

# 泰达宏利淘利债券型证券投资基金

## 2014 年度 报告 摘要

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  
送出日期：2015年3月27日

### §1 重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的董事会及监事会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。本年度报告已经基金独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2015年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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预示其未来表现。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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。  
本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。  
本报告自2014年8月6日起至2014年12月31日止。

### §2 基金简介

2.1 基金基本情况	
基金名称	泰达宏利债券
基金代码	000319
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2014年8月6日
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
报告期末基金总额	195,24,880.97份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明	
投资目标	在有效控制风险的基础上，通过主动管理，力争创造高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金管理人将遵循分散化和风险控制原则，通过积极主动的管理，采用自上而下和自下而上的相结合投资策略，实现风险和收益的最佳配比。
业绩比较基准	中债综合财富指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人及基金托管人			
项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰达宏利基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈伟	王东民
	联系电话	010-66577808	010-66594896
	电子邮箱	irm@mfchina.com	tfchina@bocchina.com
客户服务电话		400-010-88888	95566
	传真	010-66577666	010-66594942

2.4 信息披露方式	
基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.mfchina.com
基金年度报告正文的托管人互联网网址	基金管理人、基金托管人的住所

### §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标		金额单位：人民币元	
3.1.1 期间数据和指标	2014年8月6日(基金合同生效日)–2014年12月31日	泰达宏利债券	
本期已实现收益	16,228,849.97	4,873,742.95	
本期利润	15,809,935.83	5,449,971.69	
加权平均基金份额本期利润	0.0560	0.0312	
本期基金份额净值增长率	6.20%	5.90%	
3.1.2 期间数据和指标	2014年末	泰达宏利债券	
期末可供分配基金份额利润	0.0620	0.0594	
期末基金份额净值	183.048,917.03	24,292,565.05	
基金净值增长率	6.20%	5.90%	

