

泰达荷银首选企业股票型证券投资基金 2007年第一季度报告

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起六个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条(三)投资范围、(四)投资组合中规定的各项比例。具体比例如下:

- 1.基金投资于股票的比例为基金资产净值的60%-95%;
2.基金投资于债券的比例为基金资产净值的0-35%;
3.基金投资于一家上市公司股票的比例不超过该基金资产净值的10%;
4.基金由本基金经理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总市值不超过该证券的10%;
5.中国证监会规定的其他比例限制。

四、基金管理人报告 (一)基金业绩情况 温耀宇先生,管理学硕士。1998年2月起,先后就职于华夏证券有限公司研究发展部,大成基金管理有限公司研究发展部任研究员。2001年12月起至今,先后任泰达荷银基金管理有限公司研究发展部任研究员,研究助理兼基金经理。自2006年2月起至今同时担任泰达荷银优选企业股票型证券投资基金基金经理。陈少平女士,1996年毕业于厦门大学化工系,获得学士学位。2002年毕业于新加坡国立大学,获得硕士学位。2002年10月工作于高同投资咨询公司,任研究员;2003年10月起就职于泰达荷银基金管理有限公司,历任研究员,泰达荷银行业精选基金经理助理,高级研究员;现任研究助理兼基金经理,5年证券从业经验,具有证券从业资格,基金从业资格。

截至本报告期末,本基金份额净值为1.1226元,本报告期末基金净值增长率为7.7%,同期业绩比较基准指数上涨27.33%。 2007年一季度宏观仍然表现强劲,在进出口和消费的拉动下,一季度的经济增速可达到11%。但由于市场平均估值较高,一季度市场波动幅度较大,除了资产注入这个主题外,没有明确的行业性的个股,个股选择重于行业配置。受基金赎回影响,基金重仓股整体表现较沉闷,本基金主要投资的个股为各行业龙头,主要配置的行业是金融、消费、铁路、传媒等等。

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金总资产比例. Rows include 股票, 债券, 银行存款和清算备付金, etc.

(一) 报告期末基金资产组合

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 行业分类, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include A 农林牧渔, B 采掘业, C 制造业, etc.

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 600030 中信证券, 600005 宝钢股份, etc.

(四) 报告期末按券种分类的债券投资组合

泰达荷银货币市场基金 2007年第一季度报告

四、基金管理人报告 (一)基金业绩情况 郭泳先生,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,曾任任董事会秘书,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。2006年12月起担任货币市场基金基金经理。2007年3月起兼任泰达荷银稳健增值基金基金经理。5年基金从业经验,具有基金从业资格。

截至本报告期末,本基金资产净值1,866,668.66元,本报告期末基金资产净值增长率为0.0041%,同期业绩比较基准收益率为0.0000%。 2007年一季度宏观仍然表现强劲,在进出口和消费的拉动下,一季度的经济增速可达到11%。但由于市场平均估值较高,一季度市场波动幅度较大,除了资产注入这个主题外,没有明确的行业性的个股,个股选择重于行业配置。受基金赎回影响,基金重仓股整体表现较沉闷,本基金主要投资的个股为各行业龙头,主要配置的行业是金融、消费、铁路、传媒等等。

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金总资产比例. Rows include 资产组合, 债券投资, 买入返售证券, etc.

(一) 报告期末基金资产组合

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 行业分类, 市值(元), 占基金净值比例. Rows include A 农林牧渔, B 采掘业, C 制造业, etc.

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 000063 中兴通讯, 600005 宝钢股份, etc.

(四) 报告期末按券种分类的债券投资组合

泰达荷银风险预算混合型证券投资基金 2007年第一季度报告

基金基金经理助理:2006年5月起担任研究助理兼基金经理。自2006年12月起,担任本基金基金经理。许杰先生于2006年4月取得了CFA(特许金融分析师)资格。5年基金从业经验,具有基金从业资格。 郭泳先生,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,曾任任董事会秘书,2004年3月起担任研究部宏观和固定收益研究员。2005年11月起担任泰达荷银货币市场基金基金经理助理。2006年12月起担任泰达荷银货币市场基金基金经理。2007年3月起兼任泰达荷银稳健增值基金基金经理。5年基金从业经验,具有基金从业资格。

截至本报告期末,本基金资产净值25,785,217.59元,本报告期末基金资产净值增长率为0.703%,同期业绩比较基准收益率为0.54%。 2007年一季度宏观仍然表现强劲,在进出口和消费的拉动下,一季度的经济增速可达到11%。但由于市场平均估值较高,一季度市场波动幅度较大,除了资产注入这个主题外,没有明确的行业性的个股,个股选择重于行业配置。受基金赎回影响,基金重仓股整体表现较沉闷,本基金主要投资的个股为各行业龙头,主要配置的行业是金融、消费、铁路、传媒等等。

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金总资产比例. Rows include 资产组合, 债券投资, 买入返售证券, etc.

