长盛货币市场基金

招募说明书(更新)摘要

基金管理人:长盛基金管理有限公司 基金托管人:兴业银行股份有限公司

重要提示:

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2006 年 3 月 31 日,其中,总经理情况内容更新截止到 2006 年 4 月 10 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2006 年 3 月 31 日(财务数据未经审计)。

一、基金合同生效的日期:2005 年 12 月 12 日

二、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:长盛基金管理有限公司
住所:深圳市福田区华富路航都大厦 13C
办公地址:北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20–22 层
法定代表人:凤良志
电话:(010)82255818
传真:(010)82255988
联系人:叶金松

本基金管理人经中国证监会证监基字[1999]6 号文件批准,于 1999 年 3 月成立,注册资本为人民币 10000 万元。目前,本公司股东及其出资比例为:国元证券有限责任公司 49%、安徽省创新投资有限公司 26%、安徽省投资集团有限责任公司 25%。截至 2006 年 3 月 31 日,基金管理人共管理四只封闭式基金、四只开放式基金和社保基金委托资产,公募基金管理资产规模约 110 亿元。

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

凤良志先生,董事长,博士,高级经济师。曾历任安徽省政府办公厅第二办公室副主任、安徽省国际信托投资公司副总经理、安徽省证券管理办公室主任、安徽省政府驻香港窗口公司(黄山有限公司)董事长、安徽省国际信托投资公司副总经理(主持工作)、安徽国元控股(集团)有限责任公司暨国元信托有限责任公司董事长,现为国元证券有限责任公司董事长。

钱进先生(342301194601110231),董事,学士,高级工程师。曾历任安徽省全椒柴油机厂厂长、党委书记,全椒县政府副县长,全椒县委副书记、书记,滁州市常务副市长、市长,安徽省经贸委副主任,现为安徽省投资集团有限责任公司总经理、党委书记。

蔡咏先生,董事,学士,高级经济师。曾在安徽财贸学院财政金融系任会计教研室主任、安徽省国际经济技术合作公司美国(塞班)分公司任财务经理,历任安徽省国际信托投资公司国际金融部经理、深圳证券营业部总经理、安徽省政府驻香港窗口公司(黄山有限公司)总经理助理、安徽省国际信托投资公司证券总部副总经理,现为国元证券有限责任公司董事、总裁。

叶斌先生,董事,学士,高级经济师。曾任安徽大学管理系讲师、教研室副主任,历任安徽省信托投资公司部门经理、副总经理,现为安徽省中小企业信用担保中心副主任、安徽省创新投资有限公司总经理。

陈平先生,董事,硕士研究生。曾在合肥工业大学管理系任教,历任安徽省国际信托投资公司证券发行部副经理、证券投资部经理,现为国元证券有限责任公司副总裁。

钱进先生(340104650425209),董事,硕士研究生。曾历任安徽省节能中心副主任、安徽省经贸投资集团董事、安徽省医药集团股份公司总经理,现为安徽省投资集团有限责任公司资本运营部经理。

徐经长先生,独立董事,博士,教授;中国人民大学商学院 MPAcc 中心主任,会计系副主任。财政部教材编审委员会委员;香港中文大学和清华大学 FMBA 项目特聘教授;香港理工大学 MPAcc 项目特聘教授。已主持国家社科基金、国家自然科学基金、财政部重点会计科研课题四项;主要研究领域为国际比较会计、证券市场会计监管。已公开出版专著两部,主编教材五本;在《经济理论与经济管理》、《财贸研究》、《会计研究》等核心期刊中发表论文 100 余篇。

荣兆梓先生,独立董事,经济学学士,教授;兼任黄山金马股份有限公司独立董事。曾任安徽省社会科学院副主编,现为安徽大学经济学院院长,校学术委员会委员,产业经济学和工商管理硕士点学科带头人;武汉大学商学院博士生导师,安徽省政府特邀咨询员;全国马经史学会常务理事,全国资本论研究会常务理事,安徽省经济学会常务理事。

陈华平先生,独立董事,博士毕业,教授,博士生导师。曾历任中国科技大学商学院信息管理与决策研究室主任、中国科技大学商学院商务智能实验室主任,现为中国科技大学商学院副院长,中国科技大学"管理科学与工程"一级学科博士点的学科带头人。

