（上接B42版）

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	6,258,959.49
3	应收股利	-
4	应收利息	1,456,728.79
5	应收申购款	42,823.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,008,511.73

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	113,640,725.62	62.21
	其中：股票	113,640,725.62	62.21
2	固定收益投资	36,473,029.20	19.97
	其中：债券	36,473,029.20	19.97
	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	31,222,035.51	17.09
6	其他资产	1,348,454.66	0.74
7	合计	182,684,244.99	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	-	-
C	制造业	50,517,281.24	28.77
C0	食品、饮料	34,232,635.92	19.49
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	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	16,284,645.32	9.27
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	1,227,851.52	0.70
H	批发和零售贸易	5,505,308.34	3.14
I	金融、保险业	33,569,554.50	19.12
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	19,139,864.02	10.90
L	传播与文化产业	3,680,866.00	2.10
M	综合类	-	-
	合计	113,640,725.62	64.71

（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	600519	贵州茅台	53,216	13,080,492.80	7.45
2	600809	山西汾酒	268,954	10,233,699.70	5.83
3	000858	五 粮 液	297,211	10,075,452.90	5.74
4	300070	碧水源	261,538	9,083,214.74	5.17
5	000562	宏源证券	453,420	8,837,155.80	5.03
6	000783	长江证券	892,047	8,233,593.81	4.69
7	600138	中青旅	387,755	6,409,590.15	3.65
8	600109	国金证券	382,830	5,922,380.10	3.37
9	600079	人福医药	241,863	5,209,729.02	2.97
10	600056	中国医药	241,573	4,652,695.98	2.65

（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	5,725,802.00	3.26
2	央行票据	9,984,000.00	5.69
3	金融债券	20,218,000.00	11.51
	其中：政策性金融债	20,218,000.00	11.51
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	545,227.20	0.31
8	其他	-	-
9	合计	36,473,029.20	20.77

（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	120222	12国开22	200,000	20,218,000.00	11.51
2	1001032	10央票32	100,000	9,984,000.00	5.69
3	010308	03国债（8）	56,860	5,725,802.00	3.26
4	113001	中行转债	5,670	545,227.20	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	500,000.00
2	应收证券清算款	259,682.10
3	应收股利	-
4	应收利息	525,709.50
5	应收申购款	63,063.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,348,454.66

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	545,227.20	0.31

5、报告期末本基金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。

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9月30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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
	①	②	③	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-12月31日	-31.61%	1.83%	-34.32%	1.92%	2.71%	-0.09%
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9月30日	8..95%	1.19%	0.89%	0.92%	8.06%	0.27%
基金合同生效以来至2012年9月30日	396..72%	1.29%	86.56%	1.22%	310.16%	0.07%

泰达周期基金

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
	①	②	③	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9月30日	0.90%	1.10%	-1.34%	1.01%	2.24%	0.09%
基金合同生效以来至2012年9月30日	317.25%	1.40%	86.13%	1.31%	231.12%	0.09%

泰达稳定基金

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
	①	②	③	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9月30日	3.89%	1.03%	-0.61%	0.71%	4.50%	0.32%
基金合同生效以来至2012年9月30日	227.39%	1.26 %	83.68%	1.14%	143.71%	0.12%

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×1.5%÷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×0.25%÷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）、在"重要提示"中，更新了招募说明书所载内容、有关财务数据和净值表现的截止日期。

（二）更新了"四、基金托管人"的内容。

（三）、在"五、相关服务机构"部分，对代销机构部分信息进行了更新。

（四）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。

（五）更新了"八、基金的业绩"部分的内容。

（六）更新了"二十、其他应披露事项"的内容。

泰达宏利基金管理有限公司

2012年12月8日

（上接B41版）

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	9,476,629.50	0.66
2	央行票据	176,187,000.00	12.34
3	金融债券	100,890,000.00	7.07
	其中：政策性金融债	100,890,000.00	7.07
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	286,553,629.50	20.07

