

**泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业  
证券投资基金、稳定类行业证券投资基金  
更新招募说明书（摘要）**

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

泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金于 2003 年 2 月 13 日获中国证监会证监基金字【2003】21 号文批准募集，基金合同于 2003 年 4 月 25 日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示本基金的未来表现。

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其它有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本更新招募说明书已经本基金托管人交通银行股份有限公司复核，所载内容截止日为 2012 年 4 月 25 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2012 年 3 月 31 日。财务数据未经审计。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

公司名称：泰达宏利基金管理有限公司

成立日期：2002年6月6日

注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

法定代表人：刘惠文

组织形式：有限责任公司

联系电话：010-66577605

联系人：苗广斌

注册资本：1.8亿元人民币

股权结构：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%。

### （二）主要人员情况

#### 1、董事会成员

刘惠文先生，董事长。毕业于吉林大学经济系，经济学学士学位，高级经济师。1996年至2001年任天津泰达集团有限公司总经理。2001年至2006年担任天津泰达投资控股有限公司董事长兼总经理。2006年至2010年任天津泰达投资控股有限公司董事长。2010年起任天津市泰达国际控股（集团）有限公司董事长。兼任渤海财产保险股份有限公司董事长、北方信托国际投资股份有限公司董事长，渤海银行股份有限公司董事、渤海证券有限公司董事等职。

刘振宇先生，董事。毕业于天津师范大学和南开大学，拥有法学学士学位和经济学博士学位，律师、经济师。2000年至2002年任天津泰达集团有限公司投资部副部长。2002年至2008年任天津泰达投资控股有限公司资产管理部经理。2008年任天津市泰达国际控股（集团）有限公司总经理助理。2010年起任天津市泰达国际控股（集团）有限公司副总经理。兼任恒安标准人寿保险有限公司董事、渤海财产保险股份有限公司董事等职。

孙泉先生，董事。拥有天津南开大学经济学学士和经济学硕士学位及美国芝加哥罗斯福大学工商管理硕士学位。1988年任职天津开发区信托投资公司，负责信贷和外汇管理工作；1989年任职天津开发区管理委员会政策研究室，负责区域发展、国企改革、对外合作政策的研究和

制定工作；1997 年任职天津经济技术开发区总公司企划部，负责企业发展战略研究和计划经营管理工作；2001 年任职天津泰达投资控股公司资产管理部，负责泰达控股重组并购、资源整合、上市筹备和金融类、实业类企业的经营管理工作。现任天津泰达投资控股公司资产管理部经理，渤海产业基金投资管理公司、恒安标准人寿保险公司和天津钢管集团股份有限公司董事等职。

施德林(Marc Howard Sterling)先生，美国国籍，董事。心理学学士学位、法学博士学位及银行法硕士学位。施先生为宏利金融亚洲区行政副总裁，掌管宏利金融在中国和台湾的业务。施先生于亚洲从事金融服务业超过二十一年，其中在宏利工作十七年，五年则为专责有关金融服务的执业律师。施先生为宏利保险策划开拓中国、越南及澳门市场，并为宏利资产管理策划开拓中国及台湾市场。施先生分别自 1993 年及 2000 年管理宏利在中国及台湾业务，并于 1999 至 2005 年成功开拓及经营宏利在越南之业务。现任宏利金融亚洲区行政副总裁、中宏人寿保险有限公司董事长及宏利证券投资信托股份有限公司主席。

雷柏刚 (Robert Allen Cook) 先生，加拿大国籍，董事。毕业于加拿大多伦多大学及卡尔加里大学，持有金融学工商管理硕士学位。雷先生为宏利金融亚洲区高级行政副总裁兼总经理，并为宏利金融执行委员会成员。雷先生统领宏利金融于中国内地、香港、印尼、日本、马来西亚、菲律宾、新加坡、台湾、泰国、越南等地的业务发展。雷先生于 2007 年出任现职前曾担任美国保险业务部行政副总裁，掌管恒康人寿保险、恒康长期护理、恒康金融网络等业务单位。雷先生服务宏利逾三十载，历任美国、加拿大、国际及企业业务部多项管理要职，曾驻多伦多、沃特卢、波士顿、英格兰等地，现常驻香港。雷先生于策略规划、保险及年金产品管理、销售、市场推广等领域均饶富经验。现任宏利金融亚洲区高级行政副总裁兼总经理、宏利国际控股有限公司总裁兼首席行政总监及宏利资产管理(香港)有限公司主席。

杜汶高先生，董事。毕业于美国卡内基美隆大学，持有数学及管理科学理学士学位，现为宏利资产管理(亚洲)总裁兼亚洲区主管及宏利资产管理(香港)有限公司董事，掌握亚洲及日本的投资事务，专责管理宏利于区内不断壮大的资产，并确保公司的投资业务符合监管规定。出任现职前，先生掌管宏利于亚洲区(香港除外)的投资事务。2001 年至 2004 年，负责波士顿领导机构息差产品的开发工作。先生于 2001 年加入宏利，之前任职于一家环球评级机构，曾获派驻纽约、伦敦及悉尼担任杠杆融资及资产担保证券等不同部门的主管，拥有二十三年的资本市场经验。

汪丁丁先生，独立董事，毕业于北京师范学院数学系，中国科学院数学力学部理学硕士学位，1990年获夏威夷大学经济学博士学位。1984年至1998年先后担任中国科学院系统科学研究所助理研究员、美国东西方中心人口研究所访问学者、博士后研究员、香港大学经济与金融学院助理教授、德国杜伊斯堡大学经济系客座教授、北京大学中国经济研究中心副教授及美国夏威夷大学经济系访问教授。目前担任北京大学及浙江大学教授，自2007年至今，担任东北财经大学“社会与行为”跨学科教育中心学术委员会主席兼主任。

