

泰达荷银货币市场基金

2006 年年度报告

基金管理人：泰达荷银基金管理有限公司

（原湘财荷银基金管理有限公司）

基金托管人：中国农业银行

报告送出日期：2007 年 3 月 28 日

泰达荷银货币市场基金 2006 年年度报告

目 录

- 一、重要提示
- 二、基金简介
- 三、主要财务指标、净值表现及收益分配情况
- 四、基金管理人报告
- 五、基金托管人报告
- 六、审计报告
- 七、财务会计报告
- 八、投资组合报告
- 九、基金份额持有人户数、持有人结构
- 十、开放式基金份额变动情况
- 十一、重大事件揭示
- 十二、备查文件目录

一、重要提示

基金管理人泰达荷银基金管理有限公司（原湘财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。本年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于 2007 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、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。

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

二、基金简介

(一) 基金名称：泰达荷银货币市场基金

(原湘财荷银货币市场基金，下同)

本基金管理人 2006 年 6 月 6 日发布公司旗下基金更名公告，经公司董事会批准、中国证监会同意，原湘财荷银货币市场基金变更为泰达荷银货币市场基金，本基金简称、基金代码均不作变更。公告内容详见当日的《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和本公司网站。

基金简称：泰达荷银货币

交易代码：162206

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2005 年 11 月 10 日

报告期末基金份额总额：590,995,972.58 份

(二) 基金投资目标：在确保本金安全性和基金财产流动性的基础上，力争为投资者获取超过业绩比较基准的收益。

基金投资策略：本基金将在遵守投资纪律并有效管理风险的基础上，实施稳健的投资风格和谨慎的交易操作。以价值分析为基础，数量分析为支持，采用自上而下确定投资策略和自下而上个券选择的程序，运用供求分析、久期偏离、收益率曲线配置和类属配置等积极投资策略，实现基金资产的保值增值。

基金业绩比较基准：本基金的业绩比较基准为税后一年期银行定期存款利率。

基金风险收益特征：本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期收益率和预期风险均低于股票、混合和债券型基金。

(三) 基金管理人名称：泰达荷银基金管理有限公司

(原湘财荷银基金管理有限公司，下同。)

本基金管理人已于 2006 年 4 月 27 日发布公告，经中国证监会批准，湘财荷银基金管理有限公司正式更名为泰达荷银基金管理有限公司。公告内容详见当日的《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

注册地址：上海市武威路 789 号

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

邮政编码：100034

法定代表人：章嘉玉

信息披露负责人：方子木

联系电话：010 - 66577728

传真：010 - 66577666

电子信箱：zimu.fang@aateda.com

(四) 基金托管人名称：中国农业银行

名称：中国农业银行

注册地址：北京市海淀区复兴路甲23号

办公地址：北京市海淀区复兴路甲23号

邮政编码：100037

法定代表人：杨明生

信息披露负责人：李芳菲

联系电话：010-68424199

传真：010-68424181

电子邮箱：lifangfei@abchina.com

(五) 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

登载年度报告正文的管理人互联网网址：[http:// www.aateda.com](http://www.aateda.com)

基金年度报告置备地点：基金管理人、基金托管人的住所

(六) 会计师事务所的名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

办公地址：中国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法人代表：Kent Watson

经办注册会计师：汪棣、王鸣宇

(七) 注册登记机构的名称：泰达荷银基金管理有限公司

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

三、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

(一) 主要财务指标

泰达荷银货币基金		
财务指标	2006 年度	2005 年 11 月 10 日 (基金合同生效日) 至 2005 年 12 月 31 日止期间
基金本期净收益 (包括非正常收入)	47,736,897.37	-
基金本期净收益 (不包括非正常收入)	46,482,639.91	7,832,481.83
期末基金资产净值	590,995,972.58	2,109,513,479.67
期末基金份额净值	1.00	1.00
本期净值收益率 (包括非正常收入)	1.9697%	-
本期净值收益率 (不包括非正常收入)	1.8867%	0.2653%
累计净值收益率 (包括非正常收入)	2.2402%	-
累计净值收益率 (不包括非正常收入)	2.1570%	0.2653%

注：1. 本基金基金合同于 2005 年 11 月 10 日生效。

2. 本基金收益分配按月结转份额。

3. 上述本期净收益中 1,254,257.46 元按相关会计规则属于非正常收入，此部分非正常收入是本基金提前支取定期存款所收取的利息。

(二) 基金净值表现

1、a) 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表 (包含非正常收入)：

泰达荷银货币基金						
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
3 个月	0.4422%	0.0025%	0.5081%	0.0000%	-0.0659%	0.0025%
6 个月	0.9257%	0.0034%	0.9873%	0.0003%	-0.0616%	0.0031%
今年以来	1.9697%	0.0065%	1.8799%	0.0003%	0.0898%	0.0062%
成立以来	2.2402%	0.0062%	2.1363%	0.0003%	0.1038%	0.0059%

