泰达宏利中证500指数分级证券投资基金

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500指数分级		
场内简称	泰达500		
基金主代码	162216		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011年12月1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	63,994,374.25份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2011-12-20		
下属分级基金的基金简称	泰达稳健	泰达进取	泰达宏利500指数分级
下属分级基金的场内简称	泰达稳健	泰达进取	泰达500
下属分级基金的交易代码	150053	150054	162216
报告期末下属分级基金份额总额	10,142,828.00份	15,214,242.00份	38,637,304.25份

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500指数,力争获取与标的指数相似的投资收益,并将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。		
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,以实现对跟踪误差的有效控制。		
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准:95%×中证500指数收益率+5%×1年期定期存款利率(税后)		
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。		
下属分级基金的风险收益特征	泰达稳健份额具有低风险、收益相对稳定的特征	泰达进取份额具有高风险、高预期收益的特征	–

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	8,202,255.07	7,113,653.74	3,133,290.16
本期利润	6,333,196.82	6,450,715.14	9,020,564.64
加权平均基金份额本期利润	0.3153	0.2214	0.0888
本期基金份额净值增长率	32.25%	14.55%	–1.40%
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	0.4384	0.1035	–0.0341
期末基金资产净值	88,594,754.62	18,403,113.01	58,594,887.91
期末基金份额净值	1.3844	1.0728	0.9640

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。

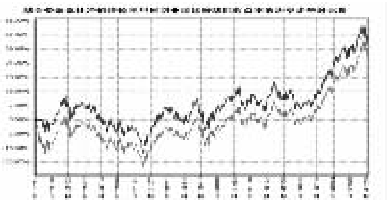
3.2 基金净值表现

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

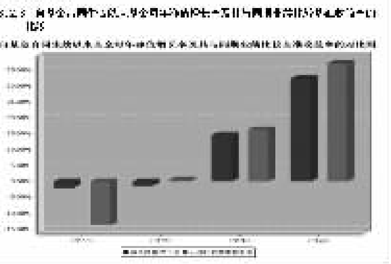
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	5.50%	1.30%	7.91%	1.37%	–2.41%	–0.07%
过去六个月	31.21%	1.11%	33.72%	1.16%	–2.51%	–0.05%
过去一年	32.25%	1.15%	37.06%	1.18%	–4.81%	–0.03%
过去三年	49.38%	1.32%	60.30%	1.34%	–10.92%	–0.02%
自基金合同生效起至今	46.39%	1.31%	38.20%	1.35%	8.19%	–0.04%

本基金的业绩比较基准:中证500指数收益率*95%+1年期定期存款利率*5%。

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



[illegible]



本基金合同生效日为2011年12月1日,2011年度净值增长率的计算期间为2011年12月1日至2011年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据本基金合同的约定,在存续期内,本基金(包括中证500、泰达稳健、泰达进取)不进行收益分配。

§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	清华大学数学科学系毕业,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任定量分析师;2008年12月至2011年7月就职于嘉实基金管理有限公司任定量分析师;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;2012年8月14日起人泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金经理,具备8年基金从业经验,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。

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相关法律法规以及基金合同的约定,本基金运作整体合法合规,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

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,中证500成分股所代表的中国转型经济持续走高,虽然四季度央行降息后市场转向权重股,但是全年依然涨幅巨大,此轮牛市中,经济的实际基本面数据已经成为了一个被投资者所忽略的因素,在经济增速转型和业绩兑现的基本面改善尚未得到确认的情况下,改革成果的乐观预期给予了中证500极大的估值溢价,配合流动性的持续宽松和相关主题概念的持续反复发酵,投资者情绪的转折导致指数表现抢眼。

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

截至报告期末,本基金份额净值为1.3844元,本报告期份额净值增长率为32.25%,同期业绩比较基准增长率为37.06%。

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,将是中国经济是否能够开始实质的结构转型的关键一年,整个宏观层面也面临较大的挑战和机遇。新型产业和互联网经济是否能够在部分国有企业、产能过剩行业的企业以及小微企业将面临盈利能力下滑幅度超过其承受能力的冲击下对冲市场的估值下滑,走出结构性的行情。部分成长股能否在2015年度兑现2014年市场所给予的估值溢价。同时,传统投资是否存在短期下滑幅度加大的风险存在不确定性,消费的持续疲软、去杠杆和去产能的进一步实施,以及输入性通货紧缩的压力进一步强化,不仅将导致2015年GDP增速的回落,同时使中国整体性通货紧缩的压力加大,海外美国经济的复苏势头也将成为影响人民币汇率和出口表现的变量。

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。

基金经理参与估值流程中停牌品种估值的讨论,发表相关意见和建议,但涉及停牌品种的估值,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

