泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金 2010年半年度报告摘要

2010年6月30日

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
送出日期:2010年8月27日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司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。本半年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年8月20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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2010年1月1日起至2010年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利成长股票
基金主代码	162201
交易代码	162201
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年4月25日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,443,156,326.94 份
基金合同存续期	持续经营

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于成长行业类别中内在价值被相对低估,并与同行业类别上市公司相比具有更高增长潜力的上市公司。在有效控制投资组合风险的前提下,为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	采用"自上而下"的投资方法,具体体现在资产配置、行业配置和个股选择的全过程中。
业绩比较基准	65%×新华富时A600成长行业指数+35%×上证国债指数
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于较高风险的基金品种。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	邢颖	张咏东
	联系电话	010-66577725	021-32169999
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		400-69-88888	95559
传真		010-66577666	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.mfcteda.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2010年1月1日至2010年6月30日)
本期已实现收益	-305,740.63
本期利润	-149,766,299.18
加权平均基金份额本期利润	-0.1247
本期基金份额净值增长率	-9.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2010年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0279
期末基金资产净值	1,402,821,438.40
期末基金份额净值	0.9721

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

3.2 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
过去一个月	-7.88%	1.43%	-7.04%	1.18%	-0.84%	0.25%
过去三个月	-10.60%	1.49%	-9.45%	1.28%	-1.15%	0.21%
过去六个月	-9.70%	1.27%	-7.56%	1.11%	-2.14%	0.16%
过去一年	10.16%	1.36%	10.21%	1.19%	-0.05%	0.17%
过去三年	24.02%	1.52%	14.62%	1.49%	9.40%	0.03%
自基金合同生效起至今	362.07%	1.31%	102.34%	1.28%	259.73%	0.03%

注:本基金业绩比较基准:65%×新华富时A600成长行业指数+35%×上证国债指数。上证国债指数选取的样本为在上海证券交易所上市交易的、除浮息债外的国债品种,样本国债的剩余期限分布均匀,收益率曲线较为完整、合理,而且参与主体丰富,竞价交易连续性更强,能反映出市场利率的瞬息变化,客观、真实地标示出利率市场整体的收益风险度。

新华富时A600成长行业指数是从新华富时中国A600行业指数中重新归类而成,成份股按照全球公认并已广泛采用的富时指数全球行业分类系统进行分类,全面体现成长行业类别的风险收益特征。

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

注: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。

§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、泰达宏利行业精选基金、泰达宏利风险预算混合型基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型基金、泰达宏利首选企业股票型基金、泰达宏利市值优选股票型基金、泰达宏利集利债券型基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型基金、泰达宏利红利先锋股票型基金、泰达宏利中证财富大盘指数型基金在内的十三只开放式证券投资基金。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
王勇	本基金基金经理	2008年8月5日	2010年1月6日	10	硕士学位。1999年8月至2001年11月期间就职于中国投资咨询公司,任投资顾问;2001年11月至2004年2月期间就职于北京海问投资咨询有限责任公司,任研究员;2004年2月至2004年11月就职于航空证券有限责任公司,任研究员。2004年11月加盟泰达宏利基金管理有限公司,先后担任研究员、基金经理助理、研究主管等职务。
李源	本基金基金经理	2010年1月6日	-	10	李源女士毕业于美国纽约州立大学布法罗分校,EMBA硕士。1993年7月至1994年就职于中国稀土开发公司任总经理秘书;1994年至1995年就职于北京国际经济技术合作公司任项目经理;1995年至1999年8月就职于中国研究公司任分析员;1999年8月至2000年9月加入IDC国际数据公司,担任市场高级分析员;2000年10月至2009年7月加入中国国际金融有限公司,先后担任研究部经理、高级经理、副总经理。2009年8月加入泰达宏利基金管理有限公司。李源女士具备基金从业经验,10年证券投资研究管理经验,具有基金从业资格。

注:1.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做出决定的公告日期。

2.我公司已于2010年1月6日发布《泰达荷银基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》,王勇先生申请辞去泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金基金经理职务,聘任李源女士担任该基金基金经理。

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 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,未发生任何利益输送的情况。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

2010年上半年度泰达成长基金份额净值增长率为-9.7%,同期泰达周期基金份额净值增长率为-14.46%。

系列基金中的泰达成长基金与泰达周期基金2010年上半年度净值增长率差异未超过5%。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的控制制度,在本报告期内未发生异常交易。

