

# 泰达宏利市值优选股票型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2014 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司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。

基金托管人中国建设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有限公司（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	泰达宏利市值优选股票
基金主代码	162209
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 8 月 3 日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,905,741,422.15 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金兼顾大盘股和中小盘股，把握不同市值的股票在不同市场环境下的投资机会，投资于其中的优质股票，力争获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金将使用成功运用的MVPS模型来进行资产配置调整。MVPS模型主要考虑M（宏观经济环境）、V（价值）、P（政策）、S（市场气氛）四方面因素。MVPS模型作为本基金管理人持续一致的资产配置工具，通过定量和定性分析的有效结合判断未来市场的发展趋势，为本基金的资产配置提供支持。</p> <p>本基金股票资产比例最高可以达到95%，最低保持在60%以上，债券资产比例最高可以达到35%，最低为0%，并保持现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，以保持基金资产流动性的要求。</p>
业绩比较基准	75%×沪深 300 指数收益率+25%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金属于高风险、高收益的基金产品，预期收益和风险高于混合型、债券型和货币市场基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曹桢桢	田青
	联系电话	010-66577728	010-67595096
	电子邮箱	irm@mfteda.com	tianqingl.zh@ccb.com

客户服务电话	400-69-88888	010-67595096
传真	010-66577666	010-66275853

## 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	722,932,035.02	-296,392,351.61	-306,029,857.17
本期利润	1,045,441,971.72	582,515,990.58	-1,720,733,385.71
加权平均基金份额本期利润	0.1386	0.0725	-0.2094
本期基金份额净值增长率	18.28%	11.33%	-24.72%
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	-0.2502	-0.3479	-0.3637
期末基金资产净值	5,786,232,957.78	5,644,452,794.66	5,181,497,715.31
期末基金份额净值	0.8379	0.7084	0.6363

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

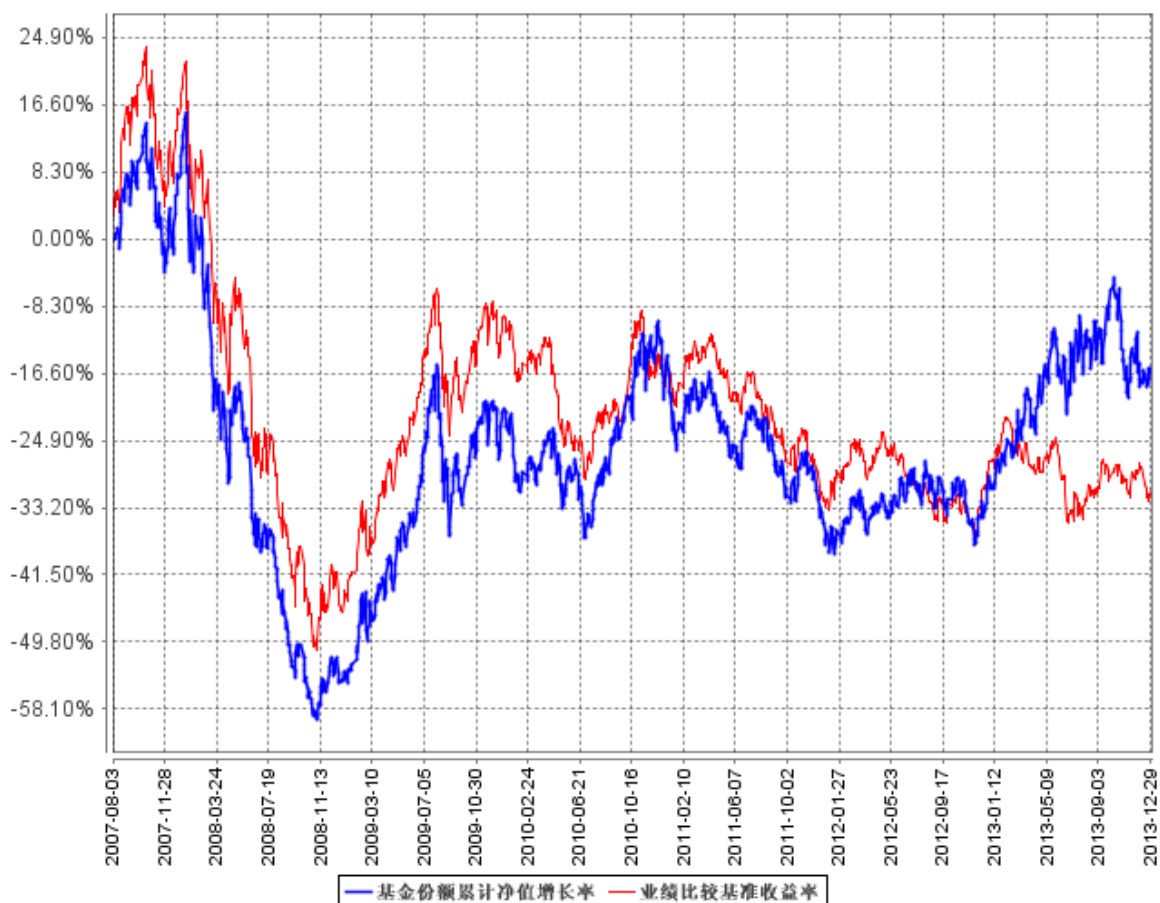
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-10.43%	1.51%	-2.25%	0.84%	-8.18%	0.67%
过去六个月	3.62%	1.65%	4.85%	0.97%	-1.23%	0.68%
过去一年	18.28%	1.61%	-4.73%	1.04%	23.01%	0.57%
过去三年	-0.88%	1.33%	-16.80%	0.99%	15.92%	0.34%

