泰达宏利中证500指数分级证券投资基金之泰达进取与泰达稳健基金份额上市交易公告书

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
注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市时间：2011年12月22日
公告日期：2011年12月19日

一、重要声明与提示

《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金之泰达进取与泰达稳健基金份额上市交易公告书》（以下简称"本公告书"）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称"《基金法》"）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号《上市交易公告书的内容与格式》》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金管理人的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2011年10月20日《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金招募说明书》。本基金招募说明书同时发布在本公司网站（http://www.mfcteda.com）。

二、基金概览

1、基金名称：泰达宏利中证500指数分级证券投资基金

2、基金类型：股票型

3、基金运作方式：契约型开放式

4、本基金的基金份额：本基金的基金份额包括泰达宏利中证500指数分级证券投资基金之基础份额（简称"泰达中证500份额"，场内简称"泰达500"）、泰达宏利中证500指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（简称"泰达稳健"）与泰达宏利中证500指数分级证券投资基金之进取收益类份额（简称"泰达进取"）。其中，泰达稳健份额、泰达进取份额的基金份额配比始终保持4:6的比率不变。

5、本基金的存续期限为不定期。

6、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，投资者场外认购的全部份额将确认为泰达中证500份额；投资者场内认购的全部份额将按照4:6的比率自动分离为预期收益与风险不同的两种份额类别，即泰达稳健份额和泰达进取份额。两类基金份额的基金资产合并运作。

基金合同生效后，泰达中证500份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。泰达稳健份额和泰达进取份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。

7、泰达500的申购与赎回：投资者可通过场外或场内两种方式对泰达500份额进行申购与赎回。泰达500份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。泰达500份额场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。泰达进取与泰达稳健将不接受投资者的申购与赎回。

8、份额配对转换：份额配对转换是指本基金的泰达500份额与泰达进取份额泰达稳健份额之间的配对转换，包括分拆和合并两个方面。分拆指基金份额持有人将其持有的每10份泰达中证500份额的场内份额申请转换成4份泰达稳健份额与6份泰达进取份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每4份泰达稳健份额与6份泰达进取份额申请转换成10份泰达中证500份额的场内份额的行为。份额配对转换业务将于2011年12月22日开始办理。

9、定期折算

在泰达稳健份额、泰达中证500份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日，基金管理人将根据《基金合同》的规定对本基金的泰达稳健份额、泰达500份额进行定期份额折算，对于泰达稳健份额期末的约定应得收益，即泰达稳健份额每个会计年度12月31日份额净值超出本金1.000元部分，将折算为场内泰达500份额分配给泰达稳健份额持有人。泰达500持有人持有的每10份泰达500份额将按4份泰达稳健份额获得新增泰达500份额的分配。

持有场外泰达500份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外泰达500份额的分配；持有场内泰达500份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内泰达500份额的分配。经过上述份额折算，泰达稳健份额和泰达500份额的基金份额净值将相应调整。有关定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

10、不定期折算

当泰达500份额的基金份额净值达到2.000元后，基金管理人将根据《基金合同》的规定对本基金全部份额进行不定期份额折算，份额折算后本基金将确保泰达稳健份额和泰达进取份额的份额数比例为4:6，份额折算后泰达稳健份额、泰达进取份额和泰达500份额的基金份额净值均调整为1.000元。当泰达进取份额的基金份额净值小于或者等于0.250元时，基金管理人将根据《基金合同》的规定对本基金全部份额进行不定期份额折算，份额折算后本基金将确保泰达稳健份额和泰达进取份额的份额数比例为4:6，份额折算后泰达500份额、泰达稳健份额和泰达进取份额的基金份额净值均调整为1.000元。有关不定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

11、基金份额总额：截至2011年12月15日，本基金的基金份额总额为1,435,467,765.48份，其中，泰达500为1,250,153,255.48份，泰达稳健为74,125,804.00份，泰达进取为111,188,706.00份。

12、基金份额净值：截至2011年12月15日，泰达500的基金份额净值为1.000元，泰达进取的基金份额净值为0.998元，泰达稳健的基金份额净值为1.003元。

