

2013年3月29日 星期五

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
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高级管理人员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确认，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同约定，于2012年3月25日复核了本报表中的财务指标、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，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金的过往业绩并不代表其未来表现，投资者在作出投资决策前应仔细阅读该基金的招募说明书及其摘要。

本报告期未按季度披露年度报告全文，因年度报告经审计，华永华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，请投资者注意阅读。

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 泰达宏利中小盘股票

基金主代码 162214

基金运作方式 约定开放型

基金合同生效日 2011年1月26日

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

报告期末基金份额总额 1,451,297,974.73份

基金合同终止日期 不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 通过深入挖掘中小市值企业成长过程中蕴含的投资机会，获取企业成长价值，努力实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略 中小市值上市公司多处于快速成长阶段，往往具有较高的增长空间和预期。本基金将通过严格的行业基本面研究和积极主动的选股策略将企业的成长转化为基金的投资回报。

业绩比较基准 80%×中证100指数收益率+20%×上证国债指数收益率

风险收益特征 本基金主要为股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

信息披露负责人 姚鹤林 李芳菲

联系电话 010-66577728 010-66060069

电子邮箱 irm@mfcteda.com lifangfeng@china.com

客户服务电话 400-69-88888 95999

传真 010-66577666 010-63201816

2.4 信息披露方式

登载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1月26日(基金合同生效日)-2012年1月31日

本期已实现收益 -68,376,740.82 -298,640,705.95

本期利润 67,320,052.47 -364,174,033.14

加权平均基金份额本期利润 0.0442 -0.1766

本期基金份额净值增长率 5.24% -19.80%

3.1.2 期末数据和指标 2012年末 2011年末

期末可供分配基金份额利润 -0.2010 -0.1981

期末基金份额净值 1,224,755,309.90 1,342,795,524.06

期末基金份额净值增长率 0.844 -0.802

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)扣减相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益扣除本期发生的管理费、托管费后的余额,即为可供分配利润。2.所述基本份额净值不包括基本份额持有人认购或申购基金的各项费用,计算费用后实际收益水平以纸面列示为准;3.期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中利润的孰低数。

3.2 基金本期净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长率为正时的业绩比较基准收益率的正负偏离度 (%) 业绩比较基准收益率(%)

①-③ ②-④

过去三个月 2.30% 1.03% 3.27% 1.10% -0.97% -0.07%

过去六个月 0.24% 1.16% -2.61% 1.12% 2.85% 0.04%

过去一年 5.24% 1.15% 1.82% 1.19% 3.42% -0.04%

自基金合同生 -15.60% 1.07% 1.17% 1.17% -0.10%

注:本基金业绩比较基准:80%×中证700指数+20%×上证国债指数。中证700指数由中证指数有限公司编制,反映沪深两市上市的中型股的整体表现,与上证综指相比,更能代表市场的整体表现。同时本基金的定期定额投资计划按照国信债加权收益率作为其持有的定期定额投资计划的业绩比较基准。

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与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金额度内部分额比例(%)

基金额度外部分额比例(%)

基金额度内部分额比例(%)