

# 泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金

## [2017] 第一季度报告

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司  
基金托管人：中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期：2017年4月21日

**§ 1 重要提示**  
基金管理人的董事及董事会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。  
基金托管人就本基金履行了应尽的职责，于2017年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告的内容，保证复核结果不存在虚假记载、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。

本报告财务数据未经审计。

本报告财务数据为2017年1月1日至2017年3月31日。

**§ 2 基金产品概况**

基金简称	泰达宏利睿智混合
交易代码	000901
基金份额总额	3,000,000.00
基金的开放方式	定期开放式
基金合同生效日	2016年1月1日
报告期末基金份额总额	1,138,903,310.00
报告期末基金资产净值	-65,312,100.00
基金本期份额净值	0.9743
报告期末基金份额净值	0.9743

通过运用量化技术进行风险管理，本基金将下行风险的限制作为主要目标。

本基金将寻求低风险、低波动率的资产配置，也是通过优化资产配置、限额配置

策略，帮助投资者获得一定的收益水平，从而实现低风险下获得高收益的理财目

标。本基金将通过量化分析，帮助投资者识别并降低基金资产的波动率，从而达到

平均收益，从而在控制风险的前提下获得更多的收益。

业绩比较基准 30%股票+70%债券+6%-8%现金类资产的平均收益率+6%

本基金为混合型基金，具有较高的风险，较低的预期收益，其预期风险和

预期收益均低于股票基金，高于债券型基金和货币市场基金。

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

单位：人民币元

**3.1 主要财务指标**

报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)

1.本期已实现收益 -20,716,732.10

2.本期利润 -16,334,495.61

3.期初至报告期期末的累计损益 -0.0532

4.期末基金净值 -1,109,500,197.10

5.期末基金份额净值 0.9743

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，本期初至本报告期利息收入、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。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期内基金份额净值增长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(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.46% 0.43% 1.46% 0.19% -2.96% 0.24%

本基金业绩比较基准：中证综合指数收益率\*65%+沪深300指数收益率\*35%

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

图例：泰达宏利睿智混合基金净值增长率(%)

泰达宏利睿智混合基金净值增长率(%)

业绩比较基准(%)

泰达宏利睿智混合基金净值增长率(%)

泰达宏利睿智混合基金净值增长率(%)