中银货币市场证券投资基金更新招募说明书摘要

（2009年第2号）

基金管理人：中银基金管理有限公司 Bank of China Investment Management

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

重要提示

本基金经中国证监会2005年4月25日证监基金字[2005] 65号文件批准募集，本基金基金合同于2005年6月7日正式生效。

基金管理人保证本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。

投资者购买本货币市场证券投资基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金管理公司不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

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资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者认购（或申购）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其未来表现。

本更新招募说明书所载内容截止日2009年6月7日，有关财务数据和净值表现截止日为2009年3月31日(财务数据未经审计)。本基金托管人中国工商银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书。

一.基金合同生效日

2005年6月7日

二.基金管理人

(一)基金管理人概况

1.公司名称：中银基金管理有限公司

2.住所：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼

3.设立日期：2004年8月12日

4.法定代表人：贾建平

5.执行总裁：陈儒

6.办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼

7.电话：（021）38834999

8.传真：（021）68872488

9.联系人：范丽萍

10.注册资本：1亿元人民币

11.股权结构：

股东	出资额	占注册资本的比例
中国银行股份有限公司	人民币8350万元	83.5%
贝莱德投资管理（英国）有限公司	相当于人民币1650万元的美元	16.5%

(二)主要人员情况

1.董事会成员

贾建平（JIA Jianping）先生，董事长。国籍：中国。高级经济师。历任中银基金管理有限公司筹备组组长、中国环球租赁有限公司业务部副主任、中国银行信托咨询公司副处长、处长、中国银行卢森堡有限公司副总经理、中国银行罗马代表处首席代表、中银集团投资有限公司(香港)副董事长、总经理、中国银行投资管理部总经理、中国银行重组上市办公室副主任、中国银行董事会秘书办公室总经理、中国银行上市办公室总经理等职。兼任中国科技金融促进会副理事长。

陈儒（CHEN Ru）先生，董事。国籍：中国。中银基金管理有限公司执行总裁。经济学博士、南开大学博士后，高级经济师、国务院政府特殊津贴专家。曾参与深交所筹建。历任深圳投资基金管理公司董事长兼执行总裁、中国银行总行基金托管部总经理、中银国际控股董事总经理、中银国际英国保诚资产管理公司董事，中银国际证券副执行总裁、董事总经理、中银国际基金管理有限公司董事、执行总裁。

董杰（DONG Jie）先生，董事。国籍：中国。西南财经大学博士学位。现任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部总经理。历任中国银行天津市分行副行长、党委委员、中国银行深圳市分行沙头角支行行长、深圳市分行信贷经营处处长、公司业务处处长、深圳市分行行长助理、党委委员等职。

服山清一（Seiichi Fukuyama）先生，董事。国籍：日本。现任贝莱德投资管理有限公司董事总经理、贝莱德亚洲区副主席。历任贝莱德日本的负责人和贝莱德亚洲区副主席，美林亚太区执行委员会委员。1989年起，供职于水星资产管理公司和美林资产管理公司（2006年，美林资产管理公司与贝莱德合并），担任伦敦、台湾、香港、日本公司的业务拓展和管理职位。在任职美林之前，曾为B.A.I.I.香港和伦敦公司管理可转换对冲基金。2001年至2003年间，曾任香港投资基金协会执行董事。东京索非亚大学比较文学学士，曾获中华人民共和国教委授予的中日奖学金在上海音乐学院从事研究工作。

赵纯均（ZHAO Chunjun）先生，独立董事。国籍：中国。现清华大学经济管理学院教授，兼任中国国家自然科学基金管理科学部专家咨询委员会委员、中国系统工程学会副理事长等。历任清华大学自动化系教研室副主任、讲师、清华大学经济管理学院院长助理、系主任、副教授、清华大学经济管理学院第一副院长、教授、清华大学经济管理学院院长、教授。