注：本基金收益分配按月结转份额。

b) 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表(不包含非正常收入)：

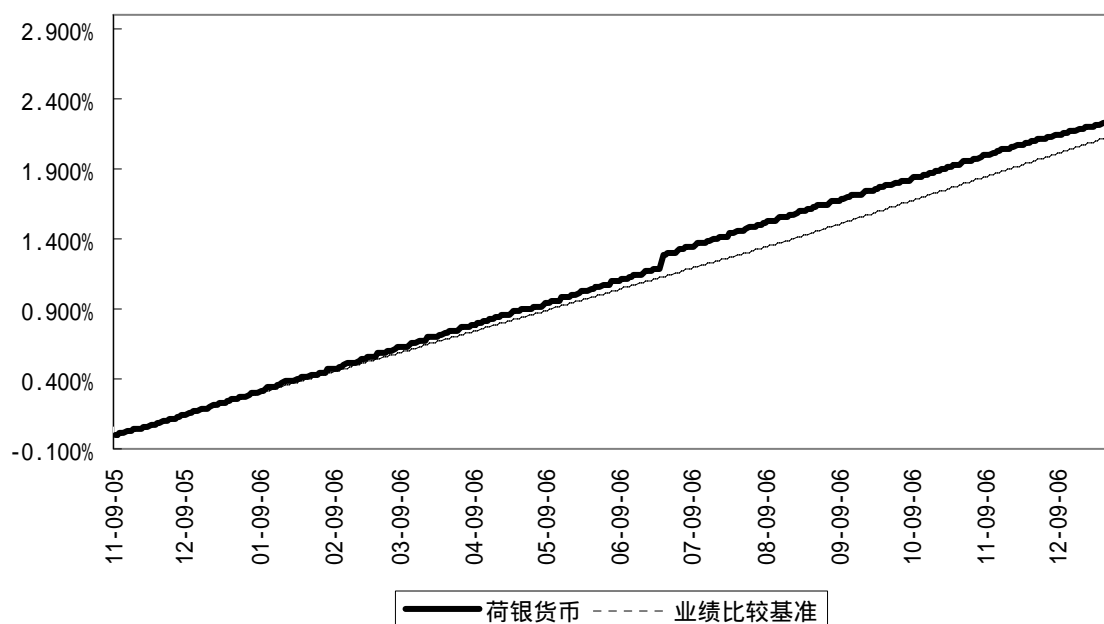
泰达荷银货币基金						
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
3个月	0.4422%	0.0025%	0.5081%	0.0000%	-0.0659%	0.0025%
6个月	0.9257%	0.0034%	0.9873%	0.0003%	-0.0616%	0.0032%
今年以来	1.8867%	0.0042%	1.8799%	0.0003%	0.0068%	0.0039%
成立以来	2.1570%	0.0041%	2.1363%	0.0003%	0.0207%	0.0038%

