

---

# 泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

## 招募说明书摘要（更新）

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

泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金募集申请已于 2010 年 2 月 8 日获中国证监会证监许可『2010』176 号文核准，本基金的基金合同于 2010 年 4 月 23 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，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资人赎回时，所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，等等。

本摘要根据本基金的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》、基金合同及其它有关规定享有权利、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。

---

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资人在认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2011 年 10 月 23 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 09 月 30 日。财务数据未经审计。

## 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：010-66577725

联系人：孙运英

注册资本：一亿八千万元人民币

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%

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月，是中国首批合资基金管理公司之一。目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选基金、泰达宏利风险预算混合型基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型基金、泰达宏利首选企业股票型基金、泰达宏利市值优选股票型基金、泰达宏利集利债券型基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型基金、泰达宏利红利先锋股票型基金、泰达宏利中证财富大盘指数型基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金、泰达宏利全球新格局证券投资基金在内的十六只证券投资基金。

---

## （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，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。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 月加入泰达荷银基金管理有限公司（现泰达宏利基金管理有限公司）工作至今，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 月起任泰达荷银基金管理有限公司（现泰达宏利基金管理有限公司）总经理。

刘青山先生，副总经理。毕业于中国人民大学，获史学学士和管理学硕士学位。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 月起任泰达荷银基金管理有限公司（现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 月起任泰达荷银基金管理有限公司（现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月起任泰达荷银基金管理有限公司（现泰达宏利基金管理有限公司）风险管理部总监。2006年11月起任泰达荷银基金管理有限公司（现泰达宏利基金管理有限公司）督察长。

#### 4、基金经理

王咏辉先生，毕业于英国牛津大学工程和计算机专业，硕士学历；1998年9月至2001年7月就职于伦敦摩根大通（JP Morgan）投资基金管理公司任分析员、高级分析师；2001年7月至2002年3月就职于伦敦汇丰（HSBC）投资基金管理公司任高级分析师；2002年3月至2004年1月就职于伦敦巴克莱国际投资基金管理公司任ETF亚洲部门经理；2004年2月至2008年3月就职于巴克莱资本(Barclays Capital)担任部门经理；2008年4月加入泰达荷银基金管理有限公司（现泰达宏利基金管理有限公司），现担任国际投资部副总经理；2011年7月20日起担任泰达宏利全球新格局证券投资基金基金经理。王咏辉先生具备13年基金从业经验，13年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

#### 5、投资决策委员会成员名单

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

变更注册登记日期：2004年8月26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

发展概况：

1912 年 2 月，经孙中山先生批准，中国银行正式成立。从 1912 年至 1949 年，中国银行先后履行中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能，坚持以服务社会民众、振兴民族金融为己任，稳健经营，锐意进取，各项业务取得了长足发展。新中国成立后，中国银行长期作为国家外汇专业银行，成为我国对外开放的重要窗口和对外筹资的主要渠道。1994 年，中国银行改为国有独资商业银行。2003 年，中国银行启动股份制改造。2004 年 8 月，中国银行股份有限公司挂牌成立。2006 年 6 月、7 月，先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市，成为国内首家在境内外资本市场上发行上市的商业银行。

中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行，在中国内地、香港澳门台湾及 31 个国家和地区为客户提供全面的金融服务，主要经营商业银行业务，包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务，并通过全资子公司中银国际开展投资银行业务，通过全资子公司中银集团保险及中银保险经营保险业务，通过全资子公司中银集团投资从事直接投资和投资管理业务，通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务，通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。

在近百年的发展历程中，中国银行始终秉承追求卓越的精神、稳健经营的理念、客户至上的宗旨、诚信为本的传统和严谨细致的作风，得到了业界和客户的广泛认可和赞誉，树立了卓越的品牌形象。2010 年度，中国银行被 Global Finance（《环球金融》）评为 2010 年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇交易银行，被 Euromoney（《欧洲货币》）评为 2010 年度房地产业“中国最佳商



---

业银行”，被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖，被 The Asset（《财资》）评为中国最佳贸易融资银行，被 Finance Asia（《金融亚洲》）评为中国最佳私人银行、中国最佳贸易融资银行，被《21 世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇，中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展，向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

