

**泰达荷银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 2007 年半年度报告**

基金管理人：泰达荷银基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2007 年 8 月 29 日

重要提示

基金管理人泰达荷银基金管理有限公司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。本半年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 年 8 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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。

报告期为 2007 年 1 月 1 日起至 2007 年 6 月 30 日止，本报告财务资料未经审计。

目 录

重要提示

一、基金简介

二、主要财务指标和基金净值表现

三、管理人报告

四、托管人报告

五、财务会计报告

六、投资组合报告

七、基金份额持有人情况

八、开放式基金份额变动情况

九、重大事件揭示

十、备查文件

一、基金简介

(一)基金基本资料

基金名称：泰达荷银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

基金简称：合丰成长、合丰周期、合丰稳定

交易代码：合丰成长：162201；合丰周期：162202；合丰稳定：162203

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2003 年 4 月 25 日

报告期末基金份额总额：合丰成长：734,379,229.02 份

合丰周期：722,018,651.56 份

合丰稳定：839,507,115.17 份

基金投资目标：泰达荷银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。

基金投资策略：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。

业绩比较基准：

合丰成长： $65\% \times \text{新华富时 A600 成长行业指数} + 35\% \times \text{上证国债指数}$

合丰周期： $65\% \times \text{新华富时 A600 周期行业指数} + 35\% \times \text{上证国债指数}$

合丰稳定： $65\% \times \text{新华富时 A600 稳定行业指数} + 35\% \times \text{上证国债指数}$

风险收益特征：本系列基金在证券投资基金中属于中等风险的基金品种。

(二)基金管理人

名称：泰达荷银基金管理有限公司

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

邮政编码：100034

法定代表人：章嘉玉

信息披露负责人：方子木

联系电话：010—66577728

传真：010—66577666

电子邮箱：irm@aateda.com

（三）基金托管人

名称：交通银行股份有限公司

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

法定代表人：蒋超良

信息披露负责人：张咏东

联系电话：021-68888917

传真：021-58408836

电子邮箱：zhangyd@bankcomm.com

（四）信息披露

基金选定的信息披露报纸名称：中国证券报、上海证券报、证券时报

登载半年度报告正文的管理人互联网网址：[http:// www.aateda.com](http://www.aateda.com)

基金半年度报告置备地点：基金管理人和基金托管人的住所

（五）其他有关资料

基金注册登记机构

名称：泰达荷银基金管理有限公司

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

二、主要财务指标和基金净值表现

（一）主要财务指标

	成长基金	周期基金	稳定基金
基金本期净收益	508,596,754.54	349,283,118.93	399,468,055.23
基金份额本期净收益	0.4574	0.2768	0.3231
期末可供分配基金收益	417,239,978.74	332,984,808.90	254,696,998.60
期末可供分配基金份额收益	0.5682	0.4612	0.3034
期末基金资产净值	1,225,647,444.94	1,055,003,460.46	1,113,384,992.93

期末基金份额净值	1.6690	1.4612	1.3262
基金加权平均净值收益率	33.36%	23.97%	27.83%
本期基金份额净值增长率	59.38%	35.93%	37.11%
基金份额累计净值增长率	272.57%	287.71%	267.81%

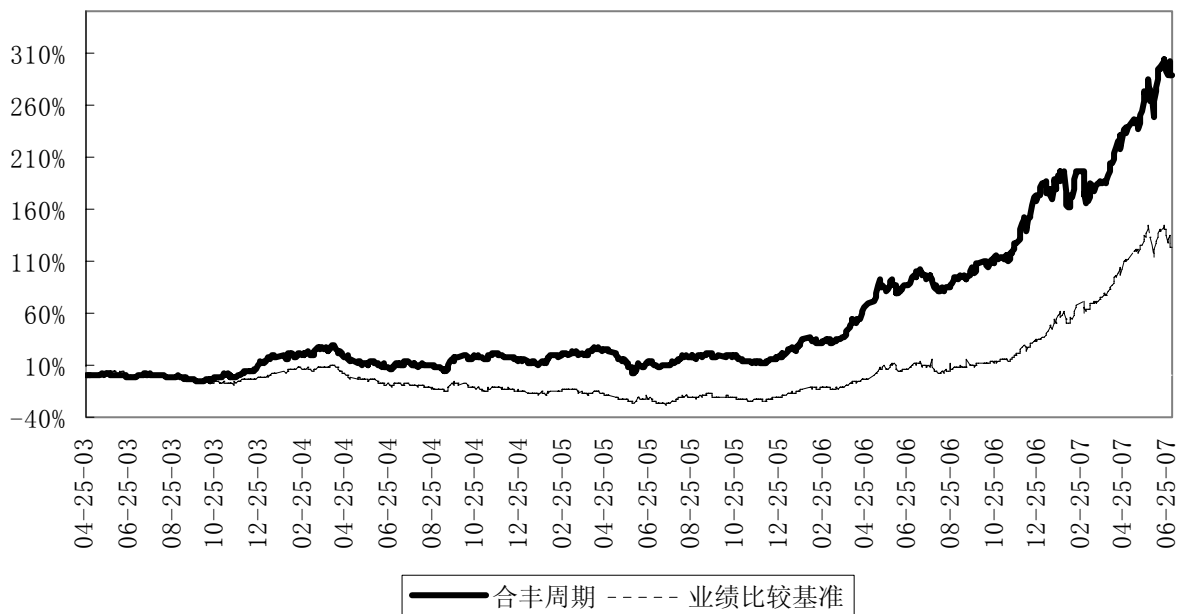
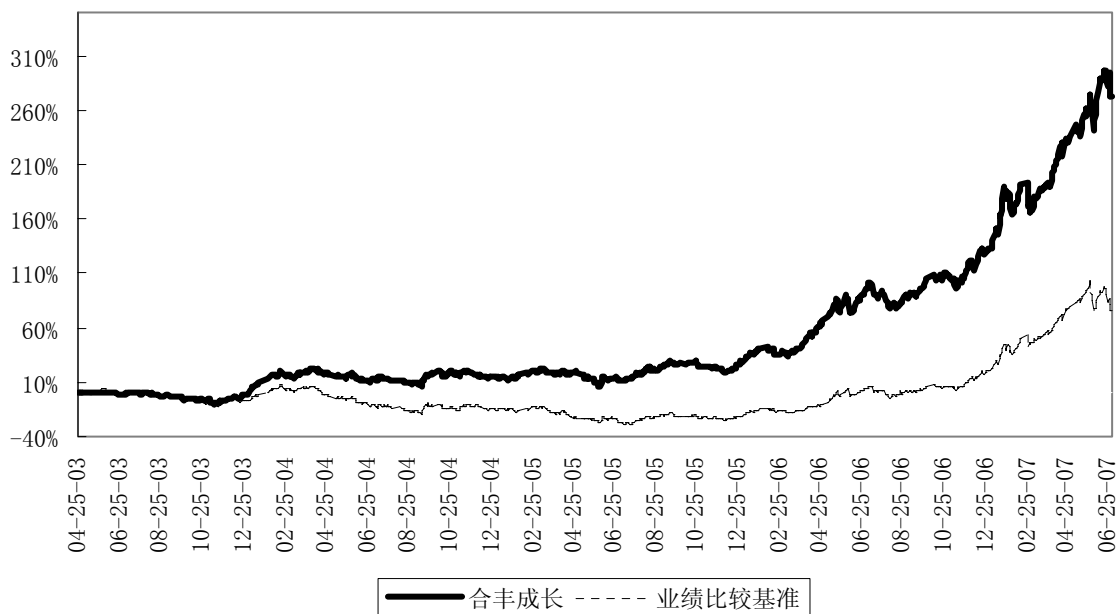
（二）基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

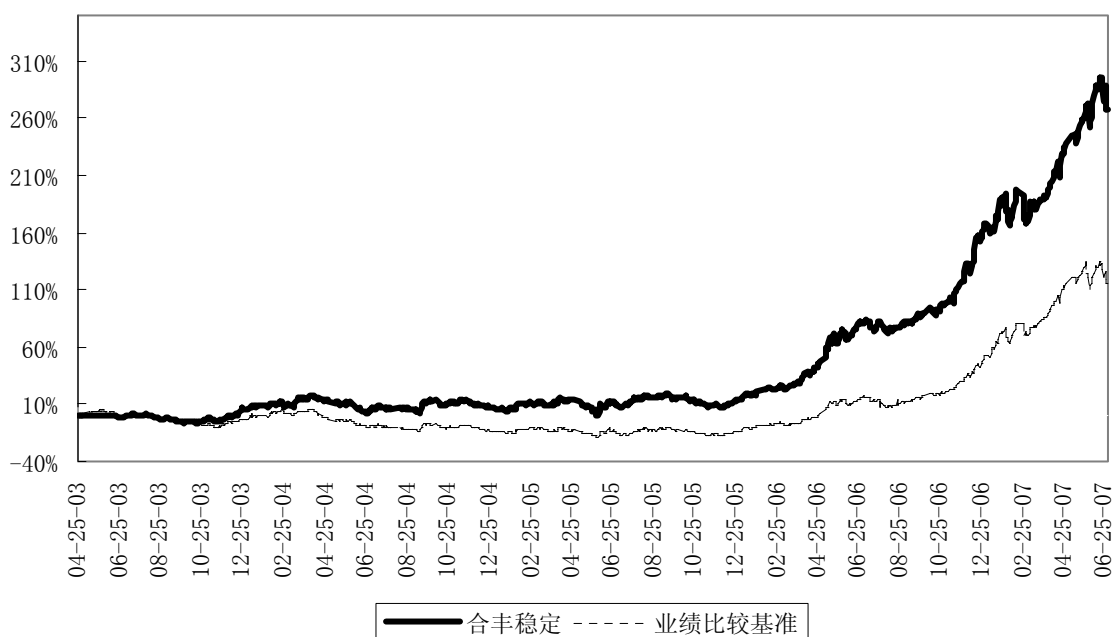
成长基金						
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差 ②	业绩比较基 准收益率 ③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去 1 个月	1.42%	2.03%	-7.49%	2.26%	8.91%	-0.23%
过去 3 个月	28.31%	1.79%	13.94%	1.82%	14.37%	-0.03%
过去 6 个月	59.38%	1.86%	45.53%	1.79%	13.85%	0.07%
过去 1 年	93.39%	1.56%	70.80%	1.48%	22.59%	0.08%
过去 3 年	237.37%	1.25%	102.80%	1.19%	134.57%	0.06%
合同生效以来	272.57%	1.14%	76.53%	1.11%	196.04%	0.03%

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
过去 1 个月	3.32%	1.90%	-4.48%	2.20%	7.80%	-0.30%
过去 3 个月	35.28%	1.84%	25.42%	1.86%	9.86%	-0.02%
过去 6 个月	35.93%	2.00%	62.16%	1.81%	-26.23%	0.19%
过去 1 年	98.63%	1.68%	102.38%	1.73%	-3.75%	-0.05%
过去 3 年	259.63%	1.33%	146.79%	1.29%	112.84%	0.04%
合同生效以来	287.71%	1.23%	122.48%	1.16%	165.23%	0.07%

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
过去 1 个月	-1.36%	1.92%	-3.56%	1.90%	2.20%	0.02%
过去 3 个月	26.49%	1.65%	16.38%	1.63%	10.11%	0.02%
过去 6 个月	37.11%	1.80%	42.00%	1.61%	-4.89%	0.19%
过去 1 年	103.20%	1.50%	86.69%	1.44%	16.51%	0.06%
过去 3 年	254.87%	1.21%	141.09%	1.10%	113.78%	0.11%
合同生效以来	267.81%	1.10%	116.05%	1.02%	151.76%	0.08%

（三）图示自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动进行比较





三、管理人报告

(一) 基金管理人及其管理基金的经验

泰达荷银基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37 号文批准成立。目前本公司股东及持股比例分别为：北方国际信托投资股份有限公司：51%；荷银投资管理（亚洲）有限公司：49%。公司注册资本为 1.8 亿元人民币。