根据本基金合同的约定,在存续期内,本基金(包括中证500、泰达稳健、泰达进取)不进行收益分配。

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

1、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的情形。

2、自2014年8月8日至本报告期末,本基金资产净值连续二十个工作日但不满六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元;截至报告期末,本基金已实现资产净值高于五千万元。

§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500指数分级证券投资基金(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500指数分级证券投资基金
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	4,050,698.78	1,305,600.19
结算备付金	719,074.03	26,699.51
存出保证金	37,186.43	7,126.80
交易性金融资产	83,977,251.16	17,465,136.93
其中:股票投资	83,977,251.16	17,465,136.93
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	210,740.56	–
应收利息	1,302.68	255.55
应收股利	–	–
应收申购款	19,862.24	1,383.40
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	89,016,115.88	18,806,202.38
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	–	30.72
应付赎回款	1,921.98	–
应付管理人报酬	73,722.92	15,906.96
应付托管费	14,744.57	3,181.40
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	262,402.24	16,987.89
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	68,569.55	366,982.40
负债合计	421,361.26	403,089.37
所有者权益:		
实收基金	60,539,775.99	16,627,896.86
未分配利润	28,054,978.63	1,775,216.15
所有者权益合计	88,594,754.62	18,403,113.01
负债和所有者权益总计	89,016,115.88	18,806,202.38

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.3844元,基金份额总额63,994,374.25份,其中下属泰达中证500份额38,637,304.25份,泰达稳健份额10,142,828.00份,泰达进取份额15,214,242.00份。下属泰达中证500份额净值1.3844元,泰达稳健份额净值1.0650元,泰达进取份额净值1.5973元。

7.2 利润表

会计主体:泰达宏利中证500指数分级证券投资基金
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	7,379,326.63	7,537,395.01
1.利息收入	15,393.72	13,931.30
其中:存款利息收入	15,387.72	13,931.30
债券利息收入	6.00	–
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)	9,158,388.77	8,079,158.07
其中:股票投资收益	9,005,048.25	7,807,874.99
基金投资收益	–	–
债券投资收益	2,786.36	–
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	150,554.16	271,283.08
3.公允价值变动收益(损失以"–"号填列)	–1,869,058.25	–662,938.60
4. 汇兑收益(损失以"–"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"–"号填列)	74,602.39	107,244.24
减:二、费用	1,046,129.81	1,086,679.87
1. 管理人报酬	240,795.55	300,287.81
2. 托管费	48,159.14	60,057.60
3. 销售服务费	–	–
4. 交易费用	482,547.52	271,323.72
5. 利息支出	–	–
其中:卖出回购金融资产支出	–	–
6. 其他费用	274,627.60	455,010.74
三、利润总额(亏损总额以"–"号填列)	6,333,196.82	6,450,715.14
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"–"号填列)	6,333,196.82	6,450,715.14

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰达宏利中证500指数分级证券投资基金
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		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计	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)	16,627,896.86	1,775,216.15	18,403,113.01	60,670,066.58	–2,075,178.67	58,594,887.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	6,333,196.82	6,333,196.82	–	6,450,715.14	6,450,715.14
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)	43,911,879.13	19,946,565.66	63,858,444.79	–44,042,169.72	–2,600,320.32	–46,642,490.04
其中:1.基金申购款	93,250,575.25	40,033,110.27	133,283,685.52	29,080,035.18	2,305,845.74	31,385,880.92
2.基金赎回款	–49,338,696.12	–20,086,544.61	–69,425,240.73	–73,122,204.90	–4,906,166.06	–78,028,370.96
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)	60,539,775.99	28,054,978.63	88,594,754.62	16,627,896.86	1,775,216.15	18,403,113.01

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500指数分级证券投资基金(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[2011]第1338号《关于核准泰达宏利中证500指数分级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500指数分级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1,435,113,080.87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(2011)第466号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金合同》于2011年12月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,435,467,765.48份基金份额,其中认购资金利息折合354,684.61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《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金合同》和《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,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")、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"泰达稳健份额")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"泰达进取份额")。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。本基金发售结束后,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。泰达中证500份额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。本基金在每个工作日按基金合同约定的净值计算规则对泰达稳健份额和泰达进取份额分别进行参考净值计算,本基金净资产优先确保泰达稳健份额的本金及泰达稳健份额累计约定日应得收益;本基金在优先确保泰达稳健份额的本金及累计约定日应得收益后的剩余净资产计为泰达进取份额的净资产。

经深圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上[2011]第379号文审核同意,本基金泰达稳健份额74,125,804.00份,泰达进取份额111,188,706.00份,于2011年12月22日在深交所挂牌交易。未上市交易的泰达中证500份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后,选择将泰达中证500份额分拆为泰达稳健份额和泰达进取份额后即可上市流通。