李伟强先生,独立董事,美国加州大学洛杉矶分校工商管理硕士,美国宾州州立大学政府管理硕士和法国文学硕士。曾历任摩根士丹利纽约、新加坡、香港等地投资顾问、副总裁、花旗环球金融亚洲有限公司高级副总裁,现任香港国际资本管理有限公司董事长。

2、基金管理人监事会成员

钱正先生,监事,学士,高级经济师。曾历任安徽省人大常委办公厅副处长、处长,安徽省信托投资公司副总经理、党委副书记,安徽省国有资产管理局分党组书记,现为安徽省创新投资有限公司董事长。

陶炜先生,监事,学士,经济师。曾历任海南联合租赁公司总经理助理、中山集团财务公司证券营业部经理、南京民生租赁有限公司董事长,现为江南模塑科技股份有限公司董事长、国元证券有限责任公司副董事长。

肖强,监事,学士。曾历任中信证券有限责任公司北太平庄营业部交易部经理、营业部总经理助理,中信证券股份有限公司研究咨询部副总经理、高级分析师,中信证券股份有限公司交易部高级交易员。2002 年 6 月加入长盛基金管理有限公司,历任基金同盛基金经理助理、基金同益基金经理、长盛动态精选基金基金经理,现为投资部副总监。

3、本基金基金经理

王茜女士,武汉大学工商管理硕士,9 年金融从业经验。作为全国银行间市场的首批成员组建人,具有丰富的全国银行间市场投资经验和跨市场操作经验。1997 年起历任武汉市商业银行信贷管理部交易员、副经理、总经理助理,2002 年任职于中信证券固定收益部。2002 年 9 月至今,就职于长盛基金管理公司投资管理部,先后负责封闭式基金债券组合管理,开放式基金债券组合管理,历任全国社保基金债券资产委托基金经理助理,现任长盛中信全债指数增强型债券基金经理和本基金基金经理。

4、投资决策委员会成员

陈礼华先生:硕士,高级经济师。历任国务院财务税收物价大检查办公室、财政部国债司和国债金融司主任科员,华泰财产保险股份有限公司投资部研发处负责人、经理,南方基金管理有限公司总经理助理兼投资总监、投资交易总监,长盛基金管理有限公司副总经理等职。现任长盛基金管理有限公司总经理。

叶金松先生:大学,会计师。历任美菱股份有限公司财会部经理,安徽省信托投资公司财会部副经理,国元证券有限责任公司清算中心主任、风险监管部副经理、经理等职。现任长盛基金管理有限公司督察长。

肖强先生:学士,历任中信证券有限责任公司北太平庄营业部交易部经理、营业部总经理助理,中信证券股份有限公司研究咨询部副总经理、高级分析师,中信证券股份有限公司交易部高级交易员。2002 年 6 月加入长盛基金管理有限公司,历任基金同盛基金经理助理、基金同益基金经理、长盛动态精选基金基金经理,现为长盛基金管理有限公司投资部副总监。

李骥先生:博士,历任中体改研究会研究秘书、嘉实基金管理公司分析师、副总监。现任长盛基金管理公司研究发展部副总监。

5、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人

名称:兴业银行股份有限公司
住所:福州市湖东路 154 号
办公地址:福州市湖东路 154 号
法定代表人:高建平
注册日期:1988 年 7 月 20 日
注册资本:39.99 亿元人民币
托管部门联系人:廖海燕
电话:(021)62155823
传真:(021)62159217

发展概况及财务状况:兴业银行股份有限公司成立于 1988 年,是国务院和中国人民银行批准成立的我国首批股份制商业银行之一,总部设于福建省福州市,注册资本 39.99 亿元,截止 2005 年末资本净额达到 200.77 亿元,资产总额达到 4739.88 亿元,各项存款余额 3552.18 亿元,各项贷款余额 2425.72 亿元,按五级分类法年末不良贷款比率 2.33%,全年实现净利润 24.55 亿元。根据英国《银行家》杂志 2005 年 7 月期 2005 年度世界 1000 家银行最新排名,该行按一级资本排名列第 325 位,按总资产排名列第 210 位。

