

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8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。本半年度报告已经单独独立董事签字同意,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8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等,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。  
本半年度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。  
本报告期自2012年1月1日起至2012年6月30日止。

**§2 基金简介**

2.1 基金基本情况

基金名称	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	289,439,959.86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,力争取得与标的指数相似的投资收益,并力争将基金的非系统风险度控制在0.5%以内,年化跟踪误差率不超过4%。
投资策略	本基金采用指数复制法,跟踪中证财富大盘指数的成份股及其权重变动进行相应的调整,以达到跟踪和复制指数的目的。但如遇特殊情形(如停牌、流动性不足、成分股被限制等等)致使基金无法得到足够数量的股票时,基金管理人将根据其他合理的方法进行适当替代,以期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	本基金为股票指数型基金,属于中高风险、高收益的基金品种,其预期风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币型基金。

2.3 基金管理人及基金托管人

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
姓名	曹伟松	唐国俊
信息披露负责人	联系电话: 010-66577228 电子邮箱: ir@mfchina.com	010-66594855 tqg@bocbank.com
客户服务电话	400-69-8888	95566
传真	010-66577228	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.mfchina.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2012年1月1日至2012年6月30日)
本期已实现收益	-42,652,972.56
本期利润	23,295,208.62
加权平均基金份额本期利润	0.0530
本期基金份额净值增长率	4.28%
3.1.2 期末基金份额净值	1.0530
期末可供分配利润	-35,433,499.50
期末可供分配基金份额利润	0.878
期末基金份额净值	1.0530

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.对期末可供分配利润,采用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孰数。

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	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	③-④
过去一个月	-4.36%	0.96%	-5.76%	0.95%
过去三个月	0.23%	0.97%	-1.05%	0.98%
过去六个月	4.28%	1.14%	2.82%	1.14%
过去一年	-15.17%	1.29%	-16.55%	1.38%
自基金合同生效起至今	-10.59%	1.23%	-21.51%	1.31%

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办的中国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择,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,该指数将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,削弱个股权重由于价格的非理性波动而引起大落,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净值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:本基金于2010年4月23日成立,在建仓期结束时及本报告期末本基金的持仓比例已达到基金合同规定的各项投资比例。

§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,湘财高银基金管理有限公司,泰达宏利基金管理有限公司,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证券投资基金、泰达宏利策略精选债券型证券投资基金、泰达宏利全球领先趋势证券投资基金、泰达宏利中证500指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金在内的十八只证券投资基金。

4.1.2 基金经理 魏基金理小组及基金经理助理简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业资格	说明
王华群	本基金基金经理、金融工程组组长	2010年4月23日	-	14	美国圣地亚哥大学工程和管理专业,硕士学历,曾担任伦敦教育集团 IP Morgan 投资集团资产管理公司分析师,高级分析师,汇丰投资管理公司 QIBIC 高级分析师,巴克美国投资管理公司,巴克 ETP 策略经理,巴克资本公司 (Bancap Capital) 经理,2008年4月加入泰达宏利基金管理有限公司,先后担任金融工程组组长、基金经理、国际投资部副总经理,2010年4月起担任泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金经理,具备14年基金从业经验,具有基金从业资格。

注:证券从业资格遵照《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》的相关规定。  
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,在本基金管理人管理、本基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券投资行为、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,本基金没有发生违反法律法规的行为,也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份额持有人利益的关联交易,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资产,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的机会;严格执行投资管理程序和交易执行流程的隔离;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;交易员运用交易系统设置的公平交易功能并按时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令;对于部分债券一级市场申购,非公开发行业务申购等以公司名义进行的交易,交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配,确保各投资组合享有公平的投资机会。  
风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数据统计、分析。在本报告期内,没有发生利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明  
本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的跟踪,风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估,向公司风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。在本报告期内,本基金管理人旗下所有投资组合的同日反向交易较少的单边交易均不超过该证券当日成交量的5%,在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

4.4 报告期内本基金投资情况的回顾分析  
A股市场上半年呈现先扬后抑态势,从板块上来看,一季度涨幅较大的周期行业在二季度出现大幅下跌,而另一方面,以食品饮料、医药为代表的业绩确定性较强的成长行业有一定涨幅。不同板块间产生较大差异反映出投资者对于未来经济预期的不确定性。一方面国内经济显现出一定困难,上半年GDP同比低于8%,另一方面,CPI持续下行政策刺激提供了一定空

# 泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

## 2012 半年度 报告摘要

2012年6月30日

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,其中认购资金及利息折合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、权证及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其中投资于股票资产的比例不低于基金资产的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8月29日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础  
本基金的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]8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6.4.4所列的中国证监会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明  
本基金2012年度上半年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2012年6月30日的财务状况以及2012年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明  
6.4.5.1 会计政策变更的说明  
本基金本报告期无会计政策的变更。  
6.4.5.2 会计估计变更的说明  
本基金本报告期无会计估计的变更。  
6.4.5.3 差错更正的说明  
本基金本报告期无重大会计差错发生。

6.4.6 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》及其他相关税收法规和实务操作,主要税项列示如下:  
① 以发行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收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、红利时暂按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定扣缴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。  
6.4.7 关联方关系  
6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况  
本基金本报告期没有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。  
6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称 与本本基金的关系  
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