## （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，下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队，现有员工 110 余人，其中，90%以上的员工具备本科以上学历。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、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII 资产、QDII 资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金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。2010 年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元，居同业前列。

## （三）证券投资基金托管情况

截至 2011 年 9 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、大成优选封闭、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、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)、工银瑞信中国机会全球配置股票型(QDII)等128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) 基金份额发售机构

##### 1、直销机构

##### 1) 泰达宏利基金管理有限公司直销中心

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

联系人:延慧、崔冉

联系电话:010-66577619、010-66577617

客服信箱:[irm@mfcteda.com](mailto:irm@mfcteda.com)

客服电话:400-698-8888

传真:010-66577760/61

公司网站:<http://www.mfcteda.com>

##### 2) 泰达宏利基金网上直销系统

交易系统网址:<https://etrade.mfcteda.com/etrading/>

目前,本基金的网上开户、交易功能可以通过以下途径实现:持有农业银行卡、建设银行卡、兴业银行卡、浦发银行卡、中信银行卡、光大银行卡、招商银行卡、民生银行卡、交通银行卡、汇付天下“天天盈”帐户的客户,可通过基金管理人的网站(<http://www.mfcteda.com>)网上基金直销交易系统开户与交易。

客户服务电话:400-698-8888 或 010-66555662

客户服务信箱:[irm@mfcteda.com](mailto:irm@mfcteda.com)

---

## 2、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：张建国（代行）

客服电话：95533

银行网站：www.ccb.com

### 3) 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：项俊波

客服电话：95599

银行网站：www.abchina.com

### 4) 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

---

**5) 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

**6) 中国邮政储蓄银行有限责任公司**

住所、办公地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

法定代表人：刘安东

联系人：陈春林

传真：（010）66415194

客服电话：95580

网址：www.psbc.com

**7) 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：倪苏云、虞谷云

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

**8) 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

#### 9) 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：巫渝峰

客服电话：0769—96228 或拨打各营业网点咨询电话

公司网址：www.dongguanbank.cn

#### 10) 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

#### 11) 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.nbc.com.cn](http://www.nbc.com.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：宁黎明

开放式基金咨询电话：021-962888

开放式基金业务传真：021-68476111

联系人：张萍

联系电话：021-68475888

网址：[www.bankofshanghai.com](http://www.bankofshanghai.com)

## 13) 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

电话：010—85238667

联系人：郑鹏

客户服务电话：95577

网址：[www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

## 14) 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

联系人：王曦

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

公司网站：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

#### 15) 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](http://www.xcsc.com)

#### 16) 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](mailto:wangzq@bhq.com)

客户服务电话：4006515988

网址：[www.bhq.com](http://www.bhq.com)



---

### 17) 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：顾伟国

客服电话：4008-888-888

电话：010-66568430

联系人：田薇

公司网站：www.chinastock.com.cn

### 18) 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 和 42 楼

法定代表人：林治海

客服电话：95575 或致电各地营业网点

传真：020-87555305

联系人：黄岚

公司网站：www.gf.com.cn

### 19) 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

---

## 20) 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：芮敏祺

公司网站：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

## 21) 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](http://www.PINGAN.com)

## 22) 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](http://www.dfzq.com.cn)

## 23) 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

**24) 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 4008895523  
网址：www.sywg.com

**25) 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

**26) 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：唐新宇  
客服电话：4006208888  
传真：021-50372474  
联系人：张静  
公司网站：www.bocichina.com

---

**27) 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

**28) 东北证券股份有限公司**

注册地址：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

联系人：潘锴

电话：0431-85096709

客户服务电话：4006000686

网址：www.nesc.cn

**29) 华泰联合证券有限责任公司**

注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A

办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层

法定代表人：马昭明

联系人：盛宗凌

联系电话：0755-82492000

客户服务电话：95513

传真：0755-82492962

---

公司网址: [www.lhzq.com](http://www.lhzq.com)

### 30) 光大证券股份有限公司

注册地址: 上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址: 上海市静安区新闸路 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](http://www.ebscn.com)

