

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司  
基金托管人：中国农业银行股份有限公司  
报告日期：2015年10月24日  
重要提示：

基金管理人的董事长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。

基金财产的运作情况说明：本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表未来表现。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报告。

报告期末财务报表未经审计。

报告期为2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称：泰达宏利首选企业股票型证券投资基金

交易代码：162208

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2006年12月1日

报告期末基金份额总额：407,237,996.96份

投资目标：集中投资于行业的首选企业，分享中国经济的高速增长和自主品牌，力争获取长期稳定的资本增值。

基金净值：本基金在各个行业中的首选企业中进行投资，部分分享各行业企业在中国的优势和增长潜力，本基金采用逆向配置和自下而上的投资管理模式，挑选企业并集中投资于企业评级标准，挑选出各行业中的首选企业，构建股票投资组合。原则上，从每个细分行业中挑出表现的企业不超3家。

业绩比较基准：90%×沪深300指数+10%×同业存款利率。

风险收益特征：本基金属于风险较高的股票基金，预期收益和风险高于混合型、债券型和货币市场基金。

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

§ 3 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 -46,481,033.32

2.本期利润 -288,828,004.69

3.加权平均基金份额本期利润 0.07015

4.期末基金份额净值 610,667,894.36

5.期末基金资产净值 14.00%

注：1.本期已实现收益指基金利息收入、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.所有基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金所产生的费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数值。

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(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差(%)

过去三个月 -31.16% -26.12% 2.03% -0.04% 1.30%

本基金的业绩比较基准：90%×沪深300指数+10%×同业存款利率。

3.2.2 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(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差(%)

过去三个月 -3.16% -2.12% 2.03% -0.04% 1.30%

本基金的业绩比较基准：90%×沪深300指数+10%×同业存款利率。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 从何时起 任期年限 说明

张军先生毕业于对外经济贸易大学，管理学硕士。2006年7月至2009年6月任职于泰达宏利基金管理有限公司，担任研究员；2009年7月至2010年4月任职于国海富兰克林基金管理有限公司，负责行业研究、行业配置、行业轮动等工作；2010年5月加盟泰达宏利基金管理有限公司，负责行业研究、行业配置、行业轮动等工作；2010年10月加盟泰达宏利基金管理有限公司，负责行业研究、行业配置、行业轮动等工作。

注：本基金基金经理变更情况见《基金合同》、《招募说明书》或《基金产品资料概要》的有关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金期内，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

# 信息披露 Disclosure

## 泰达宏利首选企业股票型证券投资基金

2015年9月30日

### 2015 第三季度报告

2015年9月30日

基金持有人利益的行为。

4.3 公公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金经理人建立了公平交易制度流程，并严格执行该制度流程。对所有投资组合，在本报告期内，本公司管理人公平对待不同投资组合，确保不同投资组合在投资决策信息、投资决策、投资决策实施方面具有平等机会；严格执行投资管理制度和公平交易制度，对所有投资组合在交易时机选择、交易定价决策等方面，非公平交易行为的申报和审批，以及公司内部各投资组合之间，对交易结果进行公平分配，确保各投资组合享有公平的交易机会。本公司定期对不同投资组合之间的交易行为进行监控分析，在本报告期内，未发生不公平交易、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

本基金经理人建立了异常交易的监控制度，对所有投资组合在交易过程中，对单个账户的交易行为进行监控，风险管理部定期对异常交易行为进行分析，对发现的不同投资组合之间的异常交易行为，及时提醒相关投资组合的基金经理，并要求其书面说明情况，以确定是否存在违反公平交易原则的情形。

4.4 报告期内基金的资运用情况和费用表

4.4.1 报告期内基金的资运用情况

2015年9月30日，本基金的资产总值为1,237,691.26元，负债总计2,467.01元，净资产为1,235,224.25元。

4.4.2 加权平均基金份额本期利润

0.00063

4.4.3 期末基金资产净值

202,031,471.60

4.4.4 期末基金份额净值

1.00%

4.4.5 期末可供分配基金份额利润

1.00%

注：1.本期已实现收益指基金利息收入、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.所有基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金所产生的费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数值。

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(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差(%)

过去三个月 -0.50% -0.07% 15.54% 10.99% -4.17%

本基金的业绩比较基准：90%×沪深300指数+10%×同业存款利率。

3.2.2 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(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差(%)

过去三个月 -0.50% -0.07% 15.54% 10.99% -4.17%

本基金的业绩比较基准：90%×沪深300指数+10%×同业存款利率。

4.5 公公平交易专项说明

4.5.1 公平交易制度的执行情况

本基金定期报告中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

4.5.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金期内，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

金持有人利益的行为。

4.6 报告期内基金的资运用情况和费用表

4.6.1 报告期内基金的资运用情况

2015年9月30日，本基金的资产总值为1,237,911,139.03元，负债总计247,123.92元，净资产为1,237,691,139.03元。

4.6.2 加权平均基金份额本期利润

-0.00079

4.6.3 期末基金资产净值

201,233,722,643.17份

4.6.4 期末基金份额净值

0.99709

注：1.本期已实现收益指基金利息收入、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.所有基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金所产生的费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数值。

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(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差(%)

过去三个月 -0.61% 0.71% 0.93% 0.01% -7.31% 0.70%

本基金的业绩比较基准：90%×沪深300指数+10%×同业存款利率。

3.2.2 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(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差(%)

过去三个月 -0.61% 0.71% 0.93% 0.01% -7.31% 0.70%

本基金的业绩比较基准：90%×沪深300指数+10%×同业存款利率。

4.7 公公平交易专项说明

4.7.1 公平交易制度的执行情况

本基金定期报告中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

4.7.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金期内，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

金持有人利益的行为。

4.8 报告期内基金的资运用情况和费用表

4.8.1 报告期内基金的资运用情况

2015年9月30日，本基金的资产总值为1,237,911,139.03元，负债总计247,123.92元，净资产为1,237,691,139.03元。

4.8.2 加权平均基金份额本期利润

-0.00079

4.8.3 期末基金资产净值

201,233,711,407.00份

4.8.4 期末基金份额净值

0.99709

注：1.本期已实现收益指基金利息收入、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.所有基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金所产生的费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数值。

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(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差(%)

过去三个月 -0.61% 0.71% 0.93% 0.01% -7.31% 0.70%

本基金的业绩比较基准：90%×沪深300指数+10%×同业存款利率。

3.2.2 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(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差(%)

过去三个月 -0.61% 0.71% 0.93% 0.01% -7.31% 0.70%

本基金的业绩比较基准：90%×沪深300指数+10%×同业存款利率。

4.9 公公平交易专项说明

4.9.1 公平交易制度的执行情况

本基金定期报告中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

4.9.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金期内，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

金持有人利益的行为。

4.10 报告期内基金的资运用情况和费用表

4.10.1 报告期内基金的资运用情况

2015年9月30日，本基金的资产总值为1,237,911,139.03元，负债总计247,123.92元，净资产为1,237,691,139.03元。

4.10.2 加权平均基金份额本期利润

-0.00079

4.10.3 期末基金资产净值

201,233,711,407.00份

4.10.4 期末基金份额净值

0.99709

注：本基金的基金合同生效日为2014年4月17日，根据基金合同的约定，本基金建仓期为6个月，建仓期结束时本基金各

项资产配置比例符合基金合同的约定。

4.10.5