泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金 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4月23日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利财富大盘指数
基金主代码	162213
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月23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	595,743,595.27份
基金合同存续期	持续经营

2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资策略,紧密跟踪中证财富大盘指数,力争获取与标的指数相似的投资收益,并力争将基金的日跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年化跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金采用指数完全复制方法,原则上按照标的指数成分股及权重构建基金的投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,以达到跟踪和复制指数的目的。但如遇特殊情况(如市场流动性不足、成分股被限制投资等)致使基金无法购得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理的方法进行适当替代,以使跟踪误差控制在限定范围内。
业绩比较基准	95%×中证财富大盘指数收益率+5%×同业存款利率。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,属于高风险、高收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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4月23日至2010年12月31日
本期已实现收益	23,639,221.48
本期利润	850,934.50
加权平均基金份额本期利润	0.0013
本期基金份额净值增长率	5.91%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末
期末可供分配基金份额利润	0.0388
期末基金资产净值	618,841,363.23
期末基金份额净值	1.039

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;

4.本基金基金合同于2010年4月23日生效。实际报告期间为2010年4月23日至2010年12月31日。

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	4.21%	1.64%	5.12%	1.63%	-0.91%	0.01%
过去六个月	13.52%	1.43%	15.43%	1.44%	-1.91%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	5.91%	1.32%	-5.90%	1.55%	11.81%	-0.23%

注:本基金业绩比较基准:95%×中证财富大盘指数收益率+5%×同业存款利率。

本基金股票资产的跟踪标的指数为中证财富大盘指数。中证财富大盘指数是由中证指数有限公司编制并开发的中国A股市场指数。该指数按照上市公司创造财富能力的大小进行选样,挑选最具创造财富能力的300家A股上市公司作为样本;此外该指数在加权方式上亦有所创新,不同于一般的市值加权指数,该指数样本个股的权重配置将与其创造财富能力的大小相适应,从而打破市值指数中价格与权重过于紧密的联系,预防个股权重由于价格的非理性波动而大起大落,提高了个股权重配置的稳定性。指数的表现综合反映了中国经济增长过程中核心企业真实的财富增长情况。

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:本基金合同于2010年4月23日生效,基金成立未满一年,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 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

注:本基金合同生效日为2010年4月23日,2010年度净值增长率的计算期间为2010年4月23日至2010年12月31日。

3.4 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
2010	0.2000	6,627,393.10	414,809.50	7,042,202.60	
合计	0.2000	6,627,393.10	414,809.50	7,042,202.60	

注:本基金基金合同于2010年4月23日生效。实际报告期间为2010年4月23日至2010年12月31日。

§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		
王咏辉	本基金基金经理	2010年4月23日	-	12	英国牛津大学工程和计算机专业,硕士学历;曾担任伦敦摩根大通(JP Morgan)投资基金管理公司分析员、高级分析师、汇丰投资基金管理公司(HSBC)高级分析师、巴克莱国际投资基金管理公司ETF亚洲部门经理、巴克莱资本公司(Barclays Capital)部门经理。2008年4月加入泰达宏利基金管理有限公司,担任金融工程部副总经理;2010年4月起担任泰达宏利中证财富大盘指数型证券投资基金基金经理;具备12年基金从业经验,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《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

本基金与公司管理的其他投资组合不具有相似的投资风格。

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

A股市场2010年基本上呈震荡小幅下跌的走势,公布的月度核心经济数据,验证了中国经济增速在季节性规律和政府的主动调控政策下出现了放缓。由于多少已经反映在市场预期当中,因此对四季度影响比较有限,不过这也抑制市场在7月和10月初趋势性上涨的行情。由于下半年管理通胀预期的形势依然严峻,进而在紧缩银根政策和市场扩容共同推动下,流动性尚难以对市场表现形成大幅推动,但是市场预期在2010年底已经转多。

