# 泰达荷银货币市场基金

## 更新招募说明书摘要

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

重要说明:本基金管理人于2006年6月6日发布旗下基金更名公告,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更名为泰达荷银货币市场基金,下同。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。

泰达荷银货币市场基金于2005年9月21日获中国证监会证监基金字[2005]161号文核准,基金合同于2005年11月10日正式生效。

**重要提示**

投资有风险,投资人认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示本基金的未来表现。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其它有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

本更新招募说明书已经本基金托管人中国农业银行复核, 所载内容截止日为2006年11月10日,有关财务数据和净值表现截止日为2006年9月30日。财务数据未经审计。

**一、基金管理人**

(一)基金管理人概况

公司名称: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。)

注: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》及公司网站(www.aateda.com)。

成立日期:2002年6月6日

注册地址:上海市武威路789号

办公地址:北京市西三环北路11号海通时代商务中心C.I座

(注: 本公司办公地址自2006年12月3日由北京市海淀区西三环北路11号海通商务中心迁至北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心三层)

法定代表人:章嘉玉

组织形式:有限责任公司

联系电话:010-88518989-8252

(注:信息披露电话自2006年12月3日改为010-66577728)

联系人:方子木

注册资本:1.8亿元人民币

股权结构: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%。

(二)主要人员情况

1、董事会成员

刘惠文先生,拟任董事长,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。毕业于吉林大学经济系,经济学学士学位,高级经济师。1996年至2001年任天津泰达集团有限公司总经理。自2001年起担任天津泰达投资控股有限公司董事长兼总经理。自2005年起兼任渤海财产保险股份有限公司、北方国际信托投资股份有限公司等核心企业的董事长。

章嘉玉女士,副董事长。毕业于美国加州大学洛山矶分校,图书馆学和企业管理学双硕士学位。1990年至1997年任台湾怡富证券投资信托股份有限公司企划部副总经理,1997年至2000年任台湾光华证券投资信托股份有限公司总经理。自2000年起担任荷银证券投资信托股份有限公司(台湾)总经理。2004年7月起任湘财荷银基金管理有限公司(现已更名为泰达荷银基金管理有限公司,下同)董事长。2004年11月起任荷银投资管理(亚洲)有限公司中国区总裁。

刘振宇先生,董事。毕业于天津师范大学,拥有法学学士学位和经济学硕士学位,律师、经济师、项目数据分析师。2000年至2002年任天津泰达集团有限公司投资部副部长。2002年起任天津泰达投资控股有限公司资产管理部经理。

马军先生,董事。毕业于天津大学管理工程系,工学士学位,经济师、项目数据分析师。2002年起任天津泰达担保有限公司常务副总经理。2005年起任天津泰达投资控股有限公司财务中心副主任。

黄金源(Alex K.G. Ng)先生,董事。马来西亚籍。美国加州大学洛杉矶分校经济学专业毕业。1983年起,先后在美国美林公司任投资人员、在马来西亚任金融研究员。1988年在新加坡加盟荷兰银行,后调荷银证券香港分公司。目前担任荷银投资管理(亚洲)有限公司亚太区投资总监。

何国良先生,董事。毕业于香港中文大学统计学专业,哲学硕士学位,特许金融分析师(CFA)。1994年至1997年任职于GMO(香港)有限公司,担任高级定量分析师;1997年至2004年任职于荷银投资管理(亚洲)有限公司,先后担任高级投资组合经理、研究部主管;2004年至2005年任职于国海富兰克林基金管理有限公司,担任研究部总经理;2005年至今,担任荷银投资管理(亚洲)有限公司香港和中国大陆股票投资主管。

汪丁丁先生,独立董事,毕业于北京师范学院数学系,中国科学院数学力学部理学硕士学位,1990年获夏威夷大学经济学博士学位。1984年至1998年先后担任中国科学院系统科学研究所助理研究员、美国东西方中心人口研究所访问学者、博士后研究员、香港大学经济与金融学院助理教授、德国杜依斯堡大学经济系客座教授、北京大学中国经济研究中心副教授及美国夏威夷大学经济系访问教授。目前担任北京大学及浙江大学教授,兼任《财经》杂志学术顾问。

