

## 泰达宏利价值优化型成长类行业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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人及交通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。

基金定期报告中更详细地披露了基金的财务状况，但不保证基金一定盈利。

基金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他资料。

本报告财务数据未经审计。

本报告期间为2015年10月1日至2015年12月31日。

## § 2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利成长混合
交易代码	162201
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2009年4月26日
报告期末基金份额总额	650,701,463.04份

本基金主要投资于成长行业类别的内在价值被相对低估，并与同行业类别上市公司相比具有更佳增长潜力的上市公司。在充分控制投资风险的前提下，本基金将积极寻求并把握具有长期持续增长的投资机会。

本基金采用“自上而下”的投资方法，具体体现在资产配置、行业配置和个股选择的全过程中。

本基金业绩比较基准：65% × 沪深300A股成长指数 + 35% × 上证国债指数。

风险收益特征 本基金在基金资产中属于较高风险的基金品种。

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 交通银行股份有限公司

§ 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

报告期( 2015年10月1日 - 2015年12月31日 )

1.本期实现收入 146,278,010.00

2.本期利润 220,758,306.01

3.加权平均基金份额本期利润 0.3368

4.期末基金份额净值 1,062,744.719/31

5.期末可供分配利润 14,869.00

注：1.本期已实现收益指本基金本期利息收入、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 本基金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(%) 净值增长标准差(%) 稳定性系数(%) 最近一季度 ①-③ ②-④  
过去三个月 24.00% 2.06% 14.11% 13.0% 0.89% 0.76%

本基金业绩比较基准：65% × 沪深300A股成长指数 + 35% × 上证国债指数。

上证国债指数选取的样本为在上海证券交易所上市的、除浮息债外的国债品种，样本公司债的剩余期限分布均匀，收益曲线较为平稳、合理，而且样本丰富，竞价交易连续性强，更能反映出市场利率变化情况，客观、真实地表示出债券市场价格波动的收益风险。

本基金在建仓期结束时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 在本基金的基金管理期间 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

周丽娟	本基金基金经理	2015年9月14日	-	5	2010年7月加入泰达宏利基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理、研究总监、基金经理等职务，具有10年从业经验。
邓芝颖	本基金基金经理	2015年9月11日	-	10	金融硕士，2004年7月至2006年6月就职于国泰君安证券有限公司，2006年7月至2008年1月就职于国泰君安证券有限公司，2008年1月加入泰达宏利基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理、基金经理等职务，具有6年从业经验。

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为公司相关公告披露的日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵守诚信守信情况的说明

本报告期内，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 公平交易执行的执行情况

本基金基金经理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，本基金基金经理对公平交易制度和公平交易机制安排，并确保公平交易可操作、可评估、可稽核，可追溯；交易部则在设置公平交易机制并按照时间优先、价格优先的原则执行指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，交易型理财产品严格按照公平交易制度执行，确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对公平交易执行情况进行统计、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

本基金基金经理建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行前审、事中和事后的监控，防范经营层对各投资组合的交易行为进行干预评估，向公司风控委员会提交公平交易监测报告。

客户服务中心对异常交易行为进行公开报告。在本报告期内，基金管理人旗下所有投资组合均未出现因异常交易而受到监控股机构的处罚情况。

4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析

本基金在操作中，发挥专注新兴产业领域投资的优势，积极在新能源车、文化传媒、医疗服务等领域选股，取得了超越基准的回报。

4.5 报告期内基金的绩效表现

截止报告期末，本基金份额净值为1,062,744.719元，本报告期份额净值增长率为24.00%，同期业绩比较基准增长率为4.34%。

4.6 报告期内基金持有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

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额( 元 )	占基金总资产的比例( % )
1	权证投资	799,064,022.04	72.04
2	其中：股票	799,064,022.04	72.04
3	固定收益投资	217,000,200.00	19.64
4	其中：债券	217,000,200.00	19.64
5	贵金属投资	2,500,123.05	0.23
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中：买断式回购的买入返售金融资产	82,096,401.01	7.40
8	其他资产	7,781,094.00	0.70
9	合计	1,109,067,640.00	100.00

本基金业绩比较基准：65% × 沪深300A股成长指数 + 35% × 上证国债指数。

上证国债指数选取的样本为在上海证券交易所上市的、除浮息债外的国债品种，样本公司债的剩余期限分布均匀，收益曲线较为平稳、合理，而且样本丰富，竞价交易连续性强，更能反映出市场利率变化情况，客观、真实地表示出债券市场价格波动的收益风险度。

本基金在建仓期结束时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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额 899,307,500.00

报告期期间基金总申购份额 36,291,171.73

减：报告期期间基金赎回份额 104,837,251.29

报告期期间基金净变动份额( 份额减少以“-”填列 ) -18,546,080.56

报告期末基金份额总额 620,761,463.04

注：本基金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为公司相关公告披露的日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵守诚信守信情况的说明

本报告期内，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 公平交易执行的执行情况

本基金基金经理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，本基金基金经理对公平交易制度和公平交易机制安排，并确保公平交易可操作、可评估、可稽核，可追溯；交易部则在设置公平交易机制并按照时间优先、价格优先的原则执行指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，交易型理财产品严格按照公平交易制度执行，确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对公平交易执行情况进行统计、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

本基金在操作中，发挥专注新兴产业领域投资的优势，积极在新能源车、文化传媒、医疗服务等领域选股，取得了超越基准的回报。

4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析

本基金在操作中，发挥专注新兴产业领域投资的优势，积极在新能源车、文化传媒、医疗服务等领域选股，取得了超越基准的回报。

4.5 报告期内基金的绩效表现

截止报告期末，本基金份额净值为1,062,744.719元，本报告期份额净值增长率为24.00%，同期业绩比较基准增长率为4.34%。

4.6 报告期内基金持有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 备查文件目录

4.7.1 基金合同

4.7.2 基金托管协议

4.7.3 报告期内基金的临时公告及说明

4.7.4 基金代销协议

4.7.5 基金上市公告书

4.7.6 基金定期报告

4.7.7 其他文件

4.7.8 基金份额持有人名册

4.7.9 基金销售机构

4.7.10 基金募集申请表

4.7.11 基金募集申请复核确认表

4.7.12 基金募集缴款凭证

4.7.13 基金验资报告

4.7.14 基金合同成立公告

4.7.15 基金募集资金到账证明

4.7.16 基金验资报告

4.7.17 基金合同生效的公告

4.7.18 基金募集规模

4.7.19 基金募集报告

4.7.20 基金募集报告复核

4.7.21 基金募集报告文本

4.7.22 基金募集报告摘要

4.7.23 基金募集报告全文

4.7.24 基金募集报告摘要全文

4.7.25 基金募集报告全文

4.7.26 基金募集报告摘要全文

4.7.27 基金募集报告全文

4.7.28 基金募集报告摘要全文

4.7.29 基金募集报告全文

4.7.30 基金募集报告摘要全文

4.7.31 基金募集报告全文

4.7.32 基金募集报告摘要全文

4.7.33 基金募集报告全文

4.7.34 基金募集报告摘要全文

4.7.35 基金募集报告全文

4.7.36 基金募集报告摘要全文

4.7.37 基金募集报告全文

4.7.38 基金募集报告摘要全文

4.7.39 基金募集报告全文

4.7.40 基金募集报告摘要全文

4.7.41 基金募集报告全文

4.7.42 基金募集报告摘要全文

4.7.43 基金募集报告全文

4.7.44 基金募集报告摘要全文

4.7.45 基金募集报告全文

4.7.46 基金募集报告摘要全文