泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

【2012】第三季度报告

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月24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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10月22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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2012年7月1日至2012年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利财富大盘指数
交易代码	162213
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月23日
报告期末基金份额总额	310,444,537.62份
投资目标	采用指数化投资策略,紧密跟踪中证财富大盘指数,力争获取与标的指数相似的投资收益,并力争将基金的日跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年化跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金采用指数完全复制方法,原则上按照标的指数成分股及权重构建基金的投资组合,并根据标的指数成分股及其权重的变动进行相应的调整,以达到跟踪和复制指数的目的。但如遇特殊情况(如市场流动性不足、成分股被限制投资等)致使基金无法购得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理的方法进行适当替代,以使跟踪误差控制在限定范围内。
业绩比较基准	95%×中证财富大盘指数收益率+5%×同业存款利率。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,属于高风险、高收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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(2012年7月1日 - 2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-16,286,238.18
2.本期利润	-18,879,373.56
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0657
4.期末基金资产净值	251,738,766.68
5.期末基金份额净值	0.811

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
过去三个月	-7.63%	1.05%	-7.33%	1.04%	-0.30%	0.01%

注:本基金业绩比较基准:95%×中证财富大盘指数收益率+5%×同业存款利率。

本基金股票资产的跟踪标的指数为中证财富大盘指数。中证财富大盘指数是由中证指数有限公司编制并开发的中国A股市场指数。该指数按照上市公司创造财富能力的大小进行选样,挑选最具创造财富能力的300家A股上市公司作为样本;此外该指数在加权方式上亦有所创新,不同于一般的市值加权指数,该指数样本个股的权重配置将与其创造财富能力的大小相适应,从而打破市值指数中价格与权重过于紧密的联系,预防个股权重由于价格的非理性波动而大起大落,提高了个股权重配置的稳定性。指数的表现综合反映了中国经济增长过程中核心企业真实的财富增长情况。

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

注:本基金于2010年4月23日成立,在建仓期结束时及本报告期末本基金的投资比例(除现金和一年内国债比例外)已达到基金合同规定,现金和一年内国债比例已于本报告期末后10个工作日内达标。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王咏辉	本基金基金经理、金融工程部副总经理	2010年4月23日	2012年8月20日	14	英国牛津大学工程和计算机专业,硕士学历;曾担任伦敦摩根大通(JP Morgan)投资基金管理公司分析员、高级分析师、汇丰投资基金管理公司(HSBC)高级分析师、巴克莱国际投资基金管理公司ETF亚洲部门经理、巴克莱资本公司(Barclays Capital)部门经理。2008年4月加入泰达宏利基金管理有限公司,先后担任金融工程部副总经理、国际投资部副总经理;2011年7月20日起担任泰达宏利全球新格局证券投资基金基金经理;2011年12月1日起任泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金经理,具备14年基金从业经验,具有基金从业资格。
刘欣	本基金基金经理	2012年8月14日	-	5	清华大学数学科学系毕业,理学硕士。2007年7月至2008年12月就职于工银瑞信基金管理有限公司任定量分析师;2008年12月至2011年7月就职于嘉实基金管理有限公司任定量分析师;2011年7月加盟泰达宏利基金管理有限公司,担任产品与金融工程部高级研究员;2012年8月14日起人泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金经理,具备5年基金从业经验,具有基金从业资格。

注:1、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。表中的任职日期和离任日期均指公司做出决定的公告日期。

2、我公司已于2012年8月22日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》。王咏辉先生自2012年8月20日起不再担任本基金基金经理。

3、我公司已于2012年8月16日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增聘基金经理的公告》。刘欣先生自2012年8月14日起担任本基金基金经理。

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 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

A股市场2012年三季度呈现震荡下行走势。宏观层面,经济、通胀均进入下行阶段,呈现衰退格局;市场氛围方面,悲观观望情绪浓厚。

本基金在操作中,严格遵守基金合同,应用指数复制技术和数量化手段降低交易成本并控制跟踪误差。

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0.811元,本报告期份额净值增长率为-7.63%,同期业绩比较基准增长率为-7.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从投资时钟看,经济衰退期既是最悲观的时刻,也是希望孕育的时刻。在通胀进入下行通道,政策逐渐宽松的背景下,经济的缓慢复苏值得期待。以财富大盘指数成分股为代表的低估值蓝筹股票是攻守兼备的品种,这体现在一方面蓝筹公司基本面较好,对周期向下的抵抗力较强;另一方面,目前蓝筹股票估值较低,因此估值修复的空间较大。

