

泰达荷银效率优选混合型证券投资基金(LOF) 2007年半年度报告摘要

基金管理人:泰达荷银基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

重要提示:基金管理人泰达荷银基金管理有限公司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...

资产负债表: 2007年6月30日, 2006年12月31日. 资产总计 2,112,533,850.34; 负债合计 4,466,968,563.90.

(二) 基金业绩表现(除特别注明外,金额单位为人民币元): 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年5月12日至2006年6月30日.

基金业绩表现表: 收入 1,531,519,889.40; 基金净收益 1,531,519,889.40; 期末基金净值 1,963,031,719.57.

(三) 收益分配表(除特别注明外,金额单位为人民币元): 本期基金净收益 1,531,519,889.40; 可供分配基金净收益 986,476,690.32.

(四) 净值变动表(除特别注明外,金额单位为人民币元): 期初基金净值 3,965,973,131.46; 期末基金净值 4,790,947,539.11.

(五) 会计报表附注: 1. 本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致; 2. 本报告期末无未决诉讼事项.

关联方关系及其交易的披露: 泰达荷银基金管理有限公司, 基金托管人: 中国建设银行股份有限公司.

2006年5月12日(基金合同生效日)至2006年6月30日: 基金管理人报酬 9,026,119.47; 基金托管人报酬 1,504,353.24.

基金管理人泰达荷银基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提, 逐日累计至每月月末, 按月支付.

资产负债表: 2007年6月30日, 2006年12月31日. 资产总计 2,112,533,850.34; 负债合计 4,466,968,563.90.

(一) 基金业绩表现(除特别注明外,金额单位为人民币元): 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年5月12日至2006年6月30日.

基金业绩表现表: 收入 1,531,519,889.40; 基金净收益 1,531,519,889.40; 期末基金净值 1,963,031,719.57.

(三) 收益分配表(除特别注明外,金额单位为人民币元): 本期基金净收益 1,531,519,889.40; 可供分配基金净收益 986,476,690.32.

(四) 净值变动表(除特别注明外,金额单位为人民币元): 期初基金净值 3,965,973,131.46; 期末基金净值 4,790,947,539.11.

(五) 会计报表附注: 1. 本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致; 2. 本报告期末无未决诉讼事项.

关联方关系及其交易的披露: 泰达荷银基金管理有限公司, 基金托管人: 中国建设银行股份有限公司.

资产负债表: 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年12月31日. 资产总计 2,112,533,850.34; 负债合计 4,466,968,563.90.

(9) 股票券资产收入(单位:元): 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年5月12日至2006年6月30日.

股票券资产收入表: 债券成交总额 1,033,066,424.96; 债券利息收入 11,995,999.33; 债券投资收益 83,606,092.16.

(10) 债券券资产收入(单位:元): 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年5月12日至2006年6月30日.

债券券资产收入表: 债券成交总额 1,033,066,424.96; 债券利息收入 11,995,999.33; 债券投资收益 83,606,092.16.

(11) 其他收入(单位:元): 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年5月12日至2006年6月30日.

(12) 其它费用(单位:元): 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年5月12日至2006年6月30日.

5. 报告期末流通转让受到限制的基金资产的说明: 本基金截至2006年6月29日止持有停牌股票详情如下:

停牌股票表: 股票代码 000338, 股票名称 隆平高科, 数量 27,309,477.83, 账面价值 35,325,000.00.

b. 本基金截至2007年6月30日止从事银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券款余额126,900,000.00元, 系以如下债券作为抵押, 除特别注明外, 金额单位为人民币元:

卖出回购证券款表: 证券代码 060010, 债券名称 06国债(10), 回购到期日 2007-7-6, 数量 600,000.00, 期末估值总额 600,000.00.

6. 其它重要事项: 经国务院批准, 财政部决定从2007年5月30日起, 调整证券(股票)交易印花税税率, 由1%调整为3%.

