泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:华夏银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月26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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月24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2017年7月1日至2017年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利创盈混合
交易代码	001141
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月30日
报告期末基金份额总额	296,033,585.81份
投资目标	在有效控制风险的基础上,通过主动管理,力争创造高于业绩比较基准的投资收益
投资策略	本基金管理人充分发挥自身的研究优势,将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,自上而下决定债券组合久期、期限结构配置及债券类别配置;同时在严谨深入的信用分析基础上,综合考量企业债券的信用评级以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,自下而上地精选具有较高投资价值的个券。同时,本基金深度关注股票市场的运行状况与相应风险收益特征,在严格控制基金资产运作风险的基础上,把握投资机会
业绩比较基准	中债总财富总指数×2%
风险收益特征	本基金为混合型基金,在证券投资基金中属于较高风险的品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金、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	华夏银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	泰达宏利创盈混合A / 泰达宏利创盈混合B
下属分级基金的交易代码	001141 / 001142
报告期末下属分级基金的份额总额	254,472,627.89份 / 31,560,957.92份

§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

主要财务指标	报告期(2017年7月1日 - 2017年9月30日)	
	泰达宏利创盈混合A	泰达宏利创盈混合B
1. 本期已实现收益	12,154,507.72	1,180,205.49
2. 本期利润	17,631,746.38	1,749,053.71
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0572	0.0549
4. 期末基金资产净值	302,897,115.00	36,800,724.72
5. 期末基金份额净值	1.190	1.166

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

泰达宏利创盈混合A

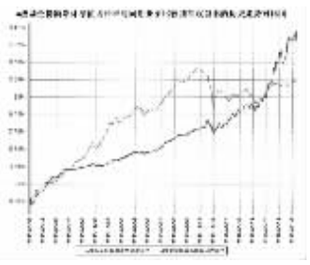
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.03%	0.28%	0.83%	0.06%	4.20%	0.23%

泰达宏利创盈混合B

阶段	净值增长率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	4.95%	0.29%	0.83%	0.06%	4.12%	0.24%

注:本基金业绩比较基准:中债总财富总指数×2%。

3.2.2 自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



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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
丁宇佳	本基金基金经理	2015年6月11日	2017年9月4日	9	理学学士;2008年7月加入泰达宏利基金管理有限公司,担任交易部交易员,负责债券交易工作;2013年9月至2014年9月,担任固定收益部研究员,从事债券研究工作;2014年10月至2015年2月,担任固定收益部基金经理助理;现任基金经理兼固定收益部总经理助理;具备9年基金从业经验,9年证券投资管理经验,具有基金从业资格。
庞宝臣	本基金基金经理	2016年8月5日	2017年9月4日	11	理学硕士;2006年7月至2011年8月,任职于永安财产保险股份有限公司,担任投资经理,负责债券研究与投资工作;2011年9月至2012年8月,任职于幸福人寿保险股份有限公司,担任高级经理,固定收益投资至负责人,负责债券投资工作;2012年9月至2014年9月,任职于中华联合保险股份有限公司投资管理部,担任高级主管一职;2014年9月至2016年3月7日,任职于中华联合保险控股股份有限公司,担任投资经理一职;2016年3月10日加入泰达宏利基金管理有限公司,担任固定收益部基金经理一职;具备11年基金从业经验,11年证券投资管理经验,具有基金从业资格。
傅浩	本基金基金经理	2017年5月27日	-	10	理学硕士;2007年7月至2011年8月,任职于东兴证券研究所,担任固定收益研究员;2011年8月至2013年4月,任职于中邮证券有限责任公司,担任投资主办人;2013年5月至2014年4月,任职于民生证券股份有限公司,担任投资经理;2014年5月至2016年11月,任职于中加基金管理有限公司固定收益部,担任投资经理;2016年11月29日加入泰达宏利基金管理有限公司,担任固定收益部基金经理助理;现任基金经理,具备10年证券投资管理经验,具有基金从业资格。

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相关公告中披露的日期。

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,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,本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;交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、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,交易部按照价格优先、比例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数量统计、分析。在本报告期内,未发现利益输送、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的5%的情况共出现了2次,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