于鸿君（YU Hongjun）先生，独立董事。国籍：中国。现任北京大学教授、博士生导师、北京大学校长助理。曾任石河子大学副校长、西安交通大学教师、内蒙古包钢钢联股份有限公司独立董事、北京大学党委组织部常务副部长、内蒙古包头市市委副书记（挂职）。北京大学外国经济思想史专业博士、北京大学国民经济计划与管理专业硕士、西安交通大学低温工程专业学士、国家社科基金重大招标项目首席专家。

葛礼（Gary Rieschel）先生，独立董事。国籍：美国。现任启明维创投资咨询有限公司的创办者、董事总经理，同时供职于里德学院董事会，亚洲协会、中美合资企业清洁能源、清洁技术论坛的顾问委员会，并担任纳斯达克上市公司THQ的独立董事。曾在美国知名技术公司思科、英特尔等任高级营运职位，并被多家杂志如福布斯、红鲱鱼、网络标准评为全球最主要的风险资本家之一。曾在美国英特尔公司担任品质保证经理，在美国NCube公司、思科公司以及日本Sequent公司担任管理职位，后为SOFTBANK/Mobius风险资本的创办者、董事总经理。哈佛商学院工商管理硕士，里德学院生物学学士。

2.监事会成员

赵绘坪（ZHAO Huiping）先生，监事。国籍：中国。中央党校经济管理专业本科，人力资源管理师、经济师。曾任中国银行人力资源部信息团队主管、曾任中国银行人力资源部综合处副处长、处长、人事部技术干部处干部、副处长。

陈宇（CHEN Yu）先生，职工监事。国籍：中国。复旦大学软件工程硕士研究生。现任中银基金管理有限公司副总裁、信息资讯部门主管，参与中银国际基金管理有限公司筹建工作。曾在申银万国证券股份公司从事信息技术管理工作，9年证券基金行业工作经历。

3.管理层成员

陈儒（CHEN Ru）先生，董事、执行总裁。国籍：中国。经济学博士、南开大学博士后，高级经济师、国务院政府特殊津贴专家。曾参与深圳证券交易所筹建。曾任深圳投资基金管理公司董事长兼执行总裁、中国银行总行基金托管部总经理、中银国际控股公司董事总经理、中银国际英国保诚资产管理公司董事、中银国际证券有限责任公司副执行总裁、董事总经理、中银国际基金管理有限公司董事、执行总裁。

欧阳向军（Jason X. OUYANG）先生，督察长。国籍：加拿大。加拿大西安大略大学毅伟商学院工商管理硕士（MBA）和经济学硕士。曾在加拿大太平洋集团公司、加拿大帝国商业银行和加拿大伦敦人寿保险公司等海外机构从事金融工作多年，也曾任蔚深证券有限责任公司（现英大证券）研究发展中心总经理、融通基金管理公司市场拓展总监、监察稽核总监和上海复旦大学国际金融系国际金融教研室主任、讲师。

俞岱曦（YU Daixi）先生，副执行总裁。国籍：中国。经济学硕士。曾担任嘉实基金管理有限公司全国社保基金106组合基金经理、基金丰和基金经理助理、鹏华基金管理有限公司基金普润基金经理助理、行业分析师。2008年4月至今任中银增长基金经理，2009年4月至今任中银优选基金经理。具有11年证券投资研究从业经验，具备基金从业资格。

4.基金经理

现任基金经理：孙庆瑞（SUN Qingrui）女士，投资管理部副总经理、副总裁(VP)，管理学硕士。曾任长盛基金管理有限公司全国社保组合债券基金经理、基金经理助理、债券研究员，联合证券股份有限公司债券研究员。2007年8月至今任中银中国基金经理，2006年7月至今任中银货币基金经理，2006年10月至2008年4月任中银收益基金经理。具有8年投资研究经验，具备基金从业资格。

现任基金经理：李建（LI Jian）先生，助理副总裁（AVP），经济师，经济学硕士研究生。曾于联合证券有限责任公司、恒泰证券有限责任公司从事固定收益投资、分析工作。2007年8月至今任中银货币基金经理，2008年11月至今任中银增利基金经理。具有11年投资、分析经验，具备基金、证券、期货和银行间债券交易员从业资格。

