泰达宏利市值优选股票型证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2015年3月27日

§1 重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司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。

基金托管人中国建设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有限公司(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	泰达宏利市值优选股票
基金主代码	162209
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年8月3日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,760,298,159.68份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金兼顾大盘股和中小盘股,把握不同市值的股票在不同市场环境下的投资机会,投资于其中的优质股票,力争获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将使用成功运用的MVPS模型来进行资产配置调整。MVPS模型主要考虑M(宏观经济环境)、V(价值)、P(政策)、S(市场气氛)四方面因素。MVPS模型作为本基金管理人持续一致的资产配置工具,通过定量和定性分析的有效结合判断未来市场的发展趋势,为本基金的资产配置提供支持。 本基金股票资产比例最高可以达到95%,最低保持在60%以上,债券资产比例最高可以达到35%,最低为0%,并保持现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,以保持基金资产流动性的要求。
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金属于高风险、高收益的基金产品,预期收益和风险高于混合型、债券型和货币市场基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈沛	田青
	联系电话	010-66577808	010-67595096
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-69-88888	010-67595096
传真		010-66577666	010-66275853

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	767,859,466.93	722,932,035.02	–296,392,351.61
本期利润	305,758,285.95	1,045,441,971.72	582,515,990.58
加权平均基金份额本期利润	0.0540	0.1386	0.0725
本期基金份额净值增长率	8.81%	18.28%	11.33%
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	–0.1006	–0.2502	–0.3479
期末基金资产净值	4,339,845,477.69	5,786,232,957.78	5,644,452,794.66
期末基金份额净值	0.9117	0.8379	0.7084

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。

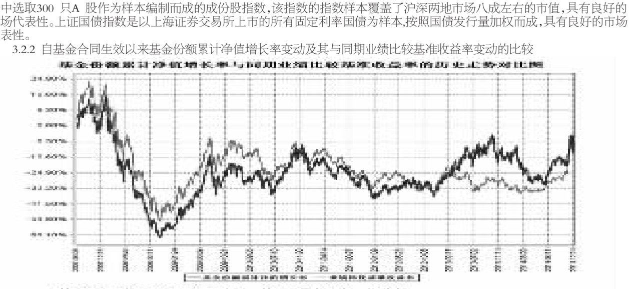
3.2 基金净值表现

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	10.18%	1.76%	32.27%	1.23%	–22.09%	0.53%
过去六个月	24.58%	1.44%	45.64%	0.99%	–21.06%	0.45%
过去一年	8.81%	1.45%	38.62%	0.91%	–29.81%	0.54%
过去三年	43.28%	1.42%	41.15%	0.97%	2.13%	0.45%
过去五年	15.26%	1.39%	5.77%	1.02%	9.49%	0.37%
自基金合同生效起至今	–8.83%	1.59%	–4.22%	1.37%	–4.61%	0.22%

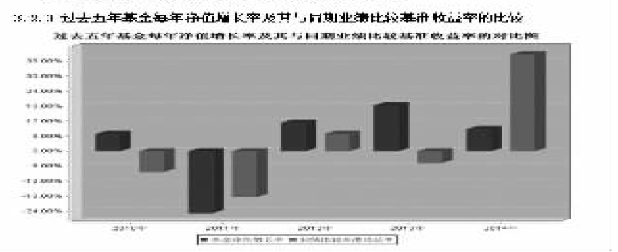
本基金的业绩比较基准:75%×沪深300 指数收益率+25%×上证国债指数收益率。沪深300 指数是由上海和深圳证券市场中选取300 只A 股作为样本编制而成的成份股指数,该指数的指数样本覆盖了沪深两地市场八成左右的市值,具有良好的市场代表性。上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本,按照国债发行量加权而成,具有良好的市场代表性。

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]

3.2.3 过去五年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



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证券投资基金、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		
吴俊峰	本基金基金经理	2009年8月25日	2014年9月11日	9	硕士。2005年5月至2005年8月期间就职于国信证券经济研究所,任研究员。2005年8月加盟泰达宏利基金管理有限公司,先后担任研究员、研究主管等职务。9年基金从业经验,具有基金从业资格。
梁辉	本基金基金经理,总经理助理兼投资总监	2014年9月11日	–	13	梁辉先生毕业于清华大学,管理科学与工程专业硕士。2002年3月加入湘财荷银基金管理有限公司(现泰达宏利基金管理有限公司),曾担任公司研究部行业研究员、基金经理助理、研究部总监、金融工程部总经理、基金投资部总经理;自2013年5月10日至今担任泰达宏利基金管理有限公司总经理助理兼投资总监;13年基金从业经验,具有基金从业资格。
刘欣	本基金基金经理助理	2014年10月22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、基金经理。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。

