

# 泰信三天收益开放二证券投资基金

## 更新招募说明书摘要

2009年第2号

### 十二、基金的投资组合报告(截至报告期末)

本基金属于低风险、预期收益率低、流动性较强的证券投资基金品种。  
 本基金管理人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法律责任。  
 本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同已于2009年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。  
 ①截至2009年6月30日基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,329,735,503.69	51.02
	其中:债券	1,329,735,503.69	51.02
	资产支持证券	0	0.00
2	买入返售金融资产	790,000,000.00	30.31
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	0	0.00
3	银行存款和备付金合计	333,358,826.33	12.79
4	其他资产	153,460,962.29	5.89
	合计	2,606,555,292.31	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期末债券回购融资余额	1,498,595,895.50	11.13
	其中:买断式回购融资	0	0.00
2	报告期末债券回购融资余额	0	0.00
	其中:买断式回购融资	0	0.00

注:1.上表中报告期末债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数,报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例在报告期内每日融资余额占基金资产净值比例最高值和最低值之间。  
 2.本报告期末基金总资产与基金净资产的差额系未通过托管的20%。  
 ②截至2009年6月30日基金组合仓位情况

投资组合平均剩余期限基本情况	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	51
报告期末投资组合平均剩余期限最高值	69
报告期末投资组合平均剩余期限最低值	39
报告期内无投资组合平均剩余期限超过180天的情况	
报告期末投资组合平均剩余期限分布比例	

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限资产占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	52.54	7.43
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天<=1-60天	19.41	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60天<=1-90天	13.64	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90天<=1-180天	6.05	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.11	0.00
5	180天<=1-397天(含)	9.58	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
	合计	101.22	7.43

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国债	688,624,945.24	28.00
2	央行票据	393,044,298.35	16.22
3	金融债	210,817,117.77	8.70
	其中:政策性金融债	248,066,260.10	10.24
4	企业债	248,066,260.10	10.24
5	企业短期融资券	0	0.00
6	其他	0	0.00
7	合计	1,329,735,503.69	54.87
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债	26,900,539.30	1.11

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	080192	2,900,000	11.94
2	080104	2,000,000	8.24
3	040705	1,822,180.58	7.52
4	040214	1,000,000	4.15
5	090112	1,000,000	4.13
6	080112	1,000,000	4.11
7	080167	800,000	3.32
8	080191	700,000	2.92
9	080415	600,000	2.49
10	020208	500,000	2.06

序号	债券名称	债券数量(张)	持仓成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	080192	92	299,335,480.91	11.94
2	080104	104	200,000,000.00	8.24
3	040705	04	182,221,80.58	7.52
4	040214	04	100,000,000.00	4.15
5	090112	09	99,977,282.73	4.13
6	080112	112	99,709,283.73	4.11
7	080167	08	80,455,388.23	3.32
8	080191	08	70,659,800.40	2.92
9	080415	08	60,268,116.5	2.49
10	020208	02	50,036,969.15	2.06

序号	债券名称	债券数量(张)	持仓成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	080192	92	299,335,480.91	11.94
2	080104	104	200,000,000.00	8.24
3	040705	04	182,221,80.58	7.52
4	040214	04	100,000,000.00	4.15
5	090112	09	99,977,282.73	4.13
6	080112	112	99,709,283.73	4.11
7	080167	08	80,455,388.23	3.32
8	080191	08	70,659,800.40	2.92
9	080415	08	60,268,116.5	2.49
10	020208	02	50,036,969.15	2.06

序号	债券名称	债券数量(张)	持仓成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	080192	92	299,335,480.91	11.94
2	080104	104	200,000,000.00	8.24
3	040705	04	182,221,80.58	7.52
4	040214	04	100,000,000.00	4.15
5	090112	09	99,977,282.73	4.13
6	080112	112	99,709,283.73	4.11
7	080167	08	80,455,388.23	3.32
8	080191	08	70,659,800.40	2.92
9	080415	08	60,268,116.5	2.49
10	020208	02	50,036,969.15	2.06

序号	债券名称	债券数量(张)	持仓成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	080192	92	299,335,480.91	11.94
2	080104	104	200,000,000.00	8.24
3	040705	04	182,221,80.58	7.52
4	040214	04	100,000,000.00	4.15
5	090112	09	99,977,282.73	4.13
6	080112	112	99,709,283.73	4.11
7	080167	08	80,455,388.23	3.32
8	080191	08	70,659,800.40	2.92
9	080415	08	60,268,116.5	2.49
10	020208	02	50,036,969.15	2.06

