

泰达荷银价值优化型成长行业证券投资基金 2009年半年度报告摘要

2009年6月30日

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8月25日

1.1 重要提示
基金管理人泰达荷银基金管理有限公司的董事会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,并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经本基金独立董事审核,并于2009年8月25日出具了书面审核意见。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年8月20日复核了本报告中的财务指标、净值信息、利润分配方案、财务会计报告、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。
本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,也不保证基金份额持有人的资产不受损失,投资者有风险,投资需谨慎,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告财务资料未经审计。
本报告期自2009年1月1日起至2009年6月30日止。
2 基金简介
2.1 基金概况
基金名称:泰达荷银价值优化型成长行业证券投资基金
基金简称:泰达荷银成长
基金代码:162201
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2003年4月25日
报告期末基金份额总额:1,116,044,294.64份

2.2 基金产品说明
投资目标:本基金主要投资于成长行业类别中在价值相对低估,并与同类上市公司相比具有更高增长潜力的上市公司,在有效控制投资组合风险的前提下,为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略:采用"自上而下"的投资方法,具体体现在资产配置和行业及个股选择的全过程。
业绩比较基准:65%新华富时1600成长行业指数+35%*上证综指
风险收益特征:本基金在证券投资基金中属于中高风险的基金品种。

2.3 基金管理人及基金托管人
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
名称:泰达荷银基金管理有限公司
地址:天津
法定代表人:张东生
总经理:王勇
基金经理:王勇

2.4 信息披露方式
基金半年度报告正文的载置网站: http://www.tedaboy.com.cn
基金半年度报告备置地点:基金管理人、基金托管人的住所

3 主要财务数据和净值表现
3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
3.1.2 期末数据和指标

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 单位:人民币元 (Unit: RMB Yuan). Rows include 1.1 期间数据和指标, 1.2 期末数据和指标.

注:1.本期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,本期利润按本期实现收益计算。
2.所述基金业绩指标不包括基金份额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字。

3.2 基金净值表现
3.2.1 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

Table with 5 columns: 阶段 (Period), 净值增长①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④.

注:本基金业绩比较基准采用65%新华富时1600成长行业指数+35%*上证综指,上述业绩比较基准的样本为在上海证券交易所上市交易的、除净息债外的国货品牌,样本国债的剩余期限分布均匀,收益率曲线较为完整,流动性与本基金资产组合资产流动性相匹配,能较好地反映本基金资产组合的利率风险和信用风险。
新财富A600成长行业指数是从新财富中国A600成长行业指数中剔除停牌类个股,成份股按照基金合同已广泛覆盖本基金主要持仓股票进行选取,成份股权重与本基金持仓权重一致,能较好地反映本基金资产组合的收益表现。

3.2.2 自基金合同生效以来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

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 单位:人民币元 (Unit: RMB Yuan). Rows include 1. 期初基金份额净值, 2. 期末基金份额净值, 3. 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.

注:本基金在建仓期未及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1.1 基金管理人及其基金经理简介
4.1.2 基金经理简介

注:本基金在报告期内未发生异常交易。

4.2 基金管理人内部控制制度的完善性
4.3 公平交易制度的执行情况
4.4 基金管理人参与股指期货交易的情况

4.5 基金管理人参与国债期货交易的情况

4.6 基金管理人参与融资融券业务的情况

4.7 基金管理人参与股指期货交易的情况

4.8 基金管理人参与国债期货交易的情况

4.9 基金管理人参与融资融券业务的情况

4.10 基金管理人参与股指期货交易的情况

4.11 基金管理人参与国债期货交易的情况

4.12 基金管理人参与融资融券业务的情况

4.13 基金管理人参与股指期货交易的情况

4.14 基金管理人参与国债期货交易的情况

4.15 基金管理人参与融资融券业务的情况

4.16 基金管理人参与股指期货交易的情况

4.17 基金管理人参与国债期货交易的情况

4.18 基金管理人参与融资融券业务的情况

4.19 基金管理人参与股指期货交易的情况

4.20 基金管理人参与国债期货交易的情况

4.21 基金管理人参与融资融券业务的情况

4.22 基金管理人参与股指期货交易的情况

4.23 基金管理人参与国债期货交易的情况

泰达荷银价值优化型成长行业证券投资基金
资产负债表、利润表、现金流量表、所有者权益变动表、财务报表附注

6.1 资产负债表
6.2 利润表
6.3 现金流量表
6.4 所有者权益变动表

6.5 财务报表附注
6.5.1 会计政策和会计估计变更及差错更正的说明
6.5.2 差错更正的说明

6.5.3 合并财务报表的编制方法
6.5.4 关联方关系及其交易的披露
6.5.5 金融工具
6.5.6 公允价值
6.5.7 投资合同的变更
6.5.8 外币折算
6.5.9 税项
6.5.10 承诺及或有事项
6.5.11 资产负债表日后事项
6.5.12 其他重要事项

