

泰达宏利行业精选证券投资基金

2013第四季度报告

2013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

报告送出日期:2014年1月21日

§1重要提示

基金管理人的声明及承诺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。

基金托管人和中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年1月17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，确认复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经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。投资人投资于基金前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报吿期财务资料未经审计。

本报吿期间为2013年10月1日至2013年12月31日。

§2基金产品概况

基金名称 泰达宏利行业精选证券投资基金

交易代码 162204

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2004年7月9日

报告期末基金份额总额 628,235,943.42份

投资目标 追求长期的长期资本增值，为投资者寻求高于业绩比较基准的投资回报。

投资策略 全面运用荷兰银行的投资管理经验，采用自上而下的资产配置和行业类别与风格选择相结合的主动投资策略，同时结合对宏观经济、政策、行业趋势、公司质地、个股质地等多方面的综合分析，力争在控制风险的前提下，获取超越业绩比较基准的收益。

业绩比较基准 70%×沪深300指数+30%×中债国债总指数(财富)

风险收益特征 本基金为股票型基金，属于较高风险、较高收益的基金品种。

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

1.本期实现收益 81,323,550.00

2.本期利润 -79,706,157.49

3.加权平均基金份额本期利润 -0.1232

4.期末基金资产净值 2,500,534,098.33

5.期末基金份额净值 3.9802

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.本期利润不包括持有人认购或申购基金产生的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值是指基金份额净资产值除以基金份额总数。

3.2本期报告基金资产净值增长及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差③ (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -3.36% 1.26% -2.82% 0.81% -0.54% 0.47%

本基金业绩比较基准:70%×沪深300指数+30%×中债国债总指数(财富)。富时中国A股000指是指数是市场的指标，指的是一些上市公司的股票，这样可以全面而准确地反映股市的动态。

3.3本期报告基金资产净值增长及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差③ (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -3.36% 1.26% -2.82% 0.81% -0.54% 0.47%

本基金业绩比较基准:70%×沪深300指数+30%×中债国债总指数(财富)。富时中国A股000指是指数是市场的指标，指的是一些上市公司的股票，这样可以全面而准确地反映股市的动态。

3.4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间 证券从业年限 说明

梁辉 本基金基金经理、总经理助理、理财投资总监 2013年2月21日 - 11 管理科学与工程学硕士，2002年5月加入泰达宏利基金管理有限公司，主要从事基金研究、基金研究、基金评价、研究报告、基金评价、研究员工作，2013年2月21日起担任本基金基金经理，具有证券从业资格，具备11年基金管理经验，其中5年基金经理经验。

4.2管理人对报告期内基金运作遵守法律法规及基金合同的情况的说明

报告期内，本基金管理人员严格遵守相关法律法规及基金合同的规定，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情况。

4.3公平交易制度的执行情况

4.3.1公平交易制度的执行情况

本基金管理人员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，本基金管理人员公平对待不同投资组合，确保投资决策在获得投资信息、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部门的隔离，在交易环节实行集中交易制度，并确保公平交易执行机制可操作、可稽核、可持续；交易部通过交易系统中设置的公平交易功能进行公平交易监控，对异常交易行为进行实时监控和预警，确保投资组合共享公平的交易机会。风

险管理部事后对每只基金的公平交易情况进行定期评估。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金管理人员建立了异常交易监控和预警制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控，风险管理部定期对异常交易行为进行分析，对异常交易行为进行识别，对异常交易行为进行预警，对异常交易行为进行处理。

4.4报告期内基金的投顾策略和行业表现情况

本基金在报告期内未有基金投顾策略。

4.5管理人对报告期内基金业绩表现的简要说明

展望2014年，我们认为经济将呈现温和复苏，中国经济基本面将好于预期，但由于房地产销售情况不佳，我们预计2014年的经济增长将低于我们此前的预期。

2013年4季度，市场表现的主要原因是：(1)部分行业阶段性地表现出良好的增长态势，如金融、家电、食品饮料、医药生物等；(2)部分行业则表现得相对平淡，如地产、煤炭、有色等。

