泰达宏利集利债券型证券投资基金 2010年年度报告摘要

2010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
报告送出日期：2011年3月29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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，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2011年3月25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。

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司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2010年1月1日起至2010年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利集利债券	
基金主代码	162210	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年9月26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	356，979，758.13 份	
下属分级基金的基金简称：	泰达宏利集利债券A	泰达宏利集利债券C
下属分级基金的交易代码：	162210	162299
报告期末下属分级基金的份额总额	227，810，504.64 份	129，169，253.49 份
基金合同存续期	持续经营	

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险及保持流动性基础上，力求实现基金财产稳定的当期收益和长期增值的综合目标。
投资策略	（1）战略性资产配置策略：根据信心度对风险进行预估和分配，从而决定资产的分配。 （2）固定收益类品种投资策略：利率预期分析策略形成对未来市场利率变动方向的预期；凸性挖掘策略形成对收益率曲线形状变化的预期判断；信用分析策略对发债企业进行深入的信用及财务分析；对于含权债券，波动性交易策略对其所隐含的期权进行合理定价，并根据其价格的波动水平获得该债券的期权调整利差； （3）股票投资策略：新股申购策略根据股票市场整体估值水平，发行定价水平及一级市场资金供求及资金成本关系，制定相应的新股认购策略；二级市场股票投资策略主要关注具有持续分红能力特征的优质上市企业，在符合基金整体资产配置及本基金整体投资风格的前提下，采用"自下而上"的个股精选策略。 （4）权证投资策略：依据现代金融投资理论，计算权证的理论价值，结合对权证标的证券的基本面进行分析，评估权证投资价值。
业绩比较基准	90%×上证国债指数收益率+10%×中证红利指数收益率。
风险收益特征	属于具有较低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

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	邢颖	唐州徽
	联系电话	010-66577725	010-66594855
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	tgxxpl@bank-of-china.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、基金托管人的住所

§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	2010年		2009年		2008年9月26日（基金合同生效日）至2008年12月31日	
	泰达宏利集利债券基金A类	泰达宏利集利债券基金C类	泰达宏利集利债券基金A类	泰达宏利集利债券基金C类	泰达宏利集利债券基金A类	泰达宏利集利债券基金C类
本期已实现收益	1，566，535.02	1，261，783.63	13，184，783.13	6，207，639.30	28，370，386.67	9，946，608.50
本期利润	2，256，410.36	999，842.84	-11，247，646.38	-5，070，289.80	53，221，445.61	20，224，930.01
加权平均基金份额本期利润	0.0431	0.0370	-0.0403	-0.0312	0.0373	0.0345
本期基金份额净值增长率	3.94%	3.47%	0.31%	-0.13%	3.94%	3.86%
3.1.2 期末数据和指标	2010年		2009年		2008年	
	泰达宏利集利债券基金A类	泰达宏利集利债券基金C类	泰达宏利集利债券基金A类	泰达宏利集利债券基金C类	泰达宏利集利债券基金A类	泰达宏利集利债券基金C类
期末可供分配基金份额利润	0.0545	0.0441	0.0215	0.0161	0.0209	0.0201
期末基金资产净值	240，217，154.83	134，867，162.78	62，541，733.76	50，328，454.06	1，128，279，224.45	654，721，002.69
期末基金份额净值	1.0545	1.0441	1.0245	1.0191	1.0394	1.0386

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

泰达宏利集利债券A

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	1.26%	0.41%	0.64%	0.17%	0.62%	0.24%
过去六个月	2.52%	0.29%	2.70%	0.16%	-0.18%	0.13%
过去一年	3.94%	0.23%	1.69%	0.16%	2.25%	0.07%
自基金合同生效日起至今	8.38%	0.20%	12.92%	0.21%	-4.54%	-0.01%

泰达宏利集利债券C

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	1.11%	0.41%	0.64%	0.17%	0.47%	0.24%
过去六个月	2.25%	0.29%	2.70%	0.16%	-0.45%	0.13%
过去一年	3.47%	0.23%	1.69%	0.16%	1.78%	0.07%
自基金合同生效日起至今	7.32%	0.20%	12.92%	0.21%	-5.60%	-0.01%

