
泰达宏利行业精选证券投资基金

更新招募说明书摘要

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

重要提示

泰达宏利行业精选证券投资基金于 2004 年 4 月 21 日经中国证监会证监基金字【2004】58 号文批准募集,基金合同于 2004 年 7 月 9 日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

投资有风险,投资人认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书正文。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2013 年 1 月 9 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2012 年 12 月 31 日,财务数据未经审计。基金托管人中国银行股份有限公司已于 2013 年 1 月 31 日对本招募说明书中的基金投资组合报告和基金业绩中的数据进行了复核。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：泰达宏利基金管理有限公司

成立日期：2002 年 6 月 6 日

注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

法定代表人：刘惠文

组织形式：有限责任公司

联系电话：010-66577605

联系人：苗广斌

注册资本：1.8 亿元人民币

股权结构：北方国际信托股份有限公司：51%；宏利资产管理（香港）有限公司：49%。

（二）主要人员情况

1、董事会成员：

刘惠文先生，董事长。毕业于吉林大学经济系，经济学学士学位，高级经济师。1996 年至 2001 年任天津泰达集团有限公司总经理。2001 年至 2006 年担任天津泰达投资控股有限公司董事长兼总经理。2006 年至 2010 年任天津泰达投资控股有限公司董事长。2010 年起任天津市泰达国际控股（集团）有限公司董事长。兼任渤海财产保险股份有限公司董事长、北方信托国际投资股份有限公司董事长，渤海银行股份有限公司董事、渤海证券有限公司董事等职。

刘振宇先生，董事。毕业于天津师范大学和南开大学，拥有法学学士学位和经济学博士学位，律师、经济师。2000 年至 2002 年任天津泰达集团有限公司投资部副部长。2002 年至 2008 年任天津泰达投资控股有限公司资产管理部经理。2008 年任天津市泰达国际控股（集团）有限公司总经理助理。2010 年起任天津市泰达国际控股（集团）有限公司副总经理。兼任恒安标准人寿保险有限公司董事、渤海财产保险股份有限公司董事等职。

孙泉先生，董事。拥有天津南开大学经济学学士和经济学硕士学位及美国芝加哥罗斯福大学工商管理硕士学位。1988 年任职天津开发区信托投资公司，负责信贷和外汇管理工作；1989 年任职天津开发区管理委员会政策研究室，负责区域发展、国企改革、对外合作

政策的研究和制定工作；1997年任职天津经济技术开发区总公司企划部，负责企业发展战略研究和计划经营管理工作；2001年任职天津泰达投资控股公司资产管理部，负责泰达控股重组并购、资源整合、上市筹备和金融类、实业类企业的经营管理工作。现任天津泰达投资控股公司资产管理部经理，渤海产业基金投资管理公司、恒安标准人寿保险公司和天津钢管集团股份有限公司董事等职。

施德林(Marc Howard Sterling)先生，美国国籍，董事。心理学学士学位、法学博士学位及银行法硕士学位。施先生为宏利金融亚洲区行政副总裁，掌管宏利金融在中国和台湾的业务。施先生于亚洲从事金融服务业超过二十一年，其中在宏利工作十七年，五年则为专责有关金融服务的执业律师。施先生为宏利保险策划开拓中国、越南及澳门市场，并为宏利资产管理策划开拓中国及台湾市场。施先生分别自1993年及2000年管理宏利在中国及台湾业务，并于1999至2005年成功开拓及经营宏利在越南之业务。现任宏利金融亚洲区行政副总裁、中宏人寿保险有限公司董事长及宏利证券投资信托股份有限公司主席。

雷柏刚(Robert Allen Cook)先生，加拿大国籍，董事。毕业于加拿大多伦多大学及卡尔加里大学，持有金融学工商管理硕士学位。雷先生为宏利金融亚洲区高级行政副总裁兼总经理，并为宏利金融执行委员会成员。雷先生统领宏利金融于中国内地、香港、印尼、日本、马来西亚、菲律宾、新加坡、台湾、泰国、越南等地的业务发展。雷先生于2007年出任现职前曾担任美国保险业务部行政副总裁，掌管恒康人寿保险、恒康长期护理、恒康金融网络等业务单位。雷先生服务宏利逾三十载，历任美国、加拿大、国际及企业业务部多项管理要职，曾驻多伦多、沃特卢、波士顿、英格兰等地，现常驻香港。雷先生于战略规划、保险及年金产品管理、销售、市场推广等领域均饶富经验。现任宏利金融亚洲区高级行政副总裁兼总经理、宏利国际控股有限公司总裁兼首席行政总监及宏利资产管理(香港)有限公司主席。

