泰达宏利市值优选股票型证券投资基金

【2014】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:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2014年8月26日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司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体独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月22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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至2014年6月30日止。

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。

1.2

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利市值优选股票
基金主代码	162209
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年8月3日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,542,263,004.34份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金兼顾大盘股和中小盘股,把握不同市值的股票在不同市场环境下的投资机会,投资于其中的优质股票,力争获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将使用成功运用的MVPS模型来进行资产配置调整。MVPS模型主要考虑M(宏观经济环境)、V(价值)、P(政策)、S(市场气氛)四方面因素。MVPS模型作为本基金管理人持续一致的资产配置工具,通过定量和定性分析的有效结合判断未来市场的发展趋势,为本基金的资产配置提供支持。 本基金股票资产比例最高可以达到95%,最低保持在60%以上,债券资产比例最高可以达到35%,最低为0%,并保持现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,以保持基金资产流动性的要求。
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金,其投资目标和投资策略决定了本基金属于高风险、高收益的基金产品,预期收益和风险高于混合型、债券型和货币市场基金

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈沛	田青
	联系电话	010-66577808	010-67595096
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-69-88888	010-67595096
传真		010-66577666	010-66275853

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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	-19,552,416.78
本期利润	-644,689,069.70
加权平均基金份额本期利润	-0.1071
本期基金份额净值增长率	-12.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2682
期末基金资产净值	4,055,772,582.96
期末基金份额净值	0.7318

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

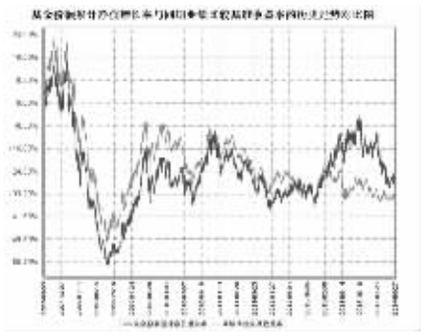
3.2 基金净值表现

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

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	1.19%	1.24%	0.40%	0.59%	0.79%	0.65%
过去三个月	-1.25%	1.16%	0.96%	0.66%	-2.21%	0.50%
过去六个月	-12.66%	1.45%	-4.82%	0.78%	-7.84%	0.67%
过去一年	-9.50%	1.55%	-0.21%	0.88%	-9.29%	0.67%
过去三年	-4.51%	1.36%	-19.67%	0.97%	15.16%	0.39%
自基金合同生效起至今	-26.82%	1.60%	-34.23%	1.39%	7.41%	0.21%

本基金的业绩比较基准:75%×沪深300 指数收益率+25%×上证国债指数收益率。沪深300 指数是由上海和深圳证券市场中选取300 只A 股作为样本编制而成的成份股指数,该指数的指数样本覆盖了沪深两地市场八成左右的市值,具有良好的市场代表性。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。

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



本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

§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基金、泰达宏利全球新格局基金、泰达宏利聚利分级债券基金、泰达宏利中证500指数分级基金、泰达宏利逆向策略股票型基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利养老收益混合型证券投资基金在内的二十多只证券投资基金。

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		
吴俊峰	本基金基金经理	2009年8月25日	-	9	硕士,2005年5月至2005年8月期间就职于国信证券经济研究所,任研究员。2005年8月加盟泰达宏利基金管理有限公司,先后担任研究员、研究主管等职务;9年基金从业经验,具有基金从业资格。

注: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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定,本基金运作整体合法合规,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度和流程,并严格执行制度的规定。在投资管理活动中,本基金管理人公平对待不同投资组合,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会;严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离;在交易环节实行集中交易制度,并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续;交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令;对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配,确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数量统计、分析。在本报告期内,没有发生利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控,风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估,向公司风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。在本报告期内,本基金管理人旗下所有投资组合的同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该证券当日成交量的5%,在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年A股维持弱势震荡,大盘蓝筹股走势较稳,而创业板波动较大。经济增速在微刺激下开始出现企稳,传统周期股和大盘蓝筹开始出现底部回升态势,但盈利改善的幅度有限,股价也缺乏较大的上涨空间。在成长股方面,存量博弈继续演化,资金从市值较大的白马成长股不断撤出,进入市值更小的、有新概念的股票中,而这些股票普遍业绩不确定性较高,由此带来了股价的大幅波动,但总体上小、新、奇的股票在上半年获取了正回报。

