泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014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
送出日期:2015 年 3 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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 2015 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(特殊普通合伙)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 2014 年 1 月 1 日起至 2014 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	126,131,285.68 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,并根据标的指数成份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	陈沛	王永民
	联系电话	010-66577808	010-66594896
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	fcid@bankofchina.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	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	25,621,705.79	18,342,490.97	-75,745,386.59
本期利润	71,348,784.16	-14,797,704.91	43,304,871.66
加权平均基金份额本期利润	0.4156	-0.0590	0.1185
本期基金份额净值增长率	64.15%	-7.57%	10.57%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.0365	-0.1767	-0.2277
期末基金资产净值	178,159,018.86	188,812,553.78	311,214,202.73
期末基金份额净值	1.4125	0.8605	0.9310

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

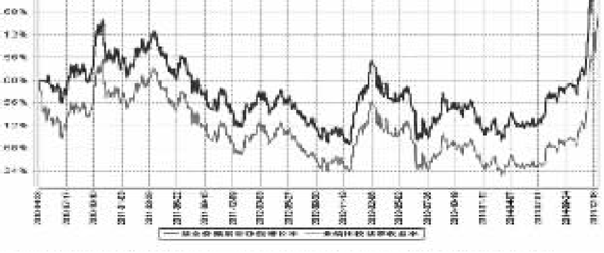
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	47.04%	1.70%	52.05%	1.80%	-5.01%	-0.10%
过去六个月	67.24%	1.34%	69.43%	1.42%	-2.19%	-0.08%
过去一年	64.15%	1.20%	61.20%	1.24%	2.95%	-0.04%
过去三年	67.76%	1.26%	59.39%	1.26%	8.37%	0.00%
自基金合同生效起至今	43.98%	1.26%	21.68%	1.30%	22.30%	-0.04%

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。

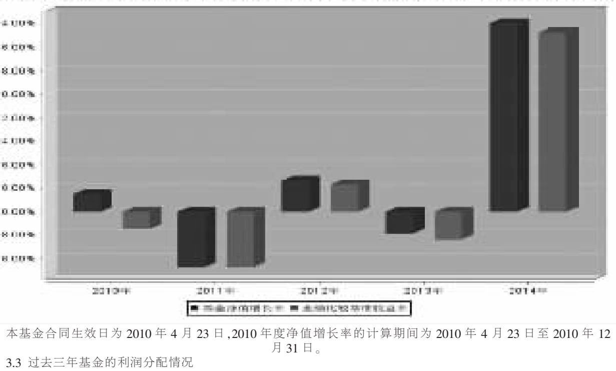
本基金股票资产的跟踪标的指数为中证财富大盘指数。中证财富大盘指数是由中证指数有限公司编制并开发的中国 A 股市场指数。该指数按照上市公司创造财富能力的大小进行选样,挑选最具创造财富能力的 300 家 A 股上市公司作为样本;此外该指数在加权方式上亦有所创新,不同于一般的市值加权指数,该指数样本个股的权重配置将与其创造财富能力的大小相适应,从而打破市值指数中价格与权重过于紧密的联系,预防个股权重由于价格的非理性波动而大起大落,提高了个股权重配置的稳定性。指数的表现综合反映了中国经济增长过程中核心企业真实的财富增长情况。

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



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



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

根据本基金合同及基金实际运作的情况,本基金近三年未进行利润分配。目前无其他收益分配安排。

§ 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证券投资基金、泰达宏利行业精选证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场证券投资基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选股票型证券投资基金、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋股票型证券投资基金、泰达宏利中证财富大盘指数型证券投资基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金、泰达宏利全球新格局证券投资基金、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、泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型基金、泰达宏利养老收益混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金在内的二十多只证券投资基金。

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		
刘欣	本基金基金经理	2012年 8 月 14 日	-	8	理学硕士;2007 年 7 月至 2008 年 12 月就职于工银瑞信基金管理有限公司;2008 年 12 月至 2011 年 7 月就职于嘉实基金管理有限公司;2011 年 7 月加盟泰达宏利基金管理有限公司,担任产品与金融工程部高级研究员。具备 8 年基金从业经验,8 年证券投资管理经验,具有基金从业资格。
杨超	本基金基金经理	2014年 10 月 13 日	-	5	杨超先生毕业于英国威尔士斯旺西大学,数学与金融计算硕士。2010 年 5 月加入建信基金管理有限公司,从事金融工程等工作,先后担任投资管理部助理研究员、初级研究员、基金经理助理等职务。2014 年 6 月加入泰达宏利基金管理有限公司,担任基金经理助理一职。

