

信息披露Disclosure

泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金

2014年半年度报告摘要

别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税法法规和实际操作,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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入、股权的股息、红利收入、债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。
(3)对基金取得的国债利息收入,由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,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。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。
(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
(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方披露

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
交通银行股份有限公司	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进行。
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

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的报酬	11,870,209.51	12,222,012.08
其中:支付给销售机构的客户维护费	2,111,348.94	2,141,012.08

注:对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1.5%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×1.5%÷当年天数。
6.4.8.2.2 基金托管费
注:对基金托管人交通银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25%÷当年天数。
6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券交易的情况

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,978,381.51	2,037,001.99

支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25%÷当年天数。
6.4.8.3.1 与关联方进行银行间同业市场的债券交易的情况

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,978,381.51	2,037,001.99

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.8.4.1 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本基金的管理人在本报告期及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。
6.4.8.4.2 报告期末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间及上年度末均未持有本基金。
6.4.8.5 与关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
交通银行	14,495,396.49	207,948.02
利息收入	195,512,706.19	199,246.16

注:本基金的银行存款存放在基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。
6.4.8.6 本基金在承销期间参与关联方承销的情况
本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期间参与关联方承销情况。
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(2014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/增发证券于期末持有的流通受限证券

基金代码	基金名称	认购数量(单位:股)	期末成本(元)	期末公允价值(元)	备注
300058	泰达宏利中证500指数分级证券投资基金	42.00	25.25	155.964	3,275,244.00
007277	泰达宏利中证500指数分级证券投资基金	12.20	12.20	4.394	53,606.80

注:蓝色光标非公开发行股票价格为每股4200元。在锁定期期间于2014年5月30日进行权益分配,每10股派发2元(含税),每股派发0.2元。本次权益分配后认购买入成本为每股21.00元。

基金代码	基金名称	认购数量(单位:股)	期末成本(元)	期末公允价值(元)	备注
09063	泰达宏利中证500指数分级证券投资基金	31.99	31.99	35.19	73
09063	泰达宏利中证500指数分级证券投资基金	31.99	31.99	35.19	73

6.4.9.2 期末持有的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
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
本基金本报告期无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

基金代码	基金名称	认购数量(单位:股)	期末成本(元)	期末公允价值(元)	备注
09063	泰达宏利中证500指数分级证券投资基金	31.99	31.99	35.19	73
09063	泰达宏利中证500指数分级证券投资基金	31.99	31.99	35.19	73

7.1 期末基金资产组合情况
7.1.1 股票资产组合
7.1.2 债券资产组合
7.1.3 货币市场基金组合
7.1.4 其他资产组合
7.1.5 其他资产组合

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600637	万科B	981,384,796.39	63.51	
2	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
3	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
4	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
5	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
6	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
7	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
8	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
9	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
10	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
11	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
12	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
13	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
14	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
15	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
16	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
17	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
18	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
19	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
20	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
21	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
22	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
23	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
24	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
25	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
26	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
27	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
28	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
29	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
30	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
31	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
32	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
33	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
34	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
35	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
36	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
37	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
38	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
39	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
40	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
41	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
42	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
43	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
44	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
45	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
46	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
47	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
48	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
49	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
50	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
51	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
52	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
53	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
54	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
55	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
56	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
57	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
58	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
59	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
60	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
61	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
62	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
63	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
64	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
65	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
66	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
67	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
68	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
69	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
70	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
71	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
72	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
73	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
74	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
75	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
76	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
77	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
78	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
79	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
80	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
81	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
82	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
83	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
84	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
85	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
86	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
87	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
88	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
89	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
90	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
91	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
92	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
93	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
94	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
95	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
96	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
97	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
98	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
99	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	
100	000001	平安银行	981,384,796.39	63.51	

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600446	金证股份	4,550.17	139,070,596.58	9.08
2	000031	深赛格	4,409.29	125,573,123.80	8.15
3	300010	达安基因	4,092.43	109,076,274.96	6.82
4	300010	达安基因	3,772.94	94,020,518.48	6.07
5	002292	奥飞娱乐	2,447.48	89,817,671.66	5.83
6	600532	白云山	3,195.53	77,570,886.15	5.04
7	600030	中国国贸	24,015.60	77,570,886.15	5.04
8	300073	和佳股份	1,856.82	57,084,558.20	3.61
9	300121	瀚叶股份	2,170.013	49,049,694.16	3.19
10	300315	掌趣科技	2,091.34	48,067,403.84	3.12

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600446	金证股份	4,550.17	139,070,596.58	9.08
2	000031	深赛格	4,409.29	125,573,123.80	8.15
3	300010	达安基因	4,092.43	109,076,274.96	6.82
4	300010	达安基因	3,772.94	94,020,518.48	6.07
5	002292	奥飞娱乐	2,447.48	89,817,671.66	5.83
6	600532	白云山	3,195.53	77,570,886.15	5.04
7	600030	中国国贸	24,015.60	77,570,886.15	5.04
8	300073	和佳股份	1,856.82	57,084,558.20	3.61
9	300121	瀚叶股份	2,170.013	49,049,694.16	3.19
10	300315	掌趣科技	2,091.34	48,067,403.84	3.12

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600446	金证股份	4,550.17	139,070,596.58	9.08
2	000031	深赛格	4,409.29	125,573,123.80	8.15
3	300010	达安基因	4,092.43	109,076,274.96	6.82
4	300010	达安基因	3,772.94	94,020,518.48	6.07
5	002292	奥飞娱乐	2,447.48	89,817,671.66	5.83
6	600532	白云山	3,195.53	77,570,886.15	5.04
7	600030	中国国贸	24,015.60	77,570,886.15	5.04
8	300073	和佳股份	1,856.82	57,084,558.20	3.61
9	300121	瀚叶股份	2,170.013	49,049,694.16	3.19
10	300315	掌趣科技	2,091.34	48,067,403.84	3.12