泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)

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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	泰达宏利效率优选混合(LOF)
交易代码	162207
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2006年5月12日
报告期末基金份额总额	730,776,516.33份
投资目标	充分挖掘具有较高投资效率的上市公司,兼顾投资优质债券,力争为投资者获得超出业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取"自上而下"和"自下而上"相结合的投资手段和方法,在正常的市场环境下不作主动性资产配置调整,股票及债券的资产配置比例基本保持在基准比例上下10%的范围内波动。本基金在股票投资策略上,强调在期待经济增长模式转型的大背景之下,选择具有较高或者稳定上升的资产收益率的上市公司,即关注上市公司经营的投资效率,注重公司在经营中对资产的使用效率以及对股东价值的创造。
业绩比较基准	富时中国A600 指数收益率*60%+中证国债指数收益率*35%+同业存款利率*5%
风险收益特征	本基金属于风险较高的混合型证券投资基金。
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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

主要财务指标	报告期(2017年7月1日 - 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	26,236,158.94
2.本期利润	48,901,528.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.0655
4.期末基金资产净值	947,425,150.20
5.期末基金份额净值	1.2965

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

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	5.38%	0.67%	2.78%	0.36%	2.60%	0.31%

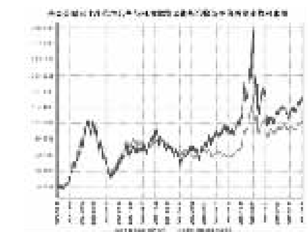
注:本基金业绩比较基准:60%×富时中国A600 指数收益率+35%×中证国债指数收益率+5%×同业存款利率。

富时中国A600 指数是富时指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所总市值最大的600 只股票并以流通股本加权的股票指数,具有良好的市场代表性。

中证国债指数是中证指数公司编制的中国国债指数,涵盖了三个市场中(银行间市场,沪深交易所)的一年期以上的国债,具有良好的流动性和市场代表性。

自2013 年3 月30 日起本基金业绩比较基准变更为 "富时中国A600 指数收益率*60%+中证国债指数收益率*35%+同业存款利率*5%"。详情请参照我公司2013年3月30日发布的《泰达宏利效率优选混合型证券投资基金关于变更业绩比较基准及修改基金合同的公告》。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
吴华	本基金基金经理	2014年3月25日	-	13	金融学硕士,2004年6月至2006年3月就职于易方达基金管理有限公司,担任宏观策略分析员职务;2006年4月至2011年4月就职于中国国际金融有限公司,先后就职于研究部、资产管理部,担任经理、副总经理等职位;2011年5月加入泰达宏利基金管理有限公司。具备13年证券从业经验,13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3季度宏观经济整体平稳,货币和财政政策整体中性,实体经济中行业分化明显。煤炭、有色、钢铁等价格大幅度波动、白酒价格稳中有升。由于宏观调控力度加大,房地产投资相关产业链的景气度有一定程度下滑。

2017年3季度的股市格局和上半年有所不同,但也延续了此前的主体脉络。市场情绪有所升温,主题相对活跃。新能源汽车板块出现了大幅度的上涨。与此前相似的是,整体行业和个股的走势继续在反映经济结构的变化和公司业绩的变化。只是这种反映的速度受到市场风险偏好上升的影响,有所放缓。

本基金继续以"业绩加速"为纲,通过量化初选、基本面精选和估值比较终选的三个步骤,精选并持有了一批长线增长潜力较好、估值比较便宜的优质股票。这些优质股票使得组合既有较好的向上弹性又有较强的抗跌性。此外,基金经理在选股上加深了对公司质地的考量——在过去注重公司运营效率等静态指标的基础上,更加注重企业的长期竞争力和管理团队的精神内核等动态指标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.2965元;本报告期基金份额净值增长率为5.38%,业绩比较基准收益率为2.78%。

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	659,460,519.38	67.66
	其中:股票	659,460,519.38	67.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	281,977,815.80	28.93
	其中:债券	281,977,815.80	28.93
	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	5,544,128.32	0.57
	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	15,681,465.62	1.61
8	其他资产	11,944,337.99	1.23
9	合计	974,608,267.11	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	1,031.00	0.00
C	制造业	550,669,029.23	58.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,634,999.00	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,995,066.15	3.69
J	金融业	69,160,394.00	7.30
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	659,460,519.38	69.61

