

泰信优质生活
股票型证券投资基金 2009 年半年度报告
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

送出日期：2009 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
§2 基金简介.....	1
2.1 基金基本情况.....	1
2.2 基金产品说明.....	1
2.3 基金管理人和基金托管人.....	1
2.4 信息披露方式.....	2
2.5 其他相关资料.....	2
§3 主要财务指标、基金净值表现.....	2
3.1 主要会计数据和财务指标.....	2
3.2 基金净值表现.....	3
§4 管理人报告.....	4
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	4
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	5
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	5
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	5
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	6
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	6
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	7
§5 托管人报告.....	7
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	7
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	7
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	8
§6 半年度财务报表(未审计).....	8
6.1 资产负债表.....	8
6.2 利润表.....	9
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	10
6.4 报表附注.....	10

§7 投资组合报告.....	23
7.1 期末基金资产组合情况.....	23
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	24
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	24
7.4 报告期内权益投资组合的重大变动.....	27
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	29
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.....	30
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	30
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.....	30
7.9 投资组合报告附注.....	30
§8 基金份额持有人信息.....	31
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	31
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	31
§9 开放式基金份额变动.....	31
§10 重大事件揭示.....	32
10.1 基金份额持有人大会决议.....	32
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	32
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	32
10.4 基金投资策略的改变.....	32
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	32
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	32
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	32
10.8 其他重大事件.....	34
§11 备查文件目录.....	35
11.1 备查文件目录.....	35
11.2 存放地点.....	35
11.3 查阅方式.....	35

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信优质生活股票型证券投资基金
基金简称	泰信优质生活股票
交易代码	290004
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 基金产品说明

投资目标	分享中国经济可持续发展过程中那些最能够满足人们优质生活需求的上市公司的长期稳定增长，在严格控制投资风险的基础上，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的大类资产配置、以核心-卫星策略为基础的优质生活行业配置和“自下而上”的证券精选相结合的投资策略。
业绩比较基准	75%*新华富时 A600 指数 + 25%*新华富时国债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。适合于能够承担一定股市风险，追求资本长期增值的个人和机构投资者。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰信基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴胜光	宁敏
	联系电话	021-50372168	010-66594977
	电子邮箱	XXPL@ftfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-5988	95566
传真		021-50372197	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42 F	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42 F	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		孟凡利	肖钢

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ftfund.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42 F

2.5 其他相关资料

项目	注册登记机构
名称	泰信基金管理有限公司
办公地址	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42 F

§ 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2009 年 1 月 1 日-2009 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	61,507,346.21
本期利润	820,778,169.86
加权平均基金份额本期利润	0.3611
本期加权平均净值利润率	38.11%
本期基金份额净值增长率	49.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期（2009 年 1 月 1 日-2009 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-335,685,593.35
期末可供分配基金份额利润	-0.1519
期末基金资产净值	2,416,705,205.74
期末基金份额净值	1.0936
3.1.3 累计期末指标	报告期（2009 年 1 月 1 日-2009 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	53.95%

注：1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或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。

2、本期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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

阶段	份 额 净 值 增长率①	份 额 净 值 增 长 率 标 准 差 ②	业 绩 比 较 基 准 收 益 率 ③	业 绩 比 较 基 准 收 益 率 标 准 差 ④	①—③	②—④
过去一个月	4.28%	0.96%	9.29%	0.84%	-5.01%	0.12%
过去三个月	11.80%	1.65%	17.01%	1.14%	-5.21%	0.51%
过去六个月	49.75%	1.97%	49.70%	1.46%	0.05%	0.51%
过去一年	14.15%	1.99%	12.18%	1.92%	1.97%	0.07%
自基金合同生 效起至今	53.95%	2.21%	53.77%	1.93%	0.18%	0.28%

本基金业绩比较基准为：75%*新华富时 A600 指数 + 25%*新华富时国债指数。

新华富时中国 A600 是新华富时公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流通市值最大的 600 只股票并以流通股本加权的股票指数，新华富时中国国债指数涵盖了在上海及深圳交易所交易的到期日在一年以上的纯定息债券，是目前中国证券市场中与本基金投资范围比较适配、公信力较好的股票指数和债券指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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：1、本基金基金合同于 2006 年 12 月 15 日正式生效。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满，基金投资组合各项比例符合基金合同的约定：股票资产 60-95%，债券资产 0%-35%，基金保留的现金以及投资于剩余期限在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42F

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42F

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：孟凡利

总经理：高清海

电话：(021) 50372168

传真：(021) 50372197

联系人：王伟毅

发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co., Ltd.）是山东省国际信托投资有限公司（现更名为山东省国际信托有限公司）联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司共同发起设立的基金管理公司。公司于 2002 年 9 月 24 日经中国证券监督管理委员会批准正式筹建，2003 年 5 月 8 日获准开业，是国内实施“好人举手制”以来第一家以信托投资公司为主发起人而发起设立的基金管理公司。

