

# 泰达宏利行业精选混合型证券投资基金 2015 年年度报告 摘要

2015 年 12 月 31 日

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

送出日期：2016 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

本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。本年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2016 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利行业混合
基金主代码	162204
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 7 月 9 日
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
报告期末基金份额总额	213, 107, 315. 33 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	追求资本的长期持续增值，为投资者寻求高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	全面引进荷兰银行的投资管理流程，采用“自上而下”资产配置和行业类别与行业配置，“自下而上”精选股票的投资策略，主要投资于具有国际、国内竞争力比较优势和长期增值潜力的行业和企业的股票。
业绩比较基准	70%×富时中国 A600 指数收益率+30%×中债国债总指数（财富）
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于风险较高的基金品种

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰达宏利基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈沛	王永民
	联系电话	010-66577808	010-66594896
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-69-88888	95566
传真		010-66577666	010-66594942

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http:// www.mfcteda.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	410,094,849.54	474,370,544.48	345,893,751.84
本期利润	294,280,326.73	162,834,461.94	523,374,988.79
加权平均基金份额本期利润	1.0593	0.2525	0.7076
本期基金份额净值增长率	12.47%	9.76%	20.27%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	2.9318	2.0618	2.0037
期末基金资产净值	837,892,664.72	1,886,398,356.25	2,500,534,098.33
期末基金份额净值	3.9318	3.4959	3.9802

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基金份额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. 期末可供分配利润等于期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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

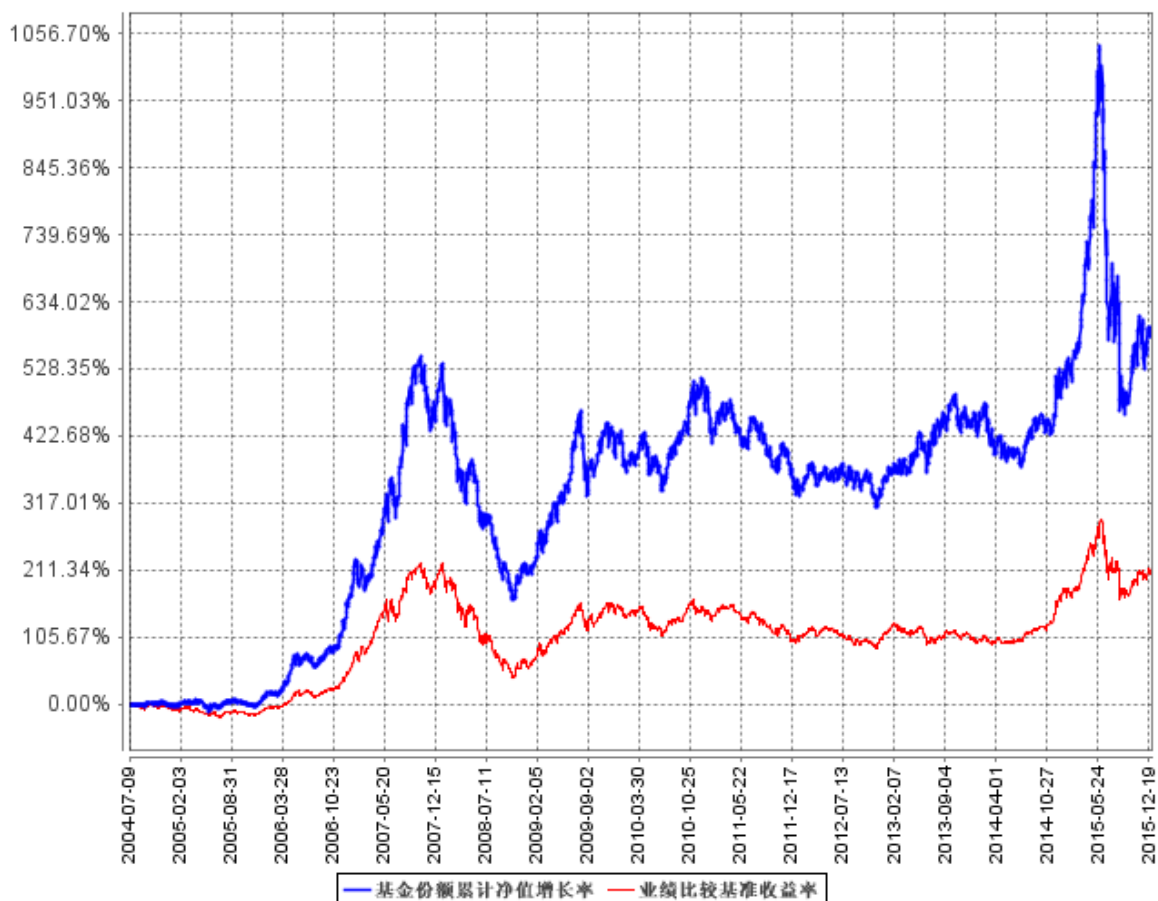
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	18.04%	2.11%	12.97%	1.20%	5.07%	0.91%
过去六个月	-19.50%	2.84%	-10.53%	1.84%	-8.97%	1.00%
过去一年	12.47%	2.63%	10.94%	1.71%	1.53%	0.92%
过去三年	48.47%	1.89%	44.33%	1.22%	4.14%	0.67%
过去五年	15.24%	1.63%	24.81%	1.11%	-9.57%	0.52%