周小明先生，独立董事。毕业于浙江大学法学院，中国政法大学法学硕士学位、民商法学博士学位。1990年起先后任职于浙江大学、中国人民银行非银行金融机构监管司、君泽君律师事务所、安信信托投资股份有限公司。曾担任全国人大常委会财经委员会《信托法》、《证券投资基金法》起草小组成员、安信信托投资股份有限公司总裁。目前担任中国人民大学信托与基金研究所所长、君泽君律师事务所合伙人、清华大学法学院联合法律硕士导师、中国信托业协会培训与资格办公室副主任、《中国信托业发展报告》主编。

孔晓艳女士，独立董事，毕业于中山大学法律系，法学学士和法学硕士学位，一级律师。1993年至1997年任天津市对外经济律师事务所专职律师。1997年至1999年任香港Livasari&Co. 律师行中国法律顾问。1999年至2004年任嘉德律师事务所专职律师、高级合伙人。2004年至今任嘉德恒时律师事务所专职律师、高级合伙人。兼全国第九届妇女代表、天津市第十一届、第十二届政协委员、天津市财政局和税务局特邀监察员、天津市津滨发展股份有限公司独立董事、天津律协金融业务委员会主任、中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、天津仲裁委员会仲裁员、天津第五届、第六届律协常务理事。

范小云女士，独立董事，毕业于南开大学金融学系，经济学博士学位。毕业于南开大学金融学系，经济学博士学位。1997年至2005年历任南开大学金融学系讲师、副教授。2005年起任南开大学金融学系教授、副主任、国际金融研究中心主任。2001年至2005年担任《南开经济研究》副主编。目前为教育部哲学社会科学重大攻关项目首席专家，南开大学金融学系教授、副主任、国际金融研究中心主任；兼任中国金融学会理事、中国国际金融学会理事。

## 2、监事会成员

邢吉海先生，监事。毕业于天津干部管理学院财会专业，会计师。1995年至1997年任天津泰达国际酒店集团副总经理兼财务总监。1997年至2000年任职于天津经济开发区财政局。2000年至2001年任天津开发区总公司财务中心主任。2001年起任天津泰达投资控股有限公司

监事、财务中心主任。兼任天津市泰达国际控股（集团）有限公司董事、渤海财产保险股份有限公司董事、天津泰达股份有限公司董事、天津津滨发展股份有限公司董事、天津滨海能源发展股份有限公司监事会主席等职。

李卓杰先生，监事。毕业于香港浸会大学，获得会计荣誉学位，美国 CPA。1993 年在香港加入宏利金融，从 1994 年起负责中国业务拓展。1999-2001 年间，李卓杰被任命为宏利金融越南公司副总经理，负责公司的保险管理与信息科技。2004-2006 年，担任中宏人寿保险有限公司北京分公司总经理一职。2005 年，同时被任命为中宏保险副总经理。李卓杰负责宏利金融在中国大陆及台湾地区的业务拓展。除了在这些地区制定执行公司战略决策外，他还负责跟进国家政策，促进与政府及合作伙伴间的关系。目前，李卓杰担任宏利环球管理顾问股份有限公司监察人（自 2010 年 7 月起）及正在筹建的安本智库保险经纪人股份有限公司董事长（自 2011 年 3 月起）一职。

王泉先生，监事。管理学学士、经济学硕士。2002 年 3 月加入泰达宏利基金管理有限公司工作至今，历任基金运营部基金会计、基金运营部副总经理、基金运营部总经理。

### 3、总经理及其他高级管理人员

缪钧伟先生，总经理。毕业于复旦大学和香港城市大学，获得理学学士、经济学硕士和金融学博士学位；1998 年 10 月至 2003 年 2 月任证监会基金部副处长；2003 年 3 月至 2006 年 8 月任海富通基金管理有限公司副总经理。2007 年 2 月起任泰达宏利基金管理有限公司总经理。

刘青山先生，副总经理兼投资总监。毕业于中国人民大学，获史学学士和管理学硕士。1997 年就职于华夏证券基金部，参与筹建华夏基金管理公司，从事投资研究工作。2001 年起参与筹建湘财合丰基金管理有限公司（泰达宏利基金管理有限公司前身）并工作至今，期间历任研究部负责人、基金经理、投资副总监，投资总监兼总经理助理。2006 年 11 月起任泰达宏利基金管理有限公司副总经理兼投资总监。

傅国庆先生，副总经理。毕业于南开大学和美国罗斯福大学，获文学学士和工商管理硕士学位。1993 年至 2006 年就职于北方国际信托股份有限公司，从事信托业务管理工作，期间曾任办公室主任、研发部经理、信托业务总部总经理、董事会秘书、以及公司副总经理。2006 年 9 月起任泰达宏利基金管理有限公司财务总监。

张萍女士，督察长。毕业于中国人民大学和中国科学院，管理学和理学双硕士。先后任职于中信公司、毕马威国际会计师事务所等公司，从事财务管理和管理咨询工作。2002 年起在嘉实基金管理有限公司工作，任监察稽核部副总监。2005 年 10 月起任泰达宏利基金管理有限

公司风险管理部总监。2006年11月起任泰达宏利基金管理有限公司督察长。

#### 4、基金经理

##### (1) 泰达成长基金：

梁辉先生，泰达成长基金基金经理，硕士。2002年3月起任职于泰达宏利基金管理有限公司，曾担任公司研究部行业研究员、基金经理助理、研究部总监、金融工程部总经理，现担任基金投资部总经理。自2011年4月起担任泰达成长基金基金经理。10年基金从业经验，具有证券从业资格、基金从业资格。

邓艺颖女士，泰达成长基金基金经理，金融学硕士。2004年5月至2005年4月就职于中国工商银行广东省分行公司业务部职员；2005年4月加盟泰达宏利基金管理有限公司，先后担任交易部交易员、固定收益部研究员、研究部总监业务助理兼研究员。自2011年6月起担任泰达成长基金基金经理。7年基金从业经验，具有基金从业资格。

该基金历任基金经理：自2003年4月至2005年4月由刘青山先生担任基金经理。自2005年4月起至2008年8月由梁辉先生担任基金经理。自2008年8月起至2010年1月由王勇先生担任基金经理。2010年1月至2011年5月由李源女士担任基金经理。