公司目前下设市场营销团队（分华东、华北、华南三个业务部）、营销策划及基金事务团队（分基金事务、客户服务、营销策划）、新业务团队（分理财顾问部、新业务销售）、基金投资部、研究部、金融工程部、清算会计部、信息技术部、监察稽核部、综合管理部及北京分公司、深圳分公司。截至 2009 年 6 月 30 日，公司共管理泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活股票、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选股票等 6 只开放式基金，基金资产规模 141.96 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘强先生	基金投资副总监、本基金基金经理	20070209	—	7	工商管理硕士。2002 年 10 月加入泰信基金管理有限公司，先后担任交易员、研究员，泰信先行策略基金基金经理助理，泰信优质生活基金基金经理助理等职。

朱志权 先生	本基金基金经理	20080628	—	14	经济学学士，先后在长盛基金、富国基金、中海信托、银河基金等单位任职，2008 年 6 月加入泰信基金管理有限公司。
崔健 先生	本基金基金经理助理	20090620	—	3	经济学硕士。曾任平安资产管理公司投资经理助理。2007 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》及其他有关法律法规、《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》的规定，本着“诚实信用、勤勉尽责，取信于市场、取信于投资者”的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法规及基金合同的约定，未发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（中国证券监督管理委员会公告[2008] 9 号），公司制定了《公平交易制度》，适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由金融工程部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

公司旗下的泰信优质生活基金与泰信蓝筹精选基金同属于股票型基金。本报告期，泰信优质生活股票基金净值增长率为 49.75%，泰信蓝筹精选股票基金成立于 2009 年 4 月 22 日，至本报告期末，该基金净值增长率 6.06%，而泰信优质生活股票基金同期的净值增长率为 5.08%，不考虑时间因素，两基金的业绩表现无明显差异。除此之外，公司旗下其他基金中不存在与本基金风格相似的基金，亦未发现异常交易行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内不存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 基金业绩表现

截至 2009 年 6 月 30 日，本基金单位净值为 1.0936 元，本报告期净值增长率为 49.75%，比较基准增长率为 49.70%。

4.4.2 投资策略和业绩表现的说明

上半年在经济刺激政策频出以及宽松的货币政策环境下，信贷增速维持高速增长，国内 PMI 及发电量增速等经济先行指标出现筑底回升，房地产与汽车等主要行业也出现好转，实体经济逐渐走出低谷，国内股票市场出现了较大的涨幅。

内需引导下的经济复苏得以延续和强化，固定资产投资不断加速，企业盈利筑底回升。与此同时，国际及国内市场的超额流动性在复苏与通胀预期的指引下提供更多的投资机会，大宗商品价格持续上扬，国内房地产、可选消费品市场强劲复苏，A 股及 H 股强势上涨。房地产、金融、可选消费品，以及受益于通胀预期的煤炭、有色金属、房地产等涨幅居前。

基于对宏观经济及 A 股市场中长期趋势的乐观预期，报告期内，本基金保持了较高的持仓水平。报告期内，本基金对政府振兴计划中的领域着重进行投资，重点配置了金融、煤炭、房地产、军工、有色金属、节能减排以及新能源等行业。但在 5 月底之后的市场研判上有些谨慎，偏于防御策略，对权重蓝筹股的配置较少也使基金净值的涨幅不太理想。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国依然是世界上经济较快发展的国家之一。实施扩大内需的政策可以使中国在一定程度上抵御出口不利带来的负面影响。我们认为本次全球性的危机过后，中国将长期受益于经济全球化和国家间的产业分工。

在充裕流动性以及企业盈利的恢复和上市公司估值的提升的背景下，我们预计在今后较长的时间里，行业及个股的活跃程度不会降低。中国宏观经济复苏的超预期是国内 A 股市场健康发展的基础。流动性助推下的预期改善与经济复苏，使得以 A 股及房地产为代表的国内资产价格正处于又一轮的膨胀周期中。尽管 A 股市场今年来的涨幅较大并可能存在结构性高估，但整体的市场预期回报仍高于债券、存款等其他金融资产，在经济筑底并趋于回升的前提下，静态估值风险可能引致的市场调整也将有限。

转变经济增长方式，改善经济结构，仍将是中国经济发展的主旨。我们将持续关注受益于经济复苏和资产价格上涨的投资标的，重点发掘由此衍生出的中长期投资机遇。预计下半年金融、地产、煤炭、化工、金属非金属将会有不错的收益率表现。另外节能减排、新能源和世博及迪斯尼等主题性投资的机会也可能较大。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

按照相关法律法规，本公司制定了《泰信基金管理有限公司证券投资基金估值政策与程序》，成立了估值委员会，由主管基金运营的公司总经理助理负责，成员包括清算会计、金融工程、基金投资、监察稽核等业务骨干，所有成员具有较为丰富的证券投资基金从业经验。估值委员会负责制定、修订估值政策与程序、定期对估值政策和程序进行评价，负责确定估值模型、估值流程，对特殊投资品种给出估值价格，及对外信息

披露工作等。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突，本基金基金经理不参与估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、基金合同关于利润分配的约定：

（1）基金收益分配采用现金方式，投资者可选择将获取的现金红利自动转为基金份额进行再投资；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

（2）每一基金份额享有同等分配权；

（3）基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；

（4）基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；

（5）如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；

（6）在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少 1 次；

（7）全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 50%。基金合同生效不满三个月，收益可不分配；