注：1、集利债券基金业绩比较基准：90%×上证国债指数收益率+10%×中证红利指数收益率

本基金采用上证国债指数及中证红利指数衡量基金的投资业绩，其主要原因如下：

上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成，具有良好的市场代表性。

中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市、现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的股票作为样本股，综合反映沪深证券市场高股息股票的整体状况和走势。

2、集利债券基金合同生效日为2008年9月26日。

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

泰达宏利集利债券A

泰达宏利集利债券C

注：本基金于2008年9月26日成立。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第九条（三）投资范围、（四）投资策略和（八）投资限制中规定的各项比例。

3.2.3 自基金合同生效以来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

泰达宏利集利债券A

泰达宏利集利债券C

注：本基金合同生效日为2008年9月26日，2008年度净值增长率的计算期间为2008年9月26日至2008年12月31日

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

泰达宏利集利债券A					
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
2010	0.1000	515，443.39	80，835.65	596，279.04	
2009	0.1800	8，787，026.02	1，080，184.80	9，867，210.82	
2008	-	-	-	-	
合计	0.2800	9，302，469.41	1，161，020.45	10，463，489.86	

泰达宏利集利债券C					
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
2010	0.1000	204，637.52	55，031.22	259，668.74	
2009	0.1800	2，674，120.30	1，291，600.95	3，965，721.25	
2008	-	-	-	-	
合计	0.2800	2，878，757.82	1，346，632.17	4，225，389.99	

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许杰	本基金基金经理	2008年9月26日	-	9	MBA、CFA。在校期间，任Pepperdine University Student Investment Fund助理基金经理职位。毕业后在Walt Disney公司任金融分析师。2002年3月加入泰达宏利基金管理有限公司。9年基金从业经验，具有基金从业资格。
沈毅	本基金基金经理，固定收益部总经理。	2008年9月26日	-	9	工商管理硕士、计量金融硕士。2002年9月至2004年2月任职嘉实基金投资部，担任固定收益投资经理及社保基金投资组合经理。2004年4月至2007年9月任职光大保德信基金管理公司，先后担任高级组合经理及资产配置经理、货币市场基金经理、投资副总监、代理投资总监、固定收益投资总监等职务。自2006年1月至2007年9月担任光大保德信货币市场基金基金经理。2007年10月至2008年1月任职长江养老保险股份有限公司，担任投资部总经理职务。2008年2月起任职于泰达宏利基金管理有限公司，担任固定收益部总经理。9年基金投资从业经验，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做出决定的公告日期。

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 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

本基金没有与之投资风格相似的投资组合。

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因异常交易而受到监管机构处罚的情况。

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

2010年，中国宏观经济形势在经历了快速恢复后，物价持续上行，CPI同比超过了政府3%的调控目标。货币政策逐步由适度宽松转向从紧，央行一方面提高了人民币贷款的存款准备金比率，另一方面限制了商业银行的外币借款。二季度下半期，随着信贷的大量投放，银行体系贷款总量达到了法定比例的上限，流动性空前紧张。由于信贷总量未得到有效控制，十一国庆节后，物价继续超预期快速上行.通货膨胀屡屡超过管理层的心理底线.在短短的三个月内，宏观调控风声越来越紧。决策层先后三次提高存款准备金率，两次加息，充分反映了政府控制通胀的努力，也进一步坚定了我们对2011年通胀可控的判断。

2010年初的信贷控制推动债券市场在一二季度出现了超预期的上涨。二季度后半段，随着流动性趋于紧张，短期债券的收益率抬升。与此同时，由于经济开始放缓的迹象已经相当明显，政策出现了一定的反复。在通胀预期抬升的打击下，长债收益率快速上升。政府控制流动性的努力，又打击了短期债券，债券市场出现了较大的调整。