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

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	1101094	11央行票据94	600,000	58,020,000.00	4.06
2	110417	11农发17	500,000	50,780,000.00	3.56
3	110203	11国开03	500,000	50,110,000.00	3.51
4	1001060	10央行票据60	500,000	49,860,000.00	3.49
5	1101096	11央行票据96	400,000	38,684,000.00	2.71

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）本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

（2）本基金投资的前十名股票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	1,213,472.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	22,599.00
4	应收利息	6,972,465.47
5	应收申购款	644,875.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,853,412.30

（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）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	600406	国电南瑞	71,597,415.94	5.02	重大资产重组

货币市场基金投资组合报告

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	固定收益投资	70,125,183.91	15.19
	其中：债券	70,125,183.91	15.19
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	143,980,815.97	31.19
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	5,399,884.76	1.17
	货币市场工具	240,000,000.00	52.00%
4	其他资产	2,050,981.51	0.44
5	合计	461,556,866.15	100.00

注：货币市场工具均为定期存款。

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	1.00
	其中：买断式回购融资	0.00

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

3、基金投资组合平均剩余期限

（1）投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	42
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	80
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	42

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内，本货币基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

（2）报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	67.17	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）-60天	4.38	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）-90天	21.69	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）-180天	2.18	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天（含）-397天（含）	4.35	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.77	-

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	19,904,482.15	4.32
3	金融债券	10,019,046.54	2.18
	其中：政策性金融债	10,019,046.54	2.18
4	企业债券	40,201,655.22	8.73
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	70,125,183.91	15.23
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	041151011	11中石油CP003	200,000	20,179,275.81	4.38
2	1101094	11央行票据94	200,000	19,904,482.15	4.32
3	041251015	12铁道CP001	100,000	10,020,906.33	2.18
4	030201	03国开01	100,000	10,019,046.54	2.18
5	041254038	12电网CP001	100,000	10,001,473.08	2.17

6、"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25（含）-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0370%
报告期内偏离度的最低值	-0.0276%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0199%

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。

8、投资组合报告附注

（1）本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提损益。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值为1.0000元。

（2）本报告期内，本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券，也不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过基金资产净值20%的情况。

（3）本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

（4）其他资产构成

项目	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,883,130.04
4	应收申购款	167,851.47
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,050,981.51

动力平衡基金投资组合报告

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	2,746,152,111.69	72.36
	其中：股票	2,746,152,111.69	72.36
2	固定收益投资	857,411,000.00	22.59
	其中：债券	857,411,000.00	22.59
	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	148,949,240.53	3.92
6	其他资产	42,598,899.36	1.12
7	合计	3,795,111,251.58	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	-	-
B	采掘业	8,668,686.54	0.23
C	制造业	1,624,415,829.64	43.02
C0	食品、饮料	501,616,091.90	13.29
C1	纺织、服装、皮毛	8,198,273.86	0.22
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	24,674,516.44	0.65
C5	电子	186,139,595.24	4.93
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	280,751,499.71	7.44
C8	医药、生物制品	623,035,852.49	16.50
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	22,720,929.30	0.60
E	建筑业	231,173,047.42	6.12
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	81,217,571.70	2.15
H	批发和零售贸易	49,000,384.50	1.30
I	金融、保险业	179,572,157.77	4.76
J	房地产业	252,689,038.01	6.69
K	社会服务业	265,610,985.16	7.03
L	传播与文化产业	31,083,481.65	0.82
M	综合类	-	-
	合计	2,746,152,111.69	72.73

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	000858	五 粮 液	6,024,942	204,245,533.80	5.41
2	601318	中国平安	3,900,183	163,573,675.02	4.33
3	000568	泸州老窖	3,881,122	149,423,197.00	3.96
4	600518	康美药业	8,923,980	141,177,363.60	3.74
5	000024	招商地产	5,806,036	120,765,548.80	3.20
6	002415	海康威视	3,656,276	101,351,970.72	2.68
7	000651	格力电器	4,603,837	98,430,035.06	2.61
8	600048	保利地产	9,115,429	98,082,016.04	2.60
9	002081	金 螳 螂	2,624,071	97,090,627.00	2.57
10	600062	华润双鹤	4,070,114	92,920,702.62	2.46