作为指数基金,本基金将积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,有效控制跟踪误差。

§5 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	239,366,861.84	88.17
	其中:股票	239,366,861.84	88.17
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
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	12,074,758.49	4.45
6	其他资产	20,047,815.11	7.38
7	合计	271,489,435.44	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	22,197,062.84	8.82
C	制造业	62,546,050.95	24.85
C0	食品、饮料	6,652,406.98	2.64
C1	纺织、服装、皮毛	755,154.77	0.30
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	436,858.46	0.17
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,375,419.35	2.14
C5	电子	3,975,916.36	1.58
C6	金属、非金属	17,297,557.00	6.87
C7	机械、设备、仪表	22,474,885.73	8.93
C8	医药、生物制品	5,400,758.80	2.15
C99	其他制造业	177,093.50	0.07
D	电力、煤气及水的生产和供应业	6,570,971.34	2.61
E	建筑业	11,072,812.24	4.40
F	交通运输、仓储业	9,195,451.42	3.65
G	信息技术业	6,057,020.27	2.41
H	批发和零售贸易	6,107,328.13	2.43
I	金融、保险业	97,123,896.23	38.58
J	房地产业	12,281,009.25	4.88
K	社会服务业	3,535,888.39	1.40
L	传播与文化产业	297,163.83	0.12
M	综合类	2,382,206.95	0.95
	合计	239,366,861.84	95.09

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	600016	民生银行	2,243,673	12,676,752.45	5.04
2	601166	兴业银行	813,632	9,771,720.32	3.88
3	600000	浦发银行	1,272,445	9,390,644.10	3.73
4	600036	招商银行	709,282	7,206,305.12	2.86
5	601328	交通银行	1,681,218	7,161,988.68	2.85
6	600015	华夏银行	711,129	5,717,477.16	2.27
7	601818	光大银行	2,057,770	5,473,668.20	2.17
8	601169	北京银行	755,346	5,189,227.02	2.06
9	601318	中国平安	115,802	4,856,735.88	1.93
10	601668	中国建筑	1,508,681	4,631,650.67	1.84

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金投资前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2

本基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	271,494.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	77,917.62
4	应收利息	3,473.63
5	应收申购款	19,694,929.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,047,815.11

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	289,439,959.86
本报告期基金总申购份额	28,258,923.97
减:本报告期基金总赎回份额	7,254,346.21
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	310,444,537.62

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金设立的文件;

2、《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》;

3、《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金招募说明书》;

4、《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金托管协议》。

7.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

7.3 查阅方式

投资人可通过指定信息披露报纸(《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》)或登录基金管理人互联网网址 http://www.mfcteda.com)查阅。

泰达宏利基金管理有限公司
2012年10月24日

泰达宏利中证500指数分级证券投资基金

【2012】第三季度报告

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月24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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10月22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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2012年7月1日至2012年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利500指数分级
交易代码	162216
基金运作方式	契约型开放式。本基金的基金份额包括本基金之基础份额(简称"泰达中证500份额",场内简称"泰达500"),本基金之稳健收益类份额(简称"泰达稳健份额",场内简称"泰达稳健")与本基金之进取收益类份额(简称"泰达进取份额",场内简称"泰达进取")。泰达中证500份额只可以进行场内与场外的申购和赎回,但不上市交易。泰达稳健份额和泰达进取份额只可在深圳证券交易所上市交易,不可单独进行申购或赎回。
基金合同生效日	2011年12月1日
报告期末基金份额总额	56,138,470.35份
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证500指数,力争获取与标的指数相似的投资收益,并将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金采用指数完全复制方法,原则上按照标的指数成分股及权重构建基金的投资组合,并根据标的指数成分股及其权重的变动进行相应的调整,以达到跟踪和复制指数的目的。但如遇特殊情况(如市场流动性不足、成分股被限制投资等)致使基金无法购得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理的方法进行适当替代,以实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准:95%×中证500指数收益率+5%×1年期定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,属于高风险、高收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