在2010年的操作中，本基金一二季度增持了中长期债券，并仍持有息票相对较高的信用类债券，以期获得稳定的持有收益。但在流动性紧张时期，减持了部分前期涨幅较大的品种，以调整持有结构。在四季度操作中，对前期持有的中长期债券进行了波段操作，并仍持有息票相对较高的信用类债券，以获得稳定的收益。预计未来仍将根据宏观经济形势变化及收益率水平对持有品种进行一定的调整。在基金运作中，我们将始终坚持合法、合规的原则，在保证安全性、流动性的基础上，力争取得较高的收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

集利债券A

截止报告期末，本基金份额净值为1.0545元，本报告期份额净值增长率为3.94%，同期业绩比较基准增长率为1.69%。

集利债券C

截止报告期末，本基金份额净值为1.0441元，本报告期份额净值增长率为3.47%，同期业绩比较基准增长率为1.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2011年，中国经济面临的挑战主要来自于比实体经济增速先行一步的通货膨胀。过去对于经济增长过热的定义是GDP上双位数，但经历了本轮全球经济危机之后，中国经济的长期增长率已经有所下调。因此，以前看来似乎不高的经济增速，带来了超预期的通货膨胀。长期债券在2010年末所创下的收益率高点，远较2007年底的低，而后者大幅度低于04年底的高点。从另一角度印证了中国经济长期增长率的下调。从市场周期而言，债券市场2011年初可能处于新的起点上。再次加息对债券市场影响不大，因目前收益率曲线已在流动性收缩的反复冲击下为加息预留了较大的空间。

中短期看，目前控制蔬菜价格等的行政手段预计效果甚微。超预期的通胀压力将持续一季度。因此，年初由于流动性的收缩尚未结束，市场仍将处于振荡格局中。如出现通胀的实质性回落，债券市场将出现波段性机会。

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日对2009年基金利润进行了分配，按每10份基金份额派发0.1元进行利润分配，共分配855，947.78元。其中A类按每10份基金份额派发0.1元，分配596，279.04元；C类按每10份基金份额派发0.1元，分配259，668.74元。本基金于2011年1月21日对2010年基金利润进行了分配，按每10份基金份额派发0.15元进行利润分配，共分配948，443.61元。其中A类按每10份基金份额派发0.15元，分配384，696.15元；C类按每10份基金份额派发0.15元，分配563，747.46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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称"本托管人"）在对泰达宏利集利债券型证券投资基金（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2010年年度报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计，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：泰达宏利集利债券型证券投资基金

报告截止日：2010年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资产：		
银行存款	29，773，867.44	10，654，784.77
结算备付金	444，908.88	585，463.30
存出保证金	250，000.00	250，000.00
交易性金融资产	97，030，448.70	102，255，800.33
其中：股票投资	6，318，275.60	4，178，770.00
基金投资	-	-
债券投资	90，712，173.10	98，077，030.33
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	-	-
应收利息	1，279，798.33	1，075，795.19
应收股利	-	-
应收申购款	253，668，033.31	317，389.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	382，447，056.66	115，139，232.59
负债和所有者权益	本期期末 2010年12月31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	5，669，608.12	-
应付赎回款	365，194.74	1，302，887.53
应付管理人报酬	29，299.21	59，622.13
应付托管费	9，766.39	19，874.06
应付销售服务费	11，227.01	18，198.64
应付交易费用	70，221.99	140，221.01
应交税费	623，120.80	417，833.16
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	584，300.79	310，408.24
负债合计	7，362，739.05	2，269，044.77
所有者权益：		
实收基金	356，979，758.13	110，432，942.50
未分配利润	18，104，559.48	2，437，245.32
所有者权益合计	375，084，317.61	112，870，187.82
负债和所有者权益总计	382，447，056.66	115，139，232.59

注：报告截止日2010年12月31日，基金份额总额356，979，758.13份，其中下属A类基金份额227，810，504.64份，C类基金份额129，169，253.49份。下属A类基金份额净值1.0545元，C类基金份额净值1.0441元。