周小明先生,独立董事,毕业于浙江大学法学院,中国政法大学法学硕士学位,1995年获法学博士学位。1990年起先后任职于浙江大学、中国人民银行非银行金融机构监管司、清华大学经管学院和国家会计学院副教授。曾担任全国人大常委会财经委员会《信托法》、《证券投资基金法》起草小组成员。目前担任安信信托投资股份有限公司总裁。

孔晓艳女士,独立董事,毕业于中山大学法律系,法学硕士学位,一级律师。1993年至1997年任天津市对外经济律师事务所专职律师。1997年至1999年任香港Livasari&Co.律师行中国法律顾问。1999年至2004年任嘉德律师事务所专职律师、高级合伙人。2004年至今任嘉德恒时律师事务所专职律师、高级合伙人。

范小云女士,独立董事,毕业于南开大学金融学系,经济学博士学位。1997年至2005年历任南开大学金融学系讲师、副教授。2005年起任南开大学金融学系副主任、国际金融研究中心主任。2001年至2005年还担任《南开经济研究》副主编。2005年起任中国金融学会理事。

2、监事会成员

邢吉海先生,监事。毕业于天津干部管理学院财会专业,会计师。1995年至1997年任天津泰达国际酒店集团副总经理兼财务总监。1997年至2000年任职于天津经济开发区财政局。2000年至2001年任天津开发区总公司财务中心主任。2001年起任天津泰达投资控股有限公司监事、财务中心主任。

陈铁风先生,监事。荷银资产管理公司亚太区首席财务官及首席营运官,负责区内10个国家和地区财务、咨讯科技及后勤支援工作。自1987年以来先后任职于景泰资产管理公司、景顺资产管理公司及保诚资产管理公司。陈铁风先生毕业于香港中文大学,具有工商管理学士及风险管理硕士学位,并为英国特许公认会计师公会及香港会计师公会资深会员。

李克吾女士,监事。毕业于湖南大学(原湖南财经学院)金融保险系,获保险精算学硕士学位。1999年至2001年在湘财证券有限责任公司基金管理部工作,2001年至今在泰达荷银基金管理公司工作,历任基金清算与评估部副总经理、战略规划部副总经理、产品开发部总经理。

3、总经理及其他高级管理人员

林伟萌先生,总经理。美国斯坦福大学经济学硕士。1982年毕业于厦门大学外文系,先后任职于国家农业委员会、中共中央书记处农研室、国务院农村发展研究中心从事国际合作和政策研究工作。1990年至1992年在美国GS Bullion & Forex (US) Inc先后任高级研究员和市场经理;1992年至1996年在美国新泽西州Prominence International Inc.任首席研究员;1997年至2002年,在美国明报任副总编辑兼财经主任。2002年3月起任湘财证券有限责任公司首席投资策略师,2003年12月起任泰达荷银基金管理有限公司总经理。

张萍女士,代行督察长职责。毕业于中国人民大学和中国科学院,管理学和理学双硕士。先后任职于中信公司、毕马威国际会计师事务所等公司,从事财务管理和管理咨询工作。2002年起在嘉实基金管理有限公司工作,任监察稽核部副总监。2005年10月起任泰达荷银基金管理有限公司风险管理部总监。

4、基金经理

梁钧先生,博士,自2005年10月18日起担任本基金基金经理,上海交通大学企业管理专业毕业。2000年7月至2002年12月,工作于湘财证券研究发展中心投资策略部,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营中心债券业务处,从事债券策略研究及债券交易工作。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。

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员包括公司总经理林伟萌、投资总监兼研究部负责人刘青山、交易部负责人陈力、风险管理部负责人张萍以及基金经理刘青山、梁辉、李泽刚、温震宇、康赛波、梁钧。督察长列席会议。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