1.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公告中披露的决定日期。

2. 基金管理人已于 2014 年 10 月 14 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》。杨超先生自 2014 年 10 月 13 日起担任本基金基金经理。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人建立了公平交易制度和内部控制流程,严格执行相关制度规定。在投资管理活动中,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;在交易环节实行集中交易制度,交易部运用交易系统中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,确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易,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。

基金管理人的风险管理部定期对基金管理人管理的不同投资组合的收益率差异进行分析, 对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3 日内、5 日内)基金管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析,并经公司管理层审核签署后存档备查。基金管理人的监察稽核部定期对公平交易制度的执行和控制工作进行稽核。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人的风险管理部事后从交易指令的公平性、同日反向交易、不同窗口下的同向交易溢价率和风格相似的基金的业绩等方面,对报告期内的公平交易执行情况进行统计分析。本报告期内,交易指令多为指令下达人管理的多只资产组合同时下发, 未发现明显的非公平交易指令; 基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易;场外交易的交易价格与市场价格一致,场内交易的溢价率在剔除交易时间差异、交易数量悬殊、市场波动剧烈等因素后,处于正常范围之内;基金管理人管理的各投资组合的业绩由于投资策略、管理风格、业绩基准等方面的因素而有所不同。

本报告期内,本基金管理人管理的各投资组合之间未发现利益输送或不公平对待不同组合的情况。

4.3.3 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、事中和事后的监控,风险管理部对可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控, 对异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析,定期对各投资组合的交易行为进行整体分析评估,定期向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。如发现疑似异常交易情况, 相关投资组合经理对该交易情况进行合理性解释。监察稽核部定期对异常交易制度的执行和控制工作进行稽核。

在本报告期内, 本基金管理人管理的所有投资组合的同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该证券当日成交量的 5%,没有发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为,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 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

2014 年度,宏观经济增速持续下行压力增大,中国经济正在全面向新常态转变,房地产行业在 2014 年行业增速明显下滑,其带动的相关产业和投资增速面临持续下滑的风险,经济增长的速度质量和模式在 2014 年度不断推进演变。流动性方面,2014 年整体较为宽松,权重股全年表现不俗,特别是央行在 4 季度的降低准备金操作,全面引爆了金融板块的行情。全年来看,基于经济转型的内在诉求,"一带一路""自贸区"等概念主题持续发酵,贯穿了全年行情。

本基金严格遵守基金合同,积极应对成份股调整,申购赎回等实际运作过程中的对指数跟踪效果带来的冲击因素,积极复制指数,有效控制了跟踪误差。

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 1.4125 元,本报告期份额净值增长率为 64.15%,同期业绩比较基准增长率为 61.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2015 年中国经济,中国房地产行业作为带动和贯穿中国经济的权重行业增速已经度过了拐点,中国经济迫切需要转变经济增长模式,未来经济增速从高增速回落将成为大概率事件,同时经济去杠杆将延续 2014 年的持续态势,M2 中债务占比依然较高,流动性方面可能仍将持续宽裕,无风险收益率将持续下性,但是企业融资成本依然在结构层面存在错配,传统行业的增长模式将面临增速持续下降的风险,而新兴行业伴随着巨大的发展空间,其业绩确认模式证伪的过程将在 2015 年不断价值发现。同时,政策方面,国企改革,新三版,注册制的不断推进,将给 A 股内在的估值结构带来深刻变化。

本基金作为指数基金,仍将积极应对成份股变化,申购赎回所带来的冲击,力争有效地控制跟踪误差。

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、研究部、固定收益部、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。

本报告期内,本基金管理人参与估值流程各方之间不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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议, 由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

自 2014 年 8 月 8 日至本报告期末,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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")在对泰达宏利中证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 2014 年年度报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)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:2014 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年 12 月 31 日	上年度末 2013年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	13,850,226.51	9,634,336.25
结算备付金	542,730.33	273,829.63
存出保证金	16,064.62	41,174.50
交易性金融资产	168,477,158.34	179,235,818.26
其中:股票投资	168,477,158.34	179,235,818.26
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	207,626.25
应收利息	3,061.45	2,165.35
应收股利	-	-
应收申购款	1,564,094.60	49,969.33
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	184,453,335.85	189,444,919.57
负债和所有者权益	本期末 2014年 12 月 31 日	上年度末 2013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	4,879,222.20	-
应付赎回款	884,448.25	22,248.78
应付管理人报酬	75,808.03	107,038.76
应付托管费	13,995.33	19,761.00
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	370,336.15	113,181.26
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	70,507.03	370,135.99
负债合计	6,294,316.99	632,365.79
所有者权益:		
实收基金	126,131,285.68	219,422,435.01
未分配利润	52,027,733.18	-30,609,881.23
所有者权益合计	178,159,018.86	188,812,553.78
负债和所有者权益总计	184,453,335.85	189,444,919.57