##### (2) 泰达周期基金：

刘金玉先生，泰达周期基金基金经理，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月就职于华夏基金管理有限公司任行业研究主管；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。自2010年3月起担任本基金基金经理。刘金玉先生具备9年基金公司工作经验，10年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

陈桥宁先生，泰达周期基金基金经理，经济学硕士。1996年7月至2000年8月就职于中国石化石家庄炼油化工股份有限公司任助理工程师；2003年6月至2004年6月就职于奇瑞汽车有限公司任经济师；2004年7月至2005年2月就职于世华国际金融信息有限公司任分析师；2005年3月至2007年4月就职于天相投资顾问有限公司任首席分析师；2007年4月加盟泰达宏利基金管理有限公司，先后担任研究部研究员、研究主管。5年基金从业经验，7年证券从业经验，具有基金从业资格。

该基金历任基金经理：自2003年4月至2004年7月由曾昭雄先生担任基金经理；自2004年7月至2005年2月由史博先生担任基金经理；自2005年2月至2007年4月由温震宇先生

担任基金经理。自 2007 年 3 月 20 日至 2008 年 8 月 5 日，由魏延军先生担任基金经理；自 2007 年 11 月至 2009 年 5 月，由梁辉先生担任基金经理；自 2009 年 3 月至 2011 年 3 月，由吴俊峰先生担任基金经理。

### （3）泰达稳定基金：

胡涛先生，泰达稳定基金基金经理。美国印第安纳大学凯利商学院 MBA，CFA，1999 年 7 月至 2000 年 7 月就职于北京证券有限责任公司任投资银行部经理，2002 年 6 月至 2003 年 6 月就职于中国国际金融有限公司任股票研究经理，2003 年 7 月至 2004 年 4 月就职于长盛基金管理有限公司任研究员，2004 年 9 月至 2007 年 4 月就职于友邦华泰基金管理有限公司任基金经理助理。胡涛先生于 2007 年 4 月加盟泰达宏利基金管理有限公司，先后担任专户投资部副总经理、研究部研究主管等职务，自 2009 年 6 月起担任本基金基金经理。9 年基金从业经验，11 年证券从业经验，具有基金从业资格。

焦云女士，泰达稳定基金基金经理，北京大学金融学硕士。2004 年 8 月至 2007 年 4 月就职于大成基金管理有限公司任研究员；2007 年 4 月加入泰达宏利基金管理有限公司，先后担任研究员、研究主管，自 2009 年 12 月起担任本基金基金经理。8 年基金从业经验，8 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

该基金历任基金经理：自 2003 年 4 月至 2005 年 4 月由康赛波担任基金经理；自 2005 年 4 月至 2005 年 9 月由吴剑飞担任基金经理；自 2005 年 9 月至 2009 年 6 月由李泽刚担任基金经理。

### 5、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员包括公司总经理缪钧伟，副总经理兼投资总监及基金经理刘青山，投资部总经理兼基金经理梁辉，研究部总监兼基金经理陈少平，交易部负责人陈力。

### 6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### （一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD

法定代表人：胡怀邦

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

邮政编码：200120

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：618.85 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：张咏东

电话：021-32169999

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国发钞行之一。交通银行先后于 2005 年 6 月和 2007 年 5 月在香港联交所、上交所挂牌上市，是中国 2010 年上海世博会唯一的商业银行全球合作伙伴。《财资》杂志（The Asset）“2010 年全球最佳交易银行评选”中，交通银行荣膺“最佳次托管银行”大奖。英国《银行家》杂志 2011 年公布的全球 1000 家银行排名，交通银行以 343.21 亿美元的一级资本连续第三年跻身全球商业银行 50 强。截至 2011 年 12 月 31 日，交通银行资产总额达到人民币 4.61 万亿元，实现净利润人民币 502.16 亿元。

交通银行总行设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

## （二）主要人员情况

牛锡明先生，交通银行行长，哈尔滨工业大学经济学硕士，高级经济师。2009 年 12 月起担任交通银行副董事长、行长。

钱文挥先生，交通银行副行长，上海财经大学工商管理硕士。2004 年 10 月起任交通银行副行长，2007 年 8 月起任交通银行执行董事。

谷娜莎女士，交通银行资产托管部总经理。大学学历，经济师。曾任交通银行研究开发部主任科员、交通银行信托部代理业务处副处长、交通银行证券投资基金托管部规划处副处长、交通银行证券投资基金托管部内控巡查处处长；2001 年 1 月任交通银行证券投资基金托管部总经理助理，2002 年 5 月起任交通银行资产托管部副总经理，2007 年 12 月起任交通银行资产托管部总经理。



### （三）基金托管业务经营情况

截止 2012 年一季度末，交通银行共托管证券投资基金 61 只，包括博时现金收益货币、博时新兴成长股票、长城久富股票(LOF)、富国汉兴封闭、富国天益价值股票、光大保德信中小盘股票、国泰金鹰增长股票、海富通精选混合、华安安顺封闭、华安宝利配置混合、华安策略优选股票、华安创新股票、华夏蓝筹混合(LOF)、华夏债券、汇丰晋信 2016 周期混合、汇丰晋信龙腾股票、汇丰晋信动态策略混合、汇丰晋信平稳增利债券、汇丰晋信大盘股票、汇丰晋信低碳先锋股票、汇丰晋信消费红利股票、建信优势封闭、金鹰红利价值混合、金鹰中小盘精选混合、大摩货币、农银恒久增利债券、农银行业成长股票、农银平衡双利混合、鹏华普惠封闭、鹏华普天收益混合、鹏华普天债券、鹏华中国 50 混合、鹏华信用增利、融通行业景气混合、泰达宏利成长股票、泰达宏利风险预算混合、泰达宏利稳定股票、泰达宏利周期股票、天治创新先锋股票、天治核心成长股票(LOF)、万家公用事业行业股票(LOF)、易方达科汇灵活配置混合、易方达科瑞封闭、易方达上证 50 指数、易方达科讯股票、银河银富货币、银华货币、中海优质成长混合、兴全磐稳增利债券、华富中证 100 指数、工银瑞信双利债券、长信量化先锋股票、华夏亚债中国指数、博时深证基本面 200ETF、博时深证基本面 200ETF 联接、建信信用增强债券、富安达优势成长股票、工银主题策略股票、汇丰晋信货币、农银汇理中证 500 指数、建信深证 100 指数。此外，还托管了全国社会保障基金、保险资产、企业年金、QFII、QDII、信托计划、证券公司集合资产计划、ABS、产业基金、专户理财等 12 类产品，托管资产规模超过九千亿元。

