

泰信优质生活股票型证券投资基金

2009年半年度报告摘要

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

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及相关法律法规的要求,编制了本报告摘要,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。本半年度报告摘要已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

§2 基金简介

Table with 2 columns: 基金基本情况, 基金名称, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额

2.1 基金基本情况
基金名称:泰信优质生活股票
交易代码:200004
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2006年12月15日
报告期末基金份额总额:2,209,880,616.35份

2.2 基金业绩说明
本报告期基金份额净值增长率:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数
投资目标:分享中国经济持续增长过程中最能体现国民大众生活需求潜力的上市公司长期稳定增值,在严格控制投资风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值。

2.3 基金管理人及基金托管人
名称: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

2.4 信息披露方式
基金半年度报告正文的互联网网址: http://www.ftfund.com

§3 主要财务指标、基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标
单位:人民币元

Table with 2 columns: 3.1.1 期间数据和指标, 本报告期(2009年1月1日至2009年6月30日)

注:1.上述基金业绩指标不包括基金申购赎回费用和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、基金转换费等)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
本报告期基金份额净值增长率:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.3 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.4 基金管理人及基金托管人
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

3.5 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.6 基金管理人及基金托管人
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

3.7 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.8 基金管理人及基金托管人
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

3.9 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.10 基金管理人及基金托管人
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

3.11 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.12 基金管理人及基金托管人
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

3.13 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.14 基金管理人及基金托管人
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

3.15 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.16 基金管理人及基金托管人
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

3.17 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.18 基金管理人及基金托管人
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

3.19 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.20 基金管理人及基金托管人
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

3.21 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.22 基金管理人及基金托管人
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

3.23 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.24 基金管理人及基金托管人
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

3.25 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.26 基金管理人及基金托管人
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

3.27 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.28 基金管理人及基金托管人
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

3.29 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.30 基金管理人及基金托管人
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

3.31 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.32 基金管理人及基金托管人
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

3.33 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.34 基金管理人及基金托管人
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

3.35 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.36 基金管理人及基金托管人
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

3.37 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.38 基金管理人及基金托管人
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

3.39 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.40 基金管理人及基金托管人
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

3.41 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.42 基金管理人及基金托管人
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

3.43 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.44 基金管理人及基金托管人
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

3.45 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.46 基金管理人及基金托管人
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

3.47 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.48 基金管理人及基金托管人
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

3.49 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.50 基金管理人及基金托管人
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

3.51 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.52 基金管理人及基金托管人
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

3.53 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.54 基金管理人及基金托管人
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

3.55 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.56 基金管理人及基金托管人
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

3.57 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.58 基金管理人及基金托管人
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

3.59 基金业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华富时国指指数

3.60 基金管理人及基金托管人
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

3.61.2.期末可供分配利润-335,685,593.35元,不满足基金分红的条件。报告期内,本基金未进行利润分配。

§5 5 托管人报告

5.1 报告期内中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)遵照《证券投资基金法》以下简称“基金法”)的托管过程中,严格遵守了法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了各项义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规性、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金估值的准确性进行了认真的复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中基金净值信息的真实、准确和完整发表意见
本半年度报告中的财务报表、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告数据核对一致。(注:财务会计报告中的“金融工具公允价值”部分不在托管人复核范围内。)

中国银行股份有限公司
2009年8月20日

§6 半年度财务报表(未审计)

6.1 资产负债表
会计主体:泰信优质生活股票型证券投资基金
报告截止日:2009年6月30日

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 本报告期末2009年6月30日, 上年度末2008年12月31日

Table with 4 columns: 负债, 附注号, 本报告期末2009年6月30日, 上年度末2008年12月31日

Table with 4 columns: 所有者权益, 附注号, 本报告期末2009年6月30日, 上年度末2008年12月31日

Table with 4 columns: 所有者权益变动表, 附注号, 本报告期末2009年6月30日, 上年度末2008年12月31日

注:1.本基金本报告期末可供分配利润-335,685,593.35元,未满足基金分红的条件,本报告期未进行利润分配。

6.2 利润表
会计主体:泰信优质生活股票型证券投资基金
本报告期:2009年1月1日至2009年6月30日

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本报告期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间金额2008年1月1日至2008年6月30日

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本报告期末2009年6月30日, 上年度末2008年12月31日

2009年6月30日

6.4.3.2 关联方管理

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

注:支付基金托管人中国银行股份有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

6.4.3.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

注:支付基金托管人中国银行股份有限公司的管理人报酬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。

6.4.3.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.3.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.3.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.3.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.3.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.3.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.3.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.3.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.3.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.3.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.3.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.3.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.3.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.3.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.3.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.3.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.3.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.3.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

6.4.3.2 关联方管理
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期2009年1月1日至2009年6月30日, 上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)

7.4.3 买入股票的成本及支出金额

单位:人民币元

Table with 2 columns: 买入股票成本, 成交总额, 2,370,972,535.57

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名支持债券投资明细

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本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、处罚的情况

7.9.2 本报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库

7.9.3 其他资产构成

单位:人民币元

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.9.6 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.9.7 投资组合报告附注

7.9.8 投资组合报告附注

7.9.9 投资组合报告附注

7.9.10 投资组合报告附注

7.9.11 投资组合报告附注

7.9.12 投资组合报告附注

7.9.13 投资组合报告附注

7.9.14 投资组合报告附注

7.9.15 投资组合报告附注

7.9.16 投资组合报告附注

7.9.17 投资组合报告附注

7.9.18 投资组合报告附注

7.9.19 投资组合报告附注

7.9.20 投资组合报告附注

7.9.21 投资组合报告附注

7.9.22 投资组合报告附注

7.9.23 投资组合报告附注

7.9.24 投资组合报告附注

7.9.25 投资组合报告附注

7.9.26 投资组合报告附注

7.9.27 投资组合报告附注

7.9.28 投资组合报告附注

7.9.29 投资组合报告附注

7.9.30 投资组合报告附注

7.9.31 投资组合报告附注

7.9.32 投资组合报告附注

7.9.33 投资组合报告附注

7.9.34 投资组合报告附注

7.9.35 投资组合报告附注

7.9.36 投资组合报告附注

7.9.37 投资组合报告附注

7.9.38 投资组合报告附注

7.9.39 投资组合报告附注

7.9.40 投资组合报告附注

7.9.41 投资组合报告附注

7.9.42 投资组合报告附注