0.00%

206.879.960.96

泰达荷银货币市场基金 2006年半年度报告

基金管理人:泰达荷银基金管理有限公司 基金托管人:中国农业银行

本基金管理人分别于 2006 年 4 月 27 日、6 月 6 日发布公司更名公告及旗下基金更名

本等显显是人们加了2000年4月27 日30月0日 日次印达日央记公日及旅户等亚史石公告,经公司董事会批准,中国证监会同意,原湘财荷银基金管理有限公司的名称变更为泰达荷银基金管理有限公司,原湘财荷银货币市场基金变更为泰达荷银货币市场基金。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

其全管理人的董事会及董事保证本报告的裁资料不左在虚假记载 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。本半年度报告已经全体 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2006年8月18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

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。 报告期为 2006 年 1 月 1 日起至 2006 年 6 月 30 日止,本报告财务资料未经审计。

本半年度报告摘要摘自本半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读登载于本基金管理人国际互联网网站(http://www.aateda.com)上的本半年度报告正文。

一、基金简介

(一)基金基本资料 基金简称:荷银货币基金

基金交易代码: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:1,734,313,085.80

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 讨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 金金金级已经验证:不会通过企业的企业。 在合理的市场化利率基准推出的情况下,基金管理人可根据投资目标,投资方向和 投资策略,确定变更业绩比较基准,并提前公告。

[30] (我们说明,明定交流现代水器性,开始的公司。 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。

二)基金管理人 名称:泰达荷银基金管理有限公司 信息披露负责人:黄竹平 联系电话:010-88518989-8071,8212

传真:010-68721958 电子邮箱:im@aateda.com 三)基金托管人

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

登载半年度报告正文的管理人互联网网址:http://www.aateda.com 基金半年度报告置备地点:基金管理人、基金托管人的住所

二、主要财务指标和基金净值表现

	单位:人民币元
财务指标	2006年1月1日至2006年6月30日
1基金本期净收益(包括非正常收入)	38,380,182.38
2.基金本期净收益(不包括非正常收人)	37,125,924.92
3.期末基金资产净值	1,734,313,085.80
4.期末基金份额净值	1.0000
5.本期净值收益率(包括非正常收入)	1.0345%
6.本期净值收益率(不包括非正常收人)	0.9522%
7.累计净值收益率(包括非正常收人)	1.3025%
8.累计净值收益率(不包括非正常收入)	1.2200%
注:1.本基金基金合同于2005年11	月 10 日生效, 自基金合同生效日至本报告期末本

基金运作时间未满一年,上述各项指标按本基金实际存续期计算。 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. 基金收	益率与同期	月业绩基准的	文益率比较表 (名	含非正常收入部	分)	
	阶段 基金收益率 本期收益率标 业绩比较基准收益 业绩比较基准收益率						(2)-(4)
Ì	过去1个月	0.2359%	0.0182%	0.1479%	0.0000%	0.0879%	0.0182%
Ì	过去3个月	0.5549%	0.0111%	0.4488%	0.0000%	0.1061%	0.0111%
Ì	过去6个月	.1.0345%	0.0085%	0.8926%	0.0000%	0.1418%	0.0085%
Ì	合同生效以来	1.3025%	0.0077%	1.1490%	0.0000%	0.1535%	0.0077%
	注: 木基全收益公配按目结转公额						

注:自基金合同生效日至本报告期末本基金运作未满一年。基金收益率按实际存续期

	2、a. 基金收益率与同期业绩基准收益率比较表 (不含非正常收入部分)						
	阶段	基金收益率 (1)	本期收益率标 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)
Ī	过去1个月	0.1543%	0.0054%	0.1479%	0.0000%	0.0064%	0.0054%
Ī	过去3个月	0.4730%	0.0049%	0.4488%	0.0000%	0.0242%	0.0049%
	过去6个月	0.9522%	0.0048%	0.8926%	0.0000%	0.0596%	0.0048%
	合同生效以来	1.2200%	0.0045%	1.1490%	0.0000%	0.0710%	0.0045%