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	002078	太阳纸业	5,692,615	56,926,150.00	6.01
2	600487	亨通光电	1,630,931	56,104,026.40	5.92
3	600036	招商银行	2,111,800	53,956,490.00	5.70
4	300115	长盈精密	1,256,068	43,422,270.76	4.58
5	002050	三花智控	2,632,539	42,331,227.12	4.47
6	000063	中兴通讯	1,434,120	40,585,596.00	4.28
7	000568	泸州老窖	644,587	36,161,330.70	3.82
8	002236	大华股份	1,453,494	34,985,600.58	3.69
9	002410	广联达	1,601,707	32,754,908.15	3.46
10	002271	东方雨虹	767,347	29,596,573.79	3.12

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	24,826,000.00	2.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	109,957,000.00	11.61
	其中:政策性金融债	109,957,000.00	11.61
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	101,458,815.80	10.71
8	同业存单	-	-
9	其他	45,736,000.00	4.83
10	合计	281,977,815.80	29.76

注:其中其他包含上交所地方政府债,公允价值45,736,000 元,占基金资产净值比例4.8274%。

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	113011	光大转债	673,760	75,070,339.20	7.92
2	160202	16国开02	700,000	69,979,000.00	7.39
3	140393	16重庆18	300,000	26,502,000.00	2.80
4	132001	14宝钢EB	178,340	24,787,476.60	2.62
5	150207	15国开07	200,000	20,044,000.00	2.12

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

报告期内基金投资前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查或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	79,766.83
2	应收证券清算款	9,530,905.31
3	应收股利	-
4	应收利息	2,255,786.76
5	应收申购款	77,879.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,944,337.99

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	75,070,339.20	7.92
2	132001	14宝钢EB	24,787,476.60	2.62

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

报告期期初基金份额总额	757,358,634.74
报告期期间基金总申购份额	5,153,539.22
减:报告期期间基金总赎回份额	31,735,657.63
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	730,776,516.33

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)设立的文件;

2、《泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)基金合同》;

3、《泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》;

4、《泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)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。

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资人可通过指定信息披露报纸(《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》)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

泰达宏利新起点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	泰达宏利新起点混合	
交易代码	001254	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年5月14日	
报告期末基金份额总额	352,820,707.32份	
投资目标	本基金采取大类资产配置策略,同时深入研究各类属资产的投资机会,力争为基金份额持有人创造持久的、稳定的收益回报	
投资策略	本基金将采取主动的类别资产配置策略,注重风险与收益的平衡。本基金将精选具有投资价值的股票和债券,力求实现基金资产的长期稳定增长	
业绩比较基准	30%*沪深300指数收益率+70%*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	泰达宏利新起点混合A	泰达宏利新起点混合B
下属分级基金的交易代码	001254	002313
报告期末下属分级基金的份额总额	352,820,707.32份	-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)	
	泰达宏利新起点混合A	泰达宏利新起点混合B
1. 本期已实现收益	10,899,303.63	-
2. 本期利润	16,060,952.24	-
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0237	-
4. 期末基金资产净值	400,819,694.08	-
5. 期末基金份额净值	1.136	-

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2016年1月21日发布的《关于泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金与泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金增加B类份额并修改基金合同和托管协议的公告》,泰达宏利基金管理有限公司决定自2016年1月25日起,对旗下泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金增加收取销售服务费的B类份额并相应修订基金合同和托管协议。截止至2017年9月30日本基金B级份额为零。

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

泰达宏利新起点混合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	2.16%	0.15%	1.84%	0.17%	0.32%	-0.02%

泰达宏利新起点混合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	2.16%	0.15%	1.84%	0.17%	0.32%	-0.02%

注:本基金业绩比较基准:中证综合债指数收益率*70%+沪深300指数收益率*30%。

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2015年5月14日,B类份额成立于2016年1月25日。本报告期末,由于证券市场波动、基金规模变动等原因,本基金有个别投资比例未达标,但已按照基金合同的规定在10个工作日内调整达标。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
庞宝臣	本基金基金经理	2016年8月5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、固定收益投资室负责人,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

报告期内,海外经济增长平稳,PMI指数仍处于扩张区域,通胀水平好于市场预期,美联储如期缩表,美元指数反弹,市场风险偏好有所回升;国内消费需求稳定,物价小幅上升,因环保督查,导致工业品价格有所上行,但工业生产小幅走低,工业企业利润继续改善。

股票市场方面,A股市场全面开花,呈现普涨格局。在经过了上半年的"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涨幅较高,而大盘蓝筹股则走势相对平稳,涨幅回落;市场整体活跃度回升,主题活跃。

