泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司
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。

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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2012年1月1日至2012年3月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利品质生活混合
交易代码	162211
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年4月9日
报告期末基金份额总额	512,686,135.64份
投资目标	随着中国经济增长迈上新的台阶，广大人民群众必然更加注重生活品质。本基金将重点把握生活品质提高的这一趋势，通过投资相关的受益行业和上市公司，充分分享中国国民经济实力的全面提升，力争为投资者带来长期稳定的投资回报。
投资策略	1.使用MVPS模型进行战略性资产配置策略，确定股票债券比例。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。2.股票投资策略，本基金采用双主线策略，对横纵交点进行重点的定性分析和定量分析，构建实际股票投资组合。横向上，利用"行业文档"分析方法，确定国内行业与提高生活品质有关行业中具有竞争优势和比较优势的行业；纵向上，努力挖掘市场上与本基金投资理念相一致的投资主题。3.债券投资策略。本基金将结合宏观经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，运用利率预期、久期管理、收益率曲线等投资管理策略。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金属于中高风险、中高收益的混合型证券投资基金。
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年1月1日－2012年3月31日)
1.本期已实现收益	-14,076,075.91
2.本期利润	-1,475,333.15
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0027
4.期末基金资产净值	510,881,890.49
5.期末基金份额净值	0.996

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。

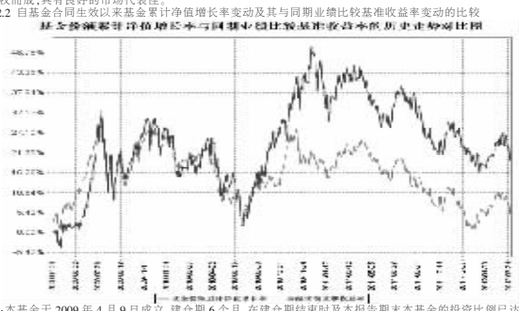
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-0.99%	0.95%	3.27%	0.91%	-4.26%	0.04%

注:本基金的业绩比较基准:60%×沪深300指数收益率+40%×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七成左右的市值，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2009年4月9日成立，建仓期6个月，在建仓期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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁辉	本基金经理，基金投资部总经理	2009年9月3日	-	10	硕士,2002年3月起任职于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，现担任基金投资部总经理。10年基金从业经验，具有证券从业资格，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。

4.3 公平交易专项说明

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机会；严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离；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；交易部运用交易系统中设置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；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票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量统计、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、事中和事后的监控，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成交较少的单边交易量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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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，为持有人带来超额的回报。从本基金成立两年来，本基金实现了同类型基金中相对业绩前5%的成绩，总体来讲还是令人满意的。

今年一季度，市场出现了反弹。主要原因如下:1. 流动性逐步改善，各类利率水平断下移；2. 经济有企稳迹象，地产、汽车销量基本见底，经济硬着陆的担心减弱；3. 海外形势超预期；美国经济好转，且流动性持续宽松。欧洲债务违约风险降低，国债利率有所下降。

这些正面因素使得市场的悲观情绪得以缓解。从板块上看，主要是普涨和轮涨的行情，其中上游的煤炭、有色，中游的汽车、家电反弹较为明显，而基金重仓股、高估值的概念股跌幅较大。

本基金适度参与了这波市场反弹，但是仍然将其定义为熊市反弹，原因是对经济周期的判断。今年上半年经济将会进入经济增长和通货膨胀双下降的衰退时期，政策会略偏正面，尤其是在存款准备金率方面，可能会有数次下调，这会改善银行间市场的利率环境，但是贷款仍然保持中性。这不会从根本上改变经济下行的运行轨迹，因而企业盈利仍然处于下行区间。

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0.996元，本报告期份额净值增长率为-0.99%，同期业绩比较基准增长率为3.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们虽然对今年的国经济和市场的长期前景相对乐观，主要基于自然禀赋、发展阶段、增长模式等因素，十到二十年的黄金发展期还在中国的面前。但是，对中国的短期(一到三年)略显谨慎。中国在过去十年赖以发展的模式可能已经遇到了相当的瓶颈:首先，投资、出口两个拉动经济多年的动力已经导致全球大宗商品的价格有了相当的上升，这制约了中国相关部门的再投资回报；其次，从2009年以来的刺激经济的货币政策的副作用越来越显著，资产(房地产)泡沫和地方平台公司的风险已经累积的比较严重。这损坏了经济整体的资产负债表，并成为经济发展的重要制约因素。

