

Disclosure

泰信优质生活股票型证券投资基金 2008年半年度报告摘要

基金管理人:泰信基金管理有限公司 基金托管人:中国银行股份有限公司 本报告送出日期:2008年8月26日

重要提示

基金管理人及基金托管人不存在虚假记载、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...

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,也不保证最低收益...

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,也不保证最低收益...

第一节 基金简介

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金简称, etc.) and Content (泰信优质生活股票型证券投资基金, etc.)

1. 投资目标: 分享中国经济持续增长过程中那些能够确定进入优质生活领域的上市公司的长期成长,在严格控制投资风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值...

2. 投资范围: 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的各种股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具...

3. 投资策略: 公司的投资目标在于投资者对其未来发展的预期,公司的持续成长是其投资价值长期提升的源泉...

4. 业绩比较基准: 75%新华富时A600指数+25%新华富时国债指数...

5. 风险收益特征: 本基金为股票型证券投资基金,属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险收益水平高于混合基金、债券基金及货币市场基金...

Table with 2 columns: Item (基金管理人, 基金托管人, etc.) and Content (泰信基金管理有限公司, 中国银行股份有限公司, etc.)

第二节 主要财务指标和基金净值表现

一、主要会计数据和财务指标 单位:人民币元

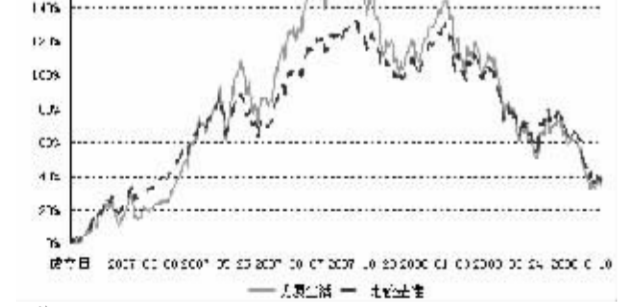
Table with 4 columns: Item (序号, 项目, 2008年1月1日至2008年6月30日, 2007年12月31日)

提示:所述基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数据...

二、基金净值表现 (一) 自基金合同生效以来,泰信优质生活基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



(二) 自基金合同生效以来,泰信优质生活基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图 (2006年12月15日至2008年6月30日)



注: 1. 本基金基金合同于2006年12月15日正式生效; 2. 本基金的投资期为六个月,建仓期满,基金投资组合各项比例符合基金合同的约定...

第三节 管理人报告

一、基金管理人概况 泰信基金管理有限公司(First-Trust Fund Management Co., Ltd.)是原山东国际信托投资公司(现更名为山东省国际信托有限公司)联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司共同发起设立的基金管理公司...

Table with 4 columns: Name (姓名), Position (职务), Tenure (任职日期), Description (说明)

三、报告期内本基金运作的遵守信情况的说明 本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》...

四、公平交易专项说明 (一) 公平交易制度的执行情况 《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(中国证监会公告[2008]9号)自2008年3月20日起执行...

(二) 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较 本基金与本公司旗下管理的另外一只基金泰信先行策略基金的投资风格有一定相似性...

(三) 异常交易行为的专项说明 本基金在报告期内不存在异常交易行为...

五、报告期内基金投资和业绩表现的说明与解释 (一) 本基金业绩表现 截至2008年6月30日,本基金份额净值为0.9580元;本报告期份额净值增长率为-40.98%...

(二) 行情回顾及后市分析 由于中小企业业绩出现下滑以及限售股解禁等因素,股票市场上半年出现较大幅度调

整,上证综指上半年下跌48%,深圳成指下跌47%。股票市场在如此短时间内有如此大幅的调整实属罕见...

本基金在报告期内增加了部分化工、商贸零售、旅游、食品饮料等内需增长类品种,主要减持了与国际市场尤其是和港股有较大溢价、估值较高、未来利润增长不确定的个股...

(三) 市场展望与投资策略 目前股市已经进入了一个相对有投资价值的区域,短期的走势有可能借助政策调节的外力来改变...

第四节 托管人报告

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对泰信优质生活股票型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定...