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,本基金将根据基金合同的规定进行基金的定期份额折算。在基金份额折算前与折算后,泰达稳健份额和泰达进取份额的份额配比保持4:6的比例。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日份额参考净值超出1.0000元部分,将折算为泰达中证500份额的场内份额分配给泰达稳健份额持有人。除以上定期份额折算外,本基金还将在以下两种情况进行不定期份额折算,即:当泰达中证500份额净值大于或等于2.0000元;当泰达进取份额的基金份额参考净值小于或等于0.2500元。当泰达中证500份额的基金份额净值大于或等于2.0000元后,本基金将分别对泰达稳健份额、泰达进取份额和泰达中证500份额进行份额折算,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比例为4:6,份额折算后泰达稳健份额和泰达进取份额的参考净值以及泰达中证500份额的基金份额净值均调整为1.0000元。当泰达进取份额的基金份额参考净值小于或等于0.2500元后,本基金将分别对泰达稳健份额、泰达进取份额和泰达中证500份额进行份额折算,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比例为4:6,份额折算后泰达中证500份额净值、泰达稳健份额和泰达进取份额的基金份额参考净值均调整为1.0000元。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定,本金的投资目标是紧密跟踪中证500指数,力争获取与标的指数相似的投资收益。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成份股、备选成份股、新股、固定收益产品、货币市场工具、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为85%-100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%,投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:95%×中证500指数收益率+5%×1年期定期存款利率(税后)。

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03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500指数分级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、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	240,795.55	300,287.81
其中:支付销售机构的客户维护费	51,057.02	90,531.29

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1.00%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×1.00%/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	48,159.14	60,057.60

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0.20%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×0.20%/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	4,050,698.78	12,301.28	1,305,600.19	12,557.22

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	138,100	793,811.89	1,104,800.00	–
000977	浪潮信息	2014年12月22日	重大事项	41.18	2015年1月19日	45.30	17,300	665,031.90	712,414.00	–
300168	万达信息	2014年12月31日	重大事项	46.20	2015年1月8日	44.50	13,800	626,506.00	637,560.00	–
000612	焦作万方	2014年12月29日	重大事项	10.10	2015年1月16日	10.20	40,900	390,585.19	413,090.00	–
000616	亿城投资	2014年12月1日	重大事项	4.77	–	–	77,600	319,928.23	370,152.00	–
600759	洲际油气	2014年12月24日	重大事项	9.90	–	–	35,603	396,818.89	352,469.70	–
002437	誉衡药业	2014年11月21日	重大事项	23.75	2015年1月26日	26.13	13,876	331,756.39	329,555.00	–
600490	鹏欣资源	2014年12月24日	重大事项	10.79	2015年1月12日	11.87	29,800	382,674.30	321,542.00	–
000426	兴业矿业	2014年12月11日	重大事项	11.95	2015年3月25日	13.15	25,702	282,474.36	307,138.90	–
601519	大智慧	2014年7月21日	重大事项	5.98	2015年1月23日	6.58	11,255	80,322.70	67,304.90	–
002396	星网锐捷	2014年10月20日	重大事项	27.31	2015年2月9日	30.04	1,970	34,288.22	53,800.70	–
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	800	8,916.00	9,600.00	–

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	83,977,251.16	94.34
	其中:股票	83,977,251.16	94.34
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	4,769,772.81	5.36
7	其他各项资产	269,091.91	0.30
8	合计	89,016,115.88	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	1,013,265.00	1.14
B	采矿业	2,135,250.23	2.41
C	制造业	44,273,148.84	49.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,245,610.00	1.41
E	建筑业	2,533,662.72	2.86
F	批发和零售业	3,548,257.55	4.01
G	交通运输、仓储和邮政业	3,254,997.00	3.67
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,111,329.75	5.77
J	金融业	2,936,058.00	3.31
K	房地产业	7,264,502.21	8.20
L	租赁和商务服务业	2,425,046.00	2.74
M	科学研究和技术服务业	157,989.00	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	559,191.36	0.63
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	566,398.21	0.64
S	综合	–	–
	合计	77,024,705.87	86.94

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	72,041.00	0.08
B	采矿业	–	–
C	制造业	4,252,156.29	4.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,087,736.00	1.23
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	184,509.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	70,233.00	0.08
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	764,515.00	0.86
J	金融业	521,355.00	0.59
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
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	6,952,545.29	7.85