杜汶高先生，董事。毕业于美国卡内基美隆大学，持有数学及管理科学理学士学位，现为宏利资产管理(亚洲)总裁兼亚洲区主管及宏利资产管理(香港)有限公司董事，掌握亚洲及日本的投资事务，专责管理宏利于区内不断壮大的资产，并确保公司的投资业务符合监管规定。出任现职前，杜先生掌管宏利于亚洲区(香港除外)的投资事务。2001年至2004年，负责波士顿领导机构息差产品的开发工作。杜先生于2001年加入宏利，之前任职于一家环球评级机构，曾获派驻纽约、伦敦及悉尼担任杠杆融资及资产担保证券等不同部门的主管，拥有二十三年的资本市场经验。

汪丁丁先生，独立董事，毕业于北京师范学院数学系，中国科学院数学力学部理学硕士学位，1990年获夏威夷大学经济学博士学位。1984年至1998年先后担任中国科学院系统科学研究所助理研究员、美国东西方中心人口研究所访问学者、博士后研究员、香港大学经济与金融学院助理教授、德国杜伊斯堡大学经济系客座教授、北京大学中国经济研究中心副教授及美国夏威夷大学经济系访问教授。目前担任北京大学及浙江大学教授，自2007年至今，担任东北财经大学“社会与行为”跨学科教育中心学术委员会主席兼主任。

周小明先生，独立董事。毕业于浙江大学法学院，中国政法大学法学硕士学位、民商法学博士学位。1990年起先后任职于浙江大学、中国人民银行非银行金融机构监管司、君泽君律师事务所、安信信托投资股份有限公司。曾担任全国人大常委会财经委员会《信托法》、《证券投资基金法》起草小组成员、安信信托投资股份有限公司总裁。目前担任中国人民大学信托与基金研究所所长、君泽君律师事务所合伙人、清华大学法学院联合法律硕士导师、中国信托业协会培训与资格办公室副主任、《中国信托业发展报告》主编。

孔晓艳女士，独立董事，毕业于中山大学法律系，法学学士和法学硕士学位，一级律师。1993年至1997年任天津市对外经济律师事务所专职律师。1997年至1999年任香港Livasari&Co. 律师行中国法律顾问。1999年至2004年任嘉德律师事务所专职律师、高级合伙人。2004年至今任嘉德恒时律师事务所专职律师、高级合伙人。兼全国第九届妇女代表、天津市第十一届、第十二届政协委员、天津市财政局和税务局特邀监察员、天津市津滨发展股份有限公司独立董事、天津律协金融业务委员会主任、中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、天津仲裁委员会仲裁员、天津第五届、第六届律协常务理事。

范小云女士，独立董事，毕业于南开大学金融学系，经济学博士学位。毕业于南开大学金融学系，经济学博士学位。1997年至2005年历任南开大学金融学系讲师、副教授。2005年起任南开大学金融学系教授、副主任、国际金融研究中心主任。2001年至2005年担任《南开经济研究》副主编。目前为教育部哲学社会科学重大攻关项目首席专家，南开大学金融学系教授、副主任、国际金融研究中心主任；兼任中国金融学会理事、中国国际金融学会理事。

2、监事会成员

邢吉海先生，监事。毕业于天津干部管理学院财会专业，会计师。1995年至1997年任天津泰达国际酒店集团副总经理兼财务总监。1997年至2000年任职于天津经济开发区财政局。2000年至2001年任天津开发区总公司财务中心主任。2001年起任天津泰达投资

控股有限公司监事、财务中心主任。兼任天津市泰达国际控股（集团）有限公司董事、渤海财产保险股份有限公司董事、天津泰达股份有限公司董事、天津津滨发展股份有限公司董事、天津滨海能源发展股份有限公司监事会主席等职。

李卓杰先生，监事。毕业于香港浸会大学，获得会计荣誉学位，美国 CPA。1993 年在香港加入宏利金融，从 1994 年起负责中国业务拓展。1999-2001 年间，李卓杰被任命为宏利金融越南公司副总经理，负责公司的保险管理与信息科技。2004-2006 年，担任中宏人寿保险有限公司北京分公司总经理一职。2005 年，同时被任命为中宏保险副总经理。李卓杰负责宏利金融在中国大陆及台湾地区的业务拓展。除了在这些地区制定执行公司战略决策外，他还负责跟进国家政策，促进与政府及合作伙伴间的关系。目前，李卓杰担任宏利环球管理顾问股份有限公司监察人（自 2010 年 7 月起）及正在筹建的安本智库保险经纪人股份有限公司董事长（自 2011 年 3 月起）一职。