第五节 财务会计报告

一、财务会计报表(单位:人民币元) (一) 资产负债表

Table with 3 columns: Item (资产, 负债, 所有者权益), 2008年6月30日, 2007年12月31日

第六节 投资组合报告

一、报告期末投资组合情况

Table with 4 columns: Item (资产类别, 金额), 占基金总资产的比例

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Code (代码), Industry (行业类别), Market Value (市值), Net Proportion (净占比)

三、报告期末按市值占基金总资产净值比例大小排序的前十名股票明细

Table with 5 columns: No. (序号), Code (股票代码), Name (股票名称), Quantity (数量), Net Asset Value (期末市值)

注:投资者想了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读登载在泰信基金管理有限公司网站(www.tfund.com)的半年度报告正文。

四、报告期内股票投资组合的重大变动 (一) 2008年1月1日至2008年6月30日累计买入金额超出期初基金总资产2%的股票明细

Table with 4 columns: No. (序号), Code (股票代码), Name (股票名称), Net Asset Value (期末市值)

(二) 2008年1月1日至2008年6月30日累计卖出金额超出期初基金总资产2%的股票明细

Table with 4 columns: No. (序号), Code (股票代码), Name (股票名称), Net Asset Value (期末市值)

(三) 报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: Item (买入股票成本总额, 卖出股票收入总额), Amount (单位:元)

五、报告期末按品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: No. (序号), Name (债券名称), Net Asset Value (期末市值)

六、报告期末按市值占基金总资产净值比例大小排序的前五名债券明细

Table with 4 columns: No. (序号), Code (股票代码), Name (债券名称), Net Asset Value (期末市值)

七、报告期末按市值占基金总资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

Table with 4 columns: No. (序号), Code (股票代码), Name (资产支持证券名称), Net Asset Value (期末市值)

八、报告期末按市值占基金总资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券明细

Table with 4 columns: No. (序号), Code (股票代码), Name (资产支持证券名称), Net Asset Value (期末市值)

九、报告期末按市值占基金总资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券明细

Table with 4 columns: No. (序号), Code (股票代码), Name (资产支持证券名称), Net Asset Value (期末市值)

(b) 基金托管人中国银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付...

(c) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入 本基金的银行存款由中国银行保管,并按银行间同业利率计息...

(d) 关联方持有的基金份额

Table with 4 columns: No. (序号), Code (股票代码), Name (资产支持证券名称), Net Asset Value (期末市值)

(e) 与关联方进行银行间同业市场进行的债券交易 本基金在本年度与银行间同业市场进行债券交易如下:

Table with 4 columns: Item (买入债券结算金额, 卖出债券结算金额, etc.), 2008年1月1日至2008年6月30日, 2007年1月1日至2007年6月30日

4. 本报告期末流通受限的基金资产情况: (a) 本报告期末在交易所和银行间市场债券正回购中质押债券的信息:无

(b) 基金因认购新发或增发证券于期末持有流通受限证券:无

(c) 期末持有的暂时停牌股票: 单位:元

Table with 7 columns: Code (股票代码), Name (股票名称), Date (停牌日期), Reason (停牌原因), End Date (预计复牌日期), Quantity (数量), Net Asset Value (期末成本总额), Net Proportion (期末公允价值总额)

5. 期末基金在买断式回购交易中收到的、在对方没有违约时就可以出售或再用于质押的资产的信息: 无。

第七节 投资组合报告

一、报告期末投资组合情况

Table with 4 columns: Item (资产类别, 金额), 占基金总资产的比例

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Code (代码), Industry (行业类别), Market Value (市值), Net Proportion (净占比)

三、报告期末按市值占基金总资产净值比例大小排序的前十名股票明细

Table with 5 columns: No. (序号), Code (股票代码), Name (股票名称), Quantity (数量), Net Asset Value (期末市值)

注:投资者想了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读登载在泰信基金管理有限公司网站(www.tfund.com)的半年度报告正文。

四、报告期内股票投资组合的重大变动 (一) 2008年1月1日至2008年6月30日累计买入金额超出期初基金总资产2%的股票明细

Table with 4 columns: No. (序号), Code (股票代码), Name (股票名称), Net Asset Value (期末市值)

(二) 2008年1月1日至2008年6月30日累计卖出金额超出期初基金总资产2%的股票明细

Table with 4 columns: No. (序号), Code (股票代码), Name (股票名称), Net Asset Value (期末市值)

(三) 报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: Item (买入股票成本总额, 卖出股票收入总额), Amount (单位:元)

五、报告期末按品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: No. (序号), Name (债券名称), Net Asset Value (期末市值)

六、报告期末按市值占基金总资产净值比例大小排序的前五名债券明细

Table with 4 columns: No. (序号), Code (股票代码), Name (资产支持证券名称), Net Asset Value (期末市值)

七、报告期末按市值占基金总资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券明细

Table with 4 columns: No. (序号), Code (股票代码), Name (资产支持证券名称), Net Asset Value (期末市值)

八、报告期末按市值占基金总资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券明细

Table with 4 columns: No. (序号), Code (股票代码), Name (资产支持证券名称), Net Asset Value (期末市值)

Table with 4 columns: No. (序号), Code (股票代码), Name (债券名称), Net Asset Value (期末市值)

七、报告期末按市值占基金总资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

八、报告期末按市值占基金总资产净值比例大小排序的前五名权证明细

九、投资组合报告附注 (一) 本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的证券...

