泰达宏利行业精选证券投资基金 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

本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。本年度报告已经全体独立董事签字同意,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	泰达宏利精选股票
基金主代码	162204
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年7月9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	1,115,191,558.11 份
基金合同存续期	持续经营

2.2 基金产品说明

投资目标	追求资本的长期持续增值,为投资者寻求高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	全面引进荷兰银行的投资管理流程,采用“自上而下”资产配置和行业类别与行业配置,“自下而上”精选股票的投资策略,主要投资于具有国际、国内竞争力比较优势和长期增值潜力的行业和企业的股票。
业绩比较基准	70%×富时中国A600指数收益率+30%×中债国债总指数(财富)
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于风险较高的基金品种

注:本基金管理人于2010年12月25日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准更名公告》,将本基金的业绩比较基准更改为“70%×富时中国A600指数收益率+30%×中债国债总指数(财富)”。

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
本期已实现收益	10,465,314.11	1,812,112,344.24	-2,294,850,317.74
本期利润	493,881,491.52	2,471,504,986.38	-3,073,541,421.41
加权平均基金份额本期利润	0.3966	1.8122	-2.7496
本期基金份额净值增长率	12.73%	71.09%	-48.44%
3.1.2 期末数据和指标	**2010 年末**	**2009 年末**	**2008 年末**
期末可供分配基金份额利润	3.0335	3.0102	1.7232
期末基金资产净值	5,975,759,936.60	7,219,090,305.44	3,007,524,931.65
期末基金份额净值	5.3585	4.8077	2.8100

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

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	11.12%	1.67%	4.25%	1.21%	6.87%	0.46%
过去六个月	32.44%	1.44%	16.99%	1.07%	15.45%	0.37%
过去一年	12.73%	1.43%	-3.91%	1.09%	16.64%	0.34%
过去三年	-0.54%	1.78%	-19.36%	1.60%	18.82%	0.18%
过去五年	466.21%	1.81%	181.02%	1.51%	285.19%	0.30%
自基金合同生效日起至今	491.76%	1.65%	145.38%	1.40%	346.38%	0.25%

注:本基金业绩比较基准:70%×富时中国A600+30%×中债国债总指数(财富)。富时中国A600指数是富时指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所总市值最大的600只股票并以流通股本加权的股票指数,具有良好的市场代表性。中债国债总指数(财富)是中央国债登记结算有限责任公司推出的中国国债总指数,该指数基于全市场角度编制的指数,价格选取上更侧重于全国银行间债券市场,选样广泛,全面而细致反映债券市场变动。

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。

3.2.3 过去五年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

3.3 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	0.5000	36,569,980.39	30,919,548.30	67,489,528.69	
2009	-	-	-	-	
2008	1.0000	65,923,638.41	49,279,086.78	115,202,725.19	
合计	1.5000	102,493,618.80	80,198,635.08	182,692,253.88	

§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		
刘青山	本基金基金经理,公司副总经理兼投资总监	2004年7月9日	-	14	本基金基金经理,公司副总经理兼投资总监。1997年毕业于中国人民大学,获管理学硕士学位,同年加入华夏证券基金管理部,参与华夏基金管理有限公司的筹建,先后在研究部和投资管理部从事行业研究及投资管理工作,并分别担任业务经理和高级经理。2001年加入湘财证券有限责任公司,参与筹建泰达宏利基金管理有限公司并工作至今。14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

2010年度,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股市场的表现离不开宏观经济这个大背景,2009年市场的大幅反弹,主要源自于低价格和低利率环境下的社会补库存,另外巨额信贷增量导致的流动性也推升了市场的估值,应该说09年市场的运行方向是较为明确的,即市场预期由坏变好,而经济的实际情况也支持这一预期,股市的上涨成为必然。然而2010年的情况变得较为复杂,一方面社会补库存于09年结束,另一方面新一轮的中周期还未启动,经济处于政策刺激逐步退出和依靠自身动力重新增长之间的过渡阶段,此外信贷增量的下降也导致市场流动性的充裕程度大幅下降,市场整体估值水平受到压缩。因此2010年A股市场更多地表现为区间震荡和结构分化,在缺乏系统性机会的情况下,投资者开始追逐消费、医药、电子以及一些新兴产业,这些行业共同的特点就是增长较为平稳,且受到政策鼓励,而那些所谓的“传统”产业的股票乏人问津,资金对前面几个行业股票的追逐导致其估值大幅提高,同时泡沫化的风险也随之而来。