过去五年	84.93%	1.50%	28.30%	1.16%	56.63%	0.34%
自基金合同生效起至今	-16.21%	1.61%	-30.90%	1.42%	14.69%	0.19%

本基金的业绩比较基准： $75\% \times$  沪深 300 指数收益率  $+25\% \times$  上证国债指数收益率。沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，该指数的指数样本覆盖了沪深两地市场八成左右的市值，具有良好的市场代表性。上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成，具有良好的市场代表性。

### 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

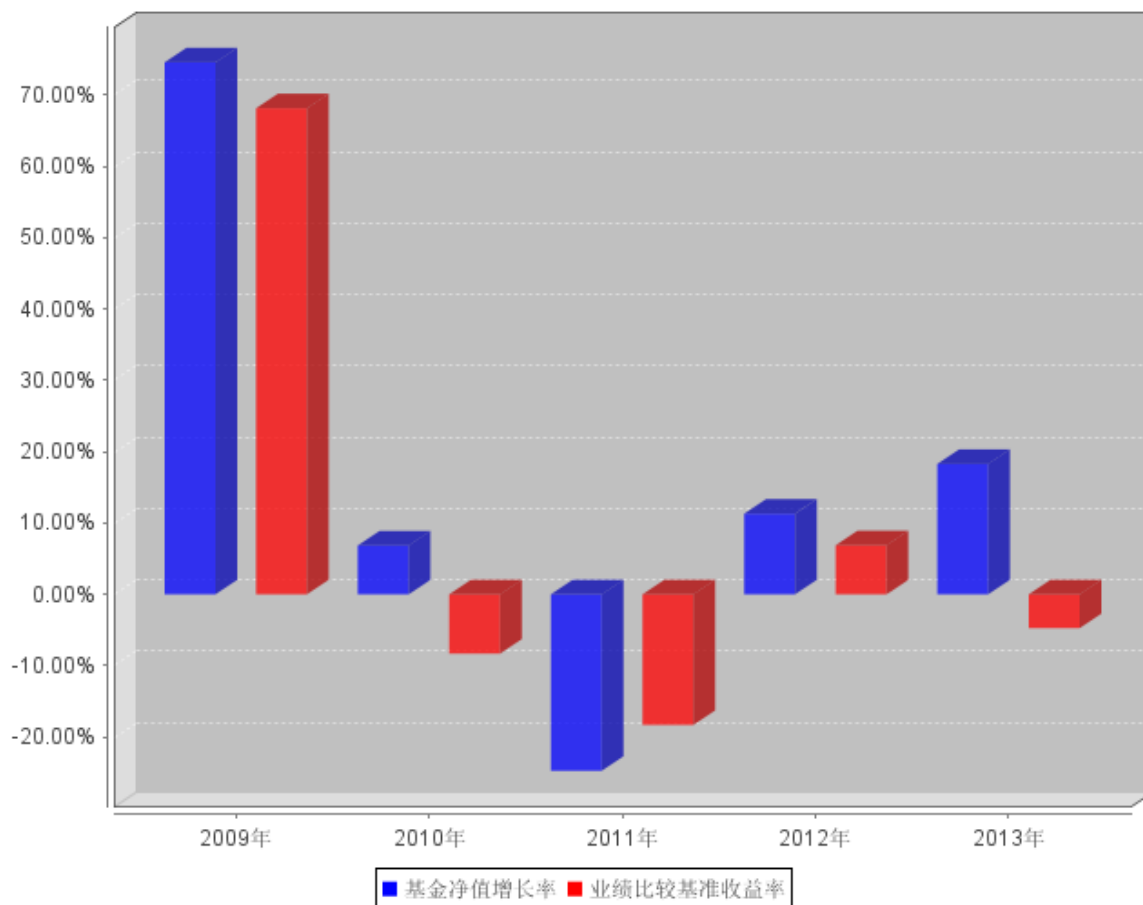
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



