

基金管理人: 泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人: 交通银行股份有限公司
送出日期: 2 0 1 3 年 3 月 2 9 日

§ 1 重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经全体独立董事签字盖章,并经董事长签署。基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告、财务会计报告等内容,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,也不保证基金份额持有人资产不受损失。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基金合同。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。本报告期内基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。本报告期内基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本报告期内基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

2.1 基金简介

基金名称	泰达宏利风险预算混合
基金代码	162205
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2005年4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	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	192,541,357.67份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

本基金通过风险预算的投资策略,力争获取超过业绩比较基准的长期稳定回报,分享市场上带来的收益,控制市场向下的风险。

本基金的投资管理全面引一种全新的投资策略——风险预算。风险预算是指基金在投资组合构建和调整前基于对市场信心(度)的判断来分配风险,然后根据风险的分配结果来调整具体资产配置,使未来的投资组合满足风险预算的要求,也就是说投资组合在构建和调整前其风险就已锁定。风险预算的策略将体现在投资的各个环节。大量应用数量化的事前和事后的风险控制手段是本基金的重要特色。投资组合资产配置比例的一个重要参考来自于数量化的风险预算。

56%×新华巴克莱资本中国国债指数+15%×新华巴克莱资本中国机构债指数+10%×新华巴克莱资本中国企业债指数+20%×富时中国A200指数+50%×1年期银行定期存款利率(税后)

本基金属于风险较低的股票投资基金

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

本基金管理人及基金托管人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大违法违规行为。

泰达宏利风险预算混合型证券投资基金

2012 年 度 报 告 摘 要

所下降,有利于股票价值的抬升。按照目前的经济回升力度,我们预计周期性行业的盈利会有所回升,但整体上仍然处于微利的阶段,因此主要的投资标的还是在于优质成长股中,良好的行业竞争结构和商业模式将是这些成长股充分受益于经济企稳回升,盈利预计会有超预期表现,因此本基金在2013年仍将坚持对优质成长股的深入挖掘,努力为投资者带来超额回报。

4.6 管理人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总经理负责,成员包括董事长、投资总监、基金经理、风控负责人、运营负责人、信息技术负责人、法律合规负责人、基金运营部的相关人员,均具有丰富的工作经历,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并对相关品种品种估值的讨论,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。公司参与估值流程各环节均不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
根据本基金合同及基金的实际运作情况,2012年度应分配6,463,712.75元。本基金于2012年12月24日发布公告对2012年度进行分配,按照10月份基金份额派发1000%,权益登记日、除息日为2012年4月26日,红利发放日为2012年4月27日,共分配3,588,756.16元。根据本基金合同的规定,截至2012年4月4日内本基金2012年度进行分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规情况
2012年度,基金托管人在泰达宏利风险预算混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人报告期内本基金投资运作遵守程序、净值计算、利润分配等情况的说明
2012年度,泰达宏利基金管理有限公司在泰达宏利风险预算混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面遵照了基金合同,未发现损害基金份额持有人的行为。

5.3 托管人对上年度报告中财务信息内容的真实性、准确性和完整性发表意见
2012年度,由泰达宏利基金管理有限公司编制并经会计师事务所审计的有关泰达宏利风险预算混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容,投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

本基金2012年度财务报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者在阅读年度报告正文时,应同时阅读审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表
会计主体: 泰达宏利风险预算混合型证券投资基金
报告截止日: 2012年12月31日

单位: 人民币元

资产

2012年12月31日

2011年12月31日

负债:

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益:

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

所有者权益合计

2012年12月31日

2011年12月31日

7.2 利润表

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[2002]125号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税问题的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和相关业务,主要列示如下:

1) 以发行方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。
2) 对基金从证券市场取得的收入,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) 对基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,在基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定减按20%代扣代缴个人所得税。
4) 基金卖出股票按1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。
7.2.1 关联方关系

项目

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

当期发生的基金应支付的

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

当期发生的基金应支付的

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

当期发生的基金应支付的

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

当期发生的基金应支付的

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

当期发生的基金应支付的

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

当期发生的基金应支付的

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

当期发生的基金应支付的

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

当期发生的基金应支付的

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

当期发生的基金应支付的

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

当期发生的基金应支付的

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

当期发生的基金应支付的

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

当期发生的基金应支付的

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

当期发生的基金应支付的

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

当期发生的基金应支付的

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

当期发生的基金应支付的

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

当期发生的基金应支付的

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

当期发生的基金应支付的

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

当期发生的基金应支付的