（8）法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

2、本报告期利润分配情况的说明：

本基金基金合同于 2006 年 12 月 15 日正式生效。截止至 2009 年 6 月 30 日，本基金本期已实现收益为 61,507,346.21，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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对优质生活股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本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财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据核对无误。

(注：财务会计报告中的“金融工具风险管理”部分未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

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	88,719,814.08	139,558,856.81
结算备付金		8,179,340.52	3,666,792.95
存出保证金		2,750,000.00	2,750,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	2,357,569,315.02	1,502,628,499.94
其中：股票投资		2,260,609,315.02	1,308,107,481.94
债券投资		96,960,000.00	194,521,018.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	308,116.25
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		4,206,751.14	-
应收利息	6.4.7.5	2,755,242.66	2,054,443.24
应收股利		424,334.27	-
应收申购款		2,846,097.14	4,151.88
其他资产	6.4.7.6	2,902.36	33,723.30
资产总计		2,467,453,797.19	1,651,004,584.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		33,832,614.00	-
应付赎回款		7,214,358.26	186,829.97

应付管理人报酬		2,956,717.42	2,151,840.31
应付托管费		492,786.22	358,640.04
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,186,394.38	1,226,856.32
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
其他负债	6.4.7.8	3,065,721.17	3,154,824.82
负债合计		50,748,591.45	7,078,991.46
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,209,880,616.35	2,250,963,443.66
未分配利润	6.4.7.10	206,824,589.39	-607,037,850.75
所有者权益合计		2,416,705,205.74	1,643,925,592.91
负债和所有者权益总计		2,467,453,797.19	1,651,004,584.37

注：报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0936 元，基金份额总额 2,209,880,616.35 份

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

单位：人民币元

项 目	附注号	本期金额 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
一、收入		849,258,050.06	-1,631,111,996.27
1. 利息收入		2,524,471.02	4,184,209.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	421,015.96	1,944,903.04
债券利息收入		2,103,455.06	2,230,356.41
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	8,950.00
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		87,010,421.64	-973,383,254.53
其中：股票投资收益	6.4.7.12	74,095,094.05	-976,737,492.86
债券投资收益	6.4.7.13	1,340,934.23	-9,593,096.56
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	448,320.44	3,512,300.00
股利收益	6.4.7.15	11,126,072.92	9,435,034.89
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	759,270,823.65	-663,043,508.34
4. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	452,333.75	1,130,557.15
二、费用		-28,479,880.20	-66,235,736.60
1. 管理人报酬		-15,897,597.42	-25,381,573.13
2. 托管费		-2,649,599.58	-4,230,262.21
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	6. 4. 7. 18	-9, 724, 550. 32	-36, 446, 471. 73
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6. 4. 7. 19	-208, 132. 88	-177, 429. 53
三、利润总额		820, 778, 169. 86	-1, 697, 347, 732. 87
四、净利润		820, 778, 169. 86	-1, 697, 347, 732. 87

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

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

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,250,963,443.66	-607,037,850.75	1,643,925,592.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	820,778,169.86	820,778,169.86
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-41,082,827.31	-6,915,729.72	-47,998,557.03
其中：1. 基金申购款	453,020,204.37	-2,339,821.32	450,680,383.05
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-494,103,031.68	-4,575,908.40	-498,678,940.08
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,209,880,616.35	206,824,589.39	2,416,705,205.74
项目	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,874,204,435.95	1,790,839,314.09	4,665,043,750.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		-1,697,347,732.87	-1,697,347,732.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-502,856,741.55	-193,062,508.84	-695,919,250.39
其中：1. 基金申购款	208,605,642.60	102,965,878.89	311,571,521.49
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-711,462,384.15	-296,028,387.73	-1,007,490,771.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,371,347,694.40	-99,570,927.62	2,271,776,766.78

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰信优质生活股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]第 229 号《关于同意泰信优质生活股票型证券投资基金设立的批复》核准，由泰

信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,591,255,543.43 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 191 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》于 2006 年 12 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,591,662,103.09 份基金份额，其中认购资金利息折合 406,559.66 份基金份额。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的各类股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金组合投资的范围为：股票资产 60-95%，债券资产 0-35%，基金保留的现金以及投资于剩余期限在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为：75%X 新华富时 A 600 指数+25%X 新华富时国债指数。本财务报表由本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司于 2009 年 8 月 25 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会基金部通知[2009]4 号关于发布《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>(试行)》等问题的通知、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2009 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2009 年 6 月 30 日的财务状况以及 2009 上半年度经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致的说明。

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明：无

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (a) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (b) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (c) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (d) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
- (e) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
活期存款	88,719,814.08
定期存款	-
其他存款	-
合计：	88,719,814.08

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2009 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		2,047,310,429.42	2,260,609,315.02	213,298,885.60
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	97,702,300.00	96,960,000.00	-742,300.00
	合计	97,702,300.00	96,960,000.00	-742,300.00
资产支持证券		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,145,012,729.42	2,357,569,315.02	212,556,585.60

6.4.7.3 衍生金融资产/负债：无

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	12,356.44
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,576.43
应收债券利息	2,740,164.38
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	145.41
其他	-
合计	2,755,242.66