在7月和10月初,引发市场上涨的主要因素有几个方面,一是通胀和人民币升值拉动市场整体估值中枢上移,二是经济复苏和业绩增长预期双轮驱动:

1、首先,预计CPI在四季度初阶段性见顶,市场预期CPI有可能逐步回落,再次加息可能不确定。因此货币政策的价格工具不会进一步收紧。尽管管理层不允许人民币的快速升值,但是如果提前加息,不仅不能管理通胀压力下的紧缩预期,反而引发市场关于国外资金流入中国套利的预期和人民币对外升值和对内贬值的双重担忧。在流动性总体上泛滥和负利率时代,初期的加息对通胀和人民币升值预期起的不是减缓而是加强的作用,更多的资金将流入A股市场寻求机会从而推高资产资源类大盘蓝筹的估值溢价。

2、再次,在四月份推出史上超严厉地产调控措施的情况下,我国前三季度GDP依然同比增长10.6%,好于预期,预示经济内生性复苏依然强劲。高经济增长是上市公司高利润增长的保证,今年上市公司同比利润增长可以期待并令人鼓舞。

3、最后,三季度末的再次地产调控措施,会打击房地产行业的投资规模和交易,但是地产行业的资金分流入股市是个趋势,同时人民币升值推高中国资产估值的预期会大大冲抵地产调控对地产板块的影响。

本基金在投资部和研究部的支持下,比较准确的抓住了4月市场的顶部和6月市场的底部,利用深度的研究和准确投资仓位控制能力,保持高的风险类股票资产的配置,在市场7月上涨过程中在很大程度上获得净值提升,同时利用有效的数量化投资模型来管理基金仓位,避免了4月和5月市场下跌对基金的部分影响。

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1.0390元,本报告期份额净值增长率为5.91%,同期业绩比较基准增长率为-5.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011市场展望和投资策略:

1.各个板块都存在机会,但是绝对幅度有限。

2.个股挖掘显得更为重要,这不同于今年的主题投资,是真实的业绩和合理的估值。成功的关键就是找到超预期的个股,集中持股。

3.变数在对价值股和成长股的判断,只能相机而动。保持良好的心态和不亏损是最重要的。

4.2011是成长风格和价值风格并存的一年,右手抓成长风格,左手抓价值风格,就如魔术师手中的两个球,在成长风格和价值风格之间博弈。

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9月8日按每10份基金份额派发0.2元进行利润分配,共分配7,042,202.60元。根据基金合同的约定,目前无收益分配安排。

§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”)在对泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金(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:泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

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
资产:	
银行存款	24,905,028.75
结算备付金	6,805,064.71
存出保证金	630,219.46
交易性金融资产	589,591,595.75
其中:股票投资	589,500,657.15
基金投资	-
债券投资	90,938.60
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	23,635.58
应收股利	-
应收申购款	52,310.64
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	622,007,854.89
负债和所有者权益	本期期末 2010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	-
应付赎回款	172,681.62
应付管理人报酬	366,352.31
应付托管费	67,634.29
应付销售服务费	-
应付交易费用	1,914,750.59
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	645,072.85
负债合计	3,166,491.66
所有者权益:	
实收基金	595,743,595.27
未分配利润	23,097,767.96
所有者权益合计	618,841,363.23
负债和所有者权益总计	622,007,854.89

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值1.039元,基金份额总额595,743,595.27份。本基金基金合同于2010年4月23日生效。实际报告期间为2010年4月23日至2010年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

本报告期:2010年4月23日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年4月23日至2010年12月31日
一、收入	11,542,955.70
1.利息收入	1,533,394.28
其中:存款利息收入	695,499.20
债券利息收入	227.19
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	837,667.89
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	30,917,794.90
其中:股票投资收益	25,165,574.94
基金投资收益	-
债券投资收益	51,039.05
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	5,701,180.91
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-22,788,286.98
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,880,053.50
二、费用	10,692,021.20
1.管理人报酬	2,950,781.13
2.托管费	544,759.61
3.销售服务费	-
4.交易费用	6,773,311.64
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	423,168.82
三、利润总额	850,934.50
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	850,934.50

