

# 泰达宏利行业精选证券投资基金 2013 年年度 报告摘要

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

送出日期：2014 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示

本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。本年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 2013 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利精选股票
基金主代码	162204
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 7 月 9 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
报告期末基金份额总额	628, 235, 943. 42 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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。
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、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。
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）
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于风险较高的基金品种

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰达宏利基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曹桢桢	唐州徽
	联系电话	010-66577728	95566
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-69-88888	95566
传真		010-66577666	010-66594942

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http:// www.mfcteda.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013 年	2012 年	2011 年
本期已实现收益	345,893,751.84	-384,828,741.55	-225,405,132.47
本期利润	523,374,988.79	77,730,638.48	-1,310,569,468.44
加权平均基金份额本期利润	0.7076	0.0724	-1.2946
本期基金份额净值增长率	20.27%	2.12%	-23.99%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	2.0037	1.5450	2.7718
期末基金资产净值	2,500,534,098.33	3,769,247,092.20	3,760,664,357.76
期末基金份额净值	3.9802	3.3093	4.0567

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基金份额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. 期末可供分配利润等于期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-3.36%	1.28%	-2.82%	0.81%	-0.54%	0.47%
过去六个月	15.40%	1.44%	4.25%	0.89%	11.15%	0.55%
过去一年	20.27%	1.43%	-3.10%	0.95%	23.37%	0.48%
过去三年	-6.65%	1.24%	-16.21%	0.92%	9.56%	0.32%
过去五年	80.06%	1.41%	30.63%	1.08%	49.43%	0.33%

自基金合同生效起至今	452.42%	1.54%	105.61%	1.27%	346.81%	0.27%
------------	---------	-------	---------	-------	---------	-------

本基金业绩比较基准： $70\% \times \text{富时中国 A600} + 30\% \times \text{中债国债总指数（财富）}$ 。富时中国 A600 指数是富时指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所总市值最大的 600 只股票并以流通股本加权的股票指数，具有良好的市场代表性。中债国债总指数（财富）是中央国债登记结算有限责任公司推出的中国国债总指数，该指数基于全市场角度编制的指数，价格选取上更侧重于全国银行间债券市场，选样广泛，全面而细致反映债券市场变动。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