曾任基金经理：苏淑敏（Tina SO）女士，2005年11月10日至2006年7月8日任本基金基金经理。

曾任基金经理：黄健斌（HUANG Jianbin）先生，2005年6月7日至2005年11月10日任本基金基金经理。

5.上述人员之间不存在近亲属关系。

(三)投资决策委员会成员的姓名及职务

主席：俞岱曦（副执行总裁）

成员：陈军（副总裁）、孙庆瑞（副总裁）、甘霖（副总裁）、张发余（副总裁）、陈志龙（副总裁）

列席成员：欧阳向军（督察长）、寻明辉（副总裁）、李建（助理副总裁）

三.基金托管人

(一)基金托管人的基本情况

本基金之基金托管银行为中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”），基本情况如下：

名称：中国工商银行
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间：1984年1月1日
法定代表人：姜建清
注册资本：人民币334，018，850，026元
联系电话：010-66105799
联系人：蒋松云

(二)基金托管人托管业务主要人员情况

截至2009年3月末，中国工商银行资产托管部共有员工116人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

(三)基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国工商银行始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行着资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至2009年3月，托管证券投资基金116只，其中封闭式8只，开放式108只。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、QFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。2009年初，中国工商银行先后被《证券时报》、香港《财资》和国内证券类年鉴《中国证券投资基金年鉴》评选为2008年度“中国最佳托管银行”，自2004年以来，中国工商银行资产托管服务已经获得16项国内外大奖。

四.相关服务机构

(一)基金发售机构

1. 直销机构

名称：中银基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼
法定代表人：贾建平
办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼
执行总裁：陈儒
电话：（021）38834999
传真：（021）68872488
联系人：徐琳

2. 代销机构

1)中国银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：肖钢
客户服务电话：95566
网址：www.boc.cn

2)中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
联系人：王佺
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

3)交通银行股份有限公司
注册地址：上海市银城中路188号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
联系人：曹榕
客户服务电话：95559
网址：www.bankcomm.com

4)中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：董文标
客户服务电话：95568
公司网站：www.cmbc.com.cn

5)中信银行股份有限公司
公司名称：中信银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人：孔丹
客服电话：95558
网址：http://bank.ecitic.com

6)中国建设银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街25号
法定代表人：郭树清
客户服务电话：95533
网址：www.ccb.com

7)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39F
法定代表人：唐新宇
联系人：张静
客服电话：61195566
网址：www.bocichina.com

8)海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路98号
法定代表人：王开国
联系人：金芸
客户服务咨询电话：(021）962503、400-8888-001、021-95553
网址：www.htsec.com

9)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
法定代表人：祝幼一
联系人：芮敏祺
客户服务咨询电话：400-8888-666
网址：http://www.gtja.com

10)申银万国证券股份有限公司
注册地址：上海市常熟路171号
法定代表人：丁国荣
联系人：邓寒冰
客户服务咨询电话：0086-21-962505
网址：www.sw2000.com.cn

11)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
法定代表人：兰荣
联系人：谢高得
客服电话：4008888123
公司网站：www.xyzq.com.cn

12)平安证券有限责任公司
注册地址：广东深圳八卦三路平安大厦三楼
法定代表人：陈敬达
联系人：袁月
客户服务咨询电话：4008-866-338
网址：www.pa18.com

13)华安证券有限责任公司
注册地址：安徽省合肥市长江中路357号
法定代表人：李工
联系人：甘霖
客户服务咨询电话：0551-96518
网址：http://www.huaans.com.cn

14)光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
联系人：刘晨
客户服务咨询电话：4008-888-788、10108998
网址：http://www.ebscn.com

15)广发证券股份有限公司
办公地址：广州市天河北路183号大都会广场43楼
法定代表人：王志伟
联系人：黄岚
客服电话：961133或致电各地营业网点
公司网站：www.gf.com.cn

16)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A座39-45层
法定代表人：宫少林
联系人：黄健
客户服务咨询电话：95565
网址：www.newone.com.cn