本基金合同生效日为 2007 年 8 月 3 日，2007 年度净值增长率的计算期间为 2007 年 8 月 3 日至 2007 年 12 月 31 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金近三年未进行利润分配。目前无其他收益分配安排。

## § 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 指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金在内的二十一只证券投资基金。

#### 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		
吴俊峰	本基金基金经理	2009 年 8 月 25 日	-	9	硕士。2005 年 5 月至 2005 年 8 月期间就职于国信证券经济研究所，任研究员。2005 年 8 月加盟泰达宏利基金管理有限公司，先后担任研究员、研究主管等职务。9 年基金从业经验，具有基金从业资格。

#### 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 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。监察稽核部定期对异常



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

2013 年 A 股市场延续了 2012 年以来的结构化行情，而且分化程度远甚于 2012 年。如果说 2012 年四季度市场还在期望经济触底反弹，由此引发一波银行股上涨，那么 2013 年连这种预期都不存在了，往年的年底经常出现的所谓风格转换基本消失，投资者的兴趣几乎全部集中于成长股。而这种市场兴趣点的高度集中，造就了以创业板为代表的成长股的一波大幅上涨，只要和新经济能搭上边，甚至还在计划和新经济搭上边的股票都受到热捧，投资者在 2013 年做的唯一一件事就是，抛掉手中的“旧经济”股票，买入“新经济”股票，这就是为何以往常用的盈利分析、估值分析在 2013 年都基本失效，而讲商业模式、讲市场空间、讲理想成为判断买入一只股票与否的关键，这样的状况和上个世纪末本世纪初美国纳斯达克市场发生的情况似乎很类似，而结局也并不难判断，唯一需要判断的就是时间点。

当然我们也欣喜地看到，许多传统行业也出现了不少业绩持续提升的公司，在经历了数年经济增速的放缓，这些公司通过内部效率的提高，不断扩大市场份额，体现出了较强的抵御系统性风险的能力，虽然并不能成为市场的焦点，但全年下来也获得了不错的回报，如格力电器、长城汽车、森源电气等，这类公司由于股价的上涨主要靠业绩推动，估值泡沫并不严重，甚至没有泡沫，作为稳健回报品种仍将是我们的投资重点。

如果说 2012 年市场对改革只是个朦胧预期的话，2013 年十八届三中全会已经确定了未来 10 年的改革方向，即继续推进市场化，打破垄断，提升经济运行效率，GDP 增长已不再是地方政府政绩考核的核心，可以预期的就是，中国经济将从投资驱动型，逐渐转向消费和创新驱动型，在这样的大背景下寻找符合这一趋势的行业和公司，将大幅提升投资成功的概率，在经历了 2013 年成长股估值的大幅提升之后，可能需要较为冷静地对这些公司的估值和成长空间进行更准确的评估。

本基金在 2013 年延续了 2012 年以来集中于成长股投资的策略，主要仓位集中于电子、医药、消费、软件、传媒等行业，上半年净值表现较好，下半年由于对更加激进的行业和公司参与较少，因此表现一般，本基金在操作过程中风险偏好偏低，对估值过高的股票较为谨慎，2014 年仍将持续这一风格。

#### 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 0.8379 元，本报告期份额净值增长率为 18.28%，同期业绩比较基准增长率为-4.73%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场对中国经济增长趋势性放缓已经没有大的分歧，而投资活动的放缓实际上也将逐渐缓解产能过剩和债务负担进一步增加带来的压力，从这一点上看 GDP 增速放缓未必不是一件好事。央行维持较高的利率水平，也是想抑制全社会杠杆率的进一步上升，但以什么方式去杠杆，是不确定的，如果出现局部的信用风险事件，对 A 股市场的打击将是巨大的。