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部,下设综合处、核算管理处、稽核监察处、市场处等处室,共有员工 27 人,平均年龄 30 岁,100%员工拥有大学本科以上学历,业务岗位人员均具有基金从业资格。兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格,截至 2006 年 3 月 31 日,兴业银行股份有限公司托管证券投资基金 3 只,托管规模 40.62 亿元。

四、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

(1)长盛基金管理有限公司北京直销中心
地址:北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层
电话:(010)82255818 转 263、288
传真:(010)82255981、82255982
联系人:关威
客户服务电话:(010)62350088

(2)长盛基金管理有限公司上海直销中心
地址:上海浦东新区世纪大道 1600 号浦项广场 2014 室
电话:(021)50580120、50580122
传真:(021)50580121
联系人:冯岩

2、代销机构

(1)兴业银行股份有限公司
住所:福州市湖东路 154 号
办公地址:福州市湖东路 154 号
法定代表人:高建平
电话:(0591)87839338
联系人:陈丹
客户服务电话:95561

(2)中国农业银行
住所:北京海淀区复兴路甲 23 号
办公地址:北京海淀区复兴路甲 23 号
法定代表人:杨明生
电话:(010)68298560、68297268
传真:(010)68297268
联系人:蒋浩

(3)国元证券证券有限责任公司
住所:合肥市寿春路 179 号
办公地址:合肥寿春路 179 号
法定代表人:凤良志
开放式基金咨询电话:安徽地区:96888;全国:400–8888–777
开放式基金业务传真:0551—2634400–1171
联系人:李蔡

(4)中信证券股份有限公司
住所:深圳市湖贝路 1030 号海龙王大厦
办公地址:北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦
法定代表人:王东明
电话:(010)84864818 转 63266
传真:(010)84865560
联系人:陈忠

(5)广发证券股份有限公司
住所:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室
办公地址:广东广州天河北路大都会广场 36、38、41 和 42 楼
法定代表人:王志伟
电话:(020)87555888
传真:(020)87557985
联系人:肖中梅

(6)中国银河证券有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
办公地址: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:朱利
电话:(010)66568587
传真:(010)66568536
联系人:郭京华

(7)国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区商城路 618 号
办公地址:上海市延平路 135 号
法定代表人:祝幼一
电话:(021)62580818–213
传真:(021)62569400
联系人:芮敏祺

(8)广发华福证券有限责任公司
住所:福州市新天地大厦 8 层
办公地址:福州市新天地大厦 8 层
法定代表人:王比
电话:(0591)87383623
传真:(0591)87383610
联系人:吴晓立

(9)招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39—45 层
办公地址: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
电话:(0755)82943511
传真:(0755)82943237
联系人:黄健

(10)兴业证券股份有限公司
住所:福州市湖东路 99 号标力大厦
办公地址:上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 18 层
法定代表人:兰荣
电话:(021)68419974
传真:(021)68419867
联系人:杨盛芳

(11)恒泰证券有限责任公司
住所:内蒙古呼和浩特市新城区东风路 111 号
办公地址:上海松林路 357 号通贸大厦 20 楼
法定代表人:李庆阳
电话:(021)51159506
客户服务电话:(021)51159559 转 2569 或 2553
传真:(021)51159596
联系人:吴士君

(12)德邦证券有限责任公司
住所:沈阳市沈河区小西路 49 号
办公地址:上海市浦东南路 588 号浦发大厦 26 层
法定代表人:王军
电话:(021)68590808–8119
传真:(021)68596077
联系人:罗芳

(13)海通证券股份有限公司
住所:上海市淮海中路 98 号
办公地址:上海市淮海中路 98 号
法定代表人:王开国
电话:(021)53594566–4125
传真:(021)53858549
联系人:金芸

(14)中信建投证券有限责任公司
住所:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址:北京市朝内大街 188 号
法定代表人:黎晓宏
电话:(010)65186758
传真:(010)65185322
联系人:权唐

(15)光大证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 15–16 楼
办公地址:上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 14 楼
法定代表人:王明权
电话:(021)68816000
客户服务咨询电话:(021)68823685
传真:(021)68815009
联系人:刘晨

(16)长江证券有限责任公司
住所:武汉市新华下路特 8 号
办公地址:武汉市新华下路特 8 号
法定代表人:明云成
电话:(027)65799560
传真:(027)85481532
联系人:毕艇

