

# 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。当投资者赎回时, 所得或会高于或低于投资者先前所支付的金额。

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, 投资者根据所持有份额享受基金的收益, 但同时也要承担相应的投资风险。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: 市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、管理风险、合规性风险、本基金的特定风险和其他风险等等。

本更新招募说明书摘要摘自更新招募说明书正文, 投资者欲了解详细内容, 应阅读更新招募说明书正文。

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, 投资者在认购(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。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则, 在投资者作出投资决策后, 基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险, 由投资者自行负责。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2014 年 7 月 9 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2014 年 6 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：弓劲梅

组织形式：有限责任公司

联系电话：010-66577676

联系人：张萍

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：

弓劲梅女士，董事长。拥有天津南开大学经济学博士学位。曾担任天津信托有限责任公司研究员，天弘基金管理有限公司高级研究员，天津泰达投资控股有限公司高级项目经理，天津市泰达国际控股（集团）有限公司融资与风险管理部副部长。现任天津市泰达国际控股（集团）有限公司资产管理部部长。

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。

何达德先生，董事。现为宏利行政副总裁及宏利人寿保险（国际）有限公司首席行政总监，宏利资产管理（香港）有限公司首席行政总监，负责宏利于香港的全线业务，包括个人保险、雇员福利及财富管理等业务。同时何先生分别为宏利人寿保险（国际）有限公司及宏利资产管理（香港）有限公司之董事。何先生毕业于英国伦敦城市大学，取得精算学荣誉理学士学位，现为澳大利亚精算学会及美国精算学会会员，在寿险及退休顾问工作方面拥有三十年的丰富经验，其间担任多个领导层要职。

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。雷先生于策略规划、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。

刘青山先生，董事。毕业于中国人民大学，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、副总经理兼投资总监。2013 年 3 月起任泰达宏利基金管理有限公司总经理。

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。

杜英华女士，独立董事，任期始于 2014 年 6 月 20 日。毕业于南开大学法律系，获得法学学士和法学硕士学位。1992 年 10 月，与其他合伙人共同发起设立天津津华律师事务所，现任该律所副主任，正高级律师，具有 22 年法律实务经验。同时担任天津第五届律师协会理事、天津第六届律师协会监事。

范小云女士，独立董事，毕业于南开大学金融系，经济学博士学位。毕业于南开大学金融系，经济学博士学位。1997 年至 2005 年历任南开大学金融系讲师、副教授。2005 年起任南开大学金融系教授、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。

任赛华女士，监事。毕业于加拿大滑铁卢大学（University of Waterloo），获得数学学士学位，加拿大安大略省会计师公会之特许会计师。任女士于2007年加盟，曾任首席行政事务总监，现担任宏利资产管理高级执行总监。早年任女士曾任职于亚洲和加拿大的著名国际投资银行、会计事务所及省级退休金委员会，监管托管业务的销售及担任全球基金服务客户关系管理、新业务发展及会计等高级职务。

王泉先生，职工监事。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。

邓艺颖女士，职工监事。金融学硕士，2004年5月至2005年4月就职于中国工商银行广东省分行公司业务部职员；2005年4月加盟泰达宏利基金管理有限公司，先后担任交易部交易员、固定收益部研究员、研究部研究部总监业务助理兼研究员；自2011年6月3日起担任泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金基金经理；具备9年基金从业经验，8年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

## 3、总经理及其他高级管理人员

刘青山先生，总经理。简历同上。

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

梁辉先生，管理科学与工程专业硕士，2002年3月起，任职于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、基金经理助理、研究部总监、金融工程部总经理，基金投资部总经理，现担任总经理助理兼投资总监；自2013年2月21日起至今担任本基金基金经理。12年基金从业经验，具有证券从业资格、基金从业资格。

本基金历任基金经理：刘青山先生，2004年7月至2013年2月管理本基金。

#### 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刘青山，总经理助理兼投资总监梁辉，研究部总监兼基金经理陈少平，基金投资部副总经理吴俊峰。

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：人民币贰仟柒佰玖拾叁亿陆仟肆佰陆拾万陆仟叁佰叁拾元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管业务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：王永民