注：本基金收益分配按月结转份额。

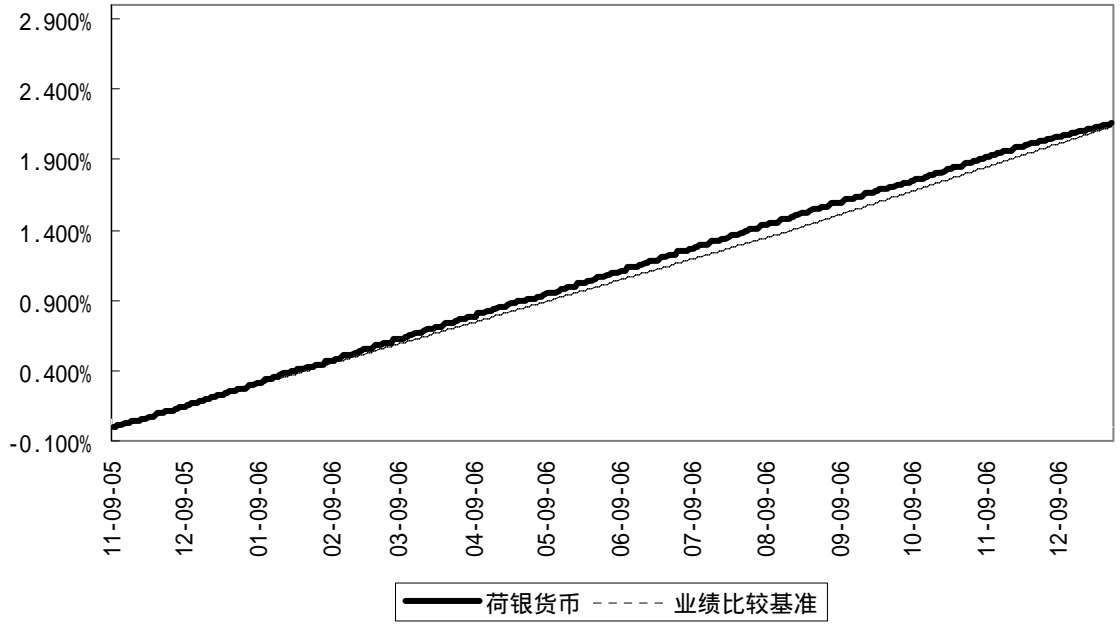
2、

a) 基金合同生效以来基金份额净值变动情况及与同期业绩比较基准的变动对比图

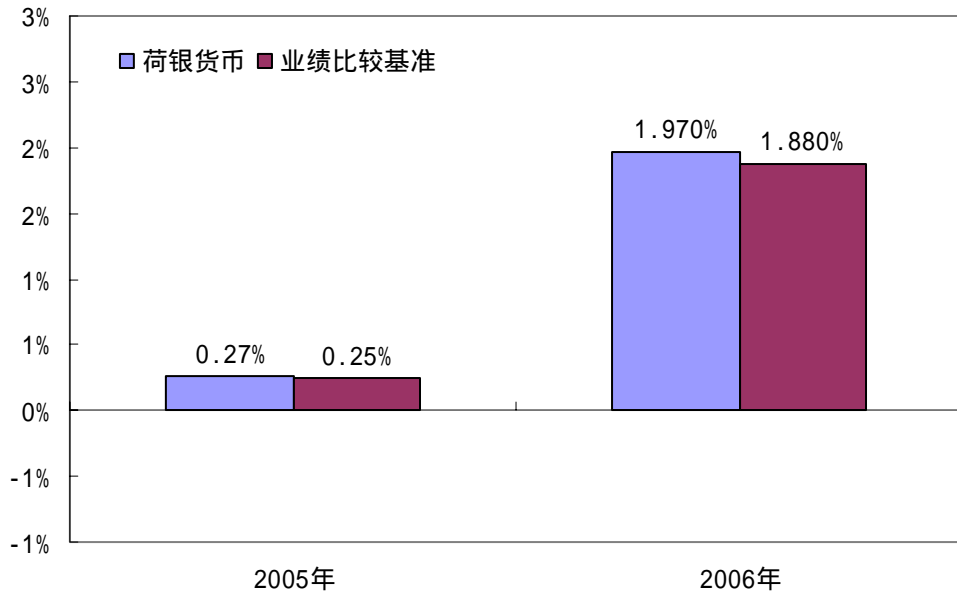
(包含非正常收入)：



b) 基金合同生效以来基金份额净值变动情况及与同期业绩比较基准的变动对比图(不包含非正常收入)：



3、自本基金合同生效以来每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的收益率比较图：



(三) 自基金合同生效以来收益分配情况 (单位: 元)

年度	收益分配金额
2005 年 11 月 10 日 (基金合同生效日) 至 2005 年 12 月 31 日	7,832,481.83
2006 年度	47,736,897.37

四、基金管理人报告

(一) 基金管理人基本情况

泰达荷银基金管理有限公司 (原名湘财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, 注册资本 1 亿元人民币。2003 年 9 月 4 日, 经中国证监会证监基金字 [2003] 102 号文批准, 荷兰银行有限公司参股本公司, 湘财合丰基金管理有限公司成为中外合资基金管理公司, 并更名为湘财荷银基金管理有限公司。2005 年 2 月 6 日, 经中国证监会批准 (证监基金字 [2005] 21 号文), 荷兰银行有限公司将所持有的本公司 33% 的股权转让给荷银投资管理 (亚洲) 有限公司, 公司股权结构为湘财证券有限责任公司 67%、荷银投资管理 (亚洲) 有限公司 33%。2006 年 4 月 27 日, 经中国证监会批准 (证监基金字 [2006] 64 号文), 湘财证券有限责任公司将所持有的湘财荷银基金管理有限公司全部 67% 的股权分别转让给公司外方股东荷银投资管理 (亚洲) 有限公司 16%、北方国际信托投资股份有限公司 51%。目前本公司股东及持股比例分别为: 北方国际信托投资股份有限公司: 51%; 荷银投资管理 (亚洲) 有限公司: 49%。2006 年 10 月 18 日, 本公司发布关于增加注册资本的公告, 根据股东会决议, 将本公司注册资本由 1 亿元人民币增加 1.8 亿元人民币。

报告期末公司旗下管理 8 只开放式基金, 分别为泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、泰达荷银价值优化型周期类行业证券投资基金、泰达荷银价值优化型稳定类行业证券投资基金、泰达荷银行业精选证券投资基金、泰达荷银风险预算混合型证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、泰达

荷银效率优选混合型证券投资基金以及泰达荷银首选企业股票型证券投资基金。

（二）基金经理基本情况

梁钧先生，自 2005 年 10 月起担任本基金基金经理，2000 年 7 月毕业于上海交通大学企业管理专业获博士学位。2000 年 7 月至 2002 年 12 月，在湘财证券研发中心投资策略部从事债券研究及咨询服务。2002 年 12 月至 2004 年 5 月，在中国太平洋保险（集团）股份有限公司资金运用中心债券业务处从事债券策略研究及债券交易。2004 年 5 月至今，就职于泰达荷银基金管理有限公司，任债券组合经理；2005 年 4 月至今，担任泰达荷银风险预算基金债券基金经理，同时全面负责泰达荷银固定收益类产品的投资。8 年债券研究、投资经验，具有基金从业资格。

彭泳先生，自 2006 年 12 月起担任本基金基金经理，2002 年毕业于北京大学经济学院金融学专业，获金融学硕士学位，同年加入泰达荷银基金管理有限公司，曾担任董事会秘书、2004 年 3 月起担任研究部宏观和固定收益研究员、2005 年 11 月起担任货币市场基金基金经理助理。4 年基金从业经验，具有基金从业资格。

（三）遵规守信情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

（四）本报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明及展望

截至报告期末，本基金累计每万份基金净收益为 187.0580 元，本报告期基金份额净值收益率为 1.9697%，同期业绩比较基准收益率为 1.8799%。

2006 年以来，货币市场所面临的宏观环境发生了一些深刻的变化：国际贸易顺差的持续流入，人民币升值压力加大，导致市场流动性过剩；国有银行上市后信贷冲动增强，固定资产投资高位运行，促使央行采取持续紧缩的货币政策，而股票市场全流通后大幅上涨的赚钱效应也大大削弱了货币市场基金对投资者的吸引力，货币市场基金遭遇系统性风险，基金规模大幅萎缩。在经济存在过热与人民币升值压力的双重影响下，各种紧缩性货币政策工具

出台的力与频度均达到历史最高水平：央行两次上调基准利率、三次上调法定存款准备金率、四次发行定向票据，并多次进行窗口指导，进而导致了货币市场利率波动性加强，难以实施较为积极的主动投资。