王泉先生，监事。管理学学士，经济学硕士。2002 年 3 月至今在泰达宏利基金管理公司工作，历任基金运营部基金会计、基金运营部副总经理、基金运营部总经理。

3、总经理及其他高级管理人员

缪钧伟先生，总经理。毕业于复旦大学和香港城市大学，获得理学学士、经济学硕士和金融学博士学位；1998 年 10 月至 2003 年 2 月任证监会基金部副处长；2003 年 3 月至 2006 年 8 月任海富通基金管理有限公司副总经理。2007 年 2 月起任泰达宏利基金管理有限公司总经理。

刘青山先生，副总经理兼投资总监。毕业于中国人民大学，获史学学士和管理学硕士。1997 年就职于华夏证券基金部，参与筹建华夏基金管理公司，从事投资研究工作。2001 年起参与筹建湘财合丰基金管理有限公司（泰达宏利基金管理有限公司前身）并工作至今，期间历任研究部负责人、基金经理、投资副总监，投资总监兼总经理助理。2006 年 11 月起任泰达宏利基金管理有限公司副总经理兼投资总监。

傅国庆先生，副总经理。毕业于南开大学和美国罗斯福大学，获文学学士和工商管理硕士学位。1993 年至 2006 年就职于北方国际信托股份有限公司，从事信托业务管理工作，期间曾任办公室主任、研发部经理、信托业务总部总经理、董事会秘书，以及公司副总经理。2006 年 9 月起任泰达宏利基金管理有限公司财务总监。

张萍女士，督察长。毕业于中国人民大学和中国科学院，管理学和理学双硕士。先后任职于中信公司、毕马威国际会计师事务所等公司，从事财务管理和管理咨询工作。2002

年起在嘉实基金管理有限公司工作，任监察稽核部副总监。2005年10月起任泰达宏利基金管理有限公司风险管理部总监。2006年11月起任泰达宏利基金管理有限公司督察长。

4、基金经理

刘青山先生，1997年毕业于中国人民大学，获管理学硕士学位，同年加入华夏证券基金管理部，参与华夏基金管理有限公司的筹建，先后在研究部和投资管理部从事行业研究及投资管理工作，并分别担任业务经理和高级经理。2001年加入湘财证券有限责任公司，参与筹建湘财合丰基金管理有限公司（泰达宏利基金管理有限公司前身），曾担任公司研究部总经理、投资副总监，投资总监兼总经理助理、现任公司副总经理兼投资总监。自2003年4月至2005年4月，担任泰达宏利成长类行业证券投资基金基金经理。自2004年7月至今，担任本基金经理。15年基金从业经验，具有基金从业资格。

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员包括公司总经理缪钧伟，副总经理兼投资总监及基金经理刘青山，投资部总经理兼基金经理梁辉，研究部总监兼基金经理陈少平，交易部负责人陈力。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：(010) 66594855

传真：(010) 66594942

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行于1998年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，现有员工120余人。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险基金、QFII、QDII、券商资产管理计划、信托计划、年金基金、理财产品、私募基金、资金托管等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务，托管资产规模居同业前列。

（三）证券投资基金托管情况

截至2012年12月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选LOF、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳

健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证 100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证 100ETF 联接、万家 180 指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票 (LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票 (LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证 180 金融交易型开放式指数、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选 30 股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证 200 指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业 (TMT) 50 交易型开放式指数、招商深证 TMT50 交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面 120 交易型开放式指数、上证 180 成长交易型开放式指数、华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证 300 指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证 380 指数增强型、泰达宏利中证 500 指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证 300 指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证 500 指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺

长城优信增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、信诚双盈分级债券型、嘉实沪深 300 交易型开放式指数、民生加银信用双利债券型、工银瑞信基本面量化策略股票型、信诚周期轮动股票型、富兰克林国海研究精选股票型、诺安汇鑫保本混合型、平安大华策略先锋混合型、华宝兴业中证短融 50 指数债券型、180 等权重交易型开放式指数、华安双月鑫短期理财债券型、大成景恒保本混合型、景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接、上投摩根分红添利债券型、嘉实优化红利股票型、长盛同鑫二号保本混合型、招商信用增强债券型、华宝兴业资源优选股票型、中证 500 沪市交易型开放式指数、大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接、博时医疗保健行业股票型、诺德深证 300 指数分级、华夏安康信用优选债券型、汇添富多元收益债券型、广发双债添利债券型、长盛添利 30 天理财债券型、信诚理财 7 日盈债券型、长盛添利 60 天理财债券型发起式、平安大华添利债券型、大成理财 21 天债券型发起式、华泰柏瑞稳健收益债券型、信诚添金分级债券型、国泰现金管理货币市场、国投瑞银纯债债券型、银华中证中票 50 指数债券型、华安信用增强债券型、长盛同丰分级债券型、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型(QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型(QDII)、信诚金砖四国积极配置(QDII)、海富通大中华精选股票型(QDII)、招商标普金砖四国指数(LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选(QDII)、大成标普 500 等权重指数(QDII)、长信标普 100 等权重指数(QDII)、博时抗通胀增强回报(QDII)、华安大中华升级股票型(QDII)、信诚全球商品主题(QDII)、上投摩根全球天然资源股票型、工银瑞信中国机会全球配置股票型(QDII)、易方达标普全球高端消费品指数增强型(QDII)、建信全球资源股票型(QDII)、恒生交易型开放式指数(QDII)、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接(QDII)、广发纳斯达克 100 指数(QDII)等 189 只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

