

泰和证券投资基金 2008年半年度报告摘要

51 重要提示

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责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2008年6月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证基金份额持有人不受损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期为2008年1月1日起至2008年6月30日止，本报告财务资料未经审计，本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

52 基金简介

Table with 2 columns: Item and Value. Includes fund name (泰和证券投资基金), type (债券型), and other details.

Table with 2 columns: Item and Value. Details investment objectives, strategies, and risk management.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists management personnel including the manager and custodian.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: Item and Value. Lists related parties and their relationships.

行了认真的复核，未发现基金管理人有关基金估值持有者利益的行为。由基金托管人和基金管理人—嘉实基金管理有限公司编制，并经基金托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

53 财务会计报告

6.1 基金会计报表

以下各项除特别说明外，金额单位均为人民币元。

6.1.1 资产负债表

Table with 4 columns: Item, Unit, 2008年6月30日, 2007年12月31日. Balance sheet data.

Table with 4 columns: Item, Unit, 本期, 上年同期. Profit and loss statement data.

Table with 4 columns: Item, Unit, 本期, 上年同期. Cash flow statement data.

6.1.2 利润表

Table with 4 columns: Item, Unit, 本期, 上年同期. Profit and loss statement data.

6.1.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 4 columns: Item, Unit, 本期, 上年同期. Equity statement data.

6.2 半年度会计报表附注

6.2.1 会计政策、会计估计及其变更
本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度7月1日至12月31日会计报表一致。

6.2.2 重大会计差错更正和重要前期差错更正
注：投资者如无重大会计差错和重要前期更正金额。

6.2.3 关联方关系及关联方交易
(一) 关联方关系

Table with 2 columns: Party Name and Relationship. Lists related parties.

Table with 2 columns: Party Name and Relationship. Lists related parties.

Table with 2 columns: Party Name and Relationship. Lists related parties.

Table with 2 columns: Party Name and Relationship. Lists related parties.

Table with 2 columns: Party Name and Relationship. Lists related parties.

Table with 2 columns: Party Name and Relationship. Lists related parties.

Table with 2 columns: Party Name and Relationship. Lists related parties.

Table with 2 columns: Party Name and Relationship. Lists related parties.

注：投资者如无重大会计差错和重要前期更正金额。
注：关联方关系及关联方交易
(一) 关联方关系

Table with 6 columns: Item, Unit, 本期, 上年同期. Equity statement data.

6.2.4 报告期末流通受限的基金资产

以下各项除特别说明外，金额单位为人民币元。

(1) 报告期末本基金持有的因认购新发或增发而流通受限的股票

Table with 10 columns: No., 证券代码, 证券简称, 成功认购日, 可流通日, 流通受限类型, 认购价格, 期末估值单价, 数量(股), 期末成本总额, 期末估值总额. Stock holdings table.

(2) 报告期末本基金持有的限售回购股票

Table with 10 columns: No., 股票代码, 股票简称, 停牌日期, 停牌原因, 期末估值单价, 复牌开盘价, 数量(股), 期末成本总额, 期末估值总额. Restricted stock table.

(3) 报告期末本基金持有的质押或冻结的股票

Table with 10 columns: No., 股票代码, 股票简称, 冻结日期, 冻结原因, 期末估值单价, 复牌开盘价, 数量(股), 期末成本总额, 期末估值总额. Frozen stock table.

7.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 资产类别, 金额(元), 占基金总资产的比例. Asset composition table.

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 行业, 股票市值(元), 市值占基金资产净值比例. Industry breakdown table.

7.3 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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 数量(股), 市值占基金资产净值比例. Top 10 stocks table.

7.4 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 债券简称, 数量(份), 市值占基金资产净值比例. Top 10 bonds table.

(2) 报告期末累计卖出价值超过期初基金资产净值1%的所有股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例. Sold stocks table.

(3) 报告期末买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 买入股票成本总额(元), 卖出股票收入总额(元). Buy/sell table.

Table with 2 columns: 债券品种, 市值(元), 市值占基金资产净值比例. Bond portfolio table.

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券简称, 市值(元), 市值占基金资产净值比例. Bond portfolio table.

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 数量(份), 市值(元), 市值占基金资产净值比例. Equity portfolio table.

7.8 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

Table with 2 columns: 序号, 代码, 权证名称, 数量(份), 市值(元), 市值占基金资产净值比例. Asset-backed securities table.

7.9 投资组合报告附注

(1) 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年本基金投资的前十名股票的发行主体未受到公开谴责和处罚。

(2) 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 项目, 期末余额(元). Other assets table.

(4) 持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 4 columns: 序号, 代码, 债券名称, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例. Convertible bonds table.

(5) 报告期末持有的权证资产

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 成本总额(元), 类别(被动持有或主动投资). Warrants table.

53 基金持有人情况

8.1 报告期末本基金持有人户数情况

Table with 2 columns: 报告期末基金持有人户数(户), 报告期末平均每户持有的基金份额(份). Holders table.

8.2 报告期末基金持有人结构

Table with 3 columns: 项目, 数量(份), 占份额的比例. Holder structure table.

8.3 报告期末本基金前十名持有人明细

Table with 4 columns: 序号, 持有人名称, 持有份额(份), 占份额的比例. Top 10 holders table.

注：上表数据由中国证券登记结算公司上海分公司提供。

54 重大事件揭示

9.1 报告期内未召开基金份额持有人大会。

9.2 报告期内基金管理人、基金托管人的托管部门无重大人事变动情况。

9.3 报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

9.4 报告期内本基金投资策略未发生变更。

9.5 基金分红情况

2008年4月8日，本基金实施了2007年年度收益分配，每10份基金份额派发现金红利16.40元，合计32.80万元。

9.6 报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

9.7 报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

9.8 基金租用证券公司专用交易席位的情况

(1) 基金租用席位的选择标准和程序

① 选择行为规范，在最近一年无重大违规行为；

② 公司财务状况良好；

③ 有良好的内部控制，在业内有良好的声誉；

④ 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供高质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究服务；

⑤ 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券公司的选择，基金管理人将与被选择的证券公司签订委托协议，报中国证监会备案并通知基金托管人。

(2) 报告期内通过证券公司专用席位进行的股票、债券、债券回购及权证情况

Table with 5 columns: 股票交易金额及佣金情况. Securities transaction table.

② 债券交易情况

Table with 5 columns: 证券公司名称, 债券成交金额(元), 占债券成交总额比例, 佣金(元), 占佣金总额比例. Bond transaction table.

③ 债券回购交易情况

Table with 5 columns: 证券公司名称, 债券回购成交金额(元), 占债券回购成交总额比例, 佣金(元), 占佣金总额比例. Bond repurchase table.

④ 权证交易情况

Table with 3 columns: 证券公司名称, 权证成交金额(元), 占权证成交总额比例. Warrant transaction table.

9.10 中国建设银行重大事项
① 2008年6月6日，因工作变动，赵林先生辞去中国建设银行董事、副行长的职务；