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

上半年市场,沪深300指数在一月初震荡摸到3587点之后就展开了两轮下跌,在6月底创出年内的新低2546点,截至6月底,沪深300跌幅高达28.32%。从年初开始,大盘股和小盘股交替成为市场下跌的动力,使得指数不断创出新低。

回顾上半年市场的表现我们发现,在年初市场缺乏方向,维持在弱势平衡的情况下。房地产政策的严厉实施在二季度伊始成为现实,成为压垮市场的最后一根稻草,房地产板块带动钢铁、水泥、金融等相关行业大幅走弱,严重拖累指数。5月之前,市场持续追捧前期持续强势的消费类和创新类行业,小盘股特别是中小板和创业板的次新股股价不断创出新高,估值泡沫也不断累积。而二季度末的中小盘股票大幅下跌,正是对这种泡沫的一个修正,再一次带领指数回落。

年初在市场方向不明确的情况下,本基金维持了低仓位的策略,在市场缺乏向上动力的情况下,利用低仓位的策略规避了一定的市场风险。在房地产政策明确之后,我们加大了医药、通信、传媒行业的投资比重,希望通过行业配置来规避经济短期波动带来的影响,并获得了一些超额收益。

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0.9721元,本报告期份额净值增长率为-9.70%,同期业绩比较基准增长率为-7.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从短期看,我们认为中国经济保持较快增长的趋势没有转变,货币政策和财政政策都将保持在一个较为中性的状态,短期来看我们不会看到经济的大起大落。从长期看,中国经济的增长确实面临增速下降的局面,但是在这个过程中,我们注意到人均可支配收入占比提升,城镇化进程将对中国经济产生深远影响。投资拉动型,成本驱动型的行业增长速度会相对下降,而内需型,技术驱动型行业增长仍将非常迅速。

展望2010年下半年,在市场快速下跌过程中,我们保持着谨慎乐观的心态。首先,大部分公司的基本面在短期内没有重大变化,股价下跌之后优秀的中小型企业会更具有投资价值。其次,我们仍然看好内需型行业、服务型行业在未来的成长空间。最后,由于证券市场往往过度反应经济的基本面,我们将抱着谨慎的心态去寻找投资机会。2010年下半年的市场将是一个反复探底的过程,但是我们相信,新兴产业的崛起将会是未来几年内中国资本市场成长最强劲的动力。因此本基金依然坚持医药、通信、传媒等行业的配置,同时也会关心符合中国经济增长大趋势的新兴行业的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会2008年9月12日发布的[2008]38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定,本公司成立长期停牌股票等没有市价的投资品种估值委员会,成员由主管基金运营的副总经理、督察长、投资总监、基金经理及研究部、交易部、监察稽核部、金融工程部、风险管理部、基金运营部的相关人员组成。职责分工、专业胜任能力和相关工作经历具体如下:

主管基金运营的副总经理担任估值委员会主任,督察长、投资总监担任副主任。主要负责估值委员会的组织、管理工作,并对涉及估值委员会的重大事项做出决策。

基金经理:基金经理参与估值委员会的日常工作,主要对长期停牌股票行业类别和重估方法提出建议。参与估值的基金经理具有上市公司研究和估值、基金投资等方面较为丰富的经验,熟悉相关法律法规和估值方法。

研究部负责人及行业研究员:负责长期停牌股票等没有市价的投资品种所属行业的专业研究,参与长期停牌股票行业类别和重估方法的确定。他们具有多年的行业研究经验,能够较好的对行业发展趋势做出判断,熟悉相关法律法规和估值方法。

交易部负责人:参与估值委员会的日常工作,主要对长期停牌股票的行业类别和重估方法提出建议。该成员具有多年的股票交易经验,能够较好的对市场的波动及发展趋势作出判断,熟悉相关的法律法规和估值方法。

监察稽核部负责人:负责对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等相关事项的合法合规性进行审核和监督,发现问题及时要求整改。该成员具有一定的会计核算估值知识和经验,熟知与估值政策相关的各项法律法规,了解估值原则和估值方法。