基本面虽然见顶,但是货币政策短期内不会发生逆转。我们认为,本轮市场调整的高点在三季度已经出现,基本面下滑、政策继续强化下未来很有可能是个非常缓慢的收益率下降过程。

报告期内,本基金债券投资策略是是增持高等级、长久期品种,严格规避中低等级信用债。由于信用利差和期限利差处于极低位置以及市场的缓慢低波动性,配置长端利率债也成为了我们一个重点配置方向。

股票投资方面,我们坚持稳健投资,精选高股息、高ROE的稳定收益的品种,通过中长期的持有获取上市公司稳定的内生业绩增长,力图获取长期持续的稳健收益;同时我们注重加强对组合回撤和波动率的控制。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达宏利创盈混合A基金份额净值为1.190元,本报告期基金份额净值增长率为5.03%;截至本报告期末泰达宏利创盈混合B基金份额净值为1.166元,本报告期基金份额净值增长率为4.95%;同期业绩比较基准收益率为0.83%。

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	129,481,061.75	33.43
	其中:股票	129,481,061.75	33.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	252,409,000.00	65.17
	其中:债券	252,409,000.00	65.17
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,226,139.17	0.32
8	其他资产	4,171,831.40	1.08
9	合计	387,288,032.32	100.00

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	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	31,783,858.24	9.36
C	制造业	33,597,364.41	9.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	77,286.30	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	94,891.38	0.03
J	金融业	63,567,102.66	18.71
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	79,324.72	0.02
M	科学研究和技术服务业	65,268.20	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.03
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.01
S	综合	-	-
	合计	129,481,061.75	38.12

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000001	平安银行	1,925,500	21,392,305.00	6.30
2	600489	中金黄金	1,545,062	16,563,064.64	4.88
3	600030	中信证券	900,000	16,371,000.00	4.82
4	601857	中国石油	1,900,000	15,181,000.00	4.47
5	000776	广发证券	780,000	14,804,400.00	4.36
6	000800	一汽轿车	1,007,810	13,867,465.60	4.08
7	000876	新希望	1,736,968	12,801,454.16	3.77
8	601601	中国太保	297,662	10,992,657.66	3.24
9	000568	泸州老窖	100,000	5,610,000.00	1.65
10	603882	金域医学	2,763	115,299.99	0.03

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	78,344,000.00	23.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	24,950,000.00	7.34
	其中:政策性金融债	24,950,000.00	7.34
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	70,185,000.00	20.66
6	中期票据	78,930,000.00	23.24
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	252,409,000.00	74.30

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010303	03国债(3)	800,000	78,344,000.00	23.06
2	108601	国开1703	250,000	24,950,000.00	7.34
3	101558027	15峨眉山旅MTN001	200,000	20,076,000.00	5.91
4	011764021	17海润航空SCP001	200,000	20,074,000.00	5.91
5	041758013	17天业CP001	200,000	20,030,000.00	5.90

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的广发证券(000776)于2016年11月28日发布收到证监会依法对场外配资中证券违法违规案件作出行政处罚的通知,广发证券未按照《证券登记结算管理办法》第24条、《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第6条、第8条、第13条、《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第3条第(4)项、《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第50条的规定对客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第28条第1款规定。依据《证券公司监督管理条例》第84条规定,证监会决定对广发证券责令改正,给予警告,没收违法所得6,805,135.75元,并处以20,415,407.25元罚款。

本基金管理人在投资广发证券(000776)前严格执行了对上市公司的调研、内部研究推荐、投资计划审批等相关投资决策流程。上述股票根据股票池审批流程进入本基金备选库,由研究员跟踪研究并分析。上述事件发生后,本基金管理人对上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,因此,没有改变本基金管理人对上述上市公司的投资判断。

本基金投资的其余前九名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	54,503.72
2	应收证券清算款	490,315.94
3	应收股利	-
4	应收利息	3,627,011.74
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,171,831.40

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	泰达宏利创盈混合A	泰达宏利创盈混合B
报告期期初基金份额总额	321,246,440.91	32,059,373.54
报告期期间基金总申购份额	41,413.53	38,090.60
减:报告期期间基金总赎回份额	66,815,226.55	536,506.22
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	254,472,627.89	31,560,957.92