2006年，我们及时跟踪分析货币政策导向，把握货币市场的变化趋势。我们一方面坚持实施稳健的投资风格和谨慎的交易操作。以价值分析为基础，数量分析为支持，采用自上而下确定投资策略和自下而上个券选择的程序，运用久期策略、收益率曲线配置等积极投资策略，实现货币市场基金资产的保值增值。另一方面，进一步强化货币市场基金的流动性管理、利率风险管理和信用风险管理，在保证基金安全性、流动性的前提下，为投资者提供稳定的业绩回报。此外，我们还通过积极的一二级市场交易以及细化的日常操作有效地提高了基金的组合收益水平和资金使用效率。

考虑到2007年通货膨胀水平存在上行的压力，中长期债券的发行量将大幅扩大，股票市场对于资金的分流效应也持续显现，未来一段时期的货币政策也将主要针对继续加强流动性控制和信贷反弹两大问题，因此我们认为2007年的货币市场仍将继续处于一个波动态势。短期货币市场利率可能会伴随着市场流动性的持续弱化呈现缓步抬高的走势；受制于中美利差的关系，1年期央行票据的发行利率将有望呈现缓步回落态势。

因此，在基金的日常管理中，我们将继续紧密跟踪分析宏观经济趋势和央行货币政策，及时把握市场资金面变化情况，力争对货币市场的运行趋势做出准确的判断并形成具有前瞻性的操作策略，继续贯彻执行基于MVS模型分析的决策机制，进行适当的基金组合久期控制，保持防御性的投资操作策略。

(五)基金内部监察稽核情况

在本报告期内，基金管理人为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，督察长、监察稽核部门、风险控制部门定期与不定期的对基金的投资、交易、研发、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的监督检查。

同时，公司制定了具体严格的投资授权流程与权限；在证券投资交易前由研究部门建立可供投资的优选库并定期进行全面维护更新和适时对个股进行维护更新，通过信息技术建立多级投资交易预警系统，并把禁选股票（含未履行规定审批程序的关联股票）排除在交易系统之外；设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；引入外方股东在风险控制方面的先进经验，完善公司风险管理指标及流程，监控公司各项业务的运作状况和风险程度；独立于各业务部门的内部监察人员日常对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报中国证监会、当地证监局和公司董事会。

五、基金托管人报告

2006 年全年，托管人在泰达荷银货币市场基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

2006 年全年，泰达荷银基金管理有限公司在泰达荷银货币市场基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。基金管理人遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作按照基金合同的规定进行。

2006 年全年，由泰达荷银基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关泰达荷银货币市场基金的全年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

六、审计报告

普华永道中天审字(2007)第 20485 号

泰达荷银货币市场基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的泰达荷银货币市场基金会计报表，包括 2005 年 12 月 31 日和 2006 年 12 月 31 日资产负债表、2005 年 12 月 10 日(基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日止期间和 2006 年度经营业绩表及基金净值变动表以及会计报表附注。

一、 管理层对会计报表的责任

按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《泰达荷银货币市场基金基金合同》及中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制会计报表是泰达荷银货币市场基金的基金管理人泰达荷银基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 设计、实施和维护与会计报表编制相关的内部控制，以使会计报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；
- (2) 选择和运用恰当的会计政策；
- (3) 作出合理的会计估计。

二、 注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对会计报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对会计报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关会计报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的会计报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与会计报表编制

相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价会计报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、 审计意见

我们认为，上述会计报表已经按照国家颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《泰达荷银货币市场基金基金合同》及中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了泰达荷银货币市场基金 2005 年 12 月 31 日和 2006 年 12 月 31 日的财务状况、2005 年 11 月 10 日(基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日止期间和 2006 年度的经营成果和基金净值变动。

普华永道中天
会计师事务所有限公司

注册会计师
汪 棣

中国 · 上海市

注册会计师
王鸣宇

2007 年 2 月 28 日

七、财务会计报告

(一)基金会计报表

1. 泰达荷银货币市场基金

资产负债表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	附注	2006年 12月31日	2005年 12月31日
资产			
银行存款	1	367,212,318.60	820,690,068.41
结算备付金		-	431,776,022.51
交易保证金		-	-
应收利息	2	3,610,099.45	5,268,117.76
应收申购款		-	32,328,121.03
股票投资市值		-	-
其中：股票投资成本		-	-
债券投资市值		182,587,488.86	1,160,251,998.08
其中：债券投资成本		182,587,488.86	1,160,251,998.08
权证投资		-	-
其中：权证投资成本		-	-
买入返售证券		38,400,000.00	50,000,000.00
待摊费用		-	-
其他资产		-	-
资产总计		591,809,906.91	2,500,314,327.79

负债及持有人权益

负债

应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付赎回费	-	-

应付管理人报酬		139,850.43	754,140.33
应付托管费		42,378.94	228,527.37
应付佣金		-	-500.00
应付销售费		105,947.34	571,318.42
应付利息	3	-	313,360.3
应付收益		421,392.47	2,368,615.14
其他应付款	4	19,865.15	18,000.00
预提费用	5	84,500.00	47,386.56
卖出回购证券款		-	386,500,000.00
负债合计		813,934.33	390,800,848.12
持有人权益			
实收基金	6	590,995,972.58	2,109,513,479.67
未实现利得		-	-
未分配收益		-	-
持有人权益合计		590,995,972.58	2,109,513,479.67
负债及持有人权益总计		591,809,906.91	2,500,314,327.79

2. 泰达荷银货币市场基金

经营业绩表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

		2006年	2005年11月10日 (基金合同生效日) 至2005年 12月31日止期间
收入			
股票差价收入		-	-
债券差价收入	7	16,917,881.66	2,496,158.24
权证差价收入		-	-

债券利息收入		27,442,033.41	2,740,151.75
存款利息收入		19,895,821.83	5,846,469.97
股利收入			
买入返售证券收入		4,680,313.05	127,313.13
其他收入	8	1,259,450.46	-
收入合计		70,195,500.41	11,210,093.09