报告期末公司旗下管理 8 只开放式基金，分别为泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、泰达荷银价值优化型周期类行业证券投资基金、泰达荷银价值优化型稳定类行业证券投资基金、泰达荷银行业精选证券投资基金、泰达荷银风险预算混合型证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、泰达荷银效率优选混合型证券投资基金以及泰达荷银首选企业股票型证券投资基金。

(二) 基金经理的基本情况

(1) 合丰成长基金基金经理：

梁辉先生，清华大学管理信息系统专业本科毕业、清华大学管理科学与工程专业硕士。2002 年 3 月起，任职于泰达荷银基金管理有限公司，曾担任公司研究部行业研究员、基金经理助理、现担任研究部总监。自 2005 年 4 月起至今担任合丰成长基金基金经理。自 2006 年 8 月起至今，梁辉先生同时还担任泰达荷银效率优选混合型证券投资基金的基金经理。5 年基金从业经验，具有证券从业资格、基金从业资格。

(2) 合丰周期基金基金经理：

魏延军先生，毕业于香港大学，获 MBA 学位。2003 年 3 月至 2006 年 2 月，任职天治基金管理公司，曾任天治财富增长基金基金经理及投资总监助理。2006 年 3 月加盟泰达荷银基金管理有限公司，任投资部基金经理助理。10 年证券从业经验，6 年基金从业经验，具有基金从业资格。

(3) 合丰稳定基金基金经理：

李泽刚先生，1998 年毕业于南开大学，获企业管理学学士学位；2002 年获复旦大学管理学院财务管理硕士学位；2002 年初应聘泰达荷银基金管理有限公司，曾担任研究部行业研究员。自 2005 年 9 月至今担任合丰稳定基金基金经理。5 年基金从业经验，具有基金从业资格。

(三) 报告期内基金运作的遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

(四) 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明及简要展望

1、合丰成长基金投资策略与业绩表现说明

(1) 上半年行情回顾及分析

2007 年上半年市场延续了 2006 年的走势，并呈现出加速上升的态势。根据对日本、台湾等市场的历史分析，我们认为一个牛市的基本要素是具备的：持续向好的宏观经济增长、本币升值、宽松的货币供应。同时，持续上涨的指数也驱动更多的投资者进入股市。

但是，2007 年市场的特征又有两点与 2006 年不同：一是流动性成为市场上涨的主要动力；二是市场换手率高且波动性加大。这里的主要原因是投资主体已经从机构投资者转向了散户，所以市场的投机氛围浓重。

从结构特征来看，行业特征并不明显，个股特征比较突出，低价股、重组股在上半年的表现远远好于绩优蓝筹股。这对于以价值投资作为主要理念的公募基金来说确实是一大考验。本基金作为行业类别基金，在投资中也适当做了调整，使资产配置尽量均衡。我们的投资视野更加广泛，从科技、医药拓展到了具有核心竞争力的机械和新材料，并加大了在这些领域的配置。

2007 年科技行业增长并不突出，而且估值吸引力也不大，所以总体机会有限。

医药行业在一季度出现了行业机会，但是从驱动力来看主要是估值提升，盈利增长的幅度比较有限。

（2）本基金业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.6690 元，本报告期份额净值增长率为 59.38%，同期业绩比较基准增长率为 45.53%。

（3）本基金下半年市场展望和投资策略

展望 2007 年下半年，我们认为市场将会震荡上升，主要原因是宏观经济向好，但是有调控的风险，同时市场估值并不便宜。首先，宏观经济增速加快，投资、消费、净出口都出现较快增长。其次，房地产、能源、资源价格上涨势头出现，经济存在过热苗条。在这种状况下，我们认为最大的变数在于调控政策。从目前的情况看，我们认为下半年的政策将是趋紧的。从估值来看，目前估值水平很高。而企业盈利增长速度在降低，这意味着未来虽然盈利还会增长，但是估值很可能是下降的。虽然我们对市场持谨慎乐观态度，但是我们认为下半年对成长行业的机会将会较大，首先，科技企业的盈利处于加速周期中。其次，科技企业的估值在 6 月的调整中出现了较大的下降，目前已经具有较大的吸引力。第三，3G、消费电子等都将成为这个行业的发展契机。我们更加看好科技行业，并会加大这方面的配置。

2、合丰周期基金投资策略与业绩表现说明

（1）上半年行情回顾及分析

本基金上半年的投资策略分为两个部分，前一个阶段，由于各种原因，基金运作并不十分理想，下一个阶段在总结经验和失误的基础上，加大了运作力度，主要在以下几个方面作出了努力：首先，行业配置适当有所侧重，前期涨幅相对指数滞后而业绩增长明确的行业，增加了一定比例配置。其次，对业绩增长确定的股票加大了投资力度。资产配置方面，侧重“防守反击”的手法，重点是选择成长性较好的二线蓝筹股进行了配置。

（2）本基金业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.4612 元，本报告期份额净值增长率为 35.93%，同期业绩比较基准增长率为 62.16%。

（3）本基金下半年市场展望和投资策略

我们认为下半年的市场行情震荡向上的可能性比较大，一方面我们重点跟踪的上市公司业绩仍然处于上升阶段，人民币升值的趋势仍将持续以及宏观经济持续向好的基础没有改变。另一方面，由于流动性过剩导致证券市场局部结构性泡沫已经引起管理层重视，控制流动性导致部分热钱将退出股市；大型蓝筹股的发行，将可能使证券市场供给在下半年加大；加上大非、小非的解禁高潮的来临等，这些方面将对资金面的需求加大。我们认为，尽管下半年市场有各种制约因素，但证券市场牛市格局没有改变。

我们认为投资策略的主线是，在人民币可能加速升值与通胀背景下受益的行业将是下阶段配置的方向。个股上仍将重点配置业绩增长明确并持续的龙头股，投资思路是与优质企业共同成长。

周期基金投资对象在震荡市中股价波动相对比较大，怎样降低基金净值的波动度，提高基金收益率将是周期基金下半年投资运作的重点工作。我们基金投资管理团队，将用勤勉尽责的态度，争取为基金持有人在下阶段的基金管理中，取得满意的回报。

3、合丰稳定基金投资策略与业绩表现说明

（1）上半年行情回顾及分析

2007 年的 A 股市场延续了 06 年走势波澜壮阔。07 年 A 股市场单边大幅上涨，以 2728.19 开盘，收盘 3820.70，大幅上涨 40.04%。上半年年亮点行业是化纤、有色、煤炭、地产等。本基金的主要投资范围中农业、电力等行业涨幅超越大盘，食品饮料、金融等行业涨幅落后大盘。

上半年的思路仍是继续看好全年的 A 股市场，减少资产配置的决心，接近满仓操作。重点配置交通运输、金融和消费服务业，个股上重点选择具有整体上市和业绩超预期的公司。消费服务具备长线机会。中国内需的崛起是大趋势，强化内需型的经济政策推动人均可支配收入加快增长；建设“新农村”、“和谐社会”，国家加强养老医疗保险、基础教育投入，刺激消费信心；农村社会的城市化，城市消费升级下的品牌化；后股改时代，竞争性领域国退民进，相当一批公司将展现新的活力；契机还可能由奥运题材、产品提价来推动。金融服务是稳定类行业的主流资产。稳定类资产中强调对整体上市板块的配置力度，主要集中在港口、机场、铁路、航运、

电力等行业。由于历史遗留因素，未来此类公司是整体上市较为集中的领域。

(2) 本基金业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.3262 元，本报告期份额净值增长率为 37.11%，同期业绩比较基准增长率为 42.00%。

(3) 本基金下半年市场展望和投资策略

我们认为，一年半以来的大牛市仍未终结，有利的宏观经济环境将继续推动市场处于上升通道，上市公司治理结构仍在逐步优化的过程中，A 股市场全面进入后股改的繁荣阶段。市场结构也在发展完善的过程中，金融市场创新层出不穷，资产注入的机会仍然很多。与此同时，短期市场面临政策调控、大股东减持、估值结构性偏高等压力。下半年的业绩贡献将更多来源于精耕细作。

四、基金托管人报告

2007 年上半年，托管人在泰达荷银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的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

2007 年上半年，泰达荷银基金管理有限公司在泰达荷银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投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

2007 年上半年，由泰达荷银基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关泰达荷银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的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

五、财务会计报告

合丰成长基金

(一) 资产负债表

	2006 年 12 月 31 日	2007 年 6 月 30 日
资产		
银行存款	4,601,639.73	106,054,485.01
清算备付金	37,945,130.08	69,070,655.91
交易保证金	859,609.61	2,447,747.77
应收证券清算款		41,228,512.64
应收股利		
应收利息	1,395,807.13	3,330,920.92
应收申购款		689,973.74
其它应收款		
股票投资市值	479,366,949.85	844,977,259.53
其中：股票投资成本	428,058,685.27	678,811,960.32
债券投资市值	127,178,595.50	261,004,346.03
其中：债券投资成本	127,362,381.69	261,140,114.43
权证投资		1,911,360.75
其中：权证投资成本		730,521.15
买入返售证券		
待摊费用		
资产总计	651,347,731.90	1,330,715,262.30
负债与持有人权益		
负债		
应付证券清算款	15,802,016.65	
应付赎回款	618,562.35	2,453,656.14
应付赎回费	676.33	8,669.15
应付管理人报酬	804,579.89	1,575,797.95
应付托管费	134,096.64	262,632.99
应付佣金	1,067,366.32	1,924,131.91
应付利息		10,739.72
应付收益		
未交税金		
其他应付款	500,042.93	750,370.26
卖出回购证券		98,000,000.00
短期借款		

预提费用	65,000.00	81,819.24
其它负债	0.00	
负债合计	18,992,341.11	105,067,817.36
持有人权益		
实收基金	333,316,149.74	734,379,229.02
未实现利得	1,209,771.57	74,028,237.18
未分配基金净收益	297,829,469.48	417,239,978.74
持有人权益合计	632,355,390.79	1,225,647,444.94
负债及持有人权益总计	651,347,731.90	1,330,715,262.30

(二) 经营业绩表

	2007年1月1日至2007年6月30日	2006年1月1日至2006年6月30日
收入	522,000,561.80	173,230,396.96
股票差价收入	514,205,466.36	167,331,312.98
债券差价收入	-1,712,139.64	-600,639.79
权证差价收入	621,267.56	0.00
债券利息收入	4,057,029.63	2,018,630.74
存款利息收入	426,417.01	182,881.48
股利收入	2,331,922.11	4,024,911.40
买入返售证券收入	0.00	0.00
其他收入	2,070,598.77	273,300.15
费用	13,403,807.26	6,039,455.34
基金管理人报酬	11,312,078.50	4,865,313.98
基金托管费	1,885,346.43	810,885.64
卖出回购证券支出	75,203.42	249,675.19
利息支出	0.00	0.00
其他费用	131,178.91	113,580.53
其中：上市年费	0.00	0.00
信息披露费	49,586.76	49,586.76
审计费用	32,232.48	39,671.58
基金净收益	508,596,754.54	167,190,941.62
加：未实现收益	116,085,892.02	102,443,499.61
基金经营业绩	624,682,646.56	269,634,441.23

(三) 收益分配表

	2007年1月1日至2007年6月30日	2006年1月1日至2006年6月30日
--	----------------------	----------------------

本期基金净收益	508,596,754.54	167,190,941.62
加：期初基金净收益	297,829,469.48	14,873,594.46
加：本期损益平准金	-106,527,181.69	-24,994,374.30
可供分配基金净收益	699,899,042.33	157,070,161.78
减：本期已分配基金净收益	282,659,063.59	26,694,921.37
期末基金净收益	417,239,978.74	130,375,240.41

