

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
送出日期:2011年8月25日

泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

重要提示
基金管理人及董事承诺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。
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8月19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预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。
本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。
本报告自2011年1月1日起至2011年6月30日止。

2.1 基金基本情况
基金名称:泰达宏利中证财富大盘指数
基金代码:162213
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日期: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:529,098,010.65份
基金合同生效日:2010年4月23日

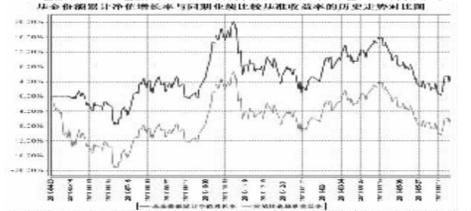
2.2 基金产品说明
投资目标:
本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证财富大盘指数,力求跟踪标的指数的表现,并力争将基金的跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年化跟踪误差率不超过4%。
投资策略:
本基金采用指数完全复制方法,原则上按照标的指数的成分股权重构建基金的投资组合,并随着标的指数成分股及其权重变动进行相应的调整,以达到跟踪和复制标的指数的目的。
业绩比较基准:95%×中证财富大盘指数收益率+5%×同业存款利率

2.3 基金管理人及基金托管人
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

2.4 信息披露方式
基金半年度报告正文的管理人互联网网址: http://www.fundchina.com
基金半年度报告备查地点:基金管理人、基金托管人的住所

3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 2 columns: 会计数据和财务指标, 金额单位:人民币元. Rows include 1.1.1 期间数据和指标, 1.1.2 期末数据和指标, 1.1.3 本期可供分配基金份额利润, 1.1.4 期末基金份额净值, 1.1.5 期末基金资产净值, 1.1.6 期末基金份额净值, 1.1.7 本期基金份额净值增长率, 1.1.8 期末基金份额净值增长率, 1.1.9 本期基金份额净值增长率, 1.1.10 期末基金份额净值增长率, 1.1.11 期末基金份额净值增长率, 1.1.12 期末基金份额净值增长率, 1.1.13 期末基金份额净值增长率, 1.1.14 期末基金份额净值增长率, 1.1.15 期末基金份额净值增长率.



注:本基金于2010年4月23日成立,在组合构建初期及本报告期末本基金的资产净值已达到基金合同约定的各投资比例。

4.1 基金管理人及基金托管人

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
基金经理:王景
基金经理助理:王景

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期. Lists the names and positions of the fund's management team members.

4.2 基金管理人及基金托管人
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

4.3 基金管理人及基金托管人
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

4.4 基金管理人及基金托管人
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

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,由运营部及时与托管行沟通,并出具合理的解释说明,造成会计准备多基金从业经验,在基金核算与估值方面积累了丰富经验和经验,熟悉相关法律法规、政策和估值方法。

6.1 资产负债表
单位:人民币元
项目 2011年6月30日 2010年12月31日
资产:
银行存款 29,170,195.73 24,965,028.75
清算备付金 980,504.91 385,064.71
存出保证金 440,768.28 630,219.46
交易性金融资产 516,932,560.21 589,591,595.75
其中:股票投资 516,888,908.71 589,500,687.15
基金投资 - 1,000,000.00
债券投资 73,651.50 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 7,721.19 23,635.58
应收股利 997,101.03 -
应收申购款 102,786.49 52,310.64
递延所得税资产 - -
其他资产 - -
资产总计 548,631,637.84 622,007,854.89

6.2 利润表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、收入 -1,865,317.35 -46,266,353.68
二、费用 1,291,181.88 211,814.84
三、利润总额 -644,135.47 -46,478,168.52
四、所得税费用 - -
五、净利润 -644,135.47 -46,478,168.52

6.3 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.4 现金流量表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、经营活动产生的现金流量:
销售基金份额收到的现金 29,170,195.73 109,810.35
赎回基金份额支付的现金 -109,810.35 -152,214,192.56
支付赎回费用 -480,986.49 -
支付基金管理费 -29,170,195.73 -
支付基金托管费 -109,810.35 -
支付销售服务费 -226,455.02 -
支付交易费用 -1,914,750.59 -
支付利息 - -
支付股利 - -
支付所得税 - -
其他 - -
经营活动产生的现金流量净额 -29,170,195.73 -152,214,192.56

