

## 泰达宏利集利债券型证券投资基金

## 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

基金管理人的董事局及董事会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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经理承诺以诚实信用、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2013年10月1日至2013年12月31日。

\$2 基金产品概况

基金简称 泰达宏利集利债券  
交易代码 162210  
基金运作方式 灵活配置开放式  
基金合同生效日 2008年6月26日  
报告期末基金份额总额 926,957,209.94份  
投资目标 在有效控制风险及保持流动性基础上，力求实现基金财产稳定的当期收益和长期增值的双重目标。

(1)战略资产配置策略：根据信心对风险进行预估和分配，从而决定资产的分配。

(2)固定收益类品种投资策略：利率预期分析策略形成对未来的市场利率变动方向的预期，进而通过买入或卖出对冲头寸，波动交易策略对所持有的债券资产进行买卖。

(3)股票投资策略：根据宏观经济基本面判断，采取相对估值策略，通过定价水平及一级股票投资需求的基本面，把握市场的整体机会，结合行业轮动，精选个股投资策略，要关注公司盈利能力及成长性的上升趋势，在综合考虑资产负债率、市盈率、市净率等指标的基础上，选择具有投资价值的股票。

(4)期权投资策略：利用衍生品对冲投资风险，计算期权的理论价格，结合对期权证的基本面进行分析，评估期权的投资价值。

业绩比较基准 90%×上证国债指数+10%×银行存款利率基准。

风险收益特征 本基金是具有较高收益的基本型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

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

报告期末基金的份额总额 399,993,441.99份

报告期末基金的净值收益 326,963,767.95份

下同

下同&lt;/div