### 31) 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](http://www.newone.com.cn)

### 32) 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](http://www.cgws.com)

---

### 33) 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

### 34) 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

### 35) 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

---

### 36) 广州证券有限责任公司

注册地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼

办公地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼

法定代表人：刘东

客服电话：020-961303

联系电话：020-87322668

传真：020-87325036

联系人：林洁茹

网址：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

### 37) 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](http://www.hfzq.com.cn)

### 38) 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](http://www.guosen.com.cn)

---

### 39) 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

### 40) 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

### 41) 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：深圳市福田区深南大道 2008 号凤凰大厦 1 栋 9 层  
法人代表人：牛冠兴  
开放式基金咨询电话：4008001001  
联系人：陈剑虹  
联系电话：0755-82558305  
网址：www.essence.com.cn



---

#### 42) 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：李涛

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

公司网络地址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

免费服务热线：400-888-8588

#### 43) 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](http://www.guodu.com)

#### 44) 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：0731-4403319

开放式基金业务传真：0731-4403439

网址：[www.cfzq.com](http://www.cfzq.com)

---

#### 45) 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

#### 46) 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

#### 47) 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

#### 48) 民生证券有限责任公司

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 16-20 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 16-20 层

---

法定代表人：岳献春  
公司网址：www.msza.com  
客服热线：4006198888

**49) 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.gjzq.com.cn  
客服热线：4006 600109

**50) 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

**51) 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

**52) 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

(二) 注册登记机构

名称：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

联系电话：010-66577768

传真：010-66577750

(三) 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：廖海

(四) 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：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：单峰

经办注册会计师：曹银华、单峰

---

## 四、基金名称

泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

## 五、基金类型

契约型开放式

## 六、基金的投资目标

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%。

## 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、货币市场工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票组合的比例不低于基金资产的 90%，投资组合中投资于中证财富大盘指数成份股的资产不低于股票资产的 90%，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的相关规定。

## 八、基金的投资策略

本基金采用指数完全复制方法，原则上按照标的指数成份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够数量的股票时，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。

### 1、标的指数

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择，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。

### 2、投资组合的构建

本基金原则上采用指数完全复制方法构建基金的股票投资组合，即根据个股在标的指数中相应的权重构建基金的指数化股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。

### 3、组合的调整

#### （1）定期调整

根据标的指数的调整规则和对备选股的预期，对股票投资组合及时进行调整。

#### （2）不定期调整

①当成份股实施增发、配送或使股本发生变动等行为时，基金将根据指数公司的指数修正公告对投资组合进行相应调整。

②当成份股发生重大变化时（收购合并、分拆、退市等），基金将根据指数公司的临时调整公告对投资组合进行相应调整。

③根据本基金的申购赎回情况，对基金的股票投资组合进行调整，以实现对标的指数的有效跟踪。

---

④因成份股流动性不足、停牌等市场因素影响或法律法规及基金合同限制，基金无法购得相应足够数量的股票时，基金将搭配使用其他合理方法对相应股票进行合理替代并对投资组合进行相应调整。

⑤在其他影响本基金复制并跟踪标的指数的情况下，本基金管理人可根据市场情况，在以跟踪误差最小化的前提下，对基金的投资组合进行合理调整。

#### 4、股票的替代

在建仓阶段和基金后续运作过程中，如遇到特殊情况（如市场流动性不足、成份股被限制投资等）导致基金无法购得足够数量的股票时，基金管理人将根据市场情况以跟踪误差最小化为原则，行业、规模、历史表现相似度为标准，采用合理的方法进行适当调整和替代。

#### 5、金融衍生品投资策略

本基金以最小化跟踪误差及风险可控为原则，在法律法规及监管机构允许范围内，采用市场公认的定价技术，适度参与金融衍生品的投资，以实现以下目标：

- ① 对冲某些成分股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险；
- ② 适当利用金融衍生产品组合的持有收益覆盖一定的基金固定费用；
- ③ 利用金融衍生产品的杠杆作用，减少现金及债券对跟踪指数的拖累；

#### 6、跟踪误差的监控与管理

跟踪误差的管理将作为本基金主要的风险控制手段之一，基金经理及风险控制部门将每日跟踪投资组合与标的指数投资回报率之间的偏离度。月末、季末定期对基金投资组合与标的指数收益率间的累积偏离程度进行归因分析，并对控制跟踪误差提出解决方案。

## 九、基金的业绩比较基准

业绩比较基准： $95\% \times$  中证财富大盘指数收益率  $+5\% \times$  同业存款利率。

如果基金所跟踪的目标指数被中证指数有限公司停止发布、或由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人在履行

