

## Disclosure

## 泰达荷银效率优选混合型证券投资基金(LOF) 2006年年度报告摘要

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:中国建设银行股份有限公司

## 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基金公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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同约定,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,对本基金年度报告整体内容不存虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金财产,但不保证基金一定盈利。

基金运作过程中可能因市场变化、基金管理人决策失误等导致基金资产损失,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。

本报告财务数据已经审计,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,请投资者注意查阅。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,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站www.watda.com的年度报告全文。

## 二、基金简介

(一)基金名称:泰达荷银效率优选混合型证券投资基金

(原湘财荷银效率优选混合型证券投资基金)

本基金管理人名称:2006年6月6日经本公司股东会批准,中国证监会同意,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,本基金简称、基金代码均不变。

基金简称:荷银效率

交易代码:162027

基金运作方式:上市契约型开放式基金(LOF)

基金合同生效日:2006年3月12日

报告期期间:2006年1月27日至2006年3月12日

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

上市地点:深圳证券交易所、上海证券交易所

上证指数:2006年7月21日 3125.28

(二)基金目标定位:充分挖掘具有较高投资效率的上市公司,兼顾投资优质债券,力争为投资者获得超出行业比较基准的投资回报。

本基金采用“自下而上”和“自下而上”相结合的投资手段和方法,在正常的市场环境下不主动地调整资产配置比例,股票及债券的资产配置比例基本保持在标准比例上下5%的范围内波动。

本基金的股票投资策略上,即市场上对公司经营的评价、投资公司在生产经营中的使用效率以及对股价的预期。

债券投资策略:60%新华人寿A股0.60%新嘉诚0.35%新国泰金融+5%同业存款利率。

风险收益特征:本基金的目标和投资范围决定了本基金属于风险适中的混合型证券投资基金。

(三)基金经理名称: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)

本基金基金经理已于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,公告内详见当日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

信函披露负责人:方子木

联系电话:021-66577728

传真:021-66577728

电子信箱:zimn.fang@wateca.com

(四)基金经理姓名:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)

注册地址:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码:100032

法定代表人:郭清勇

信函披露负责人:尹东

联系电话:021-555104

传真:021-66275000

电子邮箱:yindong@hbcncc.com

(五)登载最近一期报告正文的基金管理人的互联网网址:<http://www.watda.com>

基金份额净值报告备点地:基金管理人、基金托管人的住所。

(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(除特别注明外,金额单位为人民币元)

泰达荷银效率优选混合型证券投资基金

经营业绩表及收益分配情况

2006年5月12日基金合同生效日至2006年12月31日止期间

(除特别注明外,金额单位为人民币元)

泰达荷银效率基金

财务指标

2006年5月12日至2006年12月31日

期末净资产

208,617,463.41

本期可供分配收益

0.0898

期末可供分配基金份额

188,178,664.42

期末基金份额净值

3,965,973,131.46

本期可供分配利润

4.76%

本期可供分配利润百分比

37.74%

基金本期净资产增长率

37.74%

基金本期净资产增长率

37.74%

注:1.本基金基金合同于2006年5月12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运作期计算。  
2.所列基金业绩指标包括基金持有人认购或申购基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于不计费用的收益率。  
(二)基金净值的表现

1、基金的净值增长率与同期业绩比较基准的变动对比图:

泰达荷银效率基金

净值增长率

净值得基

准差率

标准差

①-③

②-④

2006年5月12日

2006年12月31日

2006年12月31日