

泰信蓝筹精选股票型证券投资基金

2009 第二季度报告

2009年6月30日

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7月20日

1.1 重要提示
本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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

1.2 基金概况
基金名称:泰信蓝筹精选股票
基金代码:210006
基金运作方式:契约型开放式

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 28,629,175.47
2.本期利润 66,199,013.26
3.加权平均基金份额本期利润 0.0609

3.2 基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.0606,同比增长率为13.68%,同期业绩比较基准收益率为1.31%。

3.3 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率乘以55%加上上证国债指数收益率乘以45%。

3.4 基金管理人承诺
基金管理人承诺严格遵守法律法规,恪守基金管理人职业道德,勤勉尽责,诚实信用,为基金份额持有人谋求最大利益。

2. 本基金建仓期为2009年4月22日至2009年6月30日。截至建仓期结束,本基金投资组合中股票资产占基金资产的60.95%,符合基金合同关于股票资产占基金资产比例不低于40%的规定。

4.1 基金经理 魏金强 基金经理简介
姓名:魏金强 职务:基金经理
任职日期:2009年4月22日 离任日期:- 证券从业年限:13

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守情况的说明
在本报告期内,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》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规的规定,恪守基金管理人职业道德,勤勉尽责,诚实信用,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易制度的执行情况
根据《证券投资基金公平交易制度指导意见》和中国证监会《证券投资基金公平交易管理办法》,本基金管理人严格执行公平交易制度,确保不同投资组合在交易执行过程中得到公平对待。

4.4 异常交易行为的专项说明
本基金在本报告期内不存在异常交易行为。本基金在报告期内不存在异常交易行为。

4.5 投资组合报告
截至2009年6月30日,本基金资产组合如下:
股票资产 897,108,061.81 占基金总资产比例 78.82%

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)
1 权益投资 897,108,061.81 78.82%

5.2 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
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

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权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

5.5 报告期末按行业分类的股票投资组合
代码 行业名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
序号 期货品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

5.8 投资组合报告附注
5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.2 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。

5.8.3 基金合同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。

5.8.4 基金合同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。

5.8.5 基金合同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。

5.8.6 基金合同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。

5.8.7 基金合同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。

5.8.8 基金合同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。

5.8.9 基金合同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。

1. 权益投资 897,108,061.81 78.82%
其中:股票 897,108,061.81 78.82%

2. 其中:债券 0 0.00%
固定收益投资 0 0.00%

3. 金融衍生品投资 0 0.00%
其中:买入返售金融资产 0 0.00%

4. 银行存款和结算备付金合计 262,238,031.56 22.16%
其他资产 23,929,172.72 2.02%

5. 报告期末按行业分类的股票投资组合
代码 行业名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

6. 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
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

8. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

9. 报告期末按行业分类的股票投资组合
代码 行业名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

10. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
序号 期货品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

11. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

12. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

13. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

14. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

15. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

16. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

17. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

18. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

19. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

20. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

21. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

22. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1. 权益投资 897,108,061.81 78.82%
其中:股票 897,108,061.81 78.82%

2. 其中:债券 0 0.00%
固定收益投资 0 0.00%

3. 金融衍生品投资 0 0.00%
其中:买入返售金融资产 0 0.00%

4. 银行存款和结算备付金合计 262,238,031.56 22.16%
其他资产 23,929,172.72 2.02%

5. 报告期末按行业分类的股票投资组合
代码 行业名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

6. 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
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

8. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

9. 报告期末按行业分类的股票投资组合
代码 行业名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

10. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
序号 期货品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

11. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

12. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

13. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

14. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

15. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

16. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

17. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

18. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

19. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

20. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

21. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

22. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

23. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

中银动态策略股票型证券投资基金

2009 第二季度报告

2009年6月30日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2009年7月20日

1.1 重要提示
本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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

1.2 基金概况
基金名称:中银动态策略股票
基金代码:160805
基金运作方式:契约型开放式

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 431,074,815.40
2.本期利润 512,019,702.88

3.2 基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.9181,同比增长率为19.40%,同期业绩比较基准收益率为1.16%。