自基金合同生效起至今	581.93%	1.64%	206.25%	1.28%	375.68%	0.36%
------------	---------	-------	---------	-------	---------	-------

本基金业绩比较基准： $70\% \times \text{富时中国 A600} + 30\% \times \text{中债国债总指数（财富）}$ 。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。中债国债总指数（财富）是中央国债登记结算有限责任公司推出的中国国债总指数，该指数基于全市场角度编制的指数，价格选取上更侧重于全国银行间债券市场，选样广泛，全面而细致反映债券市场变动。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

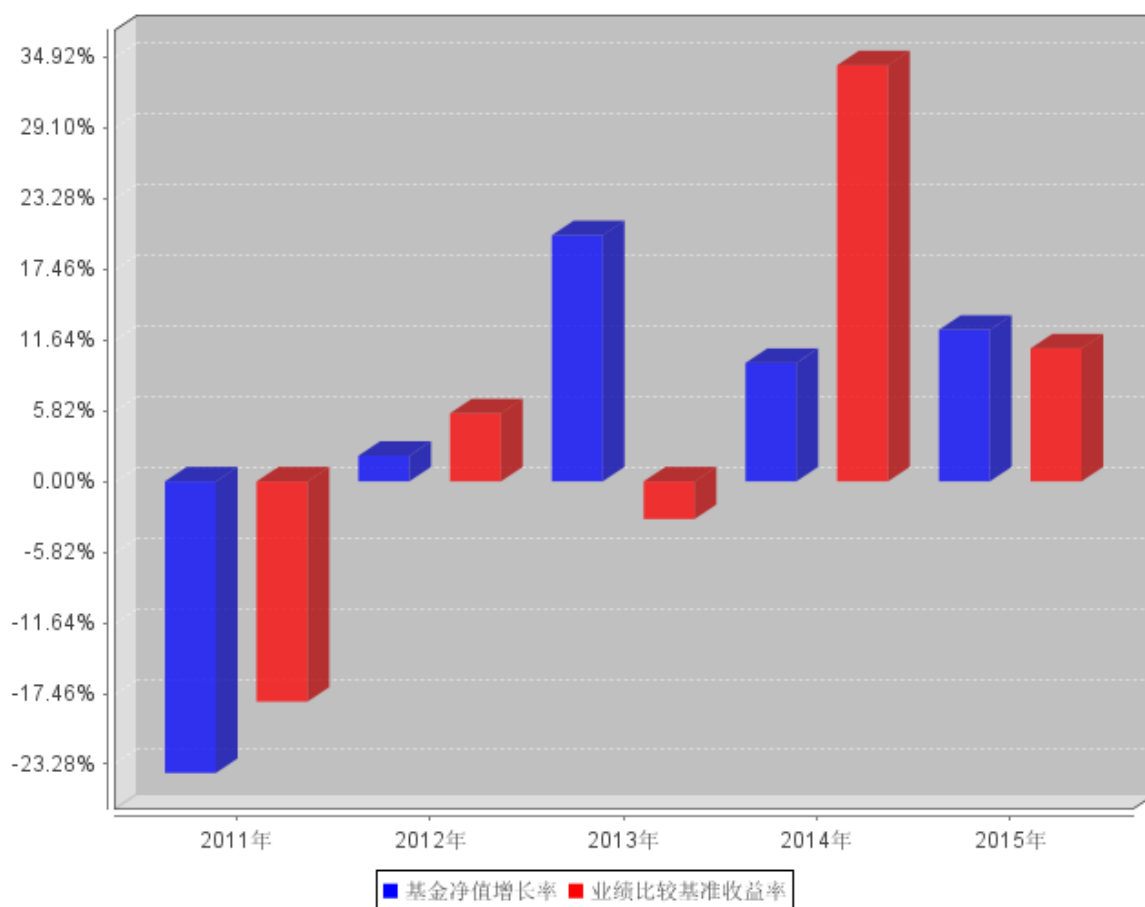
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本基金在建仓期末及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	-	-	-	-	
2014	7.2500	804,807,159.42	176,144,509.87	980,951,669.29	
2013	-	-	-	-	
合计	7.2500	804,807,159.42	176,144,509.87	980,951,669.29	