客服电话：95566

传真：(010) 66594942

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上

的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构银行间债券、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管产品体系。在国内，中国银行是首家开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至 2014 年 6 月 30 日，中国银行已托管 276 只证券投资基金，其中境内基金 251 只，QDII 基金 25 只，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

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：田国立

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：牛锡明



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](http://www.spdb.com.cn)

#### **9) 平安银行股份有限公司**

注册地址: 深圳市深南东路 5047 号

办公地址: 深圳市深南东路 5047 号

法定代表人: 孙建一

电话: 021-38637673

传真: 021-50979507

联系人: 张莉

客户服务热线: 95511-3

公司网站: [bank.pingan.com](http://bank.pingan.com)

#### **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: 陈幸

客服电话: 4001196228

公司网址: [www.dongguanbank.cn](http://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](http://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](http://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](http://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](http://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](http://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

客户服务热线：4006-960296

公司网站：[www.bank-of-tianjin.com](http://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](http://www.wzbank.cn)

## 19) 花旗银行（中国）有限公司

注册地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦主楼 28 楼 01A 单元和 02A 单元、29 楼 02 单元、30 楼 01 单元、32 楼 01 单元和 01B 单元、33 楼 01 单元和 03 单元、34 楼 01 单元及 35 楼。

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦主楼 28 楼 01A 单元和 02A 单元、29 楼 02 单元、30 楼 01 单元、32 楼 01 单元和 01B 单元、33 楼 01 单元和 03 单元、34 楼 01 单元及 35 楼。

法定代表人：欧兆伦（AU SIU LUEN）

个人客户服务中心电话：800830 1880

机构客户服务中心电话：800 820 1268

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

## 20) 湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 层

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 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：赵小明

联系电话：021-68634510-8620

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

## 21) 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：胡天彤  
电话：022-28451709  
传真：022-28451892  
电子邮箱：hutt@bhq.com  
客户服务电话：4006515988  
网址：www.bhq.com

## **22) 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：010-66568450  
联系人：宋明  
公司网站：www.chinastock.com.cn

## **23) 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

## **24) 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](http://www.csc108.com)

## **25) 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](http://www.gtja.com)

## **26) 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)

## **27) 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、23 层、25 层-29 层  
办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-23 层、25 层-29 层  
法定代表人：潘鑫军  
客服电话：95503  
联系人：胡月茹  
公司网站：[www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

## **28) 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：袁媛

客服电话：0755-83199511

公司网站：www.csc.com.cn

## **29) 申银万国证券股份有限公司**

注册地址：上海市长乐路 989 号 45 楼

办公地址：上海市长乐路 989 号 40 楼

法定代表人：储晓明

联系人：李清怡

联系电话：021-33389888

客服电话：95523 或 400-889-5523

网址：www.sywg.com

## **30) 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

## **31) 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：王炜哲  
公司网站：www.bocichina.com

### **32) 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：庞晓芸  
公司网站：www.htsc.com.cn

### **33) 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：薛峰  
联系人：刘晨、李芳芳  
客户服务电话：95525、4008888788 10108998  
传真：021-22169134  
公司网址：www.ebscn.com

### **34) 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

### **35) 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)

### **36) 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：刘阳

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)

### **37) 南京证券股份有限公司**

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：潘月

联系电话：025-52310569

客户服务电话：400 828 5888

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

### **38) 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：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 20 层

法定代表人：兰荣

联系人：黄英

联系电话：0591-38162212

客户服务电话：95562

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

### **39) 海通证券股份有限公司**

注册地址：上海市广东路 689 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、400-8888-001

联系电话：021-23219000

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

### **40) 广州证券有限责任公司**

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 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](http://www.gzs.com.cn)

#### **41) 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：张宗锐

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

#### **42) 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)

#### **43) 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](http://www.jyzq.cn)

#### **44) 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 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：姚文平