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

本基金致力于在实现正收益的前提下战胜比较基准,为持有人带来长期的、超额的回报。从本基金近五年的表现来看,本基金实现了同类型基金中累计相对较优的成绩,总体来讲还是令人满意的。当然,2014年的市场出现很多新的变化,也给基金操作带来了相当大的挑战。

2014年,市场风格转换频繁,上半年小市值、主题概念股表现最好,白马成长表现最差,大市值股票表现居中。下半年则完全逆转,大市值股票表现最优,白马成长次之,小市值股票表现最差。

这样的一种表现与中国经济新常态下,经济、政策和投资者结构的深刻变化密不可分。首先,从2010年开始,我国潜在经济增长持续下降,期间虽有小的反弹,但是调整的趋势从未改变。在整体调整的同时,新兴产业,如互联网、新能源、高端装备等产业也在不断上升,孕育着新的增长动力。传统产业虽然增长持续放缓,但是估值已经非常便宜,新兴产业代表未来的希望,但是估值很高,两者的此消彼长构成了2014年的经济主线。其次,在政策层面,从年初的市场利率下行到年中的积极财政政策的介入,再到年底的流动性实质放松,都为这种风格切换提供了宏观基础。再次,在下半年沪港通、融资融券、存量资产再配置等一系列投资者结构变化过程中,新资金的投资偏好主导了市场的风格。市场结束了从2010年以来的权重股搭台、成长股唱戏的格局,变成了权重股唱主角的状态。

本基金在上半年的操作不是很成功,主要是在战术层面。在战略上,本基金也认为始于2010年的成长股牛市进入到了中后期,市场必然从业绩转向主题,进入泡沫阶段。但是在战术层面,本基金一直以长期持有优质公司作为核心投资理念,所以参与这类股票不多,对这类股票的把握不是很成功。

从结果上看,指数化的配置可能是一个不错的选择。另一方面,在整个成长性行业进入泡沫阶段的时候,确实有一批股票具备长期上涨的动力,即所谓风口上的猪。本基金在年中意识到这样的一种长期机会,所以大胆介入如东方财富等股票,在下半年获得了不错的回报。

下半年本基金在低估值的大市值股票上寻找机会,3季度果断增持了证券股,对全年业绩的改善帮助很大。

从全年来看,本基金的业绩还是不够理想,主要原因是对投资者结构的变化估计不足,对市场的风格切换估计不足,所以组合调整不够彻底,存在患得患失的心理。这都需要在今后的投资中加以克服。

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0.9117元,本报告期份额净值增长率为8.81%,同期业绩比较基准增长率为38.62%。

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,我们有如下判断:(1)经济继续延续下滑,但是降幅趋缓;(2)流动性继续宽松,但是其对市场的影响力减弱;(3)投资者更加多元。

基于上述三点判断,我们认为市场将会更加均衡,从长期来看,成长股的机会优于周期股,因为前者代表经济转型的方向,所不利的地方就是成长股的估值。周期股有估值修复的机会。主题方面,我们将关注国企改革、一路一带、迪斯尼等。

另外,新股注册制改革、十三五规划等也将是我们关注的政策要点。

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

根据本基金合同及本基金实际运作的情况,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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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有限公司(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:泰达宏利市值优选股票型证券投资基金
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	174,472,854.28	232,295,371.51
结算备付金	35,336,325.69	7,018,999.73
存出保证金	1,472,450.10	1,695,274.46
交易性金融资产	4,009,788,256.67	5,598,132,050.42
其中:股票投资	3,969,792,256.67	5,438,488,050.42
基金投资	–	–
债券投资	39,996,000.00	159,644,000.00
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	196,678,690.87	–
应收利息	985,512.99	4,360,980.62
应收股利	–	–
应收申购款	194,363.53	176,300.33
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	4,418,928,454.13	5,843,678,977.07
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	52,418,526.63	41,112,491.93
应付赎回款	5,447,806.67	2,836,520.62
应付管理人报酬	5,664,407.68	7,389,310.02
应付托管费	944,067.95	1,231,551.69
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	14,483,841.15	4,451,908.85
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	124,326.36	424,236.18
负债合计	79,082,976.44	57,446,019.29
所有者权益:		
实收基金	4,760,298,159.68	6,905,741,422.15
未分配利润	–420,452,681.99	–1,119,508,464.37
所有者权益合计	4,339,845,477.69	5,786,232,957.78
负债和所有者权益总计	4,418,928,454.13	5,843,678,977.07