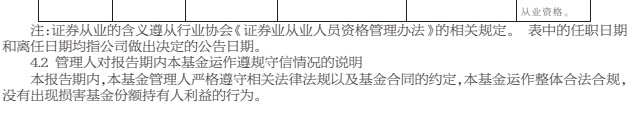
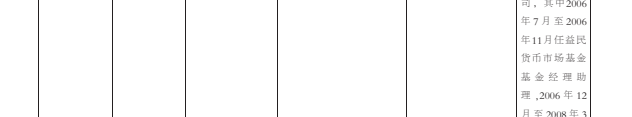
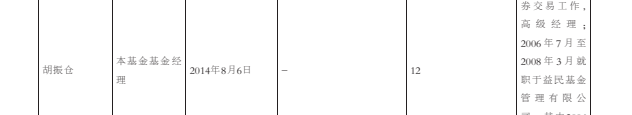
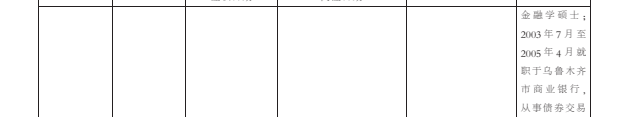
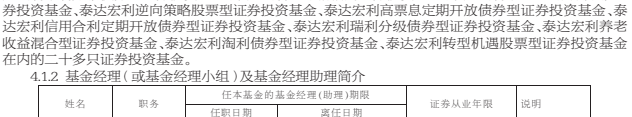
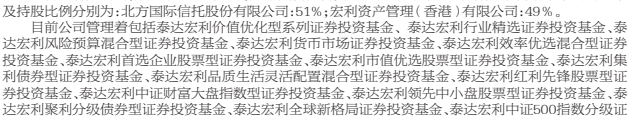
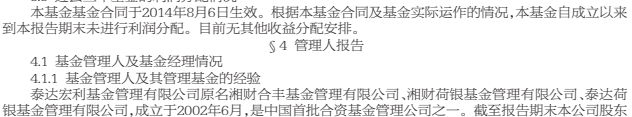
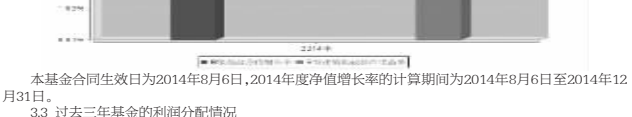
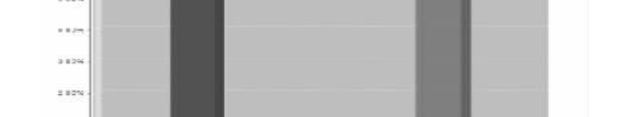
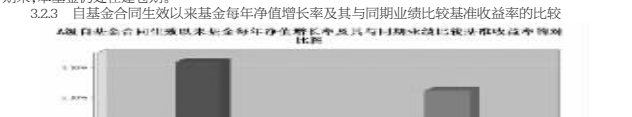
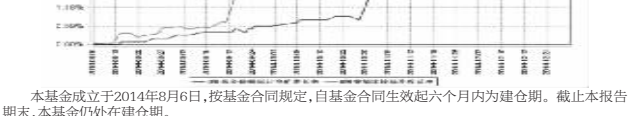
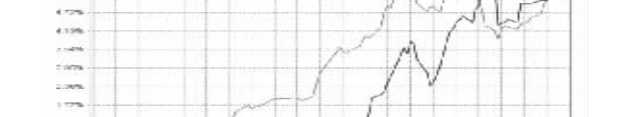
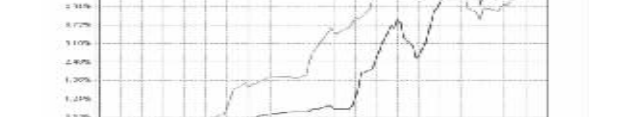
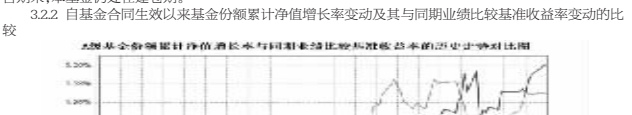
注：1. 本基金已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；  
2. 所述基金份额净值增长率不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实现的收益水平要低于所列数据；  
3. 期末可供分配利润等于期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现  
3.2.1 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	份额净值增长率	业绩比较基准	份额净值增长率	业绩比较基准	①-③	②-④
过去三个月	5.46%	0.34%	3.26%	0.23%	2.24%	0.11%
过去六个月	6.20%	0.27%	5.24%	0.19%	0.96%	0.08%

阶段	份额净值增长率	业绩比较基准	份额净值增长率	业绩比较基准	①-③	②-④
过去三个月	5.27%	0.33%	3.26%	0.23%	2.05%	0.10%
过去六个月	5.90%	0.26%	5.24%	0.19%	0.66%	0.07%

注：1. 本基金的业绩比较基准：中债综合财富指数。  
2. 本基金成立于2014年8月6日，按基金合同规定，自基金合同生效起六个月内为建仓期。截止本报告期末，本基金处于建仓期。  
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



# 泰达宏利淘利债券型证券投资基金

## 2014 年度 报告 摘要

注：1. 报告截止日2014年12月31日，基金份额总额195,294,880.97份，其中下属A类基金份额172,365,041.88份，B类基金份额22,929,839.09份。下属A类基金份额净值1.062元，B类基金份额净值1.059元。

2. 本财务报表的实际编制期间为2014年8月6日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

### 7.2 利润分配

会计主体：泰达宏利淘利债券型证券投资基金  
本报告期内未进行利润分配。

资产	本期
一、收入	24,608,411.49
1. 利息收入	9,775,750.99
其中：存款利息收入	4,248,896.38
债券利息收入	5,398,702.46
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	131,152.15
其他利息收入	-
2. 投资收益(含公允价值变动)	14,544,008.52
其中：股票投资收益	-54,998.74
基金投资收益	-
债券投资收益	14,599,038.26
资产支持证券投资损益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	190,329.60
4. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-
5. 其他收入(含利息收入)	99,294.86
二、费用	3,318,903.07
1. 管理人报酬	1,135,633.21
2. 托管费	378,544.50
3. 销售服务费	182,239.42
4. 交易费用	16,850.72
5. 利息支出	1,380,817.08
其中：卖出回购金融资产支出	1,380,817.08
6. 其他费用	224,419.04
三、净利润(亏损以“-”号填列)	21,289,507.52
四、净利润(亏损以“-”号填列)	21,289,507.52