因此本基金认为 2014 年 A 股市场的机会还是主要存在于成长股中，但总体回报将低于 2013 年，在经历了估值大幅提升之后，除非业绩增长能跟上，否则估值进一步扩张的空间已经不大，精选业绩增长确定的个股是投资能否成功的关键。

本基金将坚持投资业绩增长稳健且估值合理的成长股，对估值过高且业绩无法兑现的公司保持谨慎态度，另外对可能出现的风险事件保持警惕，应该说 2014 年 A 股市场的挑战要大于 2013 年，因此在风险可控的情况下，获取较好的投资回报，是本基金 2014 年的工作重点。

#### 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

根据本基金合同及本基金实际运作的情况，本基金于本报告期内未进行利润分配，目前无其他收益分配安排。

## § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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有限公司（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：泰达宏利市值优选股票型证券投资基金

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	232,295,371.51	373,955,037.53
结算备付金	7,018,999.73	5,945,344.71
存出保证金	1,695,274.46	3,472,861.91
交易性金融资产	5,598,132,050.42	5,205,257,873.81
其中：股票投资	5,438,488,050.42	5,205,257,873.81
基金投资	-	-

债券投资	159,644,000.00	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	70,800,626.20
应收证券清算款	-	10,932,922.92
应收利息	4,360,980.62	167,232.74
应收股利	-	-
应收申购款	176,300.33	56,871.27
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,843,678,977.07	5,670,588,771.09
<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	41,112,491.93	9,519,066.68
应付赎回款	2,836,520.62	1,619,862.83
应付管理人报酬	7,389,310.02	6,693,466.37
应付托管费	1,231,551.69	1,115,577.74
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,451,908.85	4,563,492.21
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	424,236.18	2,624,510.60
负债合计	57,446,019.29	26,135,976.43
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6,905,741,422.15	7,967,432,500.25
未分配利润	-1,119,508,464.37	-2,322,979,705.59
所有者权益合计	5,786,232,957.78	5,644,452,794.66
负债和所有者权益总计	5,843,678,977.07	5,670,588,771.09

报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8379 元，基金份额总额 6,905,741,422.15 份。

## 7.2 利润表

会计主体：泰达宏利市值优选股票型证券投资基金

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	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	1,196,270,239.54	718,806,707.55
1. 利息收入	8,900,678.34	8,971,585.99
其中：存款利息收入	2,308,186.54	4,886,116.40
债券利息收入	6,033,934.24	100,041.31
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	558,557.56	3,985,428.28
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	863,420,671.11	-169,171,140.80
其中：股票投资收益	818,133,174.20	-213,090,808.46
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-250,051.12	-276,737.85
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	45,537,548.03	44,196,405.51
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	322,509,936.70	878,908,342.19
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,438,953.39	97,920.17
<b>减：二、费用</b>	150,828,267.82	136,290,716.97
1. 管理人报酬	93,365,765.02	81,051,586.46
2. 托管费	15,560,960.83	13,508,597.79
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	41,392,490.76	41,211,760.79
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	509,051.21	518,771.93
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	1,045,441,971.72	582,515,990.58
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	1,045,441,971.72	582,515,990.58

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利市值优选股票型证券投资基金

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）	7,967,432,500.25	-2,322,979,705.59	5,644,452,794.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,045,441,971.72	1,045,441,971.72
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）	-1,061,691,078.10	158,029,269.50	-903,661,808.60
其中：1. 基金申购款	1,503,855,107.38	-278,148,052.96	1,225,707,054.42
2. 基金赎回款	-2,565,546,185.48	436,177,322.46	-2,129,368,863.02
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）	6,905,741,422.15	-1,119,508,464.37	5,786,232,957.78
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）	8,143,689,563.64	-2,962,191,848.33	5,181,497,715.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	582,515,990.58	582,515,990.58
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）	-176,257,063.39	56,696,152.16	-119,560,911.23
其中：1. 基金申购款	302,260,291.43	-96,914,877.36	205,345,414.07
2. 基金赎回款	-478,517,354.82	153,611,029.52	-324,906,325.30
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）	7,967,432,500.25	-2,322,979,705.59	5,644,452,794.66