（四）净值变动表

	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日
期初基金净值	632,355,390.79	623,230,979.50
本期经营活动		
基金净收益	508,596,754.54	167,190,941.62
未实现利得	116,085,892.02	102,443,499.61
经营活动产生的净值变动数	624,682,646.56	269,634,441.23
本期基金单位交易		
基金申购款	2,268,487,026.86	430,206,750.33
其中：红利再投资	113,716,924.70	3,639,876.12
基金赎回款	2,017,218,555.68	652,048,234.27
基金单位交易产生的净值变动数	251,268,471.18	-221,841,483.94
本期向持有人分配收益		
向基金持有人分配收益产生的净值变动数	-282,659,063.59	-26,694,921.37
期末基金净值	1,225,647,444.94	644,329,015.42

（五）会计报表附注

- 1、本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。报告期内基金因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。
- 2、本报告期末出现重大会计差错。
- 3、本报告期关联方关系发生变化的情况，本报告期及上年度可比期间的关联方交易
 - (a) 关联方关系发生变化的情况

关联方名称	与本基金关系
泰达荷银基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、基金注册登记人、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

北方国际信托投资股份有限公司	基金管理人的股东
荷银投资管理（亚洲）有限公司	基金管理人的股东

(b) 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

本基金未有与关联方席位进行的证券交易及交易佣金。

(c) 基金管理人、基金托管人报酬

支付基金管理人泰达荷银基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

	基金管理人报酬	基金托管人报酬
2007 年 1 月 1 日 至 2007 年 6 月 30 日	11,312,078.50	1,885,346.43
2006 年 1 月 1 日 至 2006 年 6 月 30 日	4,865,313.98	810,885.64

(d) 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

(e) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入：

本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2006 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 106,054,485.01 元 (2006 年 6 月 30 日为 6,102,215.17 元)。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 217,023.26 元 (2006 年同期为 71,810.73 元)。

(f) 本基金管理公司、本基金管理公司的股东在 2006 年上半年度、2007 年上半年度均未持有本基金。

4、会计报表重要项目说明

(a) 应收利息

	2007 年 6 月 30 日
应收债券利息	3,313,972.08
应收银行存款利息	5,019.59
应收清算备付金利息	11,875.21
应收权证保证金利息	41.04
应收申购款利息	13.00
合计	3,330,920.92

(b) 待摊费用

	2007 年 6 月 30 日
待摊费用	0.00

(c) 估值增值

	2007 年 6 月 30 日
股票投资	166,165,299.21
债券投资	-135,768.40
权证投资	1,180,839.60

合计	167,210,370.41
----	----------------

(d) 应付佣金

	2007年6月30日
国泰君安	231,069.68
申银万国	480,707.39
湘财证券	60,518.98
平安证券	235,705.22
兴业证券	332,695.64
国金证券	105,428.42
中信证券	478,006.58
合计	1,924,131.91

(e) 其它应付款

	2007年6月30日
交易保证金	750,000.00
基金转换费用	327.33
其他	42.93
合计	750,370.26

(f) 预提费用

	2007年6月30日
审计费	32,232.48
信息披露费	49,586.76
合计	81,819.24

(g) 实收基金

	2007年1月1日至2007年6月30日
期初数	333,316,149.74
本期申购数	1,884,245,791.78
本期赎回数	1,483,182,712.50
期末数	734,379,229.02

(h) 未实现利得

	2007年1月1日至2007年6月30日
期初余额	1,209,771.57
本期投资估值增值	116,085,892.02
申购未实现利得平准金	181,672,599.92
赎回未实现利得平准金	-224,940,026.33
合计	74,028,237.18

(i) 股票差价收入

	2007年1月1日至2007年6月30日
股票成交总额	3,068,781,252.21
股票成本总额	2,552,011,865.15
应付佣金	2,563,920.70
股票差价收入	514,205,466.36

(j) 债券差价收入

	2007年1月1日至2007年6月30日
--	----------------------

债券成交总额	485,932,198.50
债券成本总额	480,985,768.30
应收利息总额	6,658,569.84
债券差价收入	-1,712,139.64

(k) 其他收入

	2007年1月1日至2007年6月30日
新股申购手续费返还	0.00
国债兑付手续费返还	0.00
赎回基金补偿收入	2,070,598.77
合计	2,070,598.77

(l) 其它费用

	2007年1月1日至2007年6月30日
审计师费	32,232.48
信息披露费	49,586.76
回购交易费用	143.76
银行手续费	34,427.86
银行间服务费	12,670.00
外汇交易中心交易手续费	2,118.05
其它	0.00
合计	131,178.91

(m) 收益分配

登记日	分红率	现金形式发放	再投资形式发放	发放红利合计
2007-1-5	每10份基金份额8.5元	168,942,138.89	113,716,924.70	282,659,063.59

(n) 报告期内基金因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价对报告期内股票投资成本等项目的累计影响金额。

本基金于本会计期间未获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价。

5、报告期末流通转让受到限制的基金资产

本基金截至2007年6月30日止投资的流通受限制的股票情况如下：

股票代码	股票名称	数量	股票成本	股票市值	流通日期
600761	安徽合力	500,000	5,300,000.00	14,250,000.00	2007-7-5

合丰周期基金

(一) 资产负债表

	2006年12月31日	2007年6月30日
资产		
银行存款	1,996,035.46	104,317,423.22
清算备付金	1,303,192.79	78,912,121.76
交易保证金	609,609.61	2,787,464.08
应收证券清算款		39,946,716.85

应收股利		441,000.00
应收利息	547,812.17	2,468,061.95
应收申购款		1,077,763.08
其它应收款		
股票投资市值	199,169,657.65	712,748,002.62
其中：股票投资成本	153,200,117.88	564,364,969.26
债券投资市值	51,512,599.30	217,892,835.79
其中：债券投资成本	51,482,834.01	218,016,716.82
权证投资	0.00	0.00
其中：权证投资成本	0.00	0.00
买入返售证券		0.00
待摊费用		
资产总计	255,138,906.98	1,160,591,389.35
负债与持有人权益		
负债		
应付证券清算款	639,995.49	
应付赎回款	532,905.47	2,757,122.53
应付赎回费	635.35	9,475.35
应付管理人报酬	304,491.19	1,347,266.10
应付托管费	50,748.52	224,544.33
应付佣金	565,088.30	2,663,779.78
应付利息		10,739.72
应付收益		
未交税金		
其他应付款	250,000.00	500,619.13
卖出回购证券		98,000,000.00
短期借款		
预提费用	50,000.00	74,381.95
其它负债		
负债合计	2,393,864.50	105,587,928.89
持有人权益		
实收基金	109,580,643.98	722,018,651.56
未实现利得	6,975,269.82	-95,123,176.32

未分配基金净收益	136,189,128.68	428,107,985.22
持有人权益合计	252,745,042.48	1,055,003,460.46
负债及持有人权益总计	255,138,906.98	1,160,591,389.35

(二) 经营业绩表

	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日
收入	362,109,488.28	87,954,020.65
股票差价收入	351,365,476.76	81,250,924.68
债券差价收入	-3,355,609.43	-157,366.14
权证差价收入	5,710,943.81	3,822,722.90
债券利息收入	3,777,431.68	789,343.26
存款利息收入	432,056.67	66,318.22
股利收入	2,146,590.79	2,099,097.01
买入返售证券收入	0.00	0.00
其他收入	2,032,598.00	82,980.72
费用	12,826,369.35	2,450,621.00
基金管理人报酬	10,776,760.83	1,973,777.57
基金托管费	1,796,126.76	328,962.99
卖出回购证券支出	124,541.53	58,883.34
利息支出	0.00	0.00
其他费用	128,940.23	88,997.10
其中：上市年费	0.00	0.00
信息披露费	49,586.76	49,586.76
审计费用	24,795.19	24,795.19
基金净收益	349,283,118.93	85,503,399.65
加：未实现收益	102,259,847.27	43,976,597.89
基金经营业绩	451,542,966.20	129,479,997.54

(三) 收益分配表

	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日
本期基金净收益	349,283,118.93	85,503,399.65
加：期初基金净收益	136,189,128.68	-19,567.09
加：本期损益平准金	78,228,991.45	-7,719,599.72
可供分配基金净收益	563,701,239.06	77,764,232.84
减：本期已分配基金净收益	135,593,253.84	11,212,094.25
期末基金净收益	428,107,985.22	66,552,138.59

(四) 净值变动表

	2007年1月1日至2007年6月30日	2006年1月1日至2006年6月30日
期初基金净值	252,745,042.48	255,942,481.65
本期经营活动		
基金净收益	349,283,118.93	85,503,399.65
未实现利得	102,259,847.27	43,976,597.89
经营活动产生的净值变动数	451,542,966.20	129,479,997.54
本期基金单位交易		
基金申购款	2,709,224,234.77	100,569,227.22
其中：红利再投资	71,833,306.75	2,527,432.54
基金赎回款	-2,222,915,529.15	181,227,582.82
基金单位交易产生的净值变动数	486,308,705.62	-80,658,355.60
本期向持有人分配收益		
向基金持有人分配收益产生的净值变动数	-135,593,253.84	11,212,094.25
期末基金净值	1,055,003,460.46	293,552,029.34

(五) 会计报表附注

1、半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。报告期内基金因股权分置改革而获得非流通股东支付的现金对价，于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

2、本报告期末出现重大会计差错。

3、本报告期关联方关系发生变化的情况，本报告期及上年度可比期间的关联方交易

(a) 关联方关系发生变化的情况

关联方名称	与本基金关系
泰达荷银基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、基金注册登记人、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
北方国际信托投资股份有限公司	基金管理人的股东
荷银投资管理（亚洲）有限公司	基金管理人的股东

(b) 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

本基金未有与关联方席位进行的证券交易及交易佣金。

(c) 基金管理人、基金托管人报酬

支付基金管理人泰达荷银基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

	基金管理人报酬	基金托管人报酬
2007 年 1 月 1 日 至 2007 年 6 月 30 日	10,776,760.83	1,796,126.76
2006 年 1 月 1 日 至 2006 年 6 月 30 日	1,973,777.57	328,962.99

(d) 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

	关联方	买入成交金额	卖出成交金额
2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日	交通银行	0	29,986,232.88

(e) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入：

本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2007 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 104,317,423.22 元(2006 年 6 月 30 日为 927,313.21 元)。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 225,516.81 元(2006 年同期为 16,831.39 元)。

(f) 本基金管理公司、本基金管理公司的股东在 2007 年上半年度、2006 年上半年度均未持有本基金。

4、会计报表重要项目说明

(a) 应收利息

	2007 年 6 月 30 日
应收债券利息	2,446,510.00
应收银行存款利息	4,560.62
应收清算备付金利息	16,928.94
应收买入返售证券利息	0.00
应收权证保证金利息	41.04
应收申购款利息	21.35
合计	2,468,061.95

(b) 待摊费用

	2007 年 6 月 30 日
待摊费用	0.00

(c) 估值增值

	2007 年 6 月 30 日
股票投资	148,383,033.36
债券投资	-123,881.03
合计	148,259,152.33

(d) 应付佣金

	2007 年 6 月 30 日
湘财证券	323,108.29
申银万国	295,783.35
中信证券	131,256.65
高华证券	1,276,715.13

中金证券	636,916.36
合计	2,663,779.78

(e) 其它应付款

	2007 年 6 月 30 日
交易保证金	500,000.00
基金转换费用	619.13
合计	500,619.13

(f) 预提费用

	2007 年 6 月 30 日
审计费	24,795.19
信息披露费	49,586.76
合计	74,381.95

(g) 实收基金

	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日
期初数	109,580,643.98
本期申购数	2,569,716,831.49
本期赎回数	1,957,278,823.91
期末数	722,018,651.56

(h) 未实现利得

	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日
期初余额	6,975,269.82
本期投资估值增值	102,259,847.27
申购未实现利得平准金	-446,327,097.35
赎回未实现利得平准金	241,968,803.94
合计	-95,123,176.32

(i) 股票差价收入

	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日
股票成交总额	3,986,648,422.33
股票成本总额	3,631,942,953.67
应付佣金	3,339,991.90
股票差价收入	351,365,476.76

