

# 泰达宏利养老收益混合型证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 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 8 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半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 8 月 22 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 3 月 5 日起至 2014 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 12        |
| 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.....             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 13        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 14        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....                  | 14        |
| 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..... | 14        |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....      | 14        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 14        |
| 6.2 利润表.....                                 | 16        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 17        |
| 6.4 报表附注.....                                | 17        |
| <b>§7 投资组合报告</b> .....                       | <b>38</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 38        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 39        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....       | 39        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 40        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 41        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....      | 41        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....   | 42        |
| 7.8 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.....   | 42        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....      | 42        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....               | 42        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 42        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                           | 42        |
| <b>§8 基金份额持有人信息</b> .....                    | <b>43</b> |

|  |           |
|--|-----------|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....             | 43        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....          | 44        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 44        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>               | <b>44</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                 | <b>45</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                  | 45        |
| 10.2 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.....  | 45        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....       | 45        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                    | 45        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....             | 46        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....     | 46        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....            | 46        |
| 10.8 其他重大事件.....                       | 48        |
| <b>§11 备查文件目录.....</b>                 | <b>48</b> |
| 11.1 备查文件目录.....                       | 48        |
| 11.2 存放地点.....                         | 49        |
| 11.3 查阅方式.....                         | 49        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                  |
|-----------------|--------------------|------------------|
| 基金名称            | 泰达宏利养老收益混合型证券投资基金  |                  |
| 基金简称            | 泰达宏利养老混合           |                  |
| 基金主代码           | 000507             |                  |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                  |
| 基金合同生效日         | 2014 年 3 月 5 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      | 1,033,135,422.57 份 |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                  |
| 下属分级基金的基金简称:    | 泰达宏利养老混合 A         | 泰达宏利养老混合 B       |
| 下属分级基金的交易代码:    | 000507             | 000508           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 571,061,195.15 份   | 462,074,227.42 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在严格控制风险的前提下，通过积极主动的管理，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。  |
| 投资策略   | 本基金管理人充分发挥自身的研究优势，将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，自上而下决定债券组合久期、期限结构配置及债券类别配置；同时在严谨深入的信用分析基础上，综合考量企业债券的信用评级以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，自下而上地精选具有较高投资价值的个券。同时，本基金深度关注股票市场的运行状况与相应风险收益特征，在严格控制基金资产运作风险的基础上，把握投资机会。 |
| 业绩比较基准 | 人民银行一年期银行定期存款基准利率收益率（税后）+2%   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，在证券投资基金中属于较高风险的品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、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   | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 陈沛             | 王永民                  |
|         | 联系电话 | 010-66577808   | 010-66594896         |
|         | 电子邮箱 | irm@mfteda.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话  |      | 400-69-88888   | 95566                |
| 传真      |      | 010-66577666   | 010-66594942         |

|       |                            |                  |
|-------|----------------------------|------------------|
| 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 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号 |
| 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 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号 |
| 邮政编码  | 100033                     | 100818           |
| 法定代表人 | 弓劲梅                        | 田国立              |

## 2.4 信息披露方式

|                      |  |
|----------------------|--|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 中国证券报、上海证券报、证券时报   |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.mfcteda.com">http:// www.mfcteda.com</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人的住所   |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                       |
|--------|--------------|----------------------------|
| 注册登记机构 | 泰达宏利基金管理有限公司 | 北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层 |

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 基金级别          | 泰达宏利养老混合 A                            | 泰达宏利养老混合 B                            |
|---------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2014 年 3 月 5 日 - 2014 年 6 月 30 日) | 报告期(2014 年 3 月 5 日 - 2014 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | 2,674,538.04                          | 2,987,741.83                          |
| 本期利润          | 3,029,245.91                          | 3,161,972.11                          |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0070                                | 0.0061                                |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.70%                                 | 0.61%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.80%                                 | 0.70%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2014 年 6 月 30 日)                 |                                       |
| 期末可供分配利润      | 3,934,769.57                          | 2,547,259.56                          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0069                                | 0.0055                                |
| 期末基金资产净值      | 575,675,390.85                        | 465,170,795.79                        |
| 期末基金份额净值      | 1.008                                 | 1.007                                 |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2014 年 6 月 30 日)                 |                                       |

|             |       |       |
|-------------|-------|-------|
| 基金份额累计净值增长率 | 0.80% | 0.70% |
|-------------|-------|-------|

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. 对期末可供分配利润，采用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

4. 本基金基金合同于 2014 年 3 月 5 日生效，实际编制期间为 2014 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日

### 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

泰达宏利养老混合 A

| 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 0.00%    | 0.19%       | 0.42%      | 0.01%         | -0.42% | 0.18% |
| 过去三个月      | 0.60%    | 0.11%       | 1.22%      | 0.01%         | -0.62% | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.80%    | 0.10%       | 1.59%      | 0.01%         | -0.79% | 0.09% |