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
2	央行票据	609,788,000.00	16.15
3	金融债券	150,603,000.00	3.99
	其中：政策性金融债	150,603,000.00	3.99
4	企业债券	97,020,000.00	2.57
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	857,411,000.00	22.71

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

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	1101094	11央行票据94	1,800,000	174,060,000.00	4.61
2	1001074	10央行票据74	1,600,000	159,488,000.00	4.22
3	1001060	10央行票据60	1,000,000	99,720,000.00	2.64
4	122070	11海航01	1,000,000	97,020,000.00	2.57
5	120305	12进出05	900,000	90,072,000.00	2.39

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）本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

（2）本基金投资的前十名股票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	1,185,689.98
2	应收证券清算款	26,209,652.09
3	应收股利	404,719.20
4	应收利息	14,712,534.24
5	应收申购款	86,303.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,598,899.36

（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）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的情况。

十四、基金的业绩

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系列基金的招募说明书和更新招募说明书。

基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定，已经复核了下列财务指标、净值表现等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

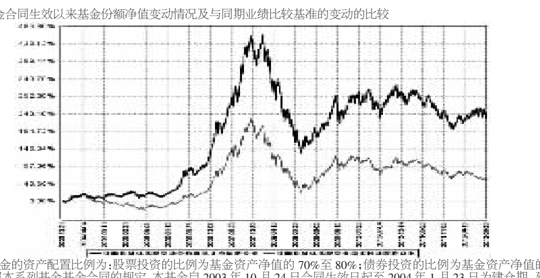
基金业绩数据截止2012年9月30日。

优选股票基金的净值表现

1、基金份额净值增长率及其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）
2003年10月24日-2003年12月31日	6.75%	0.62%	4.62%	0.97%	2.13%	-0.35%
2004年	7.63%	0.95%	-12.93%	1.07%	20.56%	-0.12%
2005年	3.32%	0.93%	-5.27%	1.12%	8.59%	-0.19%
2006年	130.58%	1.19%	92.74%	1.07%	37.84%	0.12%
2007年	96.12%	1.78%	79.80%	1.76%	16.32%	0.02%
2008年	-51.92%	2.19%	-54.74%	2.28%	2.82%	-0.09%
2009年	53.25%	1.49%	64.78%	1.53%	-11.53%	-0.04%
2010年	-1.09%	1.30%	-7.70%	1.15%	6.61%	0.15%
2011年	-19.82%	1.01%	-18.76%	0.96%	-1.06%	0.05%
2012年1月1日-2012年6月30日	11.20%	1.09%	2.43%	0.96%	8.77%	0.13%
2012年1月1日-2012年9月30日	10.03%	1.12%	-2.93%	0.93%	12.96%	0.19%
2003年10月24日-2012年9月30日	245.25%	1.39%	62.27%	1.40%	182.98%	-0.01%

2、自基金合同生效以来基金份额净值变动情况及与同期业绩比较基准的变动的比较



注：本基金的资产配置比例为：股票投资的比例为基金资产净值的70%至80%；债券投资的比例为基金资产净值的20%至30%。按照本系列基金基金合同的规定，本基金自2003年10月24日合同生效日起至2004年1月23日为建仓期。建仓期结束时，本基金投资组合均达到上述投资组合比例的要求。