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
其他应收款	2,902.36
待摊费用	-
合计	2,902.36

注：其他应收款余额为应收券商印花税手续费返还款。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	3,186,394.38
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,186,394.38

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	2,750,000.00
应付赎回费	12,938.16
预提费用	302,783.01
合计	3,065,721.17

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,250,963,443.66	2,250,963,443.66
本期申购	453,020,204.37	453,020,204.37
本期赎回	-494,103,031.68	-494,103,031.68
本期末	2,209,880,616.35	2,209,880,616.35

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-401,366,207.76	-205,671,642.99	-607,037,850.75
本期利润	61,507,346.21	759,270,823.65	820,778,169.86
本期基金份额交易产生的变动数	4,173,268.20	-11,088,997.92	-6,915,729.72
其中：基金申购款	-95,373,851.44	93,034,030.12	-2,339,821.32
基金赎回款	99,547,119.64	-104,123,028.04	-4,575,908.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-335,685,593.35	542,510,182.74	206,824,589.39

6.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	387,916.51
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	32,532.44
其他	567.01
合计	421,015.96

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,154,286,042.25
卖出股票成本总额	-3,080,190,948.20
买卖股票差价收入	74,095,094.05

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
卖出债券成交金额	98,155,678.30
卖出债券成本总额	-95,419,712.19
应收利息总额	-1,395,031.88
债券投资收益	1,340,934.23

6.4.7.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
卖出权证成交金额	448,320.44
卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入	448,320.44

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	11,126,072.92
合计	11,126,072.92

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	
——股票投资	761,720,245.71
——债券投资	-2,141,305.81
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	
——权证投资	-308,116.25
3. 其他	-
合计	759,270,823.65

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
赎回基金补偿收入	410,355.95
转出基金补偿费	41,977.80
其他	-

合计	452,333.75
----	------------

注：本基金的赎回费按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

本基金的转换由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	9,724,050.32
银行间市场交易费用	500.00
合计	9,724,550.32

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,767.52
银行费用	849.87
交易费用	-
银行间债券交易费	-
债券托管帐户维护费	8,926.92
合计	208,132.88

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项：无

6.4.8.2 资产负债表日后事项：无

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况：无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
山东省国际信托有限公司	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信实业有限公司（“青岛国信”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易：无

6.4.10.1.2 债券交易：无

6.4.10.1.3 债券回购交易：无

6.4.10.1.4 权证交易：无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金：无

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

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
当期应支付的管理费	15,897,597.42	25,381,573.13
其中：当期已支付	12,940,880.00	22,349,762.74
期末未支付	2,956,717.42	3,031,810.39

注：支付基金管理人泰信基金管理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。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

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
当期应支付的托管费	2,649,599.58	4,230,262.21
其中：当期已支付	2,156,813.36	3,724,960.48
期末未支付	492,786.22	505,301.73

注：支付基金托管人中国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。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
中国银行	199,322,481.97	-	-	-	-	-

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
期初持有的基金份额	6,041,839.87	6,041,839.87
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	11,365,082.97	-
期间因拆分增加的份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	17,406,922.84	6,041,839.87
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.79%	0.25%

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：人民币元

关联方名称	本期末 2009 年 6 月 30 日		上年度末 2008 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
山东省国际信托有限公司	14,810,141.33	0.67%	-	-
青岛国信实业有限公司	27,014,655.82	1.22%	27,014,655.82	1.20%

6.4.10.5 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

关联方 名称	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	88,719,814.08	387,916.51	99,993,876.63	1,869,660.37

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未分配利润。

6.4.12 期末（2009 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
000978	桂林旅游	20090626	筹划定向增发	10.07	20090706	11.00	6,894,628	80,315,456.90	69,428,903.96

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2009 年 6 月 30 日止，本基金无银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2009 年 6 月 30 日止，本基金无证券交易所债券正回购。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于证券投资基金中的中高风险品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会、督察长为核心，对公司所有经营管理行为进行监督的四道监控防线。

督察长全面负责、指导公司的监察稽核工作，对公司经营、基金投资等业务运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，并向公司董事长和中国证监会报告。监察稽核部下设监察稽核岗和法律事务岗，监察稽核岗负责检查、评价相关制度的合理性、完备性和有效性，监督制度的执行情况，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度的有效执行；法律事务岗协调公司经营、基金运作等业务相关的法律事务，检查各项业务的合法、合规性，检查员工行为的合规性，调查违规行为等。公司金融工程部负责运用定量分析模型，根据各基金的投资目标及投资策略，定期对基金的投资组合风险进行评估，并向投资决策委员会提交业绩评估报告。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、

