

泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金

【2012】第 季度报告

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2012年4月24日

§ 5 投资组合报告

5.1 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	918,785,198.78	62.38
其中:股票		918,785,198.78	62.38
2	固定收益投资	339,938,168.00	23.08
其中:债券		339,938,168.00	23.08
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
其中:买断式回购的买入返售金融资产		-	-
5	银行存款和结算备付金合计	202,399,627.43	13.74
6	其他资产	11,823,388.11	0.80
7	合计	1,472,946,382.32	100.00

5.2 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	96,979,470.06	6.66
B	采掘业	-	-
C	制造业	581,173,836.54	39.91
CO	食品、饮料	22,227,273.88	1.53
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	11,665,217.73	0.80
C5	电子	152,106,533.75	10.45
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	354,834,564.32	24.37
C8	医药、生物制品	40,340,242.86	2.77
C09	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	177,754,180.22	12.21
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	54,645,761.76	3.75
L	传播与文化产业	8,231,950.20	0.57
M	综合类	-	-
合计		918,785,198.78	63.10

5.3 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)
1	000063	中兴通讯	4,864,688
2	600066	宇通客车	3,072,210
3	000527	美的电器	5,588,517
4	000051	格力电器	3,241,675
5	000098	隆平高科	2,588,554
6	600498	烽火通信	2,155,572
7	600312	华平电气	6,785,143
8	600866	金发科技	5,794,614
9	002273	水晶光电	1,301,685
10	000249	兆驰股份	3,419,206

5.4 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	58,987,168.00	4.05
2	央行票据	9,674,000.00	0.66
3	金融债券	241,743,000.00	16.60
其中:政策性金融债		241,743,000.00	16.60
4	企业债券	19,506,000.00	1.34
5	企业短期融资券	10,028,000.00	0.69
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	339,938,168.00	23.35

5.5 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			
序号	债券代码	债券名称	数量(张)
1	110235	11国开35	500,000
2	110410	11农发10	500,000
3	020409	11国债04	500,000
4	110240	11国开40	400,000
5	110238	11国开38	300,000

5.6 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			
本基金本报告期末未持有资产支持证券。			
5.7 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权证投资明细			
本基金本报告期末未持有权证。			
5.8 投资组合报告附注			
5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。			
5.8.2 本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。			
5.8.3 其他资产构成			
序号	名称	金额(元)	
1	存出保证金	1,916,321.03	
2	应收证券清算款	-	
3	应收股利	-	
4	应收利息	9,496,521.86	
5	应收申购款	410,545.22	
6	其他应收款	-	
7	待摊费用	-	
8	其他	-	
9	合计	11,823,388.11	

5.8.4 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。

5.8.5 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。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
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。

6 开放式基金份额变动			
单位:份			
本报告期期初基金份额总额	1,902,666,972.82		
本报告期基金份额申购总额	41,913,462.63		
减:本报告期基金份额赎回总额	162,040,777.86		
本报告期基金份额净变动额	162,040,777.86		
本报告期末基金份额总额	1,782,535,657.59		

§ 7 备查文件目录

1. 备查文件目录
2. 基金管理人披露泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金的说明
3. 泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金基金合同
4. 泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金招募说明书
5. 泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金托管协议
6. 基金管理人及基金托管人的住所
7. 查阅方式
8. 投资者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》)或登录基金管理人互联网网址: <http://www.mfcteda.com> 查阅。

泰达宏利基金管理有限公司
2012年4月24日

泰达宏利价值优化型周期类行业证券投资基金

【2012】第 季度报告

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2012年4月24日

§ 5 投资组合报告

5.1 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	442,201,439.09	66.89
其中:股票		442,201,439.09	66.89
2	固定收益投资	139,780,600.00	21.14
其中:债券		139,780,600.00	21.14
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
其中:买断式回购的买入返售金融资产		-	-
5	银行存款和结算备付金合计	56,540,851.76	8.55
6	其他资产	22,561,207.14	3.41
7	合计	661,084,097.99	100.00