注：1. 报告截止日2014年12月31日，基金份额总额195,294,880.97份，其中下属A类基金份额172,365,041.88份，B类基金份额22,929,839.09份。下属A类基金份额净值1.062元，B类基金份额净值1.059元。

资产	本期
一、收入	24,608,411.49
1. 利息收入	9,775,750.99
其中：存款利息收入	4,248,896.38
债券利息收入	5,398,702.46
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	131,152.15
其他利息收入	-
2. 投资收益(含公允价值变动)	14,544,008.52
其中：股票投资收益	-54,998.74
基金投资收益	-
债券投资收益	14,599,038.26
资产支持证券投资损益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	190,329.60
4. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-
5. 其他收入(含利息收入)	99,294.86
二、费用	3,318,903.07
1. 管理人报酬	1,135,633.21
2. 托管费	378,544.50
3. 销售服务费	182,239.42
4. 交易费用	16,850.72
5. 利息支出	1,380,817.08
其中：卖出回购金融资产支出	1,380,817.08
6. 其他费用	224,419.04
三、净利润(亏损以“-”号填列)	21,289,507.52
四、净利润(亏损以“-”号填列)	21,289,507.52

注：1. 报告截止日2014年12月31日，基金份额总额195,294,880.97份，其中下属A类基金份额172,365,041.88份，B类基金份额22,929,839.09份。下属A类基金份额净值1.062元，B类基金份额净值1.059元。

2. 本财务报表的实际编制期间为2014年8月6日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

### 7.2 利润分配

会计主体：泰达宏利淘利债券型证券投资基金  
本报告期内未进行利润分配。

资产	本期
一、收入	24,608,411.49
1. 利息收入	9,775,750.99
其中：存款利息收入	4,248,896.38
债券利息收入	5,398,702.46
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	131,152.15
其他利息收入	-
2. 投资收益(含公允价值变动)	14,544,008.52
其中：股票投资收益	-54,998.74
基金投资收益	-
债券投资收益	14,599,038.26
资产支持证券投资损益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	190,329.60
4. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-
5. 其他收入(含利息收入)	99,294.86
二、费用	3,318,903.07
1. 管理人报酬	1,135,633.21
2. 托管费	378,544.50
3. 销售服务费	182,239.42
4. 交易费用	16,850.72
5. 利息支出	1,380,817.08
其中：卖出回购金融资产支出	1,380,817.08
6. 其他费用	224,419.04
三、净利润(亏损以“-”号填列)	21,289,507.52
四、净利润(亏损以“-”号填列)	21,289,507.52

注：1. 报告截止日2014年12月31日，基金份额总额195,294,880.97份，其中下属A类基金份额172,365,041.88份，B类基金份额22,929,839.09份。下属A类基金份额净值1.062元，B类基金份额净值1.059元。

2. 本财务报表的实际编制期间为2014年8月6日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

### 7.2 利润分配

会计主体：泰达宏利淘利债券型证券投资基金  
本报告期内未进行利润分配。

资产	本期
一、收入	24,608,411.49
1. 利息收入	9,775,750.99
其中：存款利息收入	4,248,896.38
债券利息收入	5,398,702.46
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	131,152.15
其他利息收入	-
2. 投资收益(含公允价值变动)	14,544,008.52
其中：股票投资收益	-54,998.74
基金投资收益	-
债券投资收益	14,599,038.26
资产支持证券投资损益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	190,329.60
4. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-
5. 其他收入(含利息收入)	99,294.86
二、费用	3,318,903.07
1. 管理人报酬	1,135,633.21
2. 托管费	378,544.50
3. 销售服务费	182,239.42
4. 交易费用	16,850.72
5. 利息支出	1,380,817.08
其中：卖出回购金融资产支出	1,380,817.08
6. 其他费用	224,419.04
三、净利润(亏损以“-”号填列)	21,289,507.52
四、净利润(亏损以“-”号填列)	21,289,507.52