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值0.9117元,基金份额总额4,760,298,159.68份。

7.2 利润表

会计主体:泰达宏利市值优选股票型证券投资基金
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	429,538,248.62	1,196,270,239.54
1.利息收入	5,616,493.13	8,900,678.34
其中:存款利息收入	2,408,012.06	2,308,186.54
债券利息收入	2,377,074.27	6,033,934.24
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	831,406.80	558,557.56
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以“-”填列)	885,062,785.70	863,420,671.11
其中:股票投资收益	853,965,867.87	818,133,174.20
基金投资收益	–	–
债券投资收益	251,573.22	–250,051.12
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	30,845,344.61	45,537,548.03
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	–462,101,180.98	322,509,936.70
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	–	–
5.其他收入(损失以“-”号填列)	960,150.77	1,438,953.39
减:二、费用	123,779,962.67	150,828,267.82
1.管理人报酬	67,226,449.09	93,365,765.02
2.托管费	11,204,408.26	15,560,960.83
3.销售服务费	–	–
4.交易费用	44,749,959.17	41,392,490.76
5.利息支出	11,763.00	–
其中:卖出回购金融资产支出	11,763.00	–
6.其他费用	587,383.15	509,051.21
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	305,758,285.95	1,045,441,971.72
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	305,758,285.95	1,045,441,971.72

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰达宏利市值优选股票型证券投资基金
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)	6,905,741,422.15	–1,119,508,464.37	5,786,232,957.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	305,758,285.95	305,758,285.95
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)	–2,145,443,262.47	393,297,496.43	–1,752,145,766.04
其中:1.基金申购款	397,254,485.30	–91,728,122.64	305,526,362.66
2.基金赎回款	–2,542,697,747.77	485,025,619.07	–2,057,672,128.70
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)	4,760,298,159.68	–420,452,681.99	4,339,845,477.69
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)	7,967,432,500.25	–2,322,979,705.59	5,644,452,794.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	1,045,441,971.72	1,045,441,971.72
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)	–1,061,691,078.10	158,029,269.50	–903,661,808.60
其中:1.基金申购款	1,503,855,107.38	–278,148,052.96	1,225,707,054.42
2.基金赎回款	–2,565,546,185.48	436,177,322.46	–2,129,368,863.02
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)	6,905,741,422.15	–1,119,508,464.37	5,786,232,957.78

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

泰达宏利市值优选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”,原泰达荷银市值优选股票型证券投资基金)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]第204号《关于同意泰达荷银市值优选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由泰达荷银基金管理有限公司(于2010年3月9日更名为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《泰达荷银市值优选股票型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11,867,940,890.99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(2007)第101号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达荷银市值优选股票型证券投资基金基金合同》于2007年8月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为11,868,700,887.87份基金份额,其中认购资金利息折合759,996.88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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据本基金的基金管理人2010年3月17日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于变更公司旗下公募基金名称的公告》,本基金自公告之日起更名为泰达宏利市值优选股票型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利市值优选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行、上市的股票、国债、金融债、企业债、可转债、央行票据、短期融资券、回购、权证、资产支持证券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金资产配置的比例范围是:股票资产占基金资产的60%-95%,债券资产占基金资产的0%-35%,权证占基金资产净值的0%-3%,资产支持证券占基金资产净值的0%-20%,并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:沪深300 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。

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》、《泰达宏利市值优选股票型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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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。

7.4.10.1.2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。

7.4.10.1.3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。

7.4.10.1.4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。

7.4.10.1.5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	67,226,449.09	93,365,765.02
其中:支付销售机构的客户维护费	12,071,111.47	15,008,362.36

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1.50%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×1.50% / 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	11,204,408.26	15,560,960.83

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25% / 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

单位:人民币元

本期 2014年1月1日至2014年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	–	–	–	–	–	–
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	–	20,519,806.03	–	–	–	–

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2014年12月31日		上年度末 2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国建设银行北碚支行营业部	49,411.24	0.0010%	49,411.24	0.0007%

