泰达荷银货币市场基金 2009年半年度报告摘要

2009年6月30日

基金管理人:泰达荷银基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2009年8月25日

§1 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,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股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年8月20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,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2009年1月1日起至2009年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰达荷银货币
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	2,218,403,182.13份

2.2 基金产品说明

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。
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。
业绩比较基准	税后一年期银行定期存款利率。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰达荷银基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	邢颖	李芳菲
	联系电话	010-66577725	010-68424199
	电子邮箱	irm@aateda.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-69-88888	95599
传真		010-66577666	010-68424181

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2009年1月1日至2009年6月30日)
本期已实现收益	14,886,452.29
本期利润	14,886,452.29
本期净值收益率	0.7466%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2009年1月1日至2009年6月30日)
期末基金资产净值	2,218,403,182.13
期末基金份额净值	1.00

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益

2.所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字

3.本基金收益分配按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰达荷银货币基金						
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去一个月	0.1064%	0.0045%	0.1849%	0.0000%	-0.0785%	0.0045%
过去三个月	0.3592%	0.0068%	0.5610%	0.0000%	-0.2018%	0.0068%
过去六个月	0.7466%	0.0060%	1.1158%	0.0000%	-0.3692%	0.0060%
过去一年	2.4271%	0.0076%	2.9271%	0.0021%	-0.5000%	0.0055%
过去三年	7.8264%	0.0068%	8.6605%	0.0023%	-0.8341%	0.0045%
自基金合同生效起至今	9.2307%	0.0069%	9.8096%	0.0024%	-0.5789%	0.0045%

注:1.本基金收益分配按月结转份额。

2.本基金的业绩比较基准为税后一年期银行定期存款利率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金成立于2005年11月10日,在建仓期结束时及截止报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 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经中国证监会证监基金字[2002]37号文批准成立。目前本公司股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司:51%;荷银投资管理(亚洲)有限公司:49%。公司注册资本为1.8亿元人民币。

报告期末公司旗下管理11只开放式基金,分别为泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、泰达荷银价值优化型周期类行业证券投资基金、泰达荷银价值优化型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、泰达荷银效率优选混合型证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、泰达荷银市值优选股票型证券投资基金、泰达荷银集利债券型证券投资基金以及泰达荷银品质生活灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
沈毅	本基金基金经理	2008-3-6	2009-5-23	7	工商管理硕士、计量金融硕士。2002年9月至2004年2月任职嘉实基金投资部,担任固定收益投资经理及社保基金投资组合经理。2004年4月至2007年9月任职光大保德信基金管理公司,先后担任高级组合经理及资产配置经理、货币市场基金经理、投资副总监、代理投资总监、固定收益投资总监等职务。自2006年1月至2007年9月担任光大保德信货币市场基金基金经理。2007年10月至2008年1月任职长江养老保险股份有限公司,担任投资部总经理职务。2008年2月起任职于泰达荷银基金管理公司,担任固定收益部总经理。
胡振仓	本基金基金经理	2008-8-9	-	6	硕士学位。2003年7月至2005年4月就职于乌鲁木齐市商业银行,从事债券交易与研究工作;2006年3月至2006年6月就职于国联证券公司,从事债券交易工作;2006年7月至2008年3月就职于益民基金管理有限公司,其中2006年7月至2006年11月任益民货币市场基金基金经理助理,2006年12月至2008年3月任益民货币市场基金基金经理。2008年4月加盟泰达荷银基金管理有限公司。

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度和流程,并严格执行制度的规定。在投资管理活动中,本基金管理人公平对待不同投资组合,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会;严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离;在交易环节实行集中交易制度,并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续;交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先,价格优先的原则严格执行所有指令,未发生任何利益输送的情况。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本公司旗下没有与本基金投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的控制制度,在本报告期内未发生因异常交易而受到监管机构处罚的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