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

傅国庆

王泉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

泰达宏利市值优选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”,原泰达荷银市值优选股票型证券投资基金)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[2007]第 204 号《关于同意泰达荷银市值优选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由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《泰达荷银市值优选股票型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 11,867,940,890.99 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(2007)第 101 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达荷银市值优选股票型证券投资基金基金合同》于 2007 年 8 月 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 11,868,700,887.87 份基金份额,其中认购资金利息折合 759,996.88 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

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公司旗下公募基金名称的公告》,本基金自公告之日起更名为泰达宏利市值优选股票型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利市值优选股票型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、国债、金融债、企业债、可转债、央行票据、短期融资券、回购、权证、资产支持证券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金资产配置的比例范围是:股票资产占基金资产的 60%-95%,债券资产占基金资产的 0%-35%,权证占基金资产净值的 0%-3%,资产支持证券占基金资产净值的 0%-20%,并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 75%+上证国债指数收益率 $\times$ 25%。

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》、《泰达宏利市值优选股票型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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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	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管理费	93,365,765.02	81,051,586.46
其中：支付销售机构的客户维护费	15,008,362.36	13,596,583.14

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：日管理人报酬=前一日基金资产净值

×1.50% / 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	15,560,960.83	13,508,597.79

支付基金托管人中国建设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：日托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 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
中国建设银行	-	20,519,806.03	-	-	-	-
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
中国建设银行	-	-	-	-	-	-

### 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自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自有资金投资本基金。

#### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2013 年 12 月 31 日		2012 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例

中国建设银行北碚支行营业部	49,411.24	0.0007%	49,411.24	0.0006%
---------------	-----------	---------	-----------	---------

#### 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
中国建设银行	232,295,371.51	2,036,861.19	373,955,037.53	4,694,278.96

本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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
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	586,609	24,637,578.00	26,280,083.20	-
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	1,600,000	15,808,000.00	15,136,000.00	-

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	17,984,334	216,357,360.42	205,920,624.30	-

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债券正回购余额。

## § 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	5,438,488,050.42	93.07
	其中：股票	5,438,488,050.42	93.07
2	固定收益投资	159,644,000.00	2.73
	其中：债券	159,644,000.00	2.73
	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	239,314,371.24	4.10
6	其他各项资产	6,232,555.41	0.11
7	合计	5,843,678,977.07	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,718,715,206.87	64.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	268,613,352.88	4.64
F	批发和零售业	-	-
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	913,157,136.59	15.78
J	金融业	140,326,000.00	2.43
K	房地产业	53,549,694.00	0.93
L	租赁和商务服务业	130,583,434.50	2.26
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	213,543,225.58	3.69
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	5,438,488,050.42	93.99

## 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	002450	康得新	20,000,000	486,000,000.00	8.40
2	002415	海康威视	21,000,000	482,580,000.00	8.34
3	002236	大华股份	9,700,000	396,536,000.00	6.85
4	002241	歌尔声学	9,000,000	315,720,000.00	5.46

5	600887	伊利股份	6,017,748	235,173,591.84	4.06
6	300212	易华录	7,630,422	215,330,508.84	3.72
7	300070	碧水源	5,209,642	213,543,225.58	3.69
8	000625	长安汽车	17,984,334	205,920,624.30	3.56
9	000538	云南白药	2,000,000	203,980,000.00	3.53
10	002410	广联达	6,200,000	195,300,000.00	3.38

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	601318	中国平安	543,501,814.83	9.63
2	600887	伊利股份	502,027,772.64	8.89
3	000100	TCL 集团	450,562,825.02	7.98
4	600016	民生银行	407,156,593.73	7.21
5	000001	平安银行	359,046,170.23	6.36
6	000895	双汇发展	329,917,482.16	5.84
7	002375	亚厦股份	315,980,922.96	5.60
8	002450	康得新	292,601,662.42	5.18
9	600837	海通证券	292,500,726.83	5.18
10	600060	海信电器	277,547,963.59	4.92
11	600521	华海药业	272,140,737.35	4.82
12	000527	美的电器	270,549,198.44	4.79
13	002635	安洁科技	263,782,049.82	4.67
14	002038	双鹭药业	262,363,041.78	4.65
15	600637	百视通	241,469,369.26	4.28
16	300027	华谊兄弟	238,349,905.49	4.22
17	300212	易华录	235,260,787.00	4.17
18	002241	歌尔声学	231,680,082.76	4.10
19	002415	海康威视	224,955,063.01	3.99
20	000625	长安汽车	216,357,360.42	3.83
21	002570	贝因美	202,907,636.69	3.59
22	600703	三安光电	200,805,571.97	3.56
23	000651	格力电器	197,182,778.76	3.49