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
中国建设银行	174,472,854.28	2,239,292.88	232,295,371.51	2,036,861.19

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,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
000562	宏源证券	2014年12月10日	重大事项	30.50	–	–	808,700	12,288,410.40	24,665,350.00	–
002312	三泰电子	2014年12月3日	重大事项	23.89	2015年3月6日	26.28	665,896	14,689,354.16	15,908,255.44	–
600580	卧龙电气	2014年12月8日	重大事项	10.48	2015年1月14日	11.12	993,423	9,755,846.25	10,411,073.04	–
300269	联建光电	2014年12月30日	重大事项	36.13	2015年1月7日	35.00	215,533	7,162,766.51	7,787,207.29	–
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	547,018	5,293,780.67	5,524,881.80	–
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	582,589	3,229,171.99	4,660,712.00	–
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	92,700	3,570,351.19	3,817,386.00	–
600716	凤凰股份	2014年12月12日	重大事项	9.58	2015年1月12日	8.79	366,106	2,972,737.83	3,507,295.48	–
300071	华谊嘉信	2014年12月26日	重大事项	16.40	2015年1月30日	16.00	158,391	2,827,687.13	2,597,612.40	–
300063	天龙集团	2014年12月1日	重大事项	17.75	–	–	90,922	1,463,841.70	1,613,865.50	–
300028	金亚科技	2014年11月18日	重大事项	14.16	2015年2月16日	15.58	98,900	1,470,193.40	1,400,424.00	–
300248	新开普	2014年11月17日	重大事项	31.74	2015年2月16日	34.91	43,402	1,305,188.00	1,377,579.48	–
603008	喜临门	2014年11月17日	重大事项	14.58	2015年3月13日	16.04	82,200	1,061,658.45	1,198,476.00	–
002172	澳洋科技	2014年11月13日	重大事项	6.82	2015年2月17日	7.50	158,900	1,141,742.00	1,083,698.00	–
002331	皖通科技	2014年11月10日	重大事项	15.42	2015年3月25日	16.96	47,500	722,901.00	732,450.00	–
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	44,200	652,035.98	691,730.00	–
002329	皇氏集团	2014年12月1日	重大事项	29.60	2015年1月30日	27.61	297,101	7,750,026.62	8,794,189.60	–
300359	全通教育	2014年9月22日	重大事项	94.63	2015年1月28日	96.97	1,492,297	94,532,516.48	141,216,065.11	–
300315	掌趣科技	2014年7月14日	重大事项	19.59	2015年2月16日	17.41	46,880	999,109.00	918,379.20	–

注:1.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。

2.申银万国证券以换股方式吸收合并宏源证券,换股比例为2.049382716,即每1股宏源证券股票换2.049382716股申万宏源A股股票。经交易所批准,申万宏源发行的人民币普通股股票于2015年1月26日在深交所上市,开盘价17.77,宏源证券人民币普通股股票自2015年1月26日起终止上市并摘牌。

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	3,969,792,256.67	89.84
	其中:股票	3,969,792,256.67	89.84
2	固定收益投资	39,996,000.00	0.91
	其中:债券	39,996,000.00	0.91
	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	209,809,179.97	4.75
7	其他各项资产	199,331,017.49	4.51
8	合计	4,418,928,454.13	100.00

8.2 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、渔业	–	–
B	采矿业	5,270,110.95	0.12
C	制造业	1,052,650,136.43	24.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,433,170.00	0.49
E	建筑业	388,859,608.63	8.96
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	13,642,678.76	0.31
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	437,479,072.21	10.08
J	金融业	1,784,850,448.12	41.13
K	房地产业	258,391,278.17	5.95
L	租赁和商务服务业	2,876,253.40	0.07
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	4,339,500.00	0.10
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	3,969,792,256.67	91.47

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

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	000024	招商地产	8,452,359	223,057,754.01	5.14
2	601166	兴业银行	13,074,864	215,735,256.00	4.97
3	601318	中国平安	2,885,163	215,550,527.73	4.97
4	600837	海通证券	7,635,750	183,716,145.00	4.23
5	601688	华泰证券	7,182,639	175,759,176.33	4.05
6	000783	长江证券	10,284,616	172,987,241.12	3.99
7	600999	招商证券	5,375,408	151,962,784.16	3.50
8	000776	广发证券	5,823,644	151,123,561.80	3.48
9	601668	中国建筑	20,588,204	149,882,125.12	3.45
10	600031	三一重工	14,790,114	147,605,337.72	3.40

