泰达宏利集利债券型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

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8月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月23日复核了本报告中的财务指标、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。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至2013年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利集利债券	
基金主代码	162210	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年9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	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,590,797,053.27份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	泰达宏利集利债券A	泰达宏利集利债券C
下属分级基金的交易代码:	162210	162299
报告期末下属分级基金的份额总额	909,571,559.98份	681,225,493.29份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险及保持流动性基础上,力求实现基金财产稳定的当期收益和长期增值的综合目标。
投资策略	(1)战略性资产配置策略:根据信心度对风险进行预估和分配,从而决定资产的分配。 (2)固定收益类品种投资策略:利率预期分析策略形成对未来市场利率变动方向的预期;凸性挖掘策略形成对收益率曲线形状变化的预期判断;信用分析策略对发债企业进行深入的信用及财务分析;对于含权债券,波动性交易策略对其所隐含的期权进行合理定价,并根据其价格的波动水平获得该债券的期权调整利差; (3)股票投资策略:新股申购策略根据股票市场整体估值水平,发行定价水平及一级市场资金供求及资金成本关系,制定相应的新股认购策略;二级市场股票投资策略主要关注具有持续分红能力特征的优质上市企业,在符合基金整体资产配置及本基金整体投资风格的前提下,采用"自下而上"的个股精选策略。 (4)权证投资策略:依据现代金融投资理论,计算权证的理论价值,结合对权证标的证券的基本面进行分析,评估权证投资价值。
业绩比较基准	90%×上证国债指数收益率+10%×中证红利指数收益率。
风险收益特征	属于具有较低风险收益特征的基金品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。

	泰达宏利集利债券A	泰达宏利集利债券C
下属分级基金的风险收益特征	属于具有较低风险收益特征的基金品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。	属于具有较低风险收益特征的基金品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曹桢桢	唐州徽
	联系电话	010-66577728	95566
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-69-88888	95566
传真		010-66577666	010-66594942

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.mfcteda.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

基金级别	泰达宏利集利债券A	泰达宏利集利债券C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日-2013年6月30日)	报告期(2013年1月1日-2013年6月30日)
本期已实现收益	42,774,450.80	41,610,622.11
本期利润	37,803,883.99	45,928,400.51
加权平均基金份额本期利润	0.0323	0.0386
本期基金份额净值增长率	3.42%	3.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0265	0.0072
期末基金资产净值	947,116,627.88	696,003,088.37
期末基金份额净值	1.0413	1.0217

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益

2.所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字

3.对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数

3.2 基金净值表现

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

泰达宏利集利债券A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.92%	0.27%	-1.44%	0.19%	0.52%	0.08%
过去三个月	1.16%	0.20%	-0.64%	0.17%	1.80%	0.03%
过去六个月	3.42%	0.15%	0.18%	0.17%	3.24%	-0.02%
过去一年	4.96%	0.12%	2.23%	0.15%	2.73%	-0.03%
过去三年	9.09%	0.24%	8.01%	0.14%	1.08%	0.10%
自基金合同生效起至今	15.33%	0.21%	18.76%	0.18%	-3.43%	0.03%

泰达宏利集利债券C

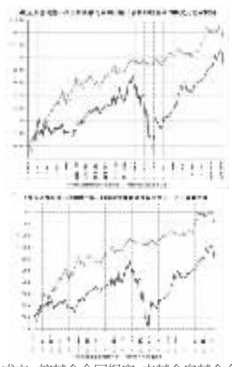
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.99%	0.27%	-1.44%	0.19%	0.45%	0.08%
过去三个月	1.02%	0.20%	-0.64%	0.17%	1.66%	0.03%
过去六个月	3.14%	0.15%	0.18%	0.17%	2.96%	-0.02%
过去一年	4.44%	0.12%	2.23%	0.15%	2.21%	-0.03%
过去三年	7.46%	0.24%	8.01%	0.14%	-0.55%	0.10%
自基金合同生效起至今	12.79%	0.21%	18.76%	0.18%	-5.97%	0.03%

注:集利债券基金业绩比较基准:90%×上证国债指数收益率+10%×中证红利指数收益率本基金采用上证国债指数及中证红利指数衡量基金的投资业绩,其主要原因如下:

上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本,按照国债发行量加权而成,具有良好的市场代表性。

中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市、现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的股票作为样本股,综合反映沪深证券市场高股息股票的整体状况和走势。

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及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金于2008年9月26日成立。按基金合同规定,本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第九条(三)投资范围、(四)投资策略和(八)投资限制中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司,成立于2002年6月,是中国首批合资基金管理公司之一。截至报告期末本公司股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司:51%;宏利资产管理(香港)有限公司:49%。

