

泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金

2012 年度报告摘要

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
送出日期: 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董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中的事实准确性、完整性承担责任。年度报告已经全体独立董事签字确认，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定，于2013年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策、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。

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的董事会及监事会对本报告了解详细内容，阅读年度报告正文。

基金合同当事人各方一致同意，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，投资者注意阅读。

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 泰达宏利聚利分级债券基金

基金代码 62215

基金运作方式契约型封闭式

基金合同生效日 2011年5月13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 1,582,104,870.50份

基金份额净值 1.00元

基金份额净值变动比例 -0.00%

基金份额上市的证券交易所 深圳证券交易所

上市日期 2011-07-08

下属分级基金的基金简称： 泰达宏利聚利A 泰达宏利聚利B

下属分级基金的交易代码： 150034 150035

报告期末下属分级基金的份额总额 1,107,473,410.47份 474,631,460.03份

2.2 基金产品说明

本基金主要投资于固定收益证券，在合理控制信用风险的基础上，通过积极

管理的策略，力求基金资产的长期稳定增值。

从利率、信用等角度深入挖掘信用债市场投资机会，在有效控制流动性风

险及信用风险的前提下，力争创造稳健收益。

业绩比较基准 中债企业债全价指数收益率×90%+中债国债全价指数收益率×10%

风险收益特征 本基金为较低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

泰达宏利聚利A 泰达宏利聚利B

下属分级基金的风险收益特征 聚利A份额将表现出低风险、预期收益相对稳定的特征；聚利B份额则表现出较高风险、预期收益相对较高的特征

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

姓名 曹植榆 唐葵徵

信息披露负责人 联系电话 010-66577728 010-66594855

电子邮箱 im@tfeda.com tgxpl@bank-of-china.com

客户服务电话 400-69-8888 95566

传真 010-66577666 010-66594942

3.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址: http://www.tfeda.com

基金管理人、基金托管人的住所 基金管理人住所: 北京市东城区建国门内大街7号泰达宏利基金管理有限公司 基金托管人住所: 北京市西城区复兴门内大街1号中国银行股份有限公司

基金年度报告备置地点 基金管理人、基金托管人的住所

3.5 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位: 人民币元

3.1 期间数据和指标

2012年 2011年5月13日(基金合同生效日) -2011年12月31日

本期已实现收益 180,314,031.91 34,788,001.63

本期利润 200,011,794.85 32,444,117.91

加权平均基金份额本期利润 0.1264 0.0205

本期基金份额净值增长率 12.34% 2.10%

3.2 期末数据指标

2012年末 2011年末

期末可供分配基金份额利润 0.1360 0.0205

期末基金份额净值 1,814,560,783.26 1,614,548,988.41

期末基金总份额 1,147 1.021

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，本期利润指报告期内利息收入、投资收益、其他收入扣除公允价值变动收益后的余额，本期可供分配利润不包括基金持有的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、金融负债、以及投资类衍生工具的公允价值变动损益。

2. 所列数据不包含持有人认购或申购基金的各项费用，计入费用后实际收益水平以所列示为准。

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

阶段 份额净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-②

过去三个月 2.78% 0.07% -0.23% 0.04% 3.01% 0.03%

过去六个月 3.23% 0.10% -1.18% 0.05% 3.30% 0.05%

过去一年 12.34% 0.12% 2.53% 0.08% 9.81% 0.04%

自基金合同生效日起至今 14.70% 0.12% 2.18% 0.10% 12.52% 0.02%

注: 1.本期业绩比较基准: 90%*中债企业债全价指数收益率+10%*中债国债全价指数收益率。

3.2.2 基金合同生效以来基金总份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注: 本基金业绩比较基准: 90%*中债企业债全价指数收益率+10%*中债国债全价指数收益率。

3.2.3 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.1 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.2 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.3 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.4 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.5 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.6 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.7 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.8 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.9 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.10 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.11 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.12 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.13 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.14 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.15 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.16 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.17 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.18 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.19 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.20 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.21 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.22 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.23 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.24 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.25 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.26 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.27 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.28 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.29 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.30 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.31 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.32 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3.33 自基金合同生效以来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

注: 本基金在基金末期及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。