(上接D26版)
电话:021-61418888
传真:021-63350003
经办注册会计师:胡小骏、洪锐明

四、基金的名称

广发沪深300指数证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式股票型证券投资基金

六、基金的投资目标

通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%。

七、基金的投资方向

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括沪深300指数成份股、备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)等,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金还可投资于法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金为指数型基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金经理会对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。

(一)资产配置策略

本基金原则上将不低于90%的基金资产净值投资于沪深300指数成份股和备选成分股,其中备选成份股投资比例不高于15%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。本基金将根据市场的实际情况,适当调整基金资产的配置比例,以保证对标的指数的有效跟踪。如果法律法规允许,本基金的股票投资比例可以提高到基金资产净值的100%,此事项无须经基金份额持有人大会同意。

(二)股票组合构建

1、股票组合构建原则本基金原则上采用完全复制法来跟踪沪深300指数,按照个股在标的指数沪深300指数中的基准权重进行指数化投资组合构建。

2、股票组合构建方法

如有因受股票停牌、股票流动性或其他一些影响指数复制的市场因素的限制,使基金管理人无法依指数权重购买成份股,基金管理人可以根据市场情况,结合经验判断,对投资组合管理进行适当变通和调整,最终获得更接近标的指数的收益率。

3、股票组合调整

①定期调整

本基金股票组合根据所跟踪的沪深300指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

②不定期调整

1)与指数相关的调整

根据指数编制规则,当沪深300指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时,本基金将根据沪深300指数在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例,进行相应调整。

2)申购赎回调整

根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数。

3)其他调整

针对我国证券市场新股发行制度的特点,本基金将参与一级市场新股认购,由此得到的非成份股将在规定持有期之后的一定时间以内卖出。

(三)股资决策依据和决策程序

1、决策依据

以《基金法》、本基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据,并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

2、决策程序

①股资决策委员会制定整体投资战略。

②研究发展部对沪深300指数成份股进行持续跟踪调研分析,并根据自身或者其他研究机构的研究成果提供研究报告,对投资决策提供建议。

③基金经理小组根据投资决策委员会的投资战略,在研究部门研究报告的指引下,结合对证券市场、上市公司、投资时机的分析,拟订基金的具体投资计划。

④股资决策委员会对基金经理小组提交的方案进行论证分析,并形成决策纪要。

⑤根据决策纪要,基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案,交由交易部执行。

⑥交易部按有关交易规则执行,并将有关信息反馈基金经理小组。

⑦金融工程部采用量化模型进行成份股权重的测算和跟踪误差的评估,并定期进行基金绩效评估,向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

⑧风控控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责,尤其重点关注基金投资组合的风险状况;金融工程部重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。

九、业绩比较基准

本基金以沪深300指数为标的指数。

本基金业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+5%×银行同业存款收益率。

如果沪深300指数被停止编制及发布,或沪深300指数由其他指数替代(单纯更名除外),或由于指数编制方法等重大变更导致沪深300指数不宜继续作为本基金的标的指数,本基金管理人在履行适当程序后,可以变更基金的标的指数和业绩比较基准,并在变更前提前2个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。

十、风险收益特征

本基金为股票型指数基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

十一、基金投资组合报告

本基金管理人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,并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2012年1月16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至2011年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

(一)基金资产配置组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,393,591,453.96	83.48
	其中:股票	2,393,591,453.96	83.48
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	80,000,000.00	2.79
	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	92,362,489.98	3.22
6	其他各项资产	301,456,296.39	10.51
7	合计	2,867,410,240.33	100.00

(二)期末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	14,085,710.92	0.55
B	采掘业	304,496,897.98	11.88
C	制造业	809,753,175.89	31.58
C0	食品、饮料	178,000,730.47	6.94
C1	纺织、服装、皮毛	8,914,886.57	0.35
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	50,157,652.52	1.96
C5	电子	24,677,841.92	0.96
C6	金属、非金属	204,318,204.20	7.97
C7	机械、设备、仪表	241,090,731.64	9.40
C8	医药、生物制品	97,789,082.17	3.81
C99	其他制造业	4,804,046.40	0.19
D	电力、煤气及水的生产和供应业	48,574,810.08	1.89
E	建筑业	72,571,035.51	2.83
F	交通运输、仓储业	90,404,370.10	3.53
G	信息技术业	84,672,360.78	3.30
H	批发和零售贸易	64,519,985.03	2.52
I	金融、保险业	712,215,117.20	27.78
J	房地产业	119,555,686.98	4.66
K	社会服务业	20,610,094.64	0.80
L	传播与文化产业	5,427,338.74	0.21
M	综合类	46,704,870.11	1.82
	合计	2,393,591,453.96	93.36