目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选基金、泰达宏利风险预算混合型基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型基金、泰达宏利首选企业股票型基金、泰达宏利市值优选股票型基金、泰达宏利集利债券型基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型基金、泰达宏利红利先锋股票型基金、泰达宏利中证财富大盘指数型基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金、泰达宏利全球新格局证券投资基金、泰达宏利中证500指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金、泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金在内的二十只证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
卓若伟	本基金基金经理,固定收益部副总经理	2012年5月22日	-	8	经济学硕士,毕业于厦门大学计统系。2004年7月至2006年9月任职于厦门市商业银行资金营运部,从事债券交易与研究工作;2006年10月至2009年5月就职于建信基金管理有限公司专户投资部任投资经理;2009年5月起就职于诺安基金管理有限公司,任基金经理助理,2009年9月至2011年12月任诺安增利债券型证券投资基金基金经理,2011年12月加入泰达宏利基金管理有限公司,担任固定收益部副总经理,具有8年基金从业经验,具有基金从业资格。
熊壮	本基金基金经理	2013年5月27日	-	5	金融学硕士;2008年7月至2012年11月任职于中国国际金融有限公司固定收益部,从事债券研究与投资交易工作;2012年11月加入泰达宏利基金管理有限公司,担任固定收益部基金经理助理;具备5年证券投资管理经验,1年基金从业经验,具有基金从业资格。

注:1、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对泰达宏利集利债券型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:泰达宏利集利债券型证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	222,235,497.01	107,716,965.85
结算备付金	36,625,766.39	25,343,493.76
存出保证金	37,879.02	250,000.00
交易性金融资产	2,405,683,916.40	3,406,218,926.21
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	2,405,683,916.40	3,406,218,926.21
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	57,936,495.48
应收利息	47,710,228.87	73,296,304.77
应收股利	-	-
应收申购款	36,010,962.72	205,068,682.32
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,748,304,250.41	3,875,830,868.39
负债和所有者权益	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	885,217,824.35	888,513,806.80
应付证券清算款	214,722,233.52	224,511,554.11
应付赎回款	610,822.09	4,974,470.77
应付管理人报酬	1,217,023.40	1,294,622.31
应付托管费	405,674.45	431,540.79
应付销售服务费	316,496.41	520,449.86
应付交易费用	45,009.80	24,861.34
应交税费	1,500,760.66	702,746.00
应付利息	967,890.60	315,917.45
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	180,798.88	336,542.34
负债合计	1,105,184,534.16	1,121,626,511.77
所有者权益:		
实收基金	1,590,797,053.27	2,603,287,477.58
未分配利润	52,322,662.98	150,916,879.04
所有者权益合计	1,643,119,716.25	2,754,204,356.62
负债和所有者权益总计	2,748,304,250.41	3,875,830,868.39

注:报告截至日2013年6月30日,基金份额总额 1,590,797,053.27份,其中下属A类基金份额 909,571,559.98份,C类基金份额 681,225,493.29份。下属A类基金份额净值1.0413元,C类基金份额净值1.0217元。

6.2 利润表

会计主体:泰达宏利集利债券型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	122,300,937.24	48,750,869.89
1.利息收入	82,318,475.45	18,156,719.17
其中:存款利息收入	539,054.45	197,288.19
债券利息收入	81,604,473.47	17,959,430.98
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	174,947.53	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	39,832,530.20	4,870,553.01
其中:股票投资收益	-	29,358.75
基金投资收益	-	-
债券投资收益	39,832,530.20	4,841,194.26
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-652,788.41	25,479,452.00
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	802,720.00	244,145.71
减:二、费用	38,568,652.74	7,848,386.35
1.管理人报酬	7,576,562.73	1,639,109.32
2.托管费	2,525,520.93	546,369.76
3.销售服务费	2,545,632.93	526,276.46
4.交易费用	68,665.30	38,384.95
5.利息支出	25,609,322.76	4,911,336.06
其中:卖出回购金融资产支出	25,609,322.76	4,911,336.06
6.其他费用	242,948.09	186,909.80
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	83,732,284.50	40,902,483.54
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	83,732,284.50	40,902,483.54

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰达宏利集利债券型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,603,287,477.58	150,916,879.04	2,754,204,356.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	83,732,284.50	83,732,284.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-1,012,490,424.31	7,828,840.54	-1,004,661,583.77
其中:1.基金申购款	4,447,179,204.25	345,960,168.89	4,793,139,373.14
2.基金赎回款	-5,459,669,628.56	-338,131,328.35	-5,797,800,956.91
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-190,155,341.10	-190,155,341.10
五、期末所有者权益(基金净值)	1,590,797,053.27	52,322,662.98	1,643,119,716.25
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	65,443,934.72	-1,091,781.50	64,352,153.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	40,902,483.54	40,902,483.54
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	1,276,054,153.00	21,391,762.78	1,297,445,915.78
其中:1.基金申购款	2,385,207,565.95	58,028,583.59	2,443,236,149.54
2.基金赎回款	-1,109,153,412.95	-36,636,820.81	-1,145,790,233.76
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,341,498,087.72	61,202,464.82	1,402,700,552.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