3.3 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率乘以55%加上上证国债指数收益率乘以45%。

3.4 基金管理人承诺
基金管理人承诺严格遵守法律法规,恪守基金管理人职业道德,勤勉尽责,诚实信用,为基金份额持有人谋求最大利益。

2. 本基金的投资策略
本基金采取自上而下的资产配置策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

2.1 资产配置策略
本基金根据对宏观经济、政策、市场、行业、个股的综合分析,动态调整资产配置比例,追求基金资产的长期增值。

2.2 股票投资策略
本基金采取自上而下的选股策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

2.3 固定收益投资策略
本基金采取自上而下的固定收益投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

2.4 衍生品投资策略
本基金采取自上而下的衍生品投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

2.5 其他资产投资策略
本基金采取自上而下的其他资产投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

2.6 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率乘以55%加上上证国债指数收益率乘以45%。

2.7 基金管理人承诺
基金管理人承诺严格遵守法律法规,恪守基金管理人职业道德,勤勉尽责,诚实信用,为基金份额持有人谋求最大利益。

2.8 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率乘以55%加上上证国债指数收益率乘以45%。

2.9 基金管理人承诺
基金管理人承诺严格遵守法律法规,恪守基金管理人职业道德,勤勉尽责,诚实信用,为基金份额持有人谋求最大利益。

2.10 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率乘以55%加上上证国债指数收益率乘以45%。

2.11 基金管理人承诺
基金管理人承诺严格遵守法律法规,恪守基金管理人职业道德,勤勉尽责,诚实信用,为基金份额持有人谋求最大利益。

2.12 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率乘以55%加上上证国债指数收益率乘以45%。

2.13 基金管理人承诺
基金管理人承诺严格遵守法律法规,恪守基金管理人职业道德,勤勉尽责,诚实信用,为基金份额持有人谋求最大利益。

中银收益混合型证券投资基金

2009 第二季度报告

2009年6月30日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2009年7月20日

1.1 重要提示
本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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

1.2 基金概况
基金名称:中银收益混合
基金代码:160806
基金运作方式:契约型开放式

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 246,581,686.99
2.本期利润 555,833,600.44

3.2 基金净值表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.4144,同比增长率为15.06%,同期业绩比较基准收益率为1.30%。

3.3 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率乘以55%加上上证国债指数收益率乘以45%。

3.4 基金管理人承诺
基金管理人承诺严格遵守法律法规,恪守基金管理人职业道德,勤勉尽责,诚实信用,为基金份额持有人谋求最大利益。

2. 本基金的投资策略
本基金采取自上而下的资产配置策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

2.1 资产配置策略
本基金根据对宏观经济、政策、市场、行业、个股的综合分析,动态调整资产配置比例,追求基金资产的长期增值。

2.2 股票投资策略
本基金采取自上而下的选股策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

2.3 固定收益投资策略
本基金采取自上而下的固定收益投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

2.4 衍生品投资策略
本基金采取自上而下的衍生品投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

2.5 其他资产投资策略
本基金采取自上而下的其他资产投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

2.6 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率乘以55%加上上证国债指数收益率乘以45%。

2.7 基金管理人承诺
基金管理人承诺严格遵守法律法规,恪守基金管理人职业道德,勤勉尽责,诚实信用,为基金份额持有人谋求最大利益。

2.8 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率乘以55%加上上证国债指数收益率乘以45%。

2.9 基金管理人承诺
基金管理人承诺严格遵守法律法规,恪守基金管理人职业道德,勤勉尽责,诚实信用,为基金份额持有人谋求最大利益。

2.10 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率乘以55%加上上证国债指数收益率乘以45%。

2.11 基金管理人承诺
基金管理人承诺严格遵守法律法规,恪守基金管理人职业道德,勤勉尽责,诚实信用,为基金份额持有人谋求最大利益。

2.12 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率乘以55%加上上证国债指数收益率乘以45%。

2.13 基金管理人承诺
基金管理人承诺严格遵守法律法规,恪守基金管理人职业道德,勤勉尽责,诚实信用,为基金份额持有人谋求最大利益。

3.5 基金管理人承诺
基金管理人承诺严格遵守法律法规,恪守基金管理人职业道德,勤勉尽责,诚实信用,为基金份额持有人谋求最大利益。

3.6 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率乘以55%加上上证国债指数收益率乘以45%。

3.7 基金管理人承诺
基金管理人承诺严格遵守法律法规,恪守基金管理人职业道德,勤勉尽责,诚实信用,为基金份额持有人谋求最大利益。

3.8 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率乘以55%加上上证国债指数收益率乘以45%。

中银基金管理有限公司
2009年7月20日