

泰达荷银风险预算混合型证券投资基金 2009 第二季度报告

基金管理人:泰达荷银基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司 报告送出日期:2009年07月20日

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责任。泰达荷银基金管理有限公司根据基金合同规定,于2009年7月15日复核了本基金的财务指标、净值表现和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。

§2 基金产品概况 基金名称:泰达荷银风险预算混合 基金代码:162210 基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日:2008年04月05日

§3 主要财务指标和基金净值表现 单位:人民币元 主要财务指标 开始日期 2009年04月01日 结束日期 2009年06月30日

阶段 净值增长率 标准差 业绩比较基准 收益差 ①-③ ②-④ 过去三个月 14.61% 0.82% 5.45% 0.32% 9.16% 0.59%

注:1.本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 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责任。

§4 管理人报告 4.1 基金管理人及基金经理简介 姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

基金经理:沈晓 2008年03月06日 7年 负责本基金的投资管理,担任投资决策委员会成员,兼任风险管理部总经理。

注:基金管理人及基金经理简介 基金管理人及基金经理简介 基金管理人及基金经理简介

§5 投资组合报告 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 96,524,319.39 41.52 其中:股票 96,524,319.39 41.52 2 固定收益投资 90,004,742.00 38.72

§6 开放式基金资产净值 截至2009年6月30日,本基金资产净值为151,411,529.40元,基金份额为1,116,044,294.64份。

§7 投资组合报告 7.1 权益投资 7.1.1 报告期末权益投资概况 7.1.2 报告期末权益投资明细

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(%)

7.2 固定收益投资 7.2.1 报告期末固定收益投资概况 7.2.2 报告期末固定收益投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

§8 投资组合报告 8.1 投资组合报告 8.2 投资组合报告 8.3 投资组合报告

§9 投资组合报告 9.1 投资组合报告 9.2 投资组合报告 9.3 投资组合报告

§10 投资组合报告 10.1 投资组合报告 10.2 投资组合报告 10.3 投资组合报告

§11 投资组合报告 11.1 投资组合报告 11.2 投资组合报告 11.3 投资组合报告

§12 投资组合报告 12.1 投资组合报告 12.2 投资组合报告 12.3 投资组合报告

§13 投资组合报告 13.1 投资组合报告 13.2 投资组合报告 13.3 投资组合报告

§14 投资组合报告 14.1 投资组合报告 14.2 投资组合报告 14.3 投资组合报告

§15 投资组合报告 15.1 投资组合报告 15.2 投资组合报告 15.3 投资组合报告

泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金 2009 第二季度报告

基金管理人:泰达荷银基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司 报告送出日期:2009年07月20日

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责任。泰达荷银基金管理有限公司根据基金合同规定,于2009年7月15日复核了本基金的财务指标、净值表现和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。

§2 基金产品概况 基金名称:泰达荷银价值优化型成长类行业 基金代码:162201 基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日:2008年4月25日

§3 主要财务指标和基金净值表现 单位:人民币元 主要财务指标 开始日期 2009年04月01日 结束日期 2009年06月30日

阶段 净值增长率 标准差 业绩比较基准 收益差 ①-③ ②-④ 过去三个月 8.99% 0.96% 7.35% 0.80% 1.64% 0.16%

注:1.本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 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责任。

§4 管理人报告 4.1 基金管理人及基金经理简介 姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

基金经理:王勇 2008年05月05日 9年 负责本基金的投资管理,担任投资决策委员会成员,兼任风险管理部总经理。

注:基金管理人及基金经理简介 基金管理人及基金经理简介 基金管理人及基金经理简介

§5 投资组合报告 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 817,198,707.99 73.27 其中:股票 817,198,707.99 73.27

§6 开放式基金资产净值 截至2009年6月30日,本基金资产净值为1,115,364,748.3元,基金份额为1,115,364,748.3份。

§7 投资组合报告 7.1 权益投资 7.1.1 报告期末权益投资概况 7.1.2 报告期末权益投资明细

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(%)

7.2 固定收益投资 7.2.1 报告期末固定收益投资概况 7.2.2 报告期末固定收益投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

§8 投资组合报告 8.1 投资组合报告 8.2 投资组合报告 8.3 投资组合报告

§9 投资组合报告 9.1 投资组合报告 9.2 投资组合报告 9.3 投资组合报告

§10 投资组合报告 10.1 投资组合报告 10.2 投资组合报告 10.3 投资组合报告

§11 投资组合报告 11.1 投资组合报告 11.2 投资组合报告 11.3 投资组合报告

§12 投资组合报告 12.1 投资组合报告 12.2 投资组合报告 12.3 投资组合报告

§13 投资组合报告 13.1 投资组合报告 13.2 投资组合报告 13.3 投资组合报告

§14 投资组合报告 14.1 投资组合报告 14.2 投资组合报告 14.3 投资组合报告

§15 投资组合报告 15.1 投资组合报告 15.2 投资组合报告 15.3 投资组合报告

泰达荷银集利债券型证券投资基金 2009 第二季度报告

基金管理人:泰达荷银基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司 报告送出日期:2009年07月20日

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责任。泰达荷银基金管理有限公司根据基金合同规定,于2009年7月15日复核了本基金的财务指标、净值表现和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。

§2 基金产品概况 基金名称:泰达荷银集利债券 基金代码:162202 基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日:2008年4月25日

§3 主要财务指标和基金净值表现 单位:人民币元 主要财务指标 开始日期 2009年04月01日 结束日期 2009年06月30日

阶段 净值增长率 标准差 业绩比较基准 收益差 ①-③ ②-④ 过去三个月 0.57% 0.18% 2.21% 0.17% -1.64% 0.01%

注:1.本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 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责任。

§4 管理人报告 4.1 基金管理人及基金经理简介 姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

基金经理:沈晓 2008年09月26日 7年 负责本基金的投资管理,担任投资决策委员会成员,兼任风险管理部总经理。

注:基金管理人及基金经理简介 基金管理人及基金经理简介 基金管理人及基金经理简介

§5 投资组合报告 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 164,389,667.86 106.58 其中:股票 164,389,667.86 106.58

§6 开放式基金资产净值 截至2009年6月30日,本基金资产净值为1,164,389,667.86元,基金份额为1,164,389,667.86份。

§7 投资组合报告 7.1 权益投资 7.1.1 报告期末权益投资概况 7.1.2 报告期末权益投资明细

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(%)

7.2 固定收益投资 7.2.1 报告期末固定收益投资概况 7.2.2 报告期末固定收益投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

§8 投资组合报告 8.1 投资组合报告 8.2 投资组合报告 8.3 投资组合报告

§9 投资组合报告 9.1 投资组合报告 9.2 投资组合报告 9.3 投资组合报告

§10 投资组合报告 10.1 投资组合报告 10.2 投资组合报告 10.3 投资组合报告

§11 投资组合报告 11.1 投资组合报告 11.2 投资组合报告 11.3 投资组合报告

§12 投资组合报告 12.1 投资组合报告 12.2 投资组合报告 12.3 投资组合报告

§13 投资组合报告 13.1 投资组合报告 13.2 投资组合报告 13.3 投资组合报告

§14 投资组合报告 14.1 投资组合报告 14.2 投资组合报告 14.3 投资组合报告

§15 投资组合报告 15.1 投资组合报告 15.2 投资组合报告 15.3 投资组合报告