泰达宏利养老混合 B

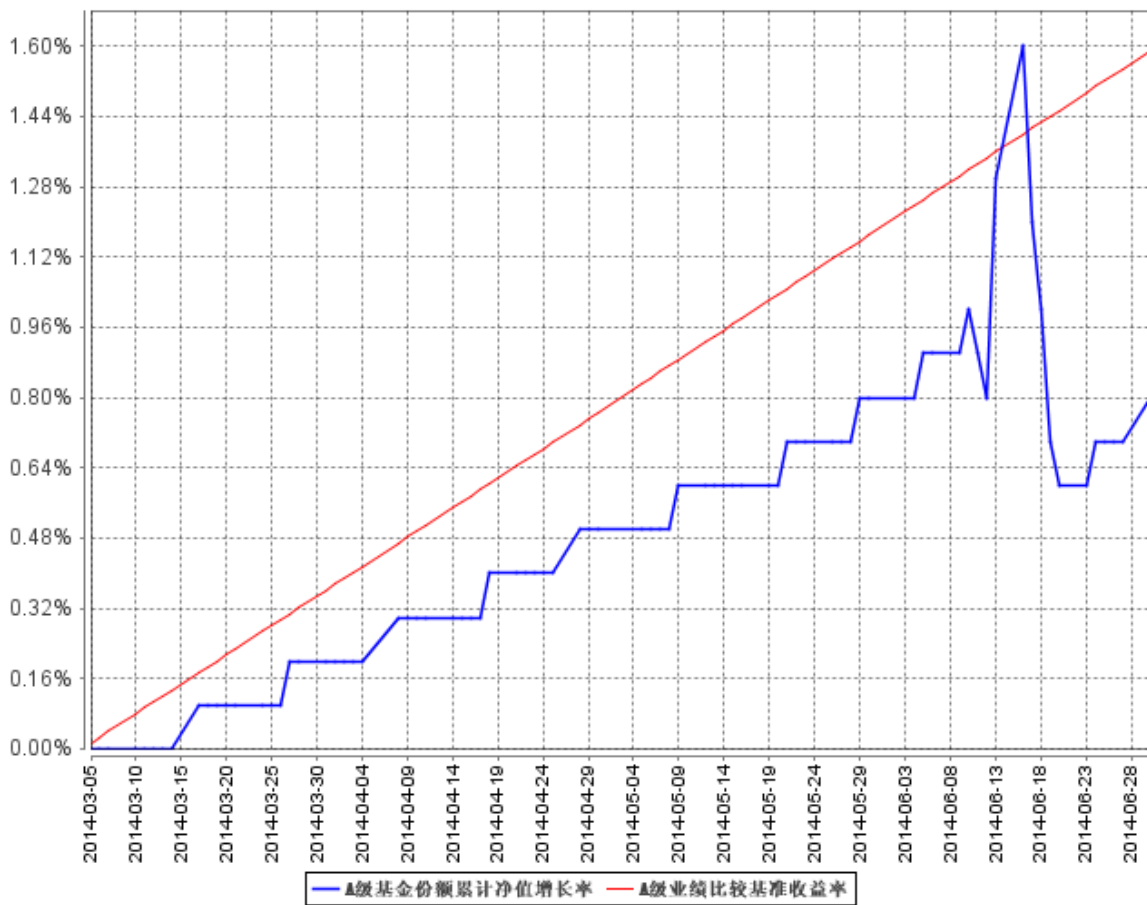
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 0.00%    | 0.19%       | 0.42%      | 0.01%         | -0.42% | 0.18% |
| 过去三个月      | 0.50%    | 0.11%       | 1.22%      | 0.01%         | -0.72% | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.70%    | 0.10%       | 1.59%      | 0.01%         | -0.89% | 0.09% |

注：1、养老混合基金业绩比较基准：人民银行一年期银行定期存款基准利率收益率（税后）+2%

2、养老混合基金合同生效日为 2014 年 3 月 5 日，建仓期 6 个月，基金合同生效日至本报告期末不满一年。本报告期末，本基金仍在建仓期。

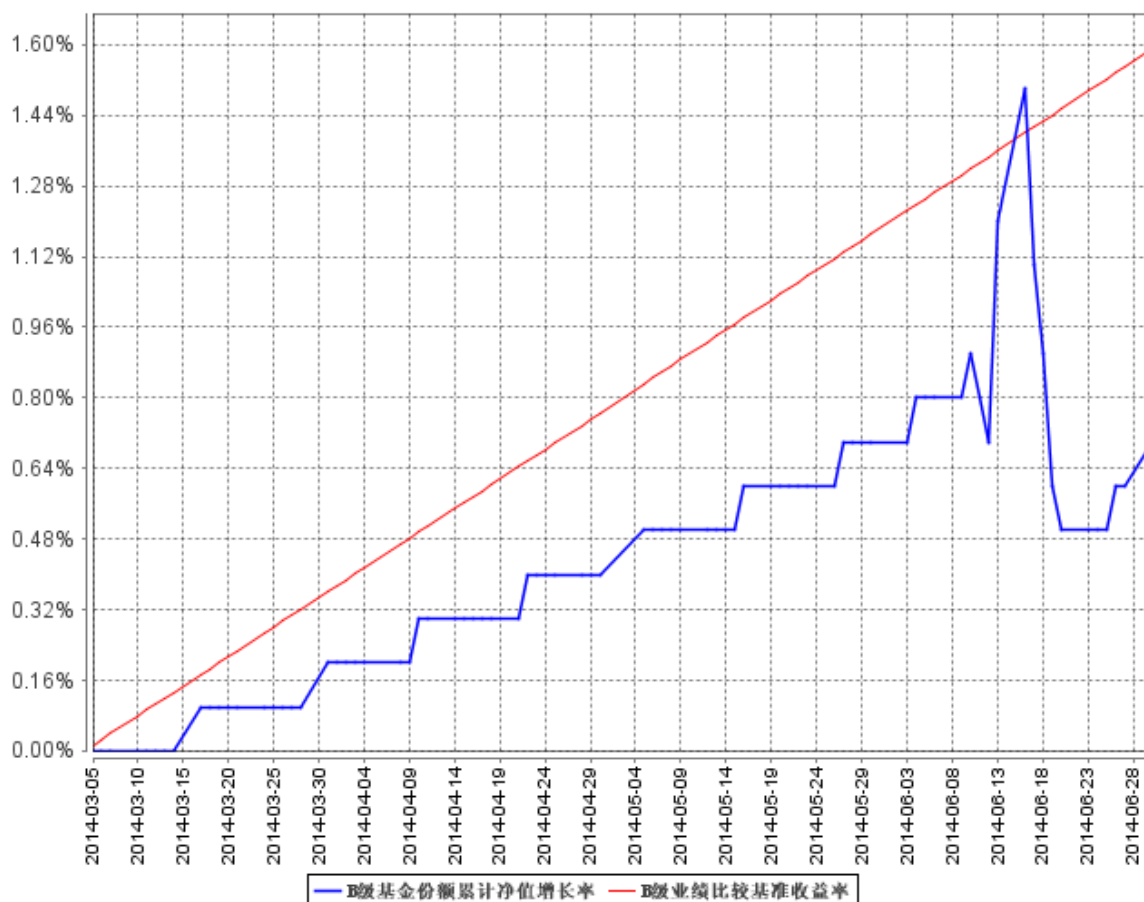
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级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





