

泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

[2016] 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:2017年1月20日

§ 1 重要提示
基金管理人的董事、监事及董事会秘书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、及时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2017年1月18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，保证复核后不存在虚假记载、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当仔细阅读本基金的招募
说明书及其摘要。

§ 2 报告期未按行业分类的股票投资组合

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 简称 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|--------|---------------------------------|--------------------|---------|--------------|
| 000006 | 机械、仪表、商业 服务 | 207,386,400.00 | 6.13% | |
| 000008 | 电气、家用电器 | 4,326,792,000.00 | 20.09% | |
| 000009 | 通信、计算机、电子 设备 | 56,300,360,000.00 | 24.23% | |
| 000010 | 电力、热力、燃气及水 生产和供应业 | 4,034,407,000.00 | 1.72% | |
| 000011 | 建筑业 | 1,028,813,815.00 | 0.44% | |
| 000012 | 批发和零售业 | 6,705,304,000.00 | 2.88% | |
| 000013 | 交通运输、仓储和邮政 业 | 1,722,708,000.00 | 0.73% | |
| 000014 | 住宿和餐饮业 | 301,102,000.00 | 0.01% | |
| 000015 | 信息传输、软件和信息 技术服务业 | 6,741,200.00 | 0.00% | |
| 000016 | 房地产业 | 7,434,370,000.00 | 3.19% | |
| 000017 | 采矿业 | 2,620,390,000.00 | 1.11% | |
| 000018 | 科学研究、技术服务 和地质勘查业 | — | — | |
| 000019 | 水、环境和公共设施、 居民服务、修理和其他 服务业 | 1,274,226,000.00 | 0.05% | |
| 000020 | 教育 | — | — | |
| 000021 | 卫生和社会工作 | — | — | |
| 000022 | 文化、体育和娱乐业 | 306,002,000.00 | 0.01% | |
| 000023 | 综合 | 1,071,612,000.00 | 0.07% | |
| 000024 | 合计 | 101,308,400,000.00 | 42.09% | |

§ 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(2016年10月11日-2016年12月31日)

1.本期利润 -4,527,900.00

2.本期利润/期初净资产 -0.22% 3.06%

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0001

4.期末基金资产净值 235,105,304.00

5.期末基金份额净值 0.9984

注:本期利润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

报告期(2016年10月11日-2016年12月31日)

净值增长率为 -0.11% 同期业绩比较基准收益率 -0.01%

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

报告期(2016年10月11日-2016年12月31日)

净值增长率为 -0.11% 同期业绩比较基准收益率 -0.01%

本基金在建仓期结束时及截止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时间 证券从业年限

刘欣 本基金基金经理,金融工程部总经理 2016年11月17日 - 9

杨超 本基金基金经理 2010年11月20日 - 6

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
任日期均指公司向中国证监会披露的日期。

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
出现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 公平交易制度的执行情况

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,基金管理人

公平对待不同投资组合,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会;严格执

行投资管理职能和交易执行职能的隔离;在交易环节实行集中交易制度,并确保公平交易可操作,可评估,可稽
核,可持续;交易员运用交易系统中设置的公平交易机制并按时间优先、价格优先的原则严格执行所有指
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,交易员按照价格优先、比价
分配的原则对交易结果进行分配,确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对本报告期的公
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 公平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估,向公司风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合
的交易行为分析报告。本报告期内,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反
向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况共出现了 19 次。19 次涉及的投资组合一
方均为按照量化策略进行投资,虽然买卖股票量少,但由于个股波动性较差,交易量小,致使其交投的单边
交易量仍然超过该证券当日成交量 5%,未发现异常。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 报告期内基金投资策略和运作分析

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,基金管理人

公平对待不同投资组合,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会;严格执

行投资管理职能和交易执行职能的隔离;在交易环节实行集中交易制度,并确保公平交易可操作,可评估,可稽
核,可持续;交易员运用交易系统中设置的公平交易机制并按时间优先、价格优先的原则严格执行所有指
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,交易员按照价格优先、比价
分配的原则对交易结果进行分配,确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对本报告期的公
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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内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
千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位:人民币元

报告期(2016年10月11日-2016年12月31日)

1.本期利润 -6,259,702.97

2.本期利润/期初净资产 -0.26% 3.06%

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0012

4.期末基金资产净值 203,579,305.00

5.期末基金份额净值 0.9984

注:本期利润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。

3.2.3 本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

报告期(2016年10月11日-2016年12月31日)

净值增长率为 -0.11% 同期业绩比较基准收益率 -0.01%

本基金在建仓期结束时及截止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

报告期(2016年10月11日-2016年12月31日)

基金总份额 227,095,411.00

基金份额净值 1.0000

本报告期内基金持有人数 200

基金份额净值波动情况

注:本基金的管理人及关联人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

§ 7 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期(2016年10月11日-2016年12月31日)

基金管理人持有的基金份额 11,795,411.00

占基金总份额比例 5.17%

基金管理人持有的基金份额变动情况

报告期(2016年10月11日-2016年12月31日)