

泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

作为指数基金,本基金将积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,有效跟踪跟踪误差,并在此基础上适当采用量化投资策略增强指数,力争为投资者获取超额收益。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
 本基金管理人按照相关法律法规规定,设有估值委员会,并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的副总经理负责,成员包括督察长、投资总监、基金经理及研究部、交易部、固定收益部、监察稽核部、金融工程部、风险管理部、基金运营部的相关人员,均具有丰富的专业工作经历,具备良好的专业经验和专业胜任能力。基金经理参与估值委员会对相关停牌品种估值的讨论,发表相关意见和建议,但未涉及停牌品种的基金经理不参与最终的投票表决。本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高原则。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
 根据本基金基金合同及基金的实际运作情况,本基金于本报告期内未进行收益分配。

§ 5 托管人报告

1.1 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(以下简称“本托管人”)在对泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金(以下简称“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的利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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
 本报告中的财务报告、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“金融工具风险及投资管理”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:泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金
 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	9,514,964.65	16,588,535.31
衍生金融资产	609,308.13	288,000.71
存出保证金	36,829.56	250,600.00
交易性金融资产	178,621,497.28	295,142,392.89
其中:股票投资	178,621,497.28	295,142,392.89
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	12,869,546.50	1,329,313.80
应收利息	2,194.85	3,450.28
应收股利	616,495.32	-
应收申购款	63,948.98	80,531.98
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	202,334,785.27	313,682,824.97
负债和所有者权益		
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	-	-
应付证券清算款	-	1,430,630.34
应付赎回款	13,668,053.23	241,623.71
应付管理人报酬	116,887.72	141,890.80
应付托管费	21,579.25	26,195.25
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	211,013.39	305,917.79
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	241,766.18	322,364.35
负债合计	14,259,299.77	2,468,622.24
所有者权益:		
实收基金	233,144,211.39	334,305,692.76
未分配利润	-45,068,725.89	-23,091,490.03
所有者权益合计	188,075,485.50	311,214,202.73
负债和所有者权益总计	202,334,785.27	313,682,824.97

注:截至2013年6月30日,基金份额净值0.807元,基金份额总额233,144,211.39份。

6.2 利润表
 会计主体:泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金
 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	-24,718,425.25	27,481,817.05
1.利息收入	54,320.54	88,166.84
其中:存款利息收入	54,320.54	88,166.84
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	26,565,357.39	-39,409,827.16
其中:股票投资收益	23,212,046.21	-44,294,097.84
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
利息收入	3,353,311.18	4,884,270.68
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-51,494,819.49	66,578,181.18
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,556,716.31	225,296.19
减:二、费用	1,938,831.67	3,556,608.43
1.管理人报酬	854,013.85	1,325,552.39
2.托管费	157,664.08	244,717.27
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	710,597.31	1,738,042.88
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	216,556.43	248,295.89
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-26,657,256.92	23,925,208.62
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-26,657,256.92	23,925,208.62

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
 会计主体:泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金
 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	
	实收基金	未分配利润	实收基金	未分配利润
一、期初所有者权益(基金净值)	334,305,692.76	-23,091,490.03	311,214,202.73	-26,587,252.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-26,657,256.92	-	-26,657,256.92
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(本期申购-赎回及转换等)	-101,161,481.37	4,680,021.06	-96,481,460.31	-
其中:1.基金申购款	42,807,032.36	-1,506,733.74	41,300,298.62	-
2.基金赎回款	-143,968,513.73	6,186,767.80	-137,781,758.93	-
四、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动(净额减少以“-”号填列)	-	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	233,144,211.39	-45,068,725.89	188,075,485.50	-

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:
 基金管理人: 刘智勇 傅国英 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 基金基本情况
 泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监基金字[2010]176号《关于核准泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金募集的批复》核准,由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《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》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基金利息共募集1,165,036,951.93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[2010]092号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同于2010年4月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,165,158,636.81份基金份额,其中认购资金及利息合计121,684.88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《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中投资于股票资产的比例不低于基金资产的90%,投资组合中投资于中证财富大盘指数成份股资产的比例不低于投资资产净值的90%,现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的投资业绩比较基准为:中证财富大盘指数收益率*95%+同业存款利率*5%。

