

**(上接B90版)**  
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	000008	神州高铁	940,442	27,921,722.98	6.84
2	300005	探路者	872,490	25,703,555.40	6.30
3	002364	中恒电气	804,399	23,439,421.53	5.74
4	002285	世联行	602,341	23,358,783.98	5.72
5	002319	歌华有线	721,214	16,912,468.30	4.14
6	002363	隆基机械	511,135	16,848,103.75	4.04
7	300354	东华测试	262,890	16,357,015.80	4.01
8	600845	宝信软件	244,132	14,398,905.36	3.53
9	000021	京山轻机	773,930	12,212,615.40	2.99
10	300003	乐普医疗	333,400	12,009,068.00	2.94

4.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	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	83,108,884.80	20.36
	其中:政策性金融债	83,108,884.80	20.36
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	83,108,884.80	20.36

5.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(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110216	11国债16	300,000	30,027,000.00	7.36
2	120401	12国债01	300,000	29,568,000.00	7.24
3	010801	国开01	131,920	13,513,884.80	3.31
4	140213	14国债13	100,000	10,000,000.00	2.45

上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。  
6.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资产支持证券投资明细  
本基金本报告期末持有资产支持证券。  
7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细  
本基金本报告期末持有贵金属。  
8.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权证投资明细  
本基金本报告期末持有权证。  
9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期无股指期货持仓和损益明细。  
9.2本基金投资股指期货的投资政策  
本基金本报告期未投资股指期货,该策略符合基金合同的约定。  
10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
10.1本期国债期货投资政策  
本基金本报告期未投资于国债期货,该策略符合基金合同的约定。  
10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期无国债期货持仓和损益明细。  
10.3本期国债期货投资评价  
本基金本报告期没有投资国债期货。  
11.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在监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。  
(2) 基金投资的前十名股票均未超出基金合同约定的备选股票库。  
(3)其他资产(单位:元)

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	445,908.89
2	应收证券清算款	3,727,821.37
3	应收股利	-
4	应收利息	640,922.67
5	其他应收款	835,173.51
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,658,826.44

(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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000008	神州高铁	27,921,722.98	6.84	重大事项
2	002364	中恒电气	23,439,421.53	5.74	重大事项

(6) 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  
1.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	银行存款	169,368,264.74	76.42
	其中:活期存款	169,368,264.74	76.42
2	国债及政府债券	45,023,559.40	20.31
	其中:国债	45,023,559.40	20.31
3	资产支持证券	-	-
4	基金投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
	其中:买入国债期货合约	-	-
	买入国债期货合约持仓市值	2,467,414.43	1.11
6	银行存款和其他货币资金合计	4,774,423.87	2.14
7	其他	221,631,671.44	100.00
8	合计	221,631,671.44	100.00

2.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	3,230,975.54	1.48
B	医药	-	-
C	制造业	38,402,750.83	17.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,256,214.33	10.67
E	建筑业	-	-
F	信息技术行业	18,035,990.85	8.27
G	交通运输、仓储和邮政业	25,256,214.33	10.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,046,198.40	6.44
J	金融业	48,946,747.81	22.45
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	15,593,271.00	7.15
O	批发和零售业	5,457,010.60	2.50
Q	文化、体育和娱乐业	2,399,245.38	1.10
S	综合	-	-
P	合计	169,368,264.74	77.70

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(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	300059	东方财富	337,649	14,046,198.40	6.44
2	601316	新华保险	231,400	12,266,514.00	5.61
3	000712	泰达红利	292,800	11,589,024.00	5.32
4	601628	中国人寿	275,178	10,195,344.90	4.68
5	600559	老白干酒	183,368	9,513,311.84	4.36
6	000069	华侨城A	846,800	8,171,620.00	3.75
7	601166	兴业银行	441,600	8,107,770.00	3.72
8	000728	中航电子	61,248	7,109,912.00	3.28
9	000728	招商证券	105,433	6,697,488.91	3.07
10	601021	春秋航空	76,647	6,618,370.41	3.04

4.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	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	45,023,559.40	20.65
	其中:政策性金融债	45,023,559.40	20.65
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	45,023,559.40	20.65

5.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(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140207	14国债07	200,000	20,006,000.00	9.18
2	010801	国开01	133,960	13,722,862.40	6.30
3	140212	14国债12	100,000	10,002,000.00	4.59
4	010802	国开02	12,000	1,292,697.60	0.59

上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。  
6.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资产支持证券投资明细  
本基金本报告期末持有资产支持证券。  
7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细  
本基金本报告期末持有贵金属。  
8.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权证投资明细  
本基金本报告期末持有权证。  
9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期无股指期货持仓和损益明细。  
9.2本基金投资股指期货的投资政策  
本基金本报告期未投资于股指期货,该策略符合基金合同的约定。  
10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
10.1本期国债期货投资政策  
本基金本报告期未投资于国债期货,该策略符合基金合同的约定。  
10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期无国债期货持仓和损益明细。  
10.3本期国债期货投资评价  
本基金本报告期没有投资国债期货。  
11.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约定的备选股票库。  
(3)其他资产(单位:元)

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	173,070.16
2	应收证券清算款	2,513,343.73
3	应收股利	-
4	应收利息	1,542,896.40
5	其他应收款	545,118.58
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,774,423.87

