

(上接B90版)
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明细(单位:元)

| 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 | 000008 | 神州高铁 | 940,442 | 27,921,722.98 | 6.84 |
| 2 | 300005 | 探路者 | 872,490 | 25,703,555.40 | 6.30 |
| 3 | 002364 | 中恒电气 | 804,399 | 23,439,421.53 | 5.74 |
| 4 | 002285 | 世联行 | 602,341 | 23,358,783.98 | 5.72 |
| 5 | 002319 | 歌尔电子 | 721,214 | 16,912,468.30 | 4.14 |
| 6 | 002363 | 隆基机械 | 511,135 | 16,848,103.75 | 4.04 |
| 7 | 300354 | 东华测试 | 262,890 | 16,357,015.80 | 4.01 |
| 8 | 600845 | 宝信软件 | 244,132 | 14,398,905.36 | 3.53 |
| 9 | 000021 | 京山轻机 | 773,930 | 12,212,615.40 | 2.99 |
| 10 | 300003 | 乐普医疗 | 333,400 | 12,009,068.00 | 2.94 |

4.报告期末按券种分类的债券投资组合(单位:元)

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国债 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 83,108,884.80 | 20.36 |
| | 其中:政策性金融债 | 83,108,884.80 | 20.36 |
| 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 | 83,108,884.80 | 20.36 |

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(单位:元)

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(元) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 110216 | 11国债16 | 300,000 | 30,027,000.00 | 7.36 |
| 2 | 120401 | 12国债01 | 300,000 | 29,568,000.00 | 7.24 |
| 3 | 010801 | 国开01 | 131,920 | 13,513,884.80 | 3.31 |
| 4 | 140213 | 14国债13 | 100,000 | 10,000,000.00 | 2.45 |

上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。
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
本基金本报告期末持有资产支持证券。
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贵金属投资明细
本基金本报告期末持有贵金属。
8.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
本基金本报告期末持有权证。
9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期无股指期货持仓和损益明细。
9.2本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期未投资股指期货。该策略符合基金合同的规定。
10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
10.1本期国债期货投资政策
本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。
10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。
10.3本期国债期货投资评价
本基金本报告期没有投资国债期货。
11.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在监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。
(2) 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 | 项目 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 445,908.89 |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,727,821.37 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 649,022.67 |
| 5 | 其他应收款 | 835,173.51 |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,658,826.44 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。
(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|---------------|--------------|----------|
| 1 | 000008 | 神州高铁 | 27,921,722.98 | 6.84 | 重大事项 |
| 2 | 002364 | 中恒电气 | 23,439,421.53 | 5.74 | 重大事项 |

(6) 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。
泰达稳定基金
1.报告期末基金资产组合(单位:元)

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|---------------|----------------|--------------|
| 1 | 银行存款 | 169,368,264.74 | 76.42 |
| | 其中:股票 | 169,368,264.74 | 76.42 |
| 2 | 国债及政府债券 | 45,023,559.40 | 20.31 |
| | 其中:可转债 | 45,023,559.40 | 20.31 |
| 3 | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 基金投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中:买入国债期货合约 | - | - |
| 6 | 买入国债期货合约 | 2,467,414.43 | 1.11 |
| 7 | 银行存款和拆借金融资产合计 | 4,774,422.87 | 2.14 |
| 8 | 其他 | 221,631,671.44 | 100.00 |
| 9 | 合计 | 221,631,671.44 | 100.00 |

2.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 | 3,230,975.54 | 1.48 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 38,402,750.83 | 17.62 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 18,035,990.85 | 8.27 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 23,256,214.33 | 10.67 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 14,046,198.40 | 6.44 |
| J | 金融业 | 48,946,747.81 | 22.45 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 15,593,271.00 | 7.15 |
| O | 国防军工 | - | - |
| P | 其他 | - | - |
| Q | 合计 | 109,588,264.74 | 77.70 |