恒丰债券基金的净值表现

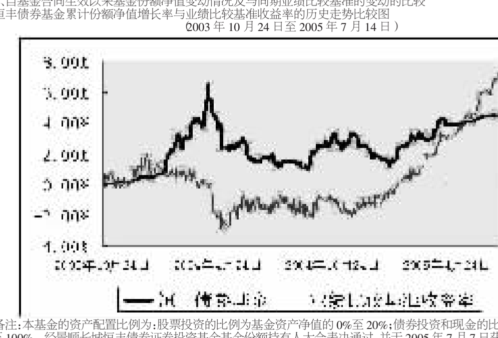
1、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率比较表

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）
2003年10月24日-2003年12月31日	0.51%	0.02%	1.71%	0.34%	-1.20%	-0.32%
2004年	1.35%	0.20%	-2.42%	0.35%	3.77%	-0.15%
2005年01月01日-2005年07月14日	2.51%	0.11%	8.03%	0.21%	-5.52%	-0.10%
2003年10月24日-2005年07月14日	4.42%	0.17%	7.23%	0.31%	-2.81%	-0.14%

2、自基金合同生效以来基金份额净值变动情况及与同期业绩比较基准的变动的比较

恒丰债券基金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势比较图

（2003年10月24日至2005年7月14日）



备注：本基金的资产配置比例为：股票投资的比例为基金资产净值的0%至20%；债券投资和现金的比例为基金资产净值的80%至100%。经景顺长城恒丰债券证券投资基金基金份额持有人大会表决通过，并于2005年7月7日获中国证券监督管理委员会证监基金字2005［121号文核准，本基金以2005年7月14日为转变基准日转变成为景顺长城货币市场证券投资基金。1

货币市场基金的净值表现

1、基金收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较表

货币基金A

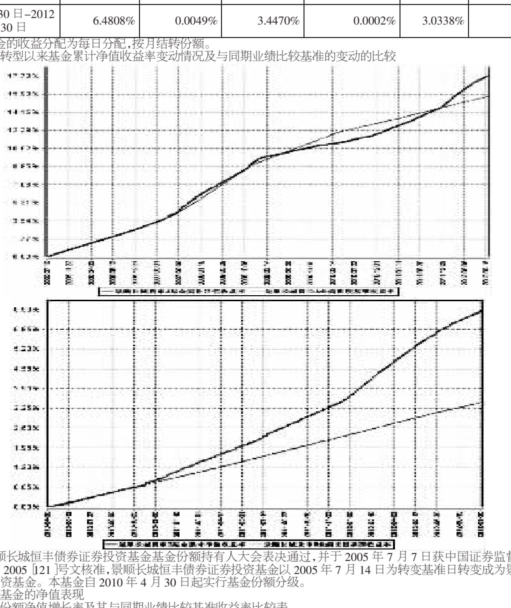
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2005年7月15日-12月31日	0.8862%	0.0033%	0.8384%	0.0000%	0.0478%	0.0033%
2006年	1.8290%	0.0029%	1.8798%	0.0003%	-0.0508%	0.0026%
2007年	3.1186%	0.0057%	2.7851%	0.0019%	0.3335%	0.0038%
2008年	3.4738%	0.0055%	3.7621%	0.0012%	-0.2883%	0.0043%
2009年	1.1973%	0.0030%	2.2500%	0.0000%	-1.0527%	0.0030%
2010年	1.1310%	0.0042%	1.6434%	0.0012%	-0.5124%	0.0030%
2011年	2.2634%	0.0042%	1.4597%	0.0001%	0.8037%	0.0041%
2012年1月1日-2012年6月30日	1.9770%	0.0029%	0.7367%	0.0001%	1.2403%	0.0028%
2012年1月1日-2012年9月30日	2.6176%	0.0037%	1.0775%	0.0002%	1.5401%	0.0035%
2005年7月15日-2012年9月30日	17.7234%	0.0053%	15.6960%	0.0023%	2.0274%	0.0030%