模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，债券投资包括交易所及银行间市场交易的固定收益品种，存在相应的利率风险。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2009 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	88,719,814.08	-	-	-	-	-	88,719,814.08
结算备付金	8,179,340.52	-	-	-	-	-	8,179,340.52
存出保证金	-	-	-	-	-	2,750,000.00	2,750,000.00
交易性金融资产	-	-	96,960,000.00	-	-	2,260,609,315.02	2,357,569,315.02
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,206,751.14	4,206,751.14
应收利息	-	-	-	-	-	2,755,242.66	2,755,242.66
应收股利	-	-	-	-	-	424,334.27	424,334.27
应收申购款	-	-	-	-	-	2,846,097.14	2,846,097.14
其他资产	-	-	-	-	-	2,902.36	2,902.36
资产总计	96,899,154.60	-	96,960,000.00	-	-	2,273,594,642.59	2,467,453,797.19
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	33,832,614.00	33,832,614.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,214,358.26	7,214,358.26
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,956,717.42	2,956,717.42
应付托管费	-	-	-	-	-	492,786.22	492,786.22
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,186,394.38	3,186,394.38
其他负债	-	-	-	-	-	3,065,721.17	3,065,721.17
负债总计	-	-	-	-	-	50,748,591.45	50,748,591.45
利率敏感度缺口	96,899,154.60	-	96,960,000.00	-	-	2,222,846,051.14	2,416,705,205.74
上年度末 2008 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产							
银行存款	139,558,856.81	-	-	-	-	-	139,558,856.81
结算备付金	3,666,792.95	-	-	-	-	-	3,666,792.95
存出保证金	-	-	-	-	-	2,750,000.00	2,750,000.00
交易性金融资产	-	-	176,667,000.00	14,329,378.00	3,524,640.00	1,308,107,481.94	1,502,628,499.94
衍生金融资产	-	-	-	-	-	308,116.25	308,116.25
应收利息	-	-	-	-	-	2,054,443.24	2,054,443.24
应收申购款	-	-	-	-	-	4,151.88	4,151.88
其他资产	-	-	-	-	-	33,723.30	33,723.30
资产总计	143,225,649.76	-	176,667,000.00	14,329,378.00	3,524,640.00	1,313,257,916.61	1,651,004,584.37
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	186,829.97	186,829.97
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,151,840.31	2,151,840.31
应付托管费	-	-	-	-	-	358,640.04	358,640.04
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,226,856.32	1,226,856.32
其他负债	-	-	-	-	-	3,154,824.82	3,154,824.82
负债总计	-	-	-	-	-	7,078,991.46	7,078,991.46
利率敏感度缺口	143,225,649.76	-	176,667,000.00	14,329,378.00	3,524,640.00	1,306,178,925.15	1,643,925,592.91

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：万元）	
		本期末（2009 年 6 月 30 日）	上年度末（2008 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	增加约 5.3	无重大影响
	市场利率上升 25 个基点	下降约 5.3	无重大影响

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

本基金组合投资的范围为：股票资产 60-95%，债券资产 0-35%，基金保留的现金以及投资于剩余期限在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。于 2009 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日		上年度末 2008 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,260,609,315.02	93.54%	1,308,107,481.94	79.57%
衍生金融资产 一 权证投资	-	-	308,116.25	0.02%
合计	2,260,609,315.02	93.54%	1,308,415,598.19	79.59%

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：万元）	
		本期末（2009 年 6 月 30 日）	上年度末（2008 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 16.1	增加约 7,756
	2. 业绩比较基准下降 5%	下降约 16.1	下降约 7,756

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项：无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,260,609,315.02	91.62
	其中：股票	2,260,609,315.02	91.62
2	固定收益投资	96,960,000.00	3.93
	其中：债券	96,960,000.00	3.93

	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	96,899,154.60	3.93
6	其他资产	12,985,327.57	0.53
	合计	2,467,453,797.19	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	156,327,165.09	6.47
C	制造业	1,173,194,933.27	48.55
C0	食品、饮料	28,187,006.56	1.17
C1	纺织、服装、皮毛	88,047,500.00	3.64
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	72,541,000.00	3.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	136,819,787.46	5.66
C5	电子	138,549,537.78	5.73
C6	金属、非金属	95,563,136.00	3.95
C7	机械、设备、仪表	435,678,469.07	18.03
C8	医药、生物制品	108,984,496.40	4.51
C99	其他制造业	68,824,000.00	2.85
D	电力、煤气及水的生产和供应业	49,919,800.00	2.07
E	建筑业	70,103,604.30	2.90
F	交通运输、仓储业	35,436,598.16	1.47
G	信息技术业	5,188,000.00	0.21
H	批发和零售贸易	131,644,565.00	5.45
I	金融、保险业	120,936,705.16	5.00
J	房地产业	176,802,709.58	7.32
K	社会服务业	136,245,634.46	5.64
L	传播与文化产业	11,510,000.00	0.48
M	综合类	193,299,600.00	8.00
	合计	2,260,609,315.02	93.54

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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