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	600376	首开股份	141,788	1,429,223.04	1.61
2	601012	隆基股份	63,273	1,318,609.32	1.49
3	601099	太平洋	90,300	1,284,066.00	1.45
4	600266	北京城建	50,700	1,199,562.00	1.35
5	600835	上海机电	59,053	1,107,834.28	1.25
6	600138	中青旅	67,300	1,107,758.00	1.25
7	600428	中远航运	138,100	1,104,800.00	1.25
8	002244	滨江集团	133,900	1,076,556.00	1.22
9	002191	劲嘉股份	78,200	1,072,122.00	1.21
10	600037	歌华有线	72,000	1,043,280.00	1.18

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	002601	佰利联	43,100	907,255.00	1.02
2	000683	远兴能源	121,500	602,640.00	0.68
3	600674	川投能源	24,000	497,520.00	0.56
4	600886	国投电力	40,400	462,176.00	0.52
5	600594	益佰制药	12,700	423,799.00	0.48

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	000050	深天马A	2,007,492.00	10.91
2	600266	北京城建	1,956,380.79	10.63
3	002191	劲嘉股份	1,644,032.86	8.93
4	600298	安琪酵母	1,633,707.96	8.88
5	601012	隆基股份	1,623,796.75	8.82
6	002595	豪迈科技	1,591,723.07	8.65
7	600835	上海机电	1,555,070.00	8.45
8	002237	恒邦股份	1,542,007.64	8.38
9	601099	太平洋	1,482,044.00	8.05
10	000540	中天城投	1,406,254.00	7.64
11	600488	天药股份	1,385,908.50	7.53
12	600351	亚宝药业	1,383,253.00	7.52
13	600038	哈飞股份	1,368,339.00	7.44
14	601233	桐昆股份	1,353,222.19	7.35
15	600858	银座股份	1,336,658.25	7.26
16	002299	圣农发展	1,326,900.00	7.21
17	600438	通威股份	1,313,374.76	7.14
18	000951	中国重汽	1,303,703.71	7.08
19	600201	金宇集团	1,286,013.28	6.99
20	600460	士兰微	1,251,067.00	6.80
21	600162	香江控股	1,249,463.40	6.79
22	600037	歌华有线	1,240,383.26	6.74
23	601101	昊华能源	1,240,183.36	6.74
24	600496	精工钢构	1,239,058.00	6.73
25	002317	众生药业	1,237,621.04	6.73
26	601208	东材科技	1,236,435.37	6.72
27	002601	佰利联	1,226,497.21	6.66
28	600138	中青旅	1,218,032.04	6.62
29	002273	水晶光电	1,205,870.00	6.55
30	600439	瑞贝卡	1,190,173.00	6.47
31	002183	怡 亚 通	1,176,729.00	6.39
32	600648	外高桥	1,167,946.75	6.35
33	000566	海南海药	1,131,583.24	6.15
34	000511	烯碳新材	1,130,444.00	6.14
35	601880	大连港	1,114,377.00	6.06
36	600428	中远航运	1,110,731.86	6.04
37	600376	首开股份	1,101,472.72	5.99
38	600551	时代出版	1,090,368.84	5.92
39	002551	尚荣医疗	1,081,286.13	5.88
40	002244	滨江集团	1,081,066.00	5.87
41	600879	航天电子	1,079,610.00	5.87
42	002345	潮宏基	1,078,739.00	5.86
43	002262	恩华药业	1,063,010.76	5.78
44	600409	三友化工	1,048,344.18	5.70
45	600398	海澜之家	1,045,760.56	5.68
46	002091	江苏国泰	1,026,472.69	5.58
47	600869	智慧能源	1,024,623.90	5.57
48	000712	锦龙股份	1,017,802.00	5.53
49	600006	东风汽车	1,016,046.00	5.52
50	002028	思源电气	1,007,609.69	5.48
51	002155	辰州矿业	1,006,226.41	5.47
52	002181	粤 传 媒	995,744.77	5.41
53	000685	中山公用	984,450.30	5.35
54	600645	中源协和	983,536.62	5.34
55	600290	华仪电气	978,953.49	5.32
56	600335	国机汽车	973,791.74	5.29
57	002048	宁波华翔	973,456.06	5.29
58	002408	齐翔腾达	972,210.48	5.28
59	000862	银星能源	968,321.75	5.26
60	300147	香雪制药	963,922.00	5.24
61	000650	仁和药业	960,531.46	5.22
62	000671	阳 光 城	945,189.48	5.14
63	600491	龙元建设	944,469.11	5.13
64	000997	新 大 陆	930,484.04	5.06
65	600611	大众交通	930,325.66	5.06
66	002342	巨力索具	929,230.00	5.05
67	600770	综艺股份	925,198.88	5.03
68	600787	中储股份	911,698.00	4.95
69	002190	成飞集成	899,482.26	4.89
70	002233	塔牌集团	895,035.72	4.86
71	002690	美亚光电	888,185.63	4.83
72	600683	京投银泰	882,980.01	4.80
73	000933	神火股份	877,022.60	4.77
74	600325	华发股份	874,239.00	4.75
75	002444	巨星科技	861,418.64	4.68
76	600601	方正科技	860,318.09	4.67
77	002092	中泰化学	853,380.00	4.64
78	002574	明牌珠宝	847,543.40	4.61
79	000541	佛山照明	844,041.41	4.59
80	002646	青青稞酒	819,355.72	4.45
81	300113	顺网科技	815,358.81	4.43
82	002327	富安娜	810,306.00	4.40
83	600056	中国医药	807,103.00	4.39
84	000049	德赛电池	801,737.60	4.36
85	000550	江铃汽车	792,490.27	4.31
86	000977	浪潮信息	788,918.91	4.29
87	000877	天山股份	786,140.00	4.27