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金的管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170701-20170930	92,335,180.06	0.00	0.00	92,335,180.06	32.28%
	2	20170701-20170930	136,115,245.01	0.00	0.00	136,115,245.01	47.59%
产品特有风险							
报告期内,本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情况,易发生巨额赎回的情况,存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险,以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

注:报告期内,申购份额含红利再投资份额。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金金合同》;

3、《泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资人可通过指定信息披露报纸(《中国证券报》、《上海证券报》)或登录基金管理人互联网网址(http://www.mfcteda.com)查阅。

泰达宏利基金管理有限公司
2017年10月26日

泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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10月26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2017年10月24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2017年7月1日至2017年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利大数据混合
交易代码	002263
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月23日
报告期末基金份额总额	115,981,369.31份
投资目标	本基金采取大类资产配置策略,同时通过计量机器法分析互联网大数据,采用数量化投资方法挖掘潜在投资机会,在严格控制风险的前提下,力争为基金份额持有人创造持久的、稳定的、较高的超业绩比较基准收益
投资策略	本基金通过综合分析互联网大数据所反映的投资者行为作为主线,通过量化投资方式精选个股。一方面,本基金在对投资者整体行为趋势研究的基础上,从"自上而下"的角度对大类资产进行优化配置,并优选受益行业;另一方面,本基金凭借多年来不断积累形成的量化选股框架,从网络点击量等互联网行为数据方面出发,适当结合估值、成长、盈利质量、情绪等因子,以"自下而上"的视角精选出具有较好公司质地但被投资者低估的投资机会,力求在甚御各类风险的前提下获取超越平均水平的良好回报
业绩比较基准	50%*中证800指数收益率+50%*中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益低于股票型基金、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	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	泰达宏利大数据混合A / 泰达宏利大数据混合C
下属分级基金的交易代码	002263 / 002554
报告期末下属分级基金的份额总额	113,786,571.23份 / 2,194,798.08份

§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

主要财务指标	报告期(2017年7月1日 - 2017年9月30日)	
	泰达宏利大数据混合A	泰达宏利大数据混合C
1. 本期已实现收益	15,435,617.69	244,847.05
2. 本期利润	14,434,224.55	227,680.67
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1053	0.1040
4. 期末基金资产净值	145,192,518.21	2,794,066.81
5. 期末基金份额净值	1.2760	1.2730

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.根据泰达宏利基金管理有限公司2017年2月7日发布的《关于泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金与泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同及托管协议的公告》,泰达宏利基金管理有限公司决定自2017年2月9日起,对旗下泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金增加收取销售服务费的C类份额并相应修订基金合同和托管协议。

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

泰达宏利大数据混合A

阶段	净值增长率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	9.14%	0.79%	3.04%	0.31%	6.10%	0.48%

泰达宏利大数据混合C

阶段	净值增长率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	9.00%	0.79%	3.04%	0.31%	5.96%	0.48%

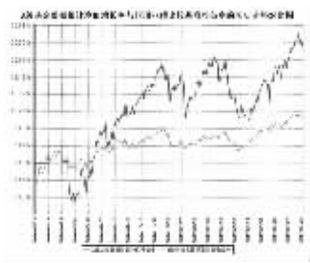
注:1、本基金业绩比较基准:中证800指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%。

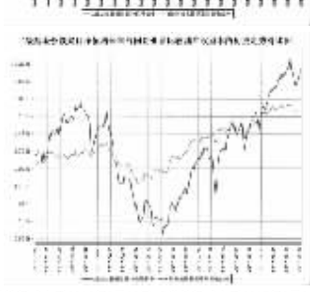
2、本基金A类份额成立于2016年2月23日,C类份额成立于2017年2月9日。

中证800指数是由中证指数有限公司编制,中证500和沪深300成份股一起构成中证800指数成份股,中证800指数综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况,具有良好的市场代表性。中证综合债券指数由中证指数有限公司编制,是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数,较全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势,为债券投资者提供更切合的市场基准。

本基金是混合型基金,基金在运作过程中股票资产占基金资产的比例为0%-95%,其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、债券回购、权证、资产支持证券等金融工具金融工具。因此,"50%*中证800指数收益率+50%*中证综合债指数收益率"是适合衡量本基金投资业绩的比较基准。