下属三级基金简称	泰达稳健	泰达进取	泰达中证500500(场内简称:泰达500)
下属三级基金交易代码	150053	150054	162216
下属三级基金报告期末基金份额总额	10,965,924.00份	16,448,886.00份	28,723,660.35份
下属三级基金的风险收益特征	泰达稳健份额具有低风险、收益相对稳定的特征	泰达进取份额具有高风险、高预期收益的特征	-

§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(2012年7月1日 - 2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-3,708,244.13
2.本期利润	-5,603,112.86
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0909
4.期末基金资产净值	52,651,781.16
5.期末基金份额净值	0.938

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。

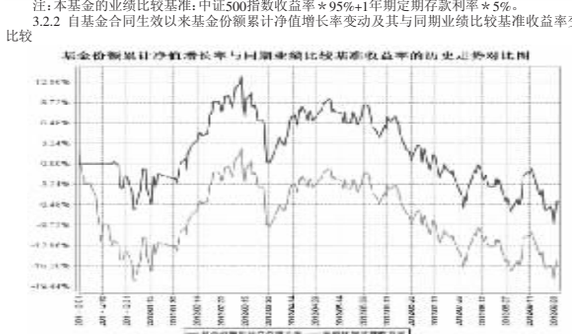
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-7.59%	1.40%	-7.37%	1.42%	-0.22%	-0.02%

注:本基金的业绩比较基准:中证500指数收益率*95%+1年期定期存款利率*5%。

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:本基金于2011年12月1日成立,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。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王咏辉	本基金基金经理、金融工程部副总经理	2011年12月1日	2012年8月20日	14	英国牛津大学工程和计算机专业,硕士学历;曾担任伦敦摩根大通(JP Morgan)投资基金管理公司分析员、高级分析师、汇丰投资基金管理公司(HSBC)高级分析师、巴克莱国际投资基金管理公司ETF亚洲部门经理、巴克莱资本公司(Barclays Capital)部门经理。2008年4月加入泰达宏利基金管理有限公司,担任金融工程部副总经理;2011年4月23日起任泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金经理;2011年7月20日起担任泰达宏利全球新格局证券投资基金基金经理;具备14年基金从业经验,具有基金从业资格。
刘欣	本基金基金经理	2012年8月14日	-	5	清华大学数学科学系毕业,理学硕士。2007年7月至2008年12月就职于工银瑞信基金管理有限公司任定量分析师;2008年12月至2011年7月就职于嘉实基金管理有限公司任定量分析师;2011年7月加盟泰达宏利基金管理有限公司,担任产品与金融工程部高级研究员;2012年8月14日起人泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金经理,具备5年基金从业经验,具有基金从业资格。

注:1、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。表中的任职日期和离任日期均指公司做出决定的公告日期。

2、我公司已于2012年8月22日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》。王咏辉先生自2012年8月20日起不再担任本基金基金经理。

3、我公司已于2012年8月16日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增聘基金经理的公告》。刘欣先生自2012年8月14日起担任本基金基金经理。

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 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

A股市场2012年三季度呈现震荡下行走势。宏观层面,经济、通胀均进入下行阶段,呈现衰退格局;市场氛围方面,悲观观望情绪浓厚。

本基金在操作中,严格遵守基金合同,应用指数复制技术和数量化手段降低交易成本并控制跟踪误差。

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0.938元,本报告期份额净值增长率为-7.59%,同期业绩比较基准增长率为-7.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从投资时钟看,经济衰退期既是最悲观的时刻,也是希望孕育的时刻。在通胀进入下行通道,政策逐渐宽松的背景下,经济的缓慢复苏值得期待。以中证500成分股为代表的新兴产业成长公司从长期看具有较大的投资机会。