88	600720	祁连山	786,076.00	4.27
89	300207	欣旺达	781,482.95	4.25
90	600545	新疆城建	778,669.00	4.23
91	000510	金路集团	778,663.80	4.23
92	002437	誉衡药业	774,661.07	4.21
93	601011	宝泰隆	772,660.10	4.20
94	601777	力帆股份	770,409.45	4.19
95	002063	远光软件	770,019.00	4.18
96	600776	东方通信	769,614.57	4.18
97	600141	兴发集团	768,200.00	4.17
98	600582	天地科技	767,813.76	4.17
99	600820	隧道股份	766,486.00	4.16
100	002557	洽洽食品	766,087.86	4.16
101	600536	中国软件	760,870.39	4.13
102	603366	日出东方	760,158.63	4.13
103	600765	中航重机	759,625.00	4.13
104	002573	国电清新	755,625.00	4.11
105	600482	风帆股份	747,495.99	4.06
106	000887	中鼎股份	746,591.64	4.06
107	600851	海欣股份	741,956.99	4.03
108	600563	法拉电子	735,996.42	4.00
109	300059	东方财富	730,796.00	3.97
110	600261	阳光照明	730,166.50	3.97
111	000931	中 关 村	725,000.18	3.94
112	600176	中国玻纤	722,277.00	3.92
113	600640	号百控股	721,541.00	3.92
114	600790	轻纺城	721,350.00	3.92
115	002311	海大集团	717,807.51	3.90
116	002254	泰和新材	715,772.98	3.89
117	000919	金陵药业	715,394.00	3.89
118	000886	海南高速	713,901.00	3.88
119	002461	珠江啤酒	713,791.18	3.88
120	601000	唐山港	710,630.00	3.86
121	600329	中新药业	699,612.00	3.80
122	600816	安信信托	695,480.00	3.78
123	600844	丹化科技	695,067.68	3.78
124	601678	滨化股份	686,269.89	3.73
125	000703	恒逸石化	683,221.57	3.71
126	002635	安洁科技	682,555.47	3.71
127	300134	大富科技	682,346.00	3.71
128	600780	通宝能源	676,071.00	3.67
129	000693	华泽钴镍	675,888.04	3.67
130	002194	武汉凡谷	674,672.12	3.67
131	002293	罗莱家纺	674,376.28	3.66
132	000683	远兴能源	672,070.00	3.65
133	000655	金岭矿业	669,805.96	3.64
134	600993	马应龙	665,895.58	3.62
135	000002	万 科A	665,209.39	3.61
136	601010	文峰股份	664,226.50	3.61
137	000631	顺发恒业	663,382.11	3.60
138	002277	友阿股份	661,123.00	3.59
139	002405	四维图新	660,245.10	3.59
140	600557	康缘药业	659,007.43	3.58
141	002490	山东墨龙	658,829.98	3.58
142	603328	依顿电子	649,982.00	3.53
143	600759	洲际油气	642,050.72	3.49
144	002004	华邦颖泰	637,297.71	3.46
145	000823	超声电子	627,034.00	3.41
146	300168	万达信息	626,506.00	3.40
147	000860	顺鑫农业	623,784.00	3.39
148	600894	广日股份	619,440.19	3.37
149	002008	大族激光	612,331.00	3.33
150	600999	招商证券	610,063.00	3.31
151	000826	桑德环境	607,108.66	3.30
152	600570	恒生电子	604,300.00	3.28
153	002508	老板电器	598,931.26	3.25
154	000780	平庄能源	598,172.62	3.25
155	002153	石基信息	596,730.85	3.24
156	002572	索菲亚	595,172.27	3.23
157	600970	中材国际	589,161.00	3.20
158	600432	吉恩镍业	589,137.00	3.20
159	002390	信邦制药	579,123.00	3.15
160	600755	厦门国贸	573,874.86	3.12
161	300229	拓尔思	573,367.60	3.12
162	002567	唐人神	571,881.00	3.11
163	000060	中金岭南	566,643.98	3.08
164	000426	兴业矿业	565,701.07	3.07
165	002204	大连重工	560,012.62	3.04
166	600673	东阳光科	559,174.00	3.04
167	600596	古井贡酒	555,626.00	3.02
168	600872	中炬高新	544,152.00	2.96
169	600312	平高电气	532,221.00	2.89
170	600643	爱建股份	529,111.00	2.88
171	600533	栖霞建设	522,747.22	2.84
172	000559	万向钱潮	512,173.00	2.78
173	600528	中铁二局	508,269.00	2.76
174	002407	多氟多	506,599.00	2.75
175	000612	焦作万方	504,844.00	2.74
176	600850	华东电脑	500,420.00	2.72
177	600815	厦工股份	494,278.00	2.69
178	600425	青松建化	492,159.00	2.67
179	600674	川投能源	480,770.67	2.61
180	002029	七 匹 狼	480,403.00	2.61
181	601908	京运通	479,476.60	2.61
182	000063	中兴通讯	472,859.00	2.57
183	600600	青岛啤酒	471,658.11	2.56
184	600158	中体产业	468,055.63	2.54
185	600587	新华医疗	460,643.18	2.50
186	600187	国中水务	459,707.00	2.50
187	002022	科华生物	458,797.00	2.49
188	600183	生益科技	451,153.64	2.45
189	002219	恒康医疗	448,615.40	2.44
190	600594	益佰制药	444,328.00	2.41
191	600073	上海梅林	443,338.00	2.41
192	002073	软控股份	431,932.00	2.35
193	600823	世茂股份	418,791.00	2.28
194	002275	桂林三金	414,406.66	2.25
195	002049	同方国芯	400,038.00	2.17
196	600490	鹏欣资源	398,084.00	2.16
197	600888	新疆众和	390,183.00	2.12
198	600639	浦东金桥	379,788.99	2.06