注：1. 报告截止日2014年12月31日，基金份额总额195,294,880.97份，其中下属A类基金份额172,365,041.88份，B类基金份额22,929,839.09份。下属A类基金份额净值1.062元，B类基金份额净值1.059元。

2. 本财务报表的实际编制期间为2014年8月6日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

### 7.2 利润分配

会计主体：泰达宏利淘利债券型证券投资基金  
本报告期内未进行利润分配。

资产	本期
一、收入	24,608,411.49
1. 利息收入	9,775,750.99
其中：存款利息收入	4,248,896.38
债券利息收入	5,398,702.46
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	131,152.15
其他利息收入	-
2. 投资收益(含公允价值变动)	14,544,008.52
其中：股票投资收益	-54,998.74
基金投资收益	-
债券投资收益	14,599,038.26
资产支持证券投资损益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	190,329.60
4. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-
5. 其他收入(含利息收入)	99,294.86
二、费用	3,318,903.07
1. 管理人报酬	1,135,633.21
2. 托管费	378,544.50
3. 销售服务费	182,239.42
4. 交易费用	16,850.72
5. 利息支出	1,380,817.08
其中：卖出回购金融资产支出	1,380,817.08
6. 其他费用	224,419.04
三、净利润(亏损以“-”号填列)	21,289,507.52
四、净利润(亏损以“-”号填列)	21,289,507.52

注：1. 报告截止日2014年12月31日，基金份额总额195,294,880.97份，其中下属A类基金份额172,365,041.88份，B类基金份额22,929,839.09份。下属A类基金份额净值1.062元，B类基金份额净值1.059元。

2. 本财务报表的实际编制期间为2014年8月6日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

### 7.2 利润分配

会计主体：泰达宏利淘利债券型证券投资基金  
本报告期内未进行利润分配。

资产	本期
一、收入	24,608,411.49
1. 利息收入	9,775,750.99
其中：存款利息收入	4,248,896.38
债券利息收入	5,398,702.46
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	131,152.15
其他利息收入	-
2. 投资收益(含公允价值变动)	14,544,008.52
其中：股票投资收益	-54,998.74
基金投资收益	-
债券投资收益	14,599,038.26
资产支持证券投资损益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	190,329.60
4. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-
5. 其他收入(含利息收入)	99,294.86
二、费用	3,318,903.07
1. 管理人报酬	1,135,633.21
2. 托管费	378,544.50
3. 销售服务费	182,239.42
4. 交易费用	16,850.72
5. 利息支出	1,380,817.08
其中：卖出回购金融资产支出	1,380,817.08
6. 其他费用	224,419.04
三、净利润(亏损以“-”号填列)	21,289,507.52
四、净利润(亏损以“-”号填列)	21,289,507.52

注：1. 报告截止日2014年12月31日，基金份额总额195,294,880.97份，其中下属A类基金份额172,365,041.88份，B类基金份额22,929,839.09份。下属A类基金份额净值1.062元，B类基金份额净值1.059元。

2. 本财务报表的实际编制期间为2014年8月6日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

### 7.2 利润分配

会计主体：泰达宏利淘利债券型证券投资基金  
本报告期内未进行利润分配。

资产	本期
一、收入	24,608,411.49
1. 利息收入	9,775,750.99
其中：存款利息收入	4,248,896.38
债券利息收入	5,398,702.46
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	131,152.15
其他利息收入	-
2. 投资收益(含公允价值变动)	14,544,008.52
其中：股票投资收益	-54,998.74
基金投资收益	-
债券投资收益	14,599,038.26
资产支持证券投资损益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	190,329.60
4. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-
5. 其他收入(含利息收入)	99,294.86
二、费用	3,318,903.07
1. 管理人报酬	1,135,633.21
2. 托管费	378,544.50
3. 销售服务费	182,239.42
4. 交易费用	16,850.72
5. 利息支出	1,380,817.08
其中：卖出回购金融资产支出	1,380,817.08
6. 其他费用	224,419.04
三、净利润(亏损以“-”号填列)	21,289,507.52
四、净利润(亏损以“-”号填列)	21,289,507.52

注：1. 报告截止日20