刘肯山 傅国庆 王泉

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰达宏利集利债券型证券投资基金(以下简称"本基金",原泰达荷银集利债券型证券投资基金)经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2008]第955号《关于核准泰达荷银集利债券型证券投资基金募集的批复》核准,由泰达荷银基金管理有限公司(于2010年3月9日更名为泰达宏利基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达荷银集利债券型证券投资基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,293,797,894.35元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第140号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达荷银集利债券型证券投资基金基金合同》于2008年9月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,294,126,340.90份基金份额,其中认购资金利息折合328,446.55份基金份额。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行")。

根据本基金的基金管理人2010年3月17日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于变更公司旗下公募基金名称的公告》,本基金自公告发布之日起更名为泰达宏利集利债券型证券投资基金。

根据《泰达宏利集利债券型证券投资基金基金合同》和《泰达宏利集利债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金自募集期起根据申购费用、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用的,称为A类;新增不收取前端申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金类别,称为C类。本基金A类、C类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,在基金管理人认为合适的情况下,基金管理人可以根据相关法律法规的规定,提供本基金不同基金份额类别之间的转换服务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利集利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国债、央行票据、金融债、企业(公司)债、资产支持证券、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、债券回购等固定收益类金融工具,以及股票、权证等权益类品种和法律法规及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金资产配置的比例范围是:本基金投资于债券类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的80%,在一般情况下,基金资产将主要投资于企业(公司)债、金融债、可转换债券、国债及央行票据等。投资于股票等权益类证券的比例不超过基金资产的20%,其中包括参与一级市场新股申购、投资二级市场股票、持有可转换公司债券转股后所得股票以及权证等。基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:上证国债指数收益率×90%+中证红利指数收益率×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司于2013年8月27日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和138项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利集利债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2013年6月30日的财务状况以及2013年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策的变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计的变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。2013年1月1日以前,对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。自2013年1月1日起,对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期没有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人、基金代销机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,576,562.73	1,639,109.32
其中:支付销售机构的客户维护费	433,954.88	110,929.01

注:支付基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.60%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,525,520.93	546,369.76

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值 X0.20%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利集利债券A	泰达宏利集利债券C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	1,604,899.69	1,604,899.69
中国银行股份有限公司	-	220,628.96	220,628.96
合计	-	1,825,528.65	1,825,528.65
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利集利债券A	泰达宏利集利债券C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	367,812.46	367,812.46
中国银行股份有限公司	-	75,215.31	75,215.31
合计	-	443,027.77	443,027.77

注:支付基金销售机构的销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给泰达宏利基金管理有限公司,再由泰达宏利基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日C类基金份额销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值 X 0.40%/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	90,079,786.99	-	-	-	987,100,000.00	267,566.43
	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日					
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	10,026,861.51	-	-	-	409,060,000.00	106,841.26

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	泰达宏利集利债券A	泰达宏利集利债券C
基金合同生效日(2008年9月26日)持有的基金份额	0.00	-
期初持有的基金份额	9,987,015.58	-
期间申购/买入总份额	0.00	-
期间因拆分变动份额	0.00	-
减:期间赎回/卖出总份额	0.00	-
期末持有的基金份额	9,987,015.58	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.63%	-

项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	泰达宏利集利债券A	泰达宏利集利债券C
基金合同生效日(2008年9月26日)持有的基金份额	0.00	-
期初持有的基金份额	9,987,015.58	-
期间申购/买入总份额	0.00	-
期间因拆分变动份额	0.00	-
减:期间赎回/卖出总份额	0.00	-
期末持有的基金份额	9,987,015.58	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.74%	-

注:本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未运用固有资金新增投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	222,235,497.01	237,230.33	31,035,943.12	120,086.94

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新股或增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30日止,本基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额210,699,163.95元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
1280320	12宜昌财投债	2013年7月2日	103.79	600,000	62,274,000.00
1380148	13建发房产	2013年7月2日	100.28	210,000	21,058,800.00
130308	13进出08	2013年7月4日	99.36	300,000	29,808,000.00
1080053	10首旅债	2013年7月9日	98.97	500,000	49,485,000.00
130201	13国开01	2013年7月9日	99.45	200,000	19,890,000.00
130218	13国开18	2013年7月9日	99.43	300,000	29,829,000.00
合计				2,110,000	212,344,800.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额674,518,660.40元,于2013年11月8日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	2,405,683,916.40	87.53
	其中:债券	2,405,683,916.40	87.53
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	258,861,263.40	9.42
6	其他各项资产	83,759,070.61	3.05
7	合计	2,748,304,250.41	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票资产。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票资产。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票资产的买卖交易。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票资产的买卖交易。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票资产的买卖交易。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	79,527,000.00	4.84
	其中:政策性金融债	79,527,000.00	4.84
4	企业债券	1,909,447,716.40	116.21
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	412,883,000.00	25.13
7	可转债	3,826,200.00	0.23
8	其他	-	-
9	合计	2,405,683,916.40	146.41

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位: