兴全社会责任股票型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31日

基金管理人:兴业全球基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21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2014年1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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全社会责任股票
基金主代码	340007
交易代码	340007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年4月30日
报告期末基金份额总额	3,828,604,943.86份
投资目标	本基金追求当期投资收益实现与长期资本增值,同时强调上市公司在持续发展、法律、道德责任等方面的履行。
投资策略	本基金采用“自上而下”与“自下而上”相结合的投资策略,将定性与定量研究相结合,在宏观与微观层面对各类资产的价值增长能力展开综合评估,动态优化资产配置。在根据行业所处生命周期、景气周期、行业盈利与发展趋势等因素选取盈利能力较好、持续发展潜力强的行业的基础上,采用“全双层行业筛选法”进行优化调整。采用“兴全社会责任四维选股模型”精选股票。
业绩比较基准	80%×中信标普300指数+20%×中信标普国债指数
风险收益特征	较高风险、较高收益
基金管理人	兴业全球基金管理有限公司
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(2013年10月1日 - 2013年12月31日)
1.本期已实现收益	37,502,007.93
2.本期利润	-256,936,049.78
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0654
4.期末基金资产净值	5,702,422,752.09
5.期末基金份额净值	1.489

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(例如:申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),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	-4.24%	1.36%	-2.77%	0.91%	-1.47%	0.45%

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:1.净值表现所取数据截至到2013年12月31日。

2.按照《兴全社会责任股票型证券投资基金基金合同》的规定,本基金建仓期为2008年4月30日至2008年10月29日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

§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		
傅鹏博	总经理助理、研究部总监、本基金基金经理	2009年1月16日	-	20年	1962年生,经济学硕士。历任上海财经大学经济管理系讲师,申银万国证券股份有限公司企业融资部经理,东方证券股份有限公司资产管理部负责人,研究所首席策略师;汇添富基金管理有限公司首席策略师;兴业全球基金管理有限公司基金管理部副总监,兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)基金经理。

注:1.职务指截止报告期末的职务(报告期末仍在任的)或离任前的职务(报告期内离任的)。

2.任职日期指基金合同生效之日(基金成立时即担任基金经理)或公司作出聘任决定之日(基金成立后担任基金经理);离任日期指公司作出解聘决定之日。

3.“证券从业年限”按其从事证券投资、研究等业务的年限计算。

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循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全社会责任股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,无违法违规、未履行基金合同承诺或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

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定,从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关,确保各投资组合之间得到公平对待,保护投资者的合法权益。公司监察稽核部对公司管理的不同投资组合的收益率差异进行统计、从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在非公平的因素。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况,未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

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

第四季度A股市场出现了不同程度的调整,上证综指下跌2.77%,深证成指下跌4.6%,沪深300下跌3.21%,中小板指下跌4.68%,创业板指下跌4.76%。第四季度,家用电器、农林牧渔、纺织服装、机械设备、交运设备以及轻工制造取得了不错的正收益,信息服务、房地产、商业贸易、有色金属跌幅较大。

从全球来看,金融危机以来,美国连续三波QE,欧洲持续维持低利率,日本“安倍经济学”,2013年外围环境持续宽松,全球经济仍在缓慢而曲折的复苏轨道中。驱松的货币环境驱动着全球股市上行,全球股市创下佳绩,日本与美国股市均出现了大幅度的上涨,取得2009年以来最好的年度回报。

从经济数据看,12月的CPI重回“2时代”,成功达成调控目标,一方面是因为政府消费性支出降低,另一方面也说明社会总需求增长较弱。PPI持续负增长,经济复苏虽已经初现苗头,但仍然面临较大库存压力。因此,对于产能过剩行业的调控将继续,金融体系降杠杆将持续深化,短期仍无法期待流动性的改善。

