

泰达宏利首选企业股票型证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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、净值公告和投资组合报告等内容,复核结果不存在虚假记载、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 泰达宏利首选企业股票

交易代码 162208

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2006年12月1日

报告期末基金份额总额 1,246,843,749.54份

投资目标 集中投资于行业中的首选企业,分享中国经济的高速增长和自主创新,力争实现长期稳定的资本增值。

本基金投资于各行业中的首选企业并集中持有,充分分享各个首选企业在行业中的优势所带来的超额回报。本基金将灵活配置自下而上相结合的投资管理模式,挑选出当行业景气行业,如果行业差别性较大,将对行业进行深入分析,借助泰达宏利首选企业评级标准,挑选出各行业中首选企业,构建股票投资组合。原则上,从每个细分行业中挑选出来的企业不超过三家。

业绩比较基准 90%×富时中国A20指数量化收益+10%×同业存款利率

风险收益特征 本基金属于高风险的证券投资基金,预期收益和风险高于混合型、债券型和货币市场基金。

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -3,888,364.82

2.本期利润 76,688,452.10

3.加权平均基金份额本期利润 0.0609

4.期末基金资产净值 1,196,773,023.63

5.期末基金份额净值 0.9598

注:1.本期已实现收益指本基金本期利息收入、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,计价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 本期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 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 6.72% 1.02% 0.79% 0.99% 5.93% 0.03%

注:本基金的业绩比较基准:90%×富时中国A20指数量化收益+10%×同业存款利率。

富时中国A20指数量化收益是富时公司编写的包含上海、深圳两个证券交易所上市市值最大的200只股票并以流通市值为权重的股票指数,具有良好的市场代表性。因此,本基金选择富时中国A20指数量化股票投资部的业绩。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

图:泰达宏利首选企业股票型证券投资基金2012年第二季度净值表现

注:按基金合同规定,本基金合同生效六个月内为建仓期。本报告期末本基金的各项投资比例符合基金合同的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理 或基金经理小组简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

刘金玉 本基金基金经理 2011年3月8日 10 管理学硕士,2002年9月至2003年12月就职于中国平安集团资产管理中心基金管理部,任研究员;2003年12月至2009年12月就职于华泰基金管理有限公司,任行业研究员;2009年12月加入泰达宏利基金管理有限公司,担任研究部副总监,刘玉生先生将其90%基金公司工作份额,一半基金公司工作份额,10%基金从事业绩,基金从业资格。

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,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,没有出现损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金公平交易制度,严格执行公平交易制度,并严格按照公平交易制度,确保各投资组合享有公平的投资机会。

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,向公司风控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,未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

4.4 报告期内基金投资组合的重大变动

本基金报告期内未发生重大投资组合变动。

4.5 管理人对宏观经济的展望

我们对下市年市场整体持谨慎态度,未采取货币和债券类资产降低对股票的配置,从政策面来看,货币政策已经开始转向宽松,但尚未体现货币宽松的信号。

4.6 管理人对证券市场走势的展望

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,向公司风控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,未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

4.7 管理人对宏观经济的展望

我们对下市年市场整体持谨慎态度,未采取货币和债券类资产降低对股票的配置,从政策面来看,货币政策已经开始转向宽松,但尚未体现货币宽松的信号。

4.8 管理人对证券市场走势的展望

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,向公司风控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,未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

4.9 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 1,073,419,707.65 89.17

其中:股票 1,073,419,707.65 89.17

2 固定收益投资 75,869,900.80 6.30

其中:债券 75,869,900.80 6.30

3 货币支持证券 - -

4 买入返售金融资产 - -

其中:买断式回购的买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 52,363,786.48 4.35

6 其他资产 2,140,406.18 0.18

7 合计 1,203,793,801.11 100.00

注:本基金业绩比较基准:90%×中债企业债全价指数+10%×中债国债全价指数。本基金将根据基金的基准资产具有较高一致性的原则,选择本基准资产的两个指数以90%和10%的权重,可以较为公平的衡量基金管理人的投资管理能力。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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 - -

B 采掘业 43,239,353.42 3.61

C 制造业 608,375,384.84 50.83

D 食品、饮料 180,485,827.36 15.08

E 纺织、服装、皮革 48,399,256.10 4.04

F 木材、家具 - -

G 印刷、造纸、印刷 23,397,690.87 1.96

H 电子、电器、塑胶、塑料 99,121,057.23 8.28

I 金属、非金属 13,964,760.60 1.17

J 机械、设备、仪表 133,840,553.02 11.18

K 医药、生物制品 109,166,239.66 9.12

L 其他制造业 - -

M 电力、煤气及水的生产和供应业 68,671,259.23 5.74

N 食品、饮料、仓储业 - -

O 信息技术业 47,023,616.64 3.93

P 批发和零售贸易 30,269,251.76 2.53

Q 金融、保险业 91,740,484.68 7.67

R 房地产业 67,251,142.82 5.62

S 科技服务 61,105,281.86 5.11

T 传播与文化产业 55,743,932.40 4.66

U 综合类 - -

5.3 报告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

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 300058 蓝色光标 3,339,960 55,743,932.40 4.66

2 600887 伊利股份 2,582,882 53,155,711.56 4.44

3 000650 仁和药业 5,609,392 48,128,583.36 4.02

4 000157 中联重科 4,500,000 45,135,000.00 3.77

5 002482 广田股份 2,287,931 39,924,395.95 3.34

6 600066 宇通客车 1,739,432 39,067,642.72 3.26

7 002353 瑞泰股份 770,596 37,373,906.00 3.12

8 600519 贵州茅台 155,995 37,306,204.25 3.12

9 002051 中工国际 1,334,313 35,439,353.28 2.96

10 000799 酒鬼酒 632,195 33,127,018.00 2.77

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 - -

2 行业票据 70,027,000.00 5.85

3 金融债券 - -

4 中政性金融债 - -

5 企业债券 3,087,606.40 0.26

6 企业短期融资券 - -

7 中期票据 - -

8 其他 - -

9 合计 75,869,900.80 6.34

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 1001047 10国债4 500,000 50,015,000.00 4.18

2 1001032 10央票32 200,000 20,012,000.00 1.67

3 126013 08青债01 32,680 3,087,606.40 0.26

4 113001 中行转债 28,370 2,755,294.40 0.23

5.6 报告期末前十名资产支持证券投资明细

注:本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

注:本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

注:本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票期权投资明细

注:本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票期权投资明细

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名基金投资明细

注:本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名基金投资明细

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生金融工具投资明细

注:本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生金融工具投资明细

5.13 报告期末按公允价值