

---

---

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

5.9.2 本基金本报告期投资的股指期货政策

本基金投资于股指期货时，该策略符合基金合同的规定。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

在本报告期内，本基金未投资于国债期货。该说明符合基金合同的规定。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

5.10.3 本期国债期货投资策略

本基金本报告未有投资国债期货。

5.11 报告期末投资组合附注

5.11.1

5.11.1.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同约定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	472,496.70
2	应收证券清算款	15,312,661.17
3	应收股利	-
4	应收利息	1,711,684.87
5	应收申购款	7,216.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,504,058.84

5.11.3.1 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值(元)	占基金资产 净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300318	博创新创	48,388,030.20	5.63	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分量和之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	871,775,174.17
报告期期间基金总申购份额	2,559,284.38
减：报告期期间基金总赎回份额	106,776,647.57
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期末基金份额总额	767,557,810.98

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金的管理人持有本基金份额变动情况：

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金购买本基金。

8 影响投资者决策的其他重要信息

1、本公司于2014年6月17日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于董事及法定代表人变更的公告》，公司董事长李强先生变更为刘旭梅女士。

2、2014年6月20日，经公司董事会批准，公司独立董事由孔晓雄女士变更为杜华英女士。本变更事项已按规定向监管机构报备。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准泰达宏利证券投资基金募集证券投资基金设立的文件；

2、《泰达宏利前湾企业股票型证券投资基金招募说明书》；

3、《泰达宏利前湾企业股票型证券投资基金招募说明书》；

4、《泰达宏利前湾企业股票型证券投资基金托管协议》；

9.2 存放地点

基金管理人及基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资人可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）或登录基金管理人互联网网站（http://www.fundtoad.com）查询。

泰达宏利基金管理有限公司  
2014年7月21日

6.8 报告期末公允价值下基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明  
本基金本报告期末未持有权证。  
6.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
6.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。  
6.9.2 本基金投资的股指期货的投资政策  
本基金本报告期未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。  
6.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
6.10.1 本期国债期货投资策略  
本基金本报告期未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。  
6.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。  
6.10.3 本期国债期货投资评价  
本基金本报告期没有投资国债期货。  
6.11 投资组合报告附注  
6.11.1 报告期内前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
6.11.2 报告期内被调查的前十名股票均未超出基金合同约定的备选股票库。  
6.11.3 其他资产构成

序号	代码	名称	金额(元)	
1	存出保证金		244,284.10	
2	应收证券清算款		17,975,191.86	
3	应收股利		-	
4	应收利息		6,157,678.90	
5	应收申购款		17,792.55	
6	其他应收款		-	
7	待摊费用		70,575.59	
8	其他		-	
9	合计		24,465,523.00	

6.12 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	113001	中行转债	301,756,455.00	9.83
2	113002	工行转债	299,690,144.00	9.76
3	110015	石化转债	193,635,557.40	6.31
4	128002	东华转债	7,435,011.60	0.24
5	110018	国电转债	2,276,091.60	0.07

6.13 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。  
6.14 投资组合报告附注的其他文字描述部分  
由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.6 开放式基金份额变动

单位：份	
报告期期初基金份额总额	3,300,344,367.56
报告期期间基金总申购份额	9,345,845.76
减：报告期期间基金总赎回份额	147,490,805.19
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期末基金份额总额	3,162,199,408.13

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金的情况变动说明  
本基金的基金管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。  
7.2 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内未运用固有资金投资本基金。

5.8 影响投资者决策的其他重要信息

1、本公司于2014年6月17日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于董事长及法定代表人变更的公告》，公司董事长及法定代表人变更为刘凤军先生。  
2、2014年6月20日，经公司股东会批准，本公司独立董事孔庆旭女士变更为杜英女士。本变更事项已按规定向监管机构报备。  
5.9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰达宏利费率优惠联合证券投资基金(LOF)设立的文件；
- 2、《泰达宏利费率优惠联合证券投资基金(LOF)基金合同》；
- 3、《泰达宏利费率优惠联合证券投资基金(LOF)招募说明书》；
- 4、《泰达宏利费率优惠联合证券投资基金(LOF)托管协议》。

9.2 存放地点  
基金管理人和基金托管人的住所。  
9.3 查阅方式  
投资人可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）或登录基金管理人互联网网站（http://www.mtfchina.com）查阅。

泰达宏利基金管理有限公司