上述背景条件将会制约资本市场中长期的收益表现。对于今年，我们认为经济将会经历一个经济增长和通货膨胀双下降的衰退时期，并在底部维持一段时间，政策会略偏正面。在这种背景下，我们认为市场将会维持震荡，分化会较为严重:一方面，与宏观经济密切相关的行业会受到不断恶化的基本面和不时的政策放松的双重影响，方向并不确定；另一方面，增长比较稳定的消费、医药、科技等行业，其估值和近一年的表现已经基本反映了其相对低下行风险，行业优势在逐步减弱，重点在于个股挖掘。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	340,274,779.87	66.42
	其中:股票	340,274,779.87	66.42
2	固定收益投资	96,805,386.30	18.90
	其中:债券	96,805,386.30	18.90
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	56,423,166.55	11.01
6	其他资产	18,814,286.54	3.67
7	合计	512,317,619.26	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	10,574,501.16	2.07
B	采掘业	7,054,898.40	1.38
C	制造业	132,338,276.37	25.90
C0	食品、饮料	78,264,136.42	15.32
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	4,469,385.00	0.87
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,969,055.00	1.17
C5	电子	2,549,013.60	0.50
C6	金属、非金属	4,985,639.73	0.98
C7	机械、设备、仪表	36,101,046.62	7.07
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	17,909,558.16	3.51
F	交通运输、仓储业	7,818,183.72	1.53
G	信息技术业	75,281,875.53	14.74
H	批发和零售贸易	14,327,040.00	2.80
I	金融、保险业	18,906,280.30	3.70
J	房地产业	15,016,862.70	2.94
K	社会服务业	26,736,254.23	5.23
L	传播与文化产业	14,311,049.30	2.80
M	综合类	-	-
	合计	340,274,779.87	66.61

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002065	东华软件	1,861,120	38,487,961.60	7.53
2	600887	伊利股份	1,715,443	37,808,363.72	7.40
3	600066	宇通客车	787,338	19,124,440.02	3.74
4	002375	亚厦股份	617,784	17,909,558.16	3.51
5	000063	中兴通讯	1,063,300	17,470,019.00	3.42
6	000402	金融街	2,383,629	15,016,862.70	2.94
7	300058	蓝色光标	528,083	14,311,049.30	2.80
8	000895	双汇发展	179,566	12,372,097.40	2.42
9	002304	洋河股份	81,854	12,044,816.10	2.36
10	002024	苏宁电器	1,212,400	11,820,900.00	2.31

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	23,126,600.00	4.53
2	央行票据	48,405,000.00	9.47
3	金融债券	20,602,000.00	4.03
	其中:政策性金融债	20,602,000.00	4.03
4	企业债券	1,998,600.00	0.39
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,673,186.30	0.52
8	其他	-	-
9	合计	96,805,386.30	18.95

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1101022	11央行票据22	500,000	48,405,000.00	9.47
2	110238	11国开38	200,000	20,602,000.00	4.03
3	110024	11附息国债24	200,000	20,114,000.00	3.94
4	010308	03国债(8)	30,000	3,012,600.00	0.59
5	113002	工行转债	24,690	2,673,186.30	0.52

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	15,617,072.97
3	应收股利	-
4	应收利息	2,647,630.22
5	应收申购款	49,583.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,814,286.54

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	2,673,186.30	0.52

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000895	双汇发展	12,372,097.40	2.42	重大资产重组

5.8.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	592,415,548.03
本报告期基金总申购份额	65,153,030.12
减:本报告期基金总赎回份额	144,882,442.51
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	512,686,135.64

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；

2、《泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；

4、《泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

7.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

7.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸(《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》)或登录基金管理人互联网网址(http://www.mfcteda.com)查阅。

泰达宏利基金管理有限公司
2012年4月24日

泰达宏利货币市场基金

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。

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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期为2012年1月1日起至2012年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利货币
交易代码	162206
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年11月10日
报告期末基金份额总额	274,534,894.28份
投资目标	在确保本金安全性和基金财产流动性的基础上，力争为投资者获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将在遵守投资纪律并有效管理风险的基础上，实施稳健的投资风格和谨慎的交易操作，以价值分析为基础，数量分析为支持，采用自上而下确定投资策略和自下而上个券选择的程序，运用供求分析、久期偏离、收益率曲线配置和类属配置等积极投资策略，实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为税后一年期银行定期存款利率。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期收益率和预期风险均低于股票、混合和债券型基金。
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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年1月1日－2012年3月31日)
1. 本期已实现收益	1,950,362.65
2.本期利润	1,950,362.65
3.期末基金资产净值	274,534,894.28

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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.所述基金业绩指标不包括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。

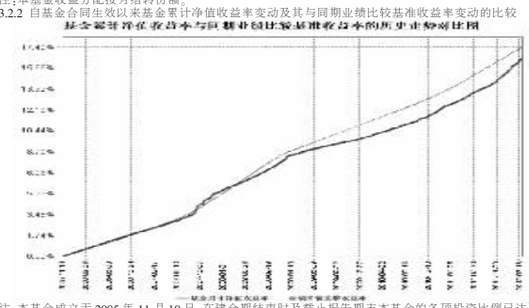
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.2014%	0.0135%	0.8726%	0.0000%	0.3288%	0.0135%

注:本基金收益分配按月结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金成立于2005年11月10日，在建仓期结束时及截止报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡振仓	本基金基金经理	2008年8月9日	-	9	硕士学位,2003年7月至2005年4月就职于乌鲁木齐市商业银行，从事债券交易与研究工作。2006年3月至2006年6月就职于国联证券公司，从事债券交易工作；2006年7月至2008年3月就职于益民基金管理有限公司，其中2006年7月至2006年11月任益民货币市场基金基金经理助理，2006年12月至2008年3月任益民货币市场基金基金经理，2008年4月加盟泰达宏利基金管理有限公司，9年证券从业经验，6年基金从业经验，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 公平交易专项说明

