

## 泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金

## [2012] 第四季度报告

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司  
基金托管人:交通银行股份有限公司  
报告送出日期:2013年1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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年1月21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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

本报告期间为2012年10月1日至2012年12月31日。

## § 2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利成长股票
交易代码	162201
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年4月25日
报告期末基金份额总额	1,553,224,503.85份

本基金主要投资于成长行业类别中内在价值被相对低估，并与同行业类别上市公司相比具有更高增长潜力的上市公司，在有效控制投资组合风险的前提下，为基金份额持有人提供长期稳定的回报。

投资目标 本基金采用“自上而下”的投资方法，具体体现在资产配置、行业配置和个股选择的全过程。

业绩比较基准 65%×富时中国A600行业指数+35%×上证国债指数

风险收益特征 本基金在证券投资基金中属于较高风险的基金品种。

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 交通银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

主要财务指标	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	56,404,299.83
2.本期利润	-1,119,579.11
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0007
4.期末基金资产净值	1,484,806,363.64
5.期末基金份额净值	0.9560

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.基金净值表现

3.1.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 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.05% 1.01% 0.29% 0.78% -0.34% 0.23%

注:本基金业绩比较基准:65%×富时中国A600行业指数+35%×上证国债指数。上证国债指数选取样本股为在上海证券交易所上市交易的、偿还期限在一年以上的国债,样本国债的剩余期限分布均匀,收益率曲线较为完全、合理,而且与主体丰富,竞价交易连续性强,能反映出场利率的瞬息变化,客观地显示出市场的整体收益风险。

4.2.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。

4.3.基金净值表现

4.3.1.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

序号 股票代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 002475 立讯精密 3,189,362 5.95

2 300212 易华录 2,652,386 5.43

3 000651 格力电器 3,013,332 5.18

4 600031 三一重工 6,428,360 4.59

5 600060 海信科龙 6,700,161 4.56

6 600535 大士力 5,942,414.82 3.77

7 002236 大华股份 1,076,353 3.36

8 000883 湖北能源 8,600,000 3.28

9 000418 小天鹅A 4,885,426 3.10

10 000937 中航油 3,252,441 44,981,259.03 3.03

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券代码 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 100410 国家债券 88,305,803 5.95

2 000402 央行票据 -

3 企业债 219,407,000.00 14.78

4 企业债券 219,407,000.00 14.78

5 企业短期融资券 -

6 中期票据 -

7 可转债 -

8 其他 -

9 合计 307,712,803.50 20.72

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 100410 国家债券 500,000.00 3.39

2 100402 国债 500,000.00 3.39

3 000402 央行票据 500,000.00 3.30

4 100428 国债 300,000.00 2.04

5 100208 国债 300,000.00 2.02

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

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

5.8 投资组合情况

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一日内受到公开谴责处罚的情形。

5.8.2 报告期内本基金投资的前十名证券中不存在流通受限的情况。

5.8.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 2,000,000.00

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 6,944,982.42

5 应收申购款 480,873.62

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 9,425,856.04

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

序号 股票代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明

1 000883 湖北能源 48,676,000.00 3.28 非公开发行

5.8.6 投资组合报告附注

由于四舍五入的原因,分项之和可能不是在尾数。

5.8.7 开放式基金份额变动

单位:份 报告期期初基金份额总额 1,553,224,503.85

报告期期间基金总申购量 1,484,806,363.64

报告期期间基金赎回量 81,746,531.22

报告期末基金份额总额 1,531,278,336.27

注:本基金在建仓期末及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

§ 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

梁辉 本基金基金经理 2011年4月21日 - 10 硕士,2002年3月起就职于泰达宏利基金管理有限公司,曾担任公司研究员、基金经理助理、研究部副总监,2005年1月担任基金经理,2008年1月担任基金经理助理,2010年1月担任基金经理,2011年4月起就职于泰达宏利基金管理有限公司,担任基金经理,2012年1月起就职于泰达宏利基金管理有限公司,担任基金经理。

邓颖丽 本基金基金经理 2011年6月3日 - 7 金融硕士,2004年5月至2005年4月就职于中国工商银行广东广州分行公司客户部助理,2005年4月加盟泰达宏利基金管理有限公司,担任基金经理助理,2007年1月担任基金经理,2011年6月就职于泰达宏利基金管理有限公司,担任基金经理,2012年1月起就职于泰达宏利基金管理有限公司,担任基金经理。

注:本基金的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理辦法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作的监督情况说明及基金合同的约定,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 公平交易制度的执行情况

4.3.1.公平交易制度的执行情况

4.3.2.公平交易制度的执行情况

4.3.3.公平交易制度的执行情况

4.3.4.公平交易制度的执行情况

4.3.5.公平交易制度的执行情况

4.3.6.公平交易制度的执行情况

4.3.7.公平交易制度的执行情况

4.3.8.公平交易制度的执行情况

4.3.9.公平交易制度的执行情况

4.3.10.公平交易制度的执行情况

4.3.11.公平交易制度的执行情况

4.3.12.公平交易制度的执行情况

4.3.13.公平交易制度的执行情况

4.3.14.公平交易制度的执行情况

4.3.15.公平交易制度的执行情况

4.3.16.公平交易制度的执行情况

4.3.17.公平交易制度的执行情况

4.3.18.公平交易制度的执行情况

4.3.19.公平交易制度的执行情况

4.3.20.公平交易制度的执行情况

4.3.21.公平交易制度的执行情况

4.3.22.公平交易制度的执行情况

4.3.23.公平交易制度的执行情况

4.3.24.公平交易制度的执行情况

4.3.25.公平交易制度的执行情况

4.3.26.公平交易制度的执行情况

4.3.27.公平交易制度的执行情况

4.3.28.公平交易制度的执行情况

4.3.29.公平交易制度的执行情况

4.3.30.公平交易制度的执行情况

4.3.31.公平交易制度的执行情况