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	601318	中国平安	422,286,563.83	7.30
2	002312	三泰电子	264,976,873.69	4.58
3	600837	海通证券	247,679,200.07	4.28
4	002065	东华软件	243,057,011.11	4.20
5	600999	招商证券	224,416,761.81	3.88
6	600887	伊利股份	223,907,676.17	3.87
7	600198	大唐电信	207,736,425.66	3.59
8	600019	宝钢股份	205,643,825.33	3.55
9	601166	兴业银行	203,068,002.66	3.51
10	000783	长江证券	201,192,815.45	3.48
11	002191	劲嘉股份	195,632,179.60	3.38
12	000024	招商地产	188,408,629.81	3.26
13	000768	中航飞机	186,727,310.30	3.23
14	000333	美的集团	186,396,638.20	3.22
15	000851	高鸿股份	175,989,233.24	3.04
16	000776	广发证券	168,928,645.52	2.92
17	002005	德豪润达	165,877,069.94	2.87
18	601668	中国建筑	164,790,022.83	2.85
19	002701	奥瑞金	162,469,529.13	2.81
20	601688	华泰证券	157,765,074.80	2.73
21	002008	大族激光	155,393,381.46	2.69
22	601628	中国人寿	148,805,640.09	2.57
23	600031	三一重工	134,397,272.05	2.32
24	300246	宝莱特	130,723,835.99	2.26
25	002081	金 螳 螂	130,591,018.01	2.26
26	300059	东方财富	130,053,403.36	2.25
27	000425	徐工机械	127,788,821.10	2.21
28	000788	北大医药	125,464,409.09	2.17
29	002041	登海种业	123,635,499.16	2.14
30	600872	中炬高新	116,054,880.62	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。

8.4.2 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	002450	康得新	580,088,079.82	10.03
2	002415	海康威视	458,934,961.19	7.93
3	600887	伊利股份	447,889,340.30	7.74
4	002065	东华软件	363,575,792.49	6.28
5	601318	中国平安	353,442,220.42	6.11
6	300070	碧水源	296,385,069.43	5.12
7	300212	易华录	285,543,499.60	4.93
8	002312	三泰电子	282,689,750.60	4.89
9	000768	中航飞机	259,070,102.53	4.48
10	002241	歌尔声学	255,715,717.42	4.42
11	002081	金 螳 螂	254,238,395.03	4.39
12	002236	大华股份	249,693,053.89	4.32
13	600196	复星医药	240,621,263.57	4.16
14	000538	云南白药	230,516,451.40	3.98
15	002410	广联达	225,761,005.46	3.90
16	002375	亚厦股份	207,429,780.15	3.58
17	000333	美的集团	197,675,050.38	3.42
18	600019	宝钢股份	193,893,886.76	3.35
19	000625	长安汽车	191,869,781.48	3.32
20	300271	华宇软件	189,315,995.93	3.27
21	002353	杰瑞股份	188,637,066.74	3.26
22	002008	大族激光	174,575,253.01	3.02
23	600535	天士力	168,431,172.90	2.91
24	000851	高鸿股份	165,065,506.07	2.85
25	600198	大唐电信	163,233,197.27	2.82
26	002038	双鹭药业	159,782,597.98	2.76
27	002701	奥瑞金	149,698,236.54	2.59
28	002005	德豪润达	144,651,672.16	2.50
29	002191	劲嘉股份	142,810,699.45	2.47
30	300205	天喻信息	139,083,115.26	2.40
31	000788	北大医药	132,463,927.11	2.29
32	300246	宝莱特	117,774,702.74	2.04
33	300259	新天科技	117,181,803.34	2.03

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	13,441,468,696.73
卖出股票收入(成交)总额	15,301,797,727.37

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

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	39,996,000.00	0.92
	其中:政策性金融债	39,996,000.00	0.92
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	39,996,000.00	0.92

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	140437	14农发37	400,000	39,996,000.00	0.92

注:以上为本基金本报告期末持有的全部债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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	1,472,450.10
2	应收证券清算款	196,678,690.87
3	应收股利	–
4	应收利息	985,512.99
5	应收申购款	194,363.53
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	199,331,017.49

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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

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
197,643	24,085.34	246,155,286.89	5.17%	4,514,142,872.79	94.83%