注:本基金合同于2010年4月23日生效,基金成立未满一年,本基金实际报告期间为2010年4月23日至2010年12月31日。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

本报告期:2010年4月23日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年4月23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)	1,165,158,636.81	-	1,165,158,636.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	850,934.50	850,934.50
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)	-569,415,041.54	29,289,036.06	-540,126,005.48
其中:1.基金申购款	860,948,725.13	102,956,706.14	963,905,431.27
2.基金赎回款	-1,430,363,766.67	-73,667,670.08	-1,504,031,436.75
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)	-	-7,042,202.60	-7,042,202.60
五、期末所有者权益(基金净值)	595,743,595.27	23,097,767.96	618,841,363.23

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

泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2010]第176号《关于核准泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金募集的批复》核准,由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《泰达宏利中证财富大盘指数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1,165,036,951.93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(2010)第092号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》于2010年4月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,165,158,636.81份基金份额,其中认购资金利息折合121,684.88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《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中投资于股票组合的比例不低于基金资产的90%,投资组合中投资于中证财富大盘指数成份股的资产不低于股票资产的90%,现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:中证财富大盘指数收益率×95%+同业存款利率×5%。

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》、《泰达宏利中证财富大盘指数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4月23日(基金合同生效日)至2010年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2010年4月23日(基金合同生效日)至2010年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时,终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

(1)重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(a)对于特殊事项停牌股票,根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值,通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动,停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。

(b)对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(c)在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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

本基金本报告期内无会计政策变更的说明。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内本基金无会计估计变更的说明。

7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内本基金无差错更正的说明。

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》、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 股票交易

本基金在本报告期内无通过关联交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本基金在本报告期内无通过关联交易单元进行的债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金在本报告期内无通过关联交易单元进行的债券回购交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金在本报告期内无通过关联交易单元进行的权证交易。

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。

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4月23日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,950,781.13
其中:支付给销售机构的客户维护费	362,790.05

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0.65%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×0.65%/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4月23日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	544,759.61

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0.12%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×0.12%/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

本报告期本基金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

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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。

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4月23日至2010年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	24,905,028.75	642,322.56

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。

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。

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

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 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
600963	岳阳纸业	2010年12月28日	2011年1月6日	配股流通锁定	7.70	10.09	12,731	98,028.70	128,455.79	-

注:1、本基金在本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限的债券和权证。

2、基金可以使用以基金名义开设的股票帐户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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
600664	哈药股份	2010年12月29日	重大事项	22.57	2011年2月16日	24.83	55,053	1,303,691.38	1,242,546.21	-
600518	康美药业	2010年12月28日	配股认购	19.71	2011年1月6日	17.29	55,566	1,136,794.55	1,095,205.86	-
002439	启明星辰	2010年12月29日	重大事项	42.55	-	-	22,500	988,595.96	957,375.00	-
000059	辽通化工	2010年12月2日	重大事项	11.59	-	-	59,857	703,028.17	693,742.63	-
000959	首钢股份	2010年10月29日	重大事项	4.42	-	-	137,475	555,320.38	607,639.50	-

注:本基金截至2010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

截至本报告期末2010年12月31日止,本基金没有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,本基金没有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	589,500,657.15	94.77
	其中:股票	589,500,657.15	94.77
2	固定收益投资	90,938.60	0.01
	其中:债券	90,938.60	0.01
	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	31,710,093.46	5.10
6	其他各项资产	706,165.68	0.11
7	合计	622,007,854.89	100.00