三、相关服务机构

(一) 直销机构

泰达宏利基金管理有限公司

地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

邮编：100033

传真：010-66577666

客户服务电话：400-698-8888（免长话费）或010-66555662

联系人：于贺、崔冉

联系电话：010-66577619、010-66577617

网址：<http://www.mfcteda.com>

网上直销网址：<https://etrade.mfcteda.com/etrading/>

(二) 代销机构

1) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

客服电话：95566

银行网站：www.boc.cn

2) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址：中国北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

客服电话：95588

银行网站：www.icbc.com.cn

3) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

客服电话：95533

银行网站：www.ccb.com

4) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

客服电话：95599

银行网站：www.abchina.com

5) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

客服电话：95559

银行网址：www.bankcomm.com

6) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：傅育宁

客服电话：95555

联系人：邓炯鹏

公司网站：www.cmbchina.com

7) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

客户服务电话：95580

联系人：陈春林

传真：(010) 68858117

公司网址：www.psbc.com

8) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：(021) 61618888

传真：(021) 63604199

联系人：虞谷云

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

9) 深圳发展银行股份有限公司

注册地址：深圳深南中路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：深圳深南中路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

客户服务电话：95501

联系人：张青

传真：0755-25841098

公司网址：www.sdb.com.cn

10) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：孔丹

客服电话：95558

网址：<http://bank.ecitic.com>

11) 东莞银行股份有限公司

注册地址：东莞市运河东一路 193 号

办公地址：东莞市运河东一路 193 号

法定代表人：廖玉林

电话：0769—22119061

传真：0769—22117730

联系人：叶德森

客服电话：4001196228

公司网址：www.dongguanbank.cn

12) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：范一飞

开放式基金咨询电话：021-962888

开放式基金业务传真：021-68476111

网址：www.bankofshanghai.com

13) 渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号

办公地址：天津市河西区马场道 201-205 号

法定代表人：刘宝凤

电话：022-58316666

传真：022-58316259

联系人：王宏

客户服务热线：400 888 8811

公司网站：www.cbhb.com.cn

14) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

电话：0574-89068340

传真：0574-87050024

联系人：胡技勋

客户服务热线：96528（上海地区 962528）

公司网站：www.nbcb.com.cn

15) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

16) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

客户服务电话：95526

公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

17) 天津银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区友谊路 15 号

办公地址：天津市河西区友谊路 15 号

法定代表人：王金龙

电话：022-28405330

传真：022-28405631

联系人：杨森

客户服务热线：4006-960296

公司网站：www.bank-of-tianjin.com

18) 温州银行股份有限公司

注册地址：温州市车站大道 196 号

办公地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

电话：0577-88990082

传真：0577-88995217

联系人：林波

客户服务热线：浙江省 96699，上海 962699，其他地区（0577）96699

公司网站：www.wzbank.cn

19) 湘财证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 A 栋 11 层

法定代表人：林俊波

客服电话：400-888-1551

传真：021- 68865680
联系人：钟康莺
联系电话：021-68634518
公司网站：www.xcsc.com

20) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室
办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号
法定代表人：杜庆平
联系人：王兆权
电话：022-28451861
传真：022-28451892
电子邮箱：wangzq@bhq.com
客户服务电话：4006515988
网址：www.bhq.com

21) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
法定代表人：陈有安
客服电话：4008-888-888
电话：010-66568430
联系人：田薇
公司网站：www.chinastock.com.cn

22) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）
办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、41、42、43、44 楼
法定代表人：孙树明