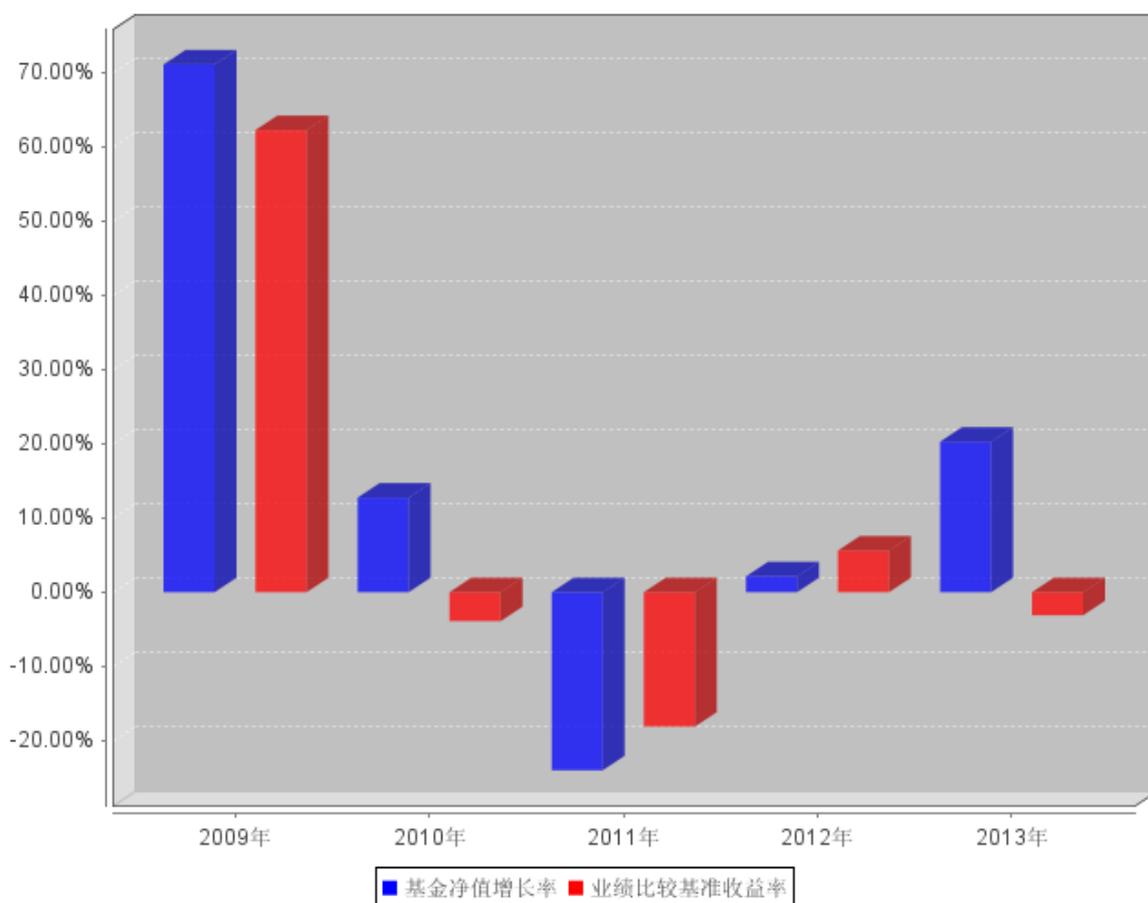
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本基金在建仓期末及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013	-	-	-	-	
2012	8.4000	1,180,409,470.74	250,040,245.33	1,430,449,716.07	
2011	0.2000	9,862,547.11	9,384,397.61	19,246,944.72	
合计	8.6000	1,190,272,017.85	259,424,642.94	1,449,696,660.79	

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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。截至报告

期末本公司股东及持股比例分别为：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%。

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基金、泰达宏利聚利分级债券型基金、泰达宏利全球新格局基金(QDII-FOF)、泰达宏利中证 500 指数分级基金、泰达宏利逆向策略股票型基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型基金、泰达宏利高票息定期开放债券型基金、泰达宏利瑞利分级债券型基金在内的二十一证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘青山	本基金基金经理，公司总经理	2004年7月9日	2013年2月21日	16	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，参与筹建泰达宏利基金管理有限公司并工作至今。16 年基金从业经验，具有基金从业资格。
梁辉	本基金基金经理， 总经理助理兼投资 总监	2013 年 2 月 21 日	-	12	毕业于清华大学，管理科学与工程专业硕士；2002 年 3 月加入湘财荷银基金管理有限公司（现泰达宏利基金管理有限公司），曾担任公司研究部行业研究员、基金经理、研究部总监、金融工程部总经理、基金投资部总经理，自 2013 年 5 月 10 日至今担任泰达宏利基金管理有限公司

					总经理助理兼投资总监；12 年基金从业经验，具有证券从业资格、基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

- 1、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。
- 2、我公司于 2013 年 2 月 23 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》，自 2013 年 2 月 21 日起，刘青山先生不再担任本基金的基金经理，梁辉先生从该日起担任本基金基金经理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、本基金合同和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，本基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人建立了公平交易制度和内部控制流程，严格执行相关制度规定。在投资管理活动中，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；在交易环节实行集中交易制度，交易部运用交易系统内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，保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，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。

基金管理人的风险管理部定期对基金管理人管理的不同投资组合的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）基金管理人管理的不同投资组合同