客服电话：4008888128

传真：021-68767981

联系人：徐可

公司网站：www.tebon.com.cn

#### **45) 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

#### **46) 东海证券股份有限公司**

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 楼

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：刘化军

联系人：王一彦

电话：021-20333333

传真：021-50498825

公司网络地址：www.longone.com.cn

客服电话：95531, 400-888-8588

#### **47) 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

#### **48) 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：孙智勇

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

#### **49) 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

#### **50) 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

### **51) 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

### **52) 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

### **53) 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

客服电话：4006 600109

### **54) 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

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

#### **55) 中信证券股份有限公司**

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

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](http://www.citics.com)

客服热线：95558

#### **56) 西藏同信证券股份有限公司**

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](http://www.xzsec.com)

客服热线：40088-11177

#### **57) 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](http://www.zszq.com)

客服热线：4001022011

#### **58) 中信证券(山东)有限责任公司**

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 20 层



办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

公司网址：www.citicssd.com

客服热线：95548

#### **59) 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：杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22、23 楼

法定代表人：沈强

公司网址：www.bigsun.com.cn

客服热线：95548

#### **60) 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：400-871-8880

#### **61) 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

#### **62) 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

**63) 上海好买基金销售有限公司**

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室  
办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼  
法定代表人：杨文斌  
公司网址：www.ehowbuy.com  
客服热线：400-700-9665

**64) 杭州数米基金销售有限公司**

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号  
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼  
法定代表人：陈柏青  
客服电话：4000-766-123  
网址：<http://www.fund123.cn/>

**65) 上海天天基金销售有限公司**

注册地址：浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室  
办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C-9 楼  
法定代表人：其实  
客服电话：400-1818-188  
网站：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

**66) 上海长量基金销售投资顾问有限公司**

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：单丙焯

电话：021-20691835

传真：021-20691861 客服电话：400-089-1289

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

### **67) 和讯信息科技有限公司**

注册地址：北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：习甜

联系电话：010-85650920

传真号码：010-85657357

全国统一客服热线：400-920-0022/ 021-20835588

公司网址： [licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

### **68) 北京展恒基金销售有限公司**

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

全国统一客服热线：400-888-6661

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

### **(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：弓劲梅

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(特殊普通合伙)

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、王珏

## 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%。

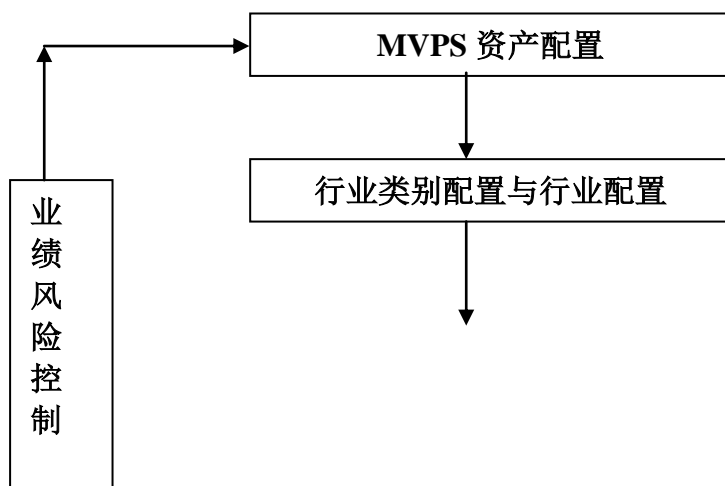
## 八、基金的投资策略

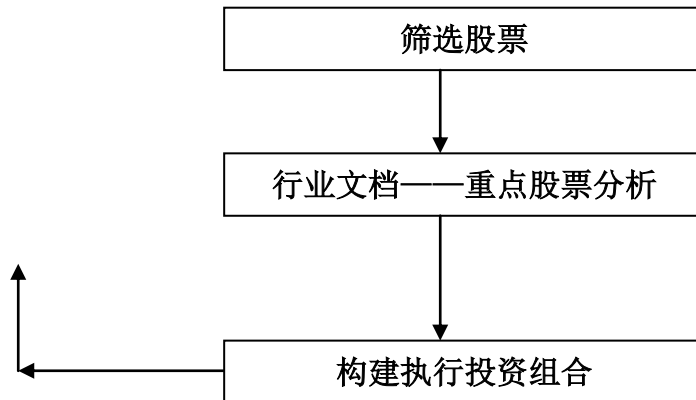
全面引进荷兰银行的投资管理流程，采用“自上而下”资产配置和行业类别与行业配置，“自下而上”精选股票的投资策略，主要投资于具有国际和国内竞争力比较优势和长期增值潜力的行业和企业的股票。