适当程序后，可以变更基金的跟踪目标和投资对象，并在变更前提前 2 个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。

## 十、基金的风险收益特征

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。

## 十一、基金投资组合报告（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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 11 月 16 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。

本投资组合报告所载数据截止 2011 年 9 月 30 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              | 503,358,454.55 | 94.39        |
|    | 其中：股票             | 503,358,454.55 | 94.39        |
| 2  | 固定收益投资            | 413,018.40     | 0.08         |
|    | 其中：债券             | 413,018.40     | 0.08         |
|    | 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      | 29,174,148.69  | 5.47         |
| 6  | 其他资产              | 357,687.58     | 0.07         |
| 7  | 合计                | 533,303,309.22 | 100.00       |

### 3、报告期末按行业分类的股票投资组合



### 3.1、指数投资部分

| 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            | 48,814,214.56  | 9.17         |
| C   | 制造业            | 125,824,534.43 | 23.65        |
| C0  | 食品、饮料          | 12,721,578.76  | 2.39         |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | 3,831,907.09   | 0.72         |
| C2  | 木材、家具          | 386,904.76     | 0.07         |
| C3  | 造纸、印刷          | 2,265,834.76   | 0.43         |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 6,648,538.71   | 1.25         |
| C5  | 电子             | 3,558,677.02   | 0.67         |
| C6  | 金属、非金属         | 36,900,638.30  | 6.93         |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 48,411,877.80  | 9.10         |
| C8  | 医药、生物制品        | 10,243,296.59  | 1.93         |
| C99 | 其他制造业          | 855,280.64     | 0.16         |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 18,009,193.85  | 3.38         |
| E   | 建筑业            | 17,033,109.59  | 3.20         |
| F   | 交通运输、仓储业       | 26,950,967.74  | 5.06         |
| G   | 信息技术业          | 15,915,643.54  | 2.99         |
| H   | 批发和零售贸易        | 11,825,664.09  | 2.22         |
| I   | 金融、保险业         | 186,421,941.10 | 35.03        |
| J   | 房地产业           | 32,932,650.70  | 6.19         |
| K   | 社会服务业          | 3,888,161.08   | 0.73         |
| L   | 传播与文化产业        | 486,819.72     | 0.09         |
| M   | 综合类            | 6,659,730.19   | 1.25         |
|     | 合计             | 494,762,630.59 | 92.98        |

### 3.2、积极投资部分

| 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 | 264,389.00   | 0.05         |
| B  | 采掘业      | 480,451.00   | 0.09         |
| C  | 制造业      | 6,117,594.76 | 1.15         |
| C0 | 食品、饮料    | 95,200.00    | 0.02         |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | -            | -            |
| C2 | 木材、家具    | -            | -            |
| C3 | 造纸、印刷    | 28,527.00    | 0.01         |

|     |                |              |      |
|-----|----------------|--------------|------|
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 2,258,650.70 | 0.42 |
| C5  | 电子             | 631,229.00   | 0.12 |
| C6  | 金属、非金属         | 733,433.00   | 0.14 |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 1,259,369.00 | 0.24 |
| C8  | 医药、生物制品        | 1,111,186.06 | 0.21 |
| C99 | 其他制造业          | -            | -    |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | -            | -    |
| E   | 建筑业            | 176,040.00   | 0.03 |
| F   | 交通运输、仓储业       | 364,190.00   | 0.07 |
| G   | 信息技术业          | 551,956.96   | 0.10 |
| H   | 批发和零售贸易        | 379,082.99   | 0.07 |
| I   | 金融、保险业         | -            | -    |
| J   | 房地产业           | -            | -    |
| K   | 社会服务业          | 262,119.25   | 0.05 |
| L   | 传播与文化产业        | -            | -    |
| M   | 综合类            | -            | -    |
|     | 合计             | 8,595,823.96 | 1.62 |