向交易的交易价差进行分析，并经公司管理层审核签署后存档备查。基金管理人的监察稽核部定期对公平交易制度的执行和控制工作进行稽核。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人的风险管理部事后从交易指令的公平性、同日反向交易、不同窗口下的同向交易溢价率和风格相似的基金的业绩等方面，对报告期内的公平交易执行情况进行统计分析。本报告期内，交易指令多为指令下达人管理的多只资产组合同时下发，未发现明显的非公平交易指令；基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；场外交易的交易价格与市场价格一致，场内交易的溢价率在剔除交易时间差异、交易数量悬殊、市场波动剧烈等因素后，处于正常范围之内；基金管理人管理的各投资组合的业绩由于投资策略、管理风格、业绩基准等方面的因素而有所不同。

本报告期内，本基金管理人管理的各投资组合之间未发现利益输送或不公平对待不同组合的情况。

### 4.3.3 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，风险管理部对可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，定期对各投资组合的交易行为进行整体分析评估，定期向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。如发现疑似异常交易情况，相关投资组合经理对该交易情况进行合理性解释。监察稽核部定期对公平交易制度的执行和控制工作进行稽核。

在本报告期内，本基金管理人管理的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%，没有发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为，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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金致力于在实现正收益的前提下战胜比较基准，为持有人带来超额的回报。近三年来，本基金实现了同类型基金中相对较优的成绩，总体来讲还是令人满意的。

2013 年，市场呈现了严重的两极分化，一方面代表经济主体的主板市场，指数下跌，而另一方面，代表转型经济的创业板指数出现了 80% 的涨幅。这种分化是在我国经济 2010 年见顶之后，

经济持续下滑的大背景下不断演绎形成的：（1）从 2010 年开始，我国潜在经济增长持续下降，期间虽有小的反弹，但是调整的趋势从未改变；（2）我国的杠杆率、融资结构等诸多结构性问题决定了我国的经济调整与转型必定是较为长期和渐进的过程；（3）在经济转型的过程中，会有很多新的增长点涌现，当然也会有很多增长点逐渐失速。

在这种新旧两者模式切换的过程中，投资机会之后偏重于新的方面，而会抛弃旧的方面。而在新的经济增长点上，经过三年多的发展，其行业自身发展和市场预期等因素共同构成行业的轮动，这种轮动与之前大家都了解的投资时钟有较大差异，也是需要不断摸索完善的投资领域。

本基金对长期的经济持有一个相对谨慎的看法，因而对具有较强宏观经济相关性的金融和周期板块始终维持低配，并始终维持对成长非周期性行业作为投资的主体，这些行业将会自上而下的受益于经济转型，具体包括消费、科技、医药、高端装备等。这种配置在 2013 年取得明显的超额收益。

#### 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 3.9802 元，本报告期份额净值增长率为 20.27%，同期业绩比较基准增长率为-3.10%。

#### 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，我们有如下判断：（1）成长性行业仍然是首选行业，我们认为 2014 年经济增长仍然比较低迷，通胀亦会较低，所以前述有利于成长行业的因素存在，成长行业仍然有着超额收益；（2）成长性行业的投资将会更加的短期化，或者说投机的色彩会更加浓，主要原因在于：一、2014 年成长性行业的估值普遍高于 2013 年初，在盈利增长大致稳定的假设下（事实上，相当多的行业盈利增速是降低的），其估值提升的难度加大，而盈利增长驱动的股价上升将会使得总体涨幅降低；二、自 2010 年以来，成长行业就是市场主要的投资方向，到 2014 年多数行业的估值都已经较高，市场的投机性也在加强，股价的驱动更多的依赖题材、收购、重组等，这给以精选增长行业和优质公司作为主要投资方法的本基金提出了挑战。本基金也会不断适应市场这一变化，通过动态调整来优化组合。

从行业选择方面，本基金会持续将科技、医药、环保、能源装备、消费等成长性行业作为核心配置。

另外，2014 年的宏观经济和市场环境变数也会增多，首先，美国逐步退出 QE 会对全球流动性产生负面影响；其次，中国利率高企，地方融资风险加大，不排除出现短期的信用危机；再次，