## 三、相关服务机构

### （一）直销机构

泰达宏利基金管理有限公司

地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

邮编：100033

传真：010-66577760/61

客户服务电话：400-698-8888（免长话费）或010-66555662

联系人：延慧、崔冉

联系电话：010-66577619、010-66577617

网址：<http://www.mfcteda.com>

网上直销网址：<https://etrade.mfcteda.com/etrading/>

## (二) 代销机构

### 1) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

客服电话：95559

银行网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

### 2) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：中国北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客服电话：95588

银行网站：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

### 3) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

客服电话：95533

银行网站：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

### 4) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

客服电话：95599

银行网站：www.abchina.com

5) **中国银行股份有限公司**

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖 钢

客服电话：95566

银行网站：www.boc.cn

6) **招商银行股份有限公司**

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：傅育宁

客服电话：95555

联系人：邓炯鹏

公司网站：www.cmbchina.com

7) **上海浦东发展银行股份有限公司**

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：(021) 61618888

传真：(021) 63604199

联系人：虞谷云

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

8) **中国邮政储蓄银行股份有限公司（泰达成长基金）**

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

联系人：陈春林

传真：(010) 68858117

客服电话：95580

网址：www.psbc.com

9) **深圳发展银行股份有限公司**

注册地址：深圳深南中路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：深圳深南中路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

客户服务电话：95501

联系人：张青

传真：0755-25841098

公司网址：www.sdb.com.cn

10) **兴业银行股份有限公司**

注册地址：福州市湖东路 154 号

办公地址：福州市五一中路 32 号元洪大厦

法定代表人：高建平

客户服务电话：95561

网站：www.cib.com.cn

11) **中信银行股份有限公司**

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：孔丹

客服电话：95558

联系人：丰靖

电话：010-65550827

传真：010-65550827

网址：<http://bank.ecitic.com>

## 12) 东莞银行股份有限公司

注册地址：东莞市运河东一路 193 号

办公地址：东莞市运河东一路 193 号

法定代表人：廖玉林

电话：0769-22119061

传真：0769-22117730

联系人：巫渝峰

客服电话：4001196228

公司网址：[www.dongguanbank.cn](http://www.dongguanbank.cn)

## 13) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：范一飞

开放式基金咨询电话：021-962888

开放式基金业务传真：021-68476111

联系人：张萍

联系电话：021-68475888

网址：[www.bankofshanghai.com](http://www.bankofshanghai.com)

## 14) 渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号

办公地址：天津市河西区马场道 201-205 号

法定代表人：刘宝凤  
电话：022-58316666  
传真：022-58316259  
联系人：王宏  
客户服务热线：400 888 8811  
公司网站：www.cbhb.com.cn

#### 15) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号  
办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号  
法定代表人：陆华裕  
电话：0574-89068340  
传真：0574-87050024  
联系人：胡技勋  
客户服务热线：96528（上海地区 962528）  
公司网站：www.nbc.com.cn

#### 16) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号  
办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号  
法定代表人：吴建  
电话：010-85238667  
联系人：郑鹏  
客户服务电话：95577  
网址：www.hxb.com.cn

#### 17) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层  
办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹  
联系人：王曦  
传真：010-66226045  
客户服务电话：95526  
公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

**18) 温州银行股份有限公司**

注册地址：温州市车站大道 196 号  
办公地址：温州市车站大道 196 号  
法定代表人：邢增福  
电话：0577-88990082  
传真：0577-88995217  
联系人：林波  
客户服务热线：浙江省 96699，上海 962699，其他地区（0577）96699  
公司网站：www.wzbank.cn

**19) 天津银行股份有限公司**

注册地址：天津市河西区友谊路 15 号  
办公地址：天津市河西区友谊路 15 号  
法定代表人：王金龙  
电话：022-28405330  
传真：022-28405631  
联系人：杨森  
客户服务热线：4006-960296  
公司网站：www.bank-of-tianjin.com

**20) 湘财证券有限责任公司**

注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼  
办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 A 栋 11 层

法定代表人：林俊波  
客服电话：400-888-1551  
传真：021- 68865680  
联系人：钟康莺  
联系电话：021-68634518  
公司网站：www.xcsc.com

#### 21) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室  
办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号  
法定代表人：杜庆平  
联系人：王兆权  
电话：022-28451861  
传真：022-28451892  
电子邮箱：wangzq@bhq.com  
客户服务电话：4006515988  
网址：www.bhq.com

#### 22) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座  
办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座  
法定代表人：顾伟国  
客服电话：4008-888-888  
电话：010-66568430  
联系人：田薇  
公司网站：www.chinastock.com.cn

#### 23) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）



办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、41 和 42 楼

法定代表人：林治海

客服电话：95575 或致电各地营业网点

传真：020-87555305

联系人：黄岚

公司网站：www.gf.com.cn

#### 24) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

客服电话：4008888108

传真：010-65182261

公司网站：www.csc108.com

#### 25) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

客服电话：4008888666

联系人：吴倩

公司网站：www.gtja.com

#### 26) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

全国免费业务咨询电话：95511-8

传真：0755-82400862

网址：[www.PINGAN.com](http://www.PINGAN.com)

**27) 东方证券股份有限公司**

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

客服电话：95503

联系人：吴宇

公司网站：[www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

**28) 世纪证券有限责任公司**

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：卢长才

联系人：方文

客服电话：0755-83199511

公司网站：[www.csc.com.cn](http://www.csc.com.cn)