8.2 期末按行业分类的股票指数投资组合

8.2.1 指数投资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	356,085.45	0.06
B	采掘业	59,216,956.52	9.57
C	制造业	156,347,780.93	25.26
C0	食品、饮料	12,057,965.16	1.95
C1	纺织、服装、皮毛	3,094,973.61	0.50
C2	木材、家具	890,954.77	0.14
C3	造纸、印刷	3,384,318.15	0.55
C4	石油、化学、塑胶、塑料	12,299,533.53	1.99
C5	电子	2,564,709.45	0.41
C6	金属、非金属	47,797,068.91	7.72
C7	机械、设备、仪表	61,361,898.24	9.92
C8	医药、生物制品	11,963,039.39	1.93
C99	其他制造业	933,319.72	0.15
D	电力、煤气及水的生产和供应业	23,353,601.16	3.77
E	建筑业	20,499,512.69	3.31
F	交通运输、仓储业	20,607,934.46	3.33
G	信息技术业	20,569,875.59	3.32
H	批发和零售贸易	13,051,170.73	2.11
I	金融、保险业	157,142,275.92	25.39
J	房地产业	32,838,077.60	5.31
K	社会服务业	4,926,529.78	0.80
L	传播与文化产业	420,112.50	0.07
M	综合类	9,685,481.56	1.57
	合计	519,015,394.89	83.87

8.2.2 积极投资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	964,008.38	0.16
B	采掘业	2,845,695.72	0.46
C	制造业	31,278,436.34	5.05
C0	食品、饮料	978,782.94	0.16
C1	纺织、服装、皮毛	964,807.20	0.16
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	941,276.82	0.15
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,069,796.02	0.50
C5	电子	2,833,812.41	0.46
C6	金属、非金属	14,263,426.69	2.30
C7	机械、设备、仪表	1,775,908.84	0.29
C8	医药、生物制品	6,450,625.42	1.04
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,926,125.80	0.31
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	13,098,665.84	2.12
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	8,259,459.04	1.33
K	社会服务业	7,464,178.29	1.21
L	传播与文化产业	937,475.20	0.15
M	综合类	3,711,217.65	0.60
	合计	70,485,262.26	11.39

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 期末指数投资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	600016	民生银行	3,579,173	17,967,448.46	2.90
2	600036	招商银行	1,303,679	16,700,127.99	2.70
3	601328	交通银行	2,885,685	15,813,553.80	2.56
4	601166	兴业银行	618,515	14,875,285.75	2.40
5	601318	中国平安	226,012	12,692,833.92	2.05
6	600050	中国联通	2,298,550	12,297,242.50	1.99
7	600000	浦发银行	968,915	12,004,856.85	1.94
8	600030	中信证券	843,020	10,613,621.80	1.72
9	000002	万 科A	1,224,871	10,068,439.62	1.63
10	601398	工商银行	2,330,016	9,879,267.84	1.60

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。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600516	方大炭素	74,763	1,047,429.63	0.17
2	600111	包钢稀土	14,300	1,021,592.00	0.17
3	002410	广联达	14,342	1,018,282.00	0.16
4	002237	恒邦股份	18,615	1,012,283.70	0.16
5	002431	棕榈园林	10,834	985,894.00	0.16