(j) 债券差价收入

	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日
债券成交总额	458,806,018.93
债券成本总额	456,507,015.27
应收利息总额	5,654,613.09
债券差价收入	-3,355,609.43

(k) 其他收入

	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日
新股申购手续费返还	0.00
国债兑付手续费返还	0.00
赎回基金补偿收入	2,032,598.00
合计	2,032,598.00

(1) 其它费用

	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日
审计师费	24,795.19
信息披露费	49,586.76
回购交易费用	468.84
银行手续费	40,170.74
银行间服务费	12,460.00
外汇交易中心交易手续费	1,458.70
其它	0.00
合计	128,940.23

(m) 收益分配

登记日	分红率	现金形式发放	再投资形式发 放	发放红利合计
2007-1-5	每 10 份基金份额 12.40 元	63,759,947.09	71,833,306.75	135,593,253.84

(n) 报告期内基金因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价对报告期内股票投资成本等项目的累计影响金额。

本基金于本会计期间未获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价。

5、报告期末流通转让受到限制的基金资产

本基金截至 2007 年 6 月 30 日止投资的流通受限制的股票情况如下：

股票代码	股票名称	数量	股票成本	股票市值	流通日期
600761	安徽合力	500,000	5,300,000.00	14,250,000.00	2007-7-5

合丰稳定基金

(一) 资产负债表

	2006 年 12 月 31 日	2007 年 6 月 30 日
资产		
银行存款	4,213,234.34	106,574,891.09
清算备付金	5,868,710.01	26,122,977.85
交易保证金	359,609.61	1,147,375.45
应收证券清算款	0.00	60,019,865.47
应收股利	0.00	
应收利息	368,159.59	2,894,704.20
应收申购款	0.00	437,113.51
其它应收款	0.00	
股票投资市值	256,429,736.92	769,840,526.62
其中：股票投资成本	223,127,542.89	631,019,715.99
债券投资市值	65,132,795.25	251,211,221.00
其中：债券投资成本	65,080,778.00	251,620,081.28

权证投资	0.00	2,369,635.18
其中：权证投资成本	0.00	
买入返售证券	0.00	
待摊费用	0.00	
资产总计	332,372,245.72	1,220,618,310.37
负债与持有人权益		
负债		
应付证券清算款	6,042,843.17	0.00
应付赎回款	575,101.93	3,905,838.96
应付赎回费	302.55	12,243.85
应付管理人报酬	376,739.63	1,480,456.65
应付托管费	62,789.95	246,742.78
应付佣金	724,741.83	2,502,546.36
应付利息	0.00	10,739.72
应付收益	0.00	0.00
未交税金	0.00	0.00
其他应付款	750,000.00	1,000,367.17
卖出回购证券	0.00	98,000,000.00
短期借款	0.00	0.00
预提费用	50,000.00	74,381.95
其它负债		
负债合计	8,582,519.06	107,233,317.44
持有人权益		
实收基金	140,258,776.64	839,507,115.17
未实现利得	11,943,622.05	19,180,879.16
未分配基金净收益	171,587,327.97	254,696,998.60
持有人权益合计	323,789,726.66	1,113,384,992.93
负债及持有人权益总计	332,372,245.72	1,220,618,310.37

(二) 经营业绩表

	2007年1月1日至2007年6月30日	2006年1月1日至2006年6月30日
收入	412,120,341.46	92,141,501.85
股票差价收入	408,453,532.43	87,634,080.39

债券差价收入	-4,489,438.12	-111,787.52
权证差价收入	0.00	25,18,476.56
债券利息收入	3,765,987.66	753,162.61
存款利息收入	423,180.61	72,434.13
股利收入	2,113,167.16	1,216,056.40
买入返售证券收入	0.00	
其他收入	1,853,911.72	59,079.28
费用	12,652,286.23	2,532,667.41
基金管理人报酬	10,610,307.80	1,990,315.71
基金托管费	1,768,384.61	331,719.26
卖出回购证券支出	146,123.70	119,557.73
利息支出	0.00	
其他费用	127,470.12	91,074.71
其中：上市年费	0.00	0.00
信息披露费	49,586.76	49,586.76
审计费用	24,795.19	24,795.19
基金净收益	399,468,055.23	89,608,834.44
加：未实现收益	107,427,374.25	36,440,575.46
基金经营业绩	506,895,429.48	126,049,409.90

(三) 收益分配表

	2007年1月1日至2007 年6月30日	2006年1月1日至2006年6 月30日
本期基金净收益	399,468,055.23	89,608,834.44
加：期初基金净收益	171,587,327.97	-1,887,435.87
加：本期损益平准金	18,872,159.14	-5,480,271.18
可供分配基金净收益	589,927,542.34	82,241,127.39
减：本期已分配基金净收益	335,230,543.74	10,951,454.76
期末基金净收益	254,696,998.60	71,289,672.63

(四) 净值变动表

	2007年1月1日至2007 年6月30日	2006年1月1日至2006 年6月30日
期初基金净值	323,789,726.66	243,791,019.10
本期经营活动		
基金净收益	399,468,055.23	89,608,834.44
未实现利得	107,427,374.25	36,440,575.46
经营活动产生的净值变动数	506,895,429.48	126,049,409.90
本期基金单位交易		

基金申购款	2,491,174,638.08	77,335,522.57
其中：红利再投资	127,229,129.28	772,485.37
基金赎回款	-1,873,244,257.55	-135,033,092.56
基金单位交易产生的净值变动数	617,930,380.53	-57,697,569.99
本期向持有人分配收益		
向基金持有人分配收益产生的净值变动数	-335,230,543.74	-10,951,454.76
期末基金净值	1,113,384,992.93	301,191,404.25

（五）会计报表附注

1、本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。报告期内基金因股权分置改革而获得非流通股东支付的现金对价，于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

2、本报告期末出现重大会计差错。

3、本报告期关联方关系发生变化的情况，本报告期及上年度可比期间的关联方交易

(a) 关联方关系发生变化的情况

关联方名称	与本基金关系
泰达荷银基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、基金注册登记人、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
北方国际信托投资股份有限公司	基金管理人的股东
荷银投资管理（亚洲）有限公司	基金管理人的股东

(b) 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

本基金未有与关联方席位进行的证券交易及交易佣金。

(c) 基金管理人、基金托管人报酬

支付基金管理人泰达荷银基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

	基金管理人报酬	基金托管人报酬
2007年1月1日至2007年6月30日	10,610,307.80	1,768,384.61
2006年1月1日至2006年6月30日	1,990,315.71	331,719.26

(d) 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

	关联方	买入成交金额	卖出成交金额
--	-----	--------	--------

2007年1月1日至 2007年6月30日	交通银行	0.00	50,010,863.02
--------------------------	------	------	---------------

(e) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入：

本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2007 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 106,574,891.09 元(2006 年 6 月 30 日为 6,820,972.38 元)。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 251,454.84 元(2006 年同期为 30,029.01 元)。

(f) 本基金管理公司、本基金管理公司的股东在 2007 年上半年度、2006 年上半年度均未持有本基金。

4、会计报表重要项目说明

(a) 应收利息

	2007 年 6 月 30 日
应收债券利息	2,880,773.12
应收银行存款利息	5,919.22
应收清算备付金利息	7,866.37
应收交收价差保证金利息	41.04
应收申购款利息	104.45
合计	2,894,704.20

(b) 待摊费用

	2007 年 6 月 30 日
信息披露费	0.00

(c) 估值增值

	2007 年 6 月 30 日
股票投资	138,820,810.63
债券投资	-408,860.28
权证投资	2,369,635.18
合计	140,781,585.53

(d) 应付佣金

	2007 年 6 月 30 日
国泰君安	608,450.35
中信建投	1,299,764.93
光大证券	206,387.47
银河证券	161,766.46
广州证券	226,177.15
合计	2,502,546.36

(e) 其它应付款

	2007 年 6 月 30 日
交易保证金	1,000,000.00
基金转换费用	367.17
合计	1,000,367.17

(f) 预提费用

	2007 年 6 月 30 日
--	-----------------

审计费	24,795.19
信息披露费	49,586.76
合计	74,381.95

(g) 实收基金

	2007年1月1日至2007年6月30日
期初数	140,258,776.64
本期申购数	2,319,366,950.58
本期赎回数	1,620,118,612.05
期末数	839,507,115.17

(h) 未实现利得

	2007年1月1日至2007年6月30日
期初余额	11,943,622.05
本期投资估值增值	107,427,374.25
申购未实现利得平准金	12,145,913.50
赎回未实现利得平准金	-112,336,030.64
合计	19,180,879.16

(i) 股票差价收入

	2007年1月1日至2007年6月30日
股票成交总额	3,356,823,209.87
股票成本总额	2,945,533,626.53
应付佣金	2,836,050.91
股票差价收入	408,453,532.43

(j) 债券差价收入

	2007年1月1日至2007年6月30日
债券成交总额	425,603,260.98
债券成本总额	424,776,719.47
应收利息总额	5,315,979.63
债券差价收入	-4,489,438.12

(k) 其他收入

	2007年1月1日至2007年6月30日
新股申购手续费返还	
国债兑付手续费返还	
赎回基金补偿收入	1,853,911.72
合计	1,853,911.72

(l) 其它费用

	2007年1月1日至2007年6月30日
审计师费	24,795.19
信息披露费	49,586.76
回购交易费用	646.90
银行手续费	37,496.32
银行间服务费	13,090.00
外汇交易中心交易手续费	1,854.95
其它	

合计	127,470.12
----	------------

(m) 收益分配

登记日	分红率	现金形式发放	再投资形式发放	发放红利合计
2007-1-5	每 10 份基金份额 12.20 元	97,382,248.38	70,703,220.02	168,085,468.40
2007-2-8	每 10 份基金份额 0.30 元	30,927,491.14	13,990,495.58	44,917,986.72
2007-3-13	每 10 份基金份额 0.90 元	79,691,674.94	42,535,413.68	122,227,088.62

(n) 报告期内基金因股权分置改革而获得非流通股东支付的现金对价对报告期内股票投资成本等项目的累计影响金额。

本基金于本会计期间未获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价。

5、本报告期流通转让受限制的基金资产

本基金截至 2006 年 6 月 30 日止流通受限制的股票情况如下：

股票代码	股票名称	数量	股票成本	股票市值	流通日期
600761	安徽合力	500,000	5,300,000.00	14,250,000.00	2007-7-5

六、投资组合报告

合丰成长基金

(一) 报告期末基金资产组合 (单位：元)

项目	金额	占基金总资产比例
股票	844,977,259.53	63.50%
债券	261,004,346.03	19.61%
银行存款和清算备付金	175,125,140.92	13.16%
权证	1,911,360.75	0.14%
其它资产	47,697,155.07	3.58%
合计	1,330,715,262.30	100.00%

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合 (单位：元)

行业分类	市值	占基金净值比例
A 农、林、牧、渔业	26,795,343.50	2.19%
B 采掘业	31,049,019.57	2.53%
C 制造业	459,335,779.36	37.48%
C0 食品、饮料	10,558,521.60	0.86%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	46,932,109.50	3.83%
C5 电子	49,874,967.24	4.07%
C6 金属、非金属	8,542,000.00	0.70%
C7 机械、设备、仪表	253,471,815.32	20.68%
C8 医药、生物制品	45,661,589.70	3.73%

C99 其他制造业	44,294,776.00	3.61%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	58,124,124.54	4.74%
G 信息技术业	56,616,503.49	4.62%
H 批发和零售贸易	74,599,001.12	6.09%
I 金融、保险业	52,970,000.00	4.32%
J 房地产业	14,758,343.31	1.20%
K 社会服务业	0.00	0.00%
L 传播与文化产业	70,729,144.64	5.77%
M 综合类	0.00	0.00%
合计	844,977,259.53	68.94%

本基金投资成长类行业股票市值合计占投资股票总市值的 80.30%。

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细 (单位: 元)