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	000540	中天城投	1,621,447.47	8.81
2	000951	中国重汽	1,528,907.88	8.31
3	600858	银座股份	1,509,017.34	8.20
4	000050	深天马A	1,399,435.79	7.60
5	600038	哈飞股份	1,325,231.79	7.20
6	600491	龙元建设	1,134,176.71	6.16
7	600879	航天电子	1,116,681.13	6.07
8	601000	唐山港	1,093,302.12	5.94
9	600648	外高桥	1,083,121.84	5.89
10	600398	海澜之家	1,074,607.83	5.84
11	600266	北京城建	1,072,776.00	5.83
12	000650	仁和药业	1,060,585.54	5.76
13	600999	招商证券	1,058,894.98	5.75
14	002262	恩华药业	1,048,365.57	5.70
15	600720	祁连山	1,046,666.04	5.69
16	600683	京投银泰	1,010,205.14	5.49
17	600290	华仪电气	980,473.89	5.33
18	600056	中国医药	972,771.97	5.29
19	002092	中泰化学	969,209.67	5.27
20	600325	华发股份	938,456.10	5.10
21	002233	塔牌集团	935,222.28	5.08
22	002028	思源电气	928,667.69	5.05
23	600645	中源协和	917,145.48	4.98
24	600438	通威股份	897,016.51	4.87
25	000931	中 关 村	855,924.81	4.65
26	600409	三友化工	851,967.12	4.63
27	600787	中储股份	850,459.69	4.62
28	600570	恒生电子	844,139.74	4.59
29	600582	天地科技	831,613.14	4.52
30	002155	辰州矿业	825,600.00	4.49
31	601233	桐昆股份	818,509.08	4.45
32	600298	安琪酵母	805,237.47	4.38
33	000860	顺鑫农业	801,884.08	4.36
34	600563	法拉电子	791,563.30	4.30
35	600006	东风汽车	775,485.72	4.21
36	600201	金宇集团	768,556.92	4.18
37	600482	风帆股份	759,435.40	4.13
38	601678	滨化股份	758,619.26	4.12
39	600790	轻纺城	757,897.04	4.12
40	600780	通宝能源	756,156.46	4.11
41	000631	顺发恒业	746,408.83	4.06
42	600536	中国软件	742,706.72	4.04
43	000510	金路集团	741,445.62	4.03
44	000693	华泽钴镍	741,423.72	4.03
45	000826	桑德环境	738,369.13	4.01
46	601777	力帆股份	734,252.75	3.99
47	000550	江铃汽车	731,869.75	3.98
48	002311	海大集团	730,848.45	3.97
49	000862	银星能源	729,357.08	3.96
50	601011	宝泰隆	724,669.02	3.94
51	600844	丹化科技	720,830.47	3.92
52	300207	欣旺达	717,015.47	3.90
53	002293	罗莱家纺	716,349.82	3.89
54	000919	金陵药业	714,564.76	3.88
55	002461	珠江啤酒	712,190.05	3.87
56	002153	石基信息	708,391.42	3.85
57	000655	金岭矿业	708,305.45	3.85
58	600551	时代出版	696,517.34	3.78
59	000703	恒逸石化	688,701.83	3.74
60	002437	誉衡药业	681,258.71	3.70
61	000566	海南海药	675,304.08	3.67
62	600851	海欣股份	661,260.92	3.59
63	000823	超声电子	649,289.17	3.53
64	000511	烯碳新材	639,322.26	3.47
65	600835	上海机电	638,374.04	3.47