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司，成立于2002年6月，是中国首批合资基金管理公司之一。截至报告期末本公司股东及持股比例分别为：北方国际信托股份有限公司：51%；宏利资产管理（香港）有

限公司：49%。

目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基金、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋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、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金、泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利收益增强债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利养老收益混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、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、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利活期友货币市场基金、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在内的三十多只证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁辉	本基金基金经理， 总经理助理兼投资总监	2013 年 2 月 21 日	2015 年 4 月 3 日	13	毕业于清华大学，管理科学与工程专业硕士；2002 年 3 月加入湘财荷银基金管理有限公司（现泰达宏利基金管理有限公司），曾担任公司研究部行业研究员、基金

					<p>经理、研究部总监、金融工程部总经理、基金投资部总经理，自 2013 年 5 月 10 日起担任泰达宏利基金管理有限公司总经理助理兼投资总监； 13 年基金从业经验，具有证券从业资格、基金从业资格。</p>
陈丹琳	本基金基金经理	2015 年 4 月 3 日	-	8	<p>毕业于中国人民大学，经济学硕士，CFA、CPA；2007 年 7 月加入泰达宏利基金管理有限公司，曾担任研究员、研究主管、研究部总经理助理等职务；具备 8 年证券投资管理经验，8 年基金从业经验，具有</p>



					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《证券法》、《证券投资基金法》、本基金合同和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，本基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人建立了公平交易制度和内部控制流程，严格执行相关制度规定。在投资管理活动中，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；在交易环节实行集中交易制度，交易部运用交易系统内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，确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，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。

基金管理人的风险管理部定期对基金管理人管理的不同投资组合的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）基金管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，并经公司管理层审核签署后存档备查。基金管理人的监察稽核部定期对公平交易制度的执行和控制工作进行稽核。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人的风险管理部事后从交易指令的公平性、同日反向交易、不同窗口下的同向交易溢价率和风格相似的基金的业绩等方面，对报告期内的公平交易执行情况进行统计分析。本报告期内，交易指令多为指令下达人管理的多只资产组合同时下发，未发现明显的非公平交易指令；基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输

送的同日反向交易；场外交易的交易价格与市场价格一致，场内交易的溢价率在剔除交易时间差异、交易数量悬殊、市场波动剧烈等因素后，处于正常范围之内；基金管理人管理的各投资组合的业绩由于投资策略、管理风格、业绩基准等方面的因素而有所不同。

本报告期内，本基金管理人管理的各投资组合之间未发现利益输送或不公平对待不同组合的情况。

### 4.3.3 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，风险管理部对可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，定期对各投资组合的交易行为进行整体分析评估，定期向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。如发现疑似异常交易情况，相关投资组合经理对该交易情况进行合理性解释。监察稽核部定期对异常交易制度的执行和控制工作进行稽核。

