

## 泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金

## 2012 第一季度 报告

2012年3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:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2012年4月24日

## §1 重要提示

基金管理人的董事及监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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告的内容，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。投资人投资有风险，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。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期期间为2012年1月1日至2012年3月31日。

## §2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利领先中小盘股票
交易代码	162214
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月26日
报告期末基金份额总额	1,581,504,303.71份
投资目标	通过深入挖掘中小企业在企业成长过程中蕴含的投资机会，获取企业成长价值，努力实现基金份额的长期稳健增值。
投资策略	市中市优，在公司众多处于快速成长阶段，往往具有较高的业绩增长空间，同时具备良好的盈利能力，以及积极主动的选股策略，精选细分行业内的成长类基金进行投资。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×上证综指指数折算比率
风险收益特征	本基金为股票型基金，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货币基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

## §3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2012年1月1日 - 2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -49,815,701.82

2.本期利润 -17,053,199.95

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0104

4.期末基金份额净值 1,249,131,376.52

5.期末基金净值增长率 0.790%

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，本期利息收入为本期利息收入加上本期公允价值变动收益。

2.本期利润是指基金本期利润减去本期公允价值变动收益。

3.基金净值增长率=净值增长/净值年初数，其中净值增长=基金本期利润加上期初基金份额净值后除以本期初基金份额总值。

4.基金净值增长率指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列示数字。

5.基金的净值表

3.2.1 本期基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 单位净值差额(%)

过去三个月 -1.50% 1.31% -3.81% -5.07% -0.19%

注:本基金的业绩比较基准=80%×沪深300指数+20%×上证综指指数折算比率。

本基金的业绩比较基准由中证100指数和中证500指数等构成，综合反映了沪深两市中小板公司的整体表现。中证100指数成份股由中证100指数成分股中100只股票组成，中证500指数成份股由中证500指数成分股中500只股票组成，按照国证行业分类标准，具有良好的市场代表性。

3.2.2 本期基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 单位净值差额(%)

过去三个月 -1.50% 1.31% -3.81% -5.07% -0.19%

注:本基金的业绩比较基准=80%×沪深300指数+20%×上证综指指数折算比率。

本基金的业绩比较基准由中证100指数和中证500指数等构成，综合反映了沪深两市中小板公司的整体表现。中证100指数成份股由中证100指数成分股中100只股票组成，中证500指数成份股由中证500指数成分股中500只股票组成，按照国证行业分类标准，具有良好的市场代表性。

3.2.3 本期基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 单位净值差额(%)

过去三个月 -1.50% 1.31% -3.81% -5.07% -0.19%

注:本基金的业绩比较基准=80%×沪深300指数+20%×上证综指指数折算比率。

本基金的业绩比较基准由中证100指数和中证500指数等构成，综合反映了沪深两市中小板公司的整体表现。中证100指数成份股由中证100指数成分股中100只股票组成，中证500指数成份股由中证500指数成分股中500只股票组成，按照国证行业分类标准，具有良好的市场代表性。

3.2.4 本期基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 单位净值差额(%)

过去三个月 -1.50% 1.31% -3.81% -5.07% -0.19%

注:本基金的业绩比较基准=80%×沪深300指数+20%×上证综指指数折算比率。

本基金的业绩比较基准由中证100指数和中证500指数等构成，综合反映了沪深两市中小板公司的整体表现。中证100指数成份股由中证100指数成分股中100只股票组成，中证500指数成份股由中证500指数成分股中500只股票组成，按照国证行业分类标准，具有良好的市场代表性。

3.2.5 本期基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 单位净值差额(%)

过去三个月 -1.50% 1.31% -3.81% -5.07% -0.19%

注:本基金的业绩比较基准=80%×沪深300指数+20%×上证综指指数折算比率。

本基金的业绩比较基准由中证100指数和中证500指数等构成，综合反映了沪深两市中小板公司的整体表现。中证100指数成份股由中证100指数成分股中100只股票组成，中证500指数成份股由中证500指数成分股中500只股票组成，按照国证行业分类标准，具有良好的市场代表性。

3.2.6 本期基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 单位净值差额(%)

过去三个月 -1.50% 1.31% -3.81% -5.07% -0.19%

注:本基金的业绩比较基准=80%×沪深300指数+20%×上证综指指数折算比率。

本基金的业绩比较基准由中证100指数和中证500指数等构成，综合反映了沪深两市中小板公司的整体表现。中证100指数成份股由中证100指数成分股中100只股票组成，中证500指数成份股由中证500指数成分股中500只股票组成，按照国证行业分类标准，具有良好的市场代表性。

3.2.7 本期基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 单位净值差额(%)

过去三个月 -1.50% 1.31% -3.81% -5.07% -0.19%

注:本基金的业绩比较基准=80%×沪深300指数+20%×上证综指指数折算比率。

本基金的业绩比较基准由中证100指数和中证500指数等构成，综合反映了沪深两市中小板公司的整体表现。中证100指数成份股由中证100指数成分股中100只股票组成，中证500指数成份股由中证500指数成分股中500只股票组成，按照国证行业分类标准，具有良好的市场代表性。

3.2.8 本期基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 单位净值差额(%)