序号	债券名称	债券数量(张)	持仓成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	080192	92	299,335,480.91	11.94
2	080104	104	200,000,000.00	8.24
3	040705	04	182,221,80.58	7.52
4	040214	04	100,000,000.00	4.15
5	090112	09	99,977,282.73	4.13
6	080112	112	99,709,283.73	4.11
7	080167	08	80,455,388.23	3.32
8	080191	08	70,659,800.40	2.92
9	080415	08	60,268,116.5	2.49
10	020208	02	50,036,969.15	2.06

序号	债券名称	债券数量(张)	持仓成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	080192	92	299,335,480.91	11.94
2	080104	104	200,000,000.00	8.24
3	040705	04	182,221,80.58	7.52
4	040214	04	100,000,000.00	4.15
5	090112	09	99,977,282.73	4.13
6	080112	112	99,709,283.73	4.11
7	080167	08	80,455,388.23	3.32
8	080191	08	70,659,800.40	2.92
9	080415	08	60,268,116.5	2.49
10	020208	02	50,036,969.15	2.06

序号	债券名称	债券数量(张)	持仓成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	080192	92	299,335,480.91	11.94
2	080104	104	200,000,000.00	8.24
3	040705	04	182,221,80.58	7.52
4	040214	04	100,000,000.00	4.15
5	090112	09	99,977,282.73	4.13
6	080112	112	99,709,283.73	4.11
7	080167	08	80,455,388.23	3.32
8	080191	08	70,659,800.40	2.92
9	080415	08	60,268,116.5	2.49
10	020208	02	50,036,969.15	2.06

序号	债券名称	债券数量(张)	持仓成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	080192	92	299,335,480.91	11.94
2	080104	104	200,000,000.00	8.24
3	040705	04	182,221,80.58	7.52
4	040214	04	100,000,000.00	4.15
5	090112	09	99,977,282.73	4.13
6	080112	112	99,709,283.73	4.11
7	080167	08	80,455,388.23	3.32
8	080191	08	70,659,800.40	2.92
9	080415	08	60,268,116.5	2.49
10	020208	02	50,036,969.15	2.06

序号	债券名称	债券数量(张)	持仓成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	080192	92	299,335,480.91	11.94
2	080104	104	200,000,000.00	8.24
3	040705	04	182,221,80.58	7.52
4	040214	04	100,000,000.00	4.15
5	090112	09	99,977,282.73	4.13
6	080112	112	99,709,283.73	4.11
7	080167	08	80,455,388.23	3.32
8	080191	08	70,659,800.40	2.92
9	080415	08	60,268,116.5	2.49
10	020208	02	50,036,969.15	2.06

序号	债券名称	债券数量(张)	持仓成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	080192	92	299,335,480.91	11.94
2	080104	104	200,000,000.00	8.24
3	040705	04	182,221,80.58	7.52
4	040214	04	100,000,000.00	4.15
5	090112	09	99,977,282.73	4.13
6	080112	112	99,709,283.73	4.11
7	080167	08	80,455,388.23	3.32
8	080191	08	70,659,800.40	2.92
9	080415	08	60,268,116.5	2.49
10	020208	02	50,036,969.15	2.06

序号	债券名称	债券数量(张)	持仓成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	080192	92	299,335,480.91	11.94
2	080104	104	200,000,000.00	8.24
3	040705	04	182,221,80.58	7.52
4	040214	04	100,000,000.00	4.15
5	090112	09	99,977,282.73	4.13
6	080112	112	99,709,283.73	4.11
7	080167	08	80,455,388.23	3.32
8	080191	08	70,659,800.40	2.92
9	080415	08	60,268,116.5	2.49
10	020208	02	50,036,969.15	2.06

序号	债券名称	债券数量(张)	持仓成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	080192	92	299,335,480.91	11.94
2	080104	104	200,000,000.00	8.24
3	040705	04	182,221,80.58	7.52
4	040214	04	100,000,000.00	4.15
5	090112	09	99,977,282.73	4.13
6	080112	112	99,709,283.73	4.11
7	080167	08	80,455,388.23	3.32
8	080191	08	70,659,800.40	2.92
9	080415	08	60,268,116.5	2.49
10	020208	02	50,036,969.1	