(三)期末基金投资前十名股票明细

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	600030	中信证券	6,453,918	72,606,577.50	2.83
2	600036	招商银行	6,349,404	70,224,408.24	2.74
3	600016	民生银行	11,597,519	64,018,304.88	2.50
4	601318	中国平安	1,720,270	57,749,463.90	2.25
5	601328	交通银行	11,756,099	52,667,323.52	2.05
6	600000	浦发银行	5,746,572	49,075,724.88	1.91
7	601166	兴业银行	3,876,766	48,033,130.74	1.87
8	600015	华夏银行	4,637,027	46,880,342.97	1.83
9	601088	中国神华	1,694,890	42,948,512.60	1.68
10	000002	万科A	5,737,898	41,542,381.52	1.62

(四)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。

(五)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。

(六)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

本报告期期末本基金未持有资产支持证券。

(七)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。

(八)投资组合报告附注

1.报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

2.报告期内本基金持有的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

3.其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	686,340.41
2	应收证券清算款	296,502,942.93
3	应收股利	305,522.32
4	应收利息	42,604.93
5	应收申购款	3,918,885.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	301,456,296.39

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转换期的可转换债券。

5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中无流通受限股票情况。

十二、基金的业绩

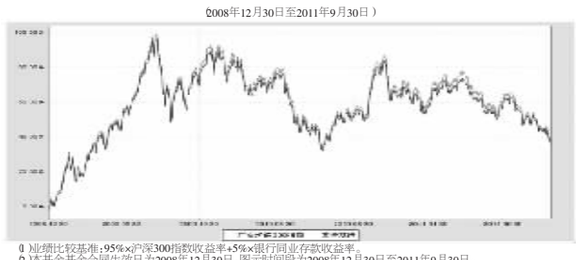
本基金管理人依照恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至2011年9月30日。

1.本基金本报告期单位基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2008.12.30-2008.12.31	-0.10%	0.07%	-1.90%	0.20%	1.80%	-0.13%
2009.1.1-2009.12.31	85.05%	1.90%	91.90%	1.95%	-6.85%	-0.05%
2010.1.1-2010.12.31	-12.30%	1.50%	-11.86%	1.50%	-0.44%	0.00%
2011.1.1-2011.9-30	-15.85%	1.19%	-16.59%	1.20%	0.74%	-0.01%
2008.12.30-2011-9-30	36.43%	1.59%	37.28%	1.62%	-0.85%	-0.03%

2.本基金自基金合同生效以来单位基金资产净值的变动与同期业绩比较基准比较图

(2008年12月30日至2011年9月30日)



①业绩比较基准:95%×沪深300指数收益率+5%×银行同业存款收益率。

②本基金基金合同生效日为2008年12月30日,图示时间段为2008年12月30日至2011年9月30日。

十三、基金的费用

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

5、基金份额持有人大会费用;

6、基金的证券交易费用;

7、基金的银行汇划费用;

8、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.75%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.15%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述"一、基金费用的种类"中第3-7项费用,根据有关法律法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人根据其与基金管理人的约定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、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基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对《广发沪深300指数证券投资基金招募说明书(更新)》(2011年2号)的内容进行了更新,主要更新的内容如下:

1.在"第一部分 基金管理人"部分,更新了基金管理人的相关内容。

2.在"第四部分 基金托管人"部分,根据基金托管人人员变动及业务经营情况对基金托管人信息进行了相应更新。

3.在"第五部分 相关服务机构"部分,增加了相关的代销机构,对原有销售机构的资料进行更新,相关事宜均已公告。

4.在"第九部分 基金的投资"部分,更新了截至2011年9月30日的基金投资组合报告。

5.在"第十部分 基金的业绩"部分,更新了截至2011年9月30日的基金业绩。

6.根据最新公告,对"第二十二部分 其他应披露事项"内容进行了更新。

广发基金管理有限公司
二〇一二年二月十日

国联安德盛精选股票证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(上接D28版)
④本基金转换业务的解释权归本公司。

八、基金的投资目标

通过投资财务稳健、业绩良好、管理规范的公司来获得长期稳定的收益。

九、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金在股票投资方面的主要投资对象是具有创值能力的公司,主要体现在以下三个方面:经营获利能力、资本成本和增长能力。

在正常的市场情况下,本基金的资产配置的基本范围为:股票资产占基金资产的60%-95%;债券、货币市场工具以及中国证监会允许投资的其他金融工具占基金资产的5%-40%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。当法律法规发生变化时,上述投资比例将按届时合法有效的法律法规予以修改,在报中国证监会备案后由基金管理人依法进行公告。