(17)申银万国证券股份有限公司
住所:上海市常熟路 171 号
办公地址:上海市常熟路 171 号
法定代表人:谢平
电话:(021)54033888
传真:(021)54035333
联系人:王序微

(18)联合证券有限责任公司
住所:深圳市深南东路 5047 号发展银行大厦 10、14、24、25 楼
办公地址:深圳市深南东路 5047 号发展银行大厦 10、14、24、25 楼
法人代表人:马国强
电话:(0755)82493561
传真:(0755)82492062
联系人:范雪玲

(二)注册登记机构
名称:长盛基金管理有限公司
住所:深圳市福田区华富路航都大厦 13C
办公地址:北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层
法定代表人:凤良志
电话:(010)82255818
传真:(010)82255988
联系人:戴君棉

(三)出具法律意见书的律师事务所和经办律师
名称:北京市广盛律师事务所
住所:北京市建国路 99 号中服大厦 25 层
办公地址:北京市建国路 99 号中服大厦 25 层
法定代表人:夏善胜
电话:(010)65813529
传真:(010)65816534
经办律师:吴军

(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
住所:上海市浦东新区沈家弄 325 号
办公地址:上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
法定代表人:Kent Watson
电话:(021)61238888
传真:(021)61238800
经办注册会计师:汪棣、薛竞

五、基金的名称

本基金名称:长盛货币市场基金

六、基金的类型

基金类型:契约型开放式

七、基金的投资目标

在力争本金安全、保证资产高流动性的基础上,追求高于业绩比较基准的收益。

八、基金的投资方向

本基金将投资于以下金融工具:
(一)现金;
(二)一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;
(三)剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券;
(四)期限在一年以内(含一年)的债券回购;
(五)期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;
(六)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、基金的投资策略与程序

(一)投资决策依据
1、国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。
2、宏观经济、微观经济运行状况,货币政策和财政政策执行状况,货币市场和证券市场运行状况;
3、策略分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告,为投资策略提供依据。

(二)投资决策程序

1、投资组合计划的拟定

基金管理小组每月月末拟定下月资产配置计划,报投资决策委员会审批。投资组合计划制定的依据未来宏观经济形势、财政与货币政策、短期市场资金供求等因素变化的研究与分析,以及据此作出的对未来短期内不同市场、不同品种的市场利率的积极判断,在此基础上基金管理小组制定未来一段时间基金组合的期限结构和品种配置计划,并报投资决策委员会审批。投资组合计划是未来一段时间投资的基础与纲领。

如果基金管理小组认为影响各期限、品种收益率的因素产生了重大变化,还可以临时提出新的投资计划,并由投资决策委员会审批。

2、投资计划的实施

基金管理小组在投资委员会通过的投资组合计划规定限制下,根据市场的实际情况,按照投资策略实施步骤,采用积极投资策略,通过动态调整优化投资组合,追求当期收益最大化。在动态调整的过程中,基金管理小组将全面考虑收益目标、交易成本、市场流动性等特征,实现收益与风险的平衡。

在组合调整过程中,基金管理小组将根据未来可预测资金流动状况,合理管理组合现金头寸,保证组合流动性。

3、交易执行

中央交易室负责执行基金管理小组下达的交易指令,同时履行一线监控的职能。在交易指令执行前,中央交易室对交易指令进行复核,确保交易指令执行后基金各项投资比例符合法律法规以及基金合同、招募说明书的各项规定。

4、组合监控与调整

基金经理与公司的风险管理人员将密切关注宏观经济和市场变化,结合基金申购和赎回导致的现金流量情况,每日对组合的风险和流动性进行监控,确保基金的各项风险控制指标维持在合理水平,确保组合的流动性能够满足投资者的赎回要求。当组合中货币市场工具价格波动引起组合投资比例不能符合控制标准时,或当组合中货币市场工具信用评级调整导致信用等级不符合要求时,基金管理小组应采取有效的措施,在合理的时间内调整组合。

(三)投资管理的方法

本基金在投资组合管理中将采用主动投资策略,在投资中将充分发挥现代金融工程与数量化分析技术方法的决策辅助作用,以提高投资决策的科学性与及时性,在控制风险的前提下,追求收益最大化。本基金的核心投资策略由四部分组成:短期市场利率预期策略、期限机构的滚动配置策略、投资组合优化策略、无风险套利操作策略。

