

泰达荷银效率优选混合型证券投资基金(LOF) 2009年半年度报告摘要

基金管理人:泰达荷银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设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、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人泰达荷银基金管理有限公司承诺,本基金在运作过程中,基金资产投资于中国证监会核准上市交易的股票、债券及其他金融工具,但不得投资于高风险品种,基金的投资组合并不代表其未来表现,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其更新。

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。

本报告日期 2009年1月1日起至2009年6月30日止

1.2 基金简介
基金名称 泰达荷银效率优选混合(LOF)

基金代码 162207

基金运作方式 上市契约型开放式基金(LOF)

基金合同生效日 2009年5月12日

报告期末基金份额总额 6,097,703,052.46份

交易场所 深圳证券交易所

上市日期 2009年7月21日

2.2 基金产品说明
投资目标 本基金具有较高投资效率的上市公司,兼做跨市场投资,力争为投资者获得超越业绩比较基准的投资回报。

投资策略 本基金采取“自上而下”和“自下而上”相结合的投资手段和方法,在正常的市场环境下不作主动性的资产配置调整。

业绩比较基准 60%新华富时1600指数收益率+35%新华巴克莱亚洲中债国债指数收益率+5%新华货币存款利率。

风险收益特征 本基金的投资目标和投资策略决定了本基金属于风险程度中等的混合型证券投资基金。

2.3 基金管理人及基金托管人
项目 基金管理人 基金托管人

名称 泰达荷银基金管理有限公司 中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)

信息披露负责人 姓名 邵琦 尹东

联系电话 010-66577725 010-67599003

电子邮箱 info@tada.com yindong@ccb.com

客户服务电话 400-69-8888 010-67599006

网址 www.tada.com http://www.ccb.com

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标 报告期(2009年1月1日至2009年6月30日)

本期已实现收益 1,975,445,827.28

本期利润 1,255,433,677.74

加权平均基金份额本期利润 0.1909

本期基金份额净值增长率 34.59%

3.1.2 期末数据和指标 报告期(2009年1月1日至2009年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 0.3237

期末基金份额净值 4,515,581,883.82

期末基金份额总额 6,097,703,052.46

注:1.本期期末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)扣除相关费用后的净额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.报告期基金份额净值增长率扣除基金管理人计提的基金托管人的各项费用,计入费用后实际收益率水平要低于所列数字。

3.2 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
泰达荷银效率优选混合(LOF) 60%新华富时1600指数收益率+35%新华巴克莱亚洲中债国债指数收益率+5%新华货币存款利率

注:本基金业绩比较基准=60%新华富时1600指数收益率+35%新华巴克莱亚洲中债国债指数收益率+5%新华货币存款利率。

新华富时1600指数是新华财富指数公司编制的包含沪深两市所有上市股票市值最大的600只股票并以流通股加权加权的指数,具有良好的市场代表性。

新华巴克莱亚洲中债国债指数是新华财富指数公司编制的包含沪深两市所有上市的全部固定利率国债,具有良好的流动性和市场代表性。

本基金投资于本基金业绩比较基准,且其根据本基金的投资范围采用新华富时1600指数、新华巴克莱亚洲中债国债指数以及同业存款利率加权作为本基金业绩比较基准。

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩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:本基金业绩比较基准=60%新华富时1600指数收益率+35%新华巴克莱亚洲中债国债指数收益率+5%新华货币存款利率。

4.1 基金管理人及基金托管人
4.1.1 基金管理人
泰达荷银基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

4.1.2 基金托管人
中国建设银行股份有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:中国建设银行51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

注:本基金业绩比较基准=60%新华富时1600指数收益率+35%新华巴克莱亚洲中债国债指数收益率+5%新华货币存款利率。

4.2 基金管理人及基金托管人的基本情况
4.2.1 基金管理人
泰达荷银基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

4.2.2 基金托管人
中国建设银行股份有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:中国建设银行51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

注:本基金业绩比较基准=60%新华富时1600指数收益率+35%新华巴克莱亚洲中债国债指数收益率+5%新华货币存款利率。

4.3 基金管理人及基金托管人的主要人员情况
4.3.1 基金管理人
泰达荷银基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

4.3.2 基金托管人
中国建设银行股份有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:中国建设银行51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

注:本基金业绩比较基准=60%新华富时1600指数收益率+35%新华巴克莱亚洲中债国债指数收益率+5%新华货币存款利率。

4.4 基金管理人及基金托管人的内部控制制度
4.4.1 基金管理人
泰达荷银基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

4.4.2 基金托管人
中国建设银行股份有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:中国建设银行51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

注:本基金业绩比较基准=60%新华富时1600指数收益率+35%新华巴克莱亚洲中债国债指数收益率+5%新华货币存款利率。

4.5 基金管理人及基金托管人的投资策略
4.5.1 基金管理人
泰达荷银基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

4.5.2 基金托管人
中国建设银行股份有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:中国建设银行51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

注:本基金业绩比较基准=60%新华富时1600指数收益率+35%新华巴克莱亚洲中债国债指数收益率+5%新华货币存款利率。

4.6 基金管理人及基金托管人的业绩比较基准
4.6.1 基金管理人
泰达荷银基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

4.6.2 基金托管人
中国建设银行股份有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:中国建设银行51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