24	600196	复星医药	194,588,657.60	3.45
25	002344	海宁皮城	188,240,010.61	3.33
26	600031	三一重工	186,581,255.23	3.31
27	000423	东阿阿胶	183,741,338.34	3.26
28	000858	五粮液	180,834,981.84	3.20
29	002410	广联达	173,304,557.94	3.07
30	300070	碧水源	171,876,076.59	3.05
31	600585	海螺水泥	168,567,499.07	2.99
32	000002	万科A	167,664,612.61	2.97
33	002440	闰土股份	162,739,623.33	2.88
34	600446	金证股份	155,144,452.00	2.75
35	002081	金螳螂	149,944,783.66	2.66
36	300146	汤臣倍健	145,123,228.25	2.57
37	300205	天喻信息	139,334,262.74	2.47
38	300251	光线传媒	135,155,331.77	2.39
39	002353	杰瑞股份	135,092,438.88	2.39
40	600089	特变电工	128,920,548.74	2.28
41	002294	信立泰	127,196,851.60	2.25
42	002065	东华软件	120,526,539.47	2.14
43	600596	新安股份	118,441,889.60	2.10
44	002138	顺络电子	118,333,038.74	2.10
45	300259	新天科技	116,057,779.00	2.06
46	600067	冠城大通	113,312,137.05	2.01

“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	000100	TCL 集团	651,509,357.21	11.54
2	600016	民生银行	410,740,403.41	7.28
3	601318	中国平安	390,029,097.55	6.91
4	600887	伊利股份	360,630,980.85	6.39
5	000001	平安银行	356,779,577.99	6.32
6	600521	华海药业	353,938,427.80	6.27

7	000895	双汇发展	351,445,560.45	6.23
8	000651	格力电器	319,831,038.06	5.67
9	600031	三一重工	306,606,589.68	5.43
10	600535	天士力	295,374,875.51	5.23
11	002635	安洁科技	288,169,000.18	5.11
12	600557	康缘药业	284,024,043.31	5.03
13	300027	华谊兄弟	273,503,400.14	4.85
14	600837	海通证券	257,705,274.58	4.57
15	002236	大华股份	255,325,338.89	4.52
16	002241	歌尔声学	247,497,967.30	4.38
17	601601	中国太保	236,937,391.86	4.20
18	600060	海信电器	235,625,394.39	4.17
19	000527	美的电器	232,183,465.07	4.11
20	601628	中国人寿	226,078,124.90	4.01
21	000024	招商地产	214,032,202.07	3.79
22	600637	百视通	195,021,604.63	3.46
23	002570	贝因美	191,676,421.75	3.40
24	000883	湖北能源	187,325,283.41	3.32
25	002081	金螳螂	187,155,811.33	3.32
26	600703	三安光电	181,343,354.75	3.21
27	000423	东阿阿胶	181,310,502.79	3.21
28	002440	闰土股份	172,440,277.51	3.06
29	300070	碧水源	172,335,084.48	3.05
30	300146	汤臣倍健	170,995,125.86	3.03
31	002450	康得新	170,841,136.49	3.03
32	000562	宏源证券	164,448,553.13	2.91
33	000858	五粮液	164,398,098.61	2.91
34	600519	贵州茅台	161,421,612.12	2.86
35	300251	光线传媒	157,141,065.74	2.78
36	000538	云南白药	155,797,205.86	2.76
37	600446	金证股份	154,689,801.46	2.74
38	000002	万科A	152,525,974.88	2.70
39	000581	威孚高科	152,317,504.91	2.70
40	600585	海螺水泥	151,504,659.18	2.68
41	002375	亚厦股份	145,953,559.00	2.59
42	002038	双鹭药业	143,522,245.31	2.54
43	300182	捷成股份	142,630,897.77	2.53
44	002415	海康威视	139,852,942.45	2.48