**B级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**



本基金于 2014 年 3 月 5 日成立。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,本基金仍在建仓期。

## § 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、泰达宏利全球新格局基金、泰达宏利聚利分级债券基金、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、泰达宏利养老收益混合型证券投资基金在内的二十多只证券投资基金。

#### 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 |        |  |
| 胡振仓 | 本基金基金经理 | 2014 年 3 月 5 日  | -    | 11     | 金融学硕士；2003 年 7 月至 2005 年 4 月就职于乌鲁木齐市商业银行，从事债券交易与研究工作，首席研究员；2006 年 3 月至 2006 年 6 月就职于国联证券公司，从事债券交易工作，高级经理；2006 年 7 月至 2008 年 3 月就职于益民基金管理有限公司，其中 2006 年 7 月至 2006 年 11 月任益民货币市场基金经理 |

|     |         |                |   |   |   |
|-----|---------|----------------|---|---|---|
|     |         |                |   |   | 助理，2006 年 12 月至 2008 年 3 月任益民货币市场基金基金经理；11 年证券从业经验，8 年基金从业经验，具有基金从业资格。  |
| 吴俊峰 | 本基金基金经理 | 2014 年 3 月 5 日 | - | 9 | 经济学硕士；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；自 2013 年 6 月起担任基金投资部副总经理（主持工作）；9 年基金从业经验，具有基金从业资格。 |

注：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。

## 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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度和流程，并严格执行制度的规定。在投资管理活动中，本基金管理人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；严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离；在交易环节实行集中交易制度，并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；交易部运用交易系统中设置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；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，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。风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数量统计、分析。在本报告期内，没有发生利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

### 4.3.2 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，风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估，向公司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。在本报告期内，本基金管理人旗下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%，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

#### 股票部分

上半年 A 股市场总体呈震荡走势，创业板波动较大，从板块间表现来看，军工、金融 IT、互联网教育等表现较好，市场仍然偏好小市值且行业成长空间较大的领域。

随着货币政策逐渐微调，总体呈放松态势，市场对经济增速继续下滑和系统性风险暴露的担心减轻，风险偏好有所上升，主题投资较为活跃，但也面临中期业绩的考验，持续性有待观察。

本基金的配置比较稳健，仓位控制在较低水平，以低估值、高分红的蓝筹股为主，随着三季

度经济企稳和沪港通的开设，会择机增加这类股票的配置。

#### 债券部分

上半年债券市场经历了一波大牛市，本基金 3 月 5 日正式成立之后基本处于建仓期，按照既定的策略，主要以协议存款和回购为主，获取较为稳定的收益。6 月 4 日，本基金进入开放期。IPO 重启之后，本基金全力参与新股申购，本基金债券部分主要投资于中短久期、高流动性资产，为股票投资做好流动性管理，同时为基金提供相对较为确定的收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

#### 养老收益 A

截止报告期末，本基金份额净值为 1.008 元，成立以来的份额净值增长率为 0.80%，同期业绩比较基准增长率为 1.59%。

#### 养老收益 B

截止报告期末，本基金份额净值为 1.007 元，成立以来的份额净值增长率为 0.70%，同期业绩比较基准增长率为 1.59%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

#### 股票部分

展望下半年的 A 股市场，政策面的逐步放松有利于化解市场对经济基本面的过度担心，市场利率的稳步下移也利于低估值板块的走强。另外沪港通的放开也将加速 A 股估值体系与国际靠拢，长期资金的引入能够增加高股息回报，基本面稳健的大盘股的吸引力。而前期过度炒作的一些高估值板块面临中期业绩的风险，因此三四季度有可能存在阶段性的风格转换。

#### 债券部分

展望 2014 年下半年，国内经济出现一些企稳迹象，政府出台了较多稳增长的举措也可能遏制经济的进一步下滑，尽管房地产销售和投资低迷对经济构成拖累，经济低位企稳的可能性较大。6 月份以来，利率债经历了较大幅度的调整，进一步上行的空间不大。目前看，资质较好的中低等级信用债仍然具有较好价值，经济企稳也有助于降低中低等级债券的信用风险。

### 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

根据本基金基金合同及基金的实际运作情况，本基金于本报告期内未进行收益分配。

## § 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”）在对泰达宏利养老收益混合型证券投资基金（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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利养老收益混合型证券投资基金  
报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2014年6月30日 |
|-----|-----|-------------------|
|     |     |                   |

|                 |            |                           |
|-----------------|------------|---------------------------|
| <b>资产:</b>      |            |                           |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 12,893,628.66             |
| 结算备付金           |            | 318,195.77                |
| 存出保证金           |            | 10,145.23                 |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 932,205,526.75            |
| 其中: 股票投资        |            | 42,291,433.56             |
| 基金投资            |            | -                         |
| 债券投资            |            | 889,914,093.19            |
| 资产支持证券投资        |            | -                         |
| 贵金属投资           |            | -                         |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                         |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | 270,000,180.00            |
| 应收证券清算款         |            | -                         |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 5,270,537.22              |
| 应收股利            |            | -                         |
| 应收申购款           |            | 20,574.06                 |
| 递延所得税资产         |            | -                         |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                         |
| 资产总计            |            | 1,220,718,787.69          |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2014年6月30日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                           |
| 短期借款            |            | -                         |
| 交易性金融负债         |            | -                         |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                         |
| 卖出回购金融资产款       |            | 166,599,796.70            |
| 应付证券清算款         |            | 1,089,035.00              |
| 应付赎回款           |            | 10,477,778.98             |
| 应付管理人报酬         |            | 693,297.82                |
| 应付托管费           |            | 192,582.74                |
| 应付销售服务费         |            | 115,954.53                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 545,237.14                |
| 应交税费            |            | -                         |
| 应付利息            |            | 13,668.23                 |
| 应付利润            |            | -                         |
| 递延所得税负债         |            | -                         |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 145,249.91                |
| 负债合计            |            | 179,872,601.05            |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                           |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 1,033,135,422.57          |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | 7,710,764.07              |
| 所有者权益合计         |            | 1,040,846,186.64          |
| 负债和所有者权益总计      |            | 1,220,718,787.69          |

1. 报告截至日 2014 年 6 月 30 日, 基金份额总额 1,033,135,422.57 份, 其中下属 A 类基金份额

571,061,195.15 份，B 类基金份额 462,074,227.42 份。下属 A 类基金份额净值 1.008 元，B 类基金份额净值 1.007 元。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2014 年 3 月 5 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日，无上年度可比数据。

## 6.2 利润表

会计主体：泰达宏利养老收益混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 3 月 5 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号        | 本期<br>2014 年 3 月 5 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|------------|--|
| <b>一、收入</b>                |            | 11,331,918.58                                  |
| 1.利息收入                     |            | 13,026,410.91                                  |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.11   | 9,803,747.37                                   |
| 债券利息收入                     |            | 1,718,362.19                                   |
| 资产支持证券利息收入                 |            | -  |
| 买入返售金融资产收入                 |            | 1,504,301.35                                   |
| 其他利息收入                     |            | -  |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |            | -2,370,400.65                                  |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.12   | -2,635,551.80                                  |
| 基金投资收益                     |            | -  |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.13   | 457.65   |
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.13.1 | -  |
| 贵金属投资收益                    | 7.4.7.14   | -  |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.15   | -  |
| 股利收益                       | 6.4.7.16   | 264,693.50                                     |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.17   | 528,938.15                                     |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |            | -  |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.18   | 146,970.17                                     |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 5,140,700.56                                   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 2,745,979.12                                   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 762,771.97                                     |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 496,293.22                                     |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 884,772.00                                     |
| 5. 利息支出                    |            | 103,244.24                                     |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 103,244.24                                     |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 147,640.01                                     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 6,191,218.02                                   |
| 减：所得税费用                    |            | -  |



|                   |  |              |
|-------------------|--|--------------|
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） |  | 6,191,218.02 |
|-------------------|--|--------------|

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利养老收益混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2014 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 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）                        | 953,698,599.67                                 | -             | 953,698,599.67   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 6,191,218.02  | 6,191,218.02     |
| 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）      | 79,436,822.90                                  | 1,519,546.05  | 80,956,368.95    |
| 其中：1.基金申购款                             | 305,432,736.43                                 | 3,266,090.05  | 308,698,826.48   |
| 2.基金赎回款                                | -225,995,913.53                                | -1,746,544.00 | -227,742,457.53  |
| 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）                        | 1,033,135,422.57                               | 7,710,764.07  | 1,040,846,186.64 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

泰达宏利养老收益混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可 [2013]1624 号《关于核准泰达宏利养老收益混合型证券投资

资基金募集的批复》核准，由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《泰达宏利养老收益混合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 953,571,180.12 元，已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(2014)第 103 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰达宏利养老收益混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 3 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 953,698,599.67 份基金份额，其中认购资金利息折合 127,419.55 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”)。

根据《泰达宏利养老收益混合型证券投资基金基金合同》和《泰达宏利养老收益混合型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金自募集期起根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用的，称为 A 类基金份额；不收取认购、申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 B 类基金份额。本基金 A 类、B 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择认购、申购某一类别的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利养老收益混合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具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票、债券（包含企业债券、公司债券、短期融资券、地方政府债券、金融债券、次级债、可转换公司债券、可分离交易的可转换债、资产支持证券、国债、中央银行票据、政策性金融债券、中期票据、以及经过法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、正回购、逆回购、银行存款、货币市场工具、权证，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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 0-30%，债券、正回购、逆回购、银行存款、货币市场工具、权证合计占基金资产的比例不低于 5%。本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%，现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。本基金的业绩比较基准为人民银行一年期银行定期存款基准利率收益率（税后）+2%。

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 8 月 26 日批准报出。

#### 6.4.2 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》、《泰达宏利养老收益混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年 3 月 5 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日止期间的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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 3 月 5 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融

资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别的基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若

期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由

中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策的变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计的变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

## 6.4.6 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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末             |
|----------------|-----------------|
|                | 2014 年 6 月 30 日 |
| 活期存款           | 12,893,628.66   |
| 定期存款           | -               |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -               |
| 其他存款           | -               |
| 合计：            | 12,893,628.66   |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末             |                |                |            |
|---------------|-----------------|----------------|----------------|------------|
|               | 2014 年 6 月 30 日 |                |                |            |
|               | 成本              | 公允价值           | 公允价值变动         |            |
| 股票            | 41,867,025.89   | 42,291,433.56  | 424,407.67     |            |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -               | -              | -              |            |
| 债券            | 交易所市场           | 78,865,702.30  | 78,947,093.19  | 81,390.89  |
|               | 银行间市场           | 810,943,860.41 | 810,967,000.00 | 23,139.59  |
|               | 合计              | 889,809,562.71 | 889,914,093.19 | 104,530.48 |
| 资产支持证券        | -               | -              | -              |            |
| 基金            | -               | -              | -              |            |
| 其他            | -               | -              | -              |            |
| 合计            | 931,676,588.60  | 932,205,526.75 | 528,938.15     |            |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产和负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目         | 本期末             |           |
|------------|-----------------|-----------|
|            | 2014 年 6 月 30 日 |           |
|            | 账面余额            | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券_交易所 | 230,000,000.00  | -         |
| 买入返售证券_银行间 | 40,000,180.00   | -         |
| 合计         | 270,000,180.00  | -         |

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。



### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2014年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,143.33          |
| 应收定期存款利息   | -                 |
| 应收其他存款利息   | -                 |
| 应收结算备付金利息  | 128.88            |
| 应收债券利息     | 5,058,100.45      |
| 应收买入返售证券利息 | 211,159.39        |
| 应收申购款利息    | 1.03              |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 其他         | 4.14              |
| 合计         | 5,270,537.22      |

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2014年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 534,742.28        |
| 银行间市场应付交易费用 | 10,494.86         |
| 合计          | 545,237.14        |

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2014年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 10,840.83         |
| 预提费用        | 134,409.08        |
| 合计          | 145,249.91        |