股票代码	股票名称	数量	市值	市值占基金净值
600037	歌华有线	2,701,648	70,729,144.64	5.77%
600717	天津港	2,309,262	58,124,124.54	4.74%
600183	生益科技	4,500,000	55,215,000.00	4.51%
600030	中信证券	1,000,000	52,970,000.00	4.32%
000063	中兴通讯	921,852	50,148,748.80	4.09%
600089	特变电工	1,569,405	48,259,203.75	3.94%
600206	有研硅股	1,261,600	44,294,776.00	3.61%
600143	金发科技	1,049,925	40,464,109.50	3.30%
000410	沈阳机床	1,679,191	40,300,584.00	3.29%
002024	苏宁电器	800,000	37,568,000.00	3.07%
000983	西山煤电	1,099,859	31,049,019.57	2.53%
600150	沪东重机	209,853	29,010,078.72	2.37%
600511	国药股份	704,974	27,409,389.12	2.24%
000829	天音控股	799,861	26,795,343.50	2.19%
002028	思源电气	404,980	25,465,142.40	2.08%
002025	航天电器	955,591	25,409,164.69	2.07%
002106	莱宝高科	815,255	24,465,802.55	2.00%
002022	科华生物	785,000	19,782,000.00	1.61%
600675	中华企业	649,861	14,758,343.31	1.20%
600201	金宇集团	1,209,057	14,629,589.70	1.19%
600761	安徽合力	500,000	14,250,000.00	1.16%
000400	许继电气	999,886	13,418,470.12	1.09%
600312	平高电气	499,927	11,393,336.33	0.93%
002038	双鹭药业	300,000	11,250,000.00	0.92%
600195	中牧股份	499,930	10,558,521.60	0.86%
000560	昆百大 A	961,200	9,621,612.00	0.79%

000527	美的电器	300,000	9,120,000.00	0.74%
600456	宝钛股份	200,000	8,542,000.00	0.70%
002097	山河智能	100,000	7,040,000.00	0.57%
600352	浙江龙盛	600,000	6,468,000.00	0.53%
600570	恒生电子	430,323	6,467,754.69	0.53%

（四）报告期内股票投资组合的重大变动

1、报告期内累计买入占期初基金资产净值 2%以上的股票明细

股票代码	股票名称	累计买入金额	占期初净值比例
002025	航天电器	147,303,100.13	23.29%
000063	中兴通讯	122,714,602.93	19.41%
600037	歌华有线	98,499,264.11	15.58%
600005	武钢股份	84,456,641.23	13.36%
600261	浙江阳光	79,242,431.23	12.53%
600030	中信证券	78,547,481.28	12.42%
000410	沈阳机床	77,334,537.02	12.23%
600183	生益科技	76,633,312.08	12.12%
002106	莱宝高科	67,991,600.69	10.75%
600717	天津港	65,183,426.53	10.31%
600206	有研硅股	61,772,470.31	9.77%
600143	金发科技	58,622,722.57	9.27%
600570	恒生电子	57,914,152.00	9.16%
000039	中集集团	57,858,338.77	9.15%
600089	特变电工	56,765,512.11	8.98%
000898	鞍钢股份	55,727,199.97	8.81%
000002	万科 A	53,289,802.68	8.43%
600511	国药股份	53,007,137.70	8.38%
600161	天坛生物	52,144,624.20	8.25%
600529	山东药玻	47,637,942.45	7.53%
000157	中联重科	45,004,569.58	7.12%
002070	众和股份	44,793,977.93	7.08%
600016	民生银行	44,296,876.54	7.01%
000983	西山煤电	38,547,993.19	6.10%
600332	广州药业	36,301,255.02	5.74%
002024	苏宁电器	36,237,471.23	5.73%
002022	科华生物	34,241,315.74	5.41%
000400	许继电气	31,609,181.18	5.00%
000829	天音控股	31,131,191.70	4.92%
601628	中国人寿	30,495,373.54	4.82%
600096	云天化	30,017,327.07	4.75%
002093	国脉科技	29,992,758.80	4.74%

600832	东方明珠	29,420,638.79	4.65%
600406	国电南瑞	29,406,455.36	4.65%
002028	思源电气	29,250,562.39	4.63%
600718	东软股份	28,987,459.35	4.58%
600150	沪东重机	28,588,631.46	4.52%
002056	横店东磁	27,742,888.97	4.39%
600036	招商银行	24,572,976.03	3.89%
600050	中国联通	23,962,324.13	3.79%
600675	中华企业	23,850,242.71	3.77%
600201	金宇集团	22,095,862.02	3.49%
600299	星新材料	21,760,390.11	3.44%
002052	同洲电子	20,947,717.11	3.31%
600111	稀土高科	20,781,503.23	3.29%
601988	中国银行	20,178,272.14	3.19%
600685	广船国际	19,905,498.31	3.15%
600269	赣粤高速	19,290,754.02	3.05%
601006	大秦铁路	19,149,345.34	3.03%
002065	东华合创	18,040,584.32	2.85%
002104	恒宝股份	17,608,370.31	2.78%
000933	神火股份	17,485,443.50	2.77%
600476	湘邮科技	16,829,363.14	2.66%
600642	申能股份	16,469,004.00	2.60%
600436	片仔癀	16,119,060.91	2.55%
600309	烟台万华	15,845,093.85	2.51%
600004	白云机场	15,619,909.40	2.47%
600360	华微电子	15,474,503.59	2.45%
600396	金山股份	15,262,519.46	2.41%
000768	西飞国际	14,907,687.87	2.36%
600320	振华港机	14,621,764.70	2.31%
600219	南山铝业	14,445,733.08	2.28%
600410	华胜天成	14,378,511.08	2.27%
600428	中远航运	14,236,294.89	2.25%
000527	美的电器	14,131,758.05	2.23%
600584	长电科技	13,482,299.06	2.13%
600195	中牧股份	13,403,469.69	2.12%
000623	吉林敖东	13,271,893.76	2.10%
600000	浦发银行	12,620,565.26	2.00%

2、报告期内累计卖出占期初基金资产净值 2%以上的股票明细

股票代码	股票名称	累计卖出金额	占期初净值比例
002025	航天电器	176,119,900.36	27.85%

000063	中兴通讯	140,000,631.83	22.14%
600037	歌华有线	127,088,159.97	20.10%
600206	有研硅股	114,254,078.68	18.07%
600005	武钢股份	89,824,395.93	14.20%
600261	浙江阳光	86,806,515.42	13.73%
600570	恒生电子	79,066,549.40	12.50%
000157	中联重科	78,969,280.73	12.49%
000898	鞍钢股份	73,843,549.84	11.68%
000768	西飞国际	73,044,688.82	11.55%
002028	思源电气	63,452,402.60	10.03%
600529	山东药玻	61,548,316.13	9.73%
000829	天音控股	59,028,717.75	9.33%
000410	沈阳机床	58,711,927.95	9.28%
600299	星新材料	57,452,002.33	9.09%
600511	国药股份	56,857,139.09	8.99%
000039	中集集团	55,062,824.56	8.71%
000002	万 科 A	51,386,574.27	8.13%
002093	国脉科技	51,242,809.31	8.10%
600030	中信证券	50,772,988.19	8.03%
600161	天坛生物	49,353,311.48	7.80%
002070	众和股份	47,051,744.90	7.44%
002106	莱宝高科	45,977,307.32	7.27%
600016	民生银行	43,929,559.47	6.95%
600332	广州药业	43,157,478.71	6.82%
600089	特变电工	39,169,549.21	6.19%
600718	东软股份	38,939,423.29	6.16%
000623	吉林敖东	35,073,213.10	5.55%
600096	云天化	34,127,611.28	5.40%
600143	金发科技	32,277,368.88	5.10%
002052	同洲电子	31,628,226.92	5.00%
600410	华胜天成	29,474,391.21	4.66%
600476	湘邮科技	28,963,547.18	4.58%
600797	浙大网新	28,788,274.12	4.55%
601006	大秦铁路	28,306,637.23	4.48%
601628	中国人寿	28,132,858.51	4.45%
002065	东华合创	27,516,906.28	4.35%
600406	国电南瑞	27,080,024.58	4.28%
002056	横店东磁	26,194,718.77	4.14%
600036	招商银行	25,807,062.22	4.08%
600271	航天信息	24,965,938.31	3.95%
600050	中国联通	24,729,025.81	3.91%

002007	华兰生物	23,856,812.64	3.77%
000933	神火股份	22,543,555.27	3.57%
600396	金山股份	22,326,726.04	3.53%
601988	中国银行	21,649,067.87	3.42%
002104	恒宝股份	21,559,193.67	3.41%
002022	科华生物	21,487,036.33	3.40%
600832	东方明珠	21,293,574.42	3.37%
600111	稀土高科	20,130,301.30	3.18%
600685	广船国际	19,423,365.91	3.07%
600031	三一重工	19,164,785.92	3.03%
600269	赣粤高速	18,974,439.97	3.00%
600675	中华企业	18,491,679.61	2.92%
600004	白云机场	18,282,074.40	2.89%
600717	天津港	18,041,237.25	2.85%
600642	申能股份	18,033,626.29	2.85%
600309	烟台万华	17,554,521.58	2.78%
600436	片仔癀	17,050,698.27	2.70%
600312	平高电气	16,528,180.58	2.61%
600585	海螺水泥	16,182,719.31	2.56%
000400	许继电气	15,480,932.16	2.45%
600360	华微电子	15,212,519.98	2.41%
600428	中远航运	15,196,815.02	2.40%
600320	振华港机	14,961,550.88	2.37%
600584	长电科技	14,724,390.01	2.33%
000069	华侨城 A	14,597,240.12	2.31%
600219	南山铝业	14,131,710.83	2.23%
600485	中创信测	13,958,173.57	2.21%
600000	浦发银行	13,544,870.76	2.14%
600867	通化东宝	12,816,308.73	2.03%
000983	西山煤电	12,711,703.09	2.01%

3、报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

报告期内买入股票成本总额	2,802,765,140.20
报告期内卖出股票收入总额	3,068,781,252.21

(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合 (单位: 元)

债券类别	债券市值	市值占净值比例
国家债券投资	129,854,460.00	10.59%
央行票据投资	21,351,886.03	1.74%
企业债券投资		

金融债券投资	109,798,000.00	8.96%
可转换债投资		
合计	261,004,346.03	21.29%

(六) 报告期末按市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)

债券名称	市 值	市值占净值比例
05 国债 14	79,836,960.00	6.51%
06 国开 31	50,025,000.00	4.08%
07 农发 01	49,975,000.00	4.08%
07 央票 15	21,351,886.03	1.74%
21 国债(15)	16,562,700.00	1.35%

(七) 报告期末基金持有的权证投资明细(单位: 元)

权证代码	权证名称	数量	成本	期末市值
580013	武钢 CWB1	315,250	730,521.15	1,911,360.75

(八) 投资组合报告附注

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股票库。

3、其他资产

项目	金 额
交易保证金	2,447,747.77
应收证券清算款	41,228,512.64
应收股利	
应收利息	3,330,920.92
应收申购款	689,973.74
其他应收款	
买入返售证券	
待摊费用	

4、基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期内基金未主动投资权证,报告期内因投资认股权和债券分离交易的可转换公司债券所附认股权证信息如下:

权证代码	权证名称	数量	成本	期末市值
580013	武钢 CWB1	315,250	730,521.15	1,911,360.75
580012	云化 CWB1	70,200	415,392.56	0.00

6、报告期末基金未持有资产支持证券。

合丰周期基金

(一) 报告期末基金资产组合(单位: 元)

项目	金 额	占基金总资产比例
----	-----	----------

股票	712,748,002.62	61.41%
债券	217,892,835.79	18.77%
银行存款和清算备付金	183,229,544.98	15.79%
权证	0.00	0.00%
其它资产	46,721,005.96	4.03%
合计	1,160,591,389.35	100.00%

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合 (单位: 元)

