

# 泰达宏利风险预算混合型证券投资基金

## 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:交通银行股份有限公司

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。

基金托管人:交通银行股份有限公司根据基金合同规定,于2017年1月18日复核了本报告中的财务指

标、净值表现和资产组合报告等内容,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2016年10月1日至2016年12月31日。

### § 2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利风险预算混合
交易代码	162206
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月1日
报告期末基金份额总额	214,096,338.10份

投资目标 本基金通过风险预算的策略,力争超越行业平均基准的长期回报

投资策略 本基金在综合考虑风险和收益的基础上,通过风险预算的策略,使本基金在风险和收益之间达到一个合理的平衡, 大幅度地改善收益和风险的性价比,从而在风险和收益之间达到一个合理的平衡。

业绩比较基准 一周期定期存款利率(税后)+10%\*沪深300指数20%+中证金融债指数5%+中证企业债指数5%

风险收益特征 本基金为混合型基金,风险收益特征介于股票型基金与债券型基金之间。

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

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2016年10月1日 - 2016年12月31日)

1.本期利润 7,016,661.68

2.本期利润/期初基金份额总额 3.085,223.00

3.期末基金资产净值 218,497,594.01

4.期末基金份额净值 1.0000

5.期末基金资产总额 71,562,847.82

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)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)扣除相关费用后的余额。

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

序号 股票型 业绩比较基准 1 净值增长率 2 业绩比较基准收益率 3 1-3 4 ①-④

过去三个月 1.40% 0.28% 0.21% 0.16% 1.19% 0.12%

本基金业比较基准:5%×中证国债指数+15%×中证企业债指数+10%×中证中企业债指数+20%×中证中国A股200指数+50%×税后一年定期存款利率(税后)

富时中国A股200前200指数是编制公司编制的三个市场(银行间市场、沪深交易所)的一年期以上的国债,中证金融债指数样本涵盖银行间市场上一年期以上的金融债,中证企业债指数样本涵盖了三个市场上一年期以上的企业债,分别反映了我国债券市场不同信用级别的债券的收益率变化趋势,具有良好的市场代表性。

3.2.2 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

图:泰达宏利风险预算混合基金净值走势图

本基金在建仓期结束时及截至报告期末各项资产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间	证券从业年限	说明
丁宇维	本基金基金经理	2016年9月30日	-	理学硕士,2008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,2013年3月起先后担任基金经理助理、基金经理、基金经理,2016年9月起任本基金基金经理。丁宇维先生对宏观经济和行业研究有深入理解,具备丰富的投资经验,其管理的基金业绩表现良好。
刘欣	本基金基金经理、 金融工程部 总经理	2016年9月30日	-	理学硕士,2007年7月至2008年12月就职于工商银行基金部,2008年12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,2010年1月起先后担任基金经理助理、基金经理、基金经理,2016年9月起任本基金基金经理。刘欣先生对宏观经济和行业研究有深入理解,具备丰富的投资经验,其管理的基金业绩表现良好。

注:证券从业的含义遵从《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相关公告中披露的日期。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金运作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

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,本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

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,本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.3.2 公平交易执行的专项说明

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.4 报告期内基金的交易情况

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,本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.4.2 公平交易执行的专项说明

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.1 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.3 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.4 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.5 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.6 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.7 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.8 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.9 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.10 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.11 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.12 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.13 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.14 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.15 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.16 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.17 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.18 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.19 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.20 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.21 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人对不同投资组合,确保各投资组合在得到投资机会、投资决策和投资决策方面有平等机会;严格执行投资管理制度和公平交易执行的隔离,在公平交易环节集中交易制度,并确保公平交易可操作,可审核,交易部根据公平交易制度和公平交易执行情况定期向督察长报告。

4.5.22 报告期内基金的业绩表现</