66	601010	文峰股份	635,772.30	3.45
67	002219	恒康医疗	628,665.61	3.42
68	600640	号百控股	626,309.00	3.40
69	600329	中新药业	625,677.86	3.40
70	600439	瑞贝卡	620,367.82	3.37
71	600261	阳光照明	612,085.99	3.33
72	000002	万 科A	610,937.20	3.32
73	002567	唐人神	600,446.68	3.26
74	002237	恒邦股份	593,873.97	3.23
75	000933	神火股份	588,346.94	3.20
76	002635	安洁科技	587,624.93	3.19
77	002183	怡 亚 通	587,127.40	3.19
78	002572	索菲亚	585,953.35	3.18
79	600970	中材国际	566,836.57	3.08
80	002048	宁波华翔	562,687.26	3.06
81	002191	劲嘉股份	558,162.18	3.03
82	600528	中铁二局	555,646.91	3.02
83	600141	兴发集团	554,157.98	3.01
84	002008	大族激光	553,973.22	3.01
85	600533	栖霞建设	553,202.00	3.01
86	000559	万向钱潮	551,355.75	3.00
87	000886	海南高速	550,884.45	2.99
88	002181	粤 传 媒	547,408.70	2.97
89	600312	平高电气	546,877.41	2.97
90	002345	潮宏基	545,039.83	2.96
91	300229	拓尔思	532,027.85	2.89
92	002063	远光软件	528,158.58	2.87
93	000060	中金岭南	527,798.97	2.87
94	600993	马应龙	518,244.04	2.82
95	002408	齐翔腾达	511,152.03	2.78
96	600183	生益科技	502,225.62	2.73
97	600815	厦工股份	499,931.92	2.72
98	002595	豪迈科技	493,957.37	2.68
99	000063	中兴通讯	490,150.17	2.66
100	601012	隆基股份	483,373.04	2.63
101	002444	巨星科技	478,888.41	2.60
102	002254	泰和新材	478,214.20	2.60
103	002574	明牌珠宝	477,037.41	2.59
104	601101	昊华能源	472,007.32	2.56
105	600488	天药股份	467,868.59	2.54
106	002646	青青稞酒	467,352.39	2.54
107	002190	成飞集成	466,674.53	2.54
108	600816	安信信托	461,956.89	2.51
109	600601	方正科技	460,296.23	2.50
110	603366	日出东方	459,756.19	2.50
111	600460	士兰微	457,766.13	2.49
112	000671	阳 光 城	450,408.66	2.45
113	600776	东方通信	445,916.86	2.42
114	000596	古井贡酒	445,449.60	2.42
115	002204	大连重工	443,701.25	2.41
116	002340	格林美	440,957.96	2.40
117	600351	亚宝药业	438,640.43	2.38
118	002049	同方国芯	432,357.30	2.35
119	002551	尚荣医疗	431,375.75	2.34
120	002271	东方雨虹	419,307.89	2.28
121	600428	中远航运	418,622.25	2.27
122	600600	青岛啤酒	416,845.45	2.27
123	601908	京运通	415,583.57	2.26
124	600639	浦东金桥	407,225.00	2.21
125	600820	隧道股份	402,403.64	2.19
126	600888	新疆众和	393,019.20	2.14
127	000712	锦龙股份	383,085.32	2.08
128	600176	中国玻纤	376,045.16	2.04
129	600770	综艺股份	372,725.51	2.03
130	600545	新疆城建	372,488.41	2.02
131	000926	福星股份	369,049.45	2.01

