

泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金

[2015] 第四季度报告

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:2016年1月22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2016年1月20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10月1日至2015年12月31日。

§ 2 基本产品概况

基金简称	泰达宏利新思路混合
交易代码	001419
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月16日
报告期末基金份额总额	1,690,199,360,909份

投资目标 本基金主要投资于股票的内部收益率，通过风格轮动和行业配置，在风格与收益的均衡。

本基金的业绩比较基准深入理解市场机理，力求实现基金资产的持续增值。

本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10月1日至2015年12月31日。

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)

1.本期已实现收益 18,440,896.42

2.本期利润 27,324,276.43

3.加权平均基金份额本期利润 0.0126

4.期末基金资产净值 1,713,461,272.34

5.期末基金份额净值 1.016

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 本报告期末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 1.30% 0.09% 9.46% 0.03% -8.16% -0.74%

本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*60%+中证综合债指数收益率*40%

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

注:1.本基金于2015年6月16日成立，截至报告期末本基金成立不满一年。按基金合同规定，自基金合同生效日起六个月内为建仓期。本基金在建仓期结束后及截至报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

§ 4 管理人报告

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期限	证券从业年限	说明
丁宇佳	本基金基金经理	2015年6月16日	-	7

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》的相关规定。表中的任职日期和离任日期均以公司相关公告中披露的日期为准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵守法律法规情况的说明

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，没有出现损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平等交易机制的执行情况

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，本基金管理人平等待遇对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资机会、投资建议和投资决策方面享有平等的机会；严格执行公平交易操作流程，并确保公平交易执行情况符合公平交易原则，从而确保各投资组合获得公平的交易机会。

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、事中和事后的监控，风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评价，向公司风控委员会提交公募基金和特定客户组合的交易行为分析报告。在报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合的当日反向交易成交较少的单边成交量均不超过该证券当日成交量的%，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 报告期内本基金投资策略和运作分析

2015年第四季度，美元经济继续好转，12月美联储宣布加息25BP，市场对明年加息次数及幅度仍然分歧较大。欧洲央行经济复苏动力强，新兴市场更加动荡。

国内经济仍面临较大的压力，工业增速维持低位，出口数据持续回落，受汽车消费刺激政策影响，消费数据略有回升，商品房销售反弹明显，但投资仍然疲弱。货币政策持续宽松，资本流动对国内流动性产生一定影响，人民币贬值预期增强，导致资金外流。

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、事中和事后的监控，风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评价，向公司风控委员会提交公募基金和特定客户组合的交易行为分析报告。在报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合的当日反向交易成交较少的单边成交量均不超过该证券当日成交量的%，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。

4.5 报告期内本基金的业绩表现

4.5.1 投资组合报告

4.5.1.1 投资组合报告

4.5.1.2 基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

4.5.1.3 基金投资的前十名证券

4.5.1.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

4.5.1.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

4.5.1.6 投资组合报告附注

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金

[2015] 第四季度报告

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:2016年1月22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2016年1月20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10月1日至2015年12月31日。

§ 2 基本产品概况

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	000766	万科A	1,813,122	16,896,306.26	0.09
2	000128	中行国际	16,107,537.34	0.08	
3	300193	佳士科技	13,049,124.00	0.07	
4	002029	七匹狼	12,549,401.75	0.07	
5	300147	香雪制药	11,679,670.00	0.06	
6	000366	万华化学	8,914,280.00	0.05	
7	601336	新华保险	8,079,771.00	0.04	
8	000728	国元证券	200,000	4,519,000.00	0.02
9	002521	齐峰新材	265,000	3,312,500.00	0.02
10	000666	金利科技	231,500	1,222,320.00	0.01
合计			10,619,422.30	5.03	

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 行业类别

5.2.2 行业配置

5.2.3 行业配置

5.2.4 行业配置

5.2.5 行业配置

5.2.6 行业配置

5.2.7 行业配置

5.2.8 行业配置

5.2.9 行业配置

5.2.10 行业配置

5.2.11 行业配置

5.2.12 行业配置

5.2.13 行业配置

5.2.14 行业配置

5.2.15 行业配置

5.2.16 行业配置

5.2.17 行业配置

5.2.18 行业配置

5.2.19 行业配置

5.2.20 行业配置

5.2.21 行业配置

5.2.22 行业配置

5.2.23 行业配置

5.2.24 行业配置

5.2.25 行业配置

5.2.26 行业配置

5.2.27 行业配置

5.2.28 行业配置

5.2.29 行业配置

5.2.30 行业配置

5.2.31 行业配置

5.2.32 行业配置

5.2.33 行业配置

5.2.34 行业配置

5.2.35 行业配置

5.2.36 行业配置

5.2.37 行业配置

5.2.38 行业配置

5.2.39 行业配置

5.2.40 行业配置

5.2.41 行业配置

5.2.42 行业配置

5.2.43 行业配置

5.2.44 行业配置

5.2.45 行业配置

5.2.46 行业配置

5.2.47 行业配置

5.2.48 行业配置

5.2.49 行业配置

5.2.50 行业配置

5.2.51 行业配置

5.2.52 行业配置

5.2.53 行业配置

5.2.54 行业配置

5.2.55 行业配置

5.2.56 行业配置