

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
报告送出日期:2009年1月20日
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...

Table with 2 columns: 基金名称 (泰信天天收益), 交易代码 (290001), 基金运作方式 (契约开放式), 基金合同生效日 (2004年02月10日), 报告期末基金份额总额 (4,318,213,730.83), 投资目标 (确保本金安全和资产的充分流动性), 投资策略 (运用久期控制、类别配置和无风险套利等投资策略), 业绩比较基准 (一年期银行定期存款利率), 风险收益特征 (属于风险较低、预期收益较低的证券投资基金品种), 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)

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2008年10月01日-2008年12月31日), 1.本期已实现收益 (-29,566,575.40), 2.本期利润 (-29,566,575.40), 3.期末基金份额净值 (4.318,213,730.83)

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④, 过去三个月 (1.1139%, 0.0015%, 0.7833%, 0.0017%, 0.3756%, 0.0088%)

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
注: 1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额...

注: 1. 本基金合同规定, 本基金自基金合同生效后3个月内为建仓期, 截至报告日本基金的各项投资比例已达到了基金合同“七、基金的投资”部分中“C. 投资组合范围”和“D. 投资组合”所规定的各项比例...

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
报告送出日期:2009年01月21日
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...

Table with 2 columns: 基金名称 (友邦红利ETF), 交易代码 (510808), 基金运作方式 (交易型开放式), 基金合同生效日 (2008年11月17日), 报告期末基金份额总额 (1,589,175,707.00), 投资目标 (紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化), 投资策略 (本基金采取完全复制法, 即按照标的指数的构成及其权重进行投资), 业绩比较基准 (上证红利指数), 风险收益特征 (本基金属股票基金, 风险与收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金), 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)

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2008年10月01日-2008年12月31日), 1.本期已实现收益 (-1,316,737,839.32), 2.本期利润 (-770,582,510.09), 3.加权平均基金份额本期利润 (-0.435), 4.期末基金份额净值 (2.337,498,230.43), 5.期末基金份额净值 (2.337,498,230.43), 6.期末基金份额净值 (2.337,498,230.43)

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④, 过去三个月 (-24.06%, 3.01%, -24.43%, 3.02%, 0.37%, -0.01%)

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
注: 1. 本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数据...

注: 1. 本基金合同于2006年11月17日至2008年12月31日。
2. 本基金已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额...

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
报告送出日期:2009年1月20日
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...

Table with 2 columns: 基金名称 (泰信天天收益), 交易代码 (290001), 基金运作方式 (契约开放式), 基金合同生效日 (2004年02月10日), 报告期末基金份额总额 (4,318,213,730.83), 投资目标 (确保本金安全和资产的充分流动性), 投资策略 (运用久期控制、类别配置和无风险套利等投资策略), 业绩比较基准 (一年期银行定期存款利率), 风险收益特征 (属于风险较低、预期收益较低的证券投资基金品种), 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)

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2008年10月01日-2008年12月31日), 1.本期已实现收益 (-381,344,615.57), 2.本期利润 (-165,655,902.78), 3.加权平均基金份额本期利润 (-0.6060), 4.期末基金份额净值 (1.643,925,592.93), 5.期末基金份额净值 (1.643,925,592.93)

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④, 过去三个月 (-8.50%, 2.19%, -11.18%, 2.26%, 2.68%, -0.13%)

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
注: 1. 本基金合同于2006年12月15日正式生效。
2. 本基金在建仓期内, 基金投资组合中各比例符合基金合同的约定...

注: 1. 本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、基金赎回费等)计入费用后实际收益水平要低于所列数据...

泰信天天收益开放式证券投资基金 2008 第四季度报告

2008年12月31日

2. 2008年11月14日, 本基金采用“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离度绝对值超过了0.5%, 经托管行履行相关程序, 偏离度为0.5136%...

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明, 何 本基金基金经理, 倪 本基金基金经理, 马 本基金基金经理

4.2 报告期内本基金运作遵守法律法规情况
2008年11月14日, 本基金采用“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离度绝对值超过了0.5%, 经托管行履行相关程序, 偏离度为0.5136%...

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
4.3.2 异常交易行为的专项说明
4.3.3 本基金投资行为的专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
1. 行情回顾及运作分析
四季度, 宏观经济的目标是确保金融体系的安全稳定运行, 保持经济平稳较快发展...