本基金投资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日批准成立。
 6.4.2 会计政策的编制基础
 本基金的财务报表按照按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则,其后颁布的企业会计准则解释和其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券业协会《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>》、中国证监会公告于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同和在财务报表附注6.4.4所列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制定。

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年上半年度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保持一致的说明

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保持一致。

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]109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、债券的差价收入免征企业所得税和企业所得税。
 3) 对基金取得的股票股息收入,由发行股票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日起,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)者,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)者,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。

6.4.7 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。
 6.4.7.1 关联方关系
 6.4.7.1.1 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
 本基金本报告期不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相关方

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 支付关联方款项的佣金
 本基金本报告期及上年度可比期间均无支付关联方的佣金。
 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基金管理费	854,013.85	1,325,552.39
其中:支付销售机构的客户维护费	89,700.43	91,974.28

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0.65%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 0.65% / 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	157,664.08	244,717.27

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的12%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 X 0.12% / 当年天数。
 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(回购)交易
 本基金本报告期及上年度可比期间内均无与关联方进行的银行间同业市场的债券(回购)交易。
 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
 本基金的基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。
 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况
 本基金除基金管理人以外的其他关联方在本报告期末及上年度均未持有本基金。
 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
中国银行	9,514,964.65	17,362,728.77
期末余额	9,514,964.65	17,362,728.77
当期利息收入	49,901.64	81,275.36

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 0013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
 金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	期末停牌日期	停牌原因	期末估值价格	复牌日期	复牌开盘价	数量(股)	期末成本	期末估值总额	备注
6019	中国银行	2013年5月17日	重大事项公告	4.52	-	-	213,000	1,019,324.31	962,760.00	-
0006	强电	2013年8月13日	重大事项公告	4.80	2013年8月18日	5.09	108,871	571,876.76	522,580.80	-
6005	山东黄金	2013年4月13日	重大事项公告	32.13	2013年4月18日	28.77	15,347	575,456.84	493,099.11	-
0009	黄海矿业	2013年3月31日	重大事项公告	29.60	2013年8月19日	26.51	1,574	48,661.20	46,590.40	-

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
 本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。
 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购
 本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。
 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	178,621,497.28	88.28
	其中:股票	178,621,497.28	88.28
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券投资	-	-
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	10,124,272.78	5.00
6	其他各项资产	13,589,015.21	6.72
7	合计	202,334,785.27	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合
 7.2.1 期末按行业分类的股票投资组合
 金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	采矿业	12,739,545.16	6.77
C	制造业	44,871,417.23	23.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,376,297.57	2.86
E	建筑业	8,258,199.44	4.39
F	批发和零售业	4,720,288.46	2.51
G	交通运输、仓储和邮政业	5,033,296.42	2.68
H	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,010,220.38	1.60
J	金融业	79,949,288.24	42.51
K	房地产业	13,240,346.19	7.04
L	租赁和商务服务业	36,504.51	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施服务业	59,794.52	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	1,326,299.16	0.71
	合计	178,621,497.28	94.97

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合
 本基金本报告期末未持有积极投资股票。
 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细
 7.3.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细
 7.3.2 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
 金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	1,408,596	12,071,667.72	6.42
2	600000	浦发银行	1,256,462	10,403,505.36	5.53
3	601328	交通银行	2,549,927	10,378,386.04	5.52
4	601166	兴业银行	674,488	9,962,187.76	5.30
5	600015	华夏银行	759,761	6,853,044.22	3.64
6	600036	招商银行	421,297	4,888,205.20	2.60
7	601288	XD农业银行	1,890,279	4,086,036.34	2.47
8	600030	中信证券	410,319	4,056,531.47	2.21
9	600028	中国石化	947,476	3,960,449.68	2.11
10	601318	中国平安	112,447	3,908,675.72	2.08

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有投资明细,应阅读登载于本公司网站的半年度报告正文。
 7.3.3 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
 本基金本报告期末未持有积极投资股票。
 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
 金额单位:人民币元

序号	股票代码	
----	------	--