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 泰达宏利养老混合 A |                                     |
|------------|-------------------------------------|
| 项目         | 本期<br>2014年3月5日(基金合同生效日)至2014年6月30日 |
|            |                                     |

|               | 基金份额（份）        | 账面金额           |
|---------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日       | 423,486,535.31 | 423,486,535.31 |
| 本期申购          | 205,397,689.92 | 205,397,689.92 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -57,823,030.08 | -57,823,030.08 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -              | -              |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -              | -              |
| 本期申购          | -              | -              |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -              | -              |
| 本期末           | 571,061,195.15 | 571,061,195.15 |

金额单位：人民币元

| 泰达宏利养老混合 B    |                                     |                 |
|---------------|-------------------------------------|-----------------|
| 项目            | 本期<br>2014年3月5日(基金合同生效日)至2014年6月30日 |                 |
|               | 基金份额（份）                             | 账面金额            |
| 基金合同生效日       | 530,212,064.36                      | 530,212,064.36  |
| 本期申购          | 100,035,046.51                      | 100,035,046.51  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -168,172,883.45                     | -168,172,883.45 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                                   | -               |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                                   | -               |
| 本期申购          | -                                   | -               |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                                   | -               |
| 本期末           | 462,074,227.42                      | 462,074,227.42  |

本基金自 2014 年 2 月 7 日起至 2014 年 2 月 28 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 953,571,180.12 元(其中 A 类基金份额 423,397,390.20 元，B 类基金份额 530,173,789.92 元)。根据《泰达宏利养老收益混合型证券投资基金招募说明书》和《泰达宏利养老收益混合型证券投资基金基金份额发售公告》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 127,419.55 元(其中 A 类基金份额 89,145.11 元，B 类基金份额 38,274.44 元)在本基金成立后，折算为 127,419.55 份基金份额(其中 A 类基金份额 89,145.11 份，B 类基金份额 38,274.44 份)，划入基金份额持有人账户。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 泰达宏利养老混合 A     |              |            |              |
|----------------|--------------|------------|--------------|
| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分      | 未分配利润合计      |
| 基金合同生效日        | -            | -          | -            |
| 本期利润           | 2,674,538.04 | 354,707.87 | 3,029,245.91 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,260,231.53 | 324,718.26 | 1,584,949.79 |
| 其中：基金申购款       | 1,699,934.36 | 367,340.92 | 2,067,275.28 |
| 基金赎回款          | -439,702.83  | -42,622.66 | -482,325.49  |
| 本期已分配利润        | -            | -          | -            |
| 本期末            | 3,934,769.57 | 679,426.13 | 4,614,195.70 |

单位：人民币元

| 泰达宏利养老混合 B     |               |            |               |
|----------------|---------------|------------|---------------|
| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分      | 未分配利润合计       |
| 基金合同生效日        | -             | -          | -             |
| 本期利润           | 2,987,741.83  | 174,230.28 | 3,161,972.11  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -440,482.27   | 375,078.53 | -65,403.74    |
| 其中：基金申购款       | 742,163.46    | 456,651.31 | 1,198,814.77  |
| 基金赎回款          | -1,182,645.73 | -81,572.78 | -1,264,218.51 |
| 本期已分配利润        | -             | -          | -             |
| 本期末            | 2,547,259.56  | 549,308.81 | 3,096,568.37  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2014年3月5日(基金合同生效日)至2014年6月30日 |
|-----------|-------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 106,087.43                          |
| 定期存款利息收入  | 9,677,955.56                        |
| 其他存款利息收入  | -                                   |
| 结算备付金利息收入 | 13,638.07                           |
| 其他        | 6,066.31                            |
| 合计        | 9,803,747.37                        |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2014年3月5日(基金合同生效日)至2014年6月30日 |
|------------|-------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 271,439,739.89                      |
| 减：卖出股票成本总额 | 274,075,291.69                      |
| 买卖股票差价收入   | -2,635,551.80                       |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2014年3月5日(基金合同生效日)至2014年6月30日 |
|----|-------------------------------------|
|----|-------------------------------------|

|                        |              |
|------------------------|--------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,048,780.82 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,006,898.51 |
| 减：应收利息总额               | 41,424.66    |
| 债券投资收益                 | 457.65       |

#### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回贵金属差价收入。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购贵金属差价收入。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2014年3月5日(基金合同生效日)至2014年6月30日 |
|-------------|-------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 264,693.50                          |
| 基金投资产生的股利收益 | -                                   |
| 合计          | 264,693.50                          |

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2014年3月5日(基金合同生效日)至2014<br>年6月30日 |
|------------|---|
| 1. 交易性金融资产 | 528,938.15                              |
| ——股票投资     | 424,407.67                              |
| ——债券投资     | 104,530.48                              |
| ——资产支持证券投资 | -                                       |
| ——贵金属投资    | -                                       |
| ——其他       | -                                       |
| 2. 衍生工具    | -                                       |
| ——权证投资     | -                                       |
| 3. 其他      | -                                       |
| 合计         | 528,938.15                              |

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2014年3月5日(基金合同生效日)至2014年6<br>月30日 |
|---------|---|
| 基金赎回费收入 | 146,965.17                              |
| 基金转换费收入 | 5.00                                    |
| 合计      | 146,970.17                              |

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2014年3月5日(基金合同生效日)至2014年6<br>月30日 |
|-----------|---|
| 交易所市场交易费用 | 880,997.00                              |
| 银行间市场交易费用 | 3,775.00                                |
| 合计        | 884,772.00                              |

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2014年3月5日(基金合同生效日)至2014年<br>6月30日 |
|-------|---|
| 审计费用  | 37,119.26                               |
| 信息披露费 | 97,289.82                               |

|      |            |
|------|------------|
| 其他   | 900.00     |
| 银行费用 | 12,330.93  |
| 合计   | 147,640.01 |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期无或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期无资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期没有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 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        |

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                                       |
|-----------------|--|
|                 | 2014 年 3 月 5 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,745,979.12                             |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 511,851.80                               |

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 0.9%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 X 0.9% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                                       |
|----------------|--|
|                | 2014 年 3 月 5 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 762,771.97                               |