行业	市值	占基金净值比例
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	39,520,927.26	3.75%
C 制造业	553,124,545.36	52.44%
C0 食品、饮料	0.00	0.00%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	143,963,940.89	13.65%
C5 电子	0.00	0.00%
C6 金属、非金属	24,374,496.72	2.31%
C7 机械、设备、仪表	314,566,107.75	29.82%
C8 医药、生物制品	0.00	0.00%
C99 其他制造业	70,220,000.00	6.66%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	24,475,000.00	2.32%
G 信息技术业	19,040,000.00	1.80%
H 批发和零售贸易	0.00	0.00%
I 金融、保险业	23,402,530.00	2.22%
J 房地产业	53,185,000.00	5.04%
K 社会服务业	0.00	0.00%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	0.00	0.00%
合计	712,748,002.62	67.56%

本基金投资周期类行业股票市值合计占投资股票总市值的 90.61%。

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细 (单位: 元)

股票代码	股票名称	数量	市值	市值占基金净值
600143	金发科技	2,108,281	81,253,149.74	7.70%
600206	有研硅股	2,000,000	70,220,000.00	6.66%
600582	天地科技	955,121	56,972,967.65	5.40%
000792	盐湖钾肥	1,250,000	55,475,000.00	5.26%
000651	格力电器	1,557,529	54,357,762.10	5.15%

002097	山河智能	767,833	54,055,443.20	5.12%
000157	中联重科	1,400,000	53,900,000.00	5.11%
000983	西山煤电	1,399,962	39,520,927.26	3.75%
000410	沈阳机床	1,600,000	38,400,000.00	3.64%
600675	中华企业	1,500,000	34,065,000.00	3.23%
601111	中国国航	2,500,000	24,475,000.00	2.32%
600067	冠城大通	1,000,000	21,550,000.00	2.04%
600150	沪东重机	146,470	20,248,012.80	1.92%
000002	万 科 A	1,000,000	19,120,000.00	1.81%
000063	中兴通讯	350,000	19,040,000.00	1.80%
600030	中信证券	349,000	18,486,530.00	1.75%
600010	包钢股份	2,499,928	17,474,496.72	1.66%
600761	安徽合力	500,000	14,250,000.00	1.35%
000878	云南铜业	200,000	6,900,000.00	0.65%
002037	久联发展	500,000	6,400,000.00	0.61%
600036	招商银行	200,000	4,916,000.00	0.47%
600299	星新材料	18,365	835,791.15	0.08%
002122	天马股份	10,000	761,900.00	0.07%
000338	潍柴动力	892	70,022.00	0.01%

（四）投资组合的重大变动

1、报告期内累计买入占期初基金资产净值 2%以上的股票明细

股票代码	股票名称	累计买入金额	占期初净值比例
000002	万 科 A	205,473,136.79	81.30%
600028	中国石化	182,180,541.84	72.08%
000792	盐湖钾肥	162,873,554.06	64.44%
600030	中信证券	159,665,409.83	63.17%
600583	海油工程	143,848,853.30	56.91%
600143	金发科技	143,183,402.28	56.65%
000039	中集集团	130,897,496.54	51.79%
000157	中联重科	114,651,082.76	45.36%
600019	宝钢股份	109,107,680.25	43.17%
000410	沈阳机床	103,863,922.57	41.09%
600000	浦发银行	93,439,285.91	36.97%
000898	鞍钢股份	92,997,308.87	36.79%
000825	太钢不锈	85,874,681.44	33.98%
600005	武钢股份	84,830,183.83	33.56%
600320	振华港机	82,410,393.33	32.61%
600206	有研硅股	77,367,855.63	30.61%
600299	星新材料	73,159,598.29	28.95%
600685	广船国际	72,571,469.33	28.71%
600383	金地集团	62,338,100.38	24.66%

600690	青岛海尔	62,268,400.82	24.64%
002037	久联发展	58,187,244.87	23.02%
600582	天地科技	56,502,257.56	22.36%
600009	上海机场	55,279,183.70	21.87%
600048	保利地产	54,730,057.42	21.65%
600585	海螺水泥	53,758,510.08	21.27%
600519	贵州茅台	53,682,923.78	21.24%
600675	中华企业	52,247,717.21	20.67%
002097	山河智能	51,870,020.32	20.52%
000063	中兴通讯	51,004,266.79	20.18%
000625	长安汽车	49,235,396.59	19.48%
000651	格力电器	46,118,256.22	18.25%
000024	招商地产	44,544,350.04	17.62%
600428	中远航运	43,901,617.05	17.37%
000528	柳 工	43,039,827.22	17.03%
000983	西山煤电	42,264,426.39	16.72%
600467	好当家	40,874,101.03	16.17%
600456	宝钛股份	40,594,685.79	16.06%
000402	金 融 街	37,718,476.43	14.92%
601111	中国国航	36,821,096.30	14.57%
000966	长源电力	35,699,341.28	14.12%
600123	兰花科创	35,117,675.79	13.89%
002122	天马股份	34,382,377.90	13.60%
600036	招商银行	33,501,955.36	13.26%
600067	冠城大通	31,349,313.28	12.40%
600150	沪东重机	29,557,360.83	11.69%
000807	云铝股份	27,528,850.89	10.89%
600660	福耀玻璃	26,592,490.26	10.52%
000821	京山轻机	26,250,726.86	10.39%
600037	歌华有线	25,923,725.14	10.26%
601166	兴业银行	25,795,046.49	10.21%
600331	宏达股份	25,722,237.18	10.18%
600096	云天化	25,609,324.23	10.13%
600717	天津港	23,439,752.51	9.27%
600547	山东黄金	23,214,429.55	9.18%
600489	中金黄金	22,749,213.77	9.00%
600472	包头铝业	22,455,430.27	8.88%
601001	大同煤业	22,009,001.10	8.71%
600495	晋西车轴	20,158,735.21	7.98%
601666	平煤天安	20,096,498.41	7.95%
600352	浙江龙盛	19,392,644.65	7.67%

600104	上海汽车	19,023,340.42	7.53%
601628	中国人寿	18,656,869.83	7.38%
600750	江中药业	17,810,414.52	7.05%
600010	包钢股份	17,648,979.58	6.98%
600022	济南钢铁	17,220,205.39	6.81%
000878	云南铜业	15,841,072.57	6.27%
601318	中国平安	15,374,254.72	6.08%
000612	焦作万方	14,899,646.33	5.90%
600761	安徽合力	14,047,370.94	5.56%
000709	唐钢股份	13,988,830.50	5.53%
600997	开滦股份	13,905,853.65	5.50%
600879	火箭股份	13,679,674.63	5.41%
000060	中金岭南	12,966,652.77	5.13%
600780	通宝能源	12,243,067.51	4.84%
601006	大秦铁路	12,209,018.50	4.83%
000338	潍柴动力	12,064,888.12	4.77%
600529	山东药玻	11,927,128.16	4.72%
000069	华侨城 A	10,753,637.42	4.25%
000419	通程控股	10,520,831.62	4.16%
000401	冀东水泥	10,489,361.39	4.15%
600309	烟台万华	10,383,548.01	4.11%
000560	昆百大 A	6,904,927.72	2.73%
600015	华夏银行	6,551,953.29	2.59%
600386	*ST 北巴	6,382,655.88	2.53%
600509	天富热电	6,016,809.94	2.38%
600991	长丰汽车	5,923,307.68	2.34%

2、报告期内累计卖出占期初基金资产净值 2%以上的股票明细

股票代码	股票名称	累计卖出金额	占期初净值比例
000002	万 科 A	214,305,440.05	84.79%
600030	中信证券	186,356,483.47	73.73%
600028	中国石化	176,298,600.78	69.75%
600583	海油工程	157,879,775.83	62.47%
600143	金发科技	135,860,311.55	53.75%
000039	中集集团	134,516,832.50	53.22%
000825	太钢不锈	131,103,047.43	51.87%
000157	中联重科	122,886,933.62	48.62%
600005	武钢股份	119,839,925.85	47.42%
000792	盐湖钾肥	115,671,693.96	45.77%
600685	广船国际	115,348,585.53	45.64%
600019	宝钢股份	99,298,399.23	39.29%

600299	星新材料	96,914,130.44	38.34%
000898	鞍钢股份	96,099,088.51	38.02%
000410	沈阳机床	88,562,272.70	35.04%
600320	振华港机	86,901,256.88	34.38%
600000	浦发银行	86,874,504.90	34.37%
600585	海螺水泥	68,677,127.58	27.17%
600383	金地集团	65,457,262.58	25.90%
600690	青岛海尔	64,831,161.44	25.65%
600519	贵州茅台	57,359,554.70	22.69%
600009	上海机场	55,677,254.93	22.03%
600048	保利地产	55,383,693.88	21.91%
002037	久联发展	54,436,478.50	21.54%
600206	有研硅股	53,229,290.03	21.06%
000528	柳 工	50,186,418.84	19.86%
000625	长安汽车	45,769,083.21	18.11%
600428	中远航运	43,394,104.88	17.17%
000024	招商地产	43,161,119.05	17.08%
600456	宝钛股份	41,638,989.68	16.47%
600675	中华企业	41,438,982.68	16.40%
600467	好当家	39,429,356.04	15.60%
000063	中兴通讯	38,831,567.53	15.36%
000966	长源电力	36,770,294.42	14.55%
002122	天马股份	35,573,564.17	14.07%
000402	金 融 街	33,641,723.23	13.31%
600123	兰花科创	33,113,880.36	13.10%
600036	招商银行	31,720,265.02	12.55%
600489	中金黄金	29,731,442.06	11.76%
600750	江中药业	27,972,405.25	11.07%
000821	京山轻机	27,796,295.43	11.00%
601166	兴业银行	26,835,701.36	10.62%
000807	云铝股份	26,765,266.65	10.59%
600331	宏达股份	26,530,525.34	10.50%
600660	福耀玻璃	26,319,284.65	10.41%
600096	云天化	26,282,913.37	10.40%
600717	天津港	25,871,798.12	10.24%
601001	大同煤业	25,650,947.64	10.15%
600037	歌华有线	24,373,209.42	9.64%
600997	开滦股份	23,390,718.14	9.25%
600472	包头铝业	22,389,134.33	8.86%
601666	平煤天安	21,870,971.78	8.65%
600547	山东黄金	21,111,541.20	8.35%

600352	浙江龙盛	20,356,272.11	8.05%
600495	晋西车轴	19,936,162.35	7.89%
600022	济南钢铁	19,666,076.20	7.78%
600104	上海汽车	19,143,842.02	7.57%
000612	焦作万方	18,522,145.93	7.33%
601628	中国人寿	17,489,316.35	6.92%
000338	潍柴动力	17,142,933.76	6.78%
601318	中国平安	16,778,506.19	6.64%
000401	冀东水泥	16,721,528.44	6.62%
600067	冠城大通	14,737,091.90	5.83%
000709	唐钢股份	14,538,106.13	5.75%
600761	安徽合力	14,266,141.67	5.64%
600780	通宝能源	14,160,350.20	5.60%
601006	大秦铁路	13,356,641.60	5.28%
600879	火箭股份	12,918,208.71	5.11%
000060	中金岭南	12,815,453.21	5.07%
600529	山东药玻	12,605,194.77	4.99%
600875	东方电机	12,274,713.64	4.86%
600309	烟台万华	11,970,861.82	4.74%
601111	中国国航	11,503,990.13	4.55%
600582	天地科技	11,257,044.66	4.45%
601398	工商银行	10,981,355.72	4.34%
600031	三一重工	10,491,249.89	4.15%
000419	通程控股	10,020,984.15	3.96%
000069	华侨城 A	9,942,617.31	3.93%
000878	云南铜业	9,394,875.34	3.72%
600887	伊利股份	9,391,659.59	3.72%
600150	沪东重机	9,247,629.83	3.66%
600386	*ST 北巴	8,811,903.99	3.49%
000983	西山煤电	7,707,467.91	3.05%
600509	天富热电	7,077,131.34	2.80%
000616	亿城股份	7,038,213.65	2.78%
600991	长丰汽车	6,108,614.69	2.42%
600015	华夏银行	5,977,859.34	2.37%
601333	广深铁路	5,772,274.77	2.28%
000560	昆百大 A	5,195,743.30	2.06%