IPO 重启使得市场供给增多，会加大市场波动。这些都可能成为市场的风险点，值得我们密切关注。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的副总经理负责，成员包括督察长、投资总监、基金经理及研究部、交易部、固定收益部、监察稽核部、金融工程部、风险管理部、基金运营部的相关人员，均具有丰富的专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力。

基金经理参与估值委员会对相关停牌品种估值的讨论，发表相关意见和建议，但涉及停牌品种的基金经理不参与最终的投票表决。本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金报告期内未进行利润分配。目前无其他利润分配安排。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰达宏利行业精选证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

本基金 2013 年年度报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可阅读年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利行业精选证券投资基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	300,607,668.01	325,172,324.42
结算备付金	3,354,570.25	1,726,641.90
存出保证金	834,193.69	3,776,280.88
交易性金融资产	2,156,725,869.30	3,525,757,215.48
其中：股票投资	2,156,725,869.30	3,403,825,215.48
基金投资	-	-
债券投资	-	121,932,000.00
资产支持证券投资	-	-

衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	29,818,456.09	19,889,398.35
应收利息	62,246.80	1,039,185.50
应收股利	-	-
应收申购款	30,283,613.88	348,494.25
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,521,686,618.02	3,877,709,540.78
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2013年12月31日</b>	<b>2012年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	15,100,518.81	94,669,785.37
应付赎回款	687,948.87	1,097,765.99
应付管理人报酬	3,094,216.53	4,505,441.40
应付托管费	515,702.73	750,906.89
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,345,550.15	4,078,475.20
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	408,582.60	3,360,073.73
负债合计	21,152,519.69	108,462,448.58
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	628,235,943.42	1,138,980,055.57
未分配利润	1,872,298,154.91	2,630,267,036.63
所有者权益合计	2,500,534,098.33	3,769,247,092.20
负债和所有者权益总计	2,521,686,618.02	3,877,709,540.78

报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.9802 元，基金份额总额 628,235,943.42 份。

## 7.2 利润表

会计主体：泰达宏利行业精选证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至	上年度可比期间 2012年1月1日至
-----	------------------	-----------------------

	2013 年 12 月 31 日	2012 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	588,118,304.93	182,209,598.81
1. 利息收入	4,479,928.06	7,563,421.01
其中：存款利息收入	1,632,883.81	4,624,479.26
债券利息收入	2,593,080.23	1,113,551.62
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	253,964.02	1,825,390.13
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	404,023,836.75	-291,054,622.55
其中：股票投资收益	381,555,991.57	-320,766,229.38
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,116,439.03	-532,357.07
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	19,351,406.15	30,243,963.90
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	177,481,236.95	462,559,380.03
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	2,133,303.17	3,141,420.32
<b>减：二、费用</b>	64,743,316.14	104,478,960.33
1. 管理人报酬	40,679,403.44	56,183,479.53
2. 托管费	6,779,900.47	9,363,913.28
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	16,821,041.89	38,402,242.95
5. 利息支出	9,312.66	70,108.63
其中：卖出回购金融资产支出	9,312.66	70,108.63
6. 其他费用	453,657.68	459,215.94
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	523,374,988.79	77,730,638.48
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	523,374,988.79	77,730,638.48

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利行业精选证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,138,980,055.57	2,630,267,036.63	3,769,247,092.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	523,374,988.79	523,374,988.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-510,744,112.15	-1,281,343,870.51	-1,792,087,982.66
其中：1. 基金申购款	333,181,912.58	872,332,622.65	1,205,514,535.23
2. 基金赎回款	-843,926,024.73	-2,153,676,493.16	-2,997,602,517.89
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	628,235,943.42	1,872,298,154.91	2,500,534,098.33
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	927,025,081.67	2,833,639,276.09	3,760,664,357.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	77,730,638.48	77,730,638.48
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	211,954,973.90	1,149,346,838.13	1,361,301,812.03
其中：1. 基金申购款	1,026,575,325.61	3,108,066,880.29	4,134,642,205.90
2. 基金赎回款	-814,620,351.71	-1,958,720,042.16	-2,773,340,393.87
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-1,430,449,716.07	-1,430,449,716.07
五、期末所有者权益（基金净值）	1,138,980,055.57	2,630,267,036.63	3,769,247,092.20