17)中国银河证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：胡长生
联系人：李洋
客户服务咨询电话：4008-888-888
网址：http://www.chinastock.com.cn

18)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10楼
法定代表人：马昭明
联系人：何晔
客户服务咨询电话：400-888-8555
网址：http://www.lhzq.com

19)中信金通证券有限责任公司
注册地址：杭州市中河南路11号万凯商务大楼A座
法定代表人：刘军
联系人：王勤
客户服务咨询电话：（0571）96598
网址：www.bigsun.com.cn

20)长江证券股份有限公司
注册地址：湖北省武汉市江汉区新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
联系人：李良
客户服务咨询电话：4008-888-999
网址：www.95579.com

21)中信万通证券有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）
法定代表人：史洁民
联系人：丁韶燕
客户服务咨询电话：（0532）96577
网址：www.zxwt.com.cn

22)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
法定代表人：张佑君
联系人：权唐
客户服务咨询电话：4008888108
网址：www.csc108.com

23)安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
法定代表人：牛冠兴
联系人：张勤
客户服务咨询电话：4008001001，020-96210
网址：http://www.essences.com.cn

24)国元证券股份有限公司
注册地址：合肥市寿春路179号
法定代表人：凤良志
联系人：李纯刚
客户服务咨询电话：4008-888-777
网址：http://www.gyzq.com.cn

25)天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
法定代表人：林义相
联系人：莫晓丽
客服电话：010-66045678
网址：http://www.txsec.com或http://www.txjijin.com

26)华宝证券经纪有限责任公司
地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23楼
法定代表人：陈林
联系人：孙赉
客服电话：4008209898；021-38929908
网址：www.cnhbstock.com

(二)基金注册与过户登记人
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人：陈耀先
电话：（010）58598839
传真：（010）58598907

(三) 出具法律意见书的律师事务所和经办律师
名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市浦东南路528号
法定代表人：韩炯
电话：（021）68818100
传真：（021）68816880
联系人：秦悦民
经办律师：秦悦民、傅轶

(四) 审计基金资产的会计师事务所和经办注册会计师
名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
法定代表人：杨绍信
电话：（021）61238888
传真：（021）61238800
联系人：薛竞
经办注册会计师：薛竞、单峰

五.基金的名称

中银货币市场证券投资基金

六.基金的类型

契约型开放式

七.基金的投资目标

在保持本金安全和资产流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的稳定收益。

八.基金的投资方向

本基金投资于法律法规允许的金融工具包括：

1)现金；
2)一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；
3)剩余期限在397天以内（含397天）的债券；
4)期限在一年以内（含一年）的债券回购；
5)期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；
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。

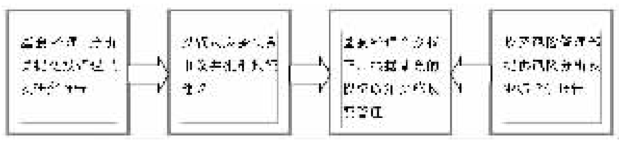
九.基金的投资策略

(一)决策依据

以《基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》等有关法律法规、本基金合同以及基金管理人公司章程等有关规定为决策依据，并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

(二)决策程序

本基金管理人的投资决策程序如下图所示：



(三)投资程序

1.整体配置策略

根据对宏观经济指标、货币政策和财政政策的预判，决定债券组合的平均剩余到期期限和比例分布。

根据各类资产的流动性、收益性和信用水平，决定组合中各类资产的投资比例。

在保证组合充分流动性的前提下，运用现代金融工具和分析方法，寻找被低估的投资品种并进行优化配置。

2.投资管理方法

■短期利率预测

深入分析国家货币政策、短期资金市场利率波动、资本市场资金面的情况和流动性的变化，对短期利率走势形成合理预期，并据此调整基金货币资产的配置策略。

■组合久期制定

根据对宏观经济和短期资金市场的利率走势，来确定投资组合的平均剩余到期期限。具体而言，在预计市场利率上升时，适当缩短投资品种的平均期限；在预计利率下降时，适当延长投资品种的平均期限。