在本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合的同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该证券当日成交量的 5%，没有发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为，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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年全年市场大起大落，跌宕起伏，上证全年上涨 9.41%。振幅 71.95%，创业板指全年上涨 84.41%，振幅 177.26%。

本基金在 1 季度初选择了均衡配置，1 季末开始向成长股集中，2 季度中期考虑到创业板的泡沫日益严重，开始转移部分仓位配置在军工和国企改革等相对弹性较大的蓝筹领域。3 季度在市场的下行震荡中选择了低仓位和国企改革，4 季度经过总结回顾，逐渐把品种集中到新兴成长的龙头白马股上。回顾看，业绩不理想的主要原因是有两个：一是在前期泡沫积累的过程中，对互联网金融等代表性板块配置不足，二是在股市触底反弹时为了应对赎回压力仓位过低。2015 年波澜壮阔的市场是对基金经理的严峻考验，也让我们吸取了很多经验教训。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 3.9318 元，本报告期份额净值增长率为 12.47%，同期业绩比较基准增长率为 10.94%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年的宏观经济的主调是供给侧改革和经济转型，无风险利率将保持低位运行，风险偏好会有适当下行。股票市场风险大幅度释放后，权益类资产相对其它大类资产的风险收益比明显提升。我们相信中国庞大的内需市场和经济活力为经济结构升级奠定必胜的基础，从而为汇率稳定提供根本性的支撑。未来新兴行业将不断涌现成功的企业，二级市场有望分享这些企业的成长红利。

综合以上判断，吸取 2015 年的经验教训，我们认为市场风险偏好会有所下降，业绩高速增长、估值较为合理的新兴行业龙头将成为具有明显超额收益的品种。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的副总经理负责，成员包括督察长、投资总监、研究部、固定收益部、金融工程部、风险管理部、基金运营部的相关人员，均具有丰富的专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力。

基金经理参与估值委员会对相关停牌品种估值的讨论，发表相关意见和建议，但涉及停牌品种的基金经理不参与最终的投票表决。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金报告期内未进行利润分配。目前无其他利润分配安排。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰达宏利行业精选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

本基金 2015 年年度报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可阅读年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利行业精选混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>		
银行存款	48,795,555.39	72,969,155.46
结算备付金	7,928,499.82	6,364,908.38
存出保证金	880,713.83	1,120,706.10
交易性金融资产	784,279,098.85	1,803,556,086.99
其中: 股票投资	727,636,191.65	1,763,504,086.99
基金投资	-	-
债券投资	56,642,907.20	40,052,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	29,376,873.71
应收利息	894,655.71	1,185,065.47
应收股利	-	-
应收申购款	47,669.59	222,829.87
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	842,826,193.19	1,914,795,625.98
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2015 年 12 月 31 日</b>	<b>2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	27,228.00	15,941,263.28
应付赎回款	284,450.80	3,157,804.05
应付管理人报酬	1,055,789.65	2,438,862.35
应付托管费	175,964.95	406,477.05
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,281,629.54	6,339,949.25
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	108,465.53	112,913.75
负债合计	4,933,528.47	28,397,269.73
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	213,107,315.33	539,607,753.76
未分配利润	624,785,349.39	1,346,790,602.49
所有者权益合计	837,892,664.72	1,886,398,356.25

负债和所有者权益总计	842,826,193.19	1,914,795,625.98
------------	----------------	------------------

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.9318 元，基金份额总额 213,107,315.33 份。

## 7.2 利润表

会计主体：泰达宏利行业精选混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	342,308,418.80	222,409,859.01
1. 利息收入	2,611,278.11	5,415,461.40
其中：存款利息收入	903,303.64	1,821,853.27
债券利息收入	1,610,570.14	3,019,218.65
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	97,404.33	574,389.48
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	454,503,114.42	524,594,639.95
其中：股票投资收益	450,139,539.88	507,197,889.09
基金投资收益	-	-
债券投资收益	162,858.29	1,534,941.35
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	4,200,716.25	15,861,809.51
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-115,814,522.81	-311,536,082.54
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,008,549.08	3,935,840.20
<b>减：二、费用</b>	48,028,092.07	59,575,397.07
1. 管理人报酬	17,485,466.59	32,403,776.52
2. 托管费	2,914,244.49	5,400,629.41
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	27,143,098.58	21,129,691.07
5. 利息支出	9,340.48	178,140.65
其中：卖出回购金融资产支出	9,340.48	178,140.65
6. 其他费用	475,941.93	463,159.42
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	294,280,326.73	162,834,461.94
减：所得税费用	-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）	294,280,326.73	162,834,461.94
-------------------	----------------	----------------

