

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  
公告日期:2013年3月29日

## § 1 重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的诚信声明及承诺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。本年度报告已经本基金的基金经理签字同意，并由基金托管人复核。

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日复核了本报表中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、托管协议和报告摘要等，并保证复核结果不存在虚假记载、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，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告财务数据经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者请见阅读。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

## § 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 泰达宏利风险预算混合型证券投资基金

基金代码 162205

基金运作方式 约定期限开放式

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，力争获取超越业绩

控制指标向下的收益，分享市场上带来的收益，

本基金的投资管理全面引进一种全新的投资策略——

风险预算。风险预算将本基金在投资组合构建和调整

前基于市场信心度的判断来分配风险，然后根据风

险的分层限制来调整具体的资产的投资策略，使未来的

投资组合满足风险预算的要求，也就是将投资组合在

构建和调整前的风险预算锁定。风险预算的策略将

现在投资的各个环节。大量应用数化化的事前和事后的

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来源自于数化的风险预算。

5%×新华巴克莱资本中国国债指数+10%×新华巴克莱

资本中国地方政府债指数+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)

本基金为风险较低的证券投资基金。

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 交通银行股份有限公司

姓名 曹树楠 施宇敏

信息披露负责人 联系电话 010-66577728 021-32169999

电子邮件 im@mfcteda.com zh\_jb@bankcomm.com

客户服务电话 400-69-88888 95599

传真 010-66577666 021-62701262

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 http://www.mfcteda.com

基金年度报告备置地点 基金管理人、基金托管人的住所

3. 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标 2012年 2011年 2010年

本期已实现收益 12,927,425.50 -7,801,136.18 -4,295,839.53

本期利润 20,748,314.87 -7,574,744.66 -10,560,737.69

加权平均基金份额本期期初 0.0949 -0.0344 -0.0590

本期基金份额净值增长率 9.74% -3.47% -4.73%

3.1.2 期末数据和指标 2012年末 2011年末 2010年末

本期可供分配基金份额利润 0.1030 0.0150 0.2730

期末基金资产净值 212,379,319.97 262,171,612.84 219,434,038.73

期末基金净值得数 1,103.00 1,015.00 1,273.00

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,本期末为本期实现收益加上本期已实现公允价值变动收益;

2.所有可供分配的利润包括基金期末持有的现金或现金等价物以及可认沽或认购基金份额的款项,计算计入费用后实际收益水平

要低于本期数据;

3.期末可供分配利润等于本期末资产负债表中未分配利润与本期利润中已实现部分的孰低数;

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

注:本基金份额净值增长率以每年基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

10%×新华巴克莱资本中国国债指数+10%×新华巴克莱

资本中国地方政府债指数+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)

注:1.本基金在基金期末及报告期末已满足基金合同规定的投资比例;

2.过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.2 基金合同生效以来基金份额净值增长率变化情况

注:1.本基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3 基金合同生效以来基金份额净值增长率变化情况

注:1.本基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2.过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.4 基金管理人对基金过往表现的说明

本基金管理人建立了严格的投资管理制度,严格执行相关制度规定。在投资管理活动中,公司

对不同投资品种,确保各投资组合在获得投资收益、建设和决策方面享有平等机会。在交易方面,

公司对不同投资品种,确保各投资组合在获得投资收益、建设和决策方面享有平等机会。在交易方面,

公司对不同投资品种,确保各投资组合在获得投资收益、建设和决策方面享有平等机会。在