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%), 1 固定收益资产 3,487,978,977.76 80.60, 2 权益类资产 106,119,454.75 2.45

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%), 1 银行存款 4,546,090,916.95 1.96, 2 其中: 买入返售金融资产 0.00, 3 其中: 买入返售金融资产 0.00, 4 其中: 买入返售金融资产 0.00

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 摊余成本(元), 占基金资产净值的比例(%), 1 国债券类 0.00, 2 央行票据 1,894,342,106.44 43.87, 3 金融债类 308,832,939.00 7.66, 4 企业债类 59,979,889.84 1.39, 5 企业短期融资券 1,135,671,600.27 26.30, 6 其他 0.00, 7 其他 3,487,978,977.76 80.77, 8 剩余未到期资产 397,985,381.21 9.22

Table with 2 columns: 序号, 行业名称, 金额(元), 占基金资产净值的比例(%), A 农林牧渔 58,889,256 13.93, B 采掘业 22,637,431.41 5.19, C 制造业 914,252,125.43 20.11, D 食品饮料 25,101,330.82 5.67, E 纺织服装、鞋帽 74,003,315.89 16.71, F 房地产业 0.00, G 商业贸易 51,842,193.72 11.62, H 金融业 589,020,291.76 13.22, I 医药生物 117,062,976.66 26.03, J 化学原料 65,096,307.52 14.52, K 其他制造业 20,966,347.53 4.63, L 其他服务业 803,089,345.23 18.07, M 其他 357,269,689.79 7.82, N 其他 117,062,976.66 26.03, O 其他 65,096,307.52 14.52, P 其他 20,966,347.53 4.63, Q 其他 803,089,345.23 18.07, R 其他 357,269,689.79 7.82, S 其他 117,062,976.66 26.03, T 其他 65,096,307.52 14.52, U 其他 20,966,347.53 4.63, V 其他 803,089,345.23 18.07, W 其他 357,269,689.79 7.82, X 其他 117,062,976.66 26.03, Y 其他 65,096,307.52 14.52, Z 其他 20,966,347.53 4.63

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.3 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股票投资明细
5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

注: 1. 上述股票投资组合不包括可替代估值值。
注: 2. 上述股票投资公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
注: 3. 上述股票投资公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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
报告送出日期:2009年01月21日
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...

Table with 2 columns: 基金名称 (友邦红利ETF), 交易代码 (510808), 基金运作方式 (交易型开放式), 基金合同生效日 (2008年11月17日), 报告期末基金份额总额 (1,589,175,707.00), 投资目标 (紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化), 投资策略 (本基金采取完全复制法, 即按照标的指数的构成及其权重进行投资), 业绩比较基准 (上证红利指数), 风险收益特征 (本基金属股票基金, 风险与收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金), 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)

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2008年10月01日-2008年12月31日), 1.本期已实现收益 (-1,316,737,839.32), 2.本期利润 (-770,582,510.09), 3.加权平均基金份额本期利润 (-0.435), 4.期末基金份额净值 (2.337,498,230.43), 5.期末基金份额净值 (2.337,498,230.43)

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④, 过去三个月 (-24.06%, 3.01%, -24.43%, 3.02%, 0.37%, -0.01%)

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
注: 1. 本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数据...

泰信优质生活股票型证券投资基金 2008 第四季度报告

2008年12月31日

注: 1. 本基金合同于2006年12月15日正式生效。
2. 本基金在建仓期内, 基金投资组合中各比例符合基金合同的约定...

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明, 何 本基金基金经理, 倪 本基金基金经理, 马 本基金基金经理

4.2 报告期内本基金运作遵守法律法规情况
2008年11月14日, 本基金采用“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离度绝对值超过了0.5%, 经托管行履行相关程序, 偏离度为0.5136%...

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
4.3.2 异常交易行为的专项说明
4.3.3 本基金投资行为的专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
1. 行情回顾及运作分析
四季度, 宏观经济的目标是确保金融体系的安全稳定运行, 保持经济平稳较快发展...