**29) 申银万国证券股份有限公司**

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

联系人：李清怡

联系电话：021-54033888

客服电话：95523 或 4008895523

网址：[www.sywg.com](http://www.sywg.com)

**30) 齐鲁证券有限公司**

注册地址：济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

**31) 中银国际证券有限责任公司**

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 40 层

法定代表人：许刚

客服电话：4006208888

传真：021-50372474

联系人：李丹

公司网站：www.bocichina.com

**32) 华泰证券股份有限公司**

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

客户服务电话：025-95597

传真：025-84579763

联系人：孙菁菁

公司网站：www.htsc.com.cn

**33) 光大证券股份有限公司**

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨、李芳芳

客户服务电话：4008888788 10108998

传真：021-22169134

公司网址：www.ebscn.com

#### 34) 新时代证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街1号A座8层

办公地址：北京市西城区金融大街1号A座8层

法定代表人：马金声

联系人：孙恺

客户服务电话：4006989898

公司网址：www.xsdzq.cn

#### 35) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

联系电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

客户服务电话：95565，4008888111

公司网址：www.newone.com.cn

#### 36) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

联系人：李春芳

传真：0755-83515567

客户服务电话：0755-33680000 400 6666 888

公司网址：www.cgws.com

### 37) 南京证券有限责任公司

注册地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

办公地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

法定代表人：张华东

联系人：徐翔

联系电话：025-83367888

客户服务电话：400 828 5888

公司网址：www.njzq.com.cn

### 38) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

联系电话：021-38565785

客户服务电话：4008888123

公司网址：www.xyzq.com.cn

### 39) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

客服电话：95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

联系人：金芸、李笑鸣

联系电话：021-23219000

公司网站：www.htsec.com

#### 40) 广州证券有限责任公司

注册地址：广州市越秀区先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19 楼

法定代表人：刘东

客服电话：020-961303

联系电话：020-88836999

传真：020-88836654

联系人：林洁茹

网址：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

#### 41) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

客服电话：96326（福建省外请先拨 0591）

传真：0591-87383610

联系人：张腾

公司网站：[www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

#### 42) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

联系人：齐晓燕

联系电话：0755-82130833

公司网站：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

#### 43) 金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 楼

法定代表人：陆涛

客户服务电话：4008-888-228

传真：0755-83025625

联系人：马贤清

网站：www.jyzq.cn

#### 44) 德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建大厦 26 楼

法定代表人：姚文平

客服电话：4008888128

传真：021-68767032

联系人：罗芳

公司网站：www.tebon.com.cn

#### 45) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号凤凰大厦 1 栋 9 层

法人代表人：牛冠兴

客服电话：4008001001

联系人：陈剑虹

联系电话：0755-82825551

网址：www.essence.com.cn

#### 46) 东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

法定代表人：朱科敏

联系人：梁旭

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

公司网络地址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

客服电话：400-888-8588

#### 47) 国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层（100007）

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层（100007）

法定代表人：常喆

客户服务电话：400-818-8118

网址：[www.guodu.com](http://www.guodu.com)

#### 48) 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼（410005）

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼（410005）

法定代表人：周晖

联系人：郭磊

联系电话：0731-84403319

开放式基金业务传真：0731-84403439

网址：[www.cfzq.com](http://www.cfzq.com)

#### 49) 宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦



办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号宏源证券

法人：冯戎

联系人：李巍

联系电话：010-88085858

客服电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

#### 50) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

长江证券客户服务网站：www.95579.com

#### 51) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

公司地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

客户服务热线：95571

网址：www.foundersc.com

#### 52) 民生证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

法定代表人：余政

公司网址：www.msza.com

客服热线：4006198888

**53) 国金证券股份有限公司**

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

公司网址： [www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

客服热线： 4006 600109

**54) 中信证券股份有限公司**

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

公司网址： [www.citics.com](http://www.citics.com)

客服热线： 95558

**55) 中山证券有限责任公司**

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人：吴永良

公司网址： [www.zszq.com](http://www.zszq.com)

客服热线： 4001022011

**56) 西藏同信证券有限责任公司**

注册地址：西藏自治区拉萨市北京中路 101 号

办公地址：上海市永和路 118 弄 24 号楼

法定代表人：贾绍君

公司网址： [www.xzsec.com](http://www.xzsec.com)

客服热线： 40088-11177

### 57) 中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：张智河

公司网址：www.zxwt.com.cn

客服热线：96577

### 58) 中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦 19 层

法定代表人：沈强

公司网址：www.bigsun.com.cn

客服热线：0571-96598

### 59) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座

办公地址：北京市金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

客服电话：010-66045678

联系人：林爽

天相投顾网-网址：www.txsec.com

天相基金网-网址：www.txjijin.com

### （三）注册登记机构

名称：泰达宏利基金管理有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

法定代表人：刘惠文

联系人：王泉

电话：010—66577768

传真：010—66577750

#### （四）律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

经办律师：廖海

#### （五）会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办注册会计师：曹银华、单峰

## 四、基金的名称

泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金。

## 五、基金的类型

契约型开放式。

## 六、基金的投资目标

泰达成长、泰达周期、泰达稳定分别主要投资于成长、周期、稳定三个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投资回报。

## 七、基金的投资方向

泰达成长、泰达周期、泰达稳定是三只相互独立的行业类别证券投资基金，共同构成本系列基金。本系列基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括投资于国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。泰达成长、泰达周期、泰达稳定的股票投资部分分别主要投资于成长、周期、稳定三个行业类别中依据市净率（P/B）和市盈率与每股预期收益增长率之比（PEG）所确定的具有增长潜力的价值型股票，即本系列基金所定义的价值优化型股票。在股票投资中严格遵循：（1）各行业类别基金投资于该基金类型所对应行业类别股票的比重不低于该基金股票净值的 80%（一级市场认购股票除外）；（2）各只行业类别基金的股票投资以价值优化型股票为主要投资对象。