					(%)
1	600655	豫园商城	5,000,000	86,400,000.00	3.58
2	000933	神火股份	3,990,000	79,800,000.00	3.30
3	000009	中国宝安	6,660,000	78,987,600.00	3.27
4	600675	中华企业	4,657,023	74,326,087.08	3.08
5	000800	一汽轿车	4,800,000	74,112,000.00	3.07
6	002073	青岛软控	3,700,000	73,852,000.00	3.06
7	600869	三普药业	4,825,178	73,053,194.92	3.02
8	600606	金丰投资	6,838,650	72,831,622.50	3.01
9	000815	美利纸业	6,748,000	72,541,000.00	3.00
10	600550	天威保变	2,030,200	72,437,536.00	3.00
11	002083	孚日股份	7,300,000	70,810,000.00	2.93
12	000978	桂林旅游	6,894,628	69,428,903.96	2.87
13	000969	安泰科技	2,800,000	68,824,000.00	2.85
14	002179	中航光电	3,990,097	65,597,194.68	2.71
15	000758	中色股份	3,964,700	63,355,906.00	2.62
16	600622	嘉宝集团	5,500,000	63,195,000.00	2.61
17	000677	山东海龙	10,300,000	56,135,000.00	2.32
18	600895	张江高科	3,300,000	51,117,000.00	2.12
19	600649	城投控股	3,620,000	49,919,800.00	2.07
20	000069	华侨城 A	2,300,000	48,070,000.00	1.99
21	601088	中国神华	1,574,499	47,093,265.09	1.95
22	000636	风华高科	6,555,784	41,957,017.60	1.74
23	600549	厦门钨业	2,230,000	41,366,500.00	1.71
24	600030	中信证券	1,457,500	41,188,950.00	1.70
25	600016	民生银行	5,070,673	40,159,730.16	1.66
26	000927	一汽夏利	5,271,300	36,846,387.00	1.52
27	600219	南山铝业	3,000,000	30,750,000.00	1.27
28	601919	中国远洋	2,199,988	29,853,837.16	1.24
29	600519	贵州茅台	181,356	26,842,501.56	1.11
30	600481	双良股份	2,049,924	22,549,164.00	0.93
31	601601	中国太保	1,000,000	22,380,000.00	0.93
32	600875	东方电气	550,000	21,395,000.00	0.89
33	601168	西部矿业	1,355,000	20,650,200.00	0.85
34	000623	吉林敖东	500,000	20,235,000.00	0.84
35	600739	辽宁成大	600,000	19,872,000.00	0.82
36	600391	成发科技	1,000,000	19,470,000.00	0.81
37	000407	胜利股份	1,955,118	17,889,329.70	0.74
38	002064	华峰氨纶	1,891,410	17,590,113.00	0.73

39	600582	天地科技	842,172	17,306,634.60	0.72
40	600177	雅戈尔	1,250,000	17,237,500.00	0.71
41	600388	龙净环保	690,000	14,345,100.00	0.59
42	000402	金 融 街	1,000,000	13,760,000.00	0.57
43	000002	万 科 A	1,000,000	12,750,000.00	0.53
44	600754	锦江股份	650,000	12,389,000.00	0.51
45	600037	歌华有线	1,000,000	11,510,000.00	0.48
46	600456	宝钛股份	500,000	11,450,000.00	0.47
47	000680	山推股份	1,012,500	11,147,625.00	0.46
48	601318	中国平安	221,250	10,943,025.00	0.45
49	600309	烟台万华	677,676	10,686,950.52	0.44
50	000157	中联重科	476,000	10,629,080.00	0.44
51	002025	航天电器	1,000,000	10,460,000.00	0.43
52	600089	特变电工	550,000	9,922,000.00	0.41
53	002024	苏宁电器	600,000	9,642,000.00	0.40
54	600486	扬农化工	288,458	9,259,501.80	0.38
55	002121	科陆电子	572,045	8,866,697.50	0.37
56	600307	酒钢宏兴	590,000	8,018,100.00	0.33
57	600276	恒瑞医药	220,163	7,685,890.33	0.32
58	000059	辽通化工	894,500	7,549,580.00	0.31
59	000816	江淮动力	1,000,000	7,430,000.00	0.31
60	002202	金风科技	230,000	6,927,600.00	0.29
61	002123	荣信股份	236,800	6,897,984.00	0.29
62	600153	建发股份	500,000	6,765,000.00	0.28
63	601390	中国中铁	993,770	6,747,698.30	0.28
64	000901	航天科技	500,000	6,425,000.00	0.27
65	600741	华域汽车	784,905	6,357,730.50	0.26
66	600015	华夏银行	500,000	6,265,000.00	0.26
67	600838	上海九百	1,000,000	6,170,000.00	0.26
68	002152	广电运通	239,959	6,166,946.30	0.26
69	002215	诺 普 信	345,700	5,935,669.00	0.25
70	600426	华鲁恒升	341,100	5,587,218.00	0.23
71	600087	长航油运	901,900	5,582,761.00	0.23
72	000826	合加资源	503,861	5,562,625.44	0.23
73	002055	得润电子	650,000	4,842,500.00	0.20
74	002038	双鹭药业	138,999	4,496,617.65	0.19
75	002155	辰州矿业	226,000	4,294,000.00	0.18
76	002214	大立科技	249,920	4,286,128.00	0.18
77	600320	振华重工	396,500	4,123,600.00	0.17
78	600893	航空动力	200,000	3,884,000.00	0.16