13、本次上市交易的基金份额简称：泰达进取、泰达稳健。

14、本次上市交易的基金份额总额：泰达进取111,188,706.00份；泰达稳健74,125,804.00份。

15、本次上市交易的基金份额交易代码：泰达稳健为150053；泰达进取为150054。

16、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。

17、上市交易日期：2011年12月22日。

18、基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司。

19、基金托管人：中国银行股份有限公司。

20、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司。

三、基金的募集与上市交易

（一）本次基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会2011年8月24日证监许可【2011】1338号

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同期限：不定期

4、发售日期：2011年10月24日至2011年11月25日

5、发售价格：1.00元人民币

6、份额发售方式：本基金通过场外、场内两种方式公开发售

7、发售机构：

（1）场外销售机构：

1）直销机构：泰达宏利基金管理有限公司

2）场外代销机构：

中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、深圳发展银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、湘财证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司、中银万国证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、中银国际证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、新时代证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、南京证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、金元证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、民生证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、西藏同信证券有限责任公司、西部证券股份有限公司、中山证券有限责任公司、天源证券经纪有限公司、江海证券有限公司、万联证券有限责任公司代销机构营业网点（具体申购赎回安排和网点名单请查阅本基金招募说明书和发售公告以及其他相关的业务公告）。

（2）场内代销机构：

本基金通过场内发售的机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位，具体名单可在深交所网站查询。

8、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

9、募集资金总额及入账情况

本次募集的净认购金额为1,435,113,080.87元人民币，认购资金在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计354,684.61元人民币，按照本基金基金合同和招募说明书的约定，折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金账户。

本次募集有效认购总户数为4,152户，按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，募集期募集资金及利息结转的基金份额共计1,435,467,765.48份。其中本基金管理人基金从业人员认购持有的基金份额总额为990.10份，占本基金总份额的比例为0.0001%。

募集资金已于2011年12月1日划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户。

10、本基金募集备案情况：本基金于2011年12月1日验资完毕，2011年12月1日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2011年12月1日获得书面确认，本基金合同自该日起正式生效。

11、基金合同生效日：2011年12月1日

12、基金合同生效日的基金份额总额：1,435,467,765.48份，其中，泰达稳健的基金份额为74,125,804.00份，泰达进取的基金份额111,188,706.00份。

（二）泰达500的日常申购、赎回情况

泰达500份额的申购、赎回自基金合同生效后不超过3个月的时间内开始办理，基金管理人在开始办理申购赎回的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

（三）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上【2011】379号

2、上市交易日期：2011年12月22日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

4、本次上市的基金份额简称：泰达稳健、泰达进取

5、本次上市的基金份额交易代码：泰达稳健的交易代码150053、泰达进取的交易代码150054

6、本次上市交易份额：泰达稳健的份额为74,125,804.00份，泰达进取的份额为111,188,706.00份（数据截至2011年12月15日）。

7、基金资产净值的披露：基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的泰达中证500份额净值、泰达稳健份额和泰达进取份额各自的基金份额参考净值和基金份额累计净值。

8、本上市交易份额的流通规定：本上市交易的泰达500份额托管在场外，基金份持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后，选择将泰达500分拆为泰达稳健和泰达进取后，方可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至2011年12月15日，泰达稳健场内基金份额持有人户数为1792户，平均每户持有的泰达稳健场内基金份额41,364.85份。泰达进取场内基金份额持有人户数为1792户，平均每户持有的泰达进取场内基金份额62,047.27份。

（二）持有人结构

截至2011年12月15日，基金份额持有情况：机构投资者持有的本次上市交易的泰达稳健与泰达进取的基金份额分别为50,777,072.00份和76,165,606.00份，分别占本次泰达稳健与泰达进取上市交易基金份额比例为68.50%；个人投资者持有的本次上市交易的泰达稳健与泰达进取的基金份额分别为23,348,732.00份和35,023,100.00份，分别占本次泰达稳健与泰达进取上市交易基金份额比例为31.50%。