金融工程部负责人:负责估值相关数值的处理和计算,确定行业指数,计算估值价格,参与确定估值方法。该成员在金融工程工作方面具有较为丰富的经验,具备应用多种估值模型的专业能力,熟悉相关法律法规和估值方法。

风险管理部负责人:负责估值相关数值的处理和计算,复核由金融工程部提供的行业指数和估值价格。该成员在基金的风险控制与绩效评估工作方面具有较为丰富的经验,熟悉相关法律法规和估值方法。

基金运营部负责人:参与长期停牌股票估值方法的确定,并与相关托管行进行核对确认,如有不符合的情况出现,立即向估值委员会反映情况,并提出合理的调整建议。该成员具备多年基金从业经验,在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验,熟悉基金估值法律法规、政策和估值方法。

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

本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同及基金的实际运作情况,本基金于2010年1月29日按每10份基金份额派发1.05元进行利润分配,共分配144,850,565.50元。

§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

2010年上半年度,基金托管人在泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2010年上半年度,泰达宏利基金管理有限公司在泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了1次收益分配,分配金额为144,850,565.50元。

5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2010年上半年度,由泰达宏利基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金

报告截止日:2010年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2010年6月30日	上年度末 2009年12月31日
资 产:		
银行存款	77,349,977.73	25,016,366.59
结算备付金	256,655,052.19	9,453,491.55
存出保证金	2,456,720.85	3,075,805.65
交易性金融资产	1,133,464,279.80	953,720,680.16
其中:股票投资	678,390,121.80	751,050,484.36
基金投资	-	-
债券投资	455,074,158.00	202,670,195.80
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	54,003,541.67	11,954,554.77
应收利息	4,707,093.36	2,764,889.68
应收股利	-	-
应收申购款	1,972,362.54	1,062,334.37
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,530,609,028.14	1,007,048,122.77
负债和所有者权益	本期期末 2010年6月30日	上年度末 2009年12月31日
负 债:		
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	120,775,287.12	13,207,818.40
应付赎回款	869,192.90	3,123,833.26
应付管理人报酬	1,904,458.10	1,279,646.17
应付托管费	317,409.71	213,274.37
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,070,018.81	1,525,294.86
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	851,223.10	956,925.18
负债合计	127,787,589.74	20,306,792.24
所有者权益:		
实收基金	1,443,156,326.94	832,566,925.21
未分配利润	-40,334,888.54	154,174,405.32
所有者权益合计	1,402,821,438.40	986,741,330.53
负债和所有者权益总计	1,530,609,028.14	1,007,048,122.77

注:报告截止日2010年06月30日,基金份额净值0.9721元,基金份额总额1,443,156,326.94份。

6.2 利润表

会计主体:泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金

本报告期:2010年1月1日 至 2010年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
一、收入	-128,476,693.22	278,539,229.06
1.利息收入	4,533,282.23	4,383,508.32
其中:存款利息收入	780,858.89	532,819.68
债券利息收入	3,752,423.34	3,850,688.64
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	15,483,976.21	174,794,025.80
其中:股票投资收益	12,239,834.30	166,117,938.11
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-50,591.56	4,110,981.30
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	3,294,733.47	4,565,106.39
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-149,460,558.55	98,497,745.62
4. 汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	966,606.89	863,949.32
减:二、费用	21,289,605.96	18,414,262.44
1.管理人报酬	9,604,349.48	8,816,665.58
2.托管费	1,600,724.92	1,469,444.29
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	9,886,178.65	7,984,745.23
5.利息支出	82,788.15	22,170.00
其中:卖出回购金融资产支出	82,788.15	22,170.00
6.其他费用	115,564.76	121,237.34
三、利润总额	-149,766,299.18	260,124,966.62
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-149,766,299.18	260,124,966.62

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金

本报告期:2010年1月1日 至 2010年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30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)	832,566,925.21	154,174,405.32	986,741,330.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-149,766,299.18	-149,766,299.18
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)	610,589,401.73	100,107,570.82	710,696,972.55
其中:1.基金申购款	1,389,504,448.09	143,130,039.41	1,532,634,487.50
2.基金赎回款	-778,915,046.36	-43,022,468.59	-821,937,514.95
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)	-	-144,850,565.50	-144,850,565.50
五、期末所有者权益(基金净值)	1,443,156,326.94	-40,334,888.54	1,402,821,438.40