7.2 利润表

会计主体：泰达宏利集利债券型证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入	4，601，581.32	-10，116，731.47
1.利息收入	1，989，938.49	13，961，021.55
其中：存款利息收入	70，668.01	310，735.71
债券利息收入	1，919，270.48	13，650，285.84
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）	2，119，742.95	11，139，495.88
其中：股票投资收益	1，300，792.04	7，469，080.89
基金投资收益	-	-
债券投资收益	792，745.91	3，432，142.70
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	29，294.22
股利收益	26，205.00	208，978.07
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	427，934.55	-35，710，358.61
4. 汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	63，965.33	493，109.71
减：二、费用	1，345，328.12	6，201，204.71
1.管理人报酬	495，438.92	2，837，777.84
2.托管费	165，146.29	945，925.93
3.销售服务费	111，939.14	689，676.56
4.交易费用	184，956.80	1，301，894.61
5.利息支出	27，919.21	88，719.57
其中：卖出回购金融资产支出	27，919.21	88，719.57
6.其他费用	359，927.76	337，210.20
三、利润总额	3，256，253.20	-16，317，936.18
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	3，256，253.20	-16，317，936.18

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利集利债券型证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010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）	110，432，942.50	2，437，245.32	112，870，187.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3，256，253.20	3，256，253.20
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）	246，546，815.63	13，267，008.74	259，813，824.37
其中：1.基金申购款	598，989，757.94	27，606，031.20	626，595，789.14
2.基金赎回款	-352，442，942.31	-14，339，022.46	-366，781，964.77
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）	-	-855，947.78	-855，947.78
五、期末所有者权益（基金净值）	356，979，758.13	18，104，559.48	375，084，317.61
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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）	1，715，876，011.71	67，124，215.43	1，783，000，227.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-16，317，936.18	-16，317，936.18
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）	-1，605，443，069.21	-34，536，101.86	-1，639，979，171.07
其中：1.基金申购款	480，926，006.13	12，050，707.02	492，976，713.15
2.基金赎回款	-2，086，369，075.34	-46，586，808.88	-2，132，955，884.22
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）	-	-13，832，932.07	-13，832，932.07
五、期末所有者权益（基金净值）	110，432，942.50	2，437，245.32	112，870，187.82

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：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰达宏利集利债券型证券投资基金（以下简称"本基金"，原泰达荷银集利债券型证券投资基金）经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）证监许可［2008］第955号《关于核准泰达荷银集利债券型证券投资基金募集的批复》核准，由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《泰达荷银集利债券型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2，293，797，894.35元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字（2008）第140号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰达荷银集利债券型证券投资基金基金合同》于2008年9月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2，294，126，340.90份基金份额，其中认购资金利息折合328，446.55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"）。

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公司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集利债券型证券投资基金。

根据《泰达宏利集利债券型证券投资基金基金合同》和《泰达宏利集利债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金自募集期起根据申购费用、赎回费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用的，称为A类；新增不收取前端申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金类别，称为C类。本基金A类、C类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，在基金管理人认为合适的情况下，基金管理人可以根据相关法律法规的规定，提供本基金不同基金份额类别之间的转换服务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利集利债券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债、央行票据、金融债、企业（公司）债、资产支持证券、可转换公司债券（含分离交易的可转换公司债券）、债券回购等固定收益类金融工具，以及股票、权证等权益类品种和法律法规及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金资产配置的比例范围是：本基金投资于债券类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的80%，在一般情况下，基金资产将主要投资于企业（公司）债、金融债、可转换债券、国债及央行票据等。投资于股票等权益类证券的比例不超过基金资产的20%，其中包括参与一级市场新股申购、投资二级市场股票、持有可转换公司债券转股后所得股票以及权证等。基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：上证国债指数收益率×90%+中证红利指数收益率×10%。

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2011年3月29日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本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》、《泰达宏利集利债券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12月31日的财务状况以及2010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

本基金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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无会计政策变更、会计估计变更或重大会计差错。

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［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》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
法国巴黎投资管理亚洲有限公司（原"荷银投资管理（亚洲）有限公司"）	基金管理人的原股东

