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:2012年3月26日

泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011年12月31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2012年3月20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2011年1月1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	472,257,522.45份
基金合同存续期	不定期

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,并根据标的指数成分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	曹桢桢	唐州徽
	联系电话	010-66577728	010-66594855
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	tgcxpl@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	2011年	2010年4月23日-2010年12月31日
本期已实现收益	-35,195,852.42	23,639,221.48
本期利润	-103,021,628.06	850,934.50
加权平均基金份额本期利润	-0.1918	0.0013
本期基金份额净值增长率	-18.96%	5.91%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1582	0.0388
期末基金资产净值	397,549,319.85	618,841,363.23
期末基金份额净值	0.842	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。比较指标的实际编制期间为2010年4月23日(基金合同生效日)至2010年12月31日。

3.2 基金净值表现

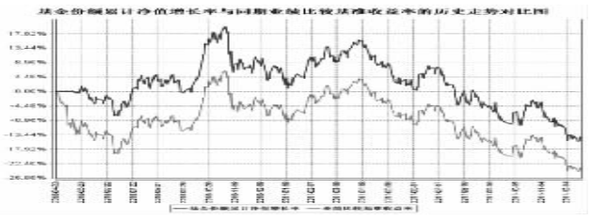
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.39%	1.25%	-5.27%	1.25%	-0.12%	0.00%
过去六个月	-18.65%	1.25%	-18.83%	1.25%	0.18%	0.00%
过去一年	-18.96%	1.20%	-18.87%	1.20%	-0.09%	0.00%
自基金合同生效起至今	-14.17%	1.25%	-23.66%	1.36%	9.49%	-0.11%

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。

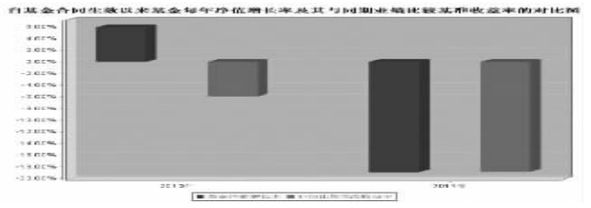
本基金股票资产的跟踪标的指数为中证财富大盘指数。中证财富大盘指数是由中证指数有限公司编制并开发的中国A股市场指数。该指数按照上市公司创造财富能力的大小进行选样,挑选最具创造财富能力的300家A股上市公司作为样本;此外该指数在加权方式上亦有所创新,不同于一般的市值加权指数,该指数样本个股的权重配置将与其创造财富能力的大小相适应,从而打破市值指数中价格与权重过于紧密的联系,预防个股权重由于价格的非理性波动而大起大落,提高了个股权重配置的稳定性。指数的表现综合反映了中国经济增长过程中核心企业真实的财富增长情况。

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:本基金在建仓结束时及本报告期末本基金的投资比例已达到基金合同规定的各项投资比例。

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。

3.3 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
2011	-	-	-	-	
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。2010年的利润分配情况实际编制期间为2010年4月23日(基金合同生效日)至2010年12月31日。

§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、泰达宏利领先中小盘股票型基金、泰达宏利聚利分级债券型基金、泰达宏利全球新格局基金(QDII-FOF)、泰达宏利中证500指数分级基金在内的十七只证券投资基金。

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	-	14	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;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;2011年12月1日起任泰达宏利中证500指数分级基金基金经理;具备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

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2011年基本上呈震荡下跌的走势,同时CPI在季节性规律和政府的主动调控政策下出现了放缓。2011年全年引发市场分化下跌的主要因素有几个方面,一是通胀见顶后政策放松没有到预期,二是国内经济大幅下滑的预期加强,三是欧洲债务危机引发的金融危机。

本基金在2011年利用深度的数量化研究和跟踪误差准确控制能力,同时通过有效的主动式数量化投资技术增加了表现不错的股票配置权重。

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0.842元,本报告期份额净值增长率为-18.96%,同期业绩比较基准增长率为-18.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