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机会；严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离；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；交易部运用交易系统中设置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；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票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量统计、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、事中和事后的监控，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成交较少的单边交易量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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年1季度，世界经济的表现略超预期，各国经济似乎都出现了探底企稳的迹象。随着希腊主权债务危机暂时缓解，欧洲主权债务危机似乎慢慢淡出市场。美国的消费、房地产及就业等表现良好，QE3的预期在逐步淡化。国内，PMI等领先指标连续多月好转，GDP环比见底的预期几乎成了共识。出人意料的是，管理层在11年11月首次降低法定存款准备金率之后，政策放松的迹象并不明显。

货币市场而言，1、2月份是比较难熬的一段时间。临近年底，加上今年春节较早，银行体系对资金的需求较为集中，尽管央行进行了大规模的逆回购，货币市场利率还是冲到了9%附近的高位。春节后，各期限回购利率均出现大幅下降，1天回购接近2%的水平。值得注意的是，一直比较稳定的3个月shibor，利率也出现较大幅度的下降，表明银行体系中长期资金需求在慢慢减弱。1季度短融、shibor浮动债表现优异。各评级短融渐次表现，高评级短融价格领涨之后，AA、AA-短融收益率的降幅也非常大，目前只有A+短融收益率还维持高位。随着shibor利率的大幅下降之后，shibor浮动债出现了一轮调整，本基金已经减持了部分shibor浮动债。1季度本基金减持了高等级短融，增持了部分资质较好的AA-短融，同时也增加了一些协议存款。2季度前期暂时维持目前的组合。

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1.0000元，本报告期份额净值增长率为1.2014%，同期业绩比较基准增长率为0.8726%。

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2季度，货币政策在1季度放松低于预期，放松力度将有所加大，预计依然会有1-2次的降准，银行体系资金将更加充裕，货币市场利率将维持在低位，央票、短融还会有继续下降的空间。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	154,943,609.81	56.27
	其中:债券	154,943,609.81	56.27
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	78,000,557.00	28.33
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	40,867,974.53	14.84
4	其他资产	1,523,794.90	0.55
5	合计	275,335,936.24	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.53	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:上表中，报表期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数，报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期未出现债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	153
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	155
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	54

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限未出现超过180天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	28.73	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	21.86	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	7.36	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	7.36	-
4	90天(含)-180天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	41.79	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.74	-

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	19,537,560.44	7.12
3	金融债券	40,226,446.95	14.65
	其中:政策性金融债	20,217,759.56	7.36
4	企业债券		
5	企业短期融资券	95,179,602.42	34.67
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	154,943,609.81	56.44
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	20,217,759.56	7.36

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100236	10国开36	200,000	20,217,759.56	7.36
2	041258014	12翠子岛CP001	200,000	20,023,283.89	7.29
3	1026001	10三菱东银01	200,000	20,008,687.39	7.29
4	041260009	12蒙发CP001	200,000	20,001,048.90	7.29
5	1101096	11央票96	200,000	19,537,560.44	7.12
6	041265005	12沁和集CP001	100,000	10,097,471.35	3.68
7	041253015	12卧龙电气CP001	100,000	10,032,506.83	3.65
8	041260011	12惠天CP001	100,000	10,024,673.15	3.65
9	041260013	12皖盐业CP001	100,000	10,000,511.96	3.64
10	041159011	11国新能源CP001	50,000	5,000,233.50	1.82

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	20
报告期内偏离度的最高值	0.3723%
报告期内偏离度的最低值	0.0442%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2111%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

报告期末基金未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

5.8.2 本报告期内，本基金没有持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 报告期内本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，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,009,094.90
4	应收申购款	514,700.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,523,794.90

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1.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。

2.报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	87,565,824.24
本报告期基金总申购份额	889,883,943.01
减:本报告期基金总赎回份额	702,914,872.97
本报告期期末基金份额总额	274,534,894.28

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准泰达宏利货币市场基金设立的文件；

2、《泰达宏利货币市场基金基金合同》；

3、《泰达宏利货币市场基金招募说明书》；

4、《泰达宏利货币市场基金托管协议》。

7.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

7.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸(《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》)或登录基金管理人互联网网址(http://www.mfcteda.com)查阅。

泰达宏利基金管理有限公司
2012年4月24日

泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

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。

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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2012年1月1日至2012年3月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利财富大盘指数
交易代码	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
报告期末基金份额总额	484,946,690.47份
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额数量的股票时，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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年1月1日－2012年3月31日)
1.本期已实现收益	-35,977,612.04
2.本期利润	15,969,757.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0333
4.期末基金资产净值	424,780,786.96
5.期末基金份额净值	0.876

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	4.04%	1.30%	3.91%	1.29%	0.13%	0.01%

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