(一) 报告期末基金资产组合(单位:元): 股票 1,302,797,178.46, 占基金总资产比例 61.67%; 债券 504,870,860.95, 占基金总资产比例 23.90%.

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合(单位:元): A 农林、牧、渔业 43,646,516.00, 占基金净值比例 2.33%; B 采掘业 79,916,810.01, 占基金净值比例 4.28%.

(三) 报告期末按市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): 股票代码 601628, 股票名称 中国人寿, 数量 99,918,511.05, 占基金净值比例 2.27%.

(四) 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明细(单位:元): 1. 报告期末累计卖出回购债券资产净值前二十名的股票明细: 股票代码 000002, 股票名称 万科A, 数量 235,943,321.88, 占基金净值比例 5.95%.

基金业绩表现表: 收入 1,531,519,889.40; 基金净收益 1,531,519,889.40; 期末基金净值 1,963,031,719.57.

(五) 会计报表附注: 1. 本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致; 2. 本报告期末无未决诉讼事项.

资产负债表: 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年12月31日. 资产总计 2,112,533,850.34; 负债合计 4,466,968,563.90.

3. 报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额(单位:元): 报告期内买入股票成本总额 1,116,702,463.85; 报告期内卖出股票收入总额 3,550,148,449.36.

(五) 报告期内未摊余成本分类的债券投资组合(单位:元): 债券类别 国家债券, 市值 276,677,929.60, 市值占净值比例 14.81%.

(六) 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(单位:元): 债券名称 02国债(03), 市值 100,250,000.00, 市值占净值比例 5.37%.

(七) 投资组合报告附注: 1. 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无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.

投资组合报告表: 交易保证金 937,604.08; 应收证券清算款 76,193,702.19; 应收股利 1,611,908.48; 应收利息 5,988,269.20.

4. 本报告期末基金持有处于转股期的可转换债券明细(单位:元): 证券代码 110021, 名称 上证转债, 市值(元) 32,157,447.00, 市值占净值比例 1.72%.

5. 报告期末本基金持仓未到期的可转债明细(单位:元): 证券代码 119006, 名称 宁建01, 市值(元) 11,995,999.33, 市值占净值比例 0.64%.

基金持有人户数及结构表: 基金名称 泰达荷银效率优选混合型证券投资基金, 个人持有份额 386,000, 占比例 0.30%.

场内基金前十名持有人表: 基金名称 泰达荷银效率优选混合型证券投资基金, 持有份额(份) 1,000,440.00, 占基金总资产比例 0.10%.

(三) 本基金基金管理人统计,截止2007年6月30日, 本公司员工持有本基金情况如下: 基金名称 泰达荷银效率优选混合型证券投资基金, 基金管理人持有该只基金份额 0.0000617%.

八、开放式基金份额变动情况表: 合同生效日基金份额 4,334,638,642.20; 期末基金份额 2,879,214,333.28.

九、重大事件揭示: (一) 本基金报告期内本基金召开基金份额持有人大会; (二) 本报告期本基金未发生基金份额持有人大会.

基金经理变更事项: 基金经理 魏庆华, 离任日期 2007年6月30日; 基金经理 王蔚, 聘任日期 2007年6月30日.

(十) 对本基金基金经理的更新: 基金经理人已于2007年4月30日发布公告关于变更基金经理的公告, 经泰达荷银基金管理有限公司董事会审议通过, 并经中国证监会基金监管部(2007)4号文核准.

基金经理变更事项: 基金经理 魏庆华, 离任日期 2007年6月30日; 基金经理 王蔚, 聘任日期 2007年6月30日.

(十一) 关联交易情况: 根据中国证监会的相关规定, 本公司通过比较多家证券经纪机构的财务状况、经营情况、研究水平, 本报告期内与下列机构进行了交易.

(十二) 基金选择证券的标准和程序: 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经纪机构, 使用其席位作为基金的专用交易席位.