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利行业精选混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	539,607,753.76	1,346,790,602.49	1,886,398,356.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	294,280,326.73	294,280,326.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-326,500,438.43	-1,016,285,579.83	-1,342,786,018.26
其中：1. 基金申购款	63,825,583.75	242,363,018.63	306,188,602.38
2. 基金赎回款	-390,326,022.18	-1,258,648,598.46	-1,648,974,620.64
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	213,107,315.33	624,785,349.39	837,892,664.72
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	628,235,943.42	1,872,298,154.91	2,500,534,098.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	162,834,461.94	162,834,461.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-88,628,189.66	292,609,654.93	203,981,465.27

其中：1. 基金申购款	1,008,555,708.98	2,582,533,997.72	3,591,089,706.70
2. 基金赎回款	-1,097,183,898.64	-2,289,924,342.79	-3,387,108,241.43
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-980,951,669.29	-980,951,669.29
五、期末所有者权益（基金净值）	539,607,753.76	1,346,790,602.49	1,886,398,356.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 刘建	_____ 傅国庆	_____ 王泉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

泰达宏利行业精选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”，原湘财荷银行业精选证券投资基金，后更名为泰达荷银行业精选证券投资基金，后更名为泰达宏利行业精选证券投资基金)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2004]第 58 号《关于同意湘财荷银行业精选证券投资基金设立的批复》核准，由基金发起人湘财荷银基金管理有限公司(于 2006 年 4 月 27 日更名为泰达荷银基金管理有限公司，于 2010 年 3 月 9 日更名为泰达宏利基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《湘财荷银行业精选证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,016,372,878.75 元，业经普华永道中天会计师事务所普华永道中天验字(2004)第 108 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《湘财荷银行业精选证券投资基金基金合同》于 2004 年 7 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,017,034,173.30 份基金份额，其中认购资金利息折合 661,294.55 份基金份额。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

经中国证监会同意，本基金于 2006 年 6 月 6 日更名为泰达荷银行业精选证券投资基金。根据本基金的基金管理人 2010 年 3 月 17 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于变更旗下公募基金名称的公告》，本基金自公告发布之日起更名为泰达宏利行业精选证券投资基金。根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，泰达宏利行业精选股票型证券投资基金于 2015 年 7 月 30 日公告后更名为泰达宏利行业精选混合型证券投资基金。



根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利行业精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票、债券，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票投资比例为基金资产净值的 60%-95%，债券投资比例为基金资产净值的 0%-35%，现金及现金等价物投资比例为基金资产净值的 5%-30%。在相关法规允许的前提下，股票投资范围最高可以达到基金资产净值的 100%。本基金的业绩比较基准为：富时中国 A600 指数收益率×70%+中债国债总指数(财富)×30%。

本财务报表由本基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司于 2016 年 3 月 30 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利行业精选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述事项外，本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除

外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
北方国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
宏利资产管理(香港)有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行股票交易。

#### 7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券交易。

#### 7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行权证交易。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	17,485,466.59	32,403,776.52
其中：支付销售机构的客户维护费	2,181,646.74	3,069,432.88

注：支付基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,914,244.49	5,400,629.41

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	48,795,555.39	759,575.48	72,969,155.46	1,608,991.17

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

## 7.4.9 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300028	金亚科技	2015年6月9日	重大事项	24.48	-	-	794,047	38,002,094.69	19,438,270.56	-
000712	锦龙	2015	重大	29.12	2016	28.00	81	2,867.28	2,358.72	-