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：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                                       |            |            |
|----------------|--|------------|------------|
|                | 2014 年 3 月 5 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日 |            |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                         |            |            |
|                | 泰达宏利养老混合 A                               | 泰达宏利养老混合 B | 合计         |
| 泰达宏利基金管理有限公司   | -  | 166,716.66 | 166,716.66 |
| 中国银行股份有限公司     | -  | 5,986.98   | 5,986.98   |
| 合计             | -  | 172,703.64 | 172,703.64 |

支付基金销售机构的销售服务费按 B 类基金份额前一日基金资产净值 0.3%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泰达宏利基金管理有限公司，再由泰达宏利基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 B 类基金份额销售服务费=前一日 B 类基金份额基金资产净值 X 0.3% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 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                                       |
|--|
| 2014 年 3 月 5 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 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           | -      | -    | -     | -    | 294,960,000.00 | 30,104.09 |

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

| 项目                        | 本期<br>2014年3月5日(基金合同生效日)至2014年6月30日 |            |
|---------------------------|-------------------------------------|------------|
|                           | 泰达宏利养老混合 A                          | 泰达宏利养老混合 B |
| 基金合同生效日(2014年3月5日)持有的基金份额 | 20,005,300.00                       | 0.00       |
| 期初持有的基金份额                 | 0.00                                | 0.00       |
| 期间申购/买入总份额                | 0.00                                | 0.00       |
| 期间因拆分变动份额                 | 0.00                                | 0.00       |
| 减：期间赎回/卖出总份额              | 0.00                                | 0.00       |
| 期末持有的基金份额                 | 20,005,300.00                       | 0.00       |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例         | 1.9364%                             | 0.0000%    |

##### 6.4.10.4.2 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未持有本基金。

##### 6.4.10.5 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<br>2014年3月5日(基金合同生效日)至2014年6月30日 |            |
|-------|-------------------------------------|------------|
|       | 期末余额                                | 当期利息收入     |
| 中国银行  | 12,893,628.66                       | 106,087.43 |

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。

##### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

##### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。



### 6.4.11 利润分配情况

#### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 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

| 6.4.12.1.1 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 |
| 002727               | 一心堂  | 2014 年 6 月 25 日 | 2014 年 7 月 2 日 | 新股流通受限 | 12.20 | 12.20  | 500      | 6,100.00 | 6,100.00 |    |

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 166,599,796.70 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码   | 债券名称     | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量（张）     | 期末估值总额         |
|--------|----------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 140212 | 14 国开 12 | 2014 年 7 月 1 日 | 100.17 | 1,700,000 | 170,289,000.00 |
| 合计     |          |                |        | 1,700,000 | 170,289,000.00 |

##### 6.4.12.3.2 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于较低风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理与基金评估部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理与基金评估部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核与法律事务部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行以及其他商业银行，与存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2014年6月30日 |
|--------|-------------------|
| A-1    | 120,345,000.00    |
| A-1 以下 | -                 |
| 未评级    | 139,832,000.00    |
| 合计     | 260,177,000.00    |

注：以上未评级的债券投资中包括国债、政策性金融债及央行票据，和超级短期融资券等。

### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2014年6月30日 |
|--------|-------------------|
| AAA    | 998,500.00        |
| AAA 以下 | 77,948,593.19     |
| 未评级    | 550,790,000.00    |
| 合计     | 629,737,093.19    |

注：以上未评级的债券投资中包括国债、政策性金融债及央行票据等。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2014年6月30<br>日 | 1年以内             | 1-5年          | 5年以上       | 不计息           | 合计               |
|-----------------------|------------------|---------------|------------|---------------|------------------|
| 资产                    |                  |               |            |               |                  |
| 银行存款                  | 12,893,628.66    | -             | -          | -             | 12,893,628.66    |
| 结算备付金                 | 318,195.77       | -             | -          | -             | 318,195.77       |
| 存出保证金                 | 10,145.23        | -             | -          | -             | 10,145.23        |
| 交易性金融资产               | 810,967,000.00   | 78,841,993.19 | 105,100.00 | 42,291,433.56 | 932,205,526.75   |
| 买入返售金融资产              | 270,000,180.00   | -             | -          | -             | 270,000,180.00   |
| 应收利息                  | -                | -             | -          | 5,270,537.22  | 5,270,537.22     |
| 应收申购款                 | -                | -             | -          | 20,574.06     | 20,574.06        |
| 资产总计                  | 1,094,189,149.66 | 78,841,993.19 | 105,100.00 | 47,582,544.84 | 1,220,718,787.69 |
| 负债                    |                  |               |            |               |                  |
| 卖出回购金融资产款             | 166,599,796.70   | -             | -          | -             | 166,599,796.70   |
| 应付证券清算款               | -                | -             | -          | 1,089,035.00  | 1,089,035.00     |
| 应付赎回款                 | -                | -             | -          | 10,477,778.98 | 10,477,778.98    |
| 应付管理人报酬               | -                | -             | -          | 693,297.82    | 693,297.82       |
| 应付托管费                 | -                | -             | -          | 192,582.74    | 192,582.74       |
| 应付销售服务费               | -                | -             | -          | 115,954.53    | 115,954.53       |
| 应付交易费用                | -                | -             | -          | 545,237.14    | 545,237.14       |
| 应付利息                  | -                | -             | -          | 13,668.23     | 13,668.23        |
| 其他负债                  | -                | -             | -          | 145,249.91    | 145,249.91       |
| 负债总计                  | 166,599,796.70   | -             | -          | 13,272,804.35 | 179,872,601.05   |
| 利率敏感度缺口               | 927,589,352.96   | 78,841,993.19 | 105,100.00 | 34,309,740.49 | 1,040,846,186.64 |
| 上年度末<br>2013年12月31日   | 1年以内             | 1-5年          | 5年以上       | 不计息           | 合计               |
| 资产                    |                  |               |            |               |                  |
| 负债                    |                  |               |            |               |                  |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 分析 | 相关风险变量的变动     | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                   |
|----|---------------|---------------------------------|-------------------|
|    |               | 本期末（2014年6月30日）                 | 上年度末（2013年12月31日） |
|    | 市场利率下降 25 个基点 | 2,120,000.00                    | -                 |
|    | 市场利率上升 25 个基点 | -2,110,000.00                   |                   |