虽然2010年的A股市场整体表现不佳,但也不乏亮点,市场给了确定性成长更高的估值溢价,如果对成长股把握的好,一样可以获取可观的正收益。

本基金在年初维持了一个较为均衡的配置,但政府刺激政策的退出速度超出市场预期,周期性行业的不确定性大幅增加,因此本基金在一季度大幅减持了金融、地产、煤炭、钢铁等周期性行业,同时大幅降低仓位,有效规避了市场在二季度的下跌风险。

在减持周期性行业的同时,本基金也谨慎地增持了高成长的行业,如消费、医药、电子等,这些行业在全年的上涨为本基金的净值增长做出了较大贡献。

四季度本基金认为这类成长股的估值溢价率已经达到历史最高点,未来可能会面临较大的估值压力,因此四季度本基金对这些行业做了适当减持,使得配置更为均衡。

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5.3585元,本报告期份额净值增长率为12.73%,同期业绩比较基准增长率为-3.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

根据对中国经济运行周期的分析,从2011年开始,中国将进入从复苏到繁荣的过渡阶段,在这个阶段,经济将有实质性的增长,也就是存在效率提升、规模扩张和产能扩张的阶段,正因为这个变化是实质性的,所以反而没有单纯库存周期那么迅速和系统。在这一阶段,市场预期会受到各种因素影响产生较大的波动,在这样的预期环境下很难产生系统性的上涨,同样系统性下跌的可能性也不大。

从市场流动性方面看,实体经济的持续好转必将导致资金的边际增量从资本市场等虚拟经济向实体经济转移,这一结果的表现就是A股市场在2011年的资金面比去年更为紧张,市场估值再次提升的概率大幅下降,去年上涨较多的高估值板块将存在巨大的估值压缩风险。

如果说2010年一些新兴板块的上涨还有估值提升推动的话,2011年只能依靠业绩不断提升才能支撑股价,这类板块股价分化将是必然。另外国内CPI不断高于市场预期,使得政策紧缩预期也非常强烈,周期股依然没有趋势性机会,可以说2011年A股市场注定不会有太高的收益,精选个股是获取超额收益的关键。

本基金将发挥投研团队的个股挖掘能力,寻找估值合理、可持续成长性好的公司,保持基金净值的稳健增长。

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0.5元进行利润分配,共分配67,489,528.69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”)在对泰达宏利行业精选证券投资基金(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:泰达宏利行业精选证券投资基金

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	615,562,742.01	513,071,672.72
结算备付金	24,206,891.90	31,070,727.39
存出保证金	5,557,969.21	5,809,480.99
交易性金融资产	5,371,317,509.23	6,273,989,853.51
其中:股票投资	5,360,871,290.43	6,268,760,074.41
基金投资	-	-
债券投资	10,446,218.80	5,229,779.10
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	35,493,327.56	452,239,207.93
应收利息	229,835.81	173,105.38
应收股利	-	-
应收申购款	1,246,611.70	501,859.28
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	6,053,614,887.42	7,276,855,907.20
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	56,337,209.57	-
应付赎回款	780,592.73	31,066,135.35
应付管理人报酬	7,972,506.86	9,287,045.34
应付托管费	1,328,751.16	1,547,840.85
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	8,994,580.35	14,130,157.91
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	2,441,310.15	1,734,422.31
负债合计	77,854,950.82	57,765,601.76
所有者权益:		
实收基金	1,115,191,558.11	1,501,555,893.97
未分配利润	4,860,568,378.49	5,717,534,411.47
所有者权益合计	5,975,759,936.60	7,219,090,305.44
负债和所有者权益总计	6,053,614,887.42	7,276,855,907.20

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值5.3585元,基金份额总额 1,115,191,558.11份。

7.2 利润表

会计主体:泰达宏利行业精选证券投资基金

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	652,693,641.91	2,653,719,236.02
1.利息收入	8,724,093.20	7,009,225.59
其中:存款利息收入	5,998,743.30	5,983,804.86
债券利息收入	2,711,570.44	1,025,420.73
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	13,779.46	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	158,291,194.77	1,983,917,240.69
其中:股票投资收益	131,669,296.69	1,915,733,984.17
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,371,169.60	29,380,666.98
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	24,250,728.48	38,802,589.54
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	483,416,177.41	659,392,642.14
4. 汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	2,262,176.53	3,400,127.60
减:二、费用	158,812,150.39	182,214,249.64
1.管理人报酬	86,586,248.35	84,677,111.41
2.托管费	14,431,041.38	14,112,851.95
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	57,305,512.57	82,967,231.60
5.利息支出	-	13,928.22
其中:卖出回购金融资产支出	-	13,928.22
6.其他费用	489,348.09	443,126.46
三、利润总额	493,881,491.52	2,471,504,986.38
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	493,881,491.52	2,471,504,986.38