■类别品种配置

在保持组合资产相对稳定的条件下，根据各类短期金融工具的市场规模、收益性和流动性，决定各类资产的配置比例；再通过评估各类资产的流动性和收益性利差，确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。

■收益率曲线分析

本基金将根据债券市场收益率曲线以及隐含的即期收益率和远期利率提供的价值判断基础，结合对资金面的分析，匹配各期限的回购与债券品种的到期日，实现现金流的有效管理。

■无风险套利

跨市场套利：短期资金市场分为银行间市场和交易所市场两个子市场，其中投资群体、交易方式等市场要素不同，使得两个市场的资金面和市场短期利率在一定期间内可能存在定价偏离。本基金在充分论证这种套利机会可行性的基础上，寻找最佳介入时机，进行跨市场操作，获得安全的超额收益。

跨品种套利：由于投资群体的差异，对期限相近的品种，因为其流动性、税收等因素造成内在价值出现明显偏离时，本基金可以在保证流动性的基础上，进行品种间的套利操作，增加超额收益。

■滚动配置策略

根据具体投资品种的市场特性，采用持续滚动投资的方法，以提高基金财产的整体持续的变现能力。

十.业绩比较基准

根据本基金的投资对象和投资目标确立本基金的业绩比较基准为税后活期存款利率：（1-利息税率）×活期存款利率。

本基金选取这个业绩比较基准的理由：本基金定位于现金管理的工具，产品性质上与银行活期存款有着很强的相似性，活期存款税后利率能很好地体现本基金良好的流动性与安全性。

当市场上有更加适合的业绩比较基准，在不损害投资者利益的前提下，基金管理人有权按照相关规定对本基金的业绩比较基准进行调整并公告。

十一.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，其预期风险和预期收益率都低于股票，债券和混合型基金。

十二.投资组合报告

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2009年6月26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至2009年3月31日，本报告所列财务数据未经审计。

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益类投资	1，755，834，109.95	97.33
	其中：债券	1，755，834，109.95	97.33
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1，986，438.60	0.11
4	其他资产	46，271，215.55	2.56
	合计	1，804，091，764.10	100.00

（二）报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	10，478，739，352.61	8.04
	其中：买断式回购融入的资金	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	213，399，693.30	13.44
	其中：买断式回购融入的资金	-	-

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%。

（三）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	126
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	166
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	124

报告期内投资组合平均剩余期限违规超过180天的说明：本报告期内无。

序号	发生日期	平均剩余期限（天）	原因	调整期
-	-	-	-	-

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	7.68	13.44
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	22.74	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.90	-
3	60天(含)-90天	16.98	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	30.24	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	33.05	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		110.69	13.44

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	924，537，313.91	58.22
3	金融债券	382，110，650.85	24.06
	其中：政策性金融债	382，110，650.85	24.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	449，186，145.19	28.28
6	其他	-	-
合计		1，755，834，109.95	110.56
剩余存续期超过397天的浮动利率债券		30，210，637.72	1.90

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价.

（五）报告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

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	0801112	08央票112	2，570，000	255，443，823.06	16.08
2	0801070	08央票70	2，000，000	199，468，574.36	12.56
3	0801095	08央票95	1，500，000	149，378，060.56	9.41
4	0801058	08央票58	1，110，000	110，816，041.20	6.98
5	040211	04国开11	1，000，000	100，819，473.71	6.35
6	070309	07进出09	1，000，000	100，144，371.68	6.31
7	0801049	08央票49	1，000，000	99，916，842.82	6.29
8	080415	08农发15	500，000	50，458，552.03	3.18
9	070414	07农发14	500，000	50，448，275.00	3.18
10	0881249	08电网CP03	500，000	50，174，252.94	3.16

（六）“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	48次
报告期内偏离度的最高值	0.3967%
报告期内偏离度的最低值	0.2180%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.3049%

（七）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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（八）投资组合报告附注