**二、基金托管人**

(一)基金托管人基本情况

1、基金托管人概况

基金托管人:中国农业银行

法定代表人:杨明生

注册资本:361亿元人民币

住所:北京市海淀区复兴路甲23号

办公地址:北京市西三环北路100号金玉大厦

组织形式:国有独资企业

营业期限:持续经营

电话:010-68424199

联系人:李芳菲

2、主要人员情况

杨明生先生:中国农业银行党委书记、行长。50岁,硕士研究生、高级经济师。曾任中国农业银行辽宁省分行办公室副主任,农行沈阳市分行副行长、党组成员,农行工业信贷部主任助理、副主任、主任,农行天津市分行副行长、党组副书记(主持工作),农行天津市分行行长、党组书记,农行副行长、党委副书记。现任农行党委书记、行长。

杨琨先生:中国农业银行副行长。47岁,硕士研究生、高级经济师。曾任中国农业银行人事部劳动工资处处长,农行人事教育部副主任,农行市场开发部总经理,农行安徽省分行行长、党委书记。现任中国农业银行副行长。

张军洲先生:基金托管部总经理。43岁,博士,高级经济师,曾任中国农业银行信托投资公司总经理助理、副总经理,农行总行法律事务部副总经理、总经理。现任基金托管部总经理。

刘树军先生:基金托管部副总经理。46岁,工商管理硕士,高级经济师、高级记者。曾任中国农业银行长春分行办公室主任、农行总行办公室正处级秘书,农行总行信贷部工业信贷处处长。现任基金托管部副总经理。

余晓晨先生:托管业务部副总经理。42岁,经济学硕士、高级经济师。曾任香港农银证券公司总经理、托管业务部市场开发处处长、境外资产托管处处长、委托资产托管处处长。现任托管业务部副总经理。

3、证券投资基金托管业务情况

(1)部门设置及员工:1998年5月,中国农业银行证券投资基金托管部经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004年9月更名为托管业务部,内设技术保障处、营运中心、委托资产托管处、证券投资基金托管处、综合管理处、风险管理处、境外资产托管处和投资银行处,拥有先进的安全防范设施和基金清算、核算、交易监督快捷处理系统,现有员工79名。

(2)基金托管业务经营情况

截止2006年9月30日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共43只,基金裕阳、基金裕隆、基金汉盛、基金景阳、基金景博、基金景福、基金天华、基金同德、基金景业、基金鸿阳、基金丰和、基金久嘉、富国动态平衡开放式基金、长盛成长价值开放式基金、宝盈鸿利收益开放式基金、大成价值增长开放式基金、大成债券开放式基金、银河稳健开放式基金、银河收益开放式基金、长盛债券开放式基金、长信利息收益开放式基金、长盛动态精选开放式基金、景顺长城内需增长开放式基金、万家保本增值开放式基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式基金、富国天瑞强势开放式基金、鹏华货币市场基金、国联分红增利开放式基金、国泰货币市场基金、新世纪优选分红证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)、信诚四季红混合型证券投资基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、富国天时货币市场基金、益民货币市场基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心精选股票型证券投资基金,托管基金份额达539亿份。

**三、相关服务机构**

(一)基金份额发售机构

1、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

法定代表人:杨明生

客服电话:95599

联系电话:010-68424199

传真:010-68424181

联系人:李芳菲

银行网站:http://www.abchina.com

2、交通银行

注册地址:上海仙霞路18号

办公地址:上海银城中路188号

法定代表人:蒋超良

电话:021-58781234

传真:021-58408842

客服电话:95559

联系人:王炜

银行网址:http://www.bankcomm.com

3、深圳发展银行

注册地址:深圳市深南东路5047号

办公地址:深圳市深南东路5047号

法定代表人:蓝德彰

联系人:周勤

联系电话:0755-22168811,0755-82088888-8811

传真:0755-82080714

公司网站:http://www.sdb.com.cn

4、湘财证券有限责任公司

注册地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

办公地址:上海市浦东银城东路139号华能大厦

法定代表人:陈学荣

客服电话:021-68865020

传真: 021-68865938

联系人: 陈伟

公司网站:http://www.xcsc.com

5、中信建投证券有限责任公司

注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市东城区朝内大街188号

法定代表人:黎晓宏

客服电话:400-8888-108(免长途费)