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

刘青山  
基金管理人负责人

傅国庆  
主管会计工作负责人

王泉  
会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

泰达宏利行业精选证券投资基金(以下简称“本基金”，原湘财荷银行业精选证券投资基金，后更名为泰达荷银行业精选证券投资基金)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2004]第 58 号《关于同意湘财荷银行业精选证券投资基金设立的批复》核准，由基金发起人湘财荷银基金管理有限公司(于 2006 年 4 月 27 日更名为泰达荷银基金管理有限公司，于 2010 年 3 月 9 日更名为泰达宏利基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《湘财荷银行业精选证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,016,372,878.75 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2004)第 108 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《湘财荷银行业精选证券投资基金基金合同》于 2004 年 7 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,017,034,173.30 份基金份额，其中认购资金利息折合 661,294.55 份基金份额。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

经中国证监会同意，本基金于 2006 年 6 月 6 日更名为泰达荷银行业精选证券投资基金。根据本基金的基金管理人 2010 年 3 月 17 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于变更旗下公募基金名称的公告》，本基金自公告发布之日起更名为泰达宏利行业精选证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利行业精选证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票、债券，以及法律法规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%。在相关法规允许的前提下，股票投资范围最高可以达到基金资产净值的 100%。本基金的业绩比较基准为：富时中国 A600 指数收益率×70%+中债国债总指数(财富)×30%。

本财务报表由本基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司于 2014 年 3 月 27 日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下

合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利行业精选证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2013 年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无会计政策变更、会计估计变更或重大会计差错。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起, 对基金从上市公司取得的股息红利所得, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统

一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
北方国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
宏利资产管理(香港)有限公司	基金管理人的股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行股票交易。

##### 7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券交易。

##### 7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券回购交易。

##### 7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行权证交易。

##### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	40,679,403.44	56,183,479.53
其中：支付销售机构的客户维护费	3,674,144.40	3,678,783.55

支付基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数。}$$

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,779,900.47	9,363,913.28

支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数。}$$

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期						
2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
上年度可比期间						
2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	99,000,000.00	57,307.40

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	300,607,668.01	1,507,379.35	325,172,324.42	4,354,803.98

本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601377	兴业证券	2013 年 5 月 10 日	2014 年 5 月 12 日	非公开发行流通受限	9.88	9.46	1,500,000	14,820,000.00	14,190,000.00	-
300058	蓝色光标	2013 年 9 月 16 日	2014 年 9 月 18 日	非公开发行流通受限	42.00	44.80	316,157	13,278,594.00	14,163,833.60	-

基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000625	长安汽车	2013 年 12 月 31 日	重大事项	11.45	2014 年 1 月 3 日	11.72	1,882,516	23,723,105.22	21,554,808.20	-

		日							
--	--	---	--	--	--	--	--	--	--

本基金截至 2013 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场正回购余额。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,156,725,869.30	85.53
	其中：股票	2,156,725,869.30	85.53
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	303,962,238.26	12.05
6	其他各项资产	60,998,510.46	2.42
7	合计	2,521,686,618.02	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	57,388,679.46	2.30
B	采矿业	-	-

C	制造业	1,541,660,721.99	61.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,402,013.64	1.02
E	建筑业	48,300,082.88	1.93
F	批发和零售业	17,529,100.00	0.70
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	351,932,915.95	14.07
J	金融业	14,190,000.00	0.57
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	36,431,980.20	1.46
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	63,890,375.18	2.56
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	-	-
	合计	2,156,725,869.30	86.25