	股份	年 12 月 25 日	事项		年 1 月 4 日					
002235	安妮股份	2015 年 7 月 2 日	重大事项	29.10	2016 年 1 月 12 日	32.00	50	1,563.98	1,455.00	-

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场正回购余额。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为 711,327,146.57 元，第二层次的余额为 72,951,952.28 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 1,709,415,357.14 元，第二层次的余额为 94,140,729.85 元，无第三层次)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输

入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 27 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	727,636,191.65	86.33
	其中：股票	727,636,191.65	86.33
2	固定收益投资	56,642,907.20	6.72
	其中：债券	56,642,907.20	6.72
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	56,724,055.21	6.73
7	其他各项资产	1,823,039.13	0.22
8	合计	842,826,193.19	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,335.24	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	327,495,812.51	39.09
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	54,232,919.92	6.47
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	191,045,634.13	22.80
J	金融业	62,013,531.42	7.40
K	房地产业	15,609,282.00	1.86
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	50,895,376.40	6.07
S	综合	26,341,300.03	3.14
	合计	727,636,191.65	86.84

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

### 8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300310	宜通世纪	675,803	42,122,800.99	5.03
2	000783	长江证券	3,272,135	40,639,916.70	4.85
3	300188	美亚柏科	758,108	38,436,075.60	4.59
4	002292	奥飞动漫	736,700	38,094,757.00	4.55
5	300144	宋城演艺	1,126,304	31,874,403.20	3.80
6	300275	梅安森	824,670	30,017,988.00	3.58
7	002407	多氟多	365,896	27,903,228.96	3.33
8	300031	宝通科技	870,100	27,321,140.00	3.26
9	600701	工大高新	1,098,971	26,298,376.03	3.14
10	002123	荣信股份	1,002,489	25,713,842.85	3.07

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601328	交通银行	223,115,173.61	11.83
2	601166	兴业银行	106,280,247.14	5.63
3	600038	中直股份	100,525,716.88	5.33
4	300186	大华农	98,222,447.31	5.21
5	600036	招商银行	95,046,954.67	5.04
6	000732	泰禾集团	80,632,531.33	4.27
7	002594	比亚迪	80,022,182.79	4.24
8	600118	中国卫星	80,009,534.21	4.24
9	000800	一汽轿车	77,176,762.05	4.09
10	601939	建设银行	76,659,292.02	4.06
11	600026	中海发展	75,647,231.99	4.01



12	600050	中国联通	72,663,380.34	3.85
13	601989	中国重工	71,607,260.42	3.80
14	601998	中信银行	71,229,114.60	3.78
15	601169	北京银行	67,007,562.18	3.55
16	601336	新华保险	64,790,667.57	3.43
17	000797	中国武夷	63,771,082.28	3.38
18	600428	中远航运	62,804,477.13	3.33
19	600391	成发科技	60,789,388.79	3.22
20	601333	广深铁路	60,186,036.00	3.19
21	300207	欣旺达	60,068,340.95	3.18
22	601618	中国中冶	58,607,786.25	3.11
23	600125	铁龙物流	58,593,753.02	3.11
24	600037	歌华有线	56,457,683.46	2.99
25	300059	东方财富	54,061,083.00	2.87
26	002285	世联行	51,502,768.89	2.73
27	300413	快乐购	50,824,840.37	2.69
28	600372	中航电子	50,460,751.76	2.67
29	000783	长江证券	50,369,766.38	2.67
30	300133	华策影视	50,310,394.51	2.67
31	601919	中国远洋	50,302,097.86	2.67
32	002142	宁波银行	49,882,350.23	2.64
33	603555	贵人鸟	47,961,146.29	2.54
34	000158	常山股份	46,703,289.31	2.48
35	601688	华泰证券	46,415,184.00	2.46
36	600999	招商证券	46,303,472.81	2.45
37	300380	安硕信息	45,881,370.00	2.43
38	300468	四方精创	45,813,830.36	2.43
39	300016	北陆药业	44,591,139.30	2.36
40	600737	中粮屯河	44,529,852.00	2.36
41	300271	华宇软件	44,493,211.00	2.36
42	002456	欧菲光	43,191,709.00	2.29
43	002101	广东鸿图	42,790,093.15	2.27
44	300248	新开普	42,513,594.24	2.25
45	002230	科大讯飞	42,380,767.31	2.25
46	601555	东吴证券	41,488,148.00	2.20
47	300339	润和软件	40,374,712.02	2.14