1、短期市场利率预期策略

短期利率预期策略是指基金管理人根据对短期货币市场有影响的宏观经济形势、财政与货币政策、短期市场资金供求等因素变化作出研究与分析,对未来短期内不同市场、不同品种的市场利率进行积极的判断,并以此为依据制定未来一段时间基金组合的期限结构和品种配置计划,期限结构与品种配置计划是未来一段投资的基础。

2、期限结构的滚动配置策略

为了保证组合资产高流动性,组合资产在到期期限配置上采用滚动配置的策略,即在一个相对固定的投资周期中,将各期限品种的投资均衡分布在不同时间上,从而保证在投资周期内的任何时刻都有稳定的到期现金流,最大限度地提高到期期限约束条件下的流动性。

3、投资组合优化策略

投资组合优化管理策略是指在期限结构与品种比例约束下,在滚动配置策略的基础上采用优化技术获得最大化收益的策略体系。其优化目标是组合资产收益最大化,约束条件为期限结构比例约束、品种类属比例约束、信用风险约束等。

4、无风险套利操作策略

由于市场环境差异以及市场参与成员的不同,市场中常常存在无风险套利机会。本基金管理人认为随着市场有效性的提高,无风险套利的机会与收益会不断减少,但是相信在较长一段时间中市场中仍然会存在的无风险套利机会,基金管理人将贯彻谨慎的原则,充分把握市场无风险套利机会,为投资人带来更大收益。

同时,随着市场的发展、新的货币投资工具的推出,会产生新的无风险套利机会,本基金将加强对市场前沿的研究,及时发现市场中新的无风险套利机会,扩大基金投资收益。

为了保证上述投资策略的顺利实施,基金管理人根据货币市场基金的特点,开发了货币资产组合优化管理系统,以提高投资决策的科学化与实时化。

(四)投资品种的选择标准

在上述组合管理的基础上,基金管理小组也将充分重视根据市场形势灵活把握投资品种的主动选择,具有下列一项或多项特征的投资品种是本基金重点投资的对象:
1、在相似到期期限和信用等级下,收益率较高的债券、票据或债券回购;
2、相似条件下,流动性较高的债券、票据;
3、相似条件下,交易对手信用等级较高的债券、票据或债券回购。

(五)投资限制

基金管理人应依据有关法律法规及《基金合同》规定,运作管理本基金。为了实现投资目标,贯彻投资理念,本基金投资组合遵循下列规定:

1、本基金不得投资于以下金融工具:
(1)股票
(2)可转换债券
(3)剩余期限超过三百九十七天的债券
(4)信用等级在 AAA 级以下的企业债券
(5)以定期存款为基准利率的浮动利率债券
(6)中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

2、投资组合遵循如下投资限制

(1)投资于同一公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的百分之十;

(2)存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的百分之三十;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的百分之五;

(3)除发生巨额赎回情形外,债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。因发生巨额赎回导致债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的,基金管理人应在 5 个交易日内进行调整。

(4)投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过 180 天。

(5)持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%。

(6)通过买断式回购融入的基础债券的剩余期限不得超过 397 天。

(7)因基金规模或市场变化等原因导致投资组合超出上述规定不在限制之内,但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达到上述标准。

(8)法律法规或监管部门对上述比例、限制另有规定的,从其规定。

3、投资组合平均剩余期限计算方法

平均剩余期限的计算公式为:

$$\frac{\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{剩余期限} + \text{债券正回购} \times \text{剩余期限}}{\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购}}$$

(六)禁止行为

本基金禁止以下投资行为:
1、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券或进行证券回购;
2、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
3、买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;
4、将基金资产用于担保、资金拆借或者贷款;
5、从事证券信用交易;
6、从事可能使基金承担无限责任的投资;
7、投资于与基金托管人或基金管理人有利害关系的公司发行的证券;
8、与管理人的股东进行交易,通过交易上的安排人为降低投资组合的平均剩余期限的真实天数;
9、法律法规及监管机关规定禁止从事的其他行为。