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰达宏利行业精选证券投资基金

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)	1,501,555,893.97	5,717,534,411.47	7,219,090,305.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	493,881,491.52	493,881,491.52
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)	-386,364,335.86	-1,283,357,995.81	-1,669,722,331.67
其中:1.基金申购款	652,344,530.33	2,616,868,632.71	3,269,213,163.04
2.基金赎回款	-1,038,708,866.19	-3,900,226,628.52	-4,938,935,494.71
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)	-	-67,489,528.69	-67,489,528.69
五、期末所有者权益(基金净值)	1,115,191,558.11	4,860,568,378.49	5,975,759,936.60
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)	1,070,289,166.65	1,937,235,765.00	3,007,524,931.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,471,504,986.38	2,471,504,986.38
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)	431,266,727.32	1,308,793,660.09	1,740,060,387.41
其中:1.基金申购款	1,419,154,758.53	4,494,185,372.89	5,913,340,131.42
2.基金赎回款	-987,888,031.21	-3,185,391,712.80	-4,173,279,744.01
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)	1,501,555,893.97	5,717,534,411.47	7,219,090,305.44

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

泰达宏利行业精选证券投资基金(以下简称“本基金”,原湘财荷银行业精选证券投资基金,后更名为泰达荷银行业精选证券投资基金)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[2004]第58号《关于同意湘财荷银行业精选证券投资基金设立的批复》核准,由基金发起人湘财荷银基金管理有限公司(于2006年4月27日更名为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《湘财荷银行业精选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2,016,372,878.75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(2004)第108号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《湘财荷银行业精选证券投资基金基金合同》于2004年7月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,017,034,173.30份基金份额,其中认购资金利息折合661,294.55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”)。

经中国证监会同意,本基金于2006年6月6日更名为泰达荷银行业精选证券投资基金。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行业精选证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利行业精选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内依法发行上市的股票、债券,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票投资比例为基金资产净值的60%-95%,债券投资比例为基金资产净值的0%-35%,现金投资比例为基金资产净值的5%-30%。在相关法规允许的前提下,股票投资范围最高可以达到基金资产净值的100%。本基金的业绩比较基准为:富时中国A600指数收益率×70%+中债国债总指数(财富)×30%。

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》、《泰达宏利行业精选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2010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年度同。

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年度同。

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年度同。

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年度同。

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年度同。

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	86,586,248.35	84,677,111.41
其中:支付给销售机构的客户维护费	5,035,113.71	4,879,315.40

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。

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	14,431,041.38	14,112,851.95

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0.25%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。

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

本期 2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	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	30,057,889.32	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	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	49,743,128.77	308,161,505.88	-	-	200,000,000.00	13,928.22

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,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

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,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	615,562,742.01	5,713,549.52	513,071,672.72	5,582,766.01

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

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
601377	兴业证券	2010年9月29日	2011年1月13日	新股网下中签	10.00	16.20	755,747	7,557,470.00	12,243,101.40	-
300130	新国都	2010年10月12日	2011年1月20日	新股网下中签	43.33	45.25	24,334	1,054,392.22	1,101,113.50	-
601933	永辉超市	2010年12月9日	2011年3月15日	新股网下中签	23.98	31.24	9,893	237,234.14	309,057.32	-

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,2009年度同。

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
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	12,399,768	237,341,056.20	244,399,427.28	-
600315	上海家化	2010年12月6日	重大事项	37.13	-	-	1,000,000	27,130,760.54	37,130,000.00	-

注:本基金截止2010年12月31日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,经交易所批准后复牌。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款余额。

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款余额。

§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	5,360,871,290.43	88.56
	其中:股票	5,360,871,290.43	88.56
2	固定收益投资	10,446,218.80	0.17
	其中:债券	10,446,218.80	0.17
	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	639,769,633.91	10.57
6	其他各项资产	42,527,744.28	0.70
7	合计	6,053,614,887.42	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	188,525,973.24	3.15
B	采掘业	180,965,473.08	3.03
C	制造业	3,705,193,952.02	62.00
C0	食品、饮料	486,393,958.31	8.14
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	319,967,689.98	5.35
C5	电子	404,897,077.50	6.78
C6	金属、非金属	919,964,852.02	15.39
C7	机械、设备、仪表	1,044,633,084.13	17.48
C8	医药、生物制品	529,337,290.08	8.86
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,359,565.42	0.26
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	46,256,627.50	0.77
H	批发和零售贸易	132,791,310.12	2.22
I	金融、保险业	354,356,054.58	5.93
J	房地产业	452,878,071.11	7.58
K	社会服务业	1,318,352.00	0.02
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	283,225,911.36	4.74
	合计	5,360,871,290.43	89.71