费用

基金管理人报酬		8,069,264.37	1,390,195.31
基金托管费		2,445,231.63	421,271.29
卖出回购证券支出		5,189,858.73	429,147.97
基金销售服务费		6,113,079.12	1,053,178.25
其他费用	9	641,169.19	83,818.44

其中：信息披露费

262,589.64	37,410.36
70,023.8	9,976.2
84,745.6	16,156.88
223,810.2	20,275.00

审计费用

银行费用

其他费用

费用合计		22,458,603.04	3,377,611.26
------	--	---------------	--------------

基金净收益		47,736,897.37	7,832,481.83
-------	--	---------------	--------------

加：未实现估值增值/(减值)变动数		-	-
-------------------	--	---	---

基金经营业绩		47,736,897.37	7,832,481.83
--------	--	---------------	--------------

3. 泰达荷银货币市场基金

收益分配表

本期基金净收益		47,736,897.37	7,832,481.83
---------	--	---------------	--------------

加：期初基金净收益		-	-
-----------	--	---	---

加：本期损益平准金		-	-
-----------	--	---	---

可供分配基金净收益		47,736,897.37	7,832,481.83
加：以前年度损益调整		-	-
减：本期已分配基金净收益	10	47,736,897.37	7,832,481.83
期末基金净收益		0.00	0.00

泰达荷银货币市场基金

基金净值变动表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	2006 年	2005 年 4 月 5 日 (基金合同生效日) 至 2005 年 12 月 31 日止期间
期初基金净值	2,109,513,479.67	4,643,264,492.55
本期经营活动		
基金净收益	47,736,897.37	7,832,481.83
未实现估值增值/(减值)变动数	-	-
经营活动产生的基金净值变动数	47,736,897.37	7,832,481.83
本期基金份额交易		
基金申购款	13,085,929,144.38	1,268,816,034.26
其中：分红再投资	44,373,351.10	3,822,615.94
基金赎回款	14,604,446,651.47	3,802,567,047.14
基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,518,517,507.09	-2,533,751,012.88
本期向基金份额持有人分配收益		
向基金份额持有人分配收益产生的基金净值变动数	47,736,897.37	7,832,481.83
期末基金净值	590,995,972.58	2,109,513,479.67

(二) 会计报表附注

(除特别标明外，金额单位为人民币元)

1. 基金基本情况

泰达荷银货币市场基金(以下简称“本基金”，原湘财荷银货币市场基金)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[2005]第 161 号《关于同意湘财荷银货币市场基金设立的批复》核准，由湘财荷银基金管理有限公司(于 2006 年 4 月 27 日更名为泰达荷银基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《湘财荷银货币市场基金基金合同》(于 2006 年 6 月 6 日改为《泰达荷银货币市场基金基金合同》)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 4,642,951,338.78 元，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(2005)第 164 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《湘财荷银货币市场基金基金合同》于 2005 年 11 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,643,264,492.55 份基金份额，其中认购资金利息折合 313,153.77 份基金份额。本基金的基金管理人为泰达荷银基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行。

2006 年 6 月 6 日，经基金管理人董事会批准、报中国证监会同意，本基金更名为泰达荷银货币市场基金。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《泰达荷银货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为现金；一年以内的银行定期存款、大额存单；剩余期限在 397 天以内的债券；期限在一年以内的中央银行票据和债券回购，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

2. 会计报表编制基础

本基金的会计报表按照国家颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》和《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》及中国证监会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

3. 主要会计政策和会计估计

1) 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较会计报表的实际编制期间为 2005 年 11 月 10 日(基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日。

2) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

3) 记账基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。债券投资和待回购债券采用摊余成本法计价，同时按公允价值进行估值监控。除此之外，所有报表项目均以历史成本计价。

4) 基金资产的估值方法

本基金的债券投资采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率或交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用市场利率和交易价格对基金持有的计价对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与影子定价的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25%时，基金管理人与基金托管人商定后应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

如有确凿证据表明按上述方法进行计价不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法计价。

5) 证券投资的成本计价方法

买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。买入央行票据和零息债券无需单独核算应收利息。

卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入。出售债券的

成本按移动加权平均法于成交日结转。

6) 待摊费用的摊销方法和摊销期限

核算本期已发生的，影响基金份额小数后五位，应分摊计入本期的费用，按直线法在受益期内平均摊销。

7) 收入的确认和计量

银行间同业市场交易的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入/(损失)按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

除银行次级债之外的债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额，并根据买入债券时溢价或折价的摊销数及应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税进行调整后的金额确认；银行次级债利息收入按债券票面价值与全额票面利率计算的金额，并根据买入债券时溢价或折价的摊销数进行调整后的金额确认。债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提。

8) 费用的确认和计量

基金管理费按照前一日基金资产净值 0.33%的年费率逐日计提；

基金托管费按照前一日基金资产净值 0.1%的年费率逐日计提；

基金销售服务费按照前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提；

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

9) 基金的收益分配政策

“每日分配，按月支付”。基金收益分配方式为红利再投资，每日进行收益分配；

每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有确认当日的分红权益，而赎回的

基金份额享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每月以红利再投资方式集中支付累计收益，每月集中宣告收益分配并将应付收益结转到基金份额持有人基金账户。

10) 基金申购、赎回的确认

在收到基金投资人申购或赎回申请之日后，于下一个工作日内对该交易的有效性进行确认。

11) 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

12) 重大会计差错的内容和更正金额

本报告期无重大会计差错和更正金额。

4. 主要税项

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》和财税 [2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，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) 基金买卖债券的差价收入免征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。