十、基金的业绩比较标准

本基金业绩比较基准为银行一年期定期存款利率(税后)(目前一年定期存款利率为 2.25%,税后收益率为 1.8%)。

十一、基金的风险收益特征

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、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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。

本基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2006 年 5 月 11 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。

本报告所载数据内容截止日为 2006 年 3 月 31 日,相关财务资料未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

资产组合	金额(人民币元)	占基金总资产的比例
债券投资	3,011,963,378.39	81.98%
买入返售证券	526,800,000.00	14.34%
其中:买断式回购的买入返售证券	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金	116,203,998.91	3.16%
其中:定期存款	0.00	0.00%
其他资产	18,850,133.06	0.52%
合计	3,673,817,510.36	100.00%

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金资产净值的比例
1	报告期内债券回购融资余额	40,257,000,000.00	16.25%
	其中:买断式回购融资	0.00	0.00%
2	报告期末债券回购融资余额	505,000,000.00	15.95%
	其中:买断式回购融资	0.00	0.00%

注:(1)上表中报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数,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日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

(2)本报告期内货币市场基金正回购的资金余额超过资产净值的 20%的情况

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例	原因	调整期(日)
1	2006–1–24	21.58%	建仓期内	15
2	2006–1–25	24.66%	建仓期内	14
3	2006–1–26	24.66%	建仓期内	13
4	2006–1–27	24.66%	建仓期内	12
5	2006–1–28	24.66%	建仓期内	11
6	2006–1–29	24.66%	建仓期内	10
7	2006–1–30	24.66%	建仓期内	9
8	2006–1–31	24.66%	建仓期内	8
9	2006–2–1	24.66%	建仓期内	7
10	2006–2–2	24.66%	建仓期内	6
11	2006–2–3	24.65%	建仓期内	5
12	2006–2–4	24.65%	建仓期内	4
13	2006–2–5	24.65%	建仓期内	3
14	2006–2–6	24.67%	建仓期内	2
15	2006–2–7	21.56%	建仓期内	1

3、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	147
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	224
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	107

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限(天)	原因	调整期(日)
1	2006–1–1	224	建仓期内	15
2	2006–1–2	223	建仓期内	14
3	2006–1–3	222	建仓期内	13
4	2006–1–4	215	建仓期内	12
5	2006–1–5	191	建仓期内	11
6	2006–1–6	224	建仓期内	10
7	2006–1–7	223	建仓期内	9
8	2006–1–8	222	建仓期内	8
9	2006–1–9	213	建仓期内	7
10	2006–1–10	203	建仓期内	6
11	2006–1–11	216	建仓期内	5
12	2006–1–12	206	建仓期内	4
13	2006–1–13	188	建仓期内	3
14	2006–1–14	188	建仓期内	2
15	2006–1–15	187	建仓期内	1

(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天内	9.75%	15.95%
2	30天(含)–60 天	13.68%	0.00%
3	60天(含)–90 天	16.48%	0.00%
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	6.96%	0.00%
4	90天(含)–180 天	32.68%	0.00%
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	9.16%	0.00%
5	180天(含)–397 天(含)	42.83%	0.00%
合计		115.42%	15.95%

4、报告期末债券投资组合

(1)债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(人民币元)	占基金资产净值的比例
1	国家债券	0.00	0.00%
2	金融债券	440,863,315.12	13.92%
	其中:政策性金融债	320,672,793.30	10.13%
3	央行票据	655,569,792.00	20.70%
4	企业债券	1,915,530,271.27	60.50%
5	其他	0.00	0.00%
合计		3,011,963,378.39	95.12%
剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券		510,555,956.88	16.12%

注:上表中,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。

(2)基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量		成本(人民币元)	占基金资产净值的比例(%)
		自有投资	买断式回购		
1	05铁道 CP01	3,000,000	0.00	301,282,489.10	9.52%
2	05央票 110	2,000,000	0.00	199,623,809.44	6.30%
3	06首都机场债	1,700,000	0.00	170,000,000.00	5.37%
4	04国开 09	1,400,000	0.00	140,108,347.86	4.42%
5	05工行 03	1,200,000	0.00	120,190,521.82	3.80%
6	05中信债 1	1,200,000	0.00	120,000,000.00	3.79%
7	05淮南矿 CP01	1,200,000	0.00	117,564,984.99	3.71%
8	06中石集 CP01	1,100,000	0.00	109,087,634.27	3.45%
9	05马钢 CP01	1,000,000	0.00	100,446,100.89	3.17%
10	05国开 07	1,000,000	0.00	100,365,435.06	3.17%