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

4.1、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  | 600016 | 民生银行 | 4,168,520 | 23,010,230.40 | 4.32         |
| 2  | 601328 | 交通银行 | 4,726,807 | 21,176,095.36 | 3.98         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 1,805,315 | 19,966,783.90 | 3.75         |
| 4  | 601166 | 兴业银行 | 1,499,017 | 18,572,820.63 | 3.49         |
| 5  | 600000 | 浦发银行 | 1,977,294 | 16,886,090.76 | 3.17         |
| 6  | 600030 | 中信证券 | 1,019,679 | 11,471,388.75 | 2.16         |
| 7  | 600050 | 中国联通 | 2,129,539 | 10,903,239.68 | 2.05         |
| 8  | 601398 | 工商银行 | 2,683,749 | 10,681,321.02 | 2.01         |
| 9  | 000002 | 万科A  | 1,352,669 | 9,793,323.56  | 1.84         |
| 10 | 601088 | 中国神华 | 365,481   | 9,261,288.54  | 1.74         |

4.2、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 | 占基金资产净 |
|----|------|------|-------|------|--------|
|----|------|------|-------|------|--------|

|   |        |      |         | (元)          | 值比例 (%) |
|---|--------|------|---------|--------------|---------|
| 1 | 000683 | 远兴能源 | 168,526 | 1,284,168.12 | 0.24    |
| 2 | 600426 | 华鲁恒升 | 71,983  | 666,562.58   | 0.13    |
| 3 | 600085 | 同仁堂  | 43,441  | 593,404.06   | 0.11    |
| 4 | 600879 | 航天电子 | 38,400  | 353,664.00   | 0.07    |
| 5 | 600812 | 华北制药 | 41,900  | 346,932.00   | 0.07    |

#### 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      | -          | -             |
| 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  | 可转债       | 413,018.40 | 0.08          |
| 7  | 其他        | -          | -             |
| 8  | 合计        | 413,018.40 | 0.08          |

#### 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  | 110018 | 国电转债 | 4,240  | 413,018.40 | 0.08          |

#### 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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9、投资组合报告附注

(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，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

(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。

(3) 其他资产

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 267,738.59 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | 63,817.70  |
| 4  | 应收利息    | 7,557.71   |
| 5  | 应收申购款   | 18,573.58  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 357,687.58 |

(4) 报告期末基金未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明。

(5.1) 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。

(5.2) 报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

(6) 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 2010 年 4 月 23 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：

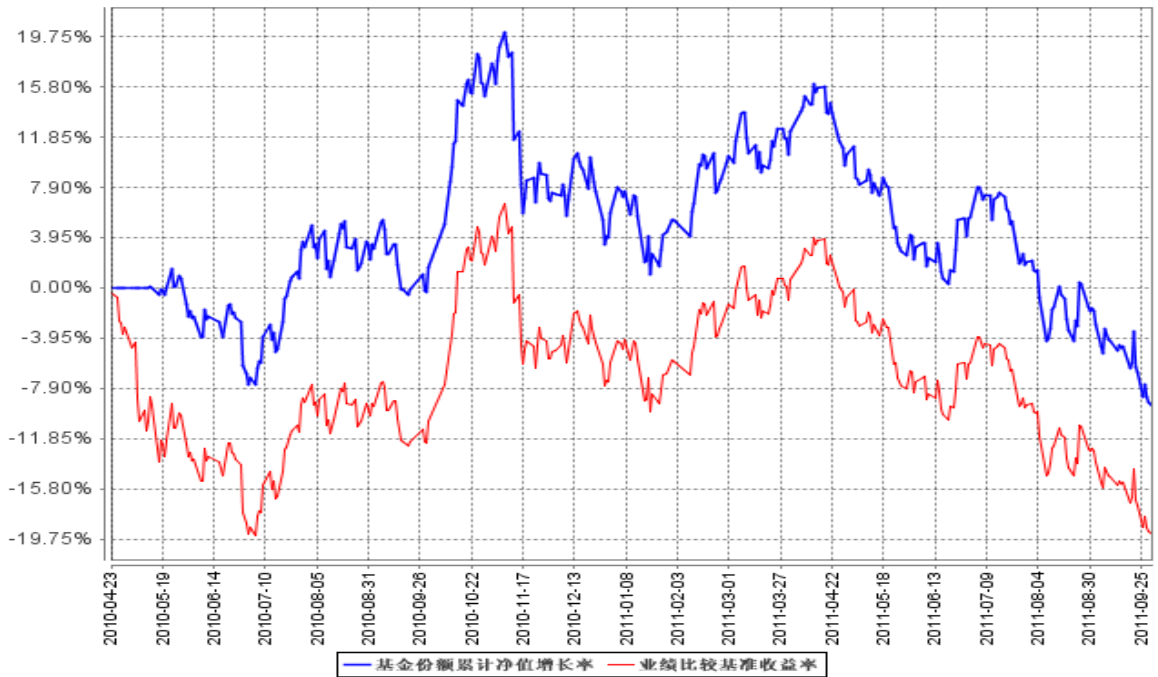
(一) 历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较

