

## 泰达宏利效率优选混合型证券投资基金 (LOF)

## 2012 第二季度报告

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:2012年7月19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2012年7月17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部分，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。

基金管理人和基金托管人并不代表本机构未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基

金的招募说明书及定期报告。

本报告财务数据未经审计。

本报告期为2012年4月1日至2012年6月30日。

## §2 基金产品概况

基金简称:泰达宏利效率优选混合(LOF)(场内简称:泰达效率)

交易代码:162207

基金运作方式:上市契约型开放式(LOF)

基金合同生效日:2006年5月12日

报告期末基金份额总额:4,989,854,194.94份

投资目标:充分挖掘具有较高投资效率的上市公司，兼顾投资优质债券，力争为投资者获取超越行业基准的绝对回报。

本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合的投资手段和策略，在正常的市场环境下不作行业属性资产配置调整，股票及债券的投资配置比例本

保持在基准比例±10%的范围内波动。本基金在股票投资策略上，注重公

司在行业中对资产使用效率以及对股东价值的创造。

业绩比较基准:60%×富时中国A股600指数收益率+35%×新华巴克莱资本中国国债指数收

益率+5%×同业存款利率。

风险收益特征:本基金属于风险较高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

报告期(2012年4月1日 - 2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -100,717,584.66

2.本期利润 468,749,504.25

3.期初平均基金份额本期利润 0.0939

4.期末基金份额净值 3,943,878,334.89

5.期末基金份额净值 0.7904

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各项费用,计入费用后实际收益水平要低

于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

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① 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 13.47% 0.84% 1.36% 0.67% 12.11% 0.17%

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

## 3.2.2 管理人报告

3.2.2.1 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.2 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.3 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.4 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.5 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.6 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.7 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.8 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.9 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.10 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.11 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.12 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.13 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.14 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.15 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.16 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.17 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.18 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.19 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.20 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.21 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.22 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.23 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.24 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.25 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.26 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.27 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.28 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.29 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.30 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.31 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.32 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.33 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.34 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.35 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.36 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明

注:本基金在2006年5月12日成立,建仓期6个月,在建仓期结束时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。

3.2.2.37 基金管理人对本期以来基金运作情况的说明