(一) 报告期末基金资产组合

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 行业分类, 市值(元), 占基金净值比例. Rows include A 农林牧渔, B 采掘业, C 制造业, etc.

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 000063 中兴通讯, 600005 宝钢股份, etc.

(四) 报告期末按券种分类的债券投资组合

泰达荷银货币市场基金 2007年第一季度报告

四、基金管理人报告 (一)基金业绩情况 郭泳先生,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,曾任任董事会秘书,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。2006年12月起担任货币市场基金基金经理。2007年3月起兼任泰达荷银稳健增值基金基金经理。5年基金从业经验,具有基金从业资格。

截至本报告期末,本基金资产净值1,866,668.66元,本报告期末基金资产净值增长率为0.0041%,同期业绩比较基准收益率为0.0000%。 2007年一季度宏观仍然表现强劲,在进出口和消费的拉动下,一季度的经济增速可达到11%。但由于市场平均估值较高,一季度市场波动幅度较大,除了资产注入这个主题外,没有明确的行业性的个股,个股选择重于行业配置。受基金赎回影响,基金重仓股整体表现较沉闷,本基金主要投资的个股为各行业龙头,主要配置的行业是金融、消费、铁路、传媒等等。

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金总资产比例. Rows include 资产组合, 债券投资, 买入返售证券, etc.

(一) 报告期末基金资产组合

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 行业分类, 市值(元), 占基金净值比例. Rows include A 农林牧渔, B 采掘业, C 制造业, etc.

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 000063 中兴通讯, 600005 宝钢股份, etc.

(四) 报告期末按券种分类的债券投资组合

泰达荷银首选企业股票型证券投资基金 2007年第一季度报告

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起六个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条(三)投资范围、(四)投资组合中规定的各项比例。具体比例如下:

- 1.基金投资于股票的比例为基金资产净值的60%-95%;
2.基金投资于债券的比例为基金资产净值的0-35%;
3.基金投资于一家上市公司股票的比例不超过该基金资产净值的10%;
4.基金由本基金经理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总市值不超过该证券的10%;
5.中国证监会规定的其他比例限制。

截至本报告期末,本基金资产净值562,015,413.33元,本报告期末基金资产净值增长率为0.700%,同期业绩比较基准收益率为2.33%。 2007年一季度宏观仍然表现强劲,在进出口和消费的拉动下,一季度的经济增速可达到11%。但由于市场平均估值较高,一季度市场波动幅度较大,除了资产注入这个主题外,没有明确的行业性的个股,个股选择重于行业配置。受基金赎回影响,基金重仓股整体表现较沉闷,本基金主要投资的个股为各行业龙头,主要配置的行业是金融、消费、铁路、传媒等等。

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金总资产比例. Rows include 股票, 债券, 银行存款和清算备付金, etc.

(一) 报告期末基金资产组合

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 行业分类, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include A 农林牧渔, B 采掘业, C 制造业, etc.

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 600030 中信证券, 600005 宝钢股份, etc.

(四) 报告期末按券种分类的债券投资组合

泰达荷银风险预算混合型证券投资基金 2007年第一季度报告

基金基金经理助理:2006年5月起担任研究助理兼基金经理。自2006年12月起,担任本基金基金经理。许杰先生于2006年4月取得了CFA(特许金融分析师)资格。5年基金从业经验,具有基金从业资格。 郭泳先生,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,曾任任董事会秘书,2004年3月起担任研究部宏观和固定收益研究员。2005年11月起担任泰达荷银货币市场基金基金经理助理。2006年12月起担任泰达荷银货币市场基金基金经理。2007年3月起兼任泰达荷银稳健增值基金基金经理。5年基金从业经验,具有基金从业资格。

截至本报告期末,本基金资产净值25,785,217.59元,本报告期末基金资产净值增长率为0.703%,同期业绩比较基准收益率为0.54%。 2007年一季度宏观仍然表现强劲,在进出口和消费的拉动下,一季度的经济增速可达到11%。但由于市场平均估值较高,一季度市场波动幅度较大,除了资产注入这个主题外,没有明确的行业性的个股,个股选择重于行业配置。受基金赎回影响,基金重仓股整体表现较沉闷,本基金主要投资的个股为各行业龙头,主要配置的行业是金融、消费、铁路、传媒等等。

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金总资产比例. Rows include 资产组合, 债券投资, 买入返售证券, etc.