## 八、基金的投资策略

本系列基金每只行业类别基金采用“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中。

本系列基金管理人根据对宏观经济变化、资本市场发展动态及行业结构调整的分析判断，确定本系列基金每只行业类别基金在股票、债券、现金和其它投资品种间的资产配置比例，并通过对国家产业政策、行业发展状况的分析研究，确定各行业类别基金的行业配置比例。

在资产配置、行业配置完成后，基金管理人主要通过 P/B、PEG 指标来确定价值优化型股票，在个股 PEG 值计算中，本系列基金管理人从以下几个方面评估上市公司的每股预期收益增长率 G：

- 公司的商业模式
- 所处行业发展前景
- 产品市场前景分析，包括产品本身市场分析、主要竞争对手、上下游产品关联性及其定

价能力、替代产品分析等

- 公司的核心竞争力分析,包括管理者素质、市场营销能力、技术创新能力、专有技术、特许权、品牌、重要客户等
- 公司财务状况及财务管理能力,包括财务安全性指标,反映行业特性的主要财务指标、公司股权与债权融资能力与成本分析、公司再投资收益率分析等
- 公司潜在风险及应对措施

以价值优化型股票为基础,结合考虑满足以下条件的相关股票,组成本系列基金股票备选库:

i. 股票 P/B、PEG 某单项指标特优,另一项指标未能反映其真实状况。

ii. 上市公司资产重组或生产经营管理方面发生重大改变,将可能会对公司经营业绩和未来发展前景产生重大和实质性影响。

iii. 公司拥有未被市场认识的或被市场低估的资源,导致公司会计帐面值低于公司内在价值。

iv. 研究部利用其它股票定价模型分析确定的投资价值被严重低估的股票。

基金经理在股票备选库的范围内进行股票投资。

## 九、基金的业绩比较基准

泰达成长:  $65\% \times \text{富时中国 A600 成长行业指数} + 35\% \times \text{上证国债指数}$

泰达周期:  $65\% \times \text{富时中国 A600 周期行业指数} + 35\% \times \text{上证国债指数}$

泰达稳定:  $65\% \times \text{富时中国 A600 稳定行业指数} + 35\% \times \text{上证国债指数}$

## 十、基金的风险收益特征

本系列基金在证券投资基金中属于较高风险的基金品种。

## 十一、基金投资组合报告（未经审计）

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2012年5月18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。

本投资组合报告所载数据截止 2012 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

## 泰达成长基金

### (一) 报告期末基金资产组合 (单位: 元)

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	918,785,198.78	62.38
	其中: 股票	918,785,198.78	62.38
2	固定收益投资	339,938,168.00	23.08
	其中: 债券	339,938,168.00	23.08
	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	202,399,627.43	13.74
6	其他资产	11,823,388.11	0.80
7	合计	1,472,946,382.32	100.00

### (二) 报告期末按行业分类的股票投资组合 (单位: 元)

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	96,979,470.06	6.66
B	采掘业	-	-
C	制造业	581,173,836.54	39.91
C0	食品、饮料	22,227,273.88	1.53
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	11,665,221.75	0.80
C5	电子	152,106,533.73	10.45
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	354,834,564.32	24.37
C8	医药、生物制品	40,340,242.86	2.77
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	177,754,180.22	12.21
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	54,645,761.76	3.75
L	传播与文化产业	8,231,950.20	0.57
M	综合类	-	-
	合计	918,785,198.78	63.10

(三) 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明细 (单位: 元)

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	000063	中兴通讯	4,864,688	79,926,823.84	5.49
2	600066	宇通客车	3,072,210	74,623,980.90	5.12
3	000527	美的电器	5,588,517	73,321,343.04	5.04
4	000651	格力电器	3,241,675	65,903,252.75	4.53
5	000998	隆平高科	2,588,554	60,727,476.84	4.17
6	600498	烽火通信	2,155,572	57,596,883.84	3.96
7	600312	平高电气	6,785,143	56,316,686.90	3.87
8	600686	金龙汽车	5,794,614	43,517,551.14	2.99
9	002273	水晶光电	1,301,685	39,141,667.95	2.69
10	002429	兆驰股份	3,419,206	35,422,974.16	2.43

(四) 报告期末按券种分类的债券投资组合 (单位: 元)

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	58,987,168.00	4.05
2	央行票据	9,674,000.00	0.66
3	金融债券	241,743,000.00	16.60
	其中: 政策性金融债	241,743,000.00	16.60
4	企业债券	19,506,000.00	1.34
5	企业短期融资券	10,028,000.00	0.69
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	339,938,168.00	23.35

(五) 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 (单位: 元)



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	110235	11 国开 35	500,000	50,720,000.00	3.48
2	110410	11 农发 10	500,000	50,645,000.00	3.48
3	020049	11 贴债 04	500,000	48,905,000.00	3.36
4	110240	11 国开 40	400,000	40,572,000.00	2.79
5	110238	11 国开 38	300,000	30,903,000.00	2.12

#### （六）报告附注

1、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年内受到公开谴责、处罚的情形。

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。

3、其他资产（单位：元）

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,916,321.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,496,521.86
5	应收申购款	410,545.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,823,388.11

4、报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

6、报告期末本基金未持有权证。

7、报告期末本基金未持有资产支持证券。

8、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。

#### 泰达周期基金

（一）报告期末基金资产组合（单位：元）

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	442,201,439.09	66.89
	其中：股票	442,201,439.09	66.89
2	固定收益投资	139,780,600.00	21.14
	其中：债券	139,780,600.00	21.14
	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	56,540,851.76	8.55
6	其他资产	22,561,207.14	3.41
7	合计	661,084,097.99	100.00

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合 (单位：元)

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	20,975,227.82	3.19
C	制造业	273,826,232.34	41.65
C0	食品、饮料	27,616,695.31	4.20
C1	纺织、服装、皮毛	3,165,112.61	0.48
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	18,093,342.43	2.75
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	62,241,771.10	9.47
C7	机械、设备、仪表	162,709,310.89	24.75
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,440,314.73	3.11
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	6,768,644.58	1.03
H	批发和零售贸易	21,860,572.50	3.33
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	74,464,432.61	11.33
K	社会服务业	23,866,014.51	3.63
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	442,201,439.09	67.27