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产占基金资产的比例为 0-30%，债券、正回购、逆回购、银行存款、货币市场工具、权证合计占基金资产的比例不低于 5%。保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2014年6月30日 |              |
|--------------|-------------------|--------------|
|              | 公允价值              | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产-股票投资 | 42,291,433.56     | 4.06         |

|               |               |      |
|---------------|---------------|------|
| 交易性金融资产—基金投资  | -             | -    |
| 交易性金融资产—债券投资  | -             | -    |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -             | -    |
| 衍生金融资产—权证投资   | -             | -    |
| 其他            | -             | -    |
| 合计            | 42,291,433.56 | 4.06 |

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

| 分析 | 相关风险变量的变动   | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |
|----|-------------|---------------------------------|
|    |             | 本期末（2014年6月30日）                 |
|    | 业绩比较基准上升 5% | 1,320,000.00                    |
|    | 业绩比较基准下降 5% | -1,320,000.00                   |

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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<br>比例（%） |
|----|-------------------|------------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 42,291,433.56    | 3.46             |
|    | 其中：股票             | 42,291,433.56    | 3.46             |
| 2  | 固定收益投资            | 889,914,093.19   | 72.90            |
|    | 其中：债券             | 889,914,093.19   | 72.90            |
|    | 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          | 270,000,180.00   | 22.12            |
|    | 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      | 13,211,824.43    | 1.08             |
| 7  | 其他各项资产            | 5,301,256.51     | 0.43             |
| 8  | 合计                | 1,220,718,787.69 | 100.00           |

## 7.2 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（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 26,601,467.10 | 2.56         |
| 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           | 6,100.00      | 0.00         |
| 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  | -             | -            |
| J  | 金融业              | 15,683,866.46 | 1.51         |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| 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        | -             | -            |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 42,291,433.56 | 4.06         |

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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  | 000625 | 长安汽车 | 1,000,000 | 12,310,000.00 | 1.18         |
| 2  | 000333 | 美的集团 | 500,000   | 9,660,000.00  | 0.93         |
| 3  | 600566 | 洪城股份 | 199,941   | 4,618,637.10  | 0.44         |
| 4  | 000001 | 平安银行 | 399,948   | 3,963,484.68  | 0.38         |
| 5  | 601939 | 建设银行 | 913,300   | 3,771,929.00  | 0.36         |

|    |        |      |           |              |      |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 6  | 601398 | 工商银行 | 1,000,000 | 3,390,000.00 | 0.33 |
| 7  | 601166 | 兴业银行 | 313,986   | 3,149,279.58 | 0.30 |
| 8  | 600016 | 民生银行 | 226,920   | 1,409,173.20 | 0.14 |
| 9  | 300385 | 雪浪环境 | 500       | 12,830.00    | 0.00 |
| 10 | 002727 | 一心堂  | 500       | 6,100.00     | 0.00 |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 000625 | 长安汽车 | 59,746,441.25 | 5.74            |
| 2  | 601398 | 工商银行 | 39,819,286.26 | 3.83            |
| 3  | 000333 | 美的集团 | 37,017,059.47 | 3.56            |
| 4  | 000651 | 格力电器 | 29,511,181.69 | 2.84            |
| 5  | 002005 | 德豪润达 | 28,732,439.35 | 2.76            |
| 6  | 600016 | 民生银行 | 23,699,917.00 | 2.28            |
| 7  | 000001 | 平安银行 | 23,376,177.53 | 2.25            |
| 8  | 601166 | 兴业银行 | 22,919,652.12 | 2.20            |
| 9  | 000858 | 五粮液  | 17,687,776.83 | 1.70            |
| 10 | 000002 | 万科A  | 16,598,720.16 | 1.59            |
| 11 | 601939 | 建设银行 | 11,999,796.00 | 1.15            |
| 12 | 600566 | 洪城股份 | 4,820,404.92  | 0.46            |
| 13 | 300385 | 雪浪环境 | 7,365.00      | 0.00            |
| 14 | 002727 | 一心堂  | 6,100.00      | 0.00            |

表中“买入金额”为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 000625 | 长安汽车 | 47,134,153.48 | 4.53            |
| 2  | 601398 | 工商银行 | 36,602,120.00 | 3.52            |
| 3  | 000651 | 格力电器 | 29,055,242.40 | 2.79            |
| 4  | 000333 | 美的集团 | 27,538,998.08 | 2.65            |
| 5  | 002005 | 德豪润达 | 27,162,873.62 | 2.61            |



|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 6  | 600016 | 民生银行 | 22,091,435.13 | 2.12 |
| 7  | 601166 | 兴业银行 | 19,858,000.00 | 1.91 |
| 8  | 000001 | 平安银行 | 19,589,000.00 | 1.88 |
| 9  | 000858 | 五粮液  | 17,561,158.47 | 1.69 |
| 10 | 000002 | 万科A  | 16,586,758.71 | 1.59 |
| 11 | 601939 | 建设银行 | 8,260,000.00  | 0.79 |

表中“卖出金额”为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 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 | 315,942,317.58 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 271,439,739.89 |

“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。

### 7.5 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      | 550,790,000.00 | 52.92        |
|    | 其中：政策性金融债 | 550,790,000.00 | 52.92        |
| 4  | 企业债券      | 78,947,093.19  | 7.58         |
| 5  | 企业短期融资券   | 260,177,000.00 | 25.00        |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债       | -              | -            |
| 8  | 其他        | -              | -            |
| 9  | 合计        | 889,914,093.19 | 85.50        |

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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  | 140207    | 14 国开 07     | 2,000,000 | 200,720,000.00 | 19.28        |
| 2  | 140212    | 14 国开 12     | 2,000,000 | 200,340,000.00 | 19.25        |
| 3  | 140213    | 14 国开 13     | 1,500,000 | 149,730,000.00 | 14.39        |
| 4  | 041452030 | 14 国电集 CP003 | 900,000   | 90,189,000.00  | 8.66         |

|   |        |          |         |               |      |
|---|--------|----------|---------|---------------|------|
| 5 | 112093 | 11 亚迪 01 | 710,009 | 70,929,189.09 | 6.81 |
|---|--------|----------|---------|---------------|------|