注:本基金收益分配按月结转份额 b. 本基金历史各时间段基金份额净值收益率与同期业绩比较基准收益率的比较列表

注:自基金合同生效日至本报告期末本基金运作未满一年。基金收益率按实际存续期

本基金每年的基金收益分配情况 本基金以单位面值 1.00 元固定单位净值交易方式,每日计算当日收益并全部分配,每

月以红利再投资方式集中支付累计收益,即按单位面值 1.00 元转为基金份额。本基金于本 报告期累计分配收益38,380,182.38元。

三、管理人报告

-)基金管理人及其管理基金的经验

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)是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。目前公司股权结构为: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%。 截至 2006 年 6 月 30 日,泰达荷银基金管理有限公司旗下共管理七只开放式基金,包括:泰

达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、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 荷银货币市场基金和泰达荷银效率优选混合型证券投资基金,管理基金资产规模达99.6亿

(二)基金经理情况 梁钧先生,本基金经理,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,先后任债券组合经理、荷银预算基金经理、荷银货币基金经理、固定收益部总经理。

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)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明及简要展望

2006年上半年债券市场收益率受到来自于紧缩性货币政策以及新股恢复发行两方面 压力影响而发生较大幅度的整体性上扬。市场对通胀压力和紧缩性政策存在忧虑,交投意

基于对货币市场走势的预期,我们一方面通过提前出售部分组合债券降低组合久期以 及适当的融资安排,加强了对投资组合流动性的管理,以确保满足持有人的正常赎回需要; 另一方面基于对新股申购市场利率走势特点的分析,积极参与银行间和交易所的回购交

易,提高了投资组合的整体静态收益率水平,保证了基金收益与流动性的合理平衡。 我们对 2006 年下半年债券市场的整体判断是中性偏负,我们认为宏观经济的整体趋 势仍然对债券市场具有不利的影响,央行继续出台紧缩政策的预期仍然很强。因此,在基金 把握新股发行的节奏和规律,继续保持货币基金作为流动性管理工具的本质特点。

四、托管人报告

本基金托管人一中国农业银行根据《泰达荷银货币市场基金基金合同》和《泰达荷银 货币市场基金托管协议》,在托管泰达荷银货币市场基金的过程中,严格遵守《证券投资基 金法》及各项法规规定,对泰达荷银货币市场基金管理人一泰达荷银基金管理有限公司 2006年1月1日至2006年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必 要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。 本托管人认为,泰达荷银基金管理有限公司在泰达荷银货币市场基金的投资运作、基

金资产净值的计算、基金费用开支等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报 告期内,较好的遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作较好的按

信息披露符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其相关法规的规定,基金管理人 所编制和披露的泰达荷银货币市场基金 2006 年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,投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金份额持

(一)基金会计报表

资产负债表 (2006年6月30日)