(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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300059	东方财富	14,046,198.40	6.44	重大事项
2	000728	招商证券	6,697,488.91	3.07	重大事项

(6) 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对比如下表所示:

截止2015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:

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
2003年4月25日至12月31日	-1.41%	0.95%	-7.34%	0.78%	5.93%	-0.22%
2004年1月1日至12月31日	17.09%	0.95%	-8.54%	1.02%	25.63%	-0.07%
2005年1月1日至12月31日	11.42%	0.97%	-7.13%	0.98%	18.55%	-0.01%
2006年1月1日至12月31日	81.74%	1.26%	54.13%	1.06%	27.61%	0.20%
2007年1月1日至12月31日	110.40%	1.64%	81.63%	1.54%	28.77%	0.10%
2008年1月1日至12月31日	-31.61%	1.83%	-34.32%	1.92%	2.71%	-0.09%
2009年1月1日至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12月31日	8.90%	1.15%	1.19%	0.88%	7.71%	0.27%
2013年1月1日至12月31日	30.78%	1.61%	22.45%	0.98%	8.33%	0.63%
2014年1月1日至12月31日	12.56%	1.36%	7.75%	0.73%	4.81%	0.63%
2015年1月1日至3月31日	42.30%	1.86%	26.44%	1.03%	15.86%	0.83%
基金合同生效以来至2015年3月31日	971.59%	1.34%	219.24%	1.16%	752.35%	0.18%

泰达红利基金  
1.申购费率如下:

申购金额M	费率
M<300	1.50%
300≤M<2000	1.20%
2000≤M<5000	0.75%
5000≤M<10000	0.50%
M≥10000	每笔1000元

2.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-1790天	0.25%
1791天-7300天	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T日,持有基金份额任意一天基金连续持有期限超过365天,赎回费率为0.25%;连续持有超过365天,赎回费率为0.25%,期间如进行基金转换,持有期限可以累计。  
③赎回费25%计入基金资产。  
(五) 不列入基金费用的项目  
基金管理人及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  
本系列基金只投资境内基金及基金份额持有应依据国家有关税法依法纳税。  
**十四、对招募说明书更新部分的说明**  
(一)“重要提示”部分对更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期进行了更新。  
(二)对“二、释义”中证券法部分进行了变更。  
(三)对“三、基金管理人”中,董事会成员、监事会成员、基金经理、投资决策委员会成员部分进行了更新。  
(四)“四、基金托管人”部分内容进行了更新。  
(五)“五、相关服务机构”部分机构信息等内容进行了更新。  
(六)“六、基金份额的申购、赎回和基金转换”中申购、赎回的费用部分增加新的内容。  
(七)“七、基金投资”部分对投资组合更新内容更新至2015年3月31日。  
(八)“八、基金的业绩”部分对基金业绩更新至2015年3月31日,并更新了历史走势对比图。  
(九)对“九、基金份额持有人的服务”中部分内容进行了更新及增加内容。  
(十)“二十、其他应披露事项”部分对报告期内应披露的本基金相关事项进行了更新。

泰达稳定基金  
1.申购费率如下:

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
2003年4月25日至12月31日	11.98%	0.69%	-1.86%	0.64%	13.84%	0.05%
2004年1月1日至12月31日	3.12%	1.08%	-14.31%	0.90%	17.43%	0.18%
2005年1月1日至12月31日	3.87%	1.07%	-4.37%	0.99%	8.24%	0.08%
2006年1月1日至12月31日	137.80%	1.29%	70.60%	1.37%	67.20%	-0.08%
2007年1月1日至12月31日	81.77%	1.82%	105.32%	1.63%	-23.55%	0.19%
2008年1月1日至12月31日	-40.52%	1.80%	-49.54%	2.01%	9.02%	-0.21%
2009年1月1日至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	-28.95%	1.18%	-21.52%	0.97%	-7.07%	0.21%
2012年1月1日至12月31日	7.65%	1.09%	5.11%	0.99%	2.54%	0.10%
2013年1月1日至12月31日	12.64%	1.25%	-8.33%	0.93%	20.97%	0.32%
2014年1月1日至12月31日	19.27%	1.19%	28.50%	0.80%	-9.23%	0.39%
2015年1月1日至3月31日	19.70%	1.19%	28.50%	0.80%	3.63%	0.53%
基金合同生效以来至2015年3月31日	615.80%	1.37%	171.09%	1.24%	444.71%	0.13%

泰达红利基金  
1.申购费率如下:

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
2003年4月25日至12月31日	11.98%	0.69%	-1.86%	0.64%	13.84%	0.05%
2004年1月1日至12月31日	3.12%	1.08%	-14.31%	0.90%	17.43%	0.18%
2005年1月1日至12月31日	3.87%	1.07%	-4.37%	0.99%	8.24%	0.08%
2006年1月1日至12月31日	137.80%	1.29%	70.60%	1.37%	67.20%	-0.08%
2007年1月1日至12月31日	81.77%	1.82%	105.32%	1.63%	-23.55%	0.19%
2008年1月1日至12月31日	-40.52%	1.80%	-49.54%	2.01%	9.02%	-0.21%
2009年1月1日至12月31日	71.49%	1.80%	66.62%	1.52%	4.87%	0.28%</