

泰达宏利中证500指数分级证券投资基金

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

资产负债表
单位:人民币元
资产 负债和所有者权益
流动资产: 货币资金 3,132,993.90 12,738,721.98
交易性金融资产 528.71 136,921.95

本基金报告期内未通过关联交易方式进行债券回购交易
本基金报告期内未通过关联交易方式进行权证交易

当期发生的基金应支付的管理费
其中:支付销售机构的客户维护费
1,054,478.36 940,280.92

当期发生的基金应支付的托管费
210,895.71 188,056.19

关联方名称 2012年1月1日至2012年12月31日
2011年12月1日至2011年12月31日

2.1 基金基本情况
基金简称:泰达宏利500指数分级
基金代码:162216
基金运作方式:契约型开放式

投资目标
本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证500指数,力争获取与指数的跟踪误差较小,并将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。

投资策略
本基金采用指数复制完全复制方法,原则上按照标的指数成份股及其权重构建基金的投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,以达到跟踪和复制指数的目的。

业绩比较基准
中证500指数收益率*95%+中证500指数收益率*5%+1年期定期存款利率(税后)

风险收益特征
本基金为股票型指数基金,属于高风险、收益高的基金品种,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。

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

信息披露负责人:曹植
联系电话:010-66577228
电子邮箱:irm@mcteda.com

3.1 主要会计数据和财务指标
2012年 2011年12月1日至2011年12月31日
本期已实现收益 3,133,290.16 -1,336,899.32

3.2 基金净值表现
过去三个月 2.77% 1.39% 2.33% 1.37% 0.44% 0.02%
过去六个月 -5.02% 1.40% -5.21% 1.39% 0.19% 0.01%
过去一年 -1.40% 1.42% 0.56% 1.46% -1.96% -0.04%

3.3 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:中证500指数收益率*95%+1年期定期存款利率*5%

3.4 基金管理人及其主要人员情况
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

3.5 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

3.6 基金管理人及其主要人员情况
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

3.7 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

3.8 基金管理人及其主要人员情况
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

3.9 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

3.10 基金管理人及其主要人员情况
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

3.11 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

3.12 基金管理人及其主要人员情况
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

2.2 基金产品说明
本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证500指数,力争获取与指数的跟踪误差较小,并将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。

2.3 基金管理人及其主要人员情况
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

2.4 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

2.5 基金管理人及其主要人员情况
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

2.6 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

2.7 基金管理人及其主要人员情况
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

2.8 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

2.9 基金管理人及其主要人员情况
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

2.10 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

2.11 基金管理人及其主要人员情况
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

2.12 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

2.13 基金管理人及其主要人员情况
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

2.14 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

2.15 基金管理人及其主要人员情况
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

2.16 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

2.17 基金管理人及其主要人员情况
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

2.18 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

2.19 基金管理人及其主要人员情况
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

2.20 基金管理人及其主要人员情况
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

2.21 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

2.22 基金管理人及其主要人员情况
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

2.23 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

2.24 基金管理人及其主要人员情况
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

2.25 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

2.26 基金管理人及其主要人员情况
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

2.27 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

2.28 基金管理人及其主要人员情况
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

2.29 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

2.30 基金管理人及其主要人员情况
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

2.31 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

2.32 基金管理人及其主要人员情况
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

2.33 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

2.34 基金管理人及其主要人员情况
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

2.35 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

2.36 基金管理人及其主要人员情况
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

2.37 基金投资组合报告
截至2012年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资 46,670,066.58 4.87%

基金资产净值变动表
单位:人民币元
序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期初基金资产净值比例(%)

基金份额持有人户数及持有人结构
单位:人民币元
序号 名称 金额
1 存出保证金 526.71

基金份额持有人户数及持有人结构
单位:人民币元
序号 名称 金额
1 存出保证金 526.71