货币基金B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
2010年4月30日-2010年12月31日	1.0445%	0.0047%	0.9099%	0.0000%	0.1346%	0.0047%
2011年	2.5092%	0.0042%	1.4597%	0.0001%	1.0495%	0.0041%
2012年1月1日-2012年6月30日	2.0980%	0.0029%	0.7367%	0.0001%	1.3613%	0.0028%
2012年1月1日-2012年9月30日	2.8011%	0.0037%	1.0775%	0.0002%	1.7236%	0.0035%
2010年4月30日-2012年9月30日	6.4808%	0.0049%	3.4470%	0.0002%	3.0338%	0.0047%

注：本基金的收益分配为每日分配，按月结转份额。

2、自基金转型以来基金累计净值收益率变动情况及与同期业绩比较基准的变动的比较



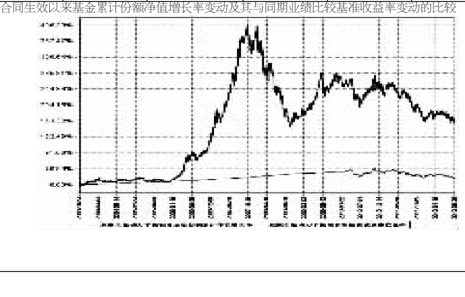
注：经景顺长城恒丰债券证券投资基金基金份额持有人大会表决通过，并于2005年7月7日获中国证券监督管理委员会证监基金字2005［121］号文核准，景顺长城恒丰债券证券投资基金以2005年7月14日为转变基准日转变成为景顺长城货币市场证券投资基金。本基金自2010年4月30日起实行基金份额分级。

动力平衡基金的净值表现

1、基金份额净值增长率及其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）
2003年10月24日-12月31日	3.89%	0.35%	0.75%	0.01%	3.14%	0.34%
2004年	6.85%	0.68%	4.03%	0.01%	2.82%	0.67%
2005年	0.31%	0.62%	4.29%	0.02%	-3.98%	0.60%
2006年	120.70%	1.16%	4.30%	0.01%	116.40%	1.15%
2007年	93.99%	1.70%	5.63%	0.02%	88.36%	1.68%
2008年	-43.74%	1.65%	6.53%	0.02%	-50.27%	1.63%
2009年	41.27%	1.12%	3.51%	0.01%	37.76%	1.11%
2010年	-7.25%	1.19%	0.45%	0.76%	-7.70%	0.43%
2011年	-22.69%	0.99%	-10.71%	0.65%	-11.98%	0.34%
2012年1月1日-2012年6月30日	3.22%	1.02%	3.81%	0.66%	-0.59%	0.36%
2012年1月1日-2012年9月30日	-1.13%	1.03%	0.14%	0.64%	-1.27%	0.39%
2003年10月24日-2012年9月30日	168.61%	1.18%	19.28%	0.38%	149.33%	0.80%

2、自基金合同生效以来基金累计份额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



注：本基金的资产配置比例为：股票投资的比例为基金资产净值的20%至80%；债券投资的比例为基金资产净值的20%至80%。按照本系列基金基金合同的规定，本基金自2003年10月24日合同生效日起至2004年1月23日为建仓期。本基金于2007年9月10日实施分红，此后基金资产规模持续增长，根据基金部函［2007］91号《关于实施基金份额拆分后调整基金建仓期有关问题的复函》的有关规定，本基金证券投资比例的调整期限延长至2007年10月9日止。建仓期结束时，本基金投资组合均达到上述投资组合比例的要求。

十五、基金费用概览

本系列基金下各基金发生的费用单独计算和计提，分别支付。本章中第（一）节至第（四）节的内容适用于优选股票基金和动力平衡基金，第（二）节第3点、第（三）节至第（六）节的内容适用于货币市场基金。

（一）与基金运作有关的费用

1、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）基金证券交易费用；
（4）基金的信息披露费用；
（5）基金份额持有人大会费用；
（6）基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
（7）销售服务费，具体计提办法按中国证监会的规定执行；
（8）按照国家有关规定可以列入的其他费用。