本基金的配置主要分布在软件、电子、大众消费和部分医药行业,重仓的个股大部分属于“白马成长股”,在上半年的存量博弈行情中属于被抛售的对象,而本基金主题性机会参与较少,因此净值表现一般。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为0.7318元,本报告期份额净值增长率为-12.66%,同期业绩比较基准增长率为-4.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年的A股市场,经济在政策的不断微刺激下有企稳迹象,一些产能过剩的传统周期性行业在经历了数年的调整之后,龙头公司盈利开始有改善的迹象,而股价处于历史低位,具备了一定的投资价值。从资金面角度看,沪港通能够带来一定幅度的资金流入,预计对高分红收益率的大盘股有较高配置需求,而上半年涨幅较高,且业绩无法兑现的主题性板块面临股价回调的风险,因此下半年有风格转换的可能,本基金将增加低估值、高分红收益率、盈利开始改善的大盘蓝筹股的配置,规避主题性板块,另外会坚持寻找和投资估值合理且业绩增速较快的成长股,努力使基金业绩有所改善。

4.6 管理人对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准则。

4.7 管理人对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

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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:泰达宏利市值优选股票型证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	271,717,744.51	232,295,371.51
结算备付金		3,480,250.84	7,018,999.73
存出保证金		1,522,816.47	1,695,274.46
交易性金融资产	6.4.7.2	3,709,091,479.15	5,598,132,050.42
其中:股票投资		3,674,287,479.15	5,438,488,050.42
基金投资		-	-
债券投资		34,804,000.00	159,644,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	110,160,475.08	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	377,407.32	4,360,980.62
应收股利		-	-
应收申购款		60,917.16	176,300.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	40,328.42	-
资产总计		4,096,451,418.95	5,843,678,977.07
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		29,380,365.43	41,112,491.93
应付赎回款		2,048,491.15	2,836,520.62
应付管理人报酬		4,974,611.65	7,389,310.02
应付托管费		829,101.93	1,231,551.69
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,244,676.74	4,451,908.85
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	201,589.09	424,236.18
负债合计		40,678,835.99	57,446,019.29
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	5,542,263,004.34	6,905,741,422.15
未分配利润	6.4.7.10	-1,486,490,421.38	-1,119,508,464.37
所有者权益合计		4,055,772,582.96	5,786,232,957.78
负债和所有者权益总计		4,096,451,418.95	5,843,678,977.07

报告截止日2014年06月30日,基金份额净值0.7318元,基金份额总额5,542,263,004.34份。

6.2 利润表

会计主体:泰达宏利市值优选股票型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	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
一、收入		-590,137,837.56	881,644,446.35
1.利息收入		2,729,538.00	4,600,631.59
其中:存款利息收入	6.4.7.11	1,365,683.13	1,192,281.33
债券利息收入		1,115,003.06	2,967,953.97
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		248,851.81	440,396.29
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		31,567,752.56	328,940,169.43
其中:股票投资收益	6.4.7.12	10,095,987.23	291,707,738.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	39,970.00	3,658.88
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	21,431,795.33	37,228,771.59
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-625,136,652.92	547,475,953.30
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	701,524.80	627,692.03
减:二、费用		54,551,232.14	74,740,873.68
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	35,060,986.33	45,451,858.62
2.托管费	6.4.10.2.2	5,843,497.75	7,575,309.83
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.19	13,357,890.83	21,460,708.68
5.利息支出		11,763.00	-
其中:卖出回购金融资产支出		11,763.00	-
6.其他费用	6.4.7.20	277,094.23	252,996.55
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-644,689,069.70	806,903,572.67
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-644,689,069.70	806,903,572.67

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰达宏利市值优选股票型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	6,905,741,422.15	-1,119,508,464.37	5,786,232,957.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-644,689,069.70	-644,689,069.70
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)	-1,363,478,417.81	277,707,112.69	-1,085,771,305.12
其中:1.基金申购款	27,924,014.74	-6,173,171.00	21,750,843.74
2.基金赎回款	-1,391,402,432.55	283,880,283.69	-1,107,522,148.86
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)	5,542,263,004.34	-1,486,490,421.38	4,055,772,582.96
项目	上年度可比期间 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)	7,967,432,500.25	-2,322,979,705.59	5,644,452,794.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	806,903,572.67	806,903,572.67
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)	-572,985,839.62	100,861,148.44	-472,124,691.18
其中:1.基金申购款	1,005,625,539.42	-209,206,380.92	796,419,158.50
2.基金赎回款	-1,578,611,379.04	310,067,529.36	-1,268,543,849.68
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)	7,394,446,660.63	-1,415,214,984.48	5,979,231,676.15