联系人:魏明

公司网站:http://www.csc108.com

6、中银国际证券有限责任公司

注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦40层

法定代表人:平岳

客服电话:021-68604866

传真:021-50372474

联系人:张静

公司网站:http://www.bocichina.com.cn

7、华泰证券有限责任公司

注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人:吴万善

联系电话:025-84457777-721/882

传真:025-84579879

联系人:袁红彬、张雪瑾

公司网站:http://www.htsc.com.cn

8、国泰君安证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区商城路618号

办公地址:上海延平路135号

法定代表人:祝幼一

客服电话:4008888666

联系人:芮敏祺

公司网站:http://www.gtja.com

9、广发证券股份有限公司

注册地址:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室

办公地址:广东广州天河北路大都会广场36、37、41和42楼

法定代表人:王志伟

联系电话:020-87555888-875

传真:020-87557985

联系人:肖中梅

公司网站:http://www.gf.com.cn

10、兴业证券股份有限公司

注册地址:福州市湖东路99号标力大厦

办公地址:上海陆家嘴东路166号中保大厦

法定代表人:兰荣

客服电话:021-68419974

联系人:杨盛芳

公司网站:http://www.xyzq.com.cn

11、东北证券有限责任公司

注册地址:长春市人民大街138-1号

办公地址:长春市自由大路1138号

法定代表人:李树

联系电话:0431-96688-99、0431-5096733

联系人: 高新宇

公司网站:http://www.nesc.cn

12、东方证券有限责任公司

注册地址:上海市浦东大道720号国际航运金融大厦20楼

办公地址:上海市浦东大道720号国际航运金融大厦20楼

法定代表人:王谊民

客服电话:021-962506

联系人:盛云

联系电话:021-62568800-3019

公司网站:http://www.dfzq.com.cn

13、中国银河证券有限责任公司

注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人:朱利

电话:010-66568587

联系人:郭京华

公司网站:http://www.chinastock.com.cn

14、平安证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

办公地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法定代表人:叶黎成

电话:0755-82450826、22622287

联系人:庄维佳、余江

公司网站:http://www.pa18.com

15、新时代证券有限责任公司

注册地址:北京市海淀区成府路298号方正大厦二层

办公地址:北京市西城区麟阁路95号尚信大厦6、7层

法定代表人:李文义

电话:010-66423510

联系人:戴荻

公司网站:http://www.xsdzq.cn

16、长城证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人:魏云鹏

联系人:高峰

电话:0755-83516094

传真:0755-83516199

公司网站:http://www.cc168.com.cn

17、招商证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层

办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层

法定代表人:宫少林

联系人:黄健

联系电话:0755-82943511

传真:0755-82943237

公司网站:http://www.newone.com.cn

18、南京证券有限责任公司

注册地址:江苏省南京市大钟亭8号

办公地址:江苏省南京市大钟亭8号

法定代表人:张华东

联系电话:025-83364032

联系人:胥春阳

公司网站:http://www.njzq.com.cn

19、东海证券有限责任公司

注册地址:常州延陵西路59号常信大厦18、19楼

办公地址:上海市浦东新区东方路989号中达广场17楼

法定代表人:顾森贤

联系人:龙涛

联系电话:021-50588876

公司网站:http://www.longone.com.cn

20、世纪证券有限责任公司

注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦41-42层

办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦41-42层

法定代表人:段强

联系人:夏尚

联系电话:0755-83199511

传真:0755-83199545

公司网站:http://www.csco.com.cn

21、国都证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区华强北路赛格广场45层

办公地址:北京市东城区安外大街2号安贞大厦3层

法定代表人:王少华

联系人:马泽承

电话:010-64482828-390

传真:010-64482090

公司网站:http://www.guodu.com

22、天相投资顾问有限公司

注册地址:北京市西城区金融街19号

办公地址:北京市朝阳区幸福村中路锦绣园D座

法定代表人:林义相

联系电话:010-84533151-822/802

联系人:陈少震