注:报告截止日 2014 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.4125 元,基金份额总额 126,131,285.68 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:2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
一、收入	74,272,177.56	-11,340,293.04
1.利息收入	69,140.77	93,957.99
其中:存款利息收入	69,134.98	93,952.62
债券利息收入	5.79	5.37
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	28,380,592.37	21,495,821.61
其中:股票投资收益	23,813,610.68	15,261,840.85
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,986.21	4,700.59
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	4,561,995.48	6,229,280.17
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	45,727,078.37	-33,140,195.88
4. 汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	95,366.05	210,123.24
减:二、费用	2,923,393.40	3,457,411.87
1.管理人报酬	1,014,249.67	1,494,185.26
2.托管费	187,246.12	275,849.58
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,306,080.98	1,257,882.66
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	415,816.63	429,494.37
三、利润总额 (亏损总额以"-"号填列)	71,348,784.16	-14,797,704.91
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	71,348,784.16	-14,797,704.91

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:2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 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)	219,422,435.01	-30,609,881.23	188,812,553.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	71,348,784.16	71,348,784.16
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)	-93,291,149.33	11,288,830.25	-82,002,319.08
其中:1.基金申购款	121,908,924.07	11,416,238.87	133,325,162.94
2.基金赎回款	-215,200,073.40	-127,408.62	-215,327,482.02
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)	126,131,285.68	52,027,733.18	178,159,018.86
项目	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 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)	334,305,692.76	-23,091,490.03	311,214,202.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-14,797,704.91	-14,797,704.91
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)	-114,883,257.75	7,279,313.71	-107,603,944.04
其中:1.基金申购款	72,623,337.38	-4,900,726.62	67,722,610.76
2.基金赎回款	-187,506,595.13	12,180,040.33	-175,326,554.80
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)	219,422,435.01	-30,609,881.23	188,812,553.78

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:

______ 刘青山 ______ ______ 傅国庆 ______ ____ 王泉 ____
基金管理人负责人 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 2015 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《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

本基金 2014 年度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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 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

财政部于 2014 年颁布 《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外,其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。本基金本报告期无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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,014,249.67	1,494,185.26
其中:支付销售机构的客户维护费	147,746.29	168,435.57

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 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	187,246.12	275,849.58

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)的交易。

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

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

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 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 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	13,850,226.51	62,582.02	9,634,336.25	87,003.87

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2014 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
600428	中远航运	2014年 12 月 22 日	重大事项	8.00	2015年 1 月 8 日	8.30	50,900	295,263.90	407,200.00	-
600761	安徽合力	2014年 12 月 26 日	重大事项	15.65	2015年 1 月 6 日	16.60	4,899	45,744.00	76,669.35	-
000811	烟台冰轮	2014年 8 月 21 日	重大事项	12.00	2015年 1 月 7 日	13.20	4	44.89	48.00	-

注:本基金截至 2014 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	168,477,158.34	91.34
	其中:股票	168,477,158.34	91.34
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	14,392,956.84	7.80
7	其他各项资产	1,583,220.67	0.86
8	合计	184,453,335.85	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末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	采矿业	6,670,443.15	3.74
C	制造业	28,630,099.92	16.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,691,103.00	4.88
E	建筑业	13,210,765.96	7.42
F	批发和零售业	2,281,288.76	1.28
G	交通运输、仓储和邮政业	5,078,536.49	2.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,844,835.20	1.60
J	金融业	76,592,783.12	42.99
K	房地产业	13,440,517.10	7.54
L	租赁和商务服务业	289,696.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	301,446.85	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	571,464.52	0.32
	合计	158,602,980.07	89.02

8.2.2 期末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	594,674.00	0.33
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,649,742.80	2.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,108,942.50	0.62
F	批发和零售业	955,776.00	0.54
G	交通运输、仓储和邮政业	1,416,571.75	0.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	202,448.00	0.11
J	金融业	53,433.00	0.03
K	房地产业	356,022.00	0.20
L	租赁和商务服务业	125,684.24	0.07
M	科学研究和技术服务业	259,989.00	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	150,894.98	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	9,874,178.27	5.54

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

8.3.1 期末指数投资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	600036	招商银行	526,057	8,727,285.63	4.90
2	600016	民生银行	800,850	8,713,248.00	4.89
3	600000	浦发银行	499,442	7,836,244.98	4.40
4	601166	兴业银行	450,351	7,430,791.50	4.17
5	601318	中国平安	79,623	5,948,634.33	3.34
6	000002	万 科A	328,952	4,572,432.80	2.57
7	601169	北京银行	369,938	4,043,422.34	2.27
8	601668	中国建筑	541,367	3,941,151.76	2.21
9	601328	交通银行	553,248	3,762,086.40	2.11
10	601398	工商银行	691,413	3,367,181.31	1.89