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:

_____刘青山_____ _____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

泰达宏利市值优选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”,原泰达荷银市值优选股票型证券投资基金)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]第204号《关于同意泰达荷银市值优选股票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《泰达荷银市值优选股票型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资金利息共募集11,867,940,890.99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(2007)第101号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达荷银市值优选股票型证券投资基金基金合同》于2007年8月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为11,868,700,887.87份基金份额,其中认购资金利息折合759,996.88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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

2010年3月17日,经基金管理人董事会批准、报中国证监会同意,本基金更名为泰达宏利市值优选股票型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利市值优选股票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内依法发行、上市的股票、国债、金融债、企业债、可转债、央行票据、短期融资券、回购、权证、资产支持证券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:股票资产占基金资产的60-95%,债券资产占基金资产的0-35%,权证占基金资产净值的0-3%,资产支持证券占基金资产净值的0-20%,并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计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:75%×沪深300 指数收益率+25%×上证国债指数收益率。

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2014年8月26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38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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利市值优选股票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2014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2014年6月30日的财务状况以及2014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[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》及其他相关财税法规和实务操作,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,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)对基金取得的企业债券利息收入,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

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.10.1.2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。

6.4.10.1.3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。

6.4.10.1.4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。

6.4.10.1.5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 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管理费	35,060,986.33	45,451,858.62
其中,支付销售机构的客户维护费	6,207,794.51	7,391,313.31

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 X 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

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	5,843,497.75	7,575,309.83

支付基金托管人中国建设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 X 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(含回购)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(含回购)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

本基金的管理人在本报告期内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 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国建设银行北碚支行营业部	49,411.24	0.0009%	49,411.24	0.0007%

本基金管理人之外的其他关联方投资本基金按照公告的费率条款执行,不存在费率优惠的情况。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	271,717,744.51	1,293,643.44	331,190,696.53	1,036,338.37

本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,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(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/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300058	蓝色光标	2013年9月16日	2014年9月18日	非公开发行流通受限	42.00	25.25	1,173,218	24,637,578.00	29,623,754.50	-
300387	富邦股份	2014年6月26日	2014年7月2日	新股流通受限	20.48	20.48	27,358	560,291.84	560,291.84	-
002727	一心堂	2014年6月25日	2014年7月2日	新股流通受限	12.20	12.20	8,968	109,409.60	109,409.60	-

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128006	长青转债	2014年6月25日	2014年7月9日	新债流通受限	100.00	100.00	46,990	4,699,000.00	4,699,000.00	-

蓝色光标非公开发行价格为每股42.00元。在锁定期间于2014年5月30日进行权益分配,每10股派发2元(含税),每10股转增10股。本次权益分配后认购成本为每股21.00元。

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	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300271	华宇软件	2014年6月27日	重大事项	40.30	-	-	3,500,000	92,352,017.36	141,050,000.00	-
300166	东方国信	2014年4月9日	重大事项	18.71	2014年7月9日	20.58	4,175,210	79,442,730.76	78,118,179.10	-

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。

6.5 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	3,674,287,479.15	89.69
	其中:股票	3,674,287,479.15	89.69
2	固定收益投资	34,804,000.00	0.85
	其中:债券	34,804,000.00	0.85
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	110,160,475.08	2.69
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	275,197,995.35	6.72
7	其他各项资产	2,001,469.37	0.05
8	合计	4,096,451,418.95	100.00

7.2 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、渔业	55,680,000.00	1.37
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,122,531,337.62	52.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	113,681,500.00	2.80
F	批发和零售业	109,409.60	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,309,395,289.86	32.28
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	42,649,618.52	1.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	30,240,323.55	0.75
S	综合	-	-
	合计	3,674,287,479.15	90.59

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

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	002065	东华软件	19,048,600	383,257,832.00	9.45
2	002415	海康威视	20,000,000	338,800,000.00	8.35
3	002450	康得新	13,946,911	317,292,225.25	7.82
4	300212	易华录	8,000,000	250,560,000.00	6.18
5	002410	广联达	6,300,142	166,575,754.48	4.11
6	600196	复星医药	8,000,000	161,520,000.00	3.98
7	002008	大族激光	9,191,532	159,381,164.88	3.93
8	300271	华宇软件	3,500,000	141,050,000.00	3.48
9	000333	美的集团	7,000,000	135,240,000.00	3.33
10	002236	大华股份	5,000,000	134,750,000.00	3.32

1) 注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本公司网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票