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。  
6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联交易  
6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易  
6.4.8.1.1 股票交易  
本基金本报告期无通过关联方进行的股票交易(2011年上半年期间)。  
6.4.8.1.2 债券交易  
本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券交易(2011年上半年期间)。  
6.4.8.1.3 债券回购交易  
本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券回购交易(2011年上半年期间)。  
6.4.8.1.4 支付关联方款项  
本基金本报告期无应付关联方的佣金(2011年上半年期间)。  
6.4.8.2 关联方报酬  
6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,325,552.39	1,833,354.03
其中:支付销售机构的客户维护费	91,974.28	100,844.60

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 X 0.65% / 当年天数。  
6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	244,717.27	338,465.39

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 X 0.12% / 当年天数。  
6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
本基金本报告期无与关联方进行的银行间同业市场债券(含回购)交易(2011年上半年期间)。  
6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况  
6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况(2011年上半年期间)。  
6.4.8.4.2 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(2011年年末期间)。  
6.4.8.5 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 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
中国银行	17,362,728.77	29,170,195.73

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。  
6.4.8.6 本基金在承销期间参与与关联方承销证券的情况  
本基金本报告期无在承销期间参与与关联方承销证券的情况(2011年上半年期间)。  
6.4.8.7 其他关联交易事项的说明  
本基金本报告期无其他关联交易事项的说明(2011年上半年期间)。  
6.4.9 期末持有待处理的非流动资产  
6.4.9.1 因认购未缴款而发行证券于期末持有的流通受限证券  
本基金本报告期末无因认购未缴款而于期末持有的流通受限证券。  
6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票  
本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。  
6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券  
6.4.9.3.1 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。  
6.4.9.3.2 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。  
6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项  
本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7.1 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	240,028,597.64	92.83
	其中:股票	240,028,597.64	92.83
2	固定收益投资	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	17,362,728.77	6.71
6	其他各项资产	1,188,751.72	0.46
7	合计	258,580,078.13	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	-	-
B	采矿业	19,589,501.32	7.71
C	制造业	6,587,016.90	2.59
C1	纺织服装、鞋帽	-	0.00
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	7,300,043.46	0.29
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,608,871.37	0.63
C5	电子	1,214,683.04	0.48
C6	金属、非金属	15,605,129.07	6.14
C7	机械、设备、仪表	3,915,668.80	1.54
C8	医药、生物制品	21,492,242.91	8.46
C9	其他制造业	667,226.52	0.26
D	电力、煤气及水的生产和供应业	10,640,723.46	4.19
E	建筑业	8,633,633.74	3.40
F	交通运输、仓储业	12,215,212.75	4.81
G	信息技术业	4,241,238.03	1.73
H	批发和零售业	6,984,437.51	2.96
I	金融业	100,116,509.14	39.41
J	房地产业	19,489,498.62	7.81
K	社会服务业	2,414,274.04	0.95
L	传播与文化业	-	-
M	综合类	1,817,597.87	0.72
合计		240,028,597.64	94.50

7.2.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

项目	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1. 权益投资	240,028,597.64	92.83
2. 固定收益投资	-	-
3. 金融衍生品投资	-	-
4. 买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
5. 银行存款和结算备付金合计	17,362,728.77	6.71
6. 其他各项资产	1,188,751.72	0.46
7. 合计	258,580,078.13	100.00

7.2.3 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

项目	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1. 权益投资	240,028,597.64	92.83
2. 固定收益投资	-	-
3. 金融衍生品投资	-	-
4. 买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
5. 银行存款和结算备付金合计	17,362,728.77	6.71
6. 其他各项资产	1,188,751.72	0.46
7. 合计	258,580,078.13	100.00

7.2.4 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

项目	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1. 权益投资	240,028,597.64	92.83
2. 固定收益投资	-	-
3. 金融衍生品投资	-	-
4. 买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
5. 银行存款和结算备付金合计	17,362,728.77	6.71
6. 其他各项资产	1,188,751.72	0.46
7. 合计	258,580,078.13	100.00

7.2.5 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

项目	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1. 权益投资	240,028,597.64	92.83
2. 固定收益投资	-	-
3. 金融衍生品投资	-	-
4. 买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
5. 银行存款和结算备付金合计	17,362,728.77	6.71
6. 其他各项资产	1,188,751.72	0.46
7. 合计	258,580,078.13	100.00

7.2.6 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

项目	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1. 权益投资	240,028,597.64	92.83
2. 固定收益投资	-	-
3. 金融衍生品投资	-	-
4. 买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
5. 银行存款和结算备付金合计	17,362,728.77	6.71
6. 其他各项资产	1,188,751.72	0.46
7. 合计	258,580,078.13	100.00

7.2.7 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

项目	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1. 权益投资	240,028,597.64	92.83
2. 固定收益投资	-	-
3. 金融衍生品投资	-	-
4. 买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
5. 银行存款和结算备付金合计	17,362,728.77	6.71
6. 其他各项资产	1,188,751.72	0.46
7. 合计	258,580,078.13	100.00

7.2.8 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

项目	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1. 权益投资	240,028,597.64	92.83
2. 固定收益投资	-	-
3. 金融衍生品投资	-	-
4. 买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
5. 银行存款和结算备付金合计	17,362,728.77	6.71
6. 其他各项资产	1,188,751.72	0.46
7. 合计	258,580,078	