过去三个月 -1.50% 1.31% -3.81% -5.07% -0.19%

注:本基金的业绩比较基准=80%×沪深300指数+20%×上证综指指数折算比率。

本基金的业绩比较基准由中证100指数和中证500指数等构成，综合反映了沪深两市中小板公司的整体表现。中证100指数成份股由中证100指数成分股中100只股票组成，中证500指数成份股由中证500指数成分股中500只股票组成，按照国证行业分类标准，具有良好的市场代表性。

3.2.9 本期基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 单位净值差额(%)

过去三个月 -1.50% 1.31% -3.81% -5.07% -0.19%

注:本基金的业绩比较基准=80%×沪深300指数+20%×上证综指指数折算比率。

本基金的业绩比较基准由中证100指数和中证500指数等构成，综合反映了沪深两市中小板公司的整体表现。中证100指数成份股由中证100指数成分股中100只股票组成，中证500指数成份股由中证500指数成分股中500只股票组成，按照国证行业分类标准，具有良好的市场代表性。

3.2.10 本期基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 单位净值差额(%)

过去三个月 -1.50% 1.31% -3.81% -5.07% -0.19%

注:本基金的业绩比较基准=80%×沪深300指数+20%×上证综指指数折算比率。

本基金的业绩比较基准由中证100指数和中证500指数等构成，综合反映了沪深两市中小板公司的整体表现。中证100指数成份股由中证100指数成分股中100只股票组成，中证500指数成份股由中证500指数成分股中500只股票组成，按照国证行业分类标准，具有良好的市场代表性。

3.2.11 本期基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 单位净值差额(%)

过去三个月 -1.50% 1.31% -3.81% -5.07% -0.19%

注:本基金的业绩比较基准=80%×沪深300指数+20%×上证综指指数折算比率。

本基金的业绩比较基准由中证100指数和中证500指数等构成，综合反映了沪深两市中小板公司的整体表现。中证100指数成份股由中证100指数成分股中100只股票组成，中证500指数成份股由中证500指数成分股中500只股票组成，按照国证行业分类标准，具有良好的市场代表性。

3.2.12 本期基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 单位净值差额(%)

过去三个月 -1.50% 1.31% -3.81% -5.07% -0.19%

注:本基金的业绩比较基准=80%×沪深300指数+20%×上证综指指数折算比率。

本基金的业绩比较基准由中证100指数和中证500指数等构成，综合反映了沪深两市中小板公司的整体表现。中证100指数成份股由中证100指数成分股中100只股票组成，中证500指数成份股由中证500指数成分股中500只股票组成，按照国证行业分类标准，具有良好的市场代表性。

3.2.13 本期基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 单位净值差额(%)

过去三个月 -1.50% 1.31% -3.81% -5.07% -0.19%

注:本基金的业绩比较基准=80%×沪深300指数+20%×上证综指指数折算比率。

本基金的业绩比较基准由中证100指数和中证500指数等构成，综合反映了沪深两市中小板公司的整体表现。中证100指数成份股由中证100指数成分股中100只股票组成，中证500指数成份股由中证500指数成分股中500只股票组成，按照国证行业分类标准，具有良好的市场代表性。

3.2.14 本期基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 单位净值差额(%)

过去三个月 -1.50% 1.31% -3.81% -5.07% -0.19%

注:本基金的业绩比较基准=80%×沪深300指数+20%×上证综指指数折算比率。

本基金的业绩比较基准由中证100指数和中证500指数等构成，综合反映了沪深两市中小板公司的整体表现。中证100指数成份股由中证100指数成分股中100只股票组成，中证500指数成份股由中证500指数成分股中500只股票组成，按照国证行业分类标准，具有良好的市场代表性。

3.2.15 本期基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 单位净值差额(%)

过去三个月 -1.50% 1.31% -3.81% -5.07% -0.19%

注:本基金的业绩比较基准=80%×沪深300指数+20%×上证综指指数折算比率。

本基金的业绩比较基准由中证100指数和中证500指数等构成，综合反映了沪深两市中小板公司的整体表现。中证100指数成份股由中证100指数成分股中100只股票组成，中证500指数成份股由中证500指数成分股中500只股票组成，按照国证行业分类标准，具有良好的市场代表性。

3.2.16 本期基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 单位净值差额(%)

过去三个月 -1.50% 1.31% -3.81% -5.07% -0.19%

注:本基金的业绩比较基准=80%×沪深300指数+20%×上证综指指数折算比率。

本基金的业绩比较基准由中证100指数和中证500指数等构成，综合反映了沪深两市中小板公司的整体表现。中证100指数成份股由中证100指数成分股中100只股票组成，中证500指数成份股由中证500指数成分股中500只股票组成，按照国证行业分类标准，具有良好的市场代表性。

3.2.17 本期基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 单位净值差额(%)

过去三个月 -1.50% 1.31% -3.81% -5.07% -0.19%

注:本基金的业绩比较基准=80%×沪深300指数+20%×上证综指指数折算比率。

本基金的业绩比较基准由中证100指数和中证500指数等构成，综合反映了沪深两市中小板公司的整体表现。中证100指数成份股由中证100指数成分股中100只股票组成，中证500指数成份股由中证500指数成分股中500只股票组成，按照国证行业分类标准，具有良好的市场代表性。

3.2.18 本期基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 单位净值差额(%)