注:本基金业绩比较基准=60%新华富时1600指数收益率+35%新华巴克莱亚洲中债国债指数收益率+5%新华货币存款利率。

4.7 基金管理人及基金托管人的风险收益特征
4.7.1 基金管理人
泰达荷银基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

4.7.2 基金托管人
中国建设银行股份有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:中国建设银行51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

注:本基金业绩比较基准=60%新华富时1600指数收益率+35%新华巴克莱亚洲中债国债指数收益率+5%新华货币存款利率。

4.8 基金管理人及基金托管人的其他重要事项
4.8.1 基金管理人
泰达荷银基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

4.8.2 基金托管人
中国建设银行股份有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:中国建设银行51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

注:本基金业绩比较基准=60%新华富时1600指数收益率+35%新华巴克莱亚洲中债国债指数收益率+5%新华货币存款利率。

4.9 基金管理人及基金托管人的其他重要事项
4.9.1 基金管理人
泰达荷银基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

4.9.2 基金托管人
中国建设银行股份有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:中国建设银行51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

注:本基金业绩比较基准=60%新华富时1600指数收益率+35%新华巴克莱亚洲中债国债指数收益率+5%新华货币存款利率。

4.10 基金管理人及基金托管人的其他重要事项
4.10.1 基金管理人
泰达荷银基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

4.10.2 基金托管人
中国建设银行股份有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:中国建设银行51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

注:本基金业绩比较基准=60%新华富时1600指数收益率+35%新华巴克莱亚洲中债国债指数收益率+5%新华货币存款利率。

4.11 基金管理人及基金托管人的其他重要事项
4.11.1 基金管理人
泰达荷银基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

4.11.2 基金托管人
中国建设银行股份有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:中国建设银行51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

注:本基金业绩比较基准=60%新华富时1600指数收益率+35%新华巴克莱亚洲中债国债指数收益率+5%新华货币存款利率。

4.12 基金管理人及基金托管人的其他重要事项
4.12.1 基金管理人
泰达荷银基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

4.12.2 基金托管人
中国建设银行股份有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:中国建设银行51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

注:本基金业绩比较基准=60%新华富时1600指数收益率+35%新华巴克莱亚洲中债国债指数收益率+5%新华货币存款利率。

4.13 基金管理人及基金托管人的其他重要事项
4.13.1 基金管理人
泰达荷银基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

4.13.2 基金托管人
中国建设银行股份有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:中国建设银行51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

注:本基金业绩比较基准=60%新华富时1600指数收益率+35%新华巴克莱亚洲中债国债指数收益率+5%新华货币存款利率。

4.14 基金管理人及基金托管人的其他重要事项
4.14.1 基金管理人
泰达荷银基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

4.14.2 基金托管人
中国建设银行股份有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:中国建设银行51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

注:本基金业绩比较基准=60%新华富时1600指数收益率+35%新华巴克莱亚洲中债国债指数收益率+5%新华货币存款利率。

4.15 基金管理人及基金托管人的其他重要事项
4.15.1 基金管理人
泰达荷银基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

4.15.2 基金托管人
中国建设银行股份有限公司经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立,目前本基金的股东及持股比例分别为:中国建设银行51%、中国建设银行49%。公司注册资本为1亿元人民币。

报告截止日期:2009年6月30日
单位:人民币元

资产 本期末 上年末

负债 本期末 上年末

净资产 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

非流动资产 本期末 上年末

资产总计 本期末 上年末

负债和所有者权益 本期末 上年末

流动资产 本期末 上年末

本期 上期可比期间

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

当期应支付的托管费 5,273,037.95 8,077,937.12

其中:当期已支付 4,358,347.28 7,014,996.73

期末未支付 914,690.67 1,062,940.39

注:支付托管费按照中国建设银行的托管费按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。

6.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券交易

单位:人民币元

本期 上期可比期间

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

银行间市场交易 债券交易金额 基金逆回购 基金正回购

基金买入 基金卖出 交易金额 利息收入 交易金额 利息支出

中国建设银行 - - - - - -

注:2009年1月1日至2009年6月30日,本基金管理人、托管人及基金管理人股东持有基金份额0.008年6月30日:0。

6.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

本期 上期可比期间

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

关联方名称 期末余额 当期利息收入 期末余额 当期利息收入

中国建设银行 136,576,363.18 1,058,443.56 134,566,758.05 2,100,314.60

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司托管,银行间市场利率。

6.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况(2008年上半年:0)。

6.4.9 期末 2009年6月30日 35家持仓比例最高的前十大重仓股

6.4.10 报告期内关联方证券买卖价差损益

本报告期间,本基金未有因关联方新增发债证券而导致证券损益的情况。

6.4.12 期末持有的暂时停牌股票

本报告期间,本基金未持有暂时停牌股票。

6.4.13 银行间市场债券正回购

本报告期间,本基金无银行间债券正回购。

6.4.9.3 交易所市场债券正回购

本报告期间,本基金交易所市场债券正回购。

6.4.10 关联方证券买卖价差损益

本报告期间,本基金未有因关联方新增发债证券而导致证券损益的情况。

6.4.12 期末持有的暂时停牌股票

本报告期间,本基金未持有暂时停牌股票。

6.4.13 银行间市场债券正回购

本报告期间,本基金无银行间债券正回购。

6.4.9.3 交易所市场债券正回购

本报告期间,本基金交易所市场债券正回购。

6.4.10 关联方证券买卖价差