79	000028	一致药业	185,915	3,513,793.50	0.15
80	600665	天地源	500,000	3,135,000.00	0.13
81	600038	哈飞股份	200,000	3,126,000.00	0.13
82	000839	中信国安	200,000	2,948,000.00	0.12
83	600418	江淮汽车	500,000	2,925,000.00	0.12
84	002264	新华都	96,900	2,795,565.00	0.12
85	600585	海螺水泥	62,400	2,629,536.00	0.11
86	002106	莱宝高科	200,000	2,540,000.00	0.11
87	000021	长城开发	200,000	2,240,000.00	0.09
88	002028	思源电气	100,000	2,193,000.00	0.09
89	601699	潞安环能	50,000	1,974,500.00	0.08
90	002164	东力传动	102,473	1,566,812.17	0.06
91	600997	开滦股份	80,000	1,495,200.00	0.06
92	600961	株冶集团	100,000	1,349,000.00	0.06
93	600737	中粮屯河	110,750	1,344,505.00	0.06
94	601899	紫金矿业	100,000	1,020,000.00	0.04
95	600703	三安光电	20,000	623,800.00	0.03

7.4 报告期内权益投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入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

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000758	中色股份	122,960,563.48	7.48
2	600549	厦门钨业	119,834,661.17	7.29
3	000009	中国宝安	101,052,861.79	6.15
4	002073	青岛软控	87,000,569.70	5.29
5	000969	安泰科技	81,941,913.01	4.98
6	600655	豫园商城	79,913,351.82	4.86
7	600606	金丰投资	76,873,248.86	4.68
8	000815	美利纸业	76,282,383.60	4.64
9	600869	三普药业	75,979,651.55	4.62
10	000800	一汽轿车	75,468,023.10	4.59
11	002179	中航光电	72,440,323.86	4.41
12	000677	山东海龙	63,960,501.97	3.89
13	000933	神火股份	63,894,952.83	3.89
14	600675	中华企业	62,166,337.16	3.78
15	600151	航天机电	60,250,693.22	3.67

16	000514	渝 开 发	59,428,747.17	3.62
17	600391	成发科技	59,302,964.57	3.61
18	600622	嘉宝集团	56,146,240.23	3.42
19	002083	孚日股份	55,583,254.37	3.38
20	002155	辰州矿业	55,509,458.37	3.38
21	600219	南山铝业	55,151,447.73	3.35
22	000978	桂林旅游	54,318,130.65	3.30
23	000031	中粮地产	54,010,998.98	3.29
24	000826	合加资源	53,969,928.84	3.28
25	000636	风华高科	53,551,719.52	3.26
26	600739	辽宁成大	51,521,964.54	3.13
27	600649	城投控股	48,340,614.52	2.94
28	600100	同方股份	47,811,341.53	2.91
29	002025	航天电器	47,215,970.28	2.87
30	000680	山推股份	47,090,596.00	2.86
31	000623	吉林敖东	44,394,753.42	2.70
32	600438	通威股份	44,286,122.60	2.69
33	601088	中国神华	41,566,043.60	2.53
34	600030	中信证券	37,761,960.29	2.30
35	000927	一汽夏利	36,864,953.84	2.24
36	601168	西部矿业	33,023,452.84	2.01

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

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（%）
1	600518	康美药业	134,702,542.77	8.19
2	600549	厦门钨业	100,044,720.85	6.09
3	000758	中色股份	85,000,391.31	5.17
4	000826	合加资源	68,292,475.73	4.15
5	000514	渝 开 发	63,660,766.62	3.87
6	600151	航天机电	63,641,692.62	3.87
7	000933	神火股份	63,035,034.36	3.83
8	600550	天威保变	56,806,423.85	3.46
9	600739	辽宁成大	56,758,552.74	3.45
10	000009	中国宝安	56,727,775.00	3.45
11	000031	中粮地产	55,339,237.94	3.37
12	601899	紫金矿业	54,708,092.68	3.33

13	002025	航天电器	54,687,039.35	3.33
14	600309	烟台万华	52,840,478.21	3.21
15	600100	同方股份	52,531,545.46	3.20
16	600000	浦发银行	50,158,428.36	3.05
17	000568	泸州老窖	49,438,415.26	3.01
18	002241	歌尔声学	48,181,105.00	2.93
19	002155	辰州矿业	47,837,721.52	2.91
20	600456	宝钛股份	47,100,820.99	2.87
21	600391	成发科技	46,813,728.48	2.85
22	600895	张江高科	45,014,945.41	2.74
23	000969	安泰科技	44,752,357.52	2.72
24	600219	南山铝业	44,195,707.10	2.69
25	600438	通威股份	41,886,368.05	2.55
26	600966	博汇纸业	40,886,273.50	2.49
27	600879	火箭股份	40,810,823.66	2.48
28	000623	吉林敖东	39,024,891.29	2.37
29	000869	张裕 A	38,834,477.96	2.36
30	600963	岳阳纸业	35,924,572.10	2.19
31	000680	山推股份	35,827,104.25	2.18

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,270,972,535.57
卖出股票收入（成交）总额	3,154,286,042.25

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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	96,960,000.00	4.01
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
	合计	96,960,000.00	4.01

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	0801110	08 央票 110	1,000,000	96,960,000.00	4.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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本期没有出现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、处罚的情形。