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	43,087.68	0.0009%

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(2007年8月3日)基金份额总额	11,868,700,887.87
本报告期期初基金份额总额	6,905,741,422.15
本报告期基金总申购份额	397,254,485.30
减:本报告期基金总赎回份额	2,542,697,747.77
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	4,760,298,159.68

§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、本公司于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,经公司股东会批准,本公司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、本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。本基金托管人2014年11月03日发布公告,聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

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、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本年度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12.40万元,该审计机构对本基金提供审计服务的连续年限为8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	
海通证券	1	2,809,114,947.82	9.79%	2,557,426.60	9.79%	–
中信证券	4	2,103,006,259.34	7.33%	1,914,579.64	7.33%	–
申银万国	1	2,101,507,923.44	7.32%	1,913,213.41	7.32%	–
银河证券	2	1,719,691,713.70	5.99%	1,565,606.69	5.99%	–
国泰君安	1	1,646,667,335.81	5.74%	1,499,129.27	5.74%	–
中投证券	2	1,586,245,446.26	5.53%	1,444,114.74	5.53%	–
长江证券	3	1,558,599,517.47	5.43%	1,418,958.49	5.43%	–
华创证券	1	1,492,373,105.16	5.20%	1,358,652.34	5.20%	–
安信证券	3	1,369,992,644.92	4.77%	1,247,245.64	4.77%	–
国信证券	2	1,286,347,861.35	4.48%	1,171,093.13	4.48%	–
宏源证券	1	1,231,175,900.79	4.29%	1,120,857.15	4.29%	–
光大证券	1	1,206,931,305.78	4.20%	1,098,791.72	4.20%	–
国金证券	1	1,185,109,854.95	4.13%	1,078,930.37	4.13%	–
高华证券	3	1,101,741,035.37	3.84%	1,003,025.05	3.84%	–
湘财证券	1	1,047,925,657.45	3.65%	954,034.73	3.65%	–
齐鲁证券	2	1,043,846,960.21	3.64%	950,319.38	3.64%	–
招商证券	2	748,380,274.56	2.61%	681,326.04	2.61%	–
长城证券	1	740,750,131.94	2.58%	674,379.08	2.58%	–
瑞银证券	2	686,557,850.03	2.39%	625,043.96	2.39%	–
民生证券	1	481,883,499.62	1.68%	438,707.18	1.68%	–
中银国际	3	452,383,924.29	1.58%	411,850.56	1.58%	–
浙商证券	2	404,442,625.09	1.41%	368,205.61	1.41%	–
东兴证券	2	314,645,040.51	1.10%	286,453.77	1.10%	–
东方证券	2	298,760,795.25	1.04%	271,994.87	1.04%	–
万联证券	1	88,426,083.26	0.31%	80,502.94	0.31%	–
渤海证券	1	–	–	–	–	–
兴业证券	1	–	–	–	–	–
中信建投	1	–	–	–	–	–
广发证券	1	–	–	–	–	–
中金公司	1	–	–	–	–	–
广州证券	1	–	–	–	–	–
平安证券	1	–	–	–	–	–
华泰证券	1	–	–	–	–	–

(一)2014年本基金撤销方正证券、英大证券、信达证券交易单元;

(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
海通证券	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
申银万国	–	–	25,400,000.00	11.27%	–	–
银河证券	–	–	–	–	–	–
国泰君安	4,954,169.12	100.00%	–	–	–	–
中投证券	–	–	50,000,000.00	22.18%	–	–
长江证券	–	–	–	–	–	–
华创证券	–	–	100,000,000.00	44.37%	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	–	–	–	–
宏源证券	–	–	50,000,000.00	22.18%	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–
国金证券	–	–	–	–	–	–
高华证券	–	–	–	–	–	–
湘财证券	–	–	–	–	–	–
齐鲁证券	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
长城证券	–	–	–	–	–	–
瑞银证券	–	–	–	–	–	–
民生证券	–	–	–	–	–	–
中银国际	–	–	–	–	–	–
浙商证券	–	–	–	–	–	–
东兴证券	–	–	–	–	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–
万联证券	–	–	–	–	–	–
渤海证券	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–
中信建投	–	–	–	–	–	–
广发证券	–	–	–	–	–	–
中金公司	–	–	–	–	–	–
广州证券	–	–	–	–	–	–
平安证券	–	–	–	–	–	–
华泰证券	–	–	–	–	–	–

泰达宏利基金管理有限公司
2015年3月27日