

泰达荷银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2006年半年度报告摘要

(上接 B54 页)

行业分类	市值	占基金净值比例
A 农林牧渔业		
B 采掘业		
C 制造业	255,705,089.83	39.68%
C0 食品、饮料		
C1 纺织、服装、皮毛		
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷		
C4 石油、化学、塑胶、塑料	35,369,896.32	5.58%
C5 电子		
C6 金属、非金属		
C7 机械、设备、仪表	140,269,696.73	21.77%
C8 医药、生物制品	79,475,496.78	12.33%
C9 其他制造业		
D 电力、煤气及水的生产和供应业		
E 建筑业		
F 交通运输、仓储业	186,719,606.00	28.98%
G 信息技术业	24,810,000.00	3.85%
H 批发和零售贸易		
I 金融、保险业		
J 房地产业		
K 社会服务业	458,743.68	0.07%
L 传播与文化产业	26,450,000.00	4.11%
M 综合类		
合计	494,143,439.61	76.69%

本基金投资成长类行业股票市值合计占投资股票总市值的 92.78%。

股票代码	股票名称	数量	市值	市值占基金净值比例
600271	G 航 信	1,885,374	56,580,073.74	8.79%
600312	G 平 高	4,100,000	49,200,000.00	7.64%
600485	G 中 创	3,600,000	38,045,000.00	5.90%
000063	G 中 兴	1,200,000	34,332,000.00	5.33%
600879	G 华 胜	2,259,971	30,487,008.79	4.73%
600410	G 华 胜	1,632,464	30,347,505.76	4.71%
600684	大商股份	600,000	24,810,000.00	3.85%
600682	天地科技	1,200,000	24,529,000.00	3.81%
600037	G 歌 华	1,600,000	22,110,000.00	3.43%
002007	华兰生物	999,998	21,969,956.00	3.41%

(四) 报告期末投资组合的重大变动

股票代码	股票名称	累计买入金额	占期初净值比例
000063	G 中 兴	80,752,819.72	12.96%
600050	G 联 通	55,961,267.15	8.98%
600485	G 中 创	51,862,220.89	8.23%
600046	国电南瑞	40,847,742.22	6.55%
002007	华兰生物	33,682,089.82	5.40%
600410	G 华 胜	29,212,625.23	4.69%
600879	G 华 胜	25,745,346.02	4.16%
600261	G 新阳光	25,070,561.23	4.05%
600183	G 生 益	25,507,140.49	4.25%
600572	天地科技	25,305,989.63	4.22%
600296	G 恒 通	25,077,620.29	4.18%
000423	东阿阿胶	24,392,600.97	4.01%
600837	G 歌 华	24,621,119.36	3.95%
600028	中国石化	23,363,944.22	3.75%
000069	G 华侨城	23,100,234.62	3.71%
600312	G 平 高	20,641,980.38	3.47%
002049	晶澳电子	20,227,040.39	3.25%
000492	G 金融街	20,066,751.98	3.22%
600594	G 益 佰	20,011,321.90	3.21%
002025	航天电器	19,614,715.32	3.29%
002028	思源电气	19,452,563.74	3.26%
002008	大族激光	19,154,244.23	3.21%
600755	G 耀阳置	17,264,291.12	2.77%
000532	万乐家 A	16,889,943.66	2.71%
000917	G 电 厂	16,850,161.76	2.70%
600330	G 天 通	15,769,962.12	2.53%
600220	G 苏阳光	15,692,200.59	2.52%
600875	G 东 电	14,028,426.26	2.25%

股票代码	股票名称	累计卖出金额	占期初净值比例
000063	G 中 兴	94,691,797.16	15.19%
600050	G 联 通	90,117,395.09	14.46%
600037	G 歌 华	45,494,876.07	7.30%
600046	国电南瑞	44,301,295.38	7.11%
600271	G 航 信	39,375,227.62	6.32%
600485	G 中 创	34,986,902.22	5.61%
000670	G 三 环	34,778,256.98	5.58%
000638	G 云白药	33,546,616.32	5.38%
600299	星新材料	32,366,415.04	5.19%
600831	G 广 电	30,289,108.42	4.98%
600694	大商股份	30,005,870.30	4.81%
600183	G 生 益	29,113,576.56	4.67%
600220	G 苏阳光	25,767,946.49	4.13%
002025	航天电器	25,224,900.60	4.05%
600268	G 南 自	24,606,520.62	3.95%
600694	G 益 佰	24,409,637.50	3.92%
000069	G 华侨城	23,346,575.35	3.75%
600028	中国石化	23,025,466.25	3.69%
600276	G 恒 通	22,616,635.15	3.63%
000402	G 金融街	22,139,284.10	3.55%
600683	G 海 工	20,610,471.92	3.31%
002028	思源电气	20,477,282.81	3.29%
000423	东阿阿胶	19,620,612.63	3.15%
002007	华兰生物	18,603,652.40	2.99%
600330	G 天 通	18,494,099.14	2.97%
600755	G 耀阳置	17,960,081.57	2.94%
600269	G 赣 粤	17,928,097.92	2.88%
002008	大族激光	17,444,760.33	2.86%
600479	G 千 金	17,063,757.89	2.74%
000917	G 电 厂	16,205,522.07	2.60%
600216	G 新医药	15,204,544.00	2.44%
000768	G 西 飞	13,170,626.42	2.11%
000100	DTCL 集团	12,651,483.17	2.03%
600261	G 新阳光	12,640,080.73	2.03%
600832	G 明 珠	12,635,190.03	2.03%