本系列基金共同承担的基金费用按照1/n的比例由各基金分摊。（n=本系列基金所包含的基金的数目。）除各基金个别清算外、单独公告及其他由管理人依公允的原则决定经托管人认可的只涉及某基金所产生的费用由该基金独自承担外，其他基金费用均为本款所称之本系列基金共同承担的费用。

2、与基金运作有关的费用的费率、计提方法、计提标准、收取方式和使用方式

（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，按前一日的各基金资产净值乘以相应的管理年费，计算方法如下：

H=E×年管理费率÷当年天数

H：为每日应计提的基金管理费；

E：为前一日基金资产净值。

各基金管理费率如下：

基金名称	管理年费率
优选股票基金	1.5%
动力平衡基金	1.5%

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基金财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，按前一日的各基金资产净值乘以相应的托管年费，计算方法如下：

H=E×年托管费率÷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。

各基金托管费率如下：

基金名称	托管年费率
优选股票基金	0.25%
动力平衡基金	0.25%

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财产中一次性支取。

（3）基金首次发行中所发生的律师费和会计师费等费用自基金发行费用中列支，不另从基金财产中支付，与基金有关的法定信息披露费按有关规定列支；若本系列基金发行失败，发行费用由基金管理人承担。基金合同生效后的各项费用按有关规定列支。

（4）上述1、基金费用第3-8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，由基金托管人从基金财产中支付。

3、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。

4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费和托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会通过。

（二）与基金销售有关的费用

1、基金申购费用

（1）基金申购可适用以下费率：

基金名称	申购费率
优选股票基金	M<50万 1.5% 50万≤M<100万 1.2% 100万≤M<200万 1.0% 200万≤M<500万 0.6% M≥500万 按笔收取，500元/笔
动力平衡基金	M<50万 1.5% 50万≤M<100万 1.2% 100万≤M<200万 1.0% 200万≤M<500万 0.6% M≥500万 按笔收取，500元/笔

M表示申购金额。

（2）计算公式

本系列基金采用金额申购方法，计算公式如下：

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）；

申购费用=申购金额-净申购金额；

申购份额=净申购金额/T日基金份额净值。

（3）例：某投资者投资5,000元申购动力平衡基金，申购费率为1.5%，假设申购当日基金份额净值为1.1283元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额=5000/（1+1.5%）=4926.11元；

申购费用=5000-4926.11=73.89元；

申购份额=4926.11/1.1283=4365.95

2、赎回费

（1）适用费率：

基金名称	赎回费率
优选股票基金	1年以内 0.4% 1年以上（含）-2年 0.25% 2年以上（含） 0
动力平衡基金	1年以内 0.4% 1年以上（含）-2年 0.25% 2年以上（含） 0

注：就赎回费而言，1年指365天，2年指730天。

（2）计算公式

赎回总额=赎回份额×赎回当日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

（3）本系列基金赎回费75%归注册登记费用，25%归基金所有，作为对其他持有人的补偿。

（4）例：某投资者持有优选股票基金10,000份基金份额，赎回费率为0.4%，假设赎回当日基金份额净值是1.1489元，则可得到的赎回金额为：

赎回总额 = 10,000×1.1489 = 11,489元

赎回费用 = 11,489×0.4% = 45.96元

赎回金额 = 11,489-45.96 = 11,443.04元

3、转换费用

本系列基金的转换交易包括了基金转出和基金转入，其中：

①基金转出时赎回费的计算：

由优选股票基金或动力平衡基金转出时：

转出总额=转出份额×转出基金当日基金份额净值

由货币市场基金转出时：

转出总额=转出份额×转出基金当日基金份额净值+待结转收益（全额转出时）

赎回费用=转出总额×转出基金赎回费率

转出净额=转出总额-赎回费用

②基金转入时申购补差费的计算：

净转入金额=转出净额-申购补差费

其中，申购补差费= MAX［转出净额在转入基金中对应的申购费用-转出净额在转出基金中对应的申购费用，0］

转入份额=净转入金额／转入基金当日基金份额净值

例：投资者申请将持有的优选股票基金10,000份转换为景顺长城内需增长开放式证券投资基金，假设转换当日优选股票基金的基金份额净值为1.148元，投资者持有该基金18个月，对应赎回费为0.25%，申购费为1.5%，内需增长基金的基金份额净值为1.163元，申购费为1.5%，则投资者转换后可得到的内需增长基金份额为：