十、基金的投资策略及投资程序

本基金是股票型基金,在股票投资上主要根据上市公司获利能力、资本成本、增长能力以及股价的估值水平来进行个股选择。同时,适度把握宏观经济结构优进行资产配置。具体来说,本基金通过以下步骤进行股票选择:

首先,通过ROIC(Return On Invested Capital)指标来衡量公司的获利能力,通过WACC(Weighted Average Cost of Capital)指标来衡量公司的资本成本;其次,将公司的获利能力和资本成本指标相结合,选择出创造价值的公司;最后,根据公司的成长能力和估值指标,选择股票,构建股票组合。

投资管理流程分为投资研究、投资决策、投资执行、投资跟踪与反馈、投资核对与监督、风险控制六个环节。

1、投资研究

为保障基金份额持有人利益,本基金管理人在投资研究过程中,将定期召开投资决策委员会会议和投资研究联席会,为投资决策提供准确的依据。

投资决策委员会对目前宏观经济、金融形势、货币政策、利率水准等总体经济数据及风险预算模型测算的资产配置方案进行分析和讨论,对基金经理提交的报告进行讨论和表决,决定各基金在一段时期内的资产配置方案。

基金经理和研究组定期召开的投资研究联席会议主要讨论可投资股票、确定股票库等,为基金投资提供投资对象。固定收益研究组和基金经理定期研究债券和可转债投资组合的构建与管理。

2、投资决策

①基金投资策略报告的形成

风险预算由数量策略部和风险管理部定期制定,并进行不定期的调整。数量策略部和风险管理部通过分析股票资产和债券资产的波动特征,利用风险预算模型和原理测算两类资产的配置比例,为投资决策委员会和基金经理的资产配置决策提供依据。

基金经理定期结合风险预算、国内外经济形势、市场走势及投资研究会议的讨论结果拟订《投资策略报告》,阐述自身的投资策略,并明确下一阶段股票、固定收益类证券、现金和融资的投资比例。

②可投资证券备选库的建立和维护

每季度研究组和基金经理针对不同产业的特征,依据各公司的财务状况、盈利能力及未来成长性等,提出可投资证券名单,讨论后确定可投资证券备选库,并上报投资总监。若证券备选库中公司的基本面有重大变化,研究员应该及时提出最新的研究报告,并通知投资总监,在取得投资组合管理部同意后作相应调整。

③核心证券库的建立和维护

研究员或基金经理对可投资证券备选库名单中的公司进行深入的研究和调研,并出具研究报告,经投资研究联席会议讨论后列入基金的核心证券库中。

④固定收益证券和可转债组合的建立和维护

债券研究组和基金经理定期或不定期对交易所、银行间等市场交易的固定收益证券和可转债等其它金融工具进行研究分析,根据对利率期限结构及其它市场因素的判断,确定固定收益证券和可转债的投资对象和范围,并根据证券的市场走势和估值水平构建投资组合。

基金经理制定或调整投资组合时,原则上须选择核心证券库中的证券。研究员或基金经理对于核心证券库中的证券须持续追踪其基本面及股价变化,并适时提出修正报告,以利基金经理进行投资决策。

基金经理在投资分析的基础上进行投资组合管理,并对其投资组合负责。

3、投资执行

基金所有的交易行为都通过基金交易部统一执行,一切交易在交易资讯保密的前提下,依既定程序公开运作。

对于违反《基金法》、基金合同、投资决策委员会决议和公司投资管理制度的交易指令,交易部经理应暂停执行该等指令,及时通知相关基金经理,并向投资总监、监察稽核部汇报。

4、投资跟踪与总结

基金经理定期进行投资总结,对已发生的投资行为进行分析和总结,为未来的投资行为提供正确的方向。

基金经理定期向投资决策委员会提交所管理基金的《投资总结报告》,对其投资组合的表现进行分析,并对投资过程中的不足提出改进意见。

如果发现基金可投资证券备选库和核心证券库中的证券的基本面情况有变化的,基金经理可提议召开临时投资研究联席会议,讨论是否要修改备选证券库和核心证券库。

基金经理根据情况的变化,认为有必要修改资产配置方案或重大投资项目方案的,应先起草《投资策略报告》或《重大投资项目建议书》,经投资总监签阅后报投资决策委员会讨论决定。

5、投资核对与监督

基金审务部交易清算员通过交易数据的核对,对当日交易操作进行复核,如发现有违反《证券法》、《基金法》、基金合同、公司相关管理制度的交易操作,须立刻向投资总监汇报,并同时通报监察稽核部、风险管理部、相关基金经理、基金交易部。