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%), 1 固定收益资产 3,487,978,977.76 80.60, 2 权益类资产 106,119,454.75 2.45

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%), 1 银行存款 4,546,090,916.95 1.96, 2 其中: 买入返售金融资产 0.00, 3 其中: 买入返售金融资产 0.00, 4 其中: 买入返售金融资产 0.00

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 摊余成本(元), 占基金资产净值的比例(%), 1 国债券类 0.00, 2 央行票据 1,894,342,106.44 43.87, 3 金融债类 308,832,939.00 7.66, 4 企业债类 59,979,889.84 1.39, 5 企业短期融资券 1,135,671,600.27 26.30, 6 其他 0.00, 7 其他 3,487,978,977.76 80.77, 8 剩余未到期资产 397,985,381.21 9.22

Table with 2 columns: 序号, 行业名称, 金额(元), 占基金资产净值的比例(%), A 农林牧渔 58,889,256 13.93, B 采掘业 22,637,431.41 5.19, C 制造业 914,252,125.43 20.11, D 食品饮料 25,101,330.82 5.67, E 纺织服装、鞋帽 74,003,315.89 16.71, F 房地产业 0.00, G 商业贸易 51,842,193.72 11.62, H 金融业 589,020,291.76 13.22, I 医药生物 117,062,976.66 26.03, J 化学原料 65,096,307.52 14.52, K 其他制造业 20,966,347.53 4.63, L 其他服务业 803,089,345.23 18.07, M 其他 357,269,689.79 7.82, N 其他 117,062,976.66 26.03, O 其他 65,096,307.52 14.52, P 其他 20,966,347.53 4.63, Q 其他 803,089,345.23 18.07, R 其他 357,269,689.79 7.82, S 其他 117,062,976.66 26.03, T 其他 65,096,307.52 14.52, U 其他 20,966,347.53 4.63, V 其他 803,089,345.23 18.07, W 其他 357,269,689.79 7.82, X 其他 117,062,976.66 26.03, Y 其他 65,096,307.52 14.52, Z 其他 20,966,347.53 4.63

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%), 1 招商银行 176,667,000.00 0.60, 2 浦发银行 176,667,000.00 0.60, 3 中信证券 3,524,640.00 0.00, 4 其中: 政策性金融债 0.00, 5 企业短期融资券 0.00, 6 可转债 14,329,378.00 0.00, 7 其他 0.00, 8 合计 104,521,018.00 0.37, 9 其他 397,766,090.00

Table with 2 columns: 序号, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%), A 农林牧渔 58,889,256 13.93, B 采掘业 22,637,431.41 5.19, C 制造业 914,252,125.43 20.11, D 食品饮料 25,101,330.82 5.67, E 纺织服装、鞋帽 74,003,315.89 16.71, F 房地产业 0.00, G 商业贸易 51,842,193.72 11.62, H 金融业 589,020,291.76 13.22, I 医药生物 117,062,976.66 26.03, J 化学原料 65,096,307.52 14.52, K 其他制造业 20,966,347.53 4.63, L 其他服务业 803,089,345.23 18.07, M 其他 357,269,689.79 7.82, N 其他 117,062,976.66 26.03, O 其他 65,096,307.52 14.52, P 其他 20,966,347.53 4.63, Q 其他 803,089,345.23 18.07, R 其他 357,269,689.79 7.82, S 其他 117,062,976.66 26.03, T 其他 65,096,307.52 14.52, U 其他 20,966,347.53 4.63, V 其他 803,089,345.23 18.07, W 其他 357,269,689.79 7.82, X 其他 117,062,976.66 26.03, Y 其他 65,096,307.52 14.52, Z 其他 20,966,347.53 4.63

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 摊余成本(元), 占基金资产净值的比例(%), 1 国债券类 0.00, 2 央行票据 1,894,342,106.44 43.87, 3 金融债类 308,832,939.00 7.66, 4 企业债类 59,979,889.84 1.39, 5 企业短期融资券 1,135,671,600.27 26.30, 6 其他 0.00, 7 其他 3,487,978,977.76 80.77, 8 剩余未到期资产 397,985,381.21 9.22

Table with 2 columns: 序号, 行业名称, 金额(元), 占基金资产净值的比例(%), A 农林牧渔 58,889,256 13.93, B 采掘业 22,637,431.41 5.19, C 制造业 914,252,125.43 20.11, D 食品饮料 25,101,330.82 5.67, E 纺织服装、鞋帽 74,003,315.89 16.71, F 房地产业 0.00, G 商业贸易 51,842,193.72 11.62, H 金融业 589,020,291.76 13.22, I 医药生物 117,062,976.66 26.03, J 化学原料 65,096,307.52 14.52, K 其他制造业 20,966,347.53 4.63, L 其他服务业 803,089,345.23 18.07, M 其他 357,269,689.79 7.82, N 其他 117,062,976.66 26.03, O 其他 65,096,307.52 14.52, P 其他 20,966,347.53 4.63, Q 其他 803,089,345.23 18.07, R 其他 357,269,689.79 7.82, S 其他 117,062,976.66 26.03, T 其他 65,096,307.52 14.52, U 其他 20,966,347.53 4.63, V 其他 803,089,345.23 18.07, W 其他 357,269,689.79 7.82, X 其他 117,062,976.66 26.03, Y 其他 65,096,307.52 14.52, Z 其他 20,966,347.53 4.63