转出总额=10,000×1.148=11,480元

赎回费用=11,480×0.25%=28.70元

转出净额=11,480-28.7= 11,451.3元

转出净额在转入基金中对应的净申购金额=11,451.3/1.015=11,282.07元

转出净额在转入基金中对应的申购费用=11,451.3-11,282.07=169.23元

转出净额在转出基金中对应的净申购金额=11,451.3/1.015=11,282.07元

转出净额在转出基金中对应的申购费用=11,451.3-11,282.07=169.23元

净转入金额=11,451.3-MAX［169.23-169.23，0］=11,451.3元

转入份额=11,451.3／1.163=9,846.34份

（三）其他费用

本系列基金运作和销售过程中发生的其他费用，以及因故与本系列基金有关的其他费用，将依照国家法律法规的规定，予以收取和使用。

（四）本系列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。

（五）货币市场基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、销售服务费；
4、基金证券交易费用；
5、基金的信息披露费用；
6、基金份额持有人大会费用；
7、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
8、按照国家有关规定可以列入的其它费用。

（六）货币市场基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理费

货币市场基金管理费年费率为0.33%，在通常情况下，按前一日的基金资产净值乘以相应的管理年费率，计算方法如下：

H=E×年管理费率÷当年天数

H：为每日应计提的基金管理费；

E：为前一日基金资产净值。

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基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管费

货币市场基金托管费年费率为0.10%，在通常情况下，按前一日的基金资产净值乘以相应的托管年费率，计算方法如下：

H=E×年托管费率÷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，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支取。

3、销售服务费

货币市场基金的销售服务费用于该基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人代收并分配给相关服务机构。在通常情况下，按前一日的基金资产净值乘以相应的销售服务年费率，计算方法如下：

H=E×年销售服务费率÷当年天数

H：为每日应支付的销售服务费；

E：为前一日的基金资产净值。

基金销售服务费每日计算，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财产中一次性支取。

销售服务费率A级份额为0.25%、B级份额为0.01%。基金管理人可以根据市场状况和本基金的具体情况调低货币市场基金的销售服务费率。基金管理人必须在开始调整之日的3个工作日之前至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

4、基金首次发行中所发生的律师费、会计师费及与基金有关的法定信息披露费等费用自基金发行费用中列支，不另从基金财产中支付；若基金发行失败，发行费用由基金管理人承担。基金合同生效后的各项费用按有关规定列支。

5、上述（五）货币市场基金费用第4-8项费用，除上款规定的费用外，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，从基金财产中支付。

十六、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《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系列基金实施的投资管理活动，对基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1、在"三、基金管理人"部分，更新了基金管理人其他高级管理人员相关信息；

2、在"四、基金托管人"部分，更新了托管人相关情况信息；

3、在"五、相关服务机构"部分，更新了代销机构、会计师事务所及经办注册会计师的相关信息；

4、在"七、基金的申购、赎回"部分，更新了定期定额投资业务的相关信息；

5、在"十、基金的投资"部分，更新了基金投资组合报告，数据截至2012年9月30日；

6、更新了"十二、基金的业绩"部分，数据截至2012年9月30日；

7、在"二十三、对基金份额持有人的服务"部分，更新了持有人交易资料的寄送服务相关信息；

8、在"二十四、其他应披露事项"部分，更新了近期发布与本基金有关的公告目录，目录更新至2012年10月24日。

景顺长城基金管理有限公司

二〇一二年十二月八日