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(单位:元)

| 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 | 300059 | 东方财富 | 337,649 | 14,046,198.40 | 6.44 |
| 2 | 601316 | 新华保险 | 231,400 | 12,266,514.00 | 5.61 |
| 3 | 000712 | 泰达红利 | 292,800 | 11,589,024.00 | 5.32 |
| 4 | 601628 | 中国人寿 | 275,178 | 10,195,344.90 | 4.68 |
| 5 | 600559 | 老白干酒 | 183,368 | 9,513,311.84 | 4.36 |
| 6 | 000069 | 华侨城A | 846,800 | 8,171,620.00 | 3.75 |
| 7 | 601166 | 兴业银行 | 441,600 | 8,107,770.00 | 3.72 |
| 8 | 000728 | 中航电子 | 61,268 | 7,109,912.00 | 3.28 |
| 9 | 000728 | 招商证券 | 105,433 | 6,697,488.91 | 3.07 |
| 10 | 600121 | 春秋航空 | 76,647 | 6,618,370.41 | 3.04 |

4.报告期末按券种分类的债券投资组合(单位:元)

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国债 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 45,023,559.40 | 20.65 |
| | 其中:政策性金融债 | 45,023,559.40 | 20.65 |
| 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 | 45,023,559.40 | 20.65 |

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(单位:元)

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(元) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 140207 | 14国债07 | 200,000 | 20,006,000.00 | 9.18 |
| 2 | 010801 | 国开1801 | 133,960 | 13,722,862.40 | 6.30 |
| 3 | 140212 | 14国债12 | 100,000 | 10,002,000.00 | 4.59 |
| 4 | 010803 | 国开1803 | 12,000 | 1,292,097.60 | 0.59 |

上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。
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
本基金本报告期末持有资产支持证券。
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贵金属投资明细
本基金本报告期末持有贵金属。
8.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
本基金本报告期末持有权证。
9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期无股指期货持仓和损益明细。
9.2本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期未投资股指期货。该策略符合基金合同的规定。
10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
10.1本期国债期货投资政策
本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。
10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。
10.3本期国债期货投资评价
本基金本报告期没有投资国债期货。
11.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未出现被监管部门立案调查的情况,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。
(2) 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 | 项目 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 173,070.16 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,513,343.73 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,542,896.40 |
| 5 | 应收申购款 | 545,118.58 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,774,422.87 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。
(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|---------------|--------------|----------|
| 1 | 300059 | 东方财富 | 14,046,198.40 | 6.44 | 重大事项 |
| 2 | 000728 | 招商证券 | 6,697,488.91 | 3.07 | 重大事项 |

泰达稳定基金

(6) 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。
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和运用基金财产,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其未来表现。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2003年4月25日,基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的对比如下表所示:

截止2015年3月31日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较:

| 阶段 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|---------------------|---------|----------|-----------|--------------|---------|--------|
| 2003年4月25日至12月31日 | -1.41% | 0.56% | -7.34% | 0.78% | 5.93% | -0.22% |
| 2004年1月1日至12月31日 | 17.09% | 0.95% | -8.54% | 1.02% | 25.63% | -0.07% |
| 2005年1月1日至12月31日 | 11.42% | 0.97% | -7.13% | 0.98% | 18.55% | -0.01% |
| 2006年1月1日至12月31日 | 81.74% | 1.26% | 54.13% | 1.06% | 27.61% | 0.20% |
| 2007年1月1日至12月31日 | 110.40% | 1.64% | 81.63% | 1.54% | 28.77% | 0.10% |
| 2008年1月1日至12月31日 | -31.61% | 1.83% | -34.32% | 1.92% | 2.71% | -0.09% |
| 2009年1月1日至12月31日 | 52.12% | 1.30% | 51.26% | 1.21% | 0.86% | 0.09% |
| 2010年1月1日至12月31日 | 22.32% | 1.33% | 9.02% | 1.12% | 13.30% | 0.21% |
| 2011年1月1日至12月31日 | -27.17% | 1.07% | -22.51% | 0.90% | -4.66% | 0.17% |
| 2012年1月1日至12月31日 | 8.90% | 1.15% | 1.19% | 0.88% | 7.71% | 0.27% |
| 2013年1月1日至12月31日 | 30.78% | 1.61% | 22.45% | 0.98% | 8.33% | 0.63% |
| 2014年1月1日至12月31日 | 12.56% | 1.36% | 7.75% | 0.73% | 4.81% | 0.63% |
| 2015年1月1日至3月31日 | 42.30% | 1.86% | 26.44% | 1.03% | 15.86% | 0.83% |
| 基金合同生效以来至2015年3月31日 | 971.59% | 1.34% | 219.24% | 1.16% | 752.35% | 0.18% |

