报告期内基金的估值政策说明。

4.8.3 影响投资者决策的其他重要信息

1.本公司于2015年6月15日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，聘任刘健先生为公司总经理。

2.4.2 报告期内基金的份额净值

本基金管理人对报告期内基金的份额净值说明。

4.8.4 报告期内基金的申购赎回费用

本基金管理人对报告期内基金的申购赎回费用说明。

4.8.5 报告期内基金的上市交易情况

本基金管理人对报告期内基金的上市交易情况说明。

4.8.6 报告期内基金的利润分配情况

本基金管理人对报告期内基金的利润分配情况说明。

4.8.7 报告期内基金的费用调整情况

本基金管理人对报告期内基金的费用调整情况说明。

4.8.8 其他需要说明的事项

本基金管理人对报告期内其他需要说明的事项说明。

4.9 报告期内基金的利润分配情况

本基金管理人对报告期内基金的利润分配情况说明。

4.10 报告期内基金的销售情况

本基金管理人对报告期内基金的销售情况说明。

4.11 报告期内基金的促销活动

本基金管理人对报告期内基金的促销活动说明。

4.12 报告期内基金份额持有人交易的情况

本基金管理人对报告期内基金份额持有人交易的情况说明。

4.13 报告期内接待机构调研、沟通、交流和接触次数情况

本基金管理人对报告期内接待机构调研、沟通、交流和接触次数情况说明。

4.14 报告期内基金的年度报告及其摘要的披露情况

本基金管理人对报告期内基金的年度报告及其摘要的披露情况说明。

4.15 报告期内基金的半年度报告及其摘要的披露情况

本基金管理人对报告期内基金的半年度报告及其摘要的披露情况说明。

4.16 报告期内基金的季度报告及其摘要的披露情况

本基金管理人对报告期内基金的季度报告及其摘要的披露情况说明。

4.17 报告期内基金的临时公告及其说明

本基金管理人对报告期内基金的临时公告及其说明。

4.18 报告期内基金的清算情况

本基金管理人对报告期内基金的清算情况说明。

4.19 报告期内基金份额持有人大会召开情况

本基金管理人对报告期内基金份额持有人大会召开情况说明。

4.20 报告期内基金的投诉情况

本基金管理人对报告期内基金的投诉情况说明。

4.21 报告期内营业网点的变更情况

本基金管理人对报告期内营业网点的变更情况说明。

4.22 报告期内信息披露费的支付情况

本基金管理人对报告期内信息披露费的支付情况说明。

4.23 报告期内会计师事务所报酬情况

本基金管理人对报告期内会计师事务所报酬情况说明。

4.24 报告期内税项情况

本基金管理人对报告期内税项情况说明。

4.25 其他需要说明的重大事项

本基金管理人对其他需要说明的重大事项说明。

4.26 其他重要事项

本基金管理人对其他重要事项说明。

4.27 其他重要事项

本基金管理人对其他重要事项说明。

4.28 其他重要事项

本基金管理人对其他重要事项说明。

4.29 其他重要事项

本基金管理人对其他重要事项说明。

4.30 其他重要事项

本基金管理人对其他重要事项说明。

4.31 其他重要事项

本基金管理人对其他重要事项说明。

4.32 其他重要事项

本基金管理人对其他重要事项说明。

4.33 其他重要事项

本基金管理人对其他重要事项说明。

4.34 其他重要事项

本基金管理人对其他重要事项说明。

4.35 其他重要事项

本基金管理人对其他重要事项说明。

4.36 其他重要事项

本基金管理人对其他重要事项说明。

4.37 其他重要事项

本基金管理人对其他重要事项说明。

4.38 其他重要事项

本基金管理人对其他重要事项说明。

4.39 其他重要事项

本基金管理人对其他重要事项说明。

4.40 其他重要事项