项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30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)	1,390,972,697.93	-307,275,005.25	1,083,697,692.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	260,124,966.62	260,124,966.62
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)	-274,928,403.29	15,347,647.80	-259,580,755.49
其中:1.基金申购款	791,687,603.28	-112,663,957.45	679,023,645.83
2.基金赎回款	-1,066,616,006.57	128,011,605.25	-938,604,401.32
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)	1,116,044,294.64	-31,802,390.83	1,084,241,903.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

缪钧伟 傅国庆 王泉

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰达宏利价值优化型行业类别系列证券投资基金(以下简称"本系列基金",原湘财合丰价值优化型系列行业类别开放式证券投资基金、泰达荷银价值优化型系列行业类别开放式证券投资基金)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[2003]第96号《关于同意湘财合丰价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金设立的批复》核准,由基金发起人泰达宏利基金管理有限公司(原湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司)依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《湘财合丰价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金基金契约》发起,并于2003年4月25日募集成立。本系列基金的基金合同于2004年10月13日改为《湘财合丰价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金基金合同》。又于2006年6月6日改为《泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金基金合同》。2010年3月17日,经基金管理人董事会批准,报中国证监会同意,本基金更名为泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金。

本系列基金为契约型开放式,存续期不定,目前下设三个子基金,分别为泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金(以下简称"本基金")、泰达宏利价值优化型周期类行业证券投资基金和泰达宏利价值优化型稳定类行业证券投资基金。首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,630,119,050.77元,其中包括本基金1,021,628,749.98元、泰达宏利价值优化型周期类行业证券投资基金627,135,410.16元和泰达宏利价值优化型稳定类行业证券投资基金981,354,890.63元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第50号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称"交通银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金基金合同》的有关规定,本系列基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中股票投资部分分别主要投资于成长、稳定、周期三个行业类别中依据市净率和市盈率与每股预期收益增长率之比所确定的具有增长潜力的价值优化型股票。每只行业类别基金投资于股票、债券的比重不低于该基金资产总值的80%,投资于国债的比重不低于该基金资产净值的20%。本基金的业绩比较基准为:65%X新华富时A600成长行业指数+35%X上证国债指数。

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2010年8月27日批准报出。

6.4.2 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日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会公告[2010]5号《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>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注6.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2010年上半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2010年6月30日的财务状况以及2010年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期内无会计政策的变更说明。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更的说明。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金,本报告期无差错更正的说明。

6.4.6 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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》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。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4)基金买卖股票于2008年4月24日之前按照0.3%的税率缴纳股票交易印花税,自2008年4月24日起至2008年9月18日止按0.1%的税率缴纳。自2008年9月19日起基金卖出股票按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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

根据泰达宏利基金管理有限公司于2010年3月9日发布的公告,经2009年度第五次股东会审议通过,报中国证监会批准(证监许可[2010]166号文),原公司外方股东荷银投资管理(亚洲)有限公司将所持有的泰达荷银基金管理有限公司全部49%的股权转让给宏利资产管理(香港)有限公司。变更后的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%。股权正式转让后,宏利资产管理(香港)有限公司作为本基金新的关联方,原股东荷银投资管理(亚洲)有限公司与本基金不再有关联关系。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本报告期无通过关联方进行的股票交易(2009年上半年同)。

6.4.8.1.2 权证交易

本报告期无通过关联方进行的权证交易(2009年上半年同)。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本报告期无应支付关联方的佣金(2009年上半年同)。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,604,349.48	8,816,665.58
其中:支付给销售机构的客户维护费	1,162,582.51	1,088,841.12

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1.5%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 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,600,724.92	1,469,444.29

注:支付基金托管人交通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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2010年1月1日至2010年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
交通银行	19,952,531.23	65,819,902.19	-	-	-	-

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金(2009年上半年同)。

6.4.8.4.2 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

报告期末基金管理人之外的其他关联方未投资本基金(2009年年末同)。

6.4.8.5 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 2010年1月1日至2010年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日 期末余额	当期利息收入
交通银行	77,349,977.73	325,086.82	9,316,512.55	194,760.71

注:本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行银行同业利率计息。

本基金用于证券交易结算的资金通过"交通银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。于2010年6月30日的相关余额在资产负债表中的"结算备付金"科目中单独列示(2009年6月30日:同)。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金未在承销期内参与关联方承销证券(2009年上半年同)。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