泰达定期基金

| 阶段 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|---------------------|---------|----------|-----------|--------------|---------|--------|
| 2003年4月25日至12月31日 | 11.98% | 0.69% | -1.86% | 0.64% | 13.84% | 0.05% |
| 2004年1月1日至12月31日 | 3.12% | 1.08% | -14.31% | 0.90% | 17.43% | 0.18% |
| 2005年1月1日至12月31日 | 3.87% | 1.07% | -4.37% | 0.99% | 8.24% | 0.08% |
| 2006年1月1日至12月31日 | 137.80% | 1.29% | 70.60% | 1.37% | 67.20% | -0.08% |
| 2007年1月1日至12月31日 | 81.77% | 1.82% | 105.32% | 1.63% | -23.55% | 0.19% |
| 2008年1月1日至12月31日 | -40.52% | 1.80% | -49.54% | 2.01% | 9.02% | -0.21% |
| 2009年1月1日至12月31日 | 71.49% | 1.80% | 66.62% | 1.52% | 4.87% | 0.28% |
| 2010年1月1日至12月31日 | 9.51% | 1.30% | 1.50% | 1.15% | 8.01% | 0.15% |
| 2011年1月1日至12月31日 | -28.59% | 1.18% | -21.52% | 0.97% | -7.07% | 0.21% |
| 2012年1月1日至12月31日 | 7.65% | 1.09% | 5.11% | 0.99% | 2.54% | 0.10% |
| 2013年1月1日至12月31日 | 12.64% | 1.25% | -8.33% | 0.93% | 20.97% | 0.32% |
| 2014年1月1日至12月31日 | 19.27% | 1.19% | 28.50% | 0.80% | -9.23% | 0.39% |
| 2015年1月1日至3月31日 | 19.70% | 1.19% | 28.50% | 0.80% | 3.63% | 0.53% |
| 基金合同生效以来至2015年3月31日 | 615.80% | 1.37% | 171.09% | 1.24% | 444.71% | 0.13% |

泰达稳定基金

| 阶段 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|---------------------|---------|----------|-----------|--------------|---------|--------|
| 2003年4月25日至12月31日 | 11.98% | 0.69% | -1.86% | 0.64% | 13.84% | 0.05% |
| 2004年1月1日至12月31日 | 3.12% | 1.08% | -14.31% | 0.90% | 17.43% | 0.18% |
| 2005年1月1日至12月31日 | 3.87% | 1.07% | -4.37% | 0.99% | 8.24% | 0.08% |
| 2006年1月1日至12月31日 | 137.80% | 1.29% | 70.60% | 1.37% | 67.20% | -0.08% |
| 2007年1月1日至12月31日 | 81.77% | 1.82% | 105.32% | 1.63% | -23.55% | 0.19% |
| 2008年1月1日至12月31日 | -40.52% | 1.80% | -49.54% | 2.01% | 9.02% | -0.21% |
| 2009年1月1日至12月31日 | 71.49% | 1.80% | 66.62% | 1.52% | 4.87% | 0.28% |
| 2010年1月1日至12月31日 | 9.51% | 1.30% | 1.50% | 1.15% | 8.01% | 0.15% |
| 2011年1月1日至12月31日 | -28.59% | 1.18% | -21.52% | 0.97% | -7.07% | 0.21% |
| 2012年1月1日至12月31日 | 7.65% | 1.09% | 5.11% | 0.99% | 2.54% | 0.10% |
| 2013年1月1日至12月31日 | 12.64% | 1.25% | -8.33% | 0.93% | 20.97% | 0.32% |
| 2014年1月1日至12月31日 | 19.27% | 1.19% | 28.50% | 0.80% | -9.23% | 0.39% |
| 2015年1月1日至3月31日 | 19.70% | 1.19% | 28.50% | 0.80% | 3.63% | 0.53% |
| 基金合同生效以来至2015年3月31日 | 615.80% | 1.37% | 171.09% | 1.24% | 444.71% | 0.13% |

泰达定期基金

| 阶段 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|-------------------|--------|----------|-----------|--------------|--------|-------|
| 2003年4月25日至12月31日 | 11.98% | 0.69% | -1.86% | 0.64% | 13.84% | 0.05% |
| 2004年1月1日至12月31日 | 3.12% | 1.08% | -14.31% | | | |