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 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。

#### 7.10.2 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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

#### 7.11.2 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。

#### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1

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。

#### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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   | 10,145.23    |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 5,270,537.22 |
| 5  | 应收申购款   | 20,574.06    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 5,301,256.51 |

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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  | 002727 | 一心堂  | 6,100.00    | 0.00          | 新股锁定     |

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别       | 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 |
| 泰达宏利养老混合 A | 2,179     | 262,074.89 | 383,643,262.94 | 67.18% | 187,417,932.21 | 32.82% |

|                            |       |            |                |        |                |        |
|----------------------------|-------|------------|----------------|--------|----------------|--------|
| 泰 达<br>宏 利<br>养 老<br>混 合 B | 644   | 717,506.56 | 437,849,090.42 | 94.76% | 24,225,137.00  | 5.24%  |
| 合计                         | 2,823 | 365,970.75 | 821,492,353.36 | 79.51% | 211,643,069.21 | 20.49% |

分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别       | 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 | 泰达宏利养老混合 A | 638,326.07 | 0.1118%  |
|                  | 泰达宏利养老混合 B | 116,456.62 | 0.0252%  |
|                  | 合计         | 754,782.69 | 0.0731%  |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                             | 份额级别       | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 泰达宏利养老混合 A | 10~50             |
|                                | 泰达宏利养老混合 B | 0                 |
|                                | 合计         | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 泰达宏利养老混合 A | 0                 |
|                                | 泰达宏利养老混合 B | 0                 |
|                                | 合计         | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                         | 泰达宏利养老混合 A     | 泰达宏利养老混合 B     |
|----------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2014 年 3 月 5 日）基金份 | 423,486,535.31 | 530,212,064.36 |

|                                    |                |                |
|------------------------------------|----------------|----------------|
| 额总额                                |                |                |
| 本报告期期初基金份额总额                       | -              | -              |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | 205,397,689.92 | 100,035,046.51 |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 57,823,030.08  | 168,172,883.45 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | -              | -              |
| 本报告期末基金份额总额                        | 571,061,195.15 | 462,074,227.42 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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、本公司于 2014 年 6 月 17 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于董事长及法定代表人变更的公告》，公司董事长及法定代表人变更为弓劲梅女士。

2、2014 年 6 月 20 日，经公司股东会批准，本公司独立董事由孔晓艳女士变更为杜英华女士。本变更事项已按规定向监管部门报备。

3、2014 年 2 月 14 日，本基金托管人发布公告，自 2014 年 2 月 13 日起，陈四清先生担任中国银行行长。

4、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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 |    |
| 东方证券 | 2      | 282,842,236.09 | 48.15%       | 257,500.23 | 48.15%     | -  |
| 中银国际 | 2      | 190,070,611.43 | 32.36%       | 173,041.18 | 32.36%     | -  |
| 湘财证券 | 1      | 114,455,744.95 | 19.49%       | 104,200.87 | 19.49%     | -  |
| 中航证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中山证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 江海证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 方正证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 华泰证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 南京证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 东海证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 招商证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国金证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 天源证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国联证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 银河证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 齐鲁证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 西南证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 渤海证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 安信证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 光大证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中信建投 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 广发证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 申银万国 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 财达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |

(一) 本基金为 2014 年新成立基金；2014 年上半年本基金以上席位均为自基金成立至本报告期末新增交易席位。

(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。

### 10.7.2 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 |
| 东方证券 | 962,204.63    | 1.19%        | -                | -              | -    | -            |
| 中银国际 | 5,656,936.54  | 6.99%        | 1,857,600,000.00 | 65.40%         | -    | -            |
| 湘财证券 | 74,158,457.70 | 91.69%       | 79,301,000.00    | 2.79%          | -    | -            |
| 中航证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 中山证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 江海证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 方正证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 华泰证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 南京证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 东海证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 招商证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 国金证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 天源证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 国联证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 银河证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 齐鲁证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 西南证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |

|      |            |       |                |        |   |
|------|------------|-------|----------------|--------|---|
| 渤海证券 | -          | -     | -              | -      | - |
| 安信证券 | -          | -     | -              | -      | - |
| 光大证券 | -          | -     | -              | -      | - |
| 中信建投 | -          | -     | -              | -      | - |
| 广发证券 | -          | -     | -              | -      | - |
| 申银万国 | -          | -     | -              | -      | - |
| 中金公司 | -          | -     | -              | -      | - |
| 中信证券 | -          | -     | -              | -      | - |
| 东北证券 | -          | -     | -              | -      | - |
| 财达证券 | -          | -     | -              | -      | - |
| 国泰君安 | 102,358.10 | 0.13% | 903,500,000.00 | 31.81% | - |
| 兴业证券 | -          | -     | -              | -      | - |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式                      | 法定披露日期     |
|----|--|-----------------------------|------------|
| 1  | 《泰达宏利基金管理有限公司关于运用自有资金认购泰达宏利养老收益混合型证券投资基金的公告》   | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 | 2014年2月22日 |
| 2  | 《泰达宏利养老收益混合型证券投资基金基金合同生效公告》                    | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 | 2014年3月6日  |
| 3  | 《泰达宏利养老收益混合型证券投资基金开放申购、赎回、转换入、转换出及定期定额投资业务的公告》 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 | 2014年5月29日 |

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照；



6、中国证监会要求的其他文件。

## 11.2 存放地点

本基金管理人或托管人的住所

## 11.3 查阅方式

基金投资者可在营业时间免费查阅，或基金投资者也可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）或登录本基金管理人互联网网址（<http://www.mfcteda.com>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泰达宏利基金管理有限公司：客户服务中心电话：400-698-8888（免长话费）或 010-66555662 网址：<http://www.mfcteda.com>

泰达宏利基金管理有限公司  
2014年8月26日