截止报告期末,本基金份额净值为1元,本报告期份额净值增长率为0.7466%,同期业绩比较基准增长率为1.1158%。

经历08年大幅降息和下调存款准备金率政策之后,2009年上半年,货币政策方面相对平静,市场资金继续维持08年4季度以来极其宽裕的局面,1季度短期市场利率快速向下,在上半年维持低位平稳运行。回顾上半年货币市场走势,1季度货币市场的一大亮点在于企业短期融资券利率的大幅下降,市场资金运用压力、机构对短债的偏好及在经济向好的预期下,1季度各评级短融依次有很好的表现。而2季度货币市场利率持续低位运行,与1季度相比缺乏明显的投资机会。与此相对应,本基金上半年总体采取了相对较为谨慎的投资策略,大幅降低组合久期和债券持有比例。同时本基金1季度以来抓住了信用风险溢价大幅下降的机会,适度超配短融,在控制风险的同时取得了比较好的收益。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2009年下半年,2季度以来经济复苏的“绿芽”在全球各地萌发,中国经济复苏的迹象越来越明确,在此背景下,下半年我国的货币、财政政策可能出现微调甚至转向的可能。7月9日央行重新开始发行暂停了7个月之久的1年期央票,1年期央票的重启大大早于市场预期,可能是政策开始微调的一个信号。如果极度宽松的市场资金状况有所改变,考虑到目前商业银行较低的超储率,IPO对货币市场的冲击可能会超出预期。7月中旬以来,货币市场利率有较大幅度的上行,这一趋势将在今年下半年延续。货币市场收益率的上行,将有利于拓宽本基金的投资机会,提高本基金的收益率。

在基金运作中,我们将始终坚持合法、合规的原则,在保证安全性、流动性的基础上,力争取得较高的收益率。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会2008年9月12日发布的[2008]38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定,本公司成立长期停牌股票等没有市价的投资品种估值委员会,成员由主管基金运营的副总经理、督察长、投资总监、基金经理及研究部、交易部、监察稽核部、金融工程部、风险管理部、基金运营部的相关人员组成。职责分工、专业胜任能力和相关工作经历具体如下:

主管基金运营的副总经理担任估值委员会主任,督察长、投资总监担任副主任。主要负责估值委员会的组织、管理工作,并对涉及估值委员会的重大事项做出决策。

基金经理:基金经理参与估值委员会的日常工作,主要对长期停牌股票行业类别和重估方法提出建议。参与估值的基金经理具有上市公司研究和估值、基金投资等方面较为丰富的经验,熟悉相关法律法规和估值方法。

研究部负责人及行业研究员:负责长期停牌股票等没有市价的投资品种所属行业的专业研究,参与长期停牌股票行业类别和重估方法的确定。他们具有多年的行业研究经验,能够较好的对行业发展趋势做出判断,熟悉相关法律法规和估值方法。

交易部负责人:参与估值委员会的日常工作,主要对长期停牌股票的行业类别和重估方法提出建议。该成员具有多年的股票交易经验,能够较好的对市场的波动及发展趋势作出判断,熟悉相关的法律法规和估值方法。

监察稽核部负责人:负责对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等相关事项的合法合规性进行审核和监督,发现问题及时要求整改。该成员具有一定的会计核算估值知识和经验,熟知与估值政策相关的各项法律法规,了解估值原则和估值方法。

金融工程部负责人:负责估值相关数值的处理和计算,确定行业指数,计算估值价格,参与确定估值方法。该成员在金融工程工作方面具有较为丰富的经验,具备应用多种估值模型的专业能力,熟悉相关法律法规和估值方法。

风险管理部负责人:负责估值相关数值的处理和计算,复核由金融工程部提供的行业指数和估值价格。该成员在基金的风险控制与绩效评估工作方面具有较为丰富的经验,熟悉相关法律法规和估值方法。

基金运营部负责人:参与长期停牌股票估值方法的确定,并与相关托管行进行核对确认,如有不符合的情况出现,立即向估值委员会反映情况,并提出合理的调整建议。该成员具备多年基金从业经验,在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验,熟悉基金估值法律法规、政策和估值方法。

基金经理参与估值委员会对相关停牌股票估值的讨论,发表相关意见和建议,但涉及停牌股票的基金经理不参与最终的投票表决。

本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同约定,本基金于本报告期间累计分配收益14,886,452.29元,已于每月中旬集中转结至基金持有人账户。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管泰达荷银货币市场基金的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》等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基金管理人—泰达荷银基金管理有限公司2009年1月1日至2009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。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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、基金份额申购赎回价格的计算、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,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,泰达荷银基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,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,未发现有损害基金持有人利益的行为。§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:泰达荷银货币市场基金