			金额单位:人民币元
资 产	附注	2006-6-30	2005-12-31
资 产:			
银行存款	1	835,488,821.45	820,690,068.41
清算备付金		0.00	431,776,022.51
交易保证金		0.00	0.00
应收证券清算款		0.00	0.00
应收股利		0.00	0.00
应收利息	2	9,631,323.09	5,268,117.76
应收申购款		197,248,637.87	32,328,121.03
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值		0.00	0.00
其中:股票投资成本		0.00	0.00
债券投资市值		446,797,946.57	1,160,251,998.08
其中:债券投资成本		446,797,946.57	1,160,251,998.08
权证投资		0.00	0.00
其中:权证投资成本		0.00	0.00
买人返售证券	3	250,000,000.00	50,000,000.00
待摊费用		0.00	0.00
其他资产		0.00	0.00
资产合计:		1,739,166,728.98	2,500,314,327.79
负债及持有人权益			
负债:			
应付证券清算款		0.00	0.00
应付赎回款		0.00	0.00
应付赎回费		0.00	0.00
应付管理人报酬		761,306.82	754,140.33
应付托管费		230,699.02	228,527.37
应付佣金		-1000.00	-500.00
应付销售费		576,747.55	571,318.42
应付利息		0.00	313,360.30
应付收益		2,961,155.68	2,368,615.14
应交税金		0.00	0.00
其他应付款	4	107,978.95	18,000.00
卖出回购证券款		0.00	386,500,000.00
短期借款		0.00	0.00
预提费用	5	216,755.16	47,386.56
应付利息		0.00	0.00
负债合计		4,853,643.18	390,800,848.12
持有人权益:		, ,	
实收基金	6	1,734,313,085.8	2,109,513,479.67
未实现利得		0.00	0.00
未分配收益		0.00	0.00
持有人权益合计		1,734,313,085.8	2,109,513,479.67
负债与持有人权益总计		1,739,166,728.98	2,500,314,327.79
2-0 4-4 (37 t) thempoon		经营业绩表	

(2006年1月1日至2006年6月30日期间)

er o	wells).	金额单位:人民币元
项目	附注	本年数
一、收入		56,584,265.72
1、股票差价收入		0.00
2、债券差价收入	7	14,603,716.26
3、权证差价收入		0.00
4、债券利息收入		24,268,317.02
5、存款利息收入		13,504,733.68
6、股利收入		0.00
7、买人返售证券收入		2,953,191.30
8、其他收入	8	1,254,307.46
二、费用		18,204,083.34
1、基金管理人报酬		6,415,152.24
2、基金托管费		1,943,985.56
3、卖出回购证券支出		4,601,423.50
4、销售费		4,859,963.73
5、其他费用	9	383,558.31
其中:信息披露费		130,216.83
审计费用		34,724.85
银行手续费		54,490.72
账户服务费		10,426.92
交易费用		153,698.99
三、基金净收益		38,380,182.38
加:未实现利得		0.00
四、基金经营业绩		38,380,18238

收益分配表 (2006年1月1日-2006年6月30日)

		金额单位:人民币元
项目	附注	本期数
本期基金净收益		38,380,182.38
加:期初基金净收益		0
加:本期损益平准金		0
可供分配基金净收益		38,380,182.38
加:以前年度损益调整		0
减:本期已分配基金净收益	10	38,380,182.38
期末基金净收益		0
	其全净值变动表	

基金浄值变动表 (2006年1月1日-2006年6月30日)					
项目	附注	金額			
一、期初基金净值		2,109,513,479.67			
二、本期经营活动					
基金净收益		38,380,18238			
未实现利得		0.00			
经营活动产生的净值变动数		38,380,18238			
三、本期基金单位交易					
基金申购款		10,749,984,611.09			
基金赎回款		11,125,185,004.96			
基金单位交易产生的净值变动数		-375,200,393.87			
四、本期向持有人分配收益					
向基金持有人分配收益产生的净值变动数		38,380,18238			
五、以前年度损益调整					
因损益调整产生的净值变动数		0.00			
六、期末基金净值		1,734,313,085.80			

(二)基金会计报表附注 1. 基金基本情况

泰达荷银货币市场基金(以下简称'本基金')由基金发起人泰达荷银基金管理有限 公司根据中国证监会证监基金字(2005)第161号文的核准,依照《证券投资基金法》和本《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验 资报告予以验证。经向中国证监会备案,本《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 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

根据本《基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为主要投资于货币市场工具,包括现金、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、剩余期限在397天以内(含397天)的债券,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、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、主要会计政策和会计估计

本基金的会计报表是按照《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》、中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》、《证 券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基 金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》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》的规定而编制。