3、报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

报告期内买入股票成本总额	4,043,107,805.05
报告期内卖出股票收入总额	3,986,648,422.33

(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合 (单位: 元)

债券类别	债券市值	市值占净值比例
国家债券投资	88,558,658.80	8.39%
央行票据投资	69,302,836.99	6.57%
企业债券投资		
金融债券投资	60,031,340.00	5.69%
可转换债投资		
合计	217,892,835.79	20.65%

(六) 报告期末按市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)

债券名称	市 值	市值占净值比例
07 农发 01	49,975,000.00	4.74%
07 央票 55	29,796,000.00	2.82%
02 国债(10)	26,514,000.00	2.51%
03 国债 02	20,080,000.00	1.90%
05 国债 14	19,959,240.00	1.89%

(七) 报告期末基金持有的权证投资明细 (单位: 元)

本基金本报告期末无权证投资。

(八) 投资组合报告附注

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股票库。

3、其他资产

项目	金 额
交易保证金	2,787,464.08
应收证券清算款	39,946,716.85
应收股利	441,000
应收利息	2,468,061.95
应收申购款	1,077,763.08
其他应收款	
买入返售证券	
待摊费用	

4、基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期内基金未主动投资权证, 也未在报告期末被动持有权证。报告期内因投资认股权和债券分离交易的可转换公司债所附认股权证信息如下:

权证代码	权证名称	数量	成本	期末市值
580013	武钢 CWB1	1,374,781	3,185,746.56	0.00

6、报告期末基金未持有资产支持证券。

合丰稳定基金

（一）报告期末基金资产组合（单位：元）

项目	金额	占基金总资产比例
股票	769,840,526.62	63.08%
债券	251,211,221.00	20.58%
银行存款和清算备付金	132,697,868.94	10.87%
权证	2,369,635.18	0.19%
其它资产	64,499,058.63	5.28%
合计	1,220,618,310.37	100.00%

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合（单位：元）

行 业	市 值	市值占净值比例
A 农、林、牧、渔业	20,930,740.02	1.88%
B 采掘业	0.00	0.00%
C 制造业	125,751,358.10	11.30%
C0 食品、饮料	14,499,304.00	1.30%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	12,870,960.60	1.16%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	47,404,200.00	4.26%
C5 电子	0.00	0.00%
C6 金属、非金属	0.00	0.00%
C7 机械、设备、仪表	38,876,905.60	3.49%
C8 医药、生物制品	12,099,987.90	1.09%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	67,314,232.03	6.05%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	176,820,010.97	15.88%
G 信息技术业	0.00	0.00%
H 批发和零售贸易	165,227,924.12	14.84%
I 金融、保险业	192,433,680.28	17.28%
J 房地产业	20,337,396.00	1.83%
K 社会服务业	1,025,185.10	0.09%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	0.00	0.00%
合计	769,840,526.62	69.14%

本基金投资稳定类行业股票市值合计占投资股票总市值的 84.58%。

（三）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细（单位：元）

股票代码	股票名称	数量	市值	市值占基金净值
600717	天津港	3,644,827	91,740,295.59	8.24%
600030	中信证券	1,112,692	58,939,295.24	5.29%

600859	王府井	1,051,578	51,685,058.70	4.64%
600036	招商银行	2,040,526	50,156,129.08	4.50%
600697	欧亚集团	2,377,720	48,291,493.20	4.34%
600143	金发科技	1,230,000	47,404,200.00	4.26%
000560	昆百大 A	4,007,286	40,112,932.86	3.60%
600009	上海机场	1,004,398	38,177,167.98	3.43%
600396	金山股份	1,680,655	34,503,847.15	3.10%
600000	浦发银行	901,684	32,992,617.56	2.96%
600900	长江电力	2,169,999	32,810,384.88	2.95%
600004	白云机场	1,707,309	31,755,947.40	2.85%
000001	深发展 A	1,006,920	27,710,438.40	2.49%
002024	苏宁电器	535,316	25,138,439.36	2.26%
002097	山河智能	349,814	24,626,905.60	2.21%
600015	华夏银行	1,880,000	22,635,200.00	2.03%
600467	好当家	1,653,297	20,930,740.02	1.88%
600376	天鸿宝业	547,440	20,337,396.00	1.83%
000848	承德露露	499,976	14,499,304.00	1.30%
600761	安徽合力	500,000	14,250,000.00	1.28%
600337	美克股份	579,773	12,870,960.60	1.16%
600201	金宇集团	999,999	12,099,987.90	1.09%
600897	厦门空港	430,000	7,576,600.00	0.68%
601006	大秦铁路	500,000	7,570,000.00	0.68%
002059	世博股份	126,410	1,025,185.10	0.09%

（四）报告期内股票投资组合的重大变动

1、报告期内累计买入占期初基金资产净值 2%以上的股票明细

股票代码	股票名称	累计买入金额	占期初净值比例
600030	中信证券	168,502,477.70	52.04%
600036	招商银行	159,283,252.87	49.19%
600195	中牧股份	153,209,483.94	47.32%
600428	中远航运	148,157,640.65	45.76%
600000	浦发银行	147,338,895.82	45.50%
600009	上海机场	130,711,067.38	40.37%
600900	长江电力	127,868,092.26	39.49%
601006	大秦铁路	126,206,691.82	38.98%
002024	苏宁电器	106,131,420.92	32.78%
600717	天津港	99,869,967.61	30.84%
600859	王府井	91,158,620.71	28.15%
600795	国电电力	88,119,168.23	27.21%
600016	民生银行	77,320,392.88	23.88%
601628	中国人寿	76,635,764.68	23.67%
600269	赣粤高速	76,424,037.66	23.60%

600143	金发科技	72,980,987.81	22.54%
600897	厦门空港	59,465,532.23	18.37%
600697	欧亚集团	56,650,166.42	17.50%
600350	山东高速	52,248,940.82	16.14%
000001	深发展 A	50,066,597.65	15.46%
600004	白云机场	48,004,930.86	14.83%
600467	好当家	46,165,324.88	14.26%
600371	万向德农	43,884,006.20	13.55%
600123	兰花科创	43,673,785.85	13.49%
000488	晨鸣纸业	42,224,836.65	13.04%
600519	贵州茅台	42,067,693.81	12.99%
600500	中化国际	42,066,743.15	12.99%
000560	昆百大 A	38,828,083.54	11.99%
000069	华侨城 A	38,499,748.20	11.89%
000063	中兴通讯	38,151,833.43	11.78%
600035	楚天高速	37,710,450.89	11.65%
600694	大商股份	36,813,535.46	11.37%
600086	东方金钰	36,001,430.70	11.12%
600809	山西汾酒	35,855,601.38	11.07%
601318	中国平安	35,242,955.90	10.88%
600396	金山股份	35,198,139.56	10.87%
000039	中集集团	32,670,103.89	10.09%
600426	华鲁恒升	31,633,521.65	9.77%
000410	沈阳机床	30,888,539.34	9.54%
600978	宜华木业	29,473,853.14	9.10%
000848	承德露露	27,416,316.17	8.47%
600201	金宇集团	26,746,186.50	8.26%
600219	南山铝业	26,101,624.59	8.06%
600015	华夏银行	24,841,948.68	7.67%
000623	吉林敖东	23,421,659.31	7.23%
600376	天鸿宝业	23,116,481.39	7.14%
002097	山河智能	23,064,899.43	7.12%
601988	中国银行	22,714,853.68	7.02%
600029	南方航空	22,635,176.05	6.99%
000900	现代投资	22,533,310.38	6.96%
002025	航天电器	21,782,244.24	6.73%
601398	工商银行	20,302,520.01	6.27%
601001	大同煤业	19,350,215.12	5.98%
600005	武钢股份	19,267,445.27	5.95%
600236	桂冠电力	18,684,656.31	5.77%
000792	盐湖钾肥	18,037,961.35	5.57%

000860	顺鑫农业	17,292,810.38	5.34%
600583	海油工程	16,351,781.75	5.05%
600361	华联综超	16,074,990.63	4.96%
601111	中国国航	15,166,261.28	4.68%
600750	江中药业	14,759,550.00	4.56%
601166	兴业银行	14,728,805.71	4.55%
600337	美克股份	13,807,429.91	4.26%
000031	中粮地产	13,245,482.15	4.09%
600785	新华百货	12,053,050.08	3.72%
600887	伊利股份	9,643,618.36	2.98%
600790	轻纺城	9,393,745.41	2.90%

2、报告期内累计卖出占期初基金资产净值 2%以上的股票明细

股票代码	股票名称	累计卖出金额	占期初净值比例
600030	中信证券	202,230,426.08	62.46%
600428	中远航运	185,975,627.32	57.44%
601006	大秦铁路	180,227,737.06	55.66%
600195	中牧股份	178,795,703.50	55.22%
600036	招商银行	169,980,160.15	52.50%
600000	浦发银行	144,852,822.78	44.74%
002024	苏宁电器	132,959,421.96	41.06%
600795	国电电力	110,566,328.36	34.15%
600269	赣粤高速	101,052,627.07	31.21%
600009	上海机场	98,434,359.40	30.40%
600016	民生银行	96,575,350.01	29.83%
600900	长江电力	93,829,537.01	28.98%
600859	王府井	77,993,656.40	24.09%
600897	厦门空港	70,866,992.97	21.89%
601628	中国人寿	67,887,804.74	20.97%
600519	贵州茅台	56,514,447.88	17.45%
600809	山西汾酒	53,876,836.41	16.64%
600350	山东高速	53,565,936.94	16.54%
000488	晨鸣纸业	51,120,661.67	15.79%
000069	华侨城 A	48,703,228.97	15.04%
600717	天津港	46,779,773.93	14.45%
600361	华联综超	44,913,988.92	13.87%
600978	宜华木业	44,696,183.92	13.80%
600500	中化国际	44,613,694.21	13.78%
600371	万向德农	43,868,787.05	13.55%
000001	深发展 A	42,670,156.78	13.18%
601318	中国平安	41,273,948.75	12.75%

000063	中兴通讯	39,767,689.99	12.28%
000623	吉林敖东	38,561,693.76	11.91%
600694	大商股份	37,840,894.01	11.69%
600123	兰花科创	36,318,972.87	11.22%
600035	楚天高速	36,091,265.52	11.15%
600143	金发科技	34,139,055.16	10.54%
600086	东方金钰	31,968,598.06	9.87%
600426	华鲁恒升	31,357,933.08	9.68%
000039	中集集团	30,854,082.90	9.53%
000410	沈阳机床	30,425,088.62	9.40%
600236	桂冠电力	28,252,453.37	8.73%
600219	南山铝业	27,880,669.39	8.61%
600467	好当家	26,972,899.75	8.33%
000848	承德露露	26,907,442.14	8.31%
601398	工商银行	26,633,318.24	8.23%
601988	中国银行	26,126,711.11	8.07%
600004	白云机场	23,934,903.12	7.39%
000900	现代投资	23,153,580.76	7.15%
002025	航天电器	22,993,720.46	7.10%
600029	南方航空	20,937,041.58	6.47%
000829	天音控股	19,409,874.90	5.99%
000792	盐湖钾肥	19,283,342.57	5.96%
600005	武钢股份	19,161,421.06	5.92%
601001	大同煤业	19,039,150.24	5.88%
600887	伊利股份	17,064,159.08	5.27%
600750	江中药业	16,889,229.48	5.22%
601166	兴业银行	16,706,627.55	5.16%
000860	顺鑫农业	16,415,349.79	5.07%
601111	中国国航	16,349,645.59	5.05%
600697	欧亚集团	15,751,528.37	4.86%
600583	海油工程	15,652,690.31	4.83%
600201	金宇集团	15,620,577.89	4.82%
000560	昆百大 A	13,456,154.20	4.16%
000031	中粮地产	12,874,174.66	3.98%
600785	新华百货	10,806,300.95	3.34%
600790	轻纺城	9,355,559.42	2.89%
600298	安琪酵母	8,358,797.39	2.58%