公司网站:http://www.txsec.com

23、联合证券有限责任公司

注册地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人:马国强

客服电话:961102,0755-25125666

联系人:刘树祥

公司网站:http://www.lhzq.com

24、申银万国证券股份有限公司

注册地址:上海市常熟路171号

客服电话:021-962505

传真:021-64738844

联系人:胡洁净

联系电话:021-54033888转2908

公司网站:http://www.sw2000.com.cn

(二)直销机构

名称:泰达荷银基金管理有限公司(直销中心)

办公地址:北京市西三环北路11号海通时代商务中心C.I座

(注: 本公司办公地址自2006年12月3日由北京市海淀区西三环北路11号海通商务中心迁至北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心三层)

联系人:延蕙、马志颖

联系电话: 010-88518989-8037/8206

(注:联系人电话自12月4日变更为:010-66577618/19)

客户服务电话:010-88517979

(注:客户服务电话自12月4日变更为:010-66577555)

传真:010-68721947/48

(注:客户服务传真自12月4日变更为:010-66577760/61)

(三)注册登记机构

名称:泰达荷银基金管理有限公司

注册地址:上海市武威路789号

办公地址:北京市西三环北路11号海通时代商务中心C.I座

(注: 本公司办公地址自2006年12月3日由北京市海淀区西三环北路11号海通商务中心迁至北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心三层)

法人代表:章嘉玉

联系人:王泉

电话:010-88518989-8071

(注:联系人电话自12月4日变更为:010-66577768)

传真:010-68721957

(注:传真自12月4日变更为:010-66577750)

(四)律师事务所

名称:北京市京伦律师事务所

负责人:曹斌

注册地址:北京市海淀区中关村南大街甲27号中扬大厦505室

办公地址:北京市海淀区中关村南大街甲27号中扬大厦505室

电话:010-68938188

传真:010-68938088

经办律师:曹斌 杨晓勇

(五)会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址:上海市浦东新区沈家弄325号

办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法人代表:Kent Watson

电话:021-61238888

传真:021-61238800

经办注册会计师:汪棣、许康玮

**四、基金的名称**

泰达荷银货币市场基金

**五、基金的类型**

契约型开放式

**六、基金的投资目标**

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。

**七、基金的投资方向**

本基金主要投资于货币市场工具,主要包括现金、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。

**八、基金的投资策略**

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。

**九、基金的业绩比较基准**

本基金的业绩比较基准为,税后一年期银行定期存款利率。

在合理的市场化利率基准推出的情况下,本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。

**十、基金的风险收益特征**

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。

**十一、基金投资组合报告(未经审计)**

基金管理人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。

本基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定,于2006年12月11日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截止2006年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合

| 资产组合 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|
| 债券投资 | 358,023,910.05 | 33.85% |
| 买入返售证券<br>其中:买断式回购的买入返售证券 | 80,000,000.00<br>- | 7.56%<br>- |
| 银行存款和清算备付金合计 | 608,936,408.69 | 57.58% |
| 其它资产 | 10,595,447.70 | 1.00% |
| 合计 | 1,057,555,766.44 | 100.00% |

2、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 | 6,687,700,000.00 | 7.10% |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 0.00 | 0.00% |
| | 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。

3、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 | 83 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 128 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 55 |