以1月1日起至12月31日止为一个会计年度。本期会计报表的实际编制期间为

2006年1月1日至2006年6月30日。 (3)记账本位币 以人民币为记账本位币。记帐单位为元。

(4)记帐基础和计价原则 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。

(5)基金资产的估值方法 本基金计价采用摊余成本法,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。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。 本基金目前投资工具的计价方法如下:基金持有的短期债券采用折溢价摊销后的成本

列示,按票面利率计提应收利息;基金持有的回购协议以成本列示,按商定利率在实际持有 期间内逐日计提利息;基金持有的银行存款以本金列示,按银行同期挂牌利率逐日计提利

在有关法律法规允许交易所短期债券可以采用摊余成本法前,本基金暂不投资于交易 所短期债券。

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和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和不公平的结果,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"影子定价"确定的基金资产净值与"摊余成本法"计算的基金资产净值的偏离 度的绝对值达到或超过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,其中,对于偏离度的绝对值达到或超过 0.5%的情形,基金管理人应编制并披露

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。 如有新增事项,按国家有关法律法规规定计价。

估值对象是基金所拥有的一切有价证券等资产

(6)证券投资的成本计价方法

买人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。买人央行票据和零息债券无需单独核算应收利

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目结转。

(7) 待摊费田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,应分摊计人本期的费用,按直线法在受 益期内亚均摊销

债券差价收入: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、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。 债券利息收入:按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除由债券发行企业代扣代缴

的个人所得税后的净额,并根据买人债券时溢价与折价的摊销数调整后的金额确认,在债 券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入:包括银行存款与清算备付金利息,按本金与适用利率逐日计提。 定期存款利息收入:按存款的本金与协议利率逐目计提。 买人返售证券收入: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。

(9)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。

(10)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; 基金收益根据每日基金收益公告,以每万份基金份额收益为基准,为投资者计算当日收益并分配,每月集中支付收益,投资者当日收益的精度为0.01元,第三位采用去尾方式,

因去尾形成的余额进行再次分配; 基金根据每日收益情况,将当日收益全部分配,若当日净收益大于零时,为投资者记正 收益;若当日净收益小于零时,为投资者记负收益;若当日净收益等于零时,当日投资者不

基金每日收益计算并分配时,以人民币元方式簿记,每月累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式,投资者可通过赎回基金份额获得现金收益;若投资者 在每月累计收益支付时,其累计收益恰好为负值,则将缩减投资者基金份额。若投资者全部 赎回基金份额时,其收益将立即结清,若收益恰好为负值,则将从投资者赎回基金款中扣

T日申购的基金份额不享有当日分红权益,赎回的基金份额享有当日分红权益; 基金收益每月集中支付一次,成立不满一个月不支付,每一基金份额享有同等分配权; 在不影响投资者利益情况下,基金管理人可酌情调整基金收益分配方式,此项调整不 需要基金持有人大会决议通过。 (11)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

每份基金份额面值为 1.00 元。实收基金为对外发行的基金份额总额。由于申购、赎回

引起的实收基金的变动分别于基金申购确认目、赎回确认目列示。 3. 主要税项

(1)营业税、企业所得税 根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税 收问题的通知》,以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围,不征收营业税、根据 财政部、国家税务总局财税字 [2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》,自 2004年1月1日起,基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和 企业所得税。

(2)个人所得税 根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税 收问题的通知》,对基金取得的企业债券的利息收入,由债券发行企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。

4、本报告期无重大会计差错和更正金额。

(1)关联方关系			
关联方名称	与本基金的关系		
泰达荷银基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记人、 基金销售机构		
中国农业银行	基金托管人、代銷机构		
北方国际信托投资股份有限公司	基金管理人股东		
荷银投资管理(亚洲)有限公司	基金管理人股东		
January Article にいっこ	廿人然毎1区町を 廿人小泉原告		

本基金管理人于2006年4月27日发布公司更名公告, 经中国证监会批准, 原公司第一大股东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%。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% 9在正常业务范围内按一般商业条款订立。