48	300028	金亚科技	39,824,448.69	2.11
49	002570	贝因美	39,510,477.07	2.09
50	300144	宋城演艺	39,318,940.72	2.08
51	600606	绿地控股	38,964,647.56	2.07
52	000971	高升控股	38,569,128.54	2.04
53	601918	国投新集	38,330,973.65	2.03
54	600271	航天信息	38,271,657.89	2.03
55	600862	南通科技	38,024,572.74	2.02
56	002100	天康生物	37,957,432.04	2.01

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601328	交通银行	221,736,214.49	11.75
2	300059	东方财富	183,707,045.41	9.74
3	600271	航天信息	153,019,010.44	8.11
4	601688	华泰证券	130,918,428.85	6.94
5	601166	兴业银行	123,938,340.68	6.57
6	000800	一汽轿车	116,167,850.66	6.16
7	600038	中直股份	115,581,854.14	6.13
8	600036	招商银行	106,310,427.43	5.64
9	600999	招商证券	104,525,064.32	5.54
10	300186	大华农	89,407,059.61	4.74
11	002117	东港股份	88,032,525.75	4.67
12	000728	国元证券	87,066,208.96	4.62
13	000797	中国武夷	86,561,264.85	4.59
14	002594	比亚迪	86,128,288.93	4.57
15	300413	快乐购	83,431,823.35	4.42
16	601939	建设银行	82,741,178.53	4.39
17	601169	北京银行	81,673,082.23	4.33
18	601336	新华保险	78,415,120.67	4.16
19	002104	恒宝股份	76,136,131.76	4.04
20	601998	中信银行	74,740,799.09	3.96
21	002454	松芝股份	71,914,513.29	3.81

22	000783	长江证券	71,407,153.03	3.79
23	600118	中国卫星	71,017,389.56	3.76
24	603555	贵人鸟	67,163,576.10	3.56
25	300207	欣旺达	65,166,947.40	3.45
26	600050	中国联通	63,155,405.85	3.35
27	600037	歌华有线	61,357,439.96	3.25
28	600026	中海发展	59,895,315.78	3.18
29	601989	中国重工	59,055,955.84	3.13
30	000732	泰禾集团	58,445,330.36	3.10
31	601618	中国中冶	57,874,279.06	3.07
32	000024	招商地产	57,403,606.88	3.04
33	300271	华宇软件	57,174,256.89	3.03
34	600428	中远航运	56,184,935.85	2.98
35	600372	中航电子	55,903,491.22	2.96
36	600606	绿地控股	55,825,669.80	2.96
37	000158	常山股份	54,578,200.35	2.89
38	002142	宁波银行	54,201,652.97	2.87
39	000776	广发证券	53,492,718.05	2.84
40	002230	科大讯飞	51,491,176.84	2.73
41	601377	兴业证券	50,021,683.01	2.65
42	600048	保利地产	49,676,913.47	2.63
43	000712	锦龙股份	49,589,929.35	2.63
44	002456	欧菲光	49,353,534.65	2.62
45	300049	福瑞股份	49,036,237.83	2.60
46	300133	华策影视	48,567,021.22	2.57
47	601919	中国远洋	48,457,369.16	2.57
48	600143	金发科技	47,596,875.12	2.52
49	002285	世联行	47,014,974.37	2.49
50	600148	长春一东	45,411,023.80	2.41
51	000997	新大陆	44,479,512.48	2.36
52	601628	中国人寿	42,947,384.22	2.28
53	601333	广深铁路	42,781,504.49	2.27
54	300016	北陆药业	42,294,876.50	2.24
55	002465	海格通信	42,171,525.35	2.24
56	600837	海通证券	41,728,040.60	2.21
57	002657	中科金财	41,629,598.02	2.21
58	300339	润和软件	41,417,414.00	2.20
59	601555	东吴证券	41,226,865.75	2.19