回顾市场,10月十八届三中全会《决议》传达出了改革的思路,市场情绪有所提升,股指出现一波强势的上扬。而临近年末新股发行改革以及IPO重启使得市场出现较大分化,加之年末流动性的收紧,市场出现了一定程度的调整。第四季度市场的普跌与流动性收紧不无关系。市场的板块特征不明显,临近年末,正如我们之前所判断的,市场对于上市公司业绩的敏感度提升,一些业绩确定性较强的行业取得了不错的收益。

第四季度的基金操作更注重防守,寻找有安全边际以及业绩保障的个股进行持有,调整了相关行业的配置。同时,积极布局未年,深挖景气行业以及竞争力突出的公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期累计份额净值增长率为-4.24%,同期业绩比较基准收益率为-2.77%。

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2014年,海外经济基本平稳,主要经济体中,美国、欧洲仍将延续复苏趋势,尤其是美国,其经济复苏最为确定以及稳定,伴随QE缩减启动,美元指数有望上行,资金或回流美国,新兴市场可能继续遭受冲击。因此,虽然中国经济的外部条件将延续变好,但流动性压力上升,会削弱外部经济复苏对出口的正面影响。

就国内经济而言,虽然面临众多短、中、长期的难题,但是,中国经济传统行业缓慢调整、消费服务缓慢回升的趋势已经建立。短期看,经过两年的去库存,库存逐步见底,大宗商品触底回升,随着后续需求增长的修复,库存或在低位缓动中上升。中期看,过剩产能的淘汰将是一场攻坚战,今明两年将进入白热化阶段。同时,债务问题也是一个中期需要平衡解决的问题,不仅需要靠经济降杠杆,更需要中期的经济增长来化解。

改革则是中国经济的长期课题。十八大三中全会提出的深化改革方案,将对化解积累深重的内外矛盾、突破增长困境,建立全新的市场化经济体系等方面都产生深远的正面影响,并确立未来七年中国经济、法制、环境等诸多领域的美好蓝图。不可否认,改革的推进依然是温和渐近式,各项制度红利的释放需要时间,因此可以提振短期信心,但不会成为左右2014年经济运行的关键因素。

流动性方面,在央行明确改紧货币政策的背景下,流动性紧张将会成为2014年的常态。在偏紧的货币政策延续决心的情况下,货币政策腾挪的空间有限。外汇占款回落压力趋升以及利率市场化约会在中短期限制利率回落,进而会继续冲制市场整体估值。同时,2014年二级市场面临的资金压力较2013年整体上升,IPO的重启或引发二级市场资金的分流效应。优先股等创新金融产品将分流部分长期投资资金,市场资金总体紧平衡。

在经济弱复苏,货币紧平衡的短期环境下,2014年的市场成触底回升,但整体难有大的趋势性机会。2014年的市场可能会在平淡的宏观基本面与乐观的改革预期相互纠结之中震荡反复。如果改革措施推进落实的进度超越大众预期,市场指数的重心有望在不断震荡中逐级上移。

行业配置方面,周期类、成长类、消费类行业和个股均有不同程度的机会。周期类的机会主要在于把握供给层面的收缩;消费类行业长期稳定增长,需要把握的是估值与成长的平横;成长类行业依然值得长期看好,但行业内公司分化严重,投资标的选择需要有较强的辨别能力。同时,2014年改革主题会贯穿全年,值得深入挖掘。我们将继续深挖个股,密切关注各行业的变化,跟踪政策的变化,从中寻找各类投资机会。

§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	5,260,059,154.82	91.85
	其中:股票	5,260,059,154.82	91.85
2	固定收益投资	295,100,000.00	5.15
	其中:债券	295,100,000.00	5.15
	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	72,312,149.55	1.26
6	其他资产	99,065,716.19	1.73
7	合计	5,726,537,020.56	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,189,959,588.32	73.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,750,000.00	0.36
E	建筑业	154,651,794.63	2.71
F	批发和零售业	109,130,090.00	1.91
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	439,709,277.23	7.71
J	金融业	-	-
K	房地产业	19,106,804.64	0.34
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	96,126,800.00	1.69
R	文化、体育和娱乐业	6,443,800.00	0.11
S	综合	224,181,000.00	3.93
	合计	5,260,059,154.82	92.24

