

泰达荷银货币市场基金 2007 年年度报告摘要

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

一、重要提示
基金管理人泰达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...

二、基金简介
(一)基金名称:泰达荷银货币市场基金
基金简称:泰达荷银货币
交易代码:162206

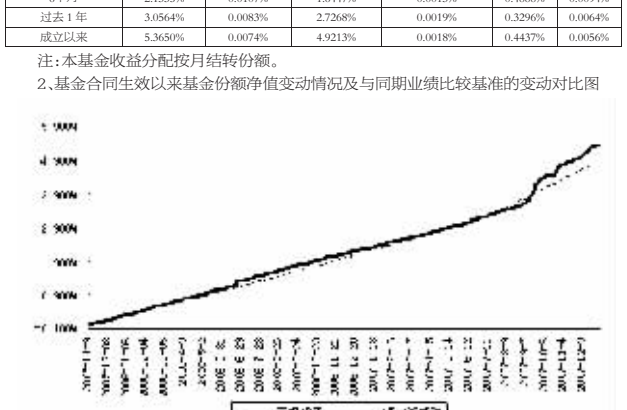
三、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况
(一)主要财务指标
本报告期内净利润 11,888,260.17

四、基金经理人报告
泰达荷银基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]137号文批准成立。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%...

五、重要事项
(一)基金合同生效以来重要日期
(二)基金合同生效以来重要事件
(三)基金合同生效以来重要事件

Table with 4 columns: 项目, 2007年, 2006年, 2005年. Rows include 本期利润总额, 本期利润总额扣除公允价值变动损益后的净额, etc.

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。
(二)基金净值表现
1.基金净值增值率与同期业绩比较基准收益率比较表:



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)

Table with 2 columns: 年度, 收益分配金额. Rows for 2005, 2006, 2007.

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经中国证监会证监基金字[2002]137号文批准成立。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%...

五、重要事项
(一)基金合同生效以来重要日期
(二)基金合同生效以来重要事件
(三)基金合同生效以来重要事件

在托管泰达荷银货币市场基金的过程中,本基金托管人—中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《泰达荷银货币市场基金基金合同》、《泰达荷银货币市场基金托管协议》的约定,对泰达荷银货币市场基金管理人—泰达荷银基金管理有限公司2007年1月1日至2007年12月31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。

Table with 3 columns: 项目, 2007年, 2006年. Rows include 资产, 负债, 所有者权益.

六、审计报告
本基金2007年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师许康伟、王鸣宇签字出具了普华永道中天审字(2008)第 03047 号“无保留意见的审计报告”。

Table with 3 columns: 项目, 2007年度, 2006年度. Rows include 收入, 支出, 费用, etc.

七、净值变动表
2007 年度所有者权益(基金净值)变动表
(除特别注明外,金额单位为人民币元)

Table with 3 columns: 项目, 2007年度, 2006年度. Rows include 年初所有者权益(基金净值), 本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

八、投资组合报告
(一)基金投资组合报告
截至2007年12月31日,本基金资产组合如下:
1. 债券投资组合

Table with 3 columns: 项目, 2007年度, 2006年度. Rows include 买入债券的摊余成本, 卖出债券的摊余成本, etc.

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。
(6) 证券投资损益的计算方法
(i) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产均为银行间同业市场交易债券投资。

自2007年7月1日起,买入银行同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资成本按交易日支付的全部价款并扣除债券起息日或上次付息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)后的金额确认,取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额。

自2007年7月1日起,买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认,取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益,上述公允价值不包含债券起息日或上次付息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

自2007年7月1日起,卖出银行同业市场交易的债券于实际支付价款时确认债券投资收益(损失);自2007年7月1日起,卖出银行间同业市场交易的债券于交易日确认债券投资收益(损失),出售债券的成本按移动加权平均法结转。

2007年7月1日之前,贷款和应收款项按实际支付或应收的金额入账,并采用名义利率法确认相关的利息收入,其中卖出返售金融资产以协议融出资金额作为入账金额;自2007年7月1日起,贷款和应收款项以公允价值作为初始确认金额,采用实际利率法以摊余成本进行后续计量,终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益,直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法,其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际收到的总额作为初始确认金额。

2007年7月1日之前,其他金融负债按实际收取或支付的金额入账,并采用名义利率法确认相关的利息支出,其中卖出回购金融资产以协议融入资金额作为入账金额;自2007年7月1日起,其他金融负债以公允价值作为初始确认金额,采用实际利率法以摊余成本进行后续计量,终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益,直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法,其中卖出回购金融资产以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额。

2007年7月1日之前,其他金融负债按实际收取或支付的金额入账,并采用名义利率法确认相关的利息支出,其中卖出回购金融资产以协议融入资金额作为入账金额;自2007年7月1日起,其他金融负债以公允价值作为初始确认金额,采用实际利率法以摊余成本进行后续计量,终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益,直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法,其中卖出回购金融资产以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额。

Table with 3 columns: 项目, 2007年度, 2006年度. Rows include 买入债券的摊余成本, 卖出债券的摊余成本, etc.

九、投资组合报告
(一) 本报告期末基金投资组合
1. 按债券品种分类的债券投资组合
(二) 基金投资前十名债券明细
(三) “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

Table with 4 columns: 序号, 平均剩余期限, 本期债券资产占基金资产净值比例, 本期国债占基金资产净值比例.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 成本(元), 占基金资产净值比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券名称, 债券数量(张), 成本(元), 占资产净值的比例(%).

Table with 2 columns: 项目, 金额(元). Rows include 交易费用, 赎回费, etc.

十、开放式基金份额变动情况
截至2007年12月31日,本公司累计持有本基金情况如下:
(一) 基金份额持有人户数、持有人结构
(二) 基金资产净值变动及与同期业绩比较基准的变动对比图

Table with 4 columns: 基金名称, 基金持有人户数, 人均持有份额, 基金持有人结构.

十一、重大事件提示
(一) 本年度涉及及本基金管理人、基金资产、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。

十二、基金管理人报告
泰达荷银基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]137号文批准成立。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%...

十三、基金管理人报告
泰达荷银基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]137号文批准成立。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%...

Table with 4 columns: 项目, 金额, 占基金总资产比例, 占基金净资产比例. Rows include 货币存款, 交易性金融资产, etc.

泰达荷银基金管理有限公司 2008年3月28日