（三）截至2011年12月15日，本次上市交易的泰达稳健前十名持有人情况

序号	持有人名称（全称）	证券帐户号	持有基金份额	占场内基金份额的比例
1	首钢总公司	0800015118	16,001,778.00	21.59%
2	红塔证券股份有限公司	0899013695	12,000,500.00	16.19%
3	中国银河证券股份有限公司	0899054806	12,000,500.00	16.19%
4	申银万国证券股份有限公司	0899025948	8,000,333.00	10.79%
5	北京淘源科技有限公司	0800107269	1,200,133.00	1.62%
6	吕中	0055852162	1,200,117.00	1.62%
7	上海肯立澳化学有限公司	0800050097	837,312.00	1.13%
8	陈微波	0030878257	400,039.00	0.54%
9	范德胜	0147469014	400,033.00	0.54%
10	黎俊文	0103302529	400,016.00	0.54%
11	中国农业生产资料天津公司	0800170495	400,016.00	0.54%
12	陆引图	0150419945	400,016.00	0.54%
合计			53,240,793.00	71.82%

截至2011年12月15日，本次上市交易的泰达进取前十名持有人情况

序号	持有人名称（全称）	证券帐户号	持有基金份额	占场内基金份额的比例
1	首钢总公司	0800015118	24,002,666.00	21.59%
2	红塔证券股份有限公司	0899013695	18,000,750.00	16.19%
3	中国银河证券股份有限公司	0899054806	18,000,750.00	16.19%
4	申银万国证券股份有限公司	0899025948	12,000,500.00	10.79%
5	北京淘源科技有限公司	0800107269	1,800,200.00	1.62%
6	吕中	0055852162	1,800,174.00	1.62%
7	上海肯立澳化学有限公司	0800050097	1,255,968.00	1.13%
8	陈微波	0030878257	600,058.00	0.54%
9	范德胜	0147469014	600,050.00	0.54%
10	黎俊文	0103302529	600,025.00	0.54%
11	中国农业生产资料天津公司	0800170495	600,025.00	0.54%
12	陆引图	0150419945	600,025.00	0.54%
合计			79,861,191.00	71.82%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、公司概况

名称：泰达宏利基金管理有限公司

成立日期：2002年6月6日

注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

法定代表人：刘惠文

组织形式：有限责任公司

联系电话：010-66577725

联系人：孙运英

注册资本：一亿八千万元人民币

2、股权结构：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%

3、内部组织结构及职能

部门名称	职能定位
投研部门	
基金投资部	负责公募股票类基金产品的投资管理
研究部	负责宏观策略、行业与上市公司研究
专户理财部	负责开展特定客户资产管理业务（专户业务）的资产募集、投资管理及客户服务等相关工作
固定收益部	负责固定收益类基金产品及资产的投资管理
国际投资部	负责国际基金的投资管理与业务合作
交易部	负责执行基金、组合交易指令，实施一线风险监控等
业务发展部	
销售总部	负责制定公司的销售战略、业务发展规划及具体的销售计划、政策和措施并予以组织实施
营销策划部	根据公司长远发展目标，负责制订公司中长期品牌战略和实施规划，高效规范、管理公司品牌形象
客户服务部	以提升客户服务为核心，主导或协助进行客户调查、客户维护等活动
区域业务中心	负责公司销售策略、业务计划在区域内的顺利实施，包括新基金发行、持续营销等活动，以促进公司资产管理规模及营业利润指标得以实现
后台部门	
综合管理部	负责行政管理与后勤保障
财务部	负责公司财务管理工作
人力资源部	负责人力资源管理
监察稽核与法律事务部	负责合规管理及监察稽核控制
风险控制与基金评估部	实施投资风险分析及控制
信息技术部	负责公司信息化建设工作
基金运营部	负责开放式基金和资产管理计划份额的登记存管和资金的清算管理，及开放式基金和资产管理计划的核算及相关信息披露工作
其它部门	
产品与金融工程部	负责产品开发、设计、报批及产品管理工作，满足投研部门关于金融工程与数量化分析的需求

4、人员情况

截至2011年11月30日，我公司共有145名员工，其中博士学位5人、硕士学位70人和学士学位64人。

5、信息披露负责人：孙运英

咨询电话：010-66577725

6、基金管理业务情况

截至2011年10月1日，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、泰达宏利领先中小盘股票型基金、泰达宏利聚利分级债券基金以及泰达宏利全球新格局基金（QDII）十六只证券投资基金。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合。