(三) 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明细 (单位：元)

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	000401	冀东水泥	1,916,053	32,017,245.63	4.87
2	600066	宇通客车	1,163,233	28,254,929.57	4.30
3	600138	中青旅	1,481,441	23,866,014.51	3.63
4	002024	苏宁电器	2,242,110	21,860,572.50	3.33
5	600048	保利地产	1,897,867	21,426,918.43	3.26
6	002146	荣盛发展	1,987,176	20,547,399.84	3.13
7	600970	中材国际	1,022,527	20,440,314.73	3.11
8	600312	平高电气	2,384,510	19,791,433.00	3.01
9	600104	上汽集团	1,210,628	17,953,613.24	2.73
10	002250	联化科技	795,529	15,234,380.35	2.32

（四）报告期末按券种分类的债券投资组合（单位：元）

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	59,568,600.00	9.06
2	央行票据	19,882,000.00	3.02
3	金融债券	60,330,000.00	9.18
	其中：政策性金融债	60,330,000.00	9.18
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	139,780,600.00	21.26

（五）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（单位：元）

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	110216	11 国开 16	400,000	40,264,000.00	6.12
2	020049	11 贴债 04	340,000	33,255,400.00	5.06
3	110305	11 进出 05	200,000	20,066,000.00	3.05
4	030002	03 国债 02	200,000	19,992,000.00	3.04
5	1001032	10 央票 32	200,000	19,882,000.00	3.02

（六）报告附注

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，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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。

### 3、其他资产（单位：元）

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,250,000.00
2	应收证券清算款	18,454,331.26
3	应收股利	-
4	应收利息	2,743,478.12
5	应收申购款	113,397.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,561,207.14

4、报告期末本基金没有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

6、报告期末本基金未持有权证。

7、报告期末本基金未持有资产支持证券。

8、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。

### 泰达稳定基金

#### （一）报告期末基金资产组合（单位：元）

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	117,394,101.76	67.29
	其中：股票	117,394,101.76	67.29
2	固定收益投资	39,162,962.40	22.45
	其中：债券	39,162,962.40	22.45
	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	14,788,610.57	8.48
6	其他资产	3,110,761.64	1.78
7	合计	174,456,436.37	100.00

#### （二）报告期末按行业分类的股票投资组合（单位：元）

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	15,538,051.46	9.04

B	采掘业	-	-
C	制造业	53,996,349.85	31.43
C0	食品、饮料	34,993,076.21	20.37
C1	纺织、服装、皮毛	3,995,961.00	2.33
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	4,169,710.44	2.43
C8	医药、生物制品	10,837,602.20	6.31
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,797,101.00	1.05
F	交通运输、仓储业	4,846,925.08	2.82
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	9,194,774.36	5.35
I	金融、保险业	25,075,861.85	14.60
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	4,978,120.16	2.90
L	传播与文化产业	1,966,918.00	1.14
M	综合类	-	-
	合计	117,394,101.76	68.33

(三) 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明细 (单位: 元)

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	000998	隆平高科	379,997	8,914,729.62	5.19
2	600887	伊利股份	314,354	6,928,362.16	4.03
3	601628	中国人寿	420,458	6,874,488.30	4.00
4	000895	双汇发展	85,840	5,914,376.00	3.44
5	002024	苏宁电器	545,472	5,318,352.00	3.10
6	600000	浦发银行	577,800	5,159,754.00	3.00
7	000568	泸州老窖	124,100	4,851,069.00	2.82
8	600009	上海机场	375,149	4,846,925.08	2.82
9	601788	光大证券	355,430	4,254,497.10	2.48
10	600559	老白干酒	153,260	4,233,041.20	2.46

(四) 报告期末按券种分类的债券投资组合 (单位: 元)

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	8,802,900.00	5.12
2	央行票据	29,823,000.00	17.36
3	金融债券	-	-
	其中: 政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	537,062.40	0.31
8	其他	-	-
9	合计	39,162,962.40	22.80

(五) 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 (单位: 元)

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	1001032	10 央票 32	300,000	29,823,000.00	17.36
2	020049	11 贴债 04	90,000	8,802,900.00	5.12
3	113001	中行转债	5,670	537,062.40	0.31

注: 上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。

(六) 报告附注

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, 在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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。

3. 其他资产 (单位: 元)

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	1,293,428.42
3	应收股利	-
4	应收利息	999,568.61
5	应收申购款	67,764.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,110,761.64

4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细。

序号	债券代码	债券名称	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	113001	中行转债	537,062.40	0.31

## 5、报告期末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	000895	双汇发展	5,914,376.00	3.44	重大资产重组

6、报告期末本基金未持有权证。

7、报告期末本基金未持有资产支持证券。

8、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。

## 十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为 2003 年 4 月 25 日，基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

(一)截止 2012 年 3 月 31 日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：

### 泰达成长基金

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
2003 年 4 月 25 日 -12 月 31 日	-1.41%	0.56%	-7.34%	0.78%	5.93%	-0.22%
2004 年 1 月 1 日 -12 月 31 日	17.09%	0.95%	-8.54%	1.02%	25.63%	-0.07%
2005 年 1 月 1 日 -12 月 31 日	11.42%	0.97%	-7.13%	0.98%	18.55%	-0.01%
2006 年 1 月 1 日 -12 月 31 日	81.74%	1.26%	54.13%	1.06%	27.61%	0.20%
2007 年 1 月 1 日 -12 月 31 日	110.40%	1.64%	81.63%	1.54%	28.77%	0.10%
2008 年 1 月 1 日	-31.61%	1.83%	-34.32%	1.92%	2.71%	-0.09%