(二) 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

(三) 本报告期无权证投资情况:

Table with 4 columns: No. (序号), Code (股票代码), Name (债券名称), Net Asset Value (期末市值)

(四) 报告期内本基金未受控股股东主导的证券,未从二级市场投资分离交易可转债附送的权证,投资流通受限证券(因认购新发证券而持有的流通受限证券)未违反相关法规或本基金管理公司的规定。

(五) 报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(六) 报告期末本基金未持有被动或主动投资的权证。

(七) 截至2008年6月30日,本基金其它证券的构成: 单位:元

Table with 2 columns: Item (项目), Amount (金额)

(八) 报告期末,本基金管理人利用固有资金持有本基金份额情况

Table with 3 columns: Item (项目), Quantity (份额), Net Proportion (占基金份额比例)

第七节 基金份额持有人情况

一、报告期末基金份额持有人户数

Table with 2 columns: Item (报告期末基金份额持有人户数, 报告期末平均每户持有基金份额), Value (数量)

二、报告期末基金份额持有人结构

Table with 3 columns: Item (项目), Quantity (数量), Net Proportion (占基金份额比例)

三、期末基金管理人从业人员投资开放式基金的情况

Table with 4 columns: Item (项目), Net Asset Value (期末持有本基金基金份额的总资产), Net Proportion (占本基金总资产比例)

第八节 开放式基金份额变动情况

Table with 2 columns: Item (项目), Quantity (份额,份)

注:本基金合同于2006年12月15日正式生效。

第九节 重大事件揭示

一、基金份额持有人大会决议 在本报告期内,没有召开基金份额持有人大会。

二、本报告期内,基金管理人重大人事变动情况: 经公司第二届董事会2008年第六次(通讯)会议审议通过,公司决定聘任朱志权为泰信优质生活基金基金经理,与刘强共同管理该基金。因业务发展需要,崔海鸿自2008年6月底起不再担任该基金基金经理职务,另有任用。

三、本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

四、本年度无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

五、基金投资策略的改变:无。

六、基金收益分配事项:本会计期间本基金未进行收益分配。

七、本报告期内,负责基金审计的会计师事务所未发生变更,仍为普华永道中天会计师事务所有限公司。

八、在本报告期内,基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

九、基金租用证券公司专用交易席位的情况 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位有关问题的通知》(证监基金字【2007】40号)和关于“一家基金公司通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金,不得超过其当年所有基金类证券交易佣金的30%”的要求,本基金管理人在选择租用席位时,注重所选证券公司的综合实力、市场声誉,根据证券公司提供的研究报告,选择研究成果的质量对其研究能力进行定期评估,并结合其基金营销能力、售后服务能力的考核结果,决定是否对其研究能力进行定期评估。

截止2008年6月30日,本基金共租用了广发证券、华泰证券、中国建银投资证券、东方证券、国信证券、联合证券、华宝证券、上海证券、江南证券、中信建投证券、大通证券、招商证券、安信证券、西南证券、光大证券、申银万国证券基金专用交易席位各一个,海通证券、中国国际证券基金专用交易席位各两个。基金专用席位交易情况如下:

(一) 股票交易情况

Table with 5 columns: Name (券商名称), Shareholding Ratio (持股比例), Transaction Amount (买入金额), Transaction Ratio (买入比例)

(二) 债券、权证及回购交易情况

Table with 5 columns: Name (券商名称), Transaction Amount (买入金额), Transaction Ratio (买入比例)

十、其他事项

序号 事项内容 信息披露源名称 披露日期

Table with 4 columns: No. (序号), Content (事项内容), Source (信息披露源名称), Date (披露日期)

第十一节 备查文件

- 1. 中国证监会批准泰信优质生活股票型证券投资基金设立的文件
2. 泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同
3. 泰信优质生活股票型证券投资基金招募说明书
4. 泰信优质生活股票型证券投资基金托管协议
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照

二、存放地点 本报告分别置放于基金管理人、基金托管人的住所,供投资者免费查阅。在支付必要的工本费后,投资者可在有效的工作时间内取得本住所及上述备查文件的复印件或复印件。

三、查阅方式 投资者可直接登录本基金管理人公司网站(www.tfund.com)查阅上述相关文件,或拨打客户服务中心电话(021-38784666),和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司 2008年8月27日