7、本基金基金经理简介

王咏辉先生，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，现任国际投资部副总经理；2010年4月23日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；2011年7月20日起任泰达宏利全球新格局证券投资基金基金经理；具备13年基金从业经验，具有基金从业资格。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称"中国银行"）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

变更注册登记日期：2004年8月26日

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理：李爱华

托管部门联系人：唐州徽

电话：010-66594855

传真：010-66594942

2、发展概况：

1912年2月，经孙中山先生批准，中国银行正式成立。从1912年至1949年，中国银行先后履行中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能，坚持以服务社会民众、振兴民族金融为己任，稳健经营，锐意进取，各项业务取得了长足发展。新中国成立后，中国银行长期作为国家外汇专业银行，成为我国对外开放的重要窗口和对外筹资的主要渠道。1994年，中国银行改为国有独资商业银行。2003年，中国银行启动股份制改造。2004年8月，中国银行股份有限公司挂牌成立。2006年6月、7月，先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市，成为国内首家在境内外资本市场上发行上市的商业银行。

中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行，在中国内地、香港澳门台湾及31个国家和地区为客户提供金融的金融服务，主要经营商业银行业务，包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务，并通过全资子公司中银国际开展投资银行业务，通过全资子公司中银集团保险及中银保险经营保险业务，通过全资子公司中银集团投资从事直接投资和投资管理业务，通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务，通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。

在近百年的发展历程中，中国银行始终秉承追求卓越的精神、稳健经营的理念、客户至上的宗旨、诚信为本的传统和严谨细致的作风，得到了业界和客户的广泛认可和赞誉，树立了卓越的品牌形象。2010年度，中国银行被被Global Finance（《环球金融》）评为2010年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇交易银行，被Euromoney（《欧洲货币》）评为2010年度房地产业"中国最佳商业银行"，被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖，被The Asset（《财资》）评为中国最佳贸易融资银行，被Finance Asia（《金融亚洲》）评为中国最佳私人银行、中国最佳贸易融资银行，被《21世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇，中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展，向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

（三）上市推荐人

本基金无上市推荐人。

（四）验资机构

法定名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人：杨绍信

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：曹银华、单峰

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在泰达宏利中证500指数分级证券投资基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

泰达宏利中证500指数分级证券投资基金2011年12月15日资产负债表如下：

单位：人民币元

项目	行次	2011年12月15日
资产：		
银行存款	1	80,076,106.60
结算备付金	2	0.00
存出保证金	3	0.00
交易性金融资产	4	0.00
其中：股票投资	5	0.00
债券投资	6	0.00
资产支持证券投资	7	0.00
衍生金融资产	8	0.00
买入返售金融资产	9	1,335,700,000.00
应收证券清算款	10	20,041,353.72
应收利息	11	382,720.63
应收股利	12	0.00
应收申购款	13	0.00
其他资产	14	354,684.61
资产总计	15	1,436,554,865.56
负 债：		
短期借款	16	0.00
交易性金融负债	17	0.00
衍生金融负债	18	0.00
卖出回购金融资产款	19	0.00
应付证券清算款	20	0.00
应付赎回款	21	0.00
应付管理人报酬	22	471,990.95
应付托管费	23	94,398.20
应付销售服务费	24	
应付交易费用	25	0.00
应交税费	26	
应付利息	27	0.00
应付利润	28	
其他负债	29	23,085.67
负债合计	30	589,474.82
所有者权益：		
实收基金	31	1,435,467,765.48
未分配利润	32	497,625.26
所有者权益合计	33	1,435,965,390.74
负债和所有者权益总计	34	1,436,554,865.56

报告截止日2011年12月15日，基金份额净值1.000元，基金份额总额1,435,467,765.48份。

八、基金投资组合

截止到2011年12月15日，泰达宏利中证500指数分级证券投资基金的投资组合如下：

（一）期末基金资产组合情况

序号	资产品种	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	0.00	0.00
	其中：股票	0.00	0.00
2	固定收益投资	0.00	0.00
	其中：债券	0.00	0.00
	资产支持证券	0.00	0.00
3	金融衍生品投资	0.00	0.00
4	买入返售金融资产	1,335,700,000.00	92.98
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
5	银行存款和结算备付金	80,076,106.60	5.57
6	其他资产	20,778,758.96	1.45
7	合计	1,436,554,865.56	100.00