客服电话：95575 或致电各地营业网点

联系人：黄岚

公司网站： www.gf.com.cn

23) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

客服电话：4008888108

传真：010—65182261

公司网站： www.csc108.com

24) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

客服电话：4008888666

联系人：吴倩

公司网站： www.gtja.com

25) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

全国免费业务咨询电话：95511-8

传真：0755-82400862

网址： www.PINGAN.com

26) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

客服电话：95503

联系人：吴宇

公司网站：www.dfzq.com.cn

27) 世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：卢长才

联系人：方文

客服电话：0755-83199511

公司网站：www.csc.com.cn

28) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

联系人：李清怡

联系电话：021-54033888

客服电话：95523 或 400-889-5523

网址：www.sywg.com

29) 齐鲁证券有限公司

注册地址：济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

30) 中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 40 层

法定代表人：许刚

客服电话：4006208888

传真：021-50372474

联系人：李丹

公司网站：www.bocichina.com

31) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

客户服务电话：025-95597

传真：025-84579763

联系人：孙菁菁

公司网站：www.htsc.com.cn

32) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨、李芳芳

客户服务电话：4008888788 10108998

传真：021-22169134

公司网址：www.ebscn.com

33) 新时代证券有限责任公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：刘汝军

联系人：孙恺

客户服务电话：4006989898

公司网址：www.xsdzq.cn

34) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

联系电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

客户服务电话：95565，4008888111

公司网址：www.newone.com.cn

35) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：李春芳

传真：0755-83515567

客户服务电话：0755-33680000 400 6666 888

公司网址：www.cgws.com

36) 南京证券有限责任公司

注册地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

办公地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

法定代表人：张华东

联系人：徐翔

联系电话：025-83367888

客户服务电话：400 828 5888

公司网址：www.njzq.com.cn

37) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

联系电话：021-38565785

客户服务电话：4008888123

公司网址：www.xyzq.com.cn

38) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

客服电话：95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

联系人：金芸、李笑鸣

联系电话：021-23219000

公司网站：www.htsec.com

39) 广州证券有限责任公司

注册地址：广州市越秀区先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19 楼

法定代表人：刘东

客服电话：020-961303

联系电话：020-88836999

传真：020-88836654

联系人：林洁茹

网址：www.gzs.com.cn

40) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

客服电话：96326（福建省外请先拨 0591）

传真：0591-87383610

联系人：张腾

公司网站：www.hfzq.com.cn

41) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

联系人：齐晓燕

联系电话：0755-82130833

公司网站：www.guosen.com.cn

42) 金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 楼

法定代表人：陆涛

客户服务电话：4008-888-228

传真：0755-83025625

联系人：马贤清

网站：www.jyzq.cn

43) 德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建大厦 26 楼

法定代表人：姚文平

客服电话：4008888128

传真：021-68767032

联系人：罗芳

公司网站：www.tebon.com.cn

44) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

客服电话：4008001001

联系人：陈剑虹

联系电话：0755-82825551

网址：www.essence.com.cn

45) 东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

法定代表人：朱科敏

联系人：梁旭

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

公司网络地址：www.longone.com.cn

客服电话：400-888-8588

46) 国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层（100007）

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层（100007）

法定代表人：常喆

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

47) 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼（410005）

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼（410005）

法定代表人：周晖

联系人：郭磊

联系电话：0731-84403319

开放式基金业务传真：0731-84403439

网址：www.cfzq.com

48) 宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号宏源证券

法人：冯戎

联系人：李巍

联系电话：010-88085858

客服电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

49) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

长江证券客户服务网站：www.95579.com

50) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

公司地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

客户服务热线：95571

网址：www.foundersc.com

51) 民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

法定代表人：余政

公司网址：www.msyzq.com

客服热线：4006198888

52) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

公司网址：www.gjq.com.cn

客服电话：4006 600109

53) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座

办公地址：北京市金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

客服电话：010-66045678

联系人：林爽

天相投顾网-网址：www.txsec.com

天相基金网-网址：www.txjijin.com

54) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

公司网址：www.citics.com

客服热线：95558

55) 西藏同信证券有限责任公司

注册地址：西藏自治区拉萨市北京中路 101 号

办公地址：上海市永和路 118 弄 24 号楼

法定代表人：贾绍君

公司网址：www.xzsec.com

客服热线：40088-11177

56) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人：吴永良

公司网址：www.zszq.com

客服热线：4001022011

57) 中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：张智河

公司网址：www.zxwt.com.cn

客服热线：96577

58) 中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦 19 层

法定代表人：沈强

公司网址：www.bigsun.com.cn

客服热线：0571-96598

59) 红塔证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

办公地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人：况雨林

公司网址：www.hongtastock.com

客服热线：0871-3577942

60) 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

公司网址：www.zlfund.cn；www.jjmmw.com

客服热线：4006-788-887

61) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 8 楼

法定代表人：汪静波

公司网址：www.noah-fund.com

客服热线：400-821-5399

（三）注册登记机构

泰达宏利基金管理有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

法定代表人：刘惠文

联系人：王泉

电话：010-66577768

传真：010-66577750

（四）律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：(021) 51150298

传真：(021) 51150398

经办律师：梁丽金、刘佳

（五）会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：汪棣、单峰

四、基金的名称

泰达宏利行业精选证券投资基金

五、基金的类型

本基金的类型： 契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金的投资目标：追求资本的长期持续增值，为投资者寻求高于业绩比较基准的投资回报。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券，以及法律、法规、规章或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票投资比例为基金资产净值的 60%—95%，债券投资比例为基金资产净值的 0%—35%，现金及现金等价物投资比例为基金资产净值的 5%—30%。