基金交易部负责对基金投资的日常交易行为进行实时监控。

6、风险控制

基金投资管理过程中的风险控制包括两个层次,一个层次是基金投资管理组织体系内部的风险管理,另一个层次是独立的风险管理机构(包括风险控制委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部)对投资管理过程的风险监控。

投资总监负责基金投资管理全流程的风险控制工作,一方面在投资管理过程中切实贯彻风险控制的原则;另一方面根据独立风险管理机构(包括风险控制委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部)的风险评估意见,及时制定相应的改进和应对措施,并责成相关部门和人员切实落实和执行。

十一、基金的业绩比较标准

本基金的业绩基准为沪深300指数×85%+上证国债指数×15%

如果今后市场有其他代表性更强的业绩比较基准推出,本基金可以在经过适当的程序后变更业绩比较基准。

本基金为股票型基金,在考虑了该基金股票组合的投资标的、构建流程以及市场上各个股票指数的选股方式和历史情况后,我们选定沪深300指数作为其基金股票组合的业绩基准;债券组合的业绩基准则采用了市场上通用的上证国债指数。

本基金的股票资产占基金资产的60%-95%。在正常的市场情况下,基金的平均股票仓位将达到85%,所以,业绩基准中的这一资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。

十二、基金的风险收益特征

中高风险、较高的预期收益。

十三、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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。

本基金的托管人——华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年1月17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至2011年12月31日,本报告财务资料未经审计师审计。

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	1,846,067,018.68	89.36
	其中:股票	1,846,067,018.68	89.36
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	49,000,273.50	2.37
	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	167,068,877.27	8.09
6	其他各项资产	3,762,399.25	0.18
7	合计	2,065,898,568.70	100.00

2、报告期末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	7,743,000.00	0.38
B	采掘业	271,532,000.00	13.25
C	制造业	962,843,933.28	46.99
C0	食品、饮料	34,783,320.67	1.70
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	115,957,200.00	5.66
C5	电子	207,843,072.60	10.14
C6	金属、非金属	3,654,948.83	0.18
C7	机械、设备、仪表	168,545,456.29	8.22
C8	医药、生物制品	306,779,934.89	14.97
C99	其他制造业	125,280,000.00	6.11
D	电力、煤气及水的生产和供应业	5,611,500.00	0.27
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	90,428,000.00	4.41
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	180,632,922.36	8.81
J	房地产业	40,000,000.00	1.95
K	社会服务业	235,041,000.00	11.47
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	52,234,663.04	2.55
	合计	1,846,067,018.68	90.08

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

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	000069	华侨城A	23,000,000	164,220,000.00	8.01
2	300142	沃森生物	3,120,049	142,305,434.89	6.94
3	600612	老凤祥	4,800,000	125,280,000.00	6.11
4	600315	上海家化	2,700,000	92,043,000.00	4.49
5	601166	兴业银行	7,200,840	90,154,516.80	4.40
6	600216	浙江医药	4,150,000	82,543,500.00	4.03
7	002415	海康威视	1,800,000	77,400,000.00	3.78
8	002155	辰州矿业	3,800,000	76,266,000.00	3.72
9	600489	中金黄金	4,350,000	76,168,500.00	3.72
10	601888	中国国旅	2,700,000	70,821,000.00	3.46

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、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。

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。

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。

8、投资组合报告附注

1)本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2)本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,509,266.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	64,241.03
5	应收申购款	159,446.79
6	其他应收款	29,445.08
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,762,399.25

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在转股期内的可转债。

5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十四、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资产,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未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

阶段	基金份额净值增长率①	同期业绩比较基准收益率③	①-③	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率标准差④	②-④
2006-01-01至2006-12-31	115.07%	97.47%	17.60%	1.53%	1.19%	0.34%
2007-01-01至2007-12-31	133.07%	128.21%	4.86%	2.03%	1.95%	0.08%
2008-01-01至2008-12-31	-58.10%	-58.82%	0.72%	2.75%	2.59%	0.16%
2009-01-01至2009-12-31	80.94%	79.18%	1.76%	2.02%	1.75%	0.27%
2010-01-01至2010-12-31	-6.62%	-9.96%	3.34%	1.40%	1.34%	0.06%
2011-01-01至2011-12-31	-24.23%	-21.03%	-3.20%	1.17%	1.10%	0.07%
2005-12-28至2011-12-31	168.88%	137.37%	31.51%	1.90%	1.75%	0.15%

十五、费用概览

(一)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、《基金合同》生效后的基金信息披露费用;

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

5、基金份额持有人大会费用;

6、基金的证券交易费用;