(一) 报告期末基金资产组合

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 行业分类, 市值(元), 占基金净值比例. Rows include A 农林牧渔, B 采掘业, C 制造业, etc.

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 000063 中兴通讯, 600005 宝钢股份, etc.

(四) 报告期末按券种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券类别, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 1 国债, 2 金融债, 3 央行票据, etc.

(五) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 4 columns: 序号, 债券名称, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 1 02国债04, 2 07农发03, 3 07武钢债, etc.

(六) 报告附注 1.报告期内本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,在报告编制前一年度内未受到公开谴责、处罚。

2.基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

3.其他资产(单位:元)

Table with 2 columns: 项目, 金额. Rows include 交易保证金, 应收股利, 应收利息, etc.

4.本报告期末基金未持有处于转股期的可转换债券。

6.报告期内基金未主动投资权证,报告期末未持有因权证分期置改获派的权证。6.报告期末基金未持有资产支持证券。

Table with 2 columns: 项目, 金额. Rows include 交易保证金, 应收股利, etc.

7. 备查文件目录 (一)备查文件目录 1.中国证监会核准泰达荷银首选企业股票型证券投资基金设立的文件;

2.《泰达荷银首选企业股票型证券投资基金合同》; 3.《泰达荷银首选企业股票型证券投资基金招募说明书》; 4.《泰达荷银首选企业股票型证券投资基金托管协议》;

(二)存放地点:基金管理人处和基金托管人的住所。

(三)查阅方式:投资人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》)或登陆基金管理人互联网网站(http://www.tsdta.com) 查阅。

泰达荷银基金管理有限公司 2007年4月19日

泰达荷银货币市场基金 2007年第一季度报告

四、基金管理人报告 (一)基金业绩情况 郭泳先生,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,曾任任董事会秘书,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。2006年12月起担任货币市场基金基金经理。2007年3月起兼任泰达荷银稳健增值基金基金经理。5年基金从业经验,具有基金从业资格。

截至本报告期末,本基金资产净值1,866,668.66元,本报告期末基金资产净值增长率为0.0041%,同期业绩比较基准收益率为0.0000%。 2007年一季度宏观仍然表现强劲,在进出口和消费的拉动下,一季度的经济增速可达到11%。但由于市场平均估值较高,一季度市场波动幅度较大,除了资产注入这个主题外,没有明确的行业性的个股,个股选择重于行业配置。受基金赎回影响,基金重仓股整体表现较沉闷,本基金主要投资的个股为各行业龙头,主要配置的行业是金融、消费、铁路、传媒等等。

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金总资产比例. Rows include 资产组合, 债券投资, 买入返售证券, etc.

(一) 报告期末基金资产组合

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 行业分类, 市值(元), 占基金净值比例. Rows include A 农林牧渔, B 采掘业, C 制造业, etc.

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 000063 中兴通讯, 600005 宝钢股份, etc.

(四) 报告期末按券种分类的债券投资组合

泰达荷银风险预算混合型证券投资基金 2007年第一季度报告

基金基金经理助理:2006年5月起担任研究助理兼基金经理。自2006年12月起,担任本基金基金经理。许杰先生于2006年4月取得了CFA(特许金融分析师)资格。5年基金从业经验,具有基金从业资格。 郭泳先生,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,曾任任董事会秘书,2004年3月起担任研究部宏观和固定收益研究员。2005年11月起担任泰达荷银货币市场基金基金经理助理。2006年12月起担任泰达荷银货币市场基金基金经理。2007年3月起兼任泰达荷银稳健增值基金基金经理。5年基金从业经验,具有基金从业资格。

截至本报告期末,本基金资产净值25,785,217.59元,本报告期末基金资产净值增长率为0.703%,同期业绩比较基准收益率为0.54%。 2007年一季度宏观仍然表现强劲,在进出口和消费的拉动下,一季度的经济增速可达到11%。但由于市场平均估值较高,一季度市场波动幅度较大,除了资产注入这个主题外,没有明确的行业性的个股,个股选择重于行业配置。受基金赎回影响,基金重仓股整体表现较沉闷,本基金主要投资的个股为各行业龙头,主要配置的行业是金融、消费、铁路、传媒等等。

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金总资产比例. Rows include 资产组合, 债券投资, 买入返售证券, etc.

(一) 报告期末基金资产组合

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 行业分类, 市值(元), 占基金净值比例. Rows include A 农林牧渔, B 采掘业, C 制造业, etc.

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 000063 中兴通讯, 600005 宝钢股份, etc.

(四) 报告期末按券种分类的债券投资组合