3.2.2 自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





本基金A类份额成立于2016年2月23日,C类份额成立于2017年2月9日。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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘欣	本基金基金经理;金融工程部总经理	2016年2月23日	-	10	理学硕士,2007年7月至2008年12月就职于工银瑞信基金管理有限公司;2008年12月至2011年7月就职于景顺基金管理有限公司;2011年7月加盟泰达宏利基金管理有限公司,曾担任产品与金融工程部高级研究员、金融工程部副总经理,现担任金融工程部总经理;具备10年基金从业经验,10年证券投资管理经验,具有基金从业资格。

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相关公告中披露的日期。

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,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,本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;交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、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,交易部按照价格优先、比例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数量统计、分析。在本报告期内,未发现利益输送、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的5%的情况共出现了2次,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

2017年三季度,A股市场基本呈现普涨格局。在经过前两个季度的"一九"行情之后,以创业板指为代表的成长型股票以及小盘股反弹较多,蓝筹股反弹较少,整体市场开始纠偏。但是我们依然认为业绩主导的逻辑会长期存在,以此为基础的慢牛格局已然开始。在当前政策环境下,我们认为未来相当长一段时间内,金融去杠杆、打击内幕交易与市场操纵等仍是市场的主旋律。A股市场的深层次改变仍在继续,在严厉监管、约束再融资、减持新规、加速IPO等因素叠加的背景下,过去数年的重组式投资逻辑正在被打破,中小盘中低盈利股票估值在持续压缩。另一方面,尽管我们看到短期中小盘股票估值出现压缩,但是从长远看,整治金融乱象对投资者保护起到了切实作用,规范引导了市场行为从融资转向投资,对于长期牛市存在提供了较好的支持基础。

本基金在操作中,有效的进行了结构性调整。在以投资者行为大数据分析为主要策略下,兼顾成长、估值、景气等因素,持续选取具有超额收益的股票。在持仓结构上分散由于市场风格大幅波动造成的风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达宏利大数据混合A基金份额净值为1.2760元,本报告期基金份额净值增长率为9.14%;截至本报告期末泰达宏利大数据混合C基金份额净值为1.2730元,本报告期基金份额净值增长率为9.00%;同期业绩比较基准收益率为3.04%。

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	137,691,761.93	92.46
	其中:股票	137,691,761.93	92.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,726,142.55	7.20
8	其他资产	499,146.06	0.34
9	合计	148,917,050.54	100.00

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	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,463,540.00	0.99
B	采矿业	2,260,613.60	1.53
C	制造业	75,408,376.73	50.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,100,673.44	1.42
E	建筑业	4,197,601.00	2.84
F	批发和零售业	17,672,554.93	11.94
G	交通运输、仓储和邮政业	7,268,714.98	4.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,616,178.03	2.44
J	金融业	256,512.00	0.17
K	房地产业	17,213,689.18	11.63
L	租赁和商务服务业	1,279,152.00	0.86
M	科学研究和技术服务业	452,904.00	0.31
N	水利、环境和公共设施管理业	1,937,570.00	1.31
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,092,753.99	0.74
R	文化、体育和娱乐业	12,776.05	0.01
S	综合	1,458,152.00	0.99
	合计	137,691,761.93	93.04

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002221	东华能源	272,051	3,036,089.16	2.05
2	000006	深振业A	265,000	2,610,250.00	1.76
3	300230	永利股份	170,000	2,590,800.00	1.75
4	002589	瑞康医药	171,998	2,466,451.32	1.67
5	601636	旗滨集团	459,700	2,427,216.00	1.64
6	300296	利亚德	117,300	2,363,595.00	1.60
7	600297	广汇汽车	267,100	2,251,653.00	1.52
8	600240	华业资本	210,700	2,151,247.00	1.45
9	600657	信达地产	336,500	2,106,490.00	1.42
10	600511	国药股份	70,500	2,103,015.00	1.42

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本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。

5.11.2

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	46,701.56
2	应收证券清算款	239,782.76
3	应收股利	-
4	应收利息	1,932.70
5	应收申购款	210,729.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	499,146.06

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股