作为指数基金,本基金将积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,有效控制跟踪误差。

§5 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	49,452,192.27	92.85
	其中:股票	49,452,192.27	92.85
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
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	3,095,175.33	5.81
6	其他资产	710,639.60	1.33
7	合计	53,258,007.20	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	623,015.24	1.18
B	采掘业	837,650.77	1.59
C	制造业	28,449,269.29	54.03
C0	食品、饮料	3,374,151.22	6.41
C1	纺织、服装、皮毛	1,302,535.37	2.47
C2	木材、家具	213,217.10	0.40
C3	造纸、印刷	663,875.03	1.26
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,824,862.35	9.16
C5	电子	2,860,593.38	5.43
C6	金属、非金属	3,087,236.56	5.86
C7	机械、设备、仪表	7,129,550.20	13.54
C8	医药、生物制品	4,532,500.57	8.61
C99	其他制造业	460,747.51	0.88
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,453,118.80	4.66
E	建筑业	903,997.47	1.72
F	交通运输、仓储业	1,934,730.18	3.67
G	信息技术业	2,575,308.63	4.89
H	批发和零售贸易	2,621,704.51	4.98
I	金融、保险业	563,021.78	1.07
J	房地产业	4,120,073.98	7.83
K	社会服务业	1,561,196.36	2.97
L	传播与文化产业	1,858,029.69	3.53
M	综合类	951,075.57	1.81
	合计	49,452,192.27	93.92

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	000656	金科股份	57,619	520,875.76	0.99
2	600743	华远地产	174,533	506,145.70	0.96
3	000631	顺发恒业	120,211	498,875.65	0.95
4	600594	益佰制药	20,724	433,960.56	0.82
5	600199	金种子酒	17,120	364,656.00	0.69
6	600780	通宝能源	54,056	362,175.20	0.69
7	600750	江中药业	17,525	354,530.75	0.67
8	000861	海印股份	23,953	343,006.96	0.65
9	600122	宏图高科	88,376	339,363.84	0.64
10	600831	广电网络	46,998	338,855.58	0.64

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况,在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	19,013.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	784.30
4	应收利息	616.48
5	应收申购款	682,885.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	7,339.64
8	其他	-
9	合计	710,639.60

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600780	通宝能源	362,175.20	0.69	重大事项

5.8.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	泰达稳健	泰达进取	泰达中证500
本报告期期初基金份额总额	11,580,436.00	17,370,654.00	61,129,585.76
本报告期基金总申购份额	-	-	29,747,068.21
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	63,689,273.62
本报告期基金拆分变动份额	-614,512.00	-921,768.00	1,536,280.00
本报告期期末基金份额总额	10,965,924.00	16,448,886.00	28,723,660.35

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰达宏利中证500指数分级证券投资基金设立的文件;

2、《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金合同》;

3、《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金招募说明书》;

4、《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金托管协议》。

7.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

7.3 查阅方式

投资人可通过指定信息披露报纸(《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》)或登录基金管理人互联网网址 http://www.mfcteda.com)查阅。

泰达宏利基金管理有限公司
2012年10月24日

泰达宏利行业精选证券投资基金

【2012】第三季度报告

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月24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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10月22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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2012年7月1日至2012年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利精选股票
交易代码	162204
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年7月9日
报告期末基金份额总额	1,136,302,757.70份
投资目标	追求资本的长期持续增值,为投资者寻求高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	全面引进荷兰银行的投资管理流程,采用"自上而下"资产配置和行业类别与行业配置,"自下而上"精选股票的投资策略,主要投资于具有国际、国内竞争力比较优势和长期增值潜力的行业和企业的股票。
业绩比较基准	70%×富时中国A600指数收益率+30%×中债国债总指数(财富)
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于风险较高的基金品种
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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(2012年7月1日 - 2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-104,208,684.20
2.本期利润	-104,829,040.30
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0936
4.期末基金资产净值	3,687,324,464.98
5.期末基金份额净值	3.2450

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
过去三个月	-2.83%	1.17%	-5.17%	0.85%	2.34%	0.32%

注:本基金业绩比较基准:70%×富时中国A600指数收益率+30%×中债国债总指数(财富)。富时中国A600指数是富时指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所总市值最大的600只股票并以流通股本加权的股票指数,具有良好的市场代表性。中债国债总指数(财富)是中央国债登记结算有限责任公司推出的中国国债总指数,该指数基于全市场角度编制的指数,价格选取上更侧重于全国银行间债券市场,选样广泛,全面而细致反映债券市场变动。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及