无论是从宏观经济指标还是政策的进度看,当前的宏观运行以及相关指标非常接近于08年7,8月份,处于一系列严厉紧缩政策的调控效果充分释放期,但是还没有出现可能导致政策显著逆转的冲击性事件,政策还处于调控效果的观察期。未来宏观政策是否明显转变取决于几个大的不确定性因素:

1.外部会不会出现希腊违约这种类似雷曼倒闭这样的信用事件;

2.房地产市场是否可能出现急跌式的明显调整,导致投资增速显著下滑;

3.外贸增长回落。目前比较一致的看法是明年出口增长15%,如果外部恶化,可能触发政策转换。

总体看,目前政策的总体基调是以政策平稳为主,与美国、德国和法国等主要经济面临的挑战一样,在政府换届之前如果没有大幅内部或外部冲击,一般不会出现大幅政策刺激和调整。

欧洲债务危机是国内外金融市场最近关心的问题,目前来看,欧洲问题的前景已经明朗,决定因素超出了经济范畴。对于欧洲来讲,需要平衡两个矛盾:

第一,通过进一步的统一财政联盟来解决统一的货币政策与不统一的财政政策的结合之间的矛盾,但是欧洲富国的财富必须转移支付给欧洲穷国;

第二,剔除欧洲穷国欧元区缩小,但是具体运作时,存在政治和成本上的难度。

总之,解决办法无外乎有一种:短期1-6个月通过IMF或ECB维持欧洲国债收益率,长期1-2年逐步实现统一财政联盟,并且整个欧元区的EURUSD贬值,从而实现欧洲穷国可以依靠出口拉动经济复苏。

财富大盘指数是中国市场的价值风向标。投资策略方面,短期较为看好大盘股、低价股、低估值和高红利的股票,以创业板为代表的高估值品种面临较大的回归压力,扩容节奏的加快,尤其是新三板的推出将加速创业板泡沫的破灭。大盘蓝筹股风险释放充分,将对稳定市场发挥一定作用。调整充分的房地产股也存在估值修复的机会。

在具体行业配置上,我认为今年行业配置的重要性显著提高,重点配置行业:1.随着通胀见顶、政策担忧减缓,逐步加仓低估值和周期的金融、地产、水泥等板块;2.继续看好银行、煤炭、建筑建材、工程机械等先进制造业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定,设有估值委员会,并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的副总经理负责,成员包括督察长、投资总监、基金经理及研究部、交易部、固定收益部、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,均具有丰富的专业工作经历,具备良好的专业经验和专业胜任能力。

基金经理参与估值委员会对相关停牌品种估值的讨论,发表相关意见和建议,但涉及停牌品种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,一切以投资者利益最大化为最高准则。

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,本基金于本报告期内未进行利润分配,目前无其他收益分配安排。

§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2011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:2011年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资 产:		
银行存款	21,626,092.81	24,905,028.75
结算备付金	136,974.45	6,805,064.71
存出保证金	299,850.47	630,219.46
交易性金融资产	376,385,573.24	589,591,595.75
其中:股票投资	376,385,573.24	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	186,048.81	-
应收利息	4,312.43	23,635.58
应收股利	-	-
应收申购款	31,155.56	52,310.64
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	398,670,007.77	622,007,854.89
负债和所有者权益	本期末 2011年12月31日	上年度末 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	16,443.20	172,681.62
应付管理人报酬	223,637.44	366,352.31
应付托管费	41,286.92	67,634.29
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	175,329.42	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	663,990.94	645,072.85
负债合计	1,120,687.92	3,166,491.66
所有者权益:		
实收基金	472,257,522.45	595,743,595.27
未分配利润	-74,708,202.60	23,097,767.96
所有者权益合计	397,549,319.85	618,841,363.23
负债和所有者权益总计	398,670,007.77	622,007,854.89