在这些行业中，表现较好的仍然是消费类的标的。不过考虑到2014年IPO重启，市场的资金可能会向新兴产业转移，我们认为2014年的总体受益会大于2013年，而且会比2013年的分化更加明显，高估值依赖成长的风格将会有较大的风险。

4.6报告期末基金的资产配置情况

本基金在报告期内未有资产配置情况。

4.7基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

1.基金管理人的交易从行业协会《证券业从业人员执业行为准则》的相关规定。

2.代理人对报告期内本基金运作遵守法律法规的情况的说明

本基金在报告期内未有代理机构的交易记录。

3.基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人投资于基金前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

4.报告期财务资料未经审计。

本报吿期间为2013年10月1日至2013年12月31日。

§2基金产品概况

基金名称 泰达宏利行业精选证券投资基金

交易代码 000169

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2013年6月20日

报告期末基金份额总额 3,217,601,696.16份

投资目标 在开放期制衡风险的基础上，通过积极的管理，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的回报。

投资策略 在开放期内本基金为保持较低的波动性的低风险品种，预期收益和预期风险均低于货币市场基金和股票型基金。

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

基金名称 泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金

交易代码 000169

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2013年6月20日

报告期末基金份额总额 4,721,196,489.52份

投资目标 在开放期制衡风险的基础上，通过积极的管理，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的回报。

投资策略 在开放期内本基金为保持较低的波动性的低风险品种，预期收益和预期风险均低于货币市场基金和股票型基金。

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

基金名称 泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金

交易代码 000169

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2013年6月20日

报告期末基金份额总额 4,721,196,489.52份

投资目标 在开放期制衡风险的基础上，通过积极的管理，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的回报。

投资策略 在开放期内本基金为保持较低的波动性的低风险品种，预期收益和预期风险均低于货币市场基金和股票型基金。

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

基金名称 泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金

交易代码 000169

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2013年6月20日

报告期末基金份额总额 4,721,196,489.52份

投资目标 在开放期制衡风险的基础上，通过积极的管理，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的回报。

投资策略 在开放期内本基金为保持较低的波动性的低风险品种，预期收益和预期风险均低于货币市场基金和股票型基金。

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

基金名称 泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金

交易代码 000169

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2013年6月20日

报告期末基金份额总额 4,721,196,489.52份

投资目标 在开放期制衡风险的基础上，通过积极的管理，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的回报。

投资策略 在开放期内本基金为保持较低的波动性的低风险品种，预期收益和预期风险均低于货币市场基金和股票型基金。

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

基金名称 泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金

交易代码 000169

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2013年6月20日

报告期末基金份额总额 4,721,196,489.52份

投资目标 在开放期制衡风险的基础上，通过积极的管理，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的回报。

投资策略 在开放期内本基金为保持较低的波动性的低风险品种，预期收益和预期风险均低于货币市场基金和股票型基金。

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

基金名称 泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金

交易代码 000169

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2013年6月20日

报告期末基金份额总额 4,721,196,489.52份

投资目标 在开放期制衡风险的基础上，通过积极的管理，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的回报。

投资策略 在开放期内本基金为保持较低的波动性的低风险品种，预期收益和预期风险均低于货币市场基金和股票型基金。

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

基金名称 泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金

交易代码 000169

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2013年6月20日

报告期末基金份额总额 4,721,196,489.52份

投资目标 在开放期制衡风险的基础上，通过积极的管理，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的回报。

投资策略 在开放期内本基金为保持较低的波动性的低风险品种，预期收益和预期风险均低于货币市场基金和股票型基金。

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

基金名称 泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金

交易代码 000169

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2013年6月20日

报告期末基金份额总额 4,721,196,489.52份

投资目标 在开放期制衡风险的基础上，通过积极的管理，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的回报。

投资策略 在开放期内本基金为保持较低的波动性的低风险品种，预期收益和预期风险均低于货币市场基金和股票型基金。

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

基金名称 泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金

交易代码 000169

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2013年6月20日

报告期末基金份额总额 4,721,196,489.52份

投资目标 在开放期制衡风险的基础上，通过积极的管理，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的回报。