报告期内买入股票成本总额	1,085,744,531.99
报告期内卖出股票收入总额	1,326,347,042.83

债券类别	债券市值	市值占净值比例
国家债券投资	105,896,427.90	16.44%
央行票据投资	--	--
企业债券投资	--	--
金融债券投资	25,020,000.00	3.88%
可转换债券投资	--	--
合计	130,916,427.90	20.32%

债券名称	市 值	市值占净值比例
05 农发 17	25,020,000.00	3.88%
02 国债 04	22,223,511.00	3.45%
银行间 05 国债 10	19,764,060.00	3.07%
96 国债 03	15,063,271.00	2.34%
21 国债 03	13,428,534.50	2.08%

项目	金额	占基金总资产比例
交易保证金	862,698.42	
应收证券清算款	4,487,131.01	
应收股利	405,000.00	
应收利息	1,892,545.89	
应收申购款	205,158.04	
其他应收款	5,300,000.00	
买入返售证券	0.00	
待摊费用	0.00	

4. 基金未持有处于转股期的可转换债券。
5. 报告期末基金未主动投资权证,也未在报告期内因股权分置改革获赠权证。
6. 报告期末未持有资产支持证券。

7. 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

项目	金额	占基金总资产比例
股票	224,265,372.29	75.65%
债券	59,677,590.40	20.13%
权证	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金	4,066,608.40	1.37%
其它资产	8,446,360.03	2.85%
合计	296,456,931.12	100.00%

行业	市值	占基金净值比例
A 农、林、牧、渔业	5,088,000.00	1.73%
B 采掘业	16,030,000.00	5.46%
C 制造业	173,632,983.41	59.16%
C0 食品、饮料	14,166,642.40	4.83%
C1 纺织、服装、皮毛		
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷		
C4 石油、化学、塑胶、塑料	46,767,220.60	15.93%
C5 电子		
C6 金属、非金属	23,208,500.00	7.91%
C7 机械、设备、仪表	89,490,610.41	30.49%
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		
F 交通运输、仓储业		
G 信息技术业		
H 批发和零售贸易		
I 金融、保险业		
J 房地产业		
K 社会服务业	101,948.89	0.03%
L 传播与文化产业		
M 综合类		
合计	224,265,372.29	76.40%

本基金投资周期类行业股票市值合计占投资股票总市值的 81.47%。

股票代码	股票名称	数量	市值	市值占基金净值比例
000792	G 晋 能	850,000	17,255,000.00	5.88%
600683	G 海 工	700,000	16,030,000.00	5.46%
600685	G 广 船	1,600,000	14,208,000.00	4.84%
000157	中联重科	1,000,000	13,860,000.00	4.72%
600143	G 金 发	639,130	12,539,730.60	4.27%
600694	大商股份	300,000	12,405,000.00	4.23%
000550	G 江 铃	1,350,919	12,360,908.85	4.21%
600682	天地科技	600,000	12,264,000.00	4.18%
600312	G 平 高	1,000,000	12,000,000.00	4.09%
600456	G 宝 钛	250,000	11,922,500.00	4.06%

(四) 投资组合的重大变动

股票代码	股票名称	累计买入金额	占期初净值比例
000069	G 华侨城	25,634,433.40	10.02%
600309	G 万 华	24,987,890.40	9.76%
600028	中国石化	24,241,489.91	9.47%
000402	G 金融街	22,448,417.62	8.77%
600549	G 耀 钧	20,273,081.75	7.92%
600320	G 振 华	20,245,269.52	7.91%
000825	G 太 钢	19,245,736.47	7.52%
000157	中联重科	17,444,946.18	6.82%
000002	G 万科 A	16,367,552.25	6.40%
600205	山东铝业	15,629,561.80	6.11%
600028	中国石化	15,370,671.44	6.01%
600456	G 宝 钛	14,808,363.72	5.79%
000898	G 鞍 钢	14,262,713.37	5.57%
000060	G 中 金	14,153,493.07	5.53%
600582	天地科技	12,934,986.66	5.05%
600271	G 航 信	12,600,057.46	4.92%
600694	大商股份	12,228,558.96	4.78%
600406	国电南瑞	11,707,627.00	4.57%
600143	G 金 发	11,245,489.57	4.39%
000550	G 江 铃	11,216,925.51	4.38%
600638	G 云白药	10,448,103.50	4.08%
000063	G 中 兴	10,428,994.50	4.07%
600685	G 广 船	9,050,139.74	3.54%
600596	G 新 安	9,041,819.16	3.53%
600037	G 歌 华	8,901,204.96	3.48%
600104	G 上 汽	8,765,165.00	3.42%
600177	G 雅戈尔	8,546,118.54	3.34%
000316	亿城股份	8,246,390.44	3.22%
600112	G 平 高	8,224,215.89	3.21%
600636	G 三爱富	8,222,031.06	3.21%
600583	G 海 工	8,070,431.33	3.15%
000709	G 鼎 凯	7,770,652.72	3.04%
600362	G 江 铜	7,416,649.73	2.90%
600262	G 北 重	7,366,223.59	2.87%
600102	莱钢股份	7,217,498.76	2.82%
000568	G 老 窖	7,210,028.46	2.82%
600686	G 金 龙	6,960,665.35	2.72%
600096	G 云天化	6,896,942.96	2.68%
600519	G 茅 台	6,719,655.06	2.63%
600625	上海机场	6,648,338.61	2.60%
000761	G 太 钢	6,339,970.24	2.48%
000848	G 露 露	6,069,046.13	2.37%
000708	G 冶特钢	5,802,420.43	2.27%
000488	G 晨 鸣	5,492,930.49	2.15%
600467	G 好当家	5,338,965.91	2.09%