-12月31日						
2009年1月1日 -12月31日	52.12%	1.30%	51.26%	1.21%	0.86%	0.09%
2010年1月1日 至12月31日	22.32%	1.33%	9.02%	1.12%	13.30%	0.21%
2011年1月1日 至12月31日	-27.17%	1.07%	-22.51%	0.90%	-4.66%	0.17%
2012年1月1日 至3月31日	-6.95%	1.31%	-0.38%	1.18%	-6.57%	0.13%
基金合同生效以 来至2012年3月 31日	324.23%	1.30%	84.21%	1.24%	240.02%	0.06%

### 泰达周期基金

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
2003年4月25日 -12月31日	11.98%	0.69%	-1.86%	0.64%	13.84%	0.05%
2004年1月1日 -12月31日	3.12%	1.08%	-14.31%	0.90%	17.43%	0.18%
2005年1月1日 -12月31日	3.87%	1.07%	-4.37%	0.99%	8.24%	0.08%
2006年1月1日 -12月31日	137.80%	1.29%	70.60%	1.37%	67.20%	-0.08%
2007年1月1日 -12月31日	81.77%	1.82%	105.32%	1.63%	-23.55%	0.19%
2008年1月1日 -12月31日	-40.52%	1.80%	-49.54%	2.01%	9.02%	-0.21%
2009年1月1日 -12月31日	71.49%	1.80%	66.62%	1.52%	4.87%	0.28%
2010年1月1日 至12月31日	9.51%	1.30%	1.50%	1.15%	8.01%	0.15%
2011年1月1日 至12月31日	-28.59%	1.18%	-21.52%	0.97%	-7.07%	0.21%
2012年1月1日 至3月31日	3.10%	1.27%	4.35%	1.20%	-1.25%	0.07%
基金合同生效以 来至2012年3月 31日	326.36%	1.42%	96.86%	1.33%	229.50%	0.09%



## 泰达稳定基金

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
2003年4月25日 -12月31日	5.10%	0.55%	-3.70%	0.71%	8.80%	-0.16%
2004年1月1日 -12月31日	1.82%	0.90%	-9.97%	0.84%	11.79%	0.06%
2005年1月1日 -12月31日	6.52%	0.97%	-0.36%	0.86%	6.88%	0.11%
2006年1月1日 -12月31日	135.33%	1.19%	76.12%	1.11%	59.21%	0.08%
2007年1月1日 -12月31日	74.10%	1.61%	76.76%	1.45%	-2.66%	0.16%
2008年1月1日 -12月31日	-46.00%	1.79%	-43.98%	1.89%	-2.02%	-0.10%
2009年1月1日 -12月31日	42.03%	1.51%	52.68%	1.27%	-10.65%	0.24%
2010年1月1日 至12月31日	5.99%	1.27%	-11.15%	0.95%	17.14%	0.32%
2011年1月1日 至12月31日	-17.00%	0.96%	-9.58%	0.75%	-7.42%	0.21%
2012年1月1日 至3月31日	-0.66%	1.17%	3.51%	0.82%	-4.17%	0.35%
基金合同生效以 来至2012年3月 31日	213.07%	1.28%	91.30%	1.17%	121.77%	0.11%

## 十三、基金的费用与税收

(一) 本系列基金发生的费用按照公平原则经托管人认定后由各行业类别基金单独承担或由各行业类别基金分摊。

(二) 基金运作费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金证券交易费用；
- 4、基金的信息披露费用；

5、基金的会计师费和律师费；

6、按照国家有关规定可以列支的其它费用。

各行业类别基金费用由基金托管人从该基金资产中支付。

### （三）基金运作费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

基金管理人的管理费，在通常情况下，按前一日的各行业类别基金资产净值之和的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H：为每日应计提的本系列基金管理费；

E：为前一日各行业类别基金资产净值的和。

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从各行业类别基金资产中一次性支付给基金管理人。

#### 2、基金托管人的托管费

基金托管人的托管费，在通常情况下，按前一日的各行业类别基金资产净值之和的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H：为每日应支付的本系列基金托管费；

E：为前一日的本系列基金各行业类别基金资产净值的和。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

3、上述（二）基金费用第 3—6 项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额，由基金托管人从本系列基金每只行业类别基金资产中支付。

4、经基金管理人与基金托管人协商一致，可以调低基金管理人的管理费及基金托管费，并报中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会通过。

### （四）申购、赎回的费用

#### 1、申购费

申购费率如下：

申购金额 (M)	费率
M<50万	1.50%
50万≤M <250万	1.20%
250万≤M <500万	0.75%
500万≤M <1000万	0.50%
M≥1000万	每笔1000元

## 2、赎回费

赎回费率如下：

连续持有期限（日历日）	适用的赎回费率
1天—365天	0.5%
366天（含）—730天	0.25%
731天（含）以上	0

说明：①认购期持有期限起始日为基金合同生效日；申购期持有期限起始日为基金申购的注册登记日。持有期限的截止日为基金赎回的注册登记日。

②投资人对本系列基金任意一子基金连续持有期限超过 365 天，赎回费率为 0.25%；连续持有期限超过 730 天，赎回费率为零。期间如进行基金转换，持有期限可以累计。

③赎回费的 25% 划归基金资产。

### （五）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或本系列基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

### （六）基金税收

本系列基金每只行业类别基金及基金份额持有人应依据国家有关规定依法纳税。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

(一) 对“二、释义”中的《销售办法》根据最新的修订作了更新;

(二) 对基金管理人部分内容的更新

在“三、基金管理人”部分,对基金管理人联系人、基金经理从业年限信息进行了更新。

(三) 对基金托管人的更新

在“四、基金托管人”部分,对基金托管人基本情况和相关业务经营情况进行了更新。

(四) 对相关服务机构的更新:

在“五、相关服务机构”部分,对代销机构的部分信息进行了更新。

(五) 在“七、基金的投资”部分,更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。

(六) 更新了“八、基金的业绩”部分的内容。

(七) 对基金资产的估值的更新

在“十、基金资产的估值”部分,对基金行业股票估值指数进行了更新

(八) 对部分其他表述进行了更新。

泰达宏利基金管理有限公司

2012年6月9日