（二）期末按行业分类的股票投资组合

截止到2011年12月15日，本基金未持有股票。

（三）报告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

截止到2011年12月15日，本基金未持有股票。

（四）期末按债券品种分类的债券投资组合

截止到2011年12月15日，本基金未持有债券。

（五）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

截止到2011年12月15日，本基金未持有债券。

（六）期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

截止到2011年12月15日，本基金未持有资产支持证券。

（七）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

截止到2011年12月15日，本基金未持有权证。

（八）投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

2、截至2011年12月15日，本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他资产构成

其他资产明细	金额（元）
交易保证金	0.00
应收证券清算款	20,041,353.72
应收股利	0.00
应收利息	382,720.63
应收申购款	0.00
其他应收款	354,684.61
待摊费用	0.00
其他	0.00
合计	20,778,758.96

4、期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细。

截止到2011年12月15日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

截止到2011年12月15日，本基金未持有股票。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅。

（一）中国证监会核准基金募集的文件

（二）《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金合同》

（三）《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金托管协议》

（四）《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金招募说明书》

（五）法律意见书

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照

泰达宏利基金管理有限公司
2011年12月19日

附件：基金合同的内容摘要

第一章 基金合同当事人及权利义务

（一）基金管理人

1、基金管理人基本情况

名称：泰达宏利基金管理有限公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

法定代表人：刘惠文

成立日期：2002年6月6日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【2002】37号

经营范围：基金管理业务；发起设立基金；及中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.8亿元人民币

存续期间：持续经营

2、基金管理人的权利

（1）依法募集基金，办理基金备案手续；

（2）按照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；

（3）根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

（4）根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；

（5）根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；

（6）在本合同的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

（7）根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

（8）启行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记机构进行必要的监督和检查；

（9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

（10）在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；

（11）依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；

（12）按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；

（13）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

（14）在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

（15）依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

（16）选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

（17）法律法规、基金合同规定的其他权利。

3、基金管理人的义务

（1）依法申请并募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

（2）办理基金备案手续；

（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；

（6）按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

（7）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

（8）进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

（9）依法接受基金托管人的监督；

（10）编制季度、半年度和年度基金报告；

（11）采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

（12）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

（13）严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

（14）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；

（15）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（16）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；

（17）按照《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（18）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

（19）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（20）因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（22）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

（二）基金托管人

1、基金托管人基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称"中国银行"）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

变更注册登记日期：2004年8月26日

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

存续期间：持续经营

经营范围：中国银行业务涵盖商业银行、投资银行和保险三大领域，其中，商业银行业务是中国银行的传统主营业务，包括公司金融业务、个人金融业务及金融市场业务。中国银行提供的公司金融业务包括存款业务、贷款业务、国际结算及贸易融资业务，以及银行汇票、本票、支票、汇兑、银行承兑汇票、委托收款、托收承付、集中支付、支票圈存及票据托管等其他公司金融业务；个人金融业务包括储蓄存款业务、个人贷款业务、个人中间业务、"中银理财"服务、私人银行业务和银行卡业务等；金融市场业务主要包括本外币金融工具的自营与代客业务、本外币各类证券或指数投资业务、债务资本市场业务、代客理财和资产管理业务、金融代理及托管业务等。

2、基金托管人的权利

（1）依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

（2）依照基金合同的约定获得基金托管费；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作；

（4）在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

（5）依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

（6）法律法规、基金合同规定的其他权利。

3、基金托管人的义务

（1）安全保管基金财产；

（2）设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

（3）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

（4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人托管基金财产；

（5）对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；

（6）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（7）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

（8）按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；

（9）保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；

（10）根据法律法规及本合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（11）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（12）保存基金份额持有人名册；

（13）复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

（14）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（15）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

（16）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

（17）按照法律法规监督基金管理人的投资运作；

（18）因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；

（19）因基金管理人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿。除法律法规和本基金合同另有规定外，基金托管人不承担连带责任；

（20）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

（三）基金份额持有人

1、基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。