1、基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法计价，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提应收利息，并按实际利率法在其剩余期限内摊消其买入时的溢价或折价。

本基金采用1.00元固定单位净值交易方式，自基金成立日起每日将实现的基金净收益分配给基金持有人，并按月结转到投资人基金账户。

2、本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的声明：

本报告期内，本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本均未超过当日基金资产净值的20%。

3、本报告期内需说明的证券投资决策程序

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。本报告期内无需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	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	13，465，053.16
4	应收申购款	32，806，162.39
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
	合计	46，271，215.55

注：由于四舍五入的原因分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十三.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6月7日，基金合同生效以来基金投资业绩与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差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
2005年6月7日（基金合同生效日）至2005年12月31日	0.8653%	0.0047%	1.0258%	0.0000%	-0.1605%	0.0047%
2006年1月1日至2006年12月31日	1.9179%	0.0039%	1.8799%	0.0003%	0.0380%	0.0036%
2007年1月1日至2007年12月31日	3.3696%	0.0067%	2.7850%	0.0019%	0.5846%	0.0048%
2008年1月1日至2008年12月31日	3.8426%	0.0122%	2.0134%	0.0044%	1.8292%	0.0078%
2009年1月1日至2009年3月31日	0.3002%	0.0037%	0.0900%	0.0000%	0.2102%	0.0037%
自基金合同生效起至2009年3月31日	10.6783%	0.0081%	7.7940%	0.0029%	2.8843%	0.0052%

十四.基金费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1. 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）销售服务费；
4）基金合同生效后的基金信息披露费用；
5）基金合同生效后与基金相关的会计师费与律师费；
6）基金份额持有人大会费用；
7）基金的证券交易费用；
8）银行汇划费用；
9）按照国家有关规定和本基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金合同终止时所发生的基金财产清算费用，按实际支出额从基金财产中扣除。

2. 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

基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计算。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

基金管理费在基金合同生效后每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2）基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.1%年费率计提。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为前一日的基金资产净值

基金托管费在基金合同生效后每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

3）销售服务费

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计算，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为前一日基金资产净值

销售服务费在基金合同生效后每日计算，每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给销售机构，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

基金管理人可酌情降低基金销售服务费，经中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会。

上述1中4到9项费用由基金托管人根据其它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。

3. 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基金资产的损失，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。基金合同生效前的相关费用，包括但不限于信息披露费、验资费、会计师费和律师费等不列入基金费用。

4. 基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费和基金托管费，经中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会。调高上述费用时，按《基金法》和本基金合同规定，需召开基金份额持有人大会决议。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

(二)与基金销售有关的费用

1. 销售服务费

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计算，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为前一日基金资产净值

销售服务费在基金合同生效后每日计算，每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给销售机构，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

基金管理人可酌情降低基金销售服务费，经中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会。

2. 转换费

在条件成熟，允许基金转换的情况下，基金管理人将另行公告基金转换费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式。

(三) 其他费用

本基金其他费用根据相关法律法规执行。

十五.对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金运作的实际情况，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

(一)在“基金管理人”部分，对管理人部分情况，如董事会成员、监事会成员、管理层成员、基金经理以及投资决策委员会成员的部分信息进行了更新。

(二)在“基金托管人”部分，对托管人主要人员情况及托管业务经营情况进行了更新。

(三)在“相关服务机构”部分，更新了代销机构的相关信息。

(四)在“基金的投资”部分，根据《信息披露内容与格式准则第5号》及《基金合同》，补充了本基金最近一期投资组合报告的内容。

(五)更新了“基金的业绩”这一章节，列明了前次更新招募说明书公布以来的基金投资业绩。

(六)在“其他应披露事项”部分，列明了前次更新招募说明书公布以来的其他应披露的事项。

中银基金管理有限公司
二〇〇九年七月二十二日

长信基金管理有限责任公司关于
长信利息收益开放式证券投资基金收益支付的公告

（2009年7月）

长信利息收益开放式证券投资基金（以下简称：本基金）成立于2004年3月19日。根据本基金《招募说明书》及《关于改变长信利息收益开放式证券投资基金收益分配结转周期的公告》的约定，本基金投资者的累计收益每月集中支付。本基金管理人定于2009年7月20日对本基金自2009年6月23日起的收益进行集中支付并结转为基金份额。