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末基金资产净值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	600016	民生银行	69,272,219.15	11.19
2	600036	招商银行	68,187,876.57	11.02
3	601328	交通银行	66,235,890.59	10.70
4	601166	兴业银行	56,770,791.97	9.17
5	600050	中国联通	53,897,315.75	8.71
6	600000	浦发银行	52,621,653.69	8.50
7	601088	中国神华	50,812,466.86	8.21
8	000002	万 科A	44,754,004.02	7.23
9	600030	中信证券	38,465,702.06	6.22
10	601318	中国平安	37,424,692.90	6.05
11	601398	工商银行	35,372,965.13	5.72
12	601939	建设银行	33,660,857.66	5.44
13	600019	宝钢股份	26,529,921.69	4.29
14	601169	北京银行	25,511,327.63	4.12
15	600028	中国石化	21,536,230.89	3.48
16	000001	深发展A	20,518,079.95	3.32
17	601668	中国建筑	20,293,138.27	3.28
18	600048	保利地产	18,912,311.47	3.06
19	601601	中国太保	18,739,146.77	3.03
20	000983	西山煤电	18,527,501.17	2.99
21	601006	大秦铁路	16,844,748.89	2.72
22	600015	华夏银行	15,811,201.45	2.55
23	600519	贵州茅台	15,419,889.85	2.49
24	601857	中国石油	15,327,769.09	2.48
25	600900	长江电力	14,932,053.94	2.41
26	000858	五 粮 液	14,874,759.87	2.40
27	600104	上海汽车	13,877,851.35	2.24
28	600383	金地集团	13,830,341.60	2.23
29	002024	苏宁电器	13,705,726.45	2.21
30	600348	国阳新能	13,690,755.87	2.21
31	000402	金 融 街	13,052,147.91	2.11
32	600837	海通证券	13,031,052.43	2.11
33	600031	三一重工	12,752,722.37	2.06
34	601666	平煤股份	12,743,095.81	2.06
35	000063	中兴通讯	12,622,163.88	2.04
36	600795	国电电力	12,635,973.45	2.04
37	601186	中国铁建	12,581,934.34	2.03

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末基金资产净值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	600036	招商银行	49,262,411.47	7.96
2	600016	民生银行	48,704,946.33	7.87
3	601328	交通银行	46,761,488.32	7.56
4	600050	中国联通	41,639,562.04	6.73
5	601166	兴业银行	40,581,668.43	6.56
6	601088	中国神华	40,120,964.41	6.48
7	600000	浦发银行	37,650,789.92	6.08
8	000002	万 科A	35,116,016.51	5.67
9	601318	中国平安	26,291,638.91	4.25
10	600030	中信证券	25,932,259.47	4.19
11	601939	建设银行	25,846,856.17	4.18
12	601398	工商银行	24,392,020.14	3.94
13	600019	宝钢股份	19,796,637.86	3.20
14	601169	北京银行	17,807,089.07	2.88
15	000983	西山煤电	15,797,305.63	2.55
16	600028	中国石化	15,307,082.77	2.47
17	600048	保利地产	14,327,885.12	2.32
18	601668	中国建筑	14,251,438.63	2.30
19	601601	中国太保	13,283,503.46	2.15
20	000001	深发展A	13,258,798.98	2.14
21	600519	贵州茅台	12,530,106.04	2.02

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	2,599,467,996.80
卖出股票收入(成交)总额	2,012,327,689.01

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。

8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	90,938.60	0.01
7	其他	-	-
8	合计	90,938.60	0.01

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	110011	歌华转债	740	90,938.60	0.01

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。

8.9.2 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。

8.9.3 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	630,219.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,635.58
5	应收申购款	52,310.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	706,165.68

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.9.5.1 指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况的说明。

8.9.5.2 积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况的说明。

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

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
5,451	109,290.70	457,692,527.35	76.83%	138,051,067.92	23.17%

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	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	514,372.37	0.0863%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2010年4月23日)基金份额总额	1,165,158,636.81
本报告期基金总申购份额	860,948,725.13
减:本报告期基金总赎回份额	1,430,363,766.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	595,743,595.27

§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

本报告期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

本报告期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

本报告期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9万元。

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

本报告期基金管理人、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

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	
中银国际	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	2,712,340,353.06	58.95%	2,305,489.57	59.76%	-
国金证券	1	751,878,942.69	16.34%	610,908.01	15.84%	-
安信证券	1	672,432,071.78	14.61%	546,358.19	14.16%	-
申银万国	1	464,756,762.72	10.10%	395,045.32	10.24%	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-

注:1、本报告期内,本基金券商交易单元均为新增。

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
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	2,688,500,000.00	100.00%	-	-
国金证券	331,811.30	68.34%	-	-	-	-
安信证券	146,270.73	30.13%	-	-	-	-
申银万国	7,448.20	1.53%	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-

§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"。

泰达宏利基金管理有限公司
2011年3月29日