6.4.9 期末(2010年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002405	四维图新	2010-05-06	2010-08-18	网下新股认购	25.60	33.18	60,570	1,550,592.00	2,009,712.60	-

注:本报告期末未有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限债券、权证。

6.4.9.2 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
002181	粤传媒	2010年5月26日	重大资产重组	10.47	2010年8月16日	11.52	1,329,943	16,620,745.96	13,924,503.21	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金无银行间正回购余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金无交易所市场正回购余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无其他事项说明。

§7 投资组合报告

7.1 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	678,390,121.80	44.32
	其中:股票	678,390,121.80	44.32
2	固定收益投资	455,074,158.00	29.73
	其中:债券	455,074,158.00	29.73
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	334,005,029.92	21.82
6	其他各项资产	63,139,718.42	4.13
7	合计	1,530,609,028.14	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	6,810,612.00	0.49
B	采掘业	-	-
C	制造业	440,007,736.11	31.37
C0	食品、饮料	78,494,076.28	5.60
C1	纺织、服装、皮毛	4,576,830.00	0.33
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	16,373,385.00	1.17
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	72,793,620.70	5.19
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	85,380,510.42	6.09
C8	医药、生物制品	182,389,313.71	13.00
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	113,477,153.63	8.09
H	批发和零售贸易	32,054,339.50	2.28
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	22,469,585.20	1.60
L	传播与文化产业	59,545,695.36	4.24
M	综合类	4,025,000.00	0.29
	合计	678,390,121.80	48.36

7.3 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	000650	仁和药业	2,960,261	44,048,683.68	3.14
2	000423	东阿阿胶	1,216,206	42,275,320.56	3.01
3	600887	伊利股份	1,371,921	40,307,038.98	2.87
4	002106	莱宝高科	1,546,531	36,343,478.50	2.59
5	600079	人福医药	2,246,210	35,939,360.00	2.56
6	002223	鱼跃医疗	1,017,419	35,894,542.32	2.56
7	002241	歌尔声学	1,161,378	35,143,298.28	2.51
8	600485	中创信测	2,527,468	32,781,259.96	2.34
9	600825	新华传媒	3,465,334	32,054,339.50	2.28
10	300058	蓝色光标	1,039,043	27,586,591.65	1.97

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000063	中兴通讯	81,402,704.78	8.25
2	600050	中国联通	74,934,751.00	7.59
3	600037	歌华有线	68,120,780.55	6.90
4	601318	中国平安	66,683,332.82	6.76
5	002138	顺络电子	59,534,230.87	6.03
6	002106	莱宝高科	54,416,291.57	5.51
7	600522	中天科技	53,720,533.73	5.44
8	000069	华侨城A	53,134,656.13	5.38
9	002123	荣信股份	50,240,105.02	5.09
10	000650	仁和药业	49,653,260.22	5.03
11	002241	歌尔声学	48,870,573.82	4.95
12	002292	奥飞动漫	48,410,132.65	4.91
13	000541	佛山照明	47,613,594.64	4.83
14	600079	人福医药	47,100,195.53	4.77
15	600825	新华传媒	45,809,064.81	4.64
16	600511	国药股份	45,488,508.20	4.61
17	002038	双鹭药业	45,209,900.70	4.58
18	000423	东阿阿胶	44,365,465.62	4.50
19	600887	伊利股份	44,067,290.58	4.47
20	002148	北纬通信	42,789,569.48	4.34
21	300039	上海凯宝	42,242,010.25	4.28
22	600765	中航重机	38,956,847.16	3.95
23	002052	同洲电子	38,862,065.64	3.94
24	600485	中创信测	38,643,899.79	3.92
25	600690	青岛海尔	37,498,549.51	3.80
26	600373	*ST鑫新	37,193,580.34	3.77
27	300027	华谊兄弟	37,109,215.66	3.76
28	300070	碧水源	36,932,650.17	3.74
29	002017	东信和平	35,916,301.86	3.64
30	002206	海利得	35,843,255.37	3.63
31	002261	拓维信息	35,811,643.90	3.63
32	002315	焦点科技	35,489,197.72	3.60
33	600351	亚宝药业	33,351,515.09	3.38
34	002157	正邦科技	33,089,182.79	3.35
35	600031	三一重工	32,692,753.29	3.31
36	600000	浦发银行	32,536,483.03	3.30
37	600458	时代新材	32,432,795.25	3.29
38	002273	水晶光电	31,453,831.15	3.19
39	600750	江中药业	31,323,311.83	3.17
40	300058	蓝色光标	30,518,169.10	3.09
41	000825	太钢不锈	30,357,232.99	3.08
42	601998	中信银行	29,959,818.73	3.04
43	600129	太极集团	29,570,833.05	3.00
44	600425	青松建化	29,480,708.09	2.99
45	000972	新中基	29,005,406.09	2.94
46	600479	千金药业	28,113,086.15	2.85
47	600166	福田汽车	27,816,035.12	2.82
48	600563	法拉电子	27,544,769.08	2.79
49	000926	福星股份	27,400,590.83	2.78
50	002316	键桥通讯	27,170,525.60	2.75
51	300054	鼎龙股份	26,712,188.86	2.71
52	002121	科陆电子	26,648,626.63	2.70
53	600489	中金黄金	25,949,046.73	2.63
54	601601	中国太保	25,920,146.62	2.63
55	000811	烟台冰轮	24,553,441.15	2.49
56	000651	格力电器	24,314,433.94	2.46
57	002104	恒宝股份	23,714,933.38	2.40
58	600138	中青旅	23,585,184.79	2.39
59	000930	丰原生化	22,227,588.84	2.25
60	002007	华兰生物	22,123,419.10	2.24
61	300086	康芝药业	21,847,346.80	2.21
62	000400	许继电气	21,175,560.20	2.15
63	600383	金地集团	21,174,693.60	2.15
64	000937	冀中能源	20,971,255.11	2.13
65	600312	平高电气	20,605,776.50	2.09
66	002307	北新路桥	20,421,333.46	2.07
67	600111	包钢稀土	20,122,545.69	2.04