注：根据本基金的基金管理人2010年3月9日发布的《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》的有关规定，经公司2009年第五次股东会审议通过并经中国证监会证监许可［2010］166号文批准，本基金的基金管理人原外方股东荷银投资管理（亚洲）有限公司将所持有的公司全部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%。

2010年4月1日，法国巴黎投资与富通资产管理集团完成合并，合并后本基金管理人的原股东荷银投资管理（亚洲）有限公司以法国巴黎投资管理亚洲有限公司（BNP Paribas Investment Partners Asia Limited）的名称营运。

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

7.4.8.1.1.1 股票交易

本基金在本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易，2009年同。

7.4.8.1.1.2 债券交易

本基金在本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易，2009年同。

7.4.8.1.1.3债券回购交易

本基金在本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易，2009年同。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金在本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易，2009年同。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期内无应支付关联方的佣金，2009年同。

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 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	495，438.92	2，837，777.84
其中：支付给销售机构的客户维护费	66，132.25	321，817.30

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0.60%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 0.60% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	165，146.29	945，925.93

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0.20%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 X0.20% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利集利债券A	泰达宏利集利债券C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	7，135.07	7，135.07
中国银行	-	77，608.89	77，608.89
合计	-	84，743.96	84，743.96
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利集利债券A	泰达宏利集利债券C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	67，207.96	67，207.96
中国银行	-	505，554.22	505，554.22
合计	-	572，762.18	572，762.18

注：支付基金销售机构的销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泰达宏利基金管理有限公司，再由泰达宏利基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日C类基金份额销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值 X 0.40% / 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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	19，957，704.38	264，720，980.14	-	-	-	-

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

报告期内无基金管理人运用固定资金投资本基金的情况，2009年同。

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

报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况，2009年同。

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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009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	29，773，867.44	64，531.36	10，654，784.77	298，631.79

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

本报告期内本基金无在承销期内参与关联方承销证券的情况，2009年同。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内本基金无其他关联交易事项，2009年同。

7.4.9 期末（2010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

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2010年12月31日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

截至本报告期末2010年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2010年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额。

§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	6，318，275.60	1.65
	其中：股票	6，318，275.60	1.65
2	固定收益投资	90，712，173.10	23.72
	其中：债券	90，712，173.10	23.72
	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	30，218，776.32	7.90
6	其他各项资产	255，197，831.64	66.73
	合计	382，447，056.66	100.00

8.2 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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	4，123，350.00	1.10
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	2，520，000.00	0.67
C8	医药、生物制品	1，603，350.00	0.43
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	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	2，194，925.60	0.59
	合计	6，318，275.60	1.68

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	002158	汉钟精机	70，000	2，520，000.00	0.67
2	002344	海宁皮城	39，995	2，194，925.60	0.59
3	000590	紫光古汉	105，000	1，603，350.00	0.43

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司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	600166	福田汽车	3，919，173.41	3.47
2	002344	海宁皮城	3，726，923.85	3.30
3	600519	贵州茅台	3，269，585.61	2.90
4	002158	汉钟精机	2，870，549.40	2.54
5	000630	铜陵有色	2，070，869.00	1.83
6	601939	建设银行	1，995，804.00	1.77
7	600221	海南航空	1，992，440.85	1.77
8	600115	东方航空	1，968，108.10	1.74
9	601398	工商银行	1，869，000.00	1.66
10	000590	紫光古汉	1，785，239.00	1.58
11	600997	开滦股份	1，670，000.00	1.48
12	000063	中兴通讯	1，663，558.00	1.47
13	002041	登海种业	1，558，000.00	1.38
14	600068	葛洲坝	1，347，472.00	1.19
15	000968	煤 气 化	1，340，887.55	1.19
16	600019	宝钢股份	1，301，300.00	1.15
17	002073	软控股份	1，217，618.70	1.08
18	000338	潍柴动力	1，166，078.20	1.03
19	002304	洋河股份	1，143，164.00	1.01
20	600256	广汇股份	1，103，246.00	0.98

