

[2012] 第四季度报告

本报告期期初基金份额总额	277,315,356.82
本报告期基金总申购份额	12,474,347.09
减：本报告期基金总赎回份额	15,866,908.79
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	273,922,795.12

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录
 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及托管协议文件。
 2、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公告。
 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招募说明书。
 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托管协议。
 7.2 存放地点
 基金管理人及基金托管人的住所。
 7.3 查阅方式
 投资人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站：<http://www.mfcteda.com> 查阅。

泰达宏利基金管理有限公司

基金合同全文。
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、稳健类行业证券投资基金招募说明书；
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、稳健类行业证券投资基金托管协议；
7.2 存放地点
基金管理人及基金托管人的住所。
7.3 查阅方式
投资人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站（<http://www.mfcteda.com>）查阅。

泰达宏利基金管理有限公司
2013年1月22日

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	34,981,507.50	5.72		
2	央行票据	—	—		
3	金融债券	89,537,000.00	14.63		
	其中：政策性金融债	89,537,000.00	14.63		
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	124,518,507.50	20.35		
5.5 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	110216	11国开16	400,000	40,036,000.00	6.54
2	120401	12农发01	300,000	29,541,000.00	4.83
3	020052	12国债02	300,000	29,400,000.00	4.81
4	120222	12国开22	200,000	19,960,000.00	3.26
5	010308	03国债08	29,800	2,990,430.00	0.49
5.6 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有资产支持投资。					
5.7 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证券均未超出基金合同规定的各券种投资。					

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	17,687,747.61
3	应收股利	-
4	应收利息	2,681,763.99
5	应收申购款	81,735.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,701,246.67

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未存在流通受限情况。

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

本报告期初基金份额总额	733,587,088.30
本报告期基金总申购份额	20,878,402.22
减:本报告期基金总赎回份额	26,497,518.27
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	727,967,972.25

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准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设立的文件;

2、中国证监会核准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募集的基金合同、基金托管协议;

基金合同全文。
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、稳健类行业证券投资基金招募说明书；
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、稳健类行业证券投资基金托管协议；
7.2 存放地点
基金管理人及基金托管人的住所。
7.3 查阅方式
投资人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站（<http://www.mfcteda.com>）查阅。

泰达宏利基金管理有限公司
2013年1月22日