### 8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002065	东华软件	7,312,374	247,158,241.20	9.88
2	002415	海康威视	9,140,653	210,052,205.94	8.40
3	002241	歌尔声学	4,706,971	165,120,542.68	6.60
4	002353	杰瑞股份	1,793,944	142,385,335.28	5.69
5	002236	大华股份	2,998,485	122,578,066.80	4.90
6	002570	贝因美	3,831,831	117,637,211.70	4.70
7	002450	康得新	4,596,782	111,701,802.60	4.47
8	600887	伊利股份	2,258,841	88,275,506.28	3.53

9	002358	森源电气	3,810,454	81,924,761.00	3.28
10	300020	银江股份	3,159,724	78,993,100.00	3.16

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600585	海螺水泥	329,022,505.08	8.73
2	601166	兴业银行	324,728,234.38	8.62
3	600060	海信电器	166,123,591.84	4.41
4	002294	信立泰	163,716,910.08	4.34
5	600887	伊利股份	150,246,441.76	3.99
6	002065	东华软件	147,377,863.64	3.91
7	002241	歌尔声学	147,062,684.56	3.90
8	002450	康得新	136,663,544.59	3.63
9	002570	贝因美	133,186,941.09	3.53
10	002353	杰瑞股份	115,876,209.36	3.07
11	600521	华海药业	95,512,013.12	2.53
12	000001	平安银行	88,587,091.63	2.35
13	300026	红日药业	84,971,465.85	2.25
14	002358	森源电气	81,641,558.91	2.17
15	000527	美的电器	81,343,427.68	2.16
16	000418	小天鹅 A	75,398,777.44	2.00
17	600809	山西汾酒	74,042,695.59	1.96
18	002653	海思科	73,046,649.95	1.94
19	000333	美的集团	72,182,922.24	1.92
20	300020	银江股份	69,587,486.28	1.85

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601166	兴业银行	301,647,122.01	8.00
2	600585	海螺水泥	239,938,070.89	6.37
3	600519	贵州茅台	203,423,381.15	5.40
4	600138	中青旅	176,774,192.11	4.69
5	002294	信立泰	176,563,184.96	4.68
6	600060	海信电器	164,068,095.81	4.35
7	000024	招商地产	161,320,421.04	4.28
8	601628	中国人寿	153,062,712.74	4.06
9	600031	三一重工	146,905,166.05	3.90
10	000998	隆平高科	143,596,872.95	3.81
11	601601	中国太保	141,361,319.86	3.75
12	600535	天士力	140,616,281.63	3.73
13	002475	立讯精密	132,293,730.55	3.51
14	600315	上海家化	127,306,557.08	3.38
15	600521	华海药业	122,753,857.30	3.26
16	002081	金螳螂	117,579,580.74	3.12
17	600048	保利地产	114,316,695.43	3.03
18	600312	平高电气	114,315,022.74	3.03
19	600887	伊利股份	113,200,299.55	3.00
20	000001	平安银行	103,304,058.93	2.74
21	300005	探路者	102,625,343.82	2.72
22	000651	格力电器	101,086,014.03	2.68
23	600557	康缘药业	98,261,327.62	2.61
24	000883	湖北能源	96,124,232.18	2.55
25	601318	中国平安	95,944,738.74	2.55
26	000888	峨眉山A	93,262,838.06	2.47
27	600166	福田汽车	90,758,770.89	2.41
28	002635	安洁科技	85,009,105.43	2.26
29	000671	阳光城	83,602,882.17	2.22
30	000418	小天鹅A	81,932,886.87	2.17
31	002482	广田股份	81,861,284.14	2.17

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,429,022,219.01
卖出股票收入（成交）总额	6,235,155,948.21

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 8.5 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。

## 8.6 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。

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.9.1 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。