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。

7.4.2 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	600037	歌华有线	101,165,606.92	10.25
2	002038	双鹭药业	86,682,662.98	8.78
3	600050	中国联通	80,337,786.55	8.14
4	000063	中兴通讯	79,814,220.17	8.09
5	002106	莱宝高科	69,235,678.10	7.02
6	002138	顺络电子	68,581,537.70	6.95
7	601318	中国平安	65,655,328.31	6.65
8	000825	太钢不锈	64,988,058.29	6.59
9	000651	格力电器	52,632,603.43	5.33
10	600522	中天科技	51,413,003.12	5.21
11	000069	华侨城A	50,836,084.95	5.15
12	000527	美的电器	49,679,897.30	5.03
13	600511	国药股份	43,834,760.82	4.44
14	601601	中国太保	43,062,515.72	4.36
15	002123	荣信股份	42,098,405.12	4.27
16	600216	浙江医药	41,760,753.20	4.23
17	600557	康缘药业	40,903,581.53	4.15
18	600373	*ST鑫新	39,968,549.79	4.05
19	002148	北纬通信	39,053,218.28	3.96
20	002294	信立泰	38,954,702.21	3.95
21	600031	三一重工	38,719,467.59	3.92
22	000541	佛山照明	38,507,972.68	3.90
23	600765	中航重机	38,244,336.76	3.88
24	002052	同洲电子	38,085,650.49	3.86
25	600690	青岛海尔	37,789,260.87	3.83
26	002261	拓维信息	36,790,761.68	3.73
27	002206	海利得	36,164,088.80	3.67
28	600351	亚宝药业	35,864,935.24	3.63
29	002017	东信和平	31,613,188.65	3.20
30	002215	诺普信	31,402,577.79	3.18
31	600129	太极集团	31,247,770.50	3.17
32	600458	时代新材	30,922,338.48	3.13
33	600563	法拉电子	30,847,327.49	3.13
34	002223	鱼跃医疗	30,719,547.92	3.11
35	600000	浦发银行	30,179,826.55	3.06
36	601998	中信银行	30,003,432.79	3.04
37	000898	鞍钢股份	29,646,625.90	3.00
38	002273	水晶光电	29,538,549.63	2.99
39	000717	韶钢松山	29,480,768.49	2.99
40	300039	上海凯宝	29,148,679.86	2.95
41	000423	东阿阿胶	29,088,642.96	2.95
42	002292	奥飞动漫	29,085,446.78	2.95
43	300070	碧水源	28,163,236.58	2.85
44	000926	福星股份	26,973,509.21	2.73
45	600479	千金药业	26,766,461.20	2.71
46	600425	青松建化	26,306,490.87	2.67
47	600166	福田汽车	25,844,406.68	2.62
48	002316	键桥通讯	25,480,376.57	2.58
49	000972	新中基	25,332,997.25	2.57
50	600498	烽火通信	24,723,810.65	2.51
51	600489	中金黄金	24,474,742.89	2.48
52	300054	鼎龙股份	23,966,987.91	2.43
53	600111	包钢稀土	23,698,001.30	2.40
54	002104	恒宝股份	22,803,151.08	2.31
55	300027	华谊兄弟	22,662,420.51	2.30
56	002241	歌尔声学	22,591,601.21	2.29
57	000937	冀中能源	21,605,772.32	2.19
58	600383	金地集团	20,600,048.32	2.09
59	002121	科陆电子	20,496,407.57	2.08
60	000400	许继电气	20,430,150.76	2.07
61	300086	康芝药业	19,882,448.94	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。