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	197,347,481.56
卖出股票收入(成交)总额	137,971,357.33

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	37,186.43
2	应收证券清算款	210,740.56
3	应收股利	–
4	应收利息	1,302.68
5	应收申购款	19,862.24
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	269,091.91

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600428	中远航运	1,104,800.00	1.25	重大事项

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未存在流通受限情况。

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

份额级别	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
泰达稳健	444	22,844.21	472,607.00	4.66%	9,670,221.00	95.34%
泰达进取	434	35,055.86	6,896,840.00	45.33%	8,317,402.00	54.67%
泰达宏利500指数分级	1,158	33,365.55	33,804,210.17	87.49%	4,833,094.08	12.51%
合计	2,036	31,431.42	41,173,657.17	64.34%	22,820,717.08	35.66%

注:分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

9.2 期末上市基金前十名持有人

泰达稳健

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	尹桃安	600,144.00	5.92%
2	龚雪松	436,300.00	4.30%
3	孟京	431,160.00	4.25%
4	施翠玉	400,160.00	3.95%
5	刘小强	312,100.00	3.08%
6	陈剑平	311,712.00	3.07%
7	宋浩	280,000.00	2.76%
8	李光雨	266,004.00	2.62%
9	王旭	251,500.00	2.48%
10	武蓉	203,756.00	2.01%

泰达进取

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	北京千石创富－光大银行－千石资本－道冲套利2号资产管理计	6,892,840.00	45.31%
2	刘丹	761,812.00	5.01%
3	王勋儿	731,874.00	4.81%
4	李光雨	399,006.00	2.62%
5	卢文江	352,000.00	2.31%
6	黄秀英	331,000.00	2.18%
7	梁禧	328,022.00	2.16%
8	宋棉英	252,640.00	1.66%
9	刘雪梅	250,000.00	1.64%
10	梁健仪	233,594.00	1.54%

持有人为本基金场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	泰达稳健	0.00	0.0000%
	泰达进取	0.00	0.0000%
	泰达宏利500指数分级	16,557.48	0.0429%
	合计	16,557.48	0.0259%

9.4 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	份额级别	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	泰达稳健	0
	泰达进取	0
	泰达宏利500指数分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达稳健	0
	泰达进取	0
	泰达宏利500指数分级	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	泰达稳健	泰达进取	泰达宏利500指数分级
基金合同生效日(2011年12月1日)基金份额总额	74,125,804.00	111,188,706.00	1,250,153,255.48
本报告期期初基金份额总额	2,274,876.00	3,412,314.00	11,466,533.80
本报告期基金总申购份额	–	–	98,572,054.30
减:本报告期基金总赎回份额	–	–	52,155,012.11
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列)	7,867,952.00	11,801,928.00	–19,246,271.74
本报告期期末基金份额总额	10,142,828.00	15,214,242.00	38,637,304.25

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未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

本年度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)审计费用为人民币66,000元,该审计机构对本基金提供审计服务的连续年限为3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

本年度基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有发生受到监管部门稽查或处罚的任何情况。

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	159,395,956.70	47.54%	145,113.33	47.54%	–
中信证券	2	155,535,815.26	46.39%	141,602.33	46.39%	–
广发证券	2	9,382,336.64	2.80%	8,541.80	2.80%	–
中银国际	2	8,596,724.30	2.56%	7,825.84	2.56%	–
天源证券	1	2,161,189.80	0.64%	1,967.59	0.64%	–
国金证券	1	137,407.00	0.04%	125.11	0.04%	–
银河证券	2	73,568.00	0.02%	66.98	0.02%	–
湘财证券	1					–
南京证券	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	–	–	–	–	–
中信建投	2	–	–	–	–	–
申银万国	1	–	–	–	–	–
中金公司	2	–	–	–	–	–
华泰证券	1	–	–	–	–	–
招商证券	1	–	–	–	–	–
江海证券	1	–	–	–	–	–
中山证券	1	–	–	–	–	–
东北证券	1	–	–	–	–	–
财达证券	1	–	–	–	–	–
方正证券	1	–	–	–	–	–

注:(一)2014年本基金撤销中航证券交易单元,无新增交易单元。
(二)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,有较完善的内控制度;
(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	10,872.00	69.73%	–	–	–	–
中信证券	4,720.36	30.27%	–	–	–	–
广发证券	–	–	–	–	–	–
中银国际	–	–	–	–	–	–
天源证券	–	–	–	–	–	–
国金证券	–	–	–	–	–	–
银河证券	–	–	–	–	–	–
湘财证券	–	–	–	–	–	–
南京证券	–	–	–	–	–	–
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	–	–	–	–	–	–
中信建投	–	–	–	–	–	–
申银万国	–	–	–	–	–	–
中金公司	–	–	–	–	–	–
华泰证券	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
江海证券	–	–	–	–	–	–
中山证券	–	–	–	–	–	–
东北证券	–	–	–	–	–	–
财达证券	–	–	–	–	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–

泰达宏利基金管理有限公司
2015年3月27日