现将有关具体事宜公告如下：

一、收益支付说明

自2009年6月23日起至2009年7月20日，本基金已实现净收益折算的年收益率为2.151%。本基金管理人定于2009年7月20日将投资者所拥有的上述期间的累计收益进行集中支付，并按1.00元面值自动结转为基金份额，不进行现金支付。

投资者的累计收益具体计算公式如下：

投资者累计收益＝∑投资者日收益（即投资者日收益逐日累加）

投资者日收益＝投资者当日持有的基金份额/10000*当日每万份基金份额收益（保留到分，即保留两位小数后去尾）

二、收益支付时间

1、收益支付日：2009年7月20日；
2、收益结转基金份额日：2009年7月21日；
3、收益结转的基金份额可赎回起始日：2009年7月22日。

三、收益支付对象

收益支付日在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的本基金全体持有人。

四、收益支付办法

本基金收益支付方式默认为收益再投资方式，投资者收益结转的基金份额将于2009年7月21日直接计入其基金账户，2009年7月22日起可通过相应的销售机构及其网点和本基金管理人的网站（http://www.cxfund.com.cn）查询。

五、有关税收和费用的说明

1、根据财政部、国家税务总局《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》（财税字[2002]128号），对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税；

2、本基金本次收益支付免收分红手续费和再投资手续费。

六、提示

1、本基金投资者的累计收益将于每月20日集中支付并按1.00元的份额面值自动结转为基金份额。若该日为非工作日，则顺延至下一工作日；

2、投资者于2009年7月20日申请申购、转换转入的基金份额不享有当日的收益，申请赎回、转换转出的基金份额享有当日的收益。

七、咨询办法

1、长信基金管理有限责任公司网站：http://www.cxfund.com.cn；
2、长信基金管理有限责任公司客户服务专线：4007005566（免长话费）；
3、中国农业银行、长江证券等代销网点。

特此公告。

长信基金管理有限责任公司
2009年7月22日

股票代码：600860　　股票简称：北人股份　　编号：临2009-013

北人印刷机械股份有限公司

（在中华人民共和国注册成立之股份有限公司）

董事辞职公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

北人印刷机械股份有限公司（以下简称“本公司”）董事会（以下简称“董事会”）宣布邓钢先生基于个人理由已辞任本公司非执行董事、副董事长和提名委员会委员的职务，由二零零九年七月二十日起生效。

邓钢先生确认与董事会并无持不同意见，亦无任何与其辞任有关而需让本公司股东知悉的事宜。董事会与邓钢先生确认并不知悉尚有须向本公司及其附属公司负担之任何个人责任或因其辞任而对该等责任产生任何影响。

特此公告。

北人印刷机械股份有限公司董事会
2009年7月21日

股票代码：601958　　股票简称：金钼股份　　公告编号：2009-015

金堆城钼业股份有限公司
2009年半年度业绩预减公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

一、预计本期业绩情况

1、业绩预告期间：2009年1月1日至2009年6月30日

2、业绩预告情况：经公司初步测算，预计2009年1-6月归属于母公司的净利润将比上年同期下降50%以上。

3、本次预计的经营情况未经注册会计师审计。

二、上年同期业绩

1、归属于母公司的净利润：1，745，500，163.63元人民币

2、基本每股收益：0.75元

三、业绩变动原因

受国际金融危机影响，2009年上半年公司主要产品市场需求减小、销售价格大幅下跌，导致营业收入和毛利率下降，预计公司经营业绩同比降幅较大。

四、其他相关说明

具体财务数据公司将在2009年半年度报告中予以详细披露，敬请广大投资者谨慎决策投资。

特此公告。

金堆城钼业股份有限公司董事会
二〇〇九年七月二十二日