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本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 2014 年 8 月 5 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 2014 年 6 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	1,825,143,069.45	63.04
	其中：股票	1,825,143,069.45	63.04
2	固定收益投资	179,410,700.00	6.20
	其中：债券	179,410,700.00	6.20
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	690,201,726.30	23.84
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	197,098,162.88	6.81
7	其他资产	3,172,356.70	0.11
8	合计	2,895,026,015.33	100.00

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,825,143,069.45	63.04
	其中：股票	1,825,143,069.45	63.04
2	固定收益投资	179,410,700.00	6.20
	其中：债券	179,410,700.00	6.20
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	690,201,726.30	23.84
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	197,098,162.88	6.81
7	其他资产	3,172,356.70	0.11
8	合计	2,895,026,015.33	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	20,944,755.84	0.73
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,205,729,574.18	41.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	426,695.00	0.01
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	391,351,624.14	13.56
J	金融业	83,262,913.30	2.89
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	70,985,256.24	2.46
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	52,442,250.75	1.82
S	综合	-	-
	合计	1,825,143,069.45	63.25

#### 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	002415	海康威视	14,912,003	252,609,330.82	8.75
2	002065	东华软件	7,731,054	155,548,806.48	5.39
3	002353	杰瑞股份	3,144,798	126,578,119.50	4.39
4	002450	康得新	4,777,849	108,696,064.75	3.77
5	601318	中国平安	2,116,495	83,262,913.30	2.89
6	002236	大华股份	2,816,191	75,896,347.45	2.63
7	600198	大唐电信	4,986,886	74,304,601.40	2.58
8	002358	森源电气	2,828,351	70,312,805.86	2.44
9	002023	海特高新	3,452,521	65,943,151.10	2.29
10	300020	银江股份	1,963,563	60,085,027.80	2.08

#### 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	100,014,700.00	3.47
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	70,135,000.00	2.43
7	可转债	9,261,000.00	0.32
8	其他	-	-
9	合计	179,410,700.00	6.22

#### 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	1382028	13 山水 MTN1	500,000	50,095,000.00	1.74
2	1380081	13 融国投债	400,000	40,360,000.00	1.40
3	112093	11 亚迪 01	300,000	29,969,700.00	1.04
4	1382013	13 重汽 MTN1	200,000	20,040,000.00	0.69
5	124298	13 临汾投	200,000	19,596,000.00	0.68

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序的前五名贵金属投资明细  
本基金本报告期末未持有贵金属。

9、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。

10、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

10.1 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。

10.2 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。

11、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

11.1 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。

11.2 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。

11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金没有投资国债期货。

12、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。

### 13、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	398,610.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,685,586.63
5	应收申购款	88,159.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,172,356.70

### 14、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 15、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

### 16、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2014年6月30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：