6.5.13 其他重要事项
6.5.14 其他重要事项
6.5.15 其他重要事项

6.5.16 其他重要事项
6.5.17 其他重要事项
6.5.18 其他重要事项

6.5.19 其他重要事项
6.5.20 其他重要事项
6.5.21 其他重要事项

6.5.22 其他重要事项
6.5.23 其他重要事项
6.5.24 其他重要事项

6.5.25 其他重要事项
6.5.26 其他重要事项
6.5.27 其他重要事项

6.5.28 其他重要事项
6.5.29 其他重要事项
6.5.30 其他重要事项

6.5.31 其他重要事项
6.5.32 其他重要事项
6.5.33 其他重要事项

6.5.34 其他重要事项
6.5.35 其他重要事项
6.5.36 其他重要事项

6.5.37 其他重要事项
6.5.38 其他重要事项
6.5.39 其他重要事项

6.5.40 其他重要事项
6.5.41 其他重要事项
6.5.42 其他重要事项

6.5.43 其他重要事项
6.5.44 其他重要事项
6.5.45 其他重要事项

6.5.46 其他重要事项
6.5.47 其他重要事项
6.5.48 其他重要事项

6.5.49 其他重要事项
6.5.50 其他重要事项
6.5.51 其他重要事项

6.5.52 其他重要事项
6.5.53 其他重要事项
6.5.54 其他重要事项

6.5.55 其他重要事项
6.5.56 其他重要事项
6.5.57 其他重要事项

6.5.58 其他重要事项
6.5.59 其他重要事项
6.5.60 其他重要事项

6.5.61 其他重要事项
6.5.62 其他重要事项
6.5.63 其他重要事项

6.5.64 其他重要事项
6.5.65 其他重要事项
6.5.66 其他重要事项

6.5.67 其他重要事项
6.5.68 其他重要事项
6.5.69 其他重要事项

6.5.70 其他重要事项
6.5.71 其他重要事项
6.5.72 其他重要事项

6.5.73 其他重要事项
6.5.74 其他重要事项
6.5.75 其他重要事项

6.5.76 其他重要事项
6.5.77 其他重要事项
6.5.78 其他重要事项

6.5.79 其他重要事项
6.5.80 其他重要事项
6.5.81 其他重要事项

6.5.82 其他重要事项
6.5.83 其他重要事项
6.5.84 其他重要事项

6.5.85 其他重要事项
6.5.86 其他重要事项
6.5.87 其他重要事项

6.5.88 其他重要事项
6.5.89 其他重要事项
6.5.90 其他重要事项

6.5.91 其他重要事项
6.5.92 其他重要事项
6.5.93 其他重要事项

6.5.94 其他重要事项
6.5.95 其他重要事项
6.5.96 其他重要事项

6.5.97 其他重要事项
6.5.98 其他重要事项
6.5.99 其他重要事项

6.5.100 其他重要事项
6.5.101 其他重要事项
6.5.102 其他重要事项

6.5.103 其他重要事项
6.5.104 其他重要事项
6.5.105 其他重要事项

6.5.106 其他重要事项
6.5.107 其他重要事项
6.5.108 其他重要事项

6.5.109 其他重要事项
6.5.110 其他重要事项
6.5.111 其他重要事项

6.5.112 其他重要事项
6.5.113 其他重要事项
6.5.114 其他重要事项

6.5.115 其他重要事项
6.5.116 其他重要事项
6.5.117 其他重要事项

6.5.118 其他重要事项
6.5.119 其他重要事项
6.5.120 其他重要事项

6.5.121 其他重要事项
6.5.122 其他重要事项
6.5.123 其他重要事项

6.5.124 其他重要事项
6.5.125 其他重要事项
6.5.126 其他重要事项

6.5.127 其他重要事项
6.5.128 其他重要事项
6.5.129 其他重要事项

6.5.130 其他重要事项
6.5.131 其他重要事项
6.5.132 其他重要事项

6.4.8.2 基金托管费
单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目 (Item), 2009年1月1日至2009年6月30日, 2008年1月1日至2008年6月30日.

注:本基金管理人泰达荷银基金管理有限公司的托管费按照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。其计算公式为:日计提托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方发生的银行间债券市场债务工具交易
单位:人民币元

Table with 6 columns: 债券交易名称, 基金买入, 基金卖出, 交易金额, 利息收入, 交易金额, 利息支出.

6.4.8.4 各关联方为基金提供服务的费用情况
6.4.8.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.2 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.3 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.5 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.6 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.7 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.8 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.9 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.10 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.11 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.12 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.13 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.14 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.15 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.16 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.17 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.18 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.19 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.20 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.21 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.22 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.23 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.24 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.25 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.26 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.27 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.28 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.29 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.30 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.31 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.32 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.33 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.34 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.35 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.36 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.37 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.38 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.39 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.39 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.40 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.41 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.42 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.43 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.44 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.45 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.46 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.46 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.47 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.47 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.48 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.48 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.49 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.49 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.50 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.50 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.51 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.51 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.52 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.52 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.53 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.53 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.54 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.54 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.55 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.55 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.56 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.56 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.57 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.57 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.58 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.58 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.59 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.59 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.60 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.60 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.61 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.61 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.62 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.4.3 期末基金资产组合中前10名债券投资明细
单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计买入金额 (This Period Cumulative Buy Amount), 占期初基金资产净值比例(%) (Percentage of Beginning Fund Net Asset Value).

注:本基金管理人泰达荷银基金管理有限公司的托管费按照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。其计算公式为:日计提托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方发生的银行间债券市场债务工具交易
单位:人民币元

Table with 6 columns: 债券交易名称, 基金买入, 基金卖出, 交易金额, 利息收入, 交易金额, 利息支出.

6.4.8.4 各关联方为基金提供服务的费用情况
6.4.8.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.2 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.3 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.5 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.6 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.7 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.8 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.9 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.10 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.11 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.12 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.13 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.14 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.15 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.16 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.17 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.18 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.19 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.19 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.20 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.20 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.21 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.21 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.22 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.22 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.23 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.23 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.24 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.24 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.25 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.25 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.26 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.26 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.27 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.27 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.28 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.28 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.29 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.29 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.30 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.30 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.31 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.31 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.32 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.32 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.33 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.33 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.34 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.34 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.35 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.35 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.36 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.36 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.37 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.37 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.38 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.38 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.39 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.39 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.40 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.40 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.41 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.41 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.42 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.42 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.43 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.43 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.44 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.44 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.45 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.45 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.46 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.46 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.47 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.47 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.48 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.48 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.49 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况