本会计期间无通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金 (3)关联方报酬

a. 基金管理人报酬 立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的基金资产净值的0.33%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.33% ÷ 当年天数 H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值 基金管理费每日计提,该日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。本基金于太期应支付基金管理人管理费共计人民币6,415,152.24元,。

h 其全托管人拐酬 支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.1%的年费

率计提。计算方法如下: H=E×0.1% - 当年天数

H 为每日应支付的基金托管费

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若 遇法定节假日、休息日等、支付日期顺延。 本基金干本期应支付基金托管人托管费共计人民

c. 销售服务费

B投资管理(亚洲)有限公司

在通常情况下,本基金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%的年费率计算,计算方法如下: H=E×0.25%÷当年天数 H 为每日应计提的销售服务费

金资产中一次性支付给销售机构,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。本基金于本 期应支付关联方销售服务费详情如下 关联方名称 3,540,972.66

本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管、并按银行间同业利率计息。 基金托管人于 2006 年 6 月 30 日保管的活期银行存款余额为 335,488,821.45 元。本会计

期间由基金托管人保管的活期银行存款产生的利息收入为1,746,033.20元。 (5)与关联方进行的银行间同业市场债券(含回购)交易

易如下,该类交易均在正常业务中按一		7世行的仮券(各凹购)父	
项 目			债券交易量
买卖债券结算金额			4,265,212,851.32
卖出回购证券协议金额			98,000,000.00
卖出回购证券利息支出	54,504.1		
(6)关联方持有的基金份额			
大歌 子		2006	-6-30
关联方	++ A //	(ideas	Late Marrial Lini

本基金截至 2006 年 6 月 30 日止从事银行间同业市场非买断式债券回购交易形成的 回购证券款余额 0.00 元,所以,无流通转让受限制的基金资产。

六、投资组合报告

资产组合	金額(元)	占基金总资产的比例(%)
债券投资	446,797,946.57	25.69%
买人返售证券 其中:买断式回购的买人返售证券	250,000,000.00	14.37%
银行存款和清算备付金合计	835,488,821.45	48.04%
其它资产	206,879,960.96	11.90%
合计	1.739.166.728.98	100.00%

注:银行存款和清算备付金合计中包括500,000,000.00元商业银行定期存款投资。

(二)报告期债券回购融资情况 98,814,800,000 报告期内债券回购融资余额 其中:买断式回购融资 报告期末债券回购融资全额 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

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

EH 2000, FIEM 1.						
序号	发生日期	融资余额占基金资产净值	直的比例(%)	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 、投资组合平均剩余期限					
项目				天数		
坦生期本和改組入证的利全期間					Q/I	

报告期内投资组合平均剩余期限最低值

设告期内投资组合平均剩余期限最高值

90天(含) - 180 天

	其中,本报告期内投资组合剩余期 、期末投资组合平均剩余期限期		
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	36.64%	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.88%	0.00
2	30天(含)-60天	7.89%	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	7.89%	0.00
3	60天(含)-90天	4.06%	0.00
	甘由,剩全方续期级过207 工的浮动利索债	406%	0.000

180天(含) - 397 天(含 (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 债券品种 成本(元) 占基金资产净值的比例(%) 230,891,910 中:政策性金融债 160,533,087.2 9.26% 行票据 205,900,298.8

25.96%

446,797,946.5

剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券

. 4,2	玄立1又贝刖 右侧	分明细			
	债券名称	债券数量(张)		成本(元)	占资产净值的比例(%)
序号		自有投资	买断式回购	DC4(1L)	口贝厂伊良的几例(%)
1	06首都机场债	1350000		136,810,616.44	7.89%
2	05工行03	700000		70,358,823.50	4.06%
3	06国开 02	500000		49,952,301.60	2.88%
4	06农发 04	500000		49,567,554.48	2.86%
5	05翔鹭 CP01	400000		39,423,630.90	2.27%
6	01国开 19	300000		30,129,750.00	1.74%
7	06上石化 CP01	300000		29,666,051.52	1.71%
8	06国开 04	200000		19,833,279.96	1.14%
9	04国开 18	110000		11,050,201.17	0.64%
10	01国债 13	100000		10.005.737.00	0.58%