债券市场方面,由于经济增长具备韧性,货币政策重心仍偏重于去杠杆,金融机构负债成本上升,资金价格高企,债券供给也有明显上行,市场受到一定压制,收益率曲线平坦化上行;信用债走势分化,高等级、国企信用利差窄幅波动,低等级以及民企受流动性影响,信用利差走阔。

报告期内,股票组合方面,我们认为业绩主导的逻辑会长期存在,操作上采取均衡配置的策略,以低估值、稳定成长的行业龙头公司为主要投资标的,同时积极参与新股网上网下申购。债券组合方面,我们认为平坦的收益率曲线已经反映了增长指标技术下行,在防范金融风险的政策导向下,货币政策转向宽松的可能性较低;虽然当前债券估值水平具备配置价值,但资本利得的机会较难把握;基于本基金的特征,我们维持低杠杆、短久期、精选个券的配置策略。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达宏利新起点A基金份额净值为1.136元,本报告期基金份额净值增长率为2.16%;截至本报告期末泰达宏利新起点B基金份额净值为1.136元,本报告期基金份额净值增长率为2.16%;同期业绩比较基准收益率为1.84%。

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	142,272,303.04	35.25
	其中:股票	142,272,303.04	35.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	229,899,797.30	56.96
	其中:债券	229,899,797.30	56.96
	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	24,550,236.83	6.08
	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	3,095,304.79	0.77
8	其他资产	3,793,622.08	0.94
9	合计	403,611,264.04	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	3,579,000.00	0.89
B	采矿业	2,989,793.60	0.75
C	制造业	51,006,595.39	12.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,321,093.44	0.33
E	建筑业	5,190,000.00	1.29
F	批发和零售业	2,725,543.45	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	12,676,920.91	3.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.00
J	金融业	44,496,384.08	11.10
K	房地产业	8,320,000.00	2.08
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,821,428.10	2.45
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	12,776.05	0.00
S	综合	-	-
	合计	142,272,303.04	35.50

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	1,200,000	13,332,000.00	3.33
2	601377	兴业证券	1,300,000	11,011,000.00	2.75
3	000895	双汇发展	400,000	9,960,000.00	2.48
4	600048	保利地产	800,000	8,320,000.00	2.08
5	000858	五 粮 液	130,000	7,446,400.00	1.86
6	601328	交通银行	1,008,969	6,376,684.08	1.59
7	000069	华侨城A	699,930	5,718,428.10	1.43
8	300146	汤臣倍健	399,939	5,455,167.96	1.36
9	600068	葛洲坝	500,000	5,190,000.00	1.29
10	601818	光大银行	1,000,000	4,050,000.00	1.01

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,626,000.00	9.89
	其中:政策性金融债	39,626,000.00	9.89
4	企业债券	2,874,000.00	0.72
5	企业短期融资券	80,391,000.00	20.06
6	中期票据	78,766,000.00	19.65
7	可转债(可交换债)	28,242,797.30	7.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	229,899,797.30	57.36

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	011762011	17南山集SCP002	500,000	50,235,000.00	12.53
2	101460018	14陕延油MTN001	300,000	30,396,000.00	7.58
3	041659022	16冀新合作CP001	300,000	30,156,000.00	7.52
4	101656013	16正泰MTN001	300,000	29,538,000.00	7.37
5	113011	光大转债	219,980	24,510,171.60	6.12

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

在报告期内,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

在报告期内,本基金未投资于国债期货。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	12,725.08
2	应收证券清算款	203,661.22
3	应收股利	-
4	应收利息	3,577,220.86
5	应收申购款	14.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,793,622.08

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	24,510,171.60	6.12

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	泰达宏利新起点混合A	泰达宏利新起点混合B
报告期期初基金份额总额	702,653,188.50	-
报告期期间基金总申购份额	39,298.83	-
减:报告期期间基金总赎回份额	349,871,780.01	-
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	352,820,707.32	-

§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 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20170701-20170930	500,179,000.00	0.00	250,000,000.00	250,179,000.00	70.91%

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新起点灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《泰达宏利新起点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》、《证券时报》、《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