注:报告截止日2011年12月31日,基金份额净值0.842元,基金份额总额472,257,522.45份。

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:2011年1月1日至2011年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年4月23日至2010年12月31日
一、收入	-96,211,812.63	11,542,955.70
1.利息收入	235,956.99	1,533,394.28
其中:存款利息收入	235,167.09	695,499.20
债券利息收入	789.90	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)	-29,037,812.91	30,917,794.90
其中:股票投资收益	-36,677,254.01	25,165,574.94
基金投资收益	-	-
债券投资收益	30,074.39	51,039.05
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	7,609,366.71	5,701,180.91
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-67,825,775.64	-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)	415,818.93	1,880,053.50
二、费用	6,809,815.43	10,692,021.20
1.管理人报酬	3,489,893.88	2,950,781.13
2.托管费	644,288.14	544,759.61
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	2,149,938.58	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	525,694.83	423,168.82
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-103,021,628.06	850,934.50
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-103,021,628.06	850,934.50

注:比较财务报表的比较期间为2010年4月23日(基金合同生效日)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:2011年1月1日至2011年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011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)	595,743,595.27	23,097,767.96	618,841,363.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-103,021,628.06	-103,021,628.06
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)	-123,486,072.82	5,215,657.50	-118,270,415.32
其中:1.基金申购款	242,231,750.19	8,334,121.12	250,565,871.31
2.基金赎回款	-365,717,823.01	-3,118,463.62	-368,836,286.63
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)	472,257,522.45	-74,708,202.60	397,549,319.85
项目	上年度可比期间 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,本基金的投资目标是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%;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2012年3月26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2011年12月31日的财务状况以及2011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》、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)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

注: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(2010年同)。

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联交易单元进行的债券交易(2010年同)。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联交易单元进行的债券回购交易(2010年同)。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联交易单元进行的权证交易(2010年同)。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金(2010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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 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	3,489,893.88	2,950,781.13
其中:支付销售机构的客户维护费	188,214.39	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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 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	644,288.14	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

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)的交易(2010年同)。

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

本基金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(2010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

本基金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(2010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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年4月23日至2010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	21,626,092.81	220,199.91	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

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况(2010年同)。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项(2010年同)。

7.4.9 期末(2011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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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
600820	隧道股份	2011年12月27日	并购重组审核	7.87	2012年1月4日	8.15	56,493	620,097.51	444,599.91	-
000768	西飞国际	2011年12月28日	并购重组审核	7.26	2012年1月4日	7.61	45,217	527,702.17	328,275.42	-
600963	岳阳林纸	2011年12月27日	重大事项公告	4.68	2012年1月4日	4.92	50,844	497,521.16	237,949.92	-

注:本基金截至2011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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

§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	376,385,573.24	94.41
	其中:股票	376,385,573.24	94.41
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	21,763,067.26	5.46
6	其他各项资产	521,367.27	0.13
7	合计	398,670,007.77	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采掘业	34,031,032.15	8.56
C	制造业	85,930,683.61	21.62
C0	食品、饮料	9,944,993.67	2.50
C1	纺织、服装、皮毛	2,920,241.37	0.73
C2	木材、家具	241,684.00	0.06
C3	造纸、印刷	1,537,054.99	0.39
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,094,344.04	1.03
C5	电子	2,276,545.85	0.57
C6	金属、非金属	24,934,048.55	6.27
C7	机械、设备、仪表	32,702,344.63	8.23
C8	医药、生物制品	6,729,551.25	1.69
C99	其他制造业	549,875.26	0.14
D	电力、煤气及水的生产和供应业	16,370,817.41	4.12
E	建筑业	11,641,749.53	2.93
F	交通运输、仓储业	19,439,210.52	4.89
G	信息技术业	12,565,963.28	3.16
H	批发和零售贸易	7,416,194.27	1.87
I	金融、保险业	152,320,100.65	38.31
J	房地产业	26,244,735.17	6.60
K	社会服务业	3,197,811.08	0.80
L	传播与文化产业	367,883.57	0.09
M	综合类	3,901,914.20	0.98
	合计	373,428,095.44	93.93

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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	2,438,451.00	0.61
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	1,135,430.85	0.29
C5	电子	76,510.00	0.02
C6	金属、非金属	362,444.00	0.09
C7	机械、设备、仪表	230,818.00	0.06
C8	医药、生物制品	633,248.15	0.16
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	70,040.00	0.02
G	信息技术业	265,376.80	0.07
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	183,610.00	0.05
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,957,477.80	0.74