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。

8.3.2 期末积极投资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

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	000683	远兴能源	183,200	908,672.00	0.51
2	002051	中工国际	29,300	800,476.00	0.45
3	601233	桐昆股份	53,100	562,860.00	0.32
4	002299	圣农发展	35,900	454,135.00	0.25
5	601880	大连港	91,000	419,510.00	0.24

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	601166	兴业银行	8,620,892.00	4.57
2	600036	招商银行	5,496,610.80	2.91
3	000002	万 科A	5,244,660.75	2.78
4	000709	河北钢铁	5,025,009.60	2.66
5	601939	建设银行	4,968,112.32	2.63
6	601169	北京银行	4,676,216.98	2.48
7	000540	中天城投	4,512,453.40	2.39
8	600900	长江电力	4,373,680.50	2.32
9	601318	中国平安	3,818,670.00	2.02
10	600000	浦发银行	3,807,023.61	2.02
11	601398	工商银行	3,549,076.84	1.88
12	601288	农业银行	3,465,813.00	1.84
13	601818	光大银行	3,457,439.48	1.83
14	601668	中国建筑	3,433,854.00	1.82
15	601601	中国太保	3,390,216.90	1.80
16	601390	中国中铁	3,376,271.73	1.79
17	600050	中国联通	3,033,909.00	1.61
18	000550	江铃汽车	3,007,575.06	1.59
19	000776	广发证券	3,005,206.00	1.59
20	600015	华夏银行	2,999,977.00	1.59

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	601166	兴业银行	12,115,640.59	6.42
2	600036	招商银行	11,287,541.85	5.98
3	600000	浦发银行	7,836,617.99	4.15
4	601668	中国建筑	7,763,537.10	4.11
5	601088	中国神华	7,304,903.02	3.87
6	600016	民生银行	7,106,700.90	3.76
7	601288	农业银行	6,968,843.10	3.69
8	601328	交通银行	6,334,844.64	3.36
9	000001	平安银行	5,358,522.81	2.84
10	000540	中天城投	5,345,039.83	2.83
11	601318	中国平安	4,910,448.32	2.60
12	601000	唐山港	4,891,959.08	2.59
13	000002	万 科A	4,697,912.41	2.49
14	000709	河北钢铁	4,666,808.46	2.47
15	600050	中国联通	3,956,547.82	2.10
16	601169	北京银行	3,955,715.71	2.10
17	000776	广发证券	3,771,076.36	2.00
18	600048	保利地产	3,659,750.98	1.94
19	600015	华夏银行	3,645,609.08	1.93
20	000625	长安汽车	3,604,434.77	1.91

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	372,035,853.35
卖出股票收入(成交)总额	452,335,202.32

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在报告期内,本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

在报告期内,本基金未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	16,064.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,061.45
5	应收申购款	1,564,094.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,583,220.67

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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
4,362	28,915.93	29,170,774.49	23.13%	96,960,511.19	76.87%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	38,439.97	0.0305%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2010 年 4 月 23 日)基金份额总额	1,165,158,636.81
本报告期期初基金份额总额	219,422,435.01
本报告期基金总申购份额	121,908,924.07
减:本报告期基金总赎回份额	215,200,073.40
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	126,131,285.68

§ 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、本基金管理人于 2014 年 6 月 17 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于董事长及法定代表人变更的公告》,公司董事长及法定代表人变更为弓劲梅女士。

2、2014 年 6 月 20 日,经本基金管理人股东会批准,本基金管理人独立董事由孔晓艳女士变更为杜英华女士。本变更事项已按规定向监管部门报备。

3、2014 年 2 月 14 日,本基金托管人发布公告,自 2014 年 2 月 13 日起,陈四清先生担任中国银行行长。

4、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期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

本报告期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(特殊普通合伙)审计费用为 6 万元,该审计机构对本基金已提供审计服务的年限为 5 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

报告期内,基金管理人、本基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

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	
东方证券	2	394,264,037.97	47.85%	358,947.54	47.85%	-
中信证券	2	189,135,109.63	22.95%	172,192.20	22.95%	-
中银国际	2	136,368,513.42	16.55%	124,150.19	16.55%	-
广发证券	2	80,620,832.48	9.78%	73,397.63	9.78%	-
天源证券	1	15,442,464.18	1.87%	14,058.78	1.87%	-
银河证券	2	6,602,207.54	0.80%	6,012.62	0.80%	-
国金证券	1	1,600,680.94	0.19%	1,457.39	0.19%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注:1、2014 年本基金撤销中航证券交易单元,无新增交易单元。

2、交易单元选择的标准和程序

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单元,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。

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
东方证券	28,992.00	100.00%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

泰达宏利基金管理有限公司
2015 年 3 月 27 日