

信息披露Disclosure

泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金

2014 半年度报告摘要

复,债市将出现上涨,我们保持了较高的杠杆,积极参与行情。

4.4.2 报告期内本基金的投资业绩表现:报告期内,本基金份额净值由1.021元,本报告期份额净值增长率为3.24%,同期业绩比较基准增长率为4.07%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望下半年,预计欧美经济将延续复苏态势,中国进出口贸易和消费增速有望保持稳定。在财政政策和货币政策的刺激之下,投资增速将放缓企稳。国内经济环比可能会企稳回升,但力度有限,而去年二三季度基础较差,今年二三季度同比数据甚至可能仍然下降,但四季度同比数据可能将出现回升,预计三四季度通胀仍将平稳,但四季度食品价格存在上行风险。货币政策延续中性,外汇占量增长较少,央行可能会重启回购来调节流动性,回购利率中权可能会与上半年持平或略有上升。

综上,二三季度基本面对市场中性偏多,但四季度可能存在投资增速企稳回升、通胀上行和通胀预期风险。目前债券收益率水平具有吸引力,仍有下行空间,我们将继续采取积极稳健的投资策略,以信用债作为主要投资品种,并做好信用风险防范。

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,并制定了相关制度和流程。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、风控、运营、合规、督察长、投资估值、基金运营及研发、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风险管理能力。

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,但涉及停牌品种的基金经理不参与最终的表决决定。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作为最终原则。

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合同约定的,在存续期内,本基金不进行收益分配。

5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况说明报告期内,中国银行股份有限公司(以下简称“本托管人”)在对泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金(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利益的行为,完全忠实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约定,对基金管理人受托基金资产运作进行了必要的监督,对基金资产净值计算、基金收益分配、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复核,未发现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真实、准确和完整发表意见“本报告中财务指标、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)部分未在本托管人复核范围内,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:泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金报告截止日:2014年6月30日

资产:	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
货币:			
现金		1,158,116.85	1,801,975.362
银行存款	6.4.2.1	53,641.86	5,596,831.99
存放同业		10,987.62	28,883.61
交易性金融资产	6.4.2.2	2,741,095,981.00	114,210,858.50
其中:股票投资		-	-
其中:债券投资		-	-
其中:资产支持证券		-	-
其中:贵金属投资		-	-
其中:其他金融资产		-	-
其中:买入返售金融资产	6.4.2.3	-	112,590,000.00
其中:应收金融资产	6.4.2.4	-	65,236.21
应收利息	6.4.2.5	33,201,847.31	10,889,575.36
应收股利		-	-
应收证券款		-	-
应收申购款		-	-
应收赎回款		-	-
其他资产	6.4.2.6	-	-
资产总计		2,776,130,574.64	2,045,227,471.99

负债:

短期借款

交易性金融负债

其中:股票投资

其中:债券投资

其中:资产支持证券

其中:贵金属投资

其中:其他金融负债

其中:卖出回购金融资产

其中:应付金融资产

应付利息

应付股利

应付证券款

应付赎回款

应付申购款

其他负债

负债总计

所有者权益:

其中:实收资本

其中:资本公积

其中:未分配利润

所有者权益合计

负债和所有者权益总计

注:1.报告截至2014年6月30日,基金份额总额1,990,806,809.13份,其中下类A类基金份额1,380,573,571.01份,B类基金份额610,033,238.12份。下类A类基金份额净值1.006元,B类基金份额净值1.005元。

2.本基金于2013年11月14日基金合同生效。

6.2 利润表会计主体:泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金报告期间:2014年1月1日至2014年6月30日

资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	16,386,923.90