7.4.3 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	3,310,500,735.60
卖出股票收入(成交)总额	3,245,839,639.21

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。7.5 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	34,487,158.00	2.46
2	央行票据	290,553,000.00	20.71
3	金融债券	130,034,000.00	9.27
	其中:政策性金融债	130,034,000.00	9.27
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
	合计	455,074,158.00	32.44

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	1001032	10央票32	1,200,000	120,180,000.00	8.57
2	090223	09国开23	700,000	69,874,000.00	4.98
3	0801035	08央票35	600,000	60,984,000.00	4.35
4	0901038	09央票38	500,000	49,085,000.00	3.50
5	0801047	08央票47	200,000	20,360,000.00	1.45

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

报告期末基金未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

报告期末基金未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	2,456,720.85
2	应收证券清算款	54,003,541.67
3	应收股利	-
4	应收利息	4,707,093.36
5	应收申购款	1,972,362.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	63,139,718.42

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.9.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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	机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
55,408	26,045.99	677,003,881.36	46.91%	766,152,445.58	53.09%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	71,599.18	0.0050%

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2003年4月25日)基金份额总额	1,021,690,071.80
本报告期期初基金份额总额	832,566,925.21
本报告期基金总申购份额	1,389,504,448.09
减:本报告期基金总赎回份额	778,915,046.36
本报告期期末基金份额总额	1,443,156,326.94

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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、经本基金管理人2010年度第一次股东会会议决议,同意黄金源(NG Kim Guan)先生、何国良(Patrick HO)先生、马军先生辞去我公司董事职务,同时聘任孙泉先生、雷柏刚先生(Robert Allen Cook)、施德林先生(Marc Howard Sterling)、王裕闵(Yu-Ming Wang)先生担任公司董事。具体内容请参考本基金管理人于2010年3月31日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于董事变更的公告》。

2 本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的业务部门及其高级管理人员无受到监管部门对其托管业务稽查或处罚的情况。

本报告期内管理人及其高级管理人员无受到监管部门对其托管业务稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	2,006,313,187.34	30.61%	1,630,141.39	30.00%	-
兴业证券	1	1,677,612,082.57	25.59%	1,425,965.71	26.24%	-
湘财证券	2	1,668,985,463.82	25.46%	1,356,060.80	24.96%	-
海通证券	1	1,201,879,049.08	18.34%	1,021,589.79	18.80%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

注:交易席位选择的标准和程序

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席位,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。

10.7.2 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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	13,911,880.10	91.65%	21,000,000.00	100.00%	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	1,267,353.90	8.35%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

我公司已于2010年3月9日发布《泰达荷银基金管理有限公司关于股权变更及公司更名的公告》,原公司外方股东荷银投资管理(亚洲)有限公司将所持有的泰达荷银基金管理有限公司全部49%的股权转让给宏利资产管理(香港)有限公司。变更后的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%。

同时公司名称由"泰达荷银基金管理有限公司"变更为"泰达宏利基金管理有限公司"。

经基金托管人同意,并报请中国证监会批准,我公司已于2010年3月17日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更公司旗下公募基金名称的公告》,本基金的名称也相应改为泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金。

泰达宏利基金管理有限公司

2010年8月27日