

2012年6月9日 星期六

(上接B027版)

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

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	000003	中兴通讯	4,864,688	79,926,823.84	5.49
2	600066	宇通客车	3,072,210	74,623,980.90	3.12
3	000571	美的电器	5,588,517	73,321,343.04	3.04
4	000651	格力电器	3,241,675	65,903,252.75	4.53
5	000998	深平高科	2,588,554	60,127,476.84	4.17
6	600498	烽火通信	2,155,572	57,596,883.84	3.96
7	600122	平高电气	6,785,143	56,316,686.90	3.87
8	600686	金龙汽车	5,794,614	43,317,551.14	2.99
9	002273	水晶光电	1,301,685	39,141,667.95	2.69
10	002429	歌尔股份	3,419,206	35,422,974.16	2.43

四)报告期末按券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	国债	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	企业短期融资券	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

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	110235	11国开35	500,000	50,720,000.00	3.48
2	110410	11农发10	500,000	50,645,000.00	3.48
3	020049	11贴息04	500,000	48,905,000.00	3.36
4	110240	11国开40	400,000	40,572,000.00	2.79
5	110238	11国开38	300,000	30,903,000.00	2.12

六)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、处罚的情况。

2.本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	1,916,321.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	9,496,521.86
4	应收利息	410,545.22
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,823,388.11

4.报告期末本基金持有处于转股期的可转换债券。5.报告期末前十名股票中本存在流通受限情况。

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。

泰达周期基金

单位:元

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	货币市场基金	-	-
4	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

C)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	20,975,227.82	3.19
C	制造业	273,826,232.34	41.65
C0	食品、饮料	27,616,695.31	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	-	-
C9	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

D)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	20,975,227.82	3.19
C	制造业	273,826,232.34	41.65
C0	食品、饮料	27,616,695.31	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	-	-
C9	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

E)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	20,975,227.82	3.19
C	制造业	273,826,232.34	41.65
C0	食品、饮料	27,616,695.31	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	-	