注:上表中,"债券数量"中的"自有投资"和"买断式回购"指自有的债券投资和通过债券买断式回购业务买入的债券卖出后的余额。

5、"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	25
报告期内偏离度的最高值	0.3354%
报告期内偏离度的最低值	0.1770%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2417%

6、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,即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价,在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。

(2)本报告期内,本基金持有的剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本不存在超过日基金资产净值 20%的情况。

(3)本报告期内无需说明的证券投资决策程序。

(4)报告期末其他资产构成

序号	其他资产	金额(元)
1	应收利息	13,007,026.26
2	应收申购款	5,831,881.00
3	待摊费用	11,225.80
合 计		18,850,133.06

十三、基金的业绩

	2005.12.12–2005.12.31	2006.1.1–2006.3.31	自成立至 2006.3.31
基金份额净值增长率	0.1058%	0.4731%	0.5793%
同期业绩比较基准收益率	0.0986%	0.4439%	0.5425%
超额收益率	0.0072%	0.0292%	0.0368%

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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来表现。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。

十四、基金费用与税收

(一)与基金运作有关的费用

1、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)证券交易费用;
(4)基金信息披露费用;
(5)基金份额持有人大会费用;
(6)与基金相关的会计师费和律师费;
(7)按照国家有关规定可以列入的其它费用。

2、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

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,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两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 0.10%的年费率计算。计算方法如下:

H=E×0.10%÷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

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,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两个工作日内从基金资产中一次性支取。

(3)上述(一)项 1 中(3)至(7)项费用由基金托管人根据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。基金合同生效前所发生的律师费和会计师费等费用自基金发行费用中列支,不另从基金资产中支付,与基金有关的法定信息披露费按有关法规列支。

(4)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财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不得列入基金费用。

(二)与基金销售有关的费用

1、基金销售服务费

基金销售服务费按前一日的基金资产净值的 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 为前一日的基金资产净值

基金管理人可以调整销售服务费率,但销售服务费年费率最高不超过 0.25%。基金管理人必须在开始调整之日的 3 个工作日之前至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人支付给各代销机构。

2、基金认购费用
本基金不收取认购费用。
3、申购费
本基金不收取申购费用。
4、赎回费
本基金不收取赎回费用。
5、转换费

本基金可以与基金管理人所管理的长盛成长价值基金之间进行转换。转换费率如下:

(1)由本基金转换为长盛成长价值基金,转换费如下表所示:

长盛货币基金转长盛成长价值基金转换金额(M)	费 率
M<100 万元	1.5%
100≤M<500 万元	1.2%
500≤M<1000 万元	0.6%
M≥1000 万元	0.2%

(2)由长盛成长价值基金转换为本基金,转换费率为 0.5%,其中的 25%归入长盛成长价值基金资产。

基金转换的具体业务规则详见基金管理人相关业务公告。

(三)税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》及其他有关法律法规的要求,对本基金 2005 年 6 月招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