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	600867	通化东宝	27,928,000	427,577,680.00	7.50
2	300146	汤臣倍健	4,101,041	298,924,878.49	5.24
3	002475	立讯精密	8,575,380	286,589,199.60	5.03
4	000895	双汇发展	5,094,582	239,852,920.56	4.21
5	600256	广汇能源	25,650,000	224,181,000.00	3.93
6	002038	双鹭药业	4,185,434	211,573,688.70	3.71
7	002250	联化科技	10,058,757	211,133,309.43	3.70
8	300088	长信科技	13,248,045	198,323,233.65	3.48
9	002008	大族激光	13,864,337	187,029,906.13	3.28
10	002450	康得新	7,438,000	180,743,400.00	3.17

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	295,100,000.00	5.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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	295,100,000.00	5.17

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	130007	13附息国债07	1,000,000	99,440,000.00	1.74
2	139906	13贴现国债06	1,000,000	97,970,000.00	1.72
3	139903	13贴现国债03	1,000,000	97,690,000.00	1.71
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,630,943.76
2	应收证券清算款	90,072,896.82
3	应收股利	-
4	应收利息	4,902,356.22
5	应收申购款	2,459,519.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,065,716.19

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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不存在流通受限情况的说明。

5.10.6 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

报告期期初基金份额总额	4,049,772,889.86
报告期期间基金总申购份额	303,205,640.05
减:报告期期间基金总赎回份额	524,373,586.05
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	3,828,604,943.86

注:总申购份额含红利再投资、转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金设立的文件

2、《兴全社会责任股票型证券投资基金基金合同》

3、《兴全社会责任股票型证券投资基金托管协议》

4、《兴全社会责任股票型证券投资基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站(http://www.xyfunds.com.cn)查阅,或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

兴业全球基金管理有限公司
2014年1月21日

泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

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	219,422,435.01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,并根据标的指数成分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够数量的股票时,基金管理人将指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(2013年10月1日 - 2013年12月31日)
1.本期已实现收益	320,864.56
2.本期利润	-4,833,206.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0216
4.期末基金资产净值	188,812,553.78
5.期末基金份额净值	0.8605

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

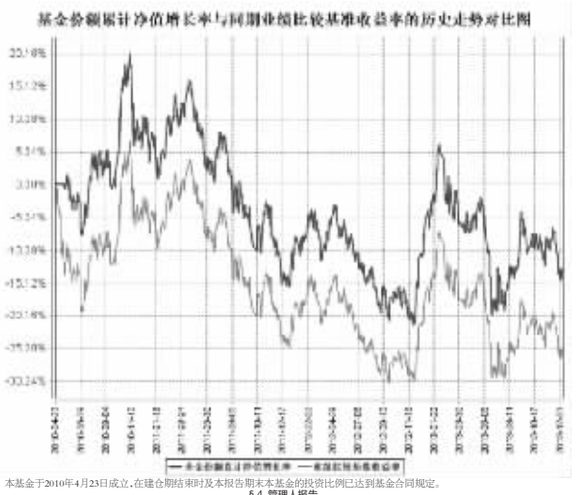
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-2.47%	1.06%	-2.90%	1.06%	0.43%	0.00%

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的300家A股上市公司作为样本;此外该指数在加权方式上亦有所创新,不同于一般的市值加权指数,该指数样本个股的权重配置将与其创造财富能力的大小相适应,从而打破市值指数中价格与权重过于紧密的联系,预防个股权重由于价格的非理性波动而大起大落,提高了个股权重配置的稳定性。指数的表现综合反映了中国经济增长过程中核心企业真实的财富增长情况。