### 8.9.2 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。

### 8.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1

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。

### 8.11.2

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。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	834,193.69
2	应收证券清算款	29,818,456.09
3	应收股利	-
4	应收利息	62,246.80
5	应收申购款	30,283,613.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	60,998,510.46

### 8.11.4 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。

### 8.11.5 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未存在流通受限的情况。

### 8.11.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
55,434	11,333.04	251,400,865.76	40.02%	376,835,077.66	59.98%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	294,893.38	0.0469%

- 1、本基金本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量在 10 万份至 50 万份之间；
- 2、本基金本报告期末，本基金的基金经理持有本基金份额总量在 0 万份至 10 万份之间，本基金的基金经理同时也是基金投资部门负责人。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004 年 7 月 9 日）基金份额总额	2,017,034,173.30
本报告期期初基金份额总额	1,138,980,055.57
本报告期基金总申购份额	333,181,912.58
减：本报告期基金总赎回份额	843,926,024.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	628,235,943.42

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2013 年 3 月 20 日，本基金管理人发布公告，聘任刘青山先生担任公司总经理，原公司总经理缪钧伟先生由于任期届满离职。上述变更事项，由泰达宏利基金管理有限公司第三届董事会第四十二次会议审议通过，已经中国证券监督管理委员会许可 [2013] 258 号文核准批复。

2、2013 年 7 月 13 日，本基金管理人发布公告，选举公司董事何达德 (Michael Huddart) 先生担任公司副董事长，施德林 (Marc Sterling) 先生因退休不再担任公司副董事长职务。上述事项经泰达宏利基金管理有限公司第三十九次股东会暨 2013 年度第二次股东会以及第三届董事会第五十次会议审议通过，并已向中国证券监督管理委员会北京监管局备案。

3、报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

(1) 2013 年 3 月 17 日中国银行股份有限公司公告，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。

(2) 2013 年 6 月 1 日中国银行股份有限公司公告，自 2013 年 5 月 31 日起，田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本年度无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管人、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本年度本基金无投资策略的变化。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用为 10.8 万元，该审计机构对本基金已提供审计服务的年限为 10 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人、本基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中银国际	2	1,803,503,869.70	17.20%	1,617,193.14	17.04%	-
兴业证券	1	1,604,151,362.83	15.30%	1,451,700.99	15.30%	-
广发证券	2	1,155,483,419.89	11.02%	1,051,951.69	11.08%	-
中信证券	2	919,278,546.07	8.77%	830,614.84	8.75%	-
中信建投	2	886,765,047.26	8.46%	805,778.94	8.49%	-
东方证券	2	648,968,844.78	6.19%	582,639.12	6.14%	-
银河证券	2	647,689,568.22	6.18%	589,655.26	6.21%	-
西南证券	1	604,378,114.66	5.76%	550,226.27	5.80%	-
中航证券	1	432,863,075.91	4.13%	394,078.30	4.15%	-
齐鲁证券	1	391,598,783.50	3.73%	356,513.07	3.76%	-
光大证券	1	361,856,296.97	3.45%	329,433.22	3.47%	-
安信证券	1	314,493,996.02	3.00%	286,315.69	3.02%	-
财达证券	1	269,993,627.40	2.58%	245,797.11	2.59%	-
国金证券	1	210,320,696.63	2.01%	191,476.69	2.02%	-
东北证券	1	157,394,327.07	1.50%	139,278.38	1.47%	-
江海证券	1	76,102,955.33	0.73%	67,343.63	0.71%	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

渤海证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-

(一) 2013 年本基金撤销财富证券交易席位。

(二) 交易席位选择的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的的标准是：

- (1) 经营规范，有较完备的内控制度；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要
- (3) 能为基金管理人提供高质量的研究咨询服务。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中银国际	-	-	-	-	-	-
兴业证券	15,015,357.63	100.00%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-

泰达宏利基金管理有限公司  
2014 年 3 月 27 日