1、在"重要提示"中,明确了更新的招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2、在"二、释义"中,更新了对《证券法》的解释。
3、在"三、基金管理人"中,更新了基金管理人的相关基本情况。
4、在"四、基金托管人"中,更新了基金托管人的相关基本情况。
5、在"五、相关服务机构"中,更新了相关服务机构的内容。并增加申银万国证券股份有限公司、联合证券有限责任公司作为本基金代销机构。
6、在"六、基金的募集"中,更新了本基金募集情况。
7、在"七、基金合同的生效"中,增加了合同生效日期。
8、在"九、基金的非交易过户、转托管、基金转换、冻结与解冻"中,更新了基金转换内容。
9、在"十、基金的投资"中增加了"(十)投资组合报告",数据内容截止时间为 2006 年 3 月 31 日。
10、在"十一、基金的业绩"中,增加了本基金成立以来的投资业绩。
11、在"十五、基金费用与税收"中,增加了转换费率相关内容。
12、在"二十二、对基金份额持有人的服务"中,更新了基金管理人客户服务中心的电话。
13、在"二十三、其它应披露的事项"中,披露了如下事项:
(1)2005 年 12 月 2 日基金管理人发布本基金增加代销机构公告,增加申银万国证券股份有限公司为本基金代理销售机构。
(2)2005 年 12 月 13 日基金管理人发布本基金基金合同生效公告。
(3)2005 年 12 月 15 日基金管理人发布本基金开放日常申购、赎回的公告,于 2005 年 12 月 19 日起办理日常申购、赎回的业务。
(4)2005 年 12 月 19 日基金管理人发布本基金收益公告。
(5)2005 年 12 月 27 日基金管理人发布本基金开展定期定额申购业务的公告。
(6)2006 年 1 月 18 日基金管理人发布本基金春节放假前暂停申购的公告。
(7)2006 年 2 月 6 日基金管理人发布本基金收益支付公告。
(8)2006 年 2 月 27 日基金管理人发布本基金与长盛成长价值基金间转换业务的公告,于 2006 年 3 月 2 日起开放本基金与长盛成长价值基金之间的转换业务。
(9)2006 年 2 月 27 日基金管理人发布本基金增加代销机构公告,增加联合证券有限责任公司为本基金代理销售机构。
(10)2006 年 3 月 2 日基金管理人发布本基金收益支付公告。

十六、签署日期

本招募说明书(更新)于 2006 年 5 月 17 日签署。

长盛基金管理有限公司
二零零六年六月九日

证券代码:600225 股票简称:*ST 天香 编号:2006–临 024

华通天香集团股份有限公司董事会决议公告

华通天香集团股份有限公司第五届董事会于 2006 年 6 月 8 日在福州召开临时会议。会议应到董事 9 名,实到董事 5 名,董事姜东溟、独立董事郑庆昌、胡建绩、尤家荣因工作原因,未出席会议。会议由董事长薛仕成授权董事总经理卢少辉主持,符合《公司法》和《公司章程》的规定。会议审议通过如下议案:

一、同意公司聘任车文立先生为公司副总经理,并代行董事会秘书职责。

二、董事王爱明不再代行董事会秘书职责。

特此公告。

华通天香集团股份有限公司董事会
2006 年 6 月 8 日

附:车文立简历

车文立,男,1967 年 6 月出生,天津商学院大学本科毕业,南开大学金融专业研究生学历,现为南开大学国际贸易专业在读博士研究生。自 1994 年起曾任国泰君安证券有限公司天津环湖中路营业部客户经理;2000 年至 2003 年任渤海证券有限公司资产管理部副总经理;2003 年至 2005 年任渤海证券有限公司基金筹备组副组长;2005 年至 2006 年任亿城集团股份有限公司总经理助理。

证券代码:600555 股票简称:G 茉织华 编号:临 2006–017
900955 茉织华 B

上海茉织华股份有限公司关于 2005 年年度股东大会会址的通知

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

根据上海茉织华股份有限公司三届十次董事会会议决议,公司定于 2006 年 6 月 26 日上午 10:00 召开公司 2006 年年度股东大会。现将会议召开的地址通知如下:

公司将假座上海市延安西路 396 号上海美丽园龙都大酒店 5 楼会议室(悉尼 B 厅)召开公司 2005 年年度股东大会,会议议程等其他事项不变。

特此通知。

上海茉织华股份有限公司
二 OO 六年六月九日

简称:潜江制药 证券代码:600568 编号:2006–012 号

湖北潜江制药股份有限公司关于取消股权分置改革动议的提示性公告

特别提示

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

根据有关规定,公司非流通股股东西安东盛集团有限公司、西安风华医药科技投资有限公司和湖北省潜江制药厂提出了股权分置改革(以下简称"股改")动议,公司股票自 2006 年 6 月 5 日发布股改的提示性公告之日起开始停牌。

由于公司股东湖北省潜江制药厂未能及时取得国资部门审批同意的备案表,因此公司不能在 6 月 9 日之前披露股改的相关文件。公司董事会现就上述事项公告如下:

1、本公司未能如期披露股改相关文件,因此将取消本次股改动议;

2、本公司股票将于 2006 年 6 月 12 日复牌。

特此公告。

湖北潜江制药股份有限公司董事会
二 OO 六年六月八日