

泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3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

重要提示:基金管理人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...

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等内容...

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1月1日至2017年3月31日。

Table with 2 columns: 基金简称, 泰达宏利复兴混合; 交易代码, 001170; 基金运作方式, 契约型开放式...

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日至2017年3月31日); 1.本期已实现收益, 400,094.24...

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...

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

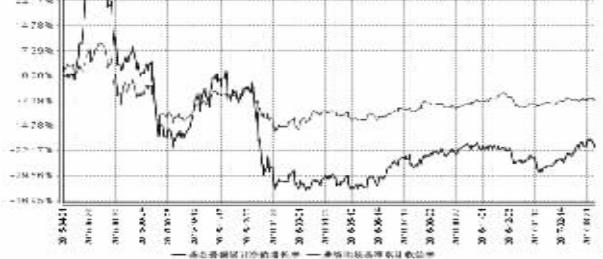
Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准收益率③, ①-③, ②-④

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%

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%

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

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限, 证券从业年限, 说明

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

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...

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...

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年1季度宏观经济保持平稳,货币政策中性,财政政策较为积极,供给侧改革继续推进。实体经济中部分行业明显复苏,产品价格维持在前高位上...

4.5 报告期内基金的投资表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.799元;本报告期基金份额净值增长率为6.25%,业绩比较基准收益率为2.13%。

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

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元); 1 权益投资, 63,140,573.39; 2 基金投资, -; 3 固定收益投资, 34,958,000.00...

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

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元); A 农林牧渔, -; B 采矿业, -; C 制造业, 618,641,797.45...

5.2.2 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。

§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十名股票投资组合

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元); 1 600487 亨通光电, 2,156,431; 2 002943 兔宝宝, 3,359,846...

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元); 1 国债券, 34,958,000.00; 2 央行票据, -; 3 金融债, -...

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组合

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元); 1 019546 16国债18, 350,000; 2 019546 16国债18, 350,000...

注:以上为本基金本报告期末持有的全部债券投资。

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

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

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

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

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.3 本期国债期货投资评价

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

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元); 1 存出保证金, 169,345.38; 2 应收证券清算款, 5,924,310.87...

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

Table with 2 columns: 项目, 金额(元); 报告期初基金份额总额, 1,228,006,621.53; 报告期期间基金总申购份额, 2,336,849.38...

§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

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人持有本基金份额变动情况