(2)报告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 | 19.79% | 0.00% |
| 2 | 30天(含)-60天 | 37.95% | 0.00% |
| 3 | 60天(含)-90天 | 12.41% | 0.00% |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 9.56% | 0.00% |
| 4 | 90天(含)-180天 | 10.08% | 0.00% |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 10.08% | 0.00% |
| 5 | 180天(含)-397天(含) | 18.94% | 0.00% |
| | 合计 | 99.17% | 0.00% |

4、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 | 9,993,484.62 | 0.95% |
| 2 | 金融债券 | 181,524,626.93 | 17.19% |
| | 其中:政策性金融债 | 110,848,375.47 | 10.50% |
| 3 | 央行票据 | 0.00 | 0.00% |
| 4 | 企业债券 | 166,505,798.50 | 15.77% |
| 5 | 其他 | 0.00 | 0.00% |
| 合 计 | | 358,023,910.05 | 33.91% |
| 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | | 207,386,845.54 | 19.64% |

注:附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

(2)基金投资的前十名债券明细

| 序号 | 债券名称 | 债券数量(张) 自有投资 | 债券数量(张) 买断式回购 | 成本(元) | 占资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 05中信债1 | 1000000 | | 100,946,831.36 | 9.56% |
| 2 | 05工行03 | 700000 | | 70,676,251.46 | 6.69% |
| 3 | 06农发04 | 500000 | | 49,844,438.47 | 4.72% |
| 4 | 06首都机场债 | 350000 | | 35,763,762.72 | 3.39% |
| 5 | 01国开19 | 300000 | | 30,039,421.48 | 2.85% |
| 6 | 06上石化CP01 | 300000 | | 29,795,204.42 | 2.82% |
| 7 | 06国开04 | 200000 | | 19,964,548.54 | 1.89% |
| 8 | 04国开18 | 110000 | | 10,999,966.98 | 1.04% |
| 9 | 01国债13 | 100000 | | 9,993,484.62 | 0.95% |

注:上表中,“债券数量”中的“自有投资”和“买断式回购”指自有的债券投资和通过债券买断式回购业务买入的债券卖出后的余额。

5、“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0.25%(含)-0.5%间的次数 | 4 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.3034% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0722% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1126% |

6、投资组合报告附注

(1)本基金的计价方法说明

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。

本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

(2)本报告期内,本基金没有持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

(3)本报告期内没有需要说明的证券投资决策程序。

(4)其他资产的构成

| 序号 | 其他资产 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 应收利息 | 10,529,261.25 |
| 2 | 待摊费用 | 66,186.45 |
| 合计 | | 10,595,447.70 |

**十二、基金的业绩**

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

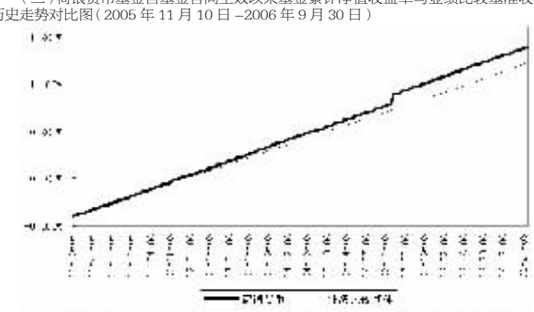
本基金合同生效日为2005年11月10日,基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

(一)历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较

| 阶段 | 基金净值收益率① | 基金净值收益率标准差② | 比较基准收益率③ | 比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2006年1月1日-9月30日 | 1.5208% | 0.0074% | 1.3718% | 0.0002% | 0.1490% | 0.0072% |
| 本基金合同生效起至2006年9月30日 | 1.7901% | 0.0069% | 1.6282% | 0.0002% | 0.1619% | 0.0067% |

注:本基金收益分配按月结转份额

(二)荷银货币基金自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2005年11月10日-2006年9月30日)



注:1、本基金合同于2005年11月10日生效,本基金已于基金合同规定的期限内完成建仓

并达到基金合同规定的投资比例。

2、截至本报告期末,本基金合同生效未满一年。

**十三、基金的费用与税收**

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、基金销售服务费;