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	002106	莱宝高科	6,111,654	404,897,077.50	6.78
2	600585	海螺水泥	10,088,045	299,413,175.60	5.01
3	000630	铜陵有色	8,172,184	286,435,049.20	4.79
4	002344	海宁皮城	5,160,822	283,225,911.36	4.74
5	000401	冀东水泥	11,753,569	277,736,835.47	4.65
6	002073	软控股份	9,203,299	245,636,050.31	4.11
7	600518	康美药业	12,399,768	244,399,427.28	4.09
8	002158	汉钟精机	6,700,660	241,223,760.00	4.04
9	600031	三一重工	10,999,992	237,929,826.96	3.98
10	601318	中国平安	4,197,545	235,734,127.20	3.94

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	601601	中国太保	507,855,564.52	7.03
2	601318	中国平安	462,909,927.68	6.41
3	600031	三一重工	387,543,171.57	5.37
4	600166	福田汽车	357,296,579.56	4.95
5	600383	金地集团	326,484,329.60	4.52
6	600585	海螺水泥	324,443,560.17	4.49
7	600036	招商银行	319,496,918.86	4.43
8	600256	广汇股份	298,554,682.57	4.14
9	600547	山东黄金	288,119,612.61	3.99
10	000401	冀东水泥	286,948,460.49	3.97
11	000012	南 玻A	262,156,660.49	3.63
12	600887	伊利股份	260,703,961.71	3.61
13	600809	山西汾酒	242,507,278.93	3.36
14	000063	中兴通讯	241,212,330.52	3.34
15	000400	许继电气	240,281,395.24	3.33
16	000630	铜陵有色	238,021,045.86	3.30
17	600518	康美药业	237,341,056.20	3.29
18	601111	中国国航	232,571,659.45	3.22
19	000002	万 科A	227,691,792.26	3.15
20	000338	潍柴动力	226,217,237.04	3.13
21	601699	潞安环能	220,877,116.98	3.06
22	000423	东阿阿胶	219,270,191.27	3.04
23	002073	软控股份	216,400,775.66	3.00
24	600016	民生银行	208,804,968.52	2.89
25	600511	国药股份	207,818,041.22	2.88
26	002344	海宁皮城	206,625,044.68	2.86
27	000651	格力电器	196,685,068.94	2.72
28	600489	中金黄金	193,050,970.40	2.67
29	000069	华侨城A	192,525,840.46	2.67
30	002106	莱宝高科	192,334,329.07	2.66
31	601666	平煤股份	190,031,370.96	2.63
32	000983	西山煤电	188,405,100.59	2.61
33	600481	双良节能	184,756,034.98	2.56
34	000425	徐工机械	184,478,125.72	2.56
35	600570	恒生电子	183,356,822.16	2.54
36	000998	隆平高科	178,299,022.20	2.47
37	600519	贵州茅台	164,659,676.20	2.28
38	600125	铁龙物流	163,914,101.05	2.27
39	600825	新华传媒	162,435,835.17	2.25
40	002304	洋河股份	158,117,859.94	2.19
41	002167	东方锆业	151,378,222.78	2.10
42	600694	大商股份	149,895,917.21	2.08