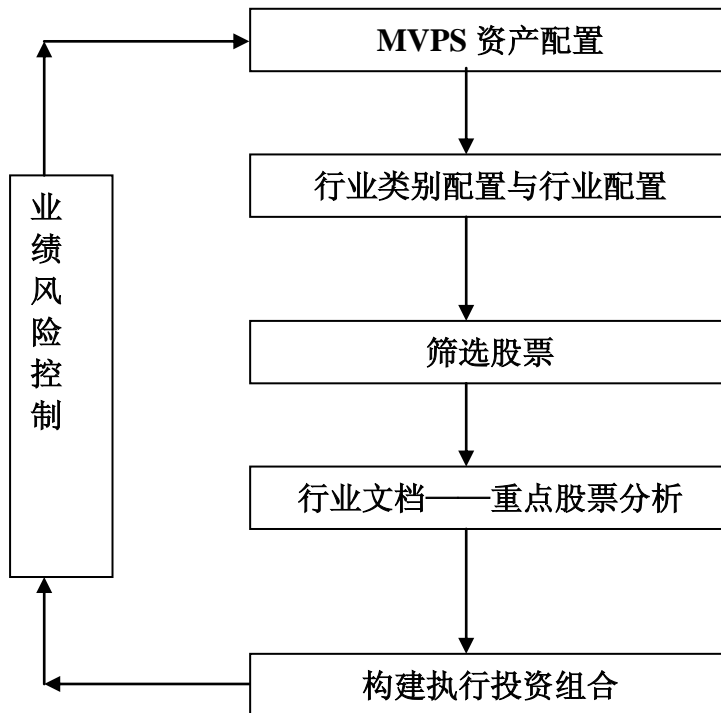
八、基金的投资策略

全面引进荷兰银行的投资管理流程，采用“自上而下”资产配置和行业类别与行业配置，“自下而上”精选股票的投资策略，主要投资于具有国际和国内竞争力比较优势和长期增值潜力的行业和企业的股票。

资产配置和行业类别与行业配置，主要采用“自上而下”的投资策略：（1）投资决策委员会根据 MVPS 模型，结合宏观和行业分析，确定投资组合资产配置比例；（2）根据行业特点和市场状况，确定行业类别与行业配置比例。

精选个股主要采用“自下而上”的投资策略包括：（1）以流动性指标筛选股票。（2）对筛选后的股票进行定量分析和评分筛选。（3）以定性的股票评级系统全面考察公司股票的未来发展。

本基金股票投资流程如下图所示：



1、投资决策委员会根据 MVPS 模型，确定投资组合资产配置比例

MVPS 模型——通过四个层面研究确定基金资产配置比例

➤ M—宏观经济环境（Macro Environment）

研究分析的主要指标包括：

-
- ✓ 季度 GDP 的增长速度
 - ✓ 每月 CPI 的数据
 - ✓ 每月工业增加值的增长速度
 - ✓ 货币供应量 M2 的增长
 - V-价值 (Valuation)
研究分析的主要指标包括：
 - ✓ P/B、P/E 运行模型
 - ✓ 公司治理结构
 - P-政策 (Policy)
 - ✓ 国家宏观经济政策和监管政策对证券市场下一阶段的发展具有的重要影响作用。
 - S-气氛 (Sentiment)
研究分析的主要指标包括：
 - ✓ 保证金
 - ✓ 分析师指数
 - ✓ 基金仓位
 - ✓ 市场的特殊效应

2、利用 SRS 模型进行行业分析和行业类别与行业配置

根据行业特点和市场状况，确定行业类别与行业配置比例

- 根据波特理论，通过以下分析，确定行业相对投资价值和行业在投资组合中的配置比例范围。
 - ✓ 对全球、地区、国内行业发展趋势和发展环境进行分析，判断行业或产品的增长前景（全球观念下，行业景气趋势分析）
 - ✓ 宏观经济周期对行业发展的影响（宏观分析）
 - ✓ 优势行业的发展模式分析（评价商业模式）
 - ✓ 与最佳行业的比较分析（测量竞争优势）
 - ✓ 该行业财务状况分析（财务稳健性分析）
- 根据行业(P/E)指标和资金流指标，对行业类别与行业配置比例进行调整

