

## 泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金

## 2012年第二季度报告

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司  
基金托管人:中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期:2012年7月19日

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,并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定,于2012年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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更新。

本报告期间为2012年4月1日至2012年6月30日。

## §2 基金产品概况

基金简称 泰达宏利品质生活混合

交易代码 162211

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2009年4月9日

报告期末基金份额总额 278,001,487.26份

随着中国经济进入新的台阶,广大人民群众必然更加注重生活质量。本基金将重点把握消费升级的趋势,通过投资相关的受益行业和上市公司,充分分享中国经济平稳增长的成果,力争为投资者带来长期稳定的回报。

投资目标 本基金将结合宏观经济变化趋势,通过行业配置、资产配置、择时配置等投资策略,本基金将结合宏观经济变化趋势,货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性变化及投资风险管理策略,运用资产配置、久期管理、收益曲线等投资管理策略。

业绩比较基准 60%×沪深300指数收益率+40%×上证国债指数收益率。

风险收益特征 本基金属于中高风险、中高收益的混合型证券投资基金。

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 4,392,800.96

2.本期利润 23,392,244.51

3.加权平均基金份额本期利润 0.0602

4.期末基金资产净值 292,388,026.55

5.期末基金份额净值 1.052

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.基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 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

过去三个月 5.62% 0.86% 0.63% 0.67% 4.99% 0.19%

注:本基金的业绩比较基准:60%×沪深300指数收益率+40%×上证国债指数收益率。沪深300指数数据由上海和深圳证券交易所共同编制并发布,其成份股由沪深两市上市的900多家样本股中选择,沪深300指数由300只有代表性的上市股票组成,具有良好的市场代表性。上证国债指数以上海证券交易所上市的有固定利率国债为样本,按照国债发行机构、到期收益率、信用等级等综合因素选择,具有良好的市场代表性。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

注:本基金在2009年4月9日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时及本报告期末本基金的投资比例已达到基金合同规定的各项投资比例。

## §4 管理人报告

4.1 基金管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

4.3 报告期内,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。

4.3.1 公平交易专项说明

4.3.1.1 平等交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度,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操作,均严格执行,可操作性、可延续性、可执行性,交易部运用交易系统中的公平交易功能并按照实时价格执行,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。

风险管理部对于本报告期的公平交易执行情况进行数量统计。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。

4.3.1.2 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.3 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.4 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.5 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.6 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.7 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.8 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.9 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.10 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.11 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.12 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.13 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.14 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.15 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.16 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.17 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.18 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.19 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.20 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.21 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.22 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.23 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.24 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.25 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.26 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.27 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.28 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.29 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.30 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.31 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.32 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.33 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.34 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.35 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.36 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.37 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.38 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.39 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.40 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.41 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.42 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.43 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.44 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.45 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人建立了公平交易制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。

4.3.1.46 管理人对报告期内基金投资组合的公平交易情况的说明

本基金管理人