报告截止日:2009年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
资产:		
银行存款	1,542,035.43	24,906,579.22
结算备付金	1,770,000,000.00	1,980,000,000.00
存出保证金	-	-
交易性金融资产	340,301,966.25	1,925,767,605.24
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	340,301,966.25	1,925,767,605.24
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	--	--
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	2,949,036.35	4,102,467.72
应收股利	-	-
应收申购款	105,806,784.68	4,300.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,220,599,822.71	3,934,780,952.18
负债和所有者权益	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	441,855.50	496,530.18
应付托管费	133,895.61	150,463.73
应付销售服务费	334,739.02	376,159.21
应付交易费用	5,200.00	28,234.43
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	1,093,043.83	4,354,515.60
递延所得税负债	-	-
其他负债	187,906.62	349,500.00
负债合计	2,196,640.58	5,755,403.15
所有者权益:		
实收基金	2,218,403,182.13	3,929,025,549.03
未分配利润	-	-
所有者权益合计	2,218,403,182.13	3,929,025,549.03
负债和所有者权益总计	2,220,599,822.71	3,934,780,952.18

注:报告截止日2009年6月30日,基金份额净值1元,基金份额总额2,218,403,182.13份。

6.2 利润表

会计主体:泰达荷银货币市场基金

本报告期:2009年1月1日至2009年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
一、收入	21,778,204.98	7,242,600.55
1.利息收入	16,759,075.94	7,132,432.69
其中:存款利息收入	5,595,543.00	330,790.79
债券利息收入	11,163,532.94	6,607,960.85
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	193,681.05
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	5,019,129.04	80,167.86
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,019,129.04	80,167.86
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	30,000.00
二、费用(以“-”号填列)	-6,891,752.69	-1,794,740.65
1.管理人报酬	-3,251,153.18	-737,256.38
2.托管费	-985,197.94	-223,411.02
3.销售服务费	-2,462,994.95	-558,527.42
4.交易费用	-	-
5.利息支出	-	-92,430.05
其中:卖出回购金融资产支出	-	-92,430.05
6.其他费用	-192,406.62	-183,115.78
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	14,886,452.29	5,447,859.90
所得税费用(以“-”号填列)	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	14,886,452.29	5,447,859.90

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰达荷银货币市场基金

本报告期:2009年1月1日至2009年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,929,025,549.03	-	3,929,025,549.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	14,886,452.29	14,886,452.29
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,710,622,366.90	-	-1,710,622,366.90
其中:1.基金申购款	6,229,068,225.35	-	6,229,068,225.35
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-7,939,690,592.25	-	-7,939,690,592.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-14,886,452.29	-14,886,452.29
五、期末所有者权益(基金净值)	2,218,403,182.13	-	2,218,403,182.13
项目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	472,743,676.12	-	472,743,676.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,447,859.90	5,447,859.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	512,452,615.29	-	512,452,615.29
其中:1.基金申购款	1,604,625,054.50	-	1,604,625,054.50
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-1,092,172,439.21	-	-1,092,172,439.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-5,447,859.90	-5,447,859.90
五、期末所有者权益(基金净值)	985,196,291.41	-	985,196,291.41

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

(除特别标明外,金额单位为人民币元)

泰达荷银货币市场基金(以下简称“本基金”,原湘财荷银货币市场基金)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2005]第161号《关于同意湘财荷银货币市场基金设立的批复》核准,由湘财荷银基金管理有限公司(于2006年4月27日更名为泰达荷银基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《湘财荷银货币市场基金基金合同》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普华永道中天验字(2005)第164号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《湘财荷银货币市场基金基金合同》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合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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称为“中国农业银行”)。

2006年6月6日,经基金管理人董事会批准、报中国证监会同意,《湘财荷银货币市场基金基金合同》改为《泰达荷银货币市场基金基金合同》,本基金更名为泰达荷银货币市场基金。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《泰达荷银货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金;一年以内的银行定期存款、大额存单;剩余期限在397天以内的债券;期限在一年以内的中央银行票据和债券回购,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。本基金的业绩比较基准为:税后一年期银行定期存款利率。