在调整行业配置比例时，应综合考虑行业(P/E)指标和资金流指标，对资金流指标的临

界数值应根据市场变化进行相应调整。

3、利用市值指标作为流动性指标，对股票进行筛选，建立待投资股票库：

首先对股票市值按大小进行排序，挑选出符合基金投资规模和流动性需要的股票，作为模型的基础股票池。

4、对待投资股票库的股票利用 QSE 模型，对股票投资价值和股票预期收益增长性进行定量分析与评分筛选。

5、利用商业评估、公司评估、价值评估和盈利预测，在基础股票库中寻找价格合理、基本面良好的上市公司：

(1) 将上市公司作为一个商业组合，根据上市公司所在行业包括的业务类别，从商业性质、上市公司管理水平、竞争优势、上市公司发展前景、市场份额、营业利润率、财务能力等方面对基础股票库中的股票进行评级。将影响上市公司的因素概括为商业因素、公司因素、财务因素，结合上述评级，确定上市公司商业因素、公司因素、财务因素的分值和上市公司的综合评分。

(2) 利用财务定价模型对企业的长期盈利状况进行预测，依靠多种价值参数，选择自身投资价值被市场低估、与同类公司相比定价较低、对比市场以往历史数据定价有合理上涨空间的上市公司。结合盈利预测和价值评估对上市公司进行打分。

(3) 按照本基金认为合理的权重，对商业评估和公司评估、盈利预测与价值评估进行综合评分，按分值大小，选择股票基础库中最好的上市公司。

6、基于“自上而下”进行的资产配置和行业类别与行业配置，“自下而上”选择的股票，结合自身的研究分析，基金经理构建、执行投资组合。

7、风险控制小组运用引进荷兰银行的风险控制模型，对基金投资组合的风险进行定期跟踪、监控、评估和风险构成的度量预测分析。监察稽核部负责对基金投资过程进行定期监督。

8、基金经理将跟踪证券市场和上市公司的发展变化，结合基金申购和赎回导致的现金流量变化情况，以及对基金投资组合风险和流动性的评估结果，对投资组合进行动态调整。

债券投资方面，基金管理人将依据市场利率的预期变化或不同债券收益曲线的变化，利用利率期限结构差异，权衡到期收益率与市场流动性，选择适宜的债券，构建和调整债券组合，在追求投资收益的同时兼顾债券资产的流动性和安全性。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准=70%×富时中国 A600 指数收益率+30%×中债国债总指数（财富）

十、基金的风险收益特征

基金的投资目标和投资范围决定了基金属于风险较高的证券投资基金。

十一、基金的投资组合报告（未经审计）

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。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于 2013 年 1 月 31 日复核了本投资组合报告的内容。

本投资组合报告所载数据截止 2012 年 12 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

2、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	3,403,825,215.48	87.78
	其中：股票	3,403,825,215.48	87.78
2	固定收益投资	121,932,000.00	3.14
	其中：债券	121,932,000.00	3.14
	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	326,898,966.32	8.43
6	其他资产	25,053,358.98	0.65
7	合计	3,877,709,540.78	100.00

3、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	125,037,506.56	3.32
B	采掘业	-	-

C	制造业	1,587,135,766.88	42.11
C0	食品、饮料	229,922,000.00	6.10
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	126,387,796.29	3.35
C5	电子	487,718,088.12	12.94
C6	金属、非金属	74,898,427.10	1.99
C7	机械、设备、仪表	467,634,455.37	12.41
C8	医药、生物制品	200,575,000.00	5.32
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	120,558,000.00	3.20
E	建筑业	275,801,344.25	7.32
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	135,987,091.83	3.61
I	金融、保险业	398,850,832.04	10.58
J	房地产业	457,528,828.56	12.14
K	社会服务业	302,925,845.36	8.04
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	3,403,825,215.48	90.31

4、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	600519	贵州茅台	1,100,000	229,922,000.00	6.10
2	600138	中青旅	11,021,118	175,456,198.56	4.65
3	000024	招商地产	5,787,343	172,983,682.27	4.59
4	002415	海康威视	5,500,000	171,105,000.00	4.54
5	601628	中国人寿	7,499,668	160,492,895.20	4.26
6	601601	中国太保	6,568,017	147,780,382.50	3.92
7	600535	天士力	2,500,000	138,175,000.00	3.67
8	002081	金螳螂	3,000,000	132,060,000.00	3.50
9	000998	隆平高科	6,105,347	125,037,506.56	3.32
10	000883	湖北能源	21,300,000	120,558,000.00	3.20

5、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	22,077,000.00	0.59
2	央行票据	49,935,000.00	1.32

3	金融债券	49,920,000.00	1.32
	其中：政策性金融债	49,920,000.00	1.32
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	121,932,000.00	3.23

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	1001060	10 央票 60	500,000	49,935,000.00	1.32
2	120245	12 国开 45	500,000	49,920,000.00	1.32
3	010308	03 国债(8)	220,000	22,077,000.00	0.59