5. 主要报表项目说明

金额单位：人民币元

(1). 银行存款

项 目	2006-12-31	2005-12-31
活期存款	167,212,318.60	20,690,068.41
定期存款投资	200,000,000.00	800,000,000.00
合 计	367,212,318.60	820,690,068.41

于 2006 年 12 月 31 日，因大额赎回导致基金投资定期存款比率超过基金资产净值的 30%。

(2). 应收利息

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
应收银行存款利息	3,426,039.98	2,247,163.54
应收债券利息	169,541.09	2,673,241.89
应收买入返售证券利息	14,518.38	127,313.13
应收结算备付金利息	-	220,399.20
	3,610,099.45	5,268,117.76

(3). 应付利息

2005年12月31日，应付利息余额为银行间市场卖出回购证券产生的应付利息。

(4). 其他应付款

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
债券交易手续费	16,630.00	17,400.00
回购交易手续费	3,235.15	600.00
	19,865.15	18,000.00

(5). 预提费用

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
--	------------------	------------------

审计费用	80,000.00	9,976.20
债券托管账户维护费	4,500.00	-
信息披露费	-	37,410.36
	84,500.00	47,386.56

(6). 实收基金

	基金份额	基金面值
募集期间认购资金本金(a)	4,642,951,338.78	4,642,951,338.78
募集期间认购资金利息折份 额(a)	313,153.77	313,153.77
期初基金净值	4,643,264,492.55	4,643,264,492.55
2005年11月10日至12月31 日期间申购(b)	1,268,816,034.26	1,268,816,034.26
其中：红利再投资	3,822,615.94	3,822,615.94
2005年11月10日至12月31 日期间赎回(b)	(3,802,567,047.14)	(3,802,567,047.14)
2005年12月31日	2,109,513,479.67	2,109,513,479.67
2006年申购	13,085,929,144.38	13,085,929,144.38
其中：红利再投资	44,373,351.10	44,373,351.10
2006年赎回	(14,604,446,651.47)	(14,604,446,651.47)
2006年12月31日	590,995,972.58	590,995,972.58

(a) 本基金自2005年10月24日至2005年11月4日止期间公开发售，共募集有效净认购资金4,642,951,338.78元。根据《湘财荷银货币市场基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入313,153.77元在本基金成立后，折算为313,153.77份基金份额，划归基金资产。

(b) 根据湘财荷银基金管理有限公司《关于湘财荷银货币市场基金开放日常申购、赎回业务的公告》的相关规定，本基金于 2005 年 11 月 15 日起办理日常申购、赎回业务。

(7). 债券差价收入

	2006 年	2005 年 11 月 10 日(基金合同生效 日)至 2005 年 12 月 31 日止期间
卖出及到期兑付债券结算金额	17,697,179,541.26	1,586,791,893.94
减：应收利息总额	(66,267,724.42)	(2,465,725.67)
减：卖出及到期兑付债券成本总额	(17,613,993,935.18)	(1,581,830,010.03)
	16,917,881.66	2,496,158.24

(8) 其他收入

	2006 年度	2005 年 11 月 10 日(基金合同生效 日)至 2005 年 12 月 31 日止期间
提前支取定期存款补偿收入(a)	1,254,257.46	-
其他	5,193.00	-
	1,259,450.46	-

(a) :按相关会计规则，此部分非正常收入是本基金 2006 年度因提前支取定期存款而损失的利息收入，此款已由基金管理人泰达荷银基金管理有限公司全额补偿。

(9). 其他费用

	2006 年度	2005 年 11 月 10 日(基金合同生效 日)至 2005 年 12 月 31 日止期间
信息披露费	262,589.64	37,410.36

银行费用	84,745.60	16,156.88
外汇交易中心手续费	83,958.75	-
银行间债券交易费用	79,800.00	18,000.00
审计费用	70,023.80	9,976.20
回购交易费用	40,551.40	1,875.00
银行间帐户服务费	19,500.00	-
其他	-	400.00
	641,169.19	83,818.44

(10). 本期已分配基金净收益

本基金在 2005 年 11 月 10 日(基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日止期间,累计分配收益 7,832,481.83 元,其中以分红再投资形式已结转为基金份额而计入实收基金 3,822,615.94 元(附注 10),包含于赎回款的已分配未支付收益 1,641,250.75 元,未结转为基金份额而计入应付收益 2,368,615.14 元。

本基金在 2006 年度累计分配收益 47,736,897.37 元,与年初应付收益 2,368,615.14 元共计 50,105,512.51 元,其中以分红再投资形式已结转为基金份额而计入实收基金 44,373,351.10 元(附注 10),包含于赎回款的已分配未支付收益 5,310,768.94 元,未结转为基金份额而计入应付收益 421,392.47 元。

6. 重大关联方关系及关联交易

(1) 关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰达荷银基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行	基金托管人、基金代销机构
湘财证券有限责任公司(“湘财证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
荷银投资管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东

荷兰银行有限公司

基金管理人的原股东

根据泰达荷银基金管理有限公司于 2006 年 4 月 27 日发布的公告，经 2005 年第五次股东会审议通过，报中国证监会批准(证监基金字[2006]64 号文)，湘财证券有限责任公司分别将其持有的湘财荷银基金管理有限公司 67%股权转让给荷银投资管理(亚洲)有限公司 16%，北方国际信托投资股份有限公司 51%。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 基金管理人报酬

支付基金管理人泰达荷银基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%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：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.33% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬 8,069,264.37 元(2005 : 1,390,195.31 元)。

(3) 基金托管费

支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%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：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金托管费 2,445,231.63 元(2005 : 421,271.29 元)。