45	002294	信立泰	135,699,818.40	2.40
46	601788	光大证券	131,469,524.45	2.33
47	300088	长信科技	129,687,457.32	2.30
48	600089	特变电工	129,167,709.87	2.29
49	600166	福田汽车	124,437,237.49	2.20
50	000338	潍柴动力	121,720,481.31	2.16
51	002475	立讯精密	121,542,677.94	2.15
52	600067	冠城大通	119,349,296.88	2.11

“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	13,044,365,303.53
卖出股票收入（成交）总额	13,951,940,967.82

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	159,644,000.00	2.76
	其中：政策性金融债	159,644,000.00	2.76
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	159,644,000.00	2.76

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	130201	13 国开 01	1,100,000	109,989,000.00	1.90
2	130236	13 国开 36	500,000	49,655,000.00	0.86

以上为本基金本报告期末持有的全部债券。

### 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	1,695,274.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	4,360,980.62
5	应收申购款	176,300.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,232,555.41

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000625	长安汽车	205,920,624.30	3.56	重大事项

### 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
245,913	28,082.05	1,129,488,361.07	16.36%	5,776,253,061.08	83.64%

### 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	218,418.63	0.0032%

- 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未持有本基金；
- 2、本基金本报告期末，本基金的基金经理未持有本基金。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2007 年 8 月 3 日 ）基金份额总额	11,868,700,887.87
本报告期期初基金份额总额	7,967,432,500.25
本报告期基金总申购份额	1,503,855,107.38
减：本报告期基金总赎回份额	2,565,546,185.48
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	6,905,741,422.15

## § 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、本基金托管人 2013 年 12 月 5 日发布任免通知，聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

### 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、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有限公司（特殊普通合伙）审计费用为人民币 12.40 万元，该审计机构对本基金提供审计服务的连续年限为 7 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

本报告期内，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	
高华证券	3	4,016,706,642.71	14.91%	3,656,811.74	14.98%	-
海通证券	1	2,700,895,994.46	10.03%	2,422,711.71	9.92%	-
广州证券	1	2,508,098,378.93	9.31%	2,273,795.31	9.31%	-
民生证券	1	2,378,284,502.21	8.83%	2,155,105.50	8.83%	-
宏源证券	1	2,062,337,584.00	7.66%	1,877,551.42	7.69%	-
华创证券	1	1,887,142,177.46	7.01%	1,718,049.67	7.04%	-
申银万国	1	1,615,373,662.45	6.00%	1,470,634.89	6.02%	-
中投证券	2	1,428,606,218.84	5.30%	1,300,605.37	5.33%	-
银河证券	2	1,232,295,030.14	4.57%	1,118,608.04	4.58%	-
国泰君安	1	1,076,101,730.63	3.99%	952,244.01	3.90%	-
中信证券	4	904,731,952.51	3.36%	823,669.05	3.37%	-
东方证券	1	619,373,174.44	2.30%	563,875.96	2.31%	-
中银国际	2	618,302,188.08	2.30%	562,900.10	2.31%	-
国信证券	2	594,300,263.72	2.21%	525,894.76	2.15%	-
瑞银证券	2	592,925,560.07	2.20%	539,800.67	2.21%	-
长城证券	1	535,699,626.84	1.99%	487,703.61	2.00%	-
国金证券	1	483,936,875.46	1.80%	440,569.92	1.80%	-
中金公司	1	478,116,233.04	1.77%	426,855.78	1.75%	-
安信证券	3	369,058,196.95	1.37%	335,990.77	1.38%	-
万联证券	1	333,077,410.80	1.24%	303,235.21	1.24%	-

光大证券	1	170,090,127.01	0.63%	154,850.24	0.63%	-
方正证券	2	143,158,068.48	0.53%	130,332.32	0.53%	-
长江证券	3	115,707,151.45	0.43%	105,341.29	0.43%	-
英大证券	1	41,309,770.77	0.15%	36,554.96	0.15%	-
渤海证券	1	33,052,024.65	0.12%	30,090.67	0.12%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

(一)2013 年本基金新增安信证券、长江证券、东兴证券、方正证券、高华证券、光大证券、国信证券、齐鲁证券、万联证券、湘财证券、信达证券、招商证券、浙商证券、中投证券、中信证券、中银国际交易席位，撤销华泰证券、中航证券交易席位；

(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
高华证券	19,800,286.90	33.22%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-

民生证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	26,857,400.00	45.05%	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	4,959,047.20	8.32%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	7,993,600.00	13.41%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

泰达宏利基金管理有限公司  
2014 年 3 月 27 日