60	002673	西部证券	40,753,630.77	2.16
61	601222	林洋能源	39,925,995.01	2.12
62	000768	中航飞机	39,736,957.17	2.11
63	300380	安硕信息	39,609,753.07	2.10
64	000858	五粮液	38,834,004.26	2.06

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,007,464,447.31
卖出股票收入（成交）总额	9,376,320,026.48

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	23,422,868.00	2.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,087,000.00	3.59
	其中：政策性金融债	30,087,000.00	3.59
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）	3,133,039.20	0.37
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	56,642,907.20	6.76

## 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

1	150211	15 国开 11	300,000	30,087,000.00	3.59
2	010303	03 国债(3)	121,100	12,579,868.00	1.50
3	010107	21 国债(7)	100,000	10,843,000.00	1.29
4	110031	航信转债	24,130	3,133,039.20	0.37

注：上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。

## 8.7 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。

## 8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	880,713.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	894,655.71
5	应收申购款	47,669.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,823,039.13

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110031	航信转债	3,133,039.20	0.37

### 8.12.5 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的情况。

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
24,632	8,651.64	45,899,500.41	21.54%	167,207,814.92	78.46%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	15,771.99	0.0074%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 ( 2004 年 7 月 9 日 ) 基金份额总额	2,017,034,173.30
本报告期期初基金份额总额	539,607,753.76
本报告期基金总申购份额	63,825,583.75
减:本报告期基金总赎回份额	390,326,022.18
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	213,107,315.33

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本公司于 2015 年 4 月 28 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，聘任刘建先生为公司副总经理。

2、本公司于 2015 年 5 月 16 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，刘青山先生因个人原因辞去公司总经理职务，由公司副总经理傅国庆先生于 5 月 15 日起代任总经理职务。

3、本公司于 2015 年 8 月 15 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，聘任刘建先生为公司总经理。

4、本公司于 2015 年 12 月 4 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，聘任王彦杰先生为公司副总经理。

5、2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本年度无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管人、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本年度本基金无投资策略的变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用为 10.8 万元，该审计机构对本基金已提供审计服务的年限为 12 年。



## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人、本基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	12,410,359,678.25	13.87%	2,232,563.22	14.00%	-
中信证券	2	22,138,629,362.73	12.30%	1,963,819.11	12.32%	-
东方证券	2	1,524,347,593.40	8.77%	1,395,311.78	8.75%	-
招商证券	1	1,477,458,302.97	8.50%	1,345,075.67	8.44%	-
华泰证券	2	1,393,777,333.01	8.02%	1,270,660.09	7.97%	-
国金证券	1	1,321,168,984.05	7.60%	1,226,467.62	7.69%	-
湘财证券	1	1,284,393,789.35	7.39%	1,169,312.48	7.33%	-
银河证券	2	1,231,756,574.51	7.09%	1,121,537.19	7.03%	-
中信建投	2	1,095,364,496.52	6.30%	1,019,454.91	6.39%	-
光大证券	1	687,495,099.31	3.95%	626,449.06	3.93%	-
广发证券	2	625,715,989.36	3.60%	569,652.56	3.57%	-
中金公司	2	534,554,473.23	3.08%	486,657.91	3.05%	-
西南证券	1	503,427,166.36	2.90%	458,316.37	2.87%	-
方正证券	1	472,760,836.78	2.72%	430,401.92	2.70%	-
财富证券	2	383,874,881.18	2.21%	349,481.85	2.19%	-
国泰君安	1	261,358,650.69	1.50%	243,401.65	1.53%	-
中泰证券	1	37,223,192.09	0.21%	34,665.31	0.22%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
九州证券	1	-	-	-	-	-

国联证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源西部	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-

注：（一）2015 年本基金新增中金公司、申万宏源西部、长城证券、财富证券、华泰证券和东吴证券交易单元。

（二）交易单元选择的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- （1）经营规范，有较完备的内控制度；
- （2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要；
- （3）能为基金管理人提供高质量的研究咨询服务。

**11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券	3,480,714.24	11.65%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

西南证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	26,408,516.35	88.35%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
九州证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-

泰达宏利基金管理有限公司  
2016年3月30日