(4) 基金销售服务费

支付基金销售机构的基金销售服务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，按月支付给泰达荷银基金管理有限公司，再由泰达荷银基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日基金持续销售费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金销售服务费 6,113,079.12 元(2005 : 1,053,178.25 元)。其中需支付给关联方的基金销售服务费如下：

	2006 年度	2005 年 11 月 10 日(基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日止期间
湘财证券有限责任公司	197,389.63	70,846.91
中国农业银行	1,057,611.92	432,747.15
泰达荷银基金管理有限公司	4,175,734.32	444,606.88

(5) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按约定利率计息。基金托管人于 2006 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 167,212,318.60 元(2005 年 :20,690,068.41 元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 3,122,195.77 元(2005 : 373,165.48 元)。

(6) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易

本基金在本年度与基金托管人中国农业银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

	2006 年度	2005 年 11 月 10 日(基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日止期间
买入债券结算金额	2,599,431,669.41	676,782,813.50
卖出债券结算金额	2,970,413,599.38	398,135,299.72
卖出回购证券协议金额	107,900,000.00	175,000,000.00
卖出回购证券利息支出	55,046.58	115,787.67

7. 流通受限制不能自由转让的基金资产

本基金截至 2005 年 12 月 31 日止从事银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券款余额 386,500,000.00 元，系以如下债券作为抵押：

债券代码	债券名称	回购到期日	年末估值单价	数量	年末估值总额
0581071	05 铁道 CP02	2006/01/10	100.18	700,000.00	70,126,000.00
058031	中信债 1	2006/01/10	99.98	2,000,000.00	199,960,000.00
040212	04 国开 12	2006/02/22	101.09	300,000.00	30,327,000.00
040217	04 国开 17	2006/02/22	101.50	500,000.00	50,750,000.00
040303	04 进出 03	2006/02/22	101.83	500,000.00	50,915,000.00
合 计				4,000,000.00	402,078,000.00

八、投资组合报告

(一) 本报告期末基金资产组合 (单位：元)

项目	金额	占基金总资产比例
债券投资	182,587,488.86	30.85%
买入返售证券	38,400,000.00	6.49%
其中：买断式回购的买入返售证券	0.00	0.00%
权证	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金合计	367,212,318.60	62.05%
其他资产	3,610,099.45	0.61%
合计	591,809,906.91	100.00%

(二) 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	106,424,300,000.00	8.77%
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：上表中，报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数，报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

其中，因赎回原因，2006年4月28日本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%，详情如下：

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2006年4月28日	20.96%	赎回	1天

(三) 基金投资组合平均剩余期限

1、投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	112
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	178
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	54

其中，本报告期内投资组合剩余期限无超过180天。

2、期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金 资产净值的比例	各期限负债占基金 资产净值的比例
1	30 天内	34.79%	0.00%
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00%	0.00%
2	30 天(含) - 60 天	0.87%	0.00%
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.87%	0.00%
3	60 天(含) - 90 天	0.00%	0.00%
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00%	0.00%
4	90 天(含) - 180 天	45.66%	0.00%
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	5.11%	0.00%
5	180 天(含) - 397 天 (含)	18.20%	0.00%
	合计	99.52%	0.00%

(四) 报告期末债券投资组合

1、按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值 的比例(%)
1	国家债券	0.00	0.00%
2	金融债券	39,630,409.60	6.71%
	其中：政策性金融债	39,630,409.60	6.71%
3	央行票据	29,337,157.71	4.96%
4	企业债券	113,619,921.55	19.23%
5	其他	0.00	0.00%

合 计	182,587,488.86	30.89%
剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	35,366,586.04	5.98%

2、基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量(张)		成本(元)	占资产净值的比例(%)
		自有投资	买断式回购		
1	06 中冶 CP01	500000		48,217,281.45	8.16%
2	06 国开 27	400000		39,630,409.60	6.71%
3	05 中信债 1	300000		30,219,998.25	5.11%
4	06 上石化 CP02	300000		30,036,054.06	5.08%
5	06 央票 78	300000		29,337,157.71	4.96%
6	06 首都机场债	50000		5,146,587.79	0.87%

(五)“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项 目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.5%(含)以上的次数	0
报告期内偏离度的绝对值在 0.25%(含)-0.5%间的次数	7
报告期内偏离度的最高值	0.3034%
报告期内偏离度的最低值	-0.2920%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0867%

(七) 投资组合报告附注

1、基金计价方法说明：本基金采用“摊余成本法”计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。

2、本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券，但

不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况。

3、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

4、其他资产（单位：元）

序号	其他资产	金额(元)
1	交易保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	3,610,099.45
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
合计		3,610,099.45

5.由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、 基金份额持有人户数、持有人结构

基金名称	基金持有人户数 (户)	户均持有份额 (份)	基金持有人份额结构			
			个人持有份额 (份)	占总份额比例	机构持有份额 (份)	占总份额比例
荷银货币	4165	141,895.79	186,834,445.50	31.61%	404,161,527.08	68.39%

十、 开放式基金份额变动情况

	荷银货币基金
基金合同生效日基金份额	4,643,264,492.55
本期期初基金份额	2,109,513,479.67
期间总申购份额	13,085,929,144.38

期间总赎回份额	14,604,446,651.47
本期期末基金份额	590,995,972.58

注：本基金合同生效日为 2005 年 11 月 10 日

十一、重大事件揭示

(一) 本年度无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(二) 本年度基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有发生受到监管部门稽查或处罚的任何情况。

(三) 本年度本基金未更换会计师事务所，本年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费用为 8 万元，该审计机构对本基金提供审计服务的年限为从 2005 年 11 月 10 日（基金合同生效日）起到 2006 年 12 月 31 日。

