

友邦华泰上证红利交易型开放式指数证券投资基金 2008年半年度报告摘要

基金管理人:友邦华泰基金管理有限公司 基金托管人:招商银行股份有限公司

重要提示:基金管理人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...

不可见小事案件。换言之,我们认为:即未来通胀不会再上升至两位数以上的普通通胀,以致使未来...

无。(4)期末债券正回购余额中作为质押的债券 6.报告期内基金因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

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...

招商银行股份有限公司 基金托管人 2008年8月28日

9.金融工具的风险及其分析 (a) 风险管理政策及组织架构 (b) 风险管理流程

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

(一) 基金基本情况 1.基金名称:上证红利交易型开放式指数证券投资基金

五、财务会计报告 (一) 资产负债表 1.资产负债表(单位:元)

(c) 衍生品工具的风险 衍生品工具的风险是指因汇率、利率、商品价格等变化造成的投资组合价值波动...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

(二) 基金产品说明 1.投资目标:跟踪标的指数的表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化...

2.投资策略:本基金主要采用完全复制法,即完全按照标的指数的构成及其权重构建股票投资组合...

(d) 股票风险 股票价格波动对基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

(三) 基金管理人 1.名称:友邦华泰基金管理有限公司

3. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(e) 股指期货 股指期货基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

(四) 基金托管人 1.名称:招商银行股份有限公司

4. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(f) 融资融券 融资融券是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

(五) 信息披露 1.信息披露网站:中国证监会指定信息披露网站

5. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(g) 基金估值 基金估值是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

(六) 其他相关资料 1.基金注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

6. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(h) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况 (一) 主要会计数据和财务指标

1. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(i) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

(二) 基金净值表现 1.基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(j) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

2.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

3. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(k) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

3.所有者权益(基金净值)变动表(单位:元)

4. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(l) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

4.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

5. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(m) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

5.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

6. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(n) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

6.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

7. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(o) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

7.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

8. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(p) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

8.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

9. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(q) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

9.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

10. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(r) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

10.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

11. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(s) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

11.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

12. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(t) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

12.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

13. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(u) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

13.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

14. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(v) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

14.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

15. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(w) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

15.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

16. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(x) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

16.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

17. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(y) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

17.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

18. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(z) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

18.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

19. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(aa) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

19.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

20. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(ab) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

20.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

21. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(ac) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

21.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

22. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(ad) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

22.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

23. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(ae) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

23.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

24. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(af) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

24.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

25. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(ag) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)

25.基金合同生效以来基金净值变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的比较

26. 资产负债表 2008年6月30日 2007年12月31日

(ah) 基金业绩 基金业绩是指基金所持股票投资的价值未来现金流量和市场利率以外汇汇率以外的市场因素...

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(万股), 占期末资产净值比例(%)