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	601601	中国太保	577,686,488.01	8.00
2	600166	福田汽车	565,156,884.63	7.83
3	000338	潍柴动力	449,534,106.59	6.23
4	600036	招商银行	433,089,327.47	6.00
5	600016	民生银行	409,488,840.90	5.67
6	601111	中国国航	402,211,983.27	5.57
7	002024	苏宁电器	382,498,044.15	5.30
8	600031	三一重工	371,539,169.02	5.15
9	000651	格力电器	354,104,617.79	4.91
10	000858	五 粮 液	345,240,122.85	4.78
11	601666	平煤股份	343,208,187.20	4.75
12	000983	西山煤电	327,515,141.66	4.54
13	600383	金地集团	317,518,764.13	4.40
14	600547	山东黄金	310,101,605.54	4.30
15	600887	伊利股份	287,429,944.01	3.98
16	600037	歌华有线	281,054,594.88	3.89
17	000568	泸州老窖	279,474,925.36	3.87
18	601318	中国平安	279,316,663.82	3.87
19	601766	中国南车	274,632,456.77	3.80
20	601628	中国人寿	258,113,852.51	3.58
21	600348	国阳新能	256,930,493.25	3.56
22	600019	宝钢股份	238,112,548.39	3.30
23	000069	华侨城A	219,897,175.19	3.05
24	600489	中金黄金	217,854,786.92	3.02
25	000063	中兴通讯	212,934,271.52	2.95
26	000400	许继电气	205,269,798.41	2.84
27	000012	南 玻A	204,781,283.89	2.84
28	000937	冀中能源	204,599,905.89	2.83
29	000538	云南白药	203,910,409.43	2.82
30	600720	祁连山	192,261,508.73	2.66
31	600221	海南航空	188,556,088.17	2.61
32	600048	保利地产	185,371,186.82	2.57
33	000425	徐工机械	184,783,355.87	2.56
34	600425	青松建化	183,114,677.32	2.54
35	600511	国药股份	182,046,109.21	2.52
36	000623	吉林敖东	178,963,062.86	2.48
37	000898	鞍钢股份	177,360,021.46	2.46
38	600315	上海家化	176,902,056.03	2.45
39	600570	恒生电子	168,008,671.74	2.33
40	002029	七 匹 狼	166,372,733.05	2.30
41	002123	荣信股份	165,806,852.01	2.30
42	600694	大商股份	164,463,759.67	2.28
43	600125	铁龙物流	158,721,989.60	2.20
44	000825	太钢不锈	158,355,289.96	2.19
45	000401	冀东水泥	150,142,500.51	2.08
46	000527	美的电器	146,851,160.11	2.03
47	000800	一汽轿车	145,316,188.27	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。

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	17,890,663,558.15
卖出股票收入(成交)总额	19,413,048,376.53

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	10,446,218.80	0.17
7	其他	-	-
8	合计	10,446,218.80	0.17

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	110009	双良转债	81,790	10,446,218.80	0.17

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	5,557,969.21
2	应收证券清算款	35,493,327.56
3	应收股利	-
4	应收利息	229,835.81
5	应收申购款	1,246,611.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,527,744.28

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	10,446,218.80	0.17

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600518	康美药业	244,399,427.28	4.09	配股认购

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
69,607	16,021.26	707,799,668.57	63.47%	407,391,889.54	36.53%

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	163,064.33	0.0146%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2004年7月9日)基金份额总额	2,017,034,173.30
本报告期期初基金份额总额	1,501,555,893.97
本报告期基金总申购份额	652,344,530.33
减:本报告期基金总赎回份额	1,038,708,866.19
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,115,191,558.11

§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14.10万元,该审计机构对本基金已提供审计服务的年限为7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

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	
南京证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	7,137,151,347.91	19.16%	6,043,422.44	19.44%	-
东方证券	1	5,562,005,519.01	14.93%	4,519,174.03	14.54%	-
申银万国	1	3,942,891,819.40	10.58%	3,351,446.06	10.78%	-
国金证券	1	3,409,183,189.69	9.15%	2,769,987.02	8.91%	-
东海证券	1	2,098,296,504.78	5.63%	1,704,879.45	5.49%	-
光大证券	1	1,975,459,356.04	5.30%	1,679,145.14	5.40%	-
财富证券	1	1,943,656,998.81	5.22%	1,579,235.61	5.08%	-
中金公司	1	1,928,627,638.22	5.18%	1,639,320.35	5.27%	-
招商证券	1	1,823,110,689.84	4.89%	1,549,640.02	4.99%	-
中银国际	1	1,517,888,657.79	4.07%	1,290,186.96	4.15%	-
中信建投	2	1,443,085,055.25	3.87%	1,226,617.61	3.95%	-
国泰君安	1	1,394,032,982.33	3.74%	1,184,920.49	3.81%	-
湘财证券	2	1,303,426,727.42	3.50%	1,059,041.89	3.41%	-
银河证券	1	1,064,038,925.95	2.86%	904,433.26	2.91%	-
中信证券	1	712,490,254.52	1.91%	578,902.54	1.86%	-
中信万通	1	-	-	-	-	-

注:(一)2010年本基金撤消中信万通239002席位,新增中信建投390596席位、广发证券21526、390590席位、光大证券24615席位、东海证券390610席位。

(二)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生效后交信息技术部执行。交易席位每个月调整一次,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
南京证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	7,434,810.20	69.97%	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	939,871.70	8.84%	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安	2,251,477.00	21.19%	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-

§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》,本基金的名称也将改为泰达宏利行业精选证券投资基金。

泰达宏利基金管理有限公司
2011年3月29日