泰达宏利新思路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	泰达宏利新思路混合	
交易代码	001419	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年6月16日	
报告期末基金份额总额	348,203,620.00份	
投资目标	在严格控制风险的前提下,本基金紧跟经济形势,深入挖掘市场机遇,力争实现基金资产的持续稳健增值	
投资策略	本基金将采取主动的类别资产配置策略,注重风险与收益的平衡。本基金紧跟经济形势,深入挖掘市场机遇,力争实现基金资产的持续稳健增值	
业绩比较基准	50%*沪深300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	泰达宏利新思路混合A	泰达宏利新思路混合B
下属分级基金的交易代码	001419	002314
报告期末下属分级基金的份额总额	320,584,572.38份	27,619,047.62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)	
	泰达宏利新思路混合A	泰达宏利新思路混合B
1. 本期已实现收益	13,735,373.55	586,228.81
2. 本期利润	19,461,525.51	823,650.30
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0304	0.0298
4. 期末基金资产净值	347,627,650.55	29,842,589.94
5. 期末基金份额净值	1.084	1.081

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

泰达宏利新思路混合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	2.85%	0.14%	2.64%	0.29%	0.21%	-0.15%

泰达宏利新思路混合B

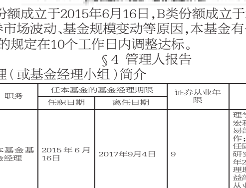
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.85%	0.15%	2.64%	0.29%	0.21%	-0.14%

注:本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%

沪深300指数是由中证指数有限公司编制,从上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本的综合性指数,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、债券回购、权证、资产支持证券等金融工具金融工具。因此,"50%*沪深300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2015年6月16日,B类份额成立于2016年1月25日。本本报告期末,由于证券市场波动、基金规模变动等原因,本基金有个别投资比例未达标,但已按照基金合同的规定在10个工作日内调整达标。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
丁宇佳	本基金基金经理	2015年6月16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,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,任职于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。
傅浩	本基金基金经理	2017年9月4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新思路混合A基金份额净值为1.084元,本报告期基金份额净值增长率为2.85%;截至本报告期末泰达宏利新思路混合B基金份额净值为1.081元,本报告期基金份额净值增长率为2.85%;同期业绩比较基准收益率为2.64%。

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	126,250,513.43	32.81
	其中:股票	126,250,513.43	32.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	252,083,000.00	65.52
	其中:债券	252,083,000.00	65.52
	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	1,125,021.05	0.29
8	其他资产	5,307,162.70	1.38
9	合计	384,765,697.18	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	39,793.60	0.01
C	制造业	37,154,319.65	9.84
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	2,820,066.91	0.75
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	84,497,581.39	22.39
K	房地产业	1,328,080.00	0.35
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	-	-
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	12,776.05	0.00
S	综合	-	-
	合计	126,250,513.43	33.45

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	000776	广发证券	1,000,000	18,980,000.00	5.03
2	000538	云南白药	200,000	18,140,000.00	4.81
3	000333	美的集团	400,000	17,676,000.00	4.68
4	601398	工商银行	2,517,226	15,103,356.00	4.00
5	601939	建设银行	1,650,000	11,500,500.00	3.05
6	601288	农业银行	3,000,000	11,460,000.00	3.04
7	601328	交通银行	1,590,000	10,048,800.00	2.66
8	601601	中国太保	182,123	6,725,802.39	1.78
9	000001	平安银行	500,000	5,555,000.00	1.47
10	600030	中信证券	281,700	5,124,123.00	1.36

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,972,000.00	5.29
	其中:政策性金融债	19,972,000.00	5.29
4	企业债券	30,282,000.00	8.02
5	企业短期融资券	160,775,000.00	42.59
6	中期票据	21,960,000.00	5.82
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	19,094,000.00	5.06
9	其他	-	-
10	合计	252,083,000.00	66.78

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	011754004	17河钢集SCP002	400,000	40,236,000.00	10.66
2	041658062	16天业CP001	400,000	40,212,000.00	10.65
3	112525	17盾安01	300,000	30,282,000.00	8.02
4	011787002	17津航空SCP002	300,000	30,141,000.00	7.99
5	041756006	17新中泰CP001	300,000	30,072,000.00	7.97

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

在报告期内,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

在报告期内,本基金未投资于国债期货。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	33,619.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,272,912.53
5	应收申购款	631.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,307,162.70

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	泰达宏利新思路混合A	泰达宏利新思路混合B
报告期期初基金份额总额	661,815,036.35	27,619,047.62
报告期期间基金总申购份额	43,931.00	-
减:报告期期间基金总赎回份额	341,274,394.97	-
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	320,584,572.38	27,619,047.62

§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 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20170701-20170930	486,380,350.19	0.00	243,380,350.19	243,000,000.00	69.79%

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新思路灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《泰达宏利新思路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》、《证券时报》、《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