6.5 利润分配表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、可供分配利润 10,278.64 52,310.64
二、提取法定盈余公积 - -
三、提取任意盈余公积 - -
四、应付股利 997,101.03 -
五、应付利息 7,721.19 23,635.58
六、应付股利 - -
七、应付利息 - -
八、应付股利 - -
九、应付利息 - -
十、应付股利 - -
十一、应付利息 - -
十二、应付股利 - -
十三、应付利息 - -
十四、应付股利 - -
十五、应付利息 - -
十六、应付股利 - -
十七、应付利息 - -
十八、应付股利 - -
十九、应付利息 - -
二十、应付股利 - -
二十一、应付利息 - -
二十二、应付股利 - -
二十三、应付利息 - -
二十四、应付股利 - -
二十五、应付利息 - -
二十六、应付股利 - -
二十七、应付利息 - -
二十八、应付股利 - -
二十九、应付利息 - -
三十、应付股利 - -
三十一、应付利息 - -
三十二、应付股利 - -
三十三、应付利息 - -
三十四、应付股利 - -
三十五、应付利息 - -
三十六、应付股利 - -
三十七、应付利息 - -
三十八、应付股利 - -
三十九、应付利息 - -
四十、应付股利 - -
四十一、应付利息 - -
四十二、应付股利 - -
四十三、应付利息 - -
四十四、应付股利 - -
四十五、应付利息 - -
四十六、应付股利 - -
四十七、应付利息 - -
四十八、应付股利 - -
四十九、应付利息 - -
五十、应付股利 - -
五十一、应付利息 - -
五十二、应付股利 - -
五十三、应付利息 - -
五十四、应付股利 - -
五十五、应付利息 - -
五十六、应付股利 - -
五十七、应付利息 - -
五十八、应付股利 - -
五十九、应付利息 - -
六十、应付股利 - -
六十一、应付利息 - -
六十二、应付股利 - -
六十三、应付利息 - -
六十四、应付股利 - -
六十五、应付利息 - -
六十六、应付股利 - -
六十七、应付利息 - -
六十八、应付股利 - -
六十九、应付利息 - -
七十、应付股利 - -
七十一、应付利息 - -
七十二、应付股利 - -
七十三、应付利息 - -
七十四、应付股利 - -
七十五、应付利息 - -
七十六、应付股利 - -
七十七、应付利息 - -
七十八、应付股利 - -
七十九、应付利息 - -
八十、应付股利 - -
八十一、应付利息 - -
八十二、应付股利 - -
八十三、应付利息 - -
八十四、应付股利 - -
八十五、应付利息 - -
八十六、应付股利 - -
八十七、应付利息 - -
八十八、应付股利 - -
八十九、应付利息 - -
九十、应付股利 - -
九十一、应付利息 - -
九十二、应付股利 - -
九十三、应付利息 - -
九十四、应付股利 - -
九十五、应付利息 - -
九十六、应付股利 - -
九十七、应付利息 - -
九十八、应付股利 - -
九十九、应付利息 - -
一百、应付股利 - -

6.6 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.7 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.8 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.9 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.10 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.11 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.12 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.13 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.14 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.15 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.16 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.17 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.18 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.19 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.20 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.21 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.22 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.23 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.24 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.25 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.26 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.27 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.28 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.29 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.30 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.31 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.32 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.33 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.34 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

6.35 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年4月23日至2010年6月30日
一、所有者权益:
实收基金 529,098,010.65 595,743,595.27
未分配利润 18,272,958.61 618,841,363.23
所有者权益合计 547,370,969.26 618,841,363.23

7.1 期末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
7.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 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(%). Lists the top 5 stocks held by the fund.

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
7.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 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(%). Lists the top 5 bonds held by the fund.

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 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(%). Lists the top 5 derivatives held by the fund.

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 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(%). Lists the top 5 derivatives held by the fund.

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
7.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 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(%). Lists the top 5 derivatives held by the fund.

7.12 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
7.13 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 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(%). Lists the top 5 derivatives held by the fund.

7.14 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
7.15 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 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(%). Lists the top 5 derivatives held by the fund.

7.16 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
7.17 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 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(%). Lists the top 5 derivatives held by the fund.

7.18 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
7.19 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 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(%). Lists the top 5 derivatives held by the fund.

7.20 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
7.21 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细