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	600166	福田汽车	4，035，395.28	3.58
2	600519	贵州茅台	3，396，051.26	3.01
3	601939	建设银行	2，955，690.00	2.62
4	601318	中国平安	2，478，905.95	2.20
5	600115	东方航空	2，331，984.00	2.07
6	600221	海南航空	2，282，089.29	2.02
7	000630	铜陵有色	2，160，879.62	1.91
8	601398	工商银行	1，993，900.00	1.77
9	600997	开滦股份	1，783，653.00	1.58
10	002344	海宁皮城	1，657，622.81	1.47
11	000063	中兴通讯	1，505，846.11	1.33
12	000968	煤 气 化	1，481，792.46	1.31
13	002304	洋河股份	1，419，638.20	1.26
14	002041	登海种业	1，365，403.91	1.21
15	600068	葛洲坝	1，316，829.60	1.17
16	600019	宝钢股份	1，281，080.79	1.14
17	600256	广汇股份	1，256，450.00	1.11
18	002073	软控股份	1，252，890.60	1.11
19	600362	江西铜业	1，215，500.00	1.08
20	000338	潍柴动力	1，180，315.96	1.05

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	59，021，164.74
卖出股票收入（成交）总额	57，885，829.23

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	44，675，050.00	11.91
2	央行票据	19，618，000.00	5.23
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	17，873，331.30	4.77
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	8，545，791.80	2.28
7	其他	-	-
	合计	90，712，173.10	24.18

8.6 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	1001037	10央票37	200，000	19，618，000.00	5.23
2	100013	10附息国债13	200，000	19，112，000.00	5.10
3	010303	03国债(3)	120，000	11，223，600.00	2.99
4	010107	21国债(7)	90，000	9，225，000.00	2.46
5	113002	工行转债	55，000	6，497，700.00	1.73

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.1 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。

8.9.3 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	250，000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1，279，798.33
5	应收申购款	253，668，033.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	255，197，831.64

8.9.4 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	110009	双良转债	638，600.00	0.17
2	110078	澄星转债	99，416.80	0.03

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票中无流通受限情况。

8.9.6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

份额级别	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
泰达宏利集利债券A	1，382	164，841.18	182，160，341.56	79.96%	45，650，163.08	20.04%
泰达宏利集利债券C	1，629	79，293.59	74，191，685.73	57.44%	54，977，567.76	42.56%
合计	3，011	118，558.54	256，352，027.29	71.81%	100，627，730.84	28.19%

9.2 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	份额级别	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	泰达宏利集利债券A	-	-
	泰达宏利集利债券C	49.85	0.0000%
	合计	49.85	0.0000%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达宏利集利债券A	泰达宏利集利债券C
基金合同生效日（2008年9月26日）基金份额总额	1，620，067，528.70	674，058，812.20
本报告期期初基金份额总额	61，045，668.11	49，387，274.39
本报告期基金总申购份额	370，043，261.67	228，946，496.27
减：本报告期基金总赎回份额	203，278，425.14	149，164，517.17
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	227，810，504.64	129，169，253.49

§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、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。

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有限公司审计费用为5万元，该审计机构对本基金已提供审计服务的年限为3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

本年度基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有发生受到监管部门稽查或处罚的任何情况。

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

1.7.1 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	
广发华福	1	67，606，151.57	58.09%	57，464.14	59.18%	-
齐鲁证券	1	48，774，498.40	41.91%	39，629.62	40.82%	-

注：1、本会计期内，本基金无交易席位增减情况；

2、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。

公司研究部定期牵头研究员和基金经理根据券商研究信息的及时性、准确性和主动性对券商服务进行评价，根据评价结果，交易部填写席位调整申请表，经投资总监和交易部总经理签字后交信息技术部执行。交易席位每月调整一次，如遇特殊情况，经交易部研究并上报公司领导批准后，可随时调整。

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
广发华福	351，173，169.16	89.10%	94，000，000.00	100.00%	-	-
齐鲁证券	42，949，448.64	10.90%	-	-	-	-

§12 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"。

经报请中国证监会批准，并通告基金托管人，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集利债券型证券投资基金。

泰达宏利基金管理有限公司
2011年3月29日