(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	1				
报告期内偏离度的最高值	0.2618%				
报告期内偏离度的最低值	-0.1238%				
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0673%				

(六) 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,即计价对象以买人成本列示, 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 信券,但不存在该类浮动利率信券的辦余成本紹讨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、其他资产的构成 交易保证金 应收证券清算款 应收利息 9.631.323.09 应收申购款 197.248.637.8 其他应收款 待維费用 0.00

期末机构投资者持有份额 ,313,162,23 期末机构投资者份额占总份额比例 期末个人投资者持有份额 421,150,852.8 八、开放式基金份额变动情况

4,643,264,492.5 期初余額 2,109,513,479.6 期内由胸总份额 10,745,919,287 期内赎回总份额 11,121,119,680.9 期末余額 1,734,313,085.8 注:本基金合同生效日为 2005 年 11 月 10 日

期末基金持有人户数

九、重大事件揭示

七、基金份额持有人情况 基金份额持有人结构:

습计

-)本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会

)基金管理人、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动: 本基金管理人于2006年6月16日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》与 公司网站货布关于变更董事、独立董事、监事的公告、根据公司股东会议决议,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。上述董事、独立董事的变更事项已报备监管部门备案。

(四)本报告期本基金投资策略未有重大改变。

(五)基金收益分配事项:本基金收益分配是按月结转份额。

(六)本报告期本基金未改聘为其审计的会计师事务所

(三)本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(七)本报告期本基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚

(八)本基金租用证券公司专用交易席位的有关情况: 金额单位:人民币元 证券公司名称及席位数量、债券回购交易及支付佣金情况

债券回购成交金额 支付佣金 总量比例 350,000,000.00 350.000.000.00

(九)本基金管理人于2006年1月9日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券 报》发布泰达荷银货币市场基金收益支付的公告,公告称本基金投资者的累计收益定于每 月10日集中支付并按1元面值自动转为基金份额。若该日为非工作日,则顺延至下一工作

日,如遇特殊情况,将另行公告。 (十)本基金管理人于2006年1月20日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券 报》发布关于春节前双目(1月24、25日)暂停申购和转换(入)的公告 一)本基金管理人于2006年4月26日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证

券报》发布关于"五一"长假前双日(4月27、28日)暂停申购和转换(人)业务的公告。

(十二)本公司于2006年1月23日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 与公司网站发布公告,本基金代销机构原华夏证券现更名为中信建投证券有限责任公司 (十三)在本报告期内,提前支取协议存款造成的利息损失已由基金管理人承担,未对 基金份额持有人造成损失。 (十四)本公司于2006年4月27日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

与公司网站发布关于股权变更,公司更名及公司章程修改的公告;主要内容是:经本公司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),原公司第一大股东湘财 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%, 并将公司名称由原"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" 公司章程也进行了相应修改。公司变更后的股东及持股比例为: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%

(十五)本公司于2006年6月6日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》与 公司网站发布关于旗下基金更名的公告,经公司董事会批准,报中国证监会同意,将本基金 名称由"湘财荷银货币市场基金"变更为"泰达荷银货币市场基金",基金简称、基金代码

(十六)本公司于2006年6月27日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》与公司网站发布关于旗下基金资产支持证券投资方案的公告,根据中国证监会(证监基金 字[2006]93号)《关于证券投资基金投资资产支持证券有关事项的通知》的要求,以及本 基金合同中的有关规定,本基金资产可以主动投资资产支持证券,在方案中已对基金投资 资产支持证券的比例、流程、风险控制进行了规定。

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:010-88517979 网址:http://www.aateda.com

泰达荷银基金管理有限公司 2006年8月26日