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 重要提示及目录

1.1 重要提示

本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。本年度报告已经全体独立董事签字同意,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25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(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。

本报告期自2014年1月1日起至2014年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰达宏利500指数分级		
场内简称	泰达500		
基金主代码	162216		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011年12月1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		
报告期末基金份额总额	63,994,374.25份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2011-12-20		
下属分级基金的基金简称	泰达稳健	泰达进取	泰达宏利500指数分级
下属分级基金的场内简称	泰达稳健	泰达进取	泰达500
下属分级基金的交易代码	150053	150054	162216
报告期末下属分级基金份额总额	10,142,828.00份	15,214,242.00份	38,637,304.25份

2.2 基金产品说明

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,并根据标的指数成份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。
下属分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 / -

2.3 基金管理人和基金托管人

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	陈沛	王永民
	联系电话	010-66577808	010-66594896
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-69-88888	95566
传真		010-66577666	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.mfcteda.com
基金年度报告备置地点	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	2013年	2012年
本期已实现收益	8,202,255.07	7,113,653.74	3,133,290.16
本期利润	6,333,196.82	6,450,715.14	9,020,564.64
加权平均基金份额本期利润	0.3153	0.2214	0.0888
本期基金份额净值增长率	32.25%	14.55%	-1.40%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.4384	0.1035	-0.0341
期末基金资产净值	88,594,754.62	18,403,113.01	58,594,887.91
期末基金份额净值	1.3844	1.0728	0.9640

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

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

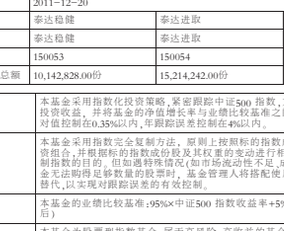
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.50%	1.30%	7.91%	1.37%	-2.41%	-0.07%
过去六个月	31.21%	1.11%	33.72%	1.16%	-2.51%	-0.05%
过去一年	32.25%	1.15%	37.06%	1.18%	-4.81%	-0.03%
过去三年	49.38%	1.32%	60.30%	1.34%	-10.92%	-0.02%
自基金合同生效起至今	46.39%	1.31%	38.20%	1.35%	8.19%	-0.04%

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

本基金于2011年12月1日成立,建仓期为6个月,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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



本基金合同生效日为2011年12月1日,2011年度净值增长率的计算期间为2011年12月1日至2011年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据本基金合同的约定,在存续期内,本基金(包括中证500、泰达稳健、泰达进取)不进行收益分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰达宏利基金管理有限公司原名称为泰达荷银基金管理有限公司,澳财前银基金管理有限公司,泰达前银基金管理有限公司,成立于2002年6月,是中国首批合资基金管理公司之一,截至报告期末本公司股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司:51%;宏利资产管理(香港)有限公司:49%。

目前公司管理着包括泰达宏利价值优化股票型证券投资基金、泰达宏利行业精选证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利策略混合型证券投资基金、泰达宏利收益债券型证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利新经济混合型证券投资基金、泰达宏利周期优选混合型证券投资基金、泰达宏利复兴混合型证券投资基金、泰达宏利盛世中国混合型证券投资基金、泰达宏利新机遇混合型证券投资基金、泰达宏利平稳收益混合型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利内需增长混合型证券投资基金、泰达宏利新兴产业混合型证券投资基金、泰达宏利新动力灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利首选成长股票型证券投资基金、泰达宏利价值驱动混合型证券投资基金、泰达宏利稳健回报混合型证券投资基金、泰达宏利中小盘股票型证券投资基金、泰达宏利领先中国股票型证券投资基金、泰达宏利新机遇灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利新动力股票型证券投资基金、泰达宏利优势精选混合型证券投资基金、泰达宏利内需驱动混合型证券投资基金、泰达宏利盛世红利混合型证券投资基金、泰达宏利转型机遇两年定期开放混合型证券投资基金、泰达宏利稳健回报两年定期开放混合型证券投资基金、泰达宏利新兴产业两年定期开放混合型证券投资基金、泰达宏利新动力两年定期开放混合型证券投资基金、泰达宏利周期优选两年定期开放混合型证券投资基金、泰达宏利内需增长两年定期开放混合型证券投资基金、泰达宏利盛世中国两年定期开放混合型证券投资基金、泰达宏利首选企业两年定期开放混合型证券投资基金、泰达宏利领先中国两年定期开放混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算两年定期开放混合型证券投资基金、泰达宏利策略两年定期开放混合型证券投资基金、泰达宏利行业精选两年定期开放混合型证券投资基金、泰达宏利价值优化两年定期开放混合型证券投资基金、泰达宏利复兴