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



本基金于2010年4月23日成立,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。

§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		
刘欣	本基金基金经理	2012年8月14日	-	6	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。具备6年基金从业经验,6年证券投资管理经验,具有基金从业资格。

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。

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

从全球经济来看,海外经济步入稳步复苏的态势,中国经济的外部条件在好转,从国内来看,四季度经济复苏的内生力量依然比较充足,但由于短期通胀有抬头的迹象,市场利率快速上升,流动性压力趋紧,市场走出了震荡调整的行情。

本基金在操作中,严格遵守基金合同,应用指数复制技术和数量化手段降低交易成本并控制跟踪误差,力争获取超额收益。

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0.8605元,本报告期份额净值增长率为-2.47%,同期业绩比较基准增长率为-2.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来经济转型和缓慢复苏依然是长期主题,但与此同时,美国长期国债利率上行,将增加全球市场融资成本,增加新兴市场经济下行压力,由于目前QE3退出暂缓,中国出口增长在短期内依然改善。预计四季度估值相对较低的价值蓝筹股会有一定超额收益。

作为指数基金,本基金将积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,有效控制跟踪误差,力争获取超额收益。

§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	179,235,818.26	94.61
	其中:股票	179,235,818.26	94.61
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	9,908,165.88	5.23
6	其他资产	300,935.43	0.16
7	合计	189,444,919.57	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	229,384.98	0.12
B	采矿业	10,812,117.82	5.73
C	制造业	38,411,074.65	20.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,703,597.39	3.55
E	建筑业	7,771,387.57	4.12
F	批发和零售业	3,184,362.33	1.69
G	交通运输、仓储和邮政业	7,574,542.06	4.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,491,064.95	1.85
J	金融业	76,556,121.17	40.55
K	房地产业	8,659,335.00	4.59
L	租赁和商务服务业	346,092.54	0.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	427,052.80	0.23
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	137,060.68	0.07
	合计	164,303,193.94	87.02

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	7,808,781.38	4.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	765,208.08	0.41
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,616,412.54	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	36,813.96	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	886,564.99	0.47
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,249,148.84	1.72
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	202,646.53	0.11
R	文化、体育和娱乐业	367,048.00	0.19
S	综合	-	-
	合计	14,932,624.32	7.91

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

5.3.1 报告期末指数投资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	600036	招商银行	1,051,234	11,447,938.26	6.06
2	600016	民生银行	1,224,850	9,455,842.00	5.01
3	601166	兴业银行	822,445	8,339,592.30	4.42
4	600000	浦发银行	879,184	8,290,705.12	4.39
5	601088	中国神华	446,618	7,065,496.76	3.74
6	601328	交通银行	1,589,475	6,103,584.00	3.23
7	601668	中国建筑	1,752,105	5,501,609.70	2.91
8	000001	平安银行	368,710	4,516,697.50	2.39
9	601288	农业银行	1,751,646	4,344,082.08	2.30
10	600048	保利地产	486,822	4,016,281.50	2.13

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600223	鲁商置业	839,566	3,249,120.42	1.72
2	000951	中国重汽	139,256	1,593,088.64	0.84
3	002064	华峰氨纶	152,694	1,391,042.34	0.74
4	600697	欧亚集团	71,814	1,345,076.22	0.71
5	002391	长青股份	44,238	1,057,288.20	0.56

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金没有投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

基金投资前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	41,174.50
2	应收证券清算款	207,626.25
3	应收股利	-
4	应收利息	2,165.35
5	应收申购款	49,969.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	300,935.43

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.10.6 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

报告期期初基金份额总额	231,621,983.95
报告期期间基金总申购份额	7,998,676.52
减:报告期期间基金总赎回份额	20,198,225.46
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	219,422,435.01

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金设立的文件;

2、《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》;

3、《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金招募说明书》;

4、《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金托管协议》。

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资人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
2014年1月21日

泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司
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2013年10月1日至2013年12月