7.9.2 本报告期内基金投资的前十名股票未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

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,750,000.00
2	应收证券清算款	4,206,751.14
3	应收股利	424,334.27
4	应收利息	2,755,242.66
5	应收申购款	2,846,097.14
6	其他应收款	2,902.36
6	待摊费用	-
7	其他	-
	合计	12,985,327.57

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

报告期内，本基金未投资于基金管理人的投资股东主承销的证券，未从二级市场投资分离交易可转债附送的权证，投资流通受限证券未违反相关法规或基金管理人的规定。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
91620	24,120.07	71,219,763.65	3.22%	2,138,660,852.70	96.78%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	320,584.85	0.0145%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006 年 12 月 15 日）基金份额总额	1,591,662,103.09
报告期期初基金份额总额	2,250,963,443.66
报告期期间基金总申购份额	453,020,204.37
报告期期间基金总赎回份额	-494,103,031.68
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	2,209,880,616.35

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘会计师事务所，仍为普华永道中天会计师事务所有限公司。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况发生。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

1、本基金股票交易情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
安信证券	1	407,690,367.50	6.35%	346,534.04	6.47%	-
渤海证券	1	226,616,619.05	3.53%	192,624.41	3.60%	-
长财证券	1	132,850,797.43	2.07%	107,942.61	2.02%	-
光大证券	1	149,267,812.93	2.32%	126,875.78	2.37%	-
广发证券	1	8,894,178.40	0.14%	7,560.09	0.14%	-
国金证券	1	253,838,201.01	3.95%	206,246.27	3.85%	-
国信证券	1	222,199,246.86	3.46%	188,868.37	3.53%	-
国元证券	1	353,406,399.55	5.50%	300,392.26	5.61%	-
华宝证券	1	551,897,527.82	8.59%	448,421.15	8.38%	-

江海证券	1	268,401,043.20	4.18%	218,077.05	4.07%	新增
江南证券	1	529,953,783.73	8.25%	430,591.25	8.04%	-
联合证券	1	679,241,466.55	10.57%	551,888.99	10.31%	-
上海远东证券	1	200,254,235.50	3.12%	170,215.79	3.18%	-
上海证券	1	235,981,919.73	3.67%	200,584.06	3.75%	-
申银万国证券	1	13,409,886.46	0.21%	11,398.35	0.21%	-
信泰证券	1	139,219,356.11	2.17%	113,117.13	2.11%	-
招商证券	1	133,305,511.52	2.07%	108,312.73	2.02%	-
中国建银投资证券	1	652,210,494.07	10.15%	554,380.50	10.36%	-
中信建投	1	951,579,397.65	14.81%	808,835.14	15.11%	-
中信证券	2	100,269,606.17	1.56%	85,229.31	1.59%	-
中银国际	2	214,770,726.58	3.34%	174,503.83	3.26%	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	新增
南京证券	1	-	-	-	-	新增
万联证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	新增
西南证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

2、本基金债券交易情况

券商名称	交易单元数量	债券交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	1	18,644,945.34	100.00%	-	-	-

3、本基金权证交易情况

券商名称	交易单元数量	权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
联合证券	1	448,320.44	100.00%	-	-	-

注：

1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）中关于“一家基金公司通过一家证券经营机构买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易

佣金30%”的要求，本基金管理人在选择租用交易单元时，注重所选证券公司的综合实力、市场声誉。对证券公司的研究能力，由公司研究人员对其提供的研究报告、研究成果的质量进行定期评估。公司将根据内部评估报告，对席位租用情况进行总体评价，决定是否对交易单元租用情况进行调整。

2、本期本基金新增江海证券、金元证券、五矿证券与中金公司共4个交易单元。

3、本基金与泰信蓝筹精选股票型证券投资基金为同一托管行，根据交易所相关规则，共用所有交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	继续参与工商银行基金定投申购费率优惠活动	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009年1月13日
2	参加光大银行基金定投申购费率优惠活动	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009年1月16日
3	新增宏源证券为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009年2月5日
4	运用自有资金投资优质生活	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009年2月5日
5	新增恒泰证券为代销机构并开通基金定投业务活动	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009年2月10日
6	基金在中信银行开通转换业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009年2月11日
7	基金在交通银行网上银行申购费率优惠调整	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009年2月25日
8	参加工商银行基智定投业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009年2月26日
9	参与华夏银行基金定投业务优惠活动	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009年2月28日
10	新增江海证券为代销机构并开通基金定投业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009年3月13日
11	新增长城证券为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009年4月9日
12	新增爱建证券为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009年5月7日
13	继续参与中国银行开展的基金定期定额交易及网银申购费率优惠活动	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009年5月7日
14	参与申银万国证券非现场交易申购费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009年5月12日
15	新增华宝证券为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009年5月14日
16	基金在华夏银行开通转换业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009年5月20日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰信优质生活股票型证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信优质生活股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信优质生活股票型证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信优质生活股票型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照

11.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。在支付必要的工本费后，投资者可在有效的工作时间内取得本报告及上述备查文件的复制件或复印件。

11.3 查阅方式

投资者可登录本基金管理人公司网站(<http://www.ftfund.com>)查阅上述相关文件，或拨打客户服务中心电话(400-888-5988，021-38784566)，和本公司客服联系。

泰信基金管理有限公司

2009 年 8 月 25 日