

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:中国建设银行股份有限公司  
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董事声明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同意,并向董事会备案。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同约定,于2013年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务报告、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本基金,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。投资人投资于本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本年度报告摘要仅供投资者阅读,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

本报告期财务资料已经审计,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,请投资者注意查阅。

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 泰达宏利效率优先混合型(LOF)

基金主代码 162207

交易代码 162207

基金运作方式 上市契约型开放式(LOF)

基金合同生效日 2006年5月12日

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

报告期末基金份额总额 4,759,668,478.58份

基金合同存续期间 不定期

基金份额上市的证券交易所 深圳证券交易所

上市日期 2006-07-21

## 2.2 基金产品说明

投资目标 充分挖掘具有较高投资效率的上市公司,兼顾投资优质债券,力争为投资者创造出业绩比较基准的投资回报。

投资策略 基本策略采取“上而下”和“下而上”相结合的组合投资手段和方法,在正常的市场环境下不作主动地资产配置调整,股票及债券的资产配置比例保持在基准比例上下10%的范围内波动。本基金在股票投资策略上,强调在期间经济增长模式转换的大背景下,选择具有价值或者稳定性上升的资产收益较高的上市公司,即关注本公司经营的持续效率,注重公司对资产的使用效率以及对股东价值的创造。

业绩比较基准 60%×富时中国A600指数+35%×新华巴克莱资本中国国债指数+5%×同业存款利率。

风险收益特征 本基金的投资目标和投资范围决定了本基金属于风险较高的债券型证券投资基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

名称 泰达宏利基金管理有限公司 中国建设银行股份有限公司

姓名 曹桢桢 田青

信息披露负责人 联系电话 010-66577728 010-67595096

电子邮箱 irm@mfcteda.com tianq@cbcb.com

客户服务电话 400-69-88888 010-67595096

传真 010-66577766 010-66275853

## 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

金额单位:人民币元

## 3.1 期间数据和指标

名称 2012年 2011年 2010年

本期已实现收益 -205,109,428.54 -636,790,730.70 653,118,585.28

本期利润 343,636,586.36 -1,176,657,851.15 692,868,442.67

加权平均基金份额本期利润 0.0700 -0.2261 0.1287

本期基金份额净值增长率 9.59% -24.36% 16.27%

## 3.2 期末数据和指标

名称 2012年末 2011年末 2010年末

期末可供分配基金份额利润 0.3510 0.2838 0.5091

期末基金资产净值 3,648,893,746.66 3,534,836,940.11 5,043,264,504.46

期末基金份额净值 0.7667 0.6996 0.9249

注:本期已实现收益指基金本期和收入、股息收益、其他收入、不含扣去分红的变动收益扣除申购赎回费后的余额,本期利润指报告期内以公允价值计量的变动收益;本期利润与本期已实现收益变动收益后,本期利润将增加;本期可供分配利润不包括基本分红、利息收入或现金股利。

3.3 本期可分配利润等于期末资产净值减去未分配利润与本期利润之差额。

## 3.4 基金份额净值增长率及其同同期业比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.00% 5.54% 0.78% -5.54% 0.19%

过去六个月 -3.00% 1.00% 0.75% -4.00% 0.34%

过去一年 9.59% 1.10% 5.61% 3.98% 0.32%

过去两年 -3.62% 1.12% -13.63% 0.83% 10.01% 0.29%

过去五年 -25.02% 1.32% -24.57% 1.17% -0.45% 0.15%

自基金合同生效日起至今 84.40% 1.34% 80.99% 1.19% 3.41% 0.15%

注:本基金优选择混合型基金业绩比较基准:60%×富时中国A600指数+35%×新华巴克莱资本中国国债指数+5%×同业存款利率。

本基金属于混合型基金,因此根据本基金的投资范围采用富时中国A600指数、新华巴克莱资本中国国债指数以及同业存款利率作为本基金的业绩比较基准。

3.2 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比较基准收益率变动的比较

阶段 份额净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.00% 5.54% 0.78% -5.54% 0.19%

过去六个月 -3.00% 1.00% 0.75% -4.00% 0.34%

过去一年 9.59% 1.10% 5.61% 3.98% 0.32%

过去两年 -3.62% 1.12% -13.63% 0.83% 10.01% 0.29%

过去五年 -25.02% 1.32% -24.57% 1.17% -0.45% 0.15%

自基金合同生效日起至今 84.40% 1.34% 80.99% 1.19% 3.41% 0.15%

注:本基金优选择混合型基金业绩比较基准:60%×富时中国A600指数+35%×新华巴克莱资本中国国债指数+5%×同业存款利率。

本基金属于混合型基金,因此根据本基金的投资范围采用富时中国A600指数、新华巴克莱资本中国国债指数以及同业存款利率作为本基金的业绩比较基准。

3.3 过去五年基金的利润分配情况

自基金合同生效以来未进行利润分配。

## 3.4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及基金经理的履历

4.1.2 基金管理人对报告期内基金运作的总体评价

4.1.3 基金管理人对报告期内基金投资策略的说明

4.1.4 报告期内基金投资策略和操作分析

4.1.5 基金管理人对宏观经济、行业政策和市场走势的展望

4.1.6 基金管理人对估值方法的说明

4.1.7 基金管理人对报告期内基金费用的计提和核实用途的说明

4.1.8 基金管理人对报告期内利润分配的说明

4.1.9 基金管理人对报告期未进行利润分配的原因的说明

4.1.10 基金管理人对报告期未进行利润分配的合理性说明

4.1.11 基金管理人对报告期未进行利润分配的合规性说明

4.1.12 基金管理人对报告期未进行利润分配的法律依据

4.1.13 基金管理人对报告期未进行利润分配的特别说明

4.1.14 基金管理人对报告期未进行利润分配的其他说明

4.2 管理人对报告期内基金运作遵守法律法规的情况的说明

本报告期内,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,没有出现损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内基金交易价格影响因素的专项说明

4.3.1 评估期内基金的交易价格是否受到不公平交易行为的影响或有明显异常波动。

4.3.2 评估期内基金的交易价格是否受到内幕信息交易的影响或有明显异常波动。

4.3.3 评估期内基金的交易价格是否受到大额赎回的影响或有明显异常波动。

4.3.4 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.5 评估期内基金的交易价格是否受到基金规模的影响或有明显异常波动。

4.3.6 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.7 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.8 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.9 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.10 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.11 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.12 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.13 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.14 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.15 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.16 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.17 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.18 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.19 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.20 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.21 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.22 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.23 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.24 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.25 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.26 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.27 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.28 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.29 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.30 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.31 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.32 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.33 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.34 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.35 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.36 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.37 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。

4.3.38 评估期内基金的交易价格是否受到成份股停牌的影响或有明显异常波动。