

(上接B34版)

(二)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、渔业	6,138,000.00	1.10
B	采矿业	6,123,112.56	1.10
C	制造业	438,916,831.15	78.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,458,316.00	1.16
F	批发和零售业	12,220,623.54	2.19
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,761,291.51	6.58
J	金融业	11,117,942.97	1.99
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,815,271.20	0.68
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,161,902.54	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	522,713,291.47	93.53

(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	300259	新飞科技	1,132,267	20,833,712.80	3.73
2	002475	立讯精密	588,469	19,666,633.98	3.52
3	002415	海康威视	841,348	19,334,177.04	3.46
4	002023	南都高能	1,058,449	18,141,815.86	3.25
5	600703	三安光电	705,884	17,498,864.36	3.13
6	600608	大族激光	1,264,630	17,009,898.70	3.04
7	002358	音容电气	788,440	16,951,460.00	3.03
8	002100	天康生物	1,325,217	16,896,516.75	3.02
9	000876	新希望	1,172,523	16,802,254.59	3.01
10	002508	老板电器	416,084	16,426,996.32	2.94
		合计		522,713,291.47	93.53

(四)报告期末未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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,998,000.00	3.58
	其中：政策性金融债	19,998,000.00	3.58
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	19,998,000.00	3.58

(五)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

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	130201	13国债01	200,000	19,998,000.00	3.58

注:以上为本基金报告期末持有的全部债券。

(一)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

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	130201	13国债01	200,000	19,998,000.00	3.58

注:以上为本基金报告期末持有的全部资产支持证券。

(二)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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0	无	0	0.00	0.00

注:以上为本基金报告期末持有的全部权证。

(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	300259	新飞科技	1,132,267	20,833,712.80	3.73
2	002475	立讯精密	588,469	19,666,633.98	3.52
3	002415	海康威视	841,348	19,334,177.04	3.46
4	002023	南都高能	1,058,449	18,141,815.86	3.25
5	600703	三安光电	705,884	17,498,864.36	3.13
6	600608	大族激光	1,264,630	17,009,898.70	3.04
7	002358	音容电气	788,440	16,951,460.00	3.03
8	002100	天康生物	1,325,217	16,896,516.75	3.02
9	000876	新希望	1,172,523	16,802,254.59	3.01
10	002508	老板电器	416,084	16,426,996.32	2.94
		合计		522,713,291.47	93.53

(四)报告期末未按券种分类的债券投资组合

4.本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细。

报告期末持有的处于转股期的可转换债券:

5.报告期末持有的因被冻结导致不能出售的股票:

本基金本报告期末无因被冻结导致不能出售的股票。

6.由于购买人的原因,分项之和与合计项之间可能存在差异。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2011年1月20日,基金合同生效以来的基金份额及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

(一)历史各时段的回报率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	基金净值增长率①	基金净值收益率②	比较基准收益率③	比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2011年1月26日至2011年12月31日	-19.80%	0.97%	-19.57%	1.15%	-0.23%	-0.18%
2012年1月1日至2012年12月31日	5.24%	1.15%	1.82%	1.19%	3.42%	-0.04%
2013年1月1日至2013年12月31日	14.10%	1.55%	9.00%	1.13%	5.10%	0.42%
本基金合同生效之日起至2013年12月31日	-3.70%	1.20%	-10.74%	1.16%	7.64%	0.10%

(二)泰达利源精选中低风险债券型基金的历史走势对比图

(2011年1月26日至2013年12月31日)

注:以上数据来自巨潮资讯网。

本基金合同生效以来的基金份额及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

(一)历史各时段的回报率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	基金净值增长率①	基金净值收益率②	比较基准收益率③	比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2011年1月26日至2011年12月31日	-19.80%	0.97%	-19.57%	1.15%	-0.23%	-0.18%
2012年1月1日至2012年12月31日	5.24%	1.15%	1.82%	1.19%	3.42%	-0.04%
2013年1月1日至2013年12月31日	14.10%	1.55%	9.00%	1.13%	5.10%	0.42%
本基金合同生效之日起至2013年12月31日	-3.70%	1.20%	-10.74%	1.16%	7.64%	0.10%

(二)泰达利源精选中低风险债券型基金的历史走势对比图

(2011年1月26日至2013年12月31日)

注:以上数据来自巨潮资讯网。

本基金合同生效以来的基金份额及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

(一)历史各时段的回报率