

泰达宏利市值优选股票型证券投资基金 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:中国建设银行股份有限公司
截止日期:2010年8月27日

1.1 重要提示
基金管理人泰达宏利基金管理有限公司及重要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法律责任。本年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长宣读。
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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或者资产增值。投资有风险,投资需谨慎。投资者应作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。
本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,应当阅读半年度报告正文。
本报告所载数据截至2010年6月30日。
本报告自2010年1月1日起至2010年6月30日止。

1.2 基金简介

基金名称	泰达宏利市值优选股票
基金代码	162209
基金交易代码	162209
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2007年8月3日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	9,160,039,565.39 份

2.1 基金的投资目标
本基金通过大股票和中小盘股,把握不同市值的股票在不同市场环境下投资价值,投资于其中的优质资产,分散投资,实现基金资产的长期稳定增值。
本基金按照效用功用的MVPV模型来进行资产配置调整。MVPV模型主要考虑M(预期超额收益)和V(价值)P(收益),S(风险)四方因素。MVPV模型作为基金经理人持续不断的资产配置工具,通过定量和定性分析的有效结合判断未来市场的预期收益,对基金资产进行合理的资产配置,力争使基金资产比例最高可以达到95%,最低保持在60%以上,债券资产比例最高可以达到35%,最低为0%,并保持现金类资产比例不低于基金资产净值的5%,以保持基金资产流动性的要求。
业绩比较基准: 75%×沪深300指数收益率+25%×上证国债指数收益率。

2.2 基金业绩说明

项目	泰达宏利市值优选股票	泰达宏利基金	泰达宏利基金
名称	泰达宏利基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名: 魏东 电话: 010-66777225 电子邮箱: tm@fund.com.cn	尹东 010-67595003 Yindong@foc.com.cn	
客户服务电话	400-69-88888 010-66776666	400-69-88888 010-67595096	

3.1 主要会计数据和财务指标

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)	金额单位:人民币元
本期已实现收益	-616,624,312.44	
本期利润	-1,333,171,786.16	
加权平均基金份额本期利润	-0.1417	
本期基金份额净值增长率	-17.84%	
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总额	-0.3501	
期末基金资产净值	5,953,377,966.05	
期末基金份额净值	0.6499	

3.2 基金净值表现

阶段	净值增长率	业绩比较基准	净值增长率	①-③	②-④
过去一个月	-8.14%	1.63%	-5.64%	1.25%	0.38%
过去三个月	-11.89%	1.64%	-17.73%	5.84%	0.28%
过去六个月	-17.84%	1.43%	-21.34%	1.19%	0.24%
过去一年	-7.22%	1.78%	-13.17%	1.42%	0.36%
自基金合同生效以来	-35.01%	1.87%	-28.76%	1.79%	0.08%

3.3 基金业绩比较基准
75%×沪深300指数收益率+25%×上证国债指数收益率。沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所300只A股作为样本编制而成的成份股指数,该指数的样本覆盖了沪深市场总市值,具有良好的市场代表性。上证国债指数以上海证券交易所的所有国债为样本,按照发行量加权而成,具有良好的市场代表性。上证国债指数与上证证券交易上的所有国债市值紧密相连,具有较好的长期跟踪分布,收益率较为完整、合理,而且参与主体丰富,交易交易连续性更强,能反映出市场利率的瞬息变化,客观、真实地显示出利率市场整体的收益风险度。
3.3.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

4.1 基金管理人
基金管理人泰达宏利基金管理有限公司,注册地址:天津经济技术开发区第一大街29号泰达MSD-C区C24101室。基金托管人中国建设银行股份有限公司,注册地址:北京市西城区金融大街25号。基金管理人泰达宏利基金管理有限公司,注册地址:天津经济技术开发区第一大街29号泰达MSD-C区C24101室。基金托管人中国建设银行股份有限公司,注册地址:北京市西城区金融大街25号。基金管理人泰达宏利基金管理有限公司,注册地址:天津经济技术开发区第一大街29号泰达MSD-C区C24101室。基金托管人中国建设银行股份有限公司,注册地址:北京市西城区金融大街25号。

4.2 基金托管人
基金托管人中国建设银行股份有限公司,注册地址:北京市西城区金融大街25号。基金管理人泰达宏利基金管理有限公司,注册地址:天津经济技术开发区第一大街29号泰达MSD-C区C24101室。基金托管人中国建设银行股份有限公司,注册地址:北京市西城区金融大街25号。基金管理人泰达宏利基金管理有限公司,注册地址:天津经济技术开发区第一大街29号泰达MSD-C区C24101室。基金托管人中国建设银行股份有限公司,注册地址:北京市西城区金融大街25号。

4.3 基金经理
基金经理魏东,2005年8月入职泰达宏利基金管理有限公司,2009年8月25日担任泰达宏利市值优选股票型证券投资基金基金经理。魏东,2005年8月入职泰达宏利基金管理有限公司,2009年8月25日担任泰达宏利市值优选股票型证券投资基金基金经理。魏东,2005年8月入职泰达宏利基金管理有限公司,2009年8月25日担任泰达宏利市值优选股票型证券投资基金基金经理。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
上半年A股市场整体呈现震荡上行趋势,上证指数在年初创下新高,随后在二季度出现回调,整体呈现震荡上行的趋势。本基金在报告期内保持了较为稳健的投资策略,重点配置了具有良好成长性的优质个股,同时适当参与了可转债投资,较好地把握了市场机会,实现了基金资产的增值。报告期内,本基金管理人严格执行了基金合同约定的投资策略,较好地把握了市场机会,实现了基金资产的增值。

4.5 报告期内基金业绩表现
截至报告期末,本基金份额净值为0.6499元,本报告期基金份额净增长率为-17.84%,同期业绩比较基准增长率为-21.34%。报告期内,本基金管理人严格执行了基金合同约定的投资策略,较好地把握了市场机会,实现了基金资产的增值。

4.6 基金管理人
基金管理人泰达宏利基金管理有限公司,注册地址:天津经济技术开发区第一大街29号泰达MSD-C区C24101室。基金托管人中国建设银行股份有限公司,注册地址:北京市西城区金融大街25号。基金管理人泰达宏利基金管理有限公司,注册地址:天津经济技术开发区第一大街29号泰达MSD-C区C24101室。基金托管人中国建设银行股份有限公司,注册地址:北京市西城区金融大街25号。基金管理人泰达宏利基金管理有限公司,注册地址:天津经济技术开发区第一大街29号泰达MSD-C区C24101室。基金托管人中国建设银行股份有限公司,注册地址:北京市西城区金融大街25号。

4.6.2.1 基金管理人
基金管理人泰达宏利基金管理有限公司,注册地址:天津经济技术开发区第一大街29号泰达MSD-C区C24101室。基金托管人中国建设银行股份有限公司,注册地址:北京市西城区金融大街25号。基金管理人泰达宏利基金管理有限公司,注册地址:天津经济技术开发区第一大街29号泰达MSD-C区C24101室。基金托管人中国建设银行股份有限公司,注册地址:北京市西城区金融大街25号。

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	50,636,167.35	44,794,586.82
其中:支付给机构投资者的	9,333,440.26	7,929,714.09

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	8,439,361.22	7,465,764.48

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	8,439,361.22	7,465,764.48

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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	1,545,342,187.35	1,650,311,613

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
----	----------------------------	---------------------------------