注：以上为本基金本报告期末持有的全部债券。

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
报告期末本基金未持有资产支持证券。

8、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
报告期末本基金未持有权证。

9、投资组合报告附注

(1) 报告期内本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(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。

10、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,776,280.88
2	应收证券清算款	19,889,398.35
3	应收股利	-
4	应收利息	1,039,185.50
5	应收申购款	348,494.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,053,358.98

11、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本报告期末本基金未持有债券。

12、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	000883	湖北能源	120,558,000.00	3.20	非公开发行

13、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。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为 2004 年 7 月 9 日，截止 2012 年 12 月 31 日，基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

阶段	净值增长率 ③	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
2004. 7. 9~ 2004. 12. 31	-1.12%	0.62%	-7.38%	0.84%	6.26%	-0.22%
2005. 1. 1~ 2005. 12. 31	5.70%	1.04%	-5.69%	0.96%	11.39%	0.08%
2006. 1. 1~ 2006. 12. 31	159.88%	1.49%	77.44%	0.99%	82.44%	0.50%
2007. 1. 1~ 2007. 12. 31	119.06%	2.13%	96.39%	1.62%	22.67%	0.51%
2008. 1. 1~ 2008. 12. 31	-48.44%	2.02%	-48.28%	2.07%	-0.16%	-0.05%
2009. 1. 1~ 2009. 12. 31	71.09%	1.80%	62.24%	1.44%	8.85%	0.36%
2010. 1. 1~ 2010. 12. 31	12.73%	1.43%	-3.91%	1.09%	16.64%	0.34%
2011. 1. 1~ 2011. 12. 31	-23.99%	1.16%	-18.12%	0.91%	-5.87%	0.25%
2012. 1. 1~ 2012. 12. 31	2.12%	1.12%	5.61%	0.91%	-3.49%	0.21%
基金合同生效以来 至 2012. 12. 31	359.31%	1.55%	112.19%	1.31%	247.12%	0.24%

十三、基金的费用与税收

(一) 基金运作费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金证券交易费用；
- 4、基金的信息披露费用；
- 5、基金的会计师费和律师费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、按照国家有关规定可以列支的其它费用。

(二) 基金运作费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理费按基金前一日资产净值的 1.5% 的年费率计提，具体计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H：为每日应计提的基金管理费；

E：为前一日基金资产净值。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人按照基金管理人划款指令于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

基金的基金托管费按基金前一日资产净值的 0.25% 的年费率计提，具体计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H：为每日应计提的基金托管费；

E：为前一日基金资产净值。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月的前 2 个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

3、上述（一）3 至 7 项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用，由基金托管人按照基金管理人的划款指令复核后从本基金资产中支付。基金合同生效前的验资费(会计师费)、律师费从基金认购费用中列支，招募说明书、发售公告等信息披露费用根据有关法律及中国证监会有关规定列支。

4、经基金管理人与基金托管人协商一致，可以酌情调低基金管理费率及基金托管费率，并报中国证监会核准后公告，无须召开基金持有人大会通过。

（三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或本基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金资产中列支。

（四）申购、赎回的费用

1、申购费

申购费率如下：

申购金额 (M)	费率
M<50万	1.50%
50万≤M <250万	1.20%
250万≤M <500万	0.75%
500万≤M <1000万	0.50%
M≥1000万	每笔1000元

2、赎回费

赎回费率如下：

连续持有期限（日历日）	适用的赎回费率
1天—365天	0.5%
366天（含）—730天	0.25%
731天（含）以上	0

说明：①认购期持有期限起始日为基金合同生效日；申购期持有期限起始日为基金申购的注册登记日。持有期限的截止日为基金赎回的注册登记日。

②投资人对本基金连续持有期限超过 365 天，赎回费率为 0.25%；连续持有期限超过 730 天，赎回费率为零。期间如进行基金转换，持有期限可以累计。

③赎回费的 25%划归基金资产。

（五）基金税收

本基金及基金持有人应依据国家有关规定依法纳税。

十四、对招募说明书更新部分的说明

依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

1、“重要提示”部分对更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期进行了更新。

2、“四、基金托管人”部分对基金托管人基本情况、主要人员情况、基金托管业务经营情况等内容进行了更新。

3、“五、相关服务机构”部分对代销机构信息进行了更新。

4、“七、基金的投资”部分对投资组合报告内容更新至2012年12月31日。

5、“八、基金的业绩”部分对基金业绩更新至2012年12月31日，并更新了历史走势对比图。

6、“二十、其他应披露事项”部分对报告期内应披露的本基金相关事项进行了更新。

泰达宏利基金管理有限公司

2013年2月22日