

## 信息披露| Disclosure

## 泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金

## [2011] 第一季度报告

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  
报告送出日期:2011年4月22日

## § 1 重要提示

基金管理人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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定，于2011年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期间为2011年1月1日至2011年3月31日。

本报告财务资料未经审计。

## § 2 基金产品概况

基金简称 泰达宏利品质生活混合

交易代码 162211

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2009年4月9日

报告期末基金份额总额 315,595,147.78份

随着中国经济增长迈上了新的台阶，广大人民群众必然更加注重生活质量。本基金将重点把握生活品质提高的这一趋势，通过投资相关的受益行业上市公司，充分分享中国国民经济力量的全面提升，力争为投资者带来良好的回报。

本基金采用双线策略，对市场交点进行重点的定价分析和定量分析，构建实际投资组合。横向上，利用“行业鸭嘴”分析方法，确定行业内具有提高生活品质相关的企业，从而选择出具有优势和比较优势的企业；纵向上，利用“成本驱动”和“需求驱动”的分析方法，选择主题：3.消费品投资策略。本基金将综合宏观经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益水平、流动性及信用风险等因素，运用利率预期、久期管理、收益率曲线等风险管理策略。

业绩比较基准 60%×沪深300指数收益率+40%×上证国债指数收益率。

本基金属于中高风险、中高收益的混合型证券投资基金。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期:2011年1月1日 - 2011年3月31日

1.本期已实现收益 10,927,915.19

2.本期利润 -10,465,718.67

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0325

4.期末基金资产净值 411,867,345.95

5.期末基金份额净值 1.305

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持有人认购或交易基金的申购费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金份额表现

3.2.1 本报告期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 -2.25% 1.19% 0.27% -0.46% 0.37%

注:本基金的业绩比较基准:60%×沪深300指数收益率+40%×上证国债指数收益率。沪深300指数是上海证券交易所和深圳证券交易所上市股票选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数。该指数样本覆盖了沪深两地市场七成左右的市值，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，按照票面发行价格加权而成，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

注:本基金的业绩比较基准:股票资产占基金资产的30%-80%，债券资产占基金资产的15%-65%，现金类资产占基金资产的0%-30%。投资于货币市场工具、现金等价物的比例合计不超过基金资产净值的5%。在建仓期结束后及本报告期末本基金的投资比例已达到基金合同规定的各项投资比例。

4.2 管理人报告

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。

4.3 公平交易专项说明

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，严格执行公平交易管理制度和交易行为准则，在交易环节中执行公平交易制度，并确保公平交易可操作。可评估、可审核，交易运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则执行。

4.3.2 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.3.3 避险交易的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的控制制度，在本报告期内未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

4.4 报告期内本基金的投票权说明和业绩表现的说明

4.5 报告期内本基金的投票权运作分析

注:本基金的投票权从行业分类 和商业业从从业人员资格管理办法的相关规定。

4.6 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，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。

4.7 公平交易专项说明

4.7.1 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，严格执行公平交易管理制度和交易行为准则，在交易环节中执行公平交易制度，并确保公平交易可操作。可评估、可审核，交易运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则执行。

4.7.2 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.3 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，严格执行公平交易管理制度和交易行为准则，在交易环节中执行公平交易制度，并确保公平交易可操作。可评估、可审核，交易运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则执行。

4.7.4 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.5 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.6 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.7 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.8 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.9 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.10 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.11 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.12 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.13 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.14 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.15 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.16 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.17 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.18 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.19 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.20 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.21 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.22 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.23 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.24 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.25 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.26 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.27 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.28 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.29 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.30 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.31 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.32 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.33 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.34 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.35 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.36 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.37 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.38 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.39 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.40 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.41 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.42 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较

本基金与公司治理的其他投资组合具有相同的投资风格。

4.7.43 本报告期组合与他人投资组合的公平交易之问的业绩比较