5.2 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	-	-
B	采掘业	20,975,227.82	3.19
C	制造业	273,826,232.34	41.65
CO	食品、饮料	216,676,695.31	4.20
C1	纺织、服装、皮毛	3,165,112.61	0.48
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	18,093,342.43	2.75
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	62,241,771.10	9.47
C7	机械、设备、仪表	162,709,310.89	24.75
C8	医药、生物制品	-	-
C09	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,440,314.73	3.11
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	6,768,644.58	1.03
H	批发和零售贸易	21,860,572.50	3.33
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	74,464,432.61	11.33
K	社会服务业	23,866,014.51	3.63
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
合计		442,201,439.09	67.27

5.3 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)
1	000041	冀东水泥	1,916,053
2	600066	宇通客车	1,163,233
3	600138	中智集团	1,481,441
4	000224	亿纬锂能	2,242,110
5	600048	保利地产	1,897,867
6	002146	荣盛发展	1,987,176
7	600970	中材国际	1,022,527
8	600312	华平电气	2,384,510
9	600104	上汽集团	1,210,628
10	000250	联化科技	795,529

5.4 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	59,529,600.00	9.06
2	央行票据	19,882,000.00	3.02
3	金融债券	60,330,000.00	9.18
其中:政策性金融债		60,330,000.00	9.18
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	139,780,600.00	21.26

5.5 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			
序号	债券代码	债券名称	数量(张)
1	110216	11国开16	400,000
2	020049	11国债04	340,000
3	110305	11国债05	200,000
4	030002	03国债02	200,000
5	1001032	10央票32	200,000

5.6 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			
本基金本报告期末未持有资产支持证券。			
5.7 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权证投资明细			
本基金本报告期末未持有权证。			
5.8 投资组合报告附注			
5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。			
5.8.2 本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。			
5.8.3 其他资产构成			
序号	名称	金额(元)	
1	存出保证金	1,250,000.00	
2	应收证券清算款	18,454,331.26	
3	应收股利	-	
4	应收利息	2,743,478.12	
5	应收申购款	113,397.76	
6	其他应收款	-	
7	待摊费用	-	
8	其他	-	
9	合计	22,561,207.14	

5.8.4 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。

5.8.5 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。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
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。

6 开放式基金份额变动			
单位:份			
本报告期期初基金份额总额	876,467,734.38		
本报告期基金份额申购总额	17,616,194.74		
减:本报告期基金份额赎回总额	77,405,235.33		
本报告期基金份额净变动额	816,678,693.77		

7 备查文件目录			
序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	8,802,900.00	5.12
2	央行票据	29,823,000.00	17.36
3	金融债券	-	-
其中:政策性金融债		-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	39,162,962.40	22.80

5.5 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			
序号	债券代码	债券名称	数量(张)
1	1001032	10央票32	300,000
2	020049	11国债04	340,000
3	110305	11国债05	200,000
4	030002	03国债02	200,000
5	1001032	10央票32	200,000

5.6 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			
本基金本报告期末未持有资产支持证券。			
5.7 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权证投资明细			
本基金本报告期末未持有权证。			
5.8 投资组合报告附注			
5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。			
5.8.2 本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。			
5.8.3 其他资产构成			
序号	名称	金额(元)	
1	存出保证金	1,250,000.00	
2	应收证券清算款	18,454,331.26	
3	应收股利	-	
4	应收利息	2,743,478.12	
5	应收申购款	113,397.76	
6	其他应收款	-	
7	待摊费用	-	
8	其他	-	
9	合计	22,561,207.14	

5.8.4 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。			
5.8.5 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。			
5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分			
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。			

6 开放式基金份额变动			
单位:份			
本报告期期初基金份额总额	876,467,734.38		
本报告期基金份额申购总额	17,616,194.74		
减:本报告期基金份额赎回总额	77,405,235.33		
本报告期基金份额净变动额	816,678,693.77		

7 备查文件目录			
序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	8,802,900.00	5.12
2	央行票据	29,823,000.00	17.36
3	金融债券	-	-
其中:政策性金融债		-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-</