本财务报表由本基金的基金管理人泰达荷银基金管理有限公司于2009年8月25日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会基金部通知[2009]4号关于发布《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>(试行)》等问题的通知、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达荷银货币市场基金基金合同》和中国证监会允许的财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2009年上半年的财务状况以及2009年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期内无会计政策的变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内无会计估计的变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内,无重大会计差错发生。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期关联方无变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

本报告期无与基金发生关联交易的关联方。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金未有股票投资。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金未有权证投资。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

报告期内,本基金无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
当期应支付的管理费	3,251,153.18	737,256.38
其中:当期已支付	2,809,297.68	563,059.45
期末未支付	441,855.50	174,196.93

注:支付基金管理人泰达荷银基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
当期应支付的托管费	985,197.94	223,411.02
其中:当期已支付	851,302.33	170,624.10
期末未支付	133,895.61	52,786.92

注:支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年6月30日		
	当期应支付的销售服务费		
	当期已支付	期末未支付	合计
泰达荷银基金管理有限公司	1,356,923.39	212,423.60	1,569,346.99
中国农业银行	254,424.37	53,320.44	307,744.81
合计	1,611,347.76	265,744.04	1,877,091.80
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日		
	当期应支付的销售服务费		
	当期已支付	期末未支付	合计
泰达荷银基金管理有限公司	284,982.53	111,405.39	396,387.92
中国农业银行	36,427.24	6,315.03	42,742.27
合计	321,409.77	117,720.42	439,130.19

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给泰达荷银基金管理有限公司,再由泰达荷银基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2009年1月1日至2009年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	99,880,578.08	-	-	-	-
上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	58,400,459.02	-	-	-	-	-

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期,未有运用固有资金投资本基金的情况。(2008年同期:同)

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2009年6月30日		上年度末 2008年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国农业银行涟源市支行	245.51	0.00%	243.96	0.00%

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	1,542,035.43	96,168.20	7,732,269.03	293,340.45

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内,本基金未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。(2008年同期:同)

6.4.9 期末(2009年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末,本基金未有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。(2008年同期:同)

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

本报告期末,本基金未持有暂时停牌的股票。(2008年同期:同)

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本报告期末,本基金未有债券正回购交易中作为抵押的债券。(2008年同期:同)

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据中国证券业协会2009年6月12日发布的《关于发布中证沪SAC基金行业股票估值指数的通知》,泰达荷银基金管理有限公司估值委员会决定自2009年6月15日起,对采用指数收益法进行估值的股票,在确定指数时应采用中证沪SAC行业指数作为计算依据,不再采用上海证券交易所和深圳证券交易所公开发布的相应行业指数作为计算依据。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	340,301,966.25	15.32
	其中:债券	340,301,966.25	15.32
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	1,771,542,035.43	79.78
4	其他资产	108,755,821.03	4.90
5	合计	2,220,599,822.71	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

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	-	0.00
	其中:买断式回购融资	-	0.00
2	报告期末债券回购融资余额	-	0.00
	其中:买断式回购融资	-	0.00

注: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个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	29
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	150
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	29

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内,本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

7.3.2 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天以内	79.86	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天(含)-60天	3.59	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60天(含)-90天	0.45	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90天(含)-180天	1.80	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
5	180天(含)-397天(含)	9.50	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
	合计	95.20	0.00

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	79,553,922.38	3.59
3	金融债券	-	0.00
	其中:政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	260,748,043.87	11.75
-	-	-	0.00
6	其他	-	0.00
7	合计	340,301,966.25	15.34
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	0.00

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。

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801095	08央票95	800,000	79,553,922.38	3.59
2	0981006	09本钢CP01	500,000	50,233,161.57	2.26
3	0981005	09沪建工CP01	400,000	40,166,236.14	1.81
4	0981009	09京热电CP01	300,000	30,128,139.03	1.36
5	0981050	09龙矿CP01	300,000	30,118,756.68	1.36
6	0881256	08太不锈CP01	200,000	20,110,988.54	0.91
7	0981099	09天音CP01	200,000	20,071,456.91	0.90
8	0981100	09津药CP01	200,000	20,069,631.87	0.90
9	0981040	09铁二股CP01	200,000	20,046,010.09	0.90
10	0881229	08折能源CP02	200,000	19,772,398.32	0.89

7.6 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	38
报告期内偏离度的最高值	0.3914%
报告期内偏离度的最低值	0.0657%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2130%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 基金计价方法说明。

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提利息,