(四) 本基金管理人已于 2006 年 4 月 27 日发布公告，经公司 2005 年第五次股东会审议通过并报中国证监会批准（证监基金字[2006]64 号文），公司股权结构、名称变更情况如下：

1、股权变更

原公司第一大股东湘财证券有限责任公司将所持有的泰达荷银基金管理有限公司全部 67% 的股权分别转让给公司外方股东荷银投资管理（亚洲）有限公司 16%、北方国际信托投资股份有限公司 51%。

变更后的股东及持股比例分别为：

北方国际信托投资股份有限公司：51%；荷银投资管理（亚洲）有限公司：49%。

2、公司更名

公司名称由“湘财荷银基金管理有限公司”变更为“泰达荷银基金管理有限公司”，公司英文名称由 ABN AMRO XIANGCAI Fund Management Co., Ltd. 变更为 ABN AMRO TEDA Fund Management Co., Ltd. 鉴于公司名称已经变更，公司决定将原公司网站名称 <http://www.xchyf.com> 变更为 <http://www.aateda.com>

公告内容详见 2006 年 4 月 27 日的《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站。

(五) 本基金管理人已于 2006 年 6 月 6 日发布公司旗下基金更名公告，经公司董事会批准、中国证监会同意，原湘财荷银货币市场证券投资基金变更为泰达荷银货币市

场证券投资基金，本基金简称、基金代码均不作变更。公告内容详见当日的《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和本公司网站。

(六) 本基金管理人已于 2006 年 6 月 16 日发布关于变更董事、独立董事、监事的公告，根据本公司 2006 年度第一次股东会议决议，决定选举刘惠文先生、刘振宇先生、马军先生担任公司的董事，选举孔晓艳女士、范小云女士担任公司的独立董事，选举邢吉海先生、陈铁风先生担任公司的监事，同意张世明先生、金岩石先生辞去公司董事，同意薛谋洪先生、郭青峰先生辞去公司独立董事，同意郭道扬先生、施光耀先生辞去公司监事的请求。

根据泰达荷银基金管理有限公司 2006 年度第四次股东会会议决议，决定选举何国良先生为公司董事，林伟萌先生不再担任公司董事。

上述董事、独立董事的变更事项已报备监管部门备案。

(七) 本基金管理人已于 2006 年 10 月 18 日发布关于增加注册资本的公告，根据泰达荷银基金管理有限公司股东会决议，泰达荷银基金管理有限公司注册资本由人民币一亿(RMB 100,000,000 元)增加为人民币一亿八千万元(RMB 180,000,000 元)，公司现有股东按其在公司的出资比例同比例认缴增资额，原持股比例保持不变，仍为：北方国际信托投资股份有限公司：51%；荷银投资管理（亚洲）有限公司：49%。

上述事项已经中国证券监督管理委员会批准，相关工商注册变更登记手续已完成。

(八) 根据公司 2006 年度第七次董事会会议决议，选举刘惠文先生担任公司董事长，目前正在履行证券投资基金行业高级管理人员任职资格申请程序。

根据公司 2006 年度第七次董事会会议决议，选举章嘉玉女士担任公司副董事长。

根据公司 2006 年度第十六次董事会会议决议，聘任刘青山先生担任公司副总经理。

经公司董事会批准，苏朗诗（Solange Rouschop）女士因工作调动的原因不再担任泰达荷银基金管理有限公司副总经理职务。

经公司董事会批准，黄竹平先生因任期届满不再担任泰达荷银基金管理有限公司督察长职务，由张萍女士担任督察长职务。

上述变动事项已按规定报告中国证监会基金监管部与北京证监局。

(九) 本基金管理人已于 2006 年 11 月 30 日发布迁址公告，公司办公地址自 2006 年 12 月 3 日由“北京市海淀区西三环北路 11 号海通商务中心 C.1 座”迁至“北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层”。

(十) 本基金管理人已于 2006 年 12 月 23 日发布关于调整基金经理的公告, 经公司董事会批准, 决定聘任彭泳先生担任泰达荷银货币市场基金基金经理, 与梁钧先生共同管理泰达荷银货币市场基金。

(十一) 本公司分别于 2006 年 8 月 21 日、12 月 7 日、12 月 27 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站发布增加渤海证券有限责任公司、广发华福证券有限责任公司、德邦证券有限责任公司为本基金代销机构的公告。

(十二) 席位交易情况

证券公司名称及席位数量、债券回购交易及支付佣金情况

券商名称	席位数量	债券回购成交金额	占成交总额比例	支付佣金	占佣金总量比例
中银国际证券	1	1,439,900,000.00	100%	-9,393.50	100%
合计	1	1,439,900,000.00	100%	-9,393.50	100%

(十三) 基金租用证券公司专用席位的有关情况

交易席位选择的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构, 使用其席位作为基金的专用交易席位, 选择的标准是:

- (1) 经营规范, 有较完备的内控制度;
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施符合证券交易的需要;
- (3) 能为基金管理人提供高质量的研究咨询服务。

十二、备查文件目录

(一) 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集的文件;
- 2、基金合同;
- 3、托管协议;
- 4、法律意见书;
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照;

7、中国证监会要求的其他文件。

(二) 存放地点：基金管理人和基金托管人的住所

(三) 查阅方式：基金投资者可在营业时间免费查阅，或基金投资者也可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）或登陆本基金管理人互联网网址（<http://www.aateda.com>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泰达荷银基金管理有限公司：

客户服务中心电话：010-66577555

网址：<http://www.aateda.com>

泰达荷银基金管理有限公司

2007年3月28日