注: 1. 上述股票投资组合不包括可替代估值值。
注: 2. 上述股票投资公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
注: 3. 上述股票投资公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

泰信优质生活股票型证券投资基金 2008 第四季度报告

Table with 2 columns: 基金名称 (友邦红利ETF), 交易代码 (510808), 基金运作方式 (交易型开放式), 基金合同生效日 (2008年11月17日), 报告期末基金份额总额 (1,589,175,707.00), 投资目标 (紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化), 投资策略 (本基金采取完全复制法, 即按照标的指数的构成及其权重进行投资), 业绩比较基准 (上证红利指数), 风险收益特征 (本基金属股票基金, 风险与收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金), 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)

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2008年10月01日-2008年12月31日), 1.本期已实现收益 (-1,316,737,839.32), 2.本期利润 (-770,582,510.09), 3.加权平均基金份额本期利润 (-0.435), 4.期末基金份额净值 (2.337,498,230.43), 5.期末基金份额净值 (2.337,498,230.43)

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④, 过去三个月 (-24.06%, 3.01%, -24.43%, 3.02%, 0.37%, -0.01%)

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
注: 1. 本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数据...

注: 1. 本基金合同于2006年12月15日正式生效。
2. 本基金在建仓期内, 基金投资组合中各比例符合基金合同的约定...

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明, 何 本基金基金经理, 倪 本基金基金经理, 马 本基金基金经理

4.2 报告期内本基金运作遵守法律法规情况
2008年11月14日, 本基金采用“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离度绝对值超过了0.5%, 经托管行履行相关程序, 偏离度为0.5136%...

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
4.3.2 异常交易行为的专项说明
4.3.3 本基金投资行为的专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
1. 行情回顾及运作分析
四季度, 宏观经济的目标是确保金融体系的安全稳定运行, 保持经济平稳较快发展...

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%), 1 固定收益资产 3,487,978,977.76 80.60, 2 权益类资产 106,119,454.75 2.45

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%), 1 银行存款 4,546,090,916.95 1.96, 2 其中: 买入返售金融资产 0.00, 3 其中: 买入返售金融资产 0.00, 4 其中: 买入返售金融资产 0.00

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 摊余成本(元), 占基金资产净值的比例(%), 1 国债券类 0.00, 2 央行票据 1,894,342,106.44 43.87, 3 金融债类 308,832,939.00 7.66, 4 企业债类 59,979,889.84 1.39, 5 企业短期融资券 1,135,671,600.27 26.30, 6 其他 0.00, 7 其他 3,487,978,977.76 80.77, 8 剩余未到期资产 397,985,381.21 9.22

Table with 2 columns: 序号, 行业名称, 金额(元), 占基金资产净值的比例(%), A 农林牧渔 58,889,256 13.93, B 采掘业 22,637,431.41 5.19, C 制造业 914,252,125.43 20.11, D 食品饮料 25,101,330.82 5.67, E 纺织服装、鞋帽 74,003,315.89 16.71, F 房地产业 0.00, G 商业贸易 51,842,193.72 11.62, H 金融业 589,020,291.76 13.22, I 医药生物 117,062,976.66 26.03, J 化学原料 65,096,307.52 14.52, K 其他制造业 20,966,347.53 4.63, L 其他服务业 803,089,345.23 18.07, M 其他 357,269,689.79 7.82, N 其他 117,062,976.66 26.03, O 其他 65,096,307.52 14.52, P 其他 20,966,347.53 4.63, Q 其他 803,089,345.23 18.07, R 其他 357,269,689.79 7.82, S 其他 117,062,976.66 26.03, T 其他 65,096,307.52 14.52, U 其他 20,966,347.53 4.63, V 其他 803,089,345.23 18.07, W 其他 357,269,689.79 7.82, X 其他 117,062,976.66 26.03, Y 其他 65,096,307.52 14.52, Z 其他 20,966,347.53 4.63

注: 1. 上述股票投资组合不包括可替代估值值。
注: 2. 上述股票投资公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
注: 3. 上述股票投资公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细