| 阶段 | 基金净值<br>收益率<br>① | 基金净值收<br>益率标准差<br>② | 比较基准<br>收益率<br>③ | 比较基准收<br>益率标准差<br>④ | ①-③ | ②-④ |
|----|------------------|---------------------|------------------|---------------------|-----|-----|
|----|------------------|---------------------|------------------|---------------------|-----|-----|

|   |         |       |         |       |        |        |
|---|---------|-------|---------|-------|--------|--------|
| 2010.4.23 至<br>2010.12.31                   | 5.91%   | 1.32% | -5.90%  | 1.55% | 11.81% | -0.23% |
| 2011.1.1 至<br>2011.9.30                     | -14.34% | 1.19% | -14.36% | 1.19% | 0.02%  | 0.00%  |
| 自基金合同生效<br>日（2010年4月<br>23日）至2011<br>年9月30日 | -9.28%  | 1.25% | -19.41% | 1.37% | 10.13% | -0.12% |

(二) 本基金自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图（2010年4月23日-2011年9月30日）

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金投资于股票组合的比例不低于基金资产的90%，投资组合中投资于中证财富大盘指数成份股的资产不低于股票资产的90%，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的相关规定。根据证券投资基金运作管理办法第三十二条的规定，基金建仓期为自合同生效之日起6个月。本基金合同于2010年4月23日生效，截至报告日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。

---

## 十三、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后的指数许可使用费；
- 4、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- 5、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 8、基金资产的资金汇划费用；
- 9、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### （三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

在通常市场情况下，基金管理费按基金前一日基金资产净值的 0.65% 的费率计提，具体计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费；

E 为前一日基金资产净值。

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

在通常市场情况下，基金托管费按基金前一日基金资产净值的 0.12% 的费率计提，具体计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

---

H 为每日应计提的基金托管费；

E 为前一日基金资产净值。

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 3、基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法每日计提指数许可使用费。其中，基金合同生效前的许可使用固定费是为获取使用指数开发基金的权利而支付的费用，不列入基金费用从基金财产中列支；基金合同生效后的指数许可使用费从基金财产中列支，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率每日计提，逐日累计。计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人与指数许可方约定了每季度（包括基金成立当季）指数许可使用费人民币伍万元（5 万元）（即不足人民币 5 万元时按照人民币 5 万元收取）的收取下限，则该下限超出当季累计指数使用费的部分（即：每季度指数许可使用费收取下限减当季累计指数许可使用费）由基金管理人自行承担，不作为基金费用从基金财产中列支。基金合同生效后的指数许可使用费按季支付，由基金管理人向基金托管人发送基金指数许可使用费划款指令，基金托管人复核后于次季前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。

4、除管理费、托管费和基金合同生效后的指数许可使用费之外的基金费用，由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

## （四）与基金销售有关的费用

### 1、基金的认购费用

---

本基金的认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式详见“基金的募集”一章。

## 2、基金的申购费用

本基金的申购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式详见“基金份额的申购与赎回”一章。

## 3、基金的赎回费用

本基金的赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式详见“基金份额的申购与赎回”一章。

### （五）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财产的损失，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。

（六）基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

### （七）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

### （一）对基金管理人部分内容的更新

对“一、基金管理人”中的联系人、董事会成员、监事会成员及基金经理信息等内容进行了更新。

### （二）对基金托管人的更新

在“二、基金托管人”部分，对基金托管人基本情况和相关业务经营情况进行了更新。

### （三）对相关服务机构的更新：

在“三、相关服务机构”部分，对代销机构、会计师事务所的部分信息进行了更新。



---

（四）在“十一、基金投资组合报告”部分，更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。

（五）更新了“十二、基金的业绩”部分的内容。

（六）对部分其他表述进行了更新。

泰达宏利基金管理有限公司

2011年12月7日