7、银行汇划费用;

8、在有关规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,销售服务费的具体计提方法、计提标准在招募说明书或有关公告中载明。

9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产中扣除。

(二)费用计提方法、计提标准和支付方式

1、与基金运作有关的费用:

①基金管理人的管理费

本基金的管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

②基金托管人的托管费

本基金的托管费按基金资产净值的2.5‰的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×2.5‰÷当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述"一、基金费用的种类"中第3-9项费用由基金托管人根据有关法律法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,从基金财产中支付。

③除管理费和托管费之外的基金费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

2、与基金销售有关的费用

①申购费

本基金申购费的费率水平、计算公式和收取方式等内容详见"七、基金份额的申购与赎回"部分。

②赎回费

本基金赎回费的费率水平、计算公式和收取方式等内容详见"七、基金份额的申购与赎回"部分。

③转换费

本基金转换费的费率水平、计算公式和收取方式等内容详见"七、基金份额的申购与赎回"部分。

(三)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基金财产的损失,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。

基金合同生效前的相关费用,包括但不限于验资费用、会计师和律师费用、信息披露费用等不列入基金费用。其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

(四)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率。

调高基金管理费率、基金托管费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

(五)基金税收

根据财政部财税[2004]78号《国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的要求,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税。

根据财税字[2005]11号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》,自2005年1月24日起,基金买卖股票按照0.1%的税率缴纳印花税。

根据财税字[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》,自2005年6月13日起,基金取得的股票的股息、红利收入暂减按50%计入个人应纳税所得额。

根据财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》,(一)证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入、股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。(二)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入,暂不征收企业所得税。(三)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,暂不征收企业所得税。

本基金运作过程中的各类纳税主体,依照国家法律、法规的规定,履行纳税义务。

十六、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理方法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,对本基金管理人于2011年8月11日刊登的本基金原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、更新了"三、基金管理人"部分的内容。

2、更新了"四、基金托管人"部分的内容。

3、更新了"五、相关服务机构"部分的内容。

4、更新了"八、基金份额的申购与赎回"部分的内容。

5、更新了"九、基金的投资"部分的内容。

6、更新了"十、基金的业绩"部分的内容。

7、更新了"二十一、对基金份额持有人的服务"部分的内容。

8、更新了"二十二、其他应披露事项"部分的内容。

国联安基金管理有限公司
二〇一二年二月十日

泰达宏利基金管理有限公司
关于增加中信证券(浙江)有限责任公司为代销机构的公告

根据泰达宏利基金管理有限公司(以下简称"本公司")与中信证券(浙江)有限责任公司签署的基金销售代理协议,自2012年2月13日起,中信证券(浙江)有限责任公司在其全国的所有营业网点对投资者开始代理销售泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金(代码:162201)、泰达宏利价值优化型周期类行业证券投资基金(代码:162202)、泰达宏利价值优化型稳定类行业证券投资基金(代码:162203)、泰达宏利行业精选股票型证券投资基金(代码:162204)、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金(代码:162205)、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(代码:162207)、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金(代码:162208)、泰达宏利市值优选股票型证券投资基金(代码:162209)、泰达宏利集利债券型证券投资基金(A类,代码:162210;C类,代码:162299)、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金(代码:162211)、泰达宏利红利先锋股票型证券投资基金(代码:162212)、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金(代码:162213)、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金(代码:162214)、泰达宏利货币市场基金(代码:162206)、泰达宏利全球新格局证券投资基金(代码:229001)、泰达宏利中证500指数分级证券投资基金(代码:162216)。

自2012年2月13日起,中信证券(浙江)有限责任公司开通泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金(代码:162201)、泰达宏利价值优化型周期类行业证券投资基金(代码:162202)、泰达宏利价值优化型稳定类行业证券投资基金(代码:162203)、泰达宏利行业精选股票型证券投资基金(代码:162204)、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金(代码:162205)、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金(代码:162208)、泰达宏利市值优选股票型证券投资基金(代码:162209)、泰达宏利集利债券型证券投资基金(A类,代码:162210;C类,代码:162299)、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金(代码:162211)、泰达宏利红利先锋股票型证券投资基金(代码:162212)、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金(代码:162214)、泰达宏利货币市场基金(代码:162206)的转换业务。

自2012年2月13日起,中信证券(浙江)有限责任公司开通泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金(代码:162201)、泰达宏利价值优化型周期类行业证券投资基金(代码:162202)、泰达宏利价值优化型稳定类行业证券投资基金(代码:162203)、泰达宏利行业精选股票型证券投资基金(代码:162204)、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金(代码:162205)、泰达宏利效率优选混合型