4、基金证券交易费用;

5、基金合同生效后的信息披露费用;

6、基金合同生效后的会计师费和律师费;

7、基金份额持有人大会费用;

8、按照国家有关规定可以列支的其它费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金管理费按基金前一日的资产净值的0.33%的年费率计提,具体计算方法如下:

H=E×0.33%÷当年天数

H:为每日应计提的基金管理费;

E:为前一日基金资产净值。

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的托管费

本基金的基金托管费按基金前一日的资产净值的0.1%的年费率计提, 具体计算方法如下:

H=E×0.1%÷当年天数

H:为每日应计提的基金托管费;

E:为前一日基金资产净值。

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支取。

3、基金销售服务费

本基金的销售服务费按基金前一日的资产净值的0.25%的年费率计提,具体计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H:为每日应计提的销售服务费;

E:为前一日的基金资产净值。

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人, 由基金管理人支付给各代销机构,专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

基金管理人可以调整基金销售服务费率,但销售服务费年费率不得超过0.25%。基金管理人必须在开始调整之日的3个工作日之前至少在一家中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

4、上述(一)4至8项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用,由基金托管人从基金财产中支付。

5、经基金管理人与基金托管人协商一致, 可以酌情调低基金管理费率及基金托管费率,并报中国证监会核准后公告,无须召开基金份额持有人大会通过。

(三)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或本基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金财产中列支。

(四)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依据国家有关法律、法规的规定履行纳税义务。

**十四、对招募说明书更新部分的说明**

本期更新招募说明书主要更新内容说明如下:

(一)对注册资本的更新

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%。

(二)对本基金名称的更新

本基金管理人于2006年6月6日发布旗下基金更名公告,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现更名为泰达荷银货币市场基金,下同。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。

(三)本基金管理人高级管理人员的变更

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。

本基金管理人已于2006年8月12日发布公告,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。

本基金管理人已于2006年8月19日发布公告,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。

本基金管理人经公司董事会批准,并报中国证监会基金监管部核准,由张萍女士代行督察长职务,代行时间不超过三个月。

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。

(四)根据公司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。

泰达荷银基金管理有限公司

2006年12月22日

---

股票简称:武汉石油 股票代码:000668 公告编号:2006-23

## 中国石化武汉石油(集团)股份有限公司关于股权分置改革的提示性公告

由于本公司控股股东中国石油化工股份有限公司与盛世达投资有限公司就本公司重大重组及股权分置改革的方案尚未最终确定, 经有关部门同意, 本公司股票已于2006年12月6日起停牌,并于2006年12月25日正式进入股权分置改革程序,至本公司披露股权分置改革方案后按规定复牌。鉴于本公司股权分置改革方案尚未最终确定,仍存在取消股权分置改革或者长期无法刊登股权分置改革方案的可能性,因此本公司股票停牌时间可能较长。本公司将积极与有关非流通股股东开展工作,争取尽快刊登股权分置改革说明书,特此提醒投资者关注本公司在指定报刊上的信息披露。

中国石化武汉石油(集团)股份有限公司

董 事 会

2006年12月25日

---

证券代码:000736 证券简称:S*ST重实 公告编号:2006-040

## 重庆国际实业投资股份有限公司股权分置改革提示性公告

本公司及董事保证信息披露内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本公司股权分置改革拟与重点资产收购、出售相结合,经有关部门同意,本公司股票从2006年12月25日(星期一)起继续停牌,直至本公司披露股权分置改革方案后按规定复牌。本公司股权分置改革由于尚未最终确定,仍存在取消股权分置改革或者长期无法刊登股权分置改革方案的可能性,因此本公司股票停牌时间可能较长。本公司将积极与有关非流通股股东开展工作,争取尽快刊登股权分置改革说明书,特此提醒投资者关注本公司在指定报刊上的信息披露。

特此公告!

重庆国际实业投资股份有限公司董事会

二00六年十二月二十二日