3、报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

报告期内买入股票成本总额	3,353,426,811.21
报告期内卖出股票收入总额	3,356,823,209.87

(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合 (单位: 元)

债券类别	债券市值	市值占净值比例
国家债券投资	131,706,221.00	11.83%
央行票据投资	69,530,000.00	6.24%
企业债券投资		
金融债券投资	49,975,000.00	4.49%
可转换债投资		
合计	251,211,221.00	22.56%

(六) 报告期末按市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)

债券名称	市 值	市值占净值比例
07 农发 01	49,975,000.00	4.49%
02 国债(10)	35,548,400.00	3.19%
07 央票 49	29,802,000.00	2.68%
02 国债(14)	20,050,000.00	1.80%
银行间 05 国债 07	19,967,000.00	1.79%

(七) 报告期末基金持有的权证投资明细 (单位: 元)

权证代码	权证名称	数量	成本	期末市值
031003	深发 SFC1	100,692	0.00	1,534,546.08
031004	深发 SFC2	50,346	0.00	835,089.10

(八) 投资组合报告附注

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股票库。

3、其他资产

项目	金额
交易保证金	1,147,375.45
应收证券清算款	60,019,865.47
应收股利	0.00
应收利息	2,894,704.20
应收申购款	437,113.51
其它应收款	0.00
买入返售证券	0.00
待摊费用	0.00

4、基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期内基金未主动投资权证,报告期内因股权分置改革获赠的权证信息如下:

权证代码	权证名称	数量	成本	期末市值
031003	深发 SFC1	100,692	0.00	1,534,546.08

031004	深发 SFC2	50,346	0.00	835,089.10
--------	---------	--------	------	------------

6、报告期末基金未持有资产支持证券。

七、基金份额持有人情况

基金名称	基金持有人户数 (户)	户均持有份额 (万份)	基金持有人份额结构			
			个人持有份额(亿份)	占总份额比例	机构持有份额(亿份)	占总份额比例
合丰成长	26,481	27,732.31	536,306,931.09	73.03%	198,072,297.93	26.97%
合丰周期	27,565	26,193.31	683,425,272.50	94.65%	38,593,379.06	5.35%
合丰稳定	28,307	29,657.23	743,473,798.39	88.56%	96,033,316.78	11.44%

经本基金管理人统计,截止 2007 年 6 月 30 日,本公司员工持有本基金情况如下:

基金名称	本公司员工持有该只基金总份额	占该只基金份额比例
合丰成长	91,355.70	0.012439%
合丰周期	399.11	0.000055%
合丰稳定	1,652.88	0.000196%

八、开放式基金份额变动情况

	成长基金	周期基金	稳定基金
合同生效日基金份额	1,021,690,071.80	627,160,140.84	981,417,134.10
期初基金份额	333,316,149.74	109,580,643.98	140,258,776.64
期间总申购份额	1,884,245,791.78	2,569,716,831.49	2,319,366,950.58
期间总赎回份额	1,483,182,712.50	1,957,278,823.91	1,620,118,612.05
期末基金份额	734,379,229.02	722,018,651.56	839,507,115.17

九、重大事件揭示

- (一) 本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。
- (二) 本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。
- (三) 本报告期本基金投资策略未有重大改变。
- (四) 基金收益分配事项:

本公司于 2007 年 2 月 6 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》与公司网站发布分红公告,泰达荷银稳定类行业证券投资基金(合丰稳定基金)向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.3 元,权益登记日、除息日为 2007 年 2 月 8 日。

本公司于 2007 年 3 月 10 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》与公司网站发布分红公告,泰达荷银稳定类行业证券投资基金(合丰稳定基金)向

基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.9 元，权益登记日、除息日为 2007 年 3 月 13 日。

（五）本报告期本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

（六）本报告期本基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形。

（七）基金管理人办公地址、注册地址及客服电话号码的更新

本基金管理人已于 2007 年 1 月 24 日发布变更公司住所的公告，公司住所变更为：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层。本公司住所变更经中国证监会证监基金字[2006]258 号文审核批准，并已办理完毕相关工商变更登记手续。

本基金管理人已于 2007 年 3 月 28 日发布变更客服电话号码的公告，新启用的全国统一客服电话为 400 698 8888（免长话费）。

本基金管理人已于 2007 年 6 月 19 日发布增加客服电话号码的公告，新增加的客服电话为 010-66555662。

（八）基金管理人、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：

本基金管理人已于 2007 年 1 月 18 日发布关于副总经理任职的公告，经泰达荷银基金管理有限公司董事会会议审议通过，并经中国证监会证监基金字[2007]4 号文核准，泰达荷银基金管理有限公司聘任傅国庆先生担任公司副总经理。

本基金管理人已于 2007 年 2 月 3 日发布关于副总经理任职的公告，经泰达荷银基金管理有限公司董事会会议审议通过，并经中国证监会证监基金字[2007]24 号文核准，泰达荷银基金管理有限公司聘任许苓女士、雷学军先生担任公司副总经理。

本基金管理人已于 2007 年 2 月 5 日发布关于总经理变更的公告，经泰达荷银基金管理有限公司董事会会议审议通过，并经中国证监会证监基金字[2007]24 号文核准，泰达荷银基金管理有限公司聘任缪钧伟先生担任公司总经理。

本基金管理人已于 2007 年 6 月 2 日发布关于副总经理变更的公告，经泰达荷银基金管理有限公司董事会批准，许苓女士因个人原因不再担任泰达荷银基金管理有限公司副总经理职务。

该事项已按规定报告中国证监会基金监管部与北京证监局。

（九）对公司监事的更新

根据公司 2007 年度第 1 次股东会议决议，同意陈铁风先生、李克吾女士辞去公司监事的请求，并选举潘孝祖先生、王泉先生为公司监事。

（十）对本基金基金经理的更新

本基金管理人已于 2007 年 3 月 20 日发布关于调整基金经理的公告，聘任魏延军先生担任泰达荷银价值优化型周期类行业证券投资基金（合丰周期）的基金经理，与温震宇先生共同管理该只基金。

本基金管理人已于 2007 年 4 月 30 日发布关于变更基金经理的公告，温震宇先生因个人工作变动的原因不再担任合丰周期基金基金经理。魏延军先生将继续担任泰达荷银价值优化型周期类行业基金的基金经理。

上述基金经理的变更事项已报备北京证监局备案。

（十一）对本系列基金价外法计算方法的更新：

本基金管理人已于 2007 年 4 月 30 日发布了《关于调整泰达荷银价值优化型系列行业类别证券投资基金申购费用及申购份额计算方法的公告》，自 2007 年 5 月 8 日起，对本系列基金的申购费用及申购份额统一调整为“外扣法”计算，具体计算公式如下：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

基金申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金单位净值

（十二）对基金托管人的更新

在“四、基金托管人报告”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。

（十三）席位交易情况

根据中国证监会的相关规定，本公司通过比较多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，本系列基金租用了下表列示的券商席位进行交易。2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日本系列基金通过各证券经营机构的席位买卖证券的交易量及支付的佣金如下：

合丰成长基金

	席位 数量	买卖股票成交量		买卖债券成交量		债券回购成交量		权证成交量		佣金	
		成交量	占本期成交比例	成交量	占本期成交比例	成交量	占本期成交比例	成交量	占本期成交比例	佣金	占本期佣金比例
国泰君安	1	419,390,549.49	7.15%	24,171,023.60	10.72%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	343,682.20	7.28%
申银万国	1	1,252,102,355.66	21.33%	30,288,327.70	13.44%	31,800,000.00	100.00%	0.00	0.00%	1,026,301.05	21.74%
海通证券	1	457,333,410.26	7.79%	103,225,254.70	45.80%	0.00	0.00%	1,036,740.48	100.00%	373,978.69	7.92%
湘财证券	2	692,759,469.36	11.80%	16,955,177.30	7.52%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	553,544.11	11.73%
平安证券	1	766,234,483.25	13.06%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	599,583.66	12.70%
兴业证券	1	741,345,403.06	12.63%	50,733,236.40	22.51%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	607,387.21	12.87%
华泰证券	1	643,779,792.28	10.97%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	503,762.09	10.67%
国金证券	1	285,285,470.26	4.86%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	233,933.85	4.96%
中信证券	1	610,867,014.70	10.41%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	478,006.58	10.13%
合计	10	5,869,097,948.32	100.00%	225,373,019.70	100.00%	31,800,000.00	100.00%	1,036,740.48	100.00%	4,720,179.44	100.00%

合丰周期基金

	席位 数量	买卖股票成交量		买卖债券成交量		债券回购成交量		权证成交量		佣金	
		成交量	占本期 成交比 例	成交量	占本期成 交比例	成交量	占本期成 交比例	成交量	占本期成 交比例	佣金	占本期佣 金比例
湘财证 券	1	958,436,648.97	11.94%	19,445,721.20	8.90%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	785,720.54	12.15%
申银万 国	1	1,222,835,730.81	15.24%	1,656,512.50	0.76%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	956,875.78	14.80%
东海证 券	1	582,120,580.58	7.25%	74,330,380.80	34.02%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	476,585.48	7.37%
招商证 券	1	772,231,780.50	9.62%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	604,275.52	9.34%
中信证 券	2	1,585,003,910.85	19.75%	50,817,365.90	23.26%	26,000,000.00	19.85%	0.00	0.00%	1,292,766.62	19.99%
高华证 券	1	2,091,242,343.66	26.06%	72,269,411.90	33.07%	105,000,000.00	80.15%	8,897,379.86	100.00%	1,713,986.87	26.50%
中金证 券	1	813,944,586.51	10.14%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	636,916.36	9.85%
合计	8	8,025,815,581.88	100.00%	218,519,392.30	100.00%	131,000,000.00	100.00%	8,897,379.86	100.00%	6,467,127.17	100.00%

合丰稳定基金

	席位 数量	买卖股票成交量		买卖债券成交量		债券回购成交量		权证成交量		佣金	
		成交量	占本期成 交比例	成交量	占本期 成交比 例	成交量	占本期 成交比 例	成交量	占本期成 交比例	佣金	占本期佣 金比例
湘财证 券	2	984,487,574.65	14.68%	3,623,053.30	2.49%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	793,489.50	14.55%
国泰君 安	1	1,616,705,966.05	24.11%	65,611,844.40	45.14%	32,000,000.00	30.92%	0.00	0.00%	1,324,873.20	24.29%
中信建 投	1	1,641,382,760.55	24.47%	43,056,789.10	29.63%	15,000,000.00	14.49%	0.00	0.00%	1,345,415.30	24.66%
中金公 司	1	737,843,076.32	11.00%	16,010,833.50	11.02%	56,500,000.00	54.59%	0.00	0.00%	604,586.02	11.08%
光大	1	914,530,761.24	13.64%	17,033,495.90	11.72%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	749,739.76	13.74%

证 券											
银 河 证 券	1	468,255,016.07	6.98%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	366,411.82	6.72%
西 部 证 券	1	54,151,649.39	0.81%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	44,403.90	0.81%
广 州 证 券	1	289,041,496.30	4.31%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	226,177.15	4.15%
合 计	9	6,706,398,300.57	100.00%	145,336,016.20	100.00%	103,500,000.00	100.00%	0.00	0.00%	5,455,096.65	100.00%

十、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

（二）存放地点：基金管理人和基金托管人的住所

（三）查阅方式：基金投资者可在营业时间免费查阅，或基金投资者也可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）或登陆本基金管理人互联网网址（<http://www.aateda.com>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泰达荷银基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-698-8888 或 010-66555662

网址：<http://www.aateda.com>

泰达荷银基金管理有限公司

2007年8月29日