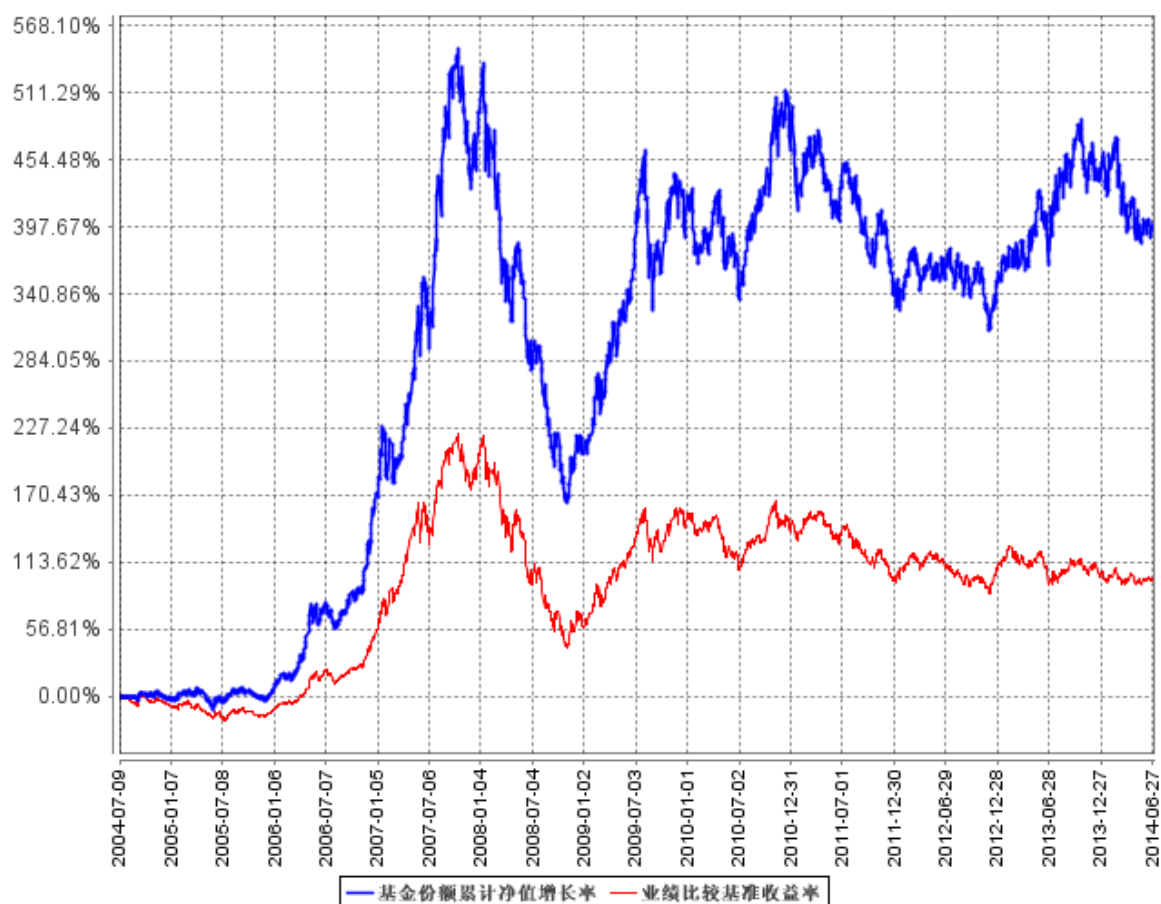
### 1. 历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	净值增长率	净值增长率标	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益	①-③	②-④
----	-------	--------	-----------	----------	-----	-----

	③ ①	准差 ②	③	率标准差 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%
2013. 1. 1~ 2013. 12. 31	20.27%	1.43%	-3.10%	0.95%	23.37%	0.48%
2014. 1. 1~ 2014. 6. 30	-8.98%	1.35%	-2.52%	0.73%	-6.46%	0.62%
基金合同生效以来 至 2014. 6. 30	402.80%	1.53%	100.44%	1.25%	302.36%	0.28%

2. 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（2004年7月9日-2014年6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：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期。本报告期末本基金的各项投资比例符合基金合同的规定。

### 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的资产净值的 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的资产净值的 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、“三、基金管理人”中对基金管理人概况、董事会成员、监事会成员和基金经理内容部分进行了变更。

3、“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。

4、“五、相关服务机构”部分对对代销机构信息、注册登记机构及会计师事务所信息进行了更新。

5、新增“六、基金的募集与基金合同生效”的内容。

6、更新了“七、基金份额的申购、赎回和基金间转换”中部分内容。

7、“八、基金的投资”部分对投资组合报告内容更新至2014年6月30日。

8、“九、基金的业绩”部分对基金业绩更新至2014年6月30日，并更新了历史走势对比图。

9、“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

2014年8月22日