

长城货币市场证券投资基金

更新的招募说明书摘要

基金管理人：长城基金管理有限公司 基金托管人：华夏银行股份有限公司

长城货币市场证券投资基金经中国证监会证监基金字【2006】62号文件“关于同意长城货币市场证券投资基金设立的批复”批准发起设立。基金合同于2006年5月30日正式生效。

重要提示
投资有风险，投资者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。
本招募说明书所载基金合同和基金招募说明书摘要，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，持有基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受，并视同《基金法》、《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，应详细阅读基金合同。
本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。
本招募说明书所载内容截止日为2006年5月30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、基金管理人

(一)基金管理人概况
1、名称：长城基金管理有限公司
2、注册地址：深圳市福田区深南中路2066号华能大厦25层
3、办公地址：深圳市福田区深南中路2066号华能大厦25层
4、法定代表人：杨光裕
5、组织形式：有限责任公司
6、设立日期：2001年12月27日
7、电话：0755-83662888 传真：0755-83662600
8、联系人：王大治
9、管理基金情况：目前管理基金久富、久嘉、久恒、久泰中信标普300指数、长城货币市场、长城消费增值六只基金
10、客户服务中心电话：0755-83680399
11、注册资本：10000万元
12、股权结构：

持股单位	占总股本比例
长城证券有限责任公司	40%
西北证券有限责任公司	15%
东方证券股份有限公司	15%
中原信托投资有限公司	15%
北方国际信托投资股份有限公司	15%
合计	100%

(二)主要人员情况

1、公司董事、监事及高管人员介绍
(1)公司董事
杨光裕先生，中共党员，硕士研究生毕业。历任江西省审计厅办公室主任，长城证券有限责任公司副总裁，现任长城基金管理有限公司董事长。
邹平先生，博士研究生毕业，管理学博士，高级经济师。历任湖南省进出口总公司部门经理，中国宝安集团分公司副总经理，大鹏证券有限责任公司首席分析师，金元证券有限责任公司研究所所长，现任长城证券有限责任公司总裁助理。
龙鼎霖先生，硕士研究生毕业，经济师。历任长城证券有限责任公司营业部总经理助理、资产管理部总经理、公司经纪业务管理总部总经理、资产管理总部总经理助理、证券投资部总经理，现任长城证券有限责任公司投资总监。
吕朝杰先生，中共党员，高级经济师。历任宁夏证券分公司副总经理、总经理、董事长，西北证券有限责任公司董事长，现任西北证券有限责任公司监事长。
贺若先生，中共党员，博士研究生毕业。历任国家财政部世界银行司科长，新城建设股份有限公司部门主任，光大证券有限责任公司投资银行总部副总经理，北方研究院助理经理、资产管理部副总经理，东方证券股份有限公司办公室副主任兼战略部主任、总裁助理兼人力资源管理部总经理，现任东方证券股份有限公司总裁助理兼资产管理业务部总经理。

崔肇军先生，中共党员，硕士研究生毕业，高级会计师。历任中原信托投资有限公司财务部副经理、经理，公司副总经理，现任中原信托投资有限公司总经理。
陆妍，女，1965年生，1991年毕业于天津理工大学管理信息系统专业，获工学学士学位，1997年毕业于天津大学管理学院，获工学硕士学位。曾任天津国际信托投资公司进出口贸易咨询部部门经理、天津泰达集团证券投资部项目经理，现任北方国际信托投资股份有限公司证券管理总部总经理。
任俊东先生，大学本科毕业。历任中国人民银行深圳分行处长、深圳金融机构同业协会首任秘书长、赛格投资有限公司（香港注册）董事总经理、祥安证券有限公司（香港联交所会员）董事、中国投资环境协会副理事长，现任深圳休斯企业投资顾问有限公司副经理。
马晓红女士，中共党员，研究生毕业。历任最高人民法院法官、副庭长、处长、副院长，中国女法学会会长、中国人民大学兼职教授。
姜建光先生，香港注册会计师，英国特许公认会计师公会资深会员、香港会计师公会资深会员。历任安达信深圳、广州分公司主管合伙人，安达信国际组织合伙人，现任华粤创业投资管理（深圳）有限公司董事总经理。
刘杉，男，1964年生，1986年毕业于南开大学国际经济系，1989年毕业于南开大学国际经济研究所，获经济学硕士学位，现就读于南开大学国际经济系，攻读博士学位。曾任中华工商时报社海外编辑部、副主任、中华工商时报社编辑部主任；中国人民银行深圳分行金融汇报处总编辑。现任职于中华工商时报社，曾任总编辑助理，现任副总编辑，兼任中国人民大学信托与受托管理研究中心主任、北京证券投资理事。
关林戈先生，中共党员，经济学硕士。历任中国汽车贸易公司办公室主任，中共天津市委领导同志秘书，南方证券天津分公司副总经理、常务副总经理、代总经理，长城证券有限责任公司总裁助理，长城基金管理有限公司副总经理、常务副总经理，现任长城基金管理有限公司总经理。

(2)公司监事

阮争先生，大学本科毕业。历任黄河证券有限责任公司发行部经理，港澳信托投资有限公司信托基金部投资管理经理，中国电力信托投资有限公司投资基金部经理，现任中原信托投资有限公司资产管理部副经理，现任长城基金管理有限公司监事长。
杨海女士，会计师。历任伊斯兰国际信托投资公司计划财务部经理兼证券运营营业部主任，宁夏证券登记公司经理，宁夏证券财务总监兼稽核部经理。现任西北证券有限责任公司总裁助理。
罗睿容女士，中共党员，大学本科毕业，会计师。历任四川轻工技工学校财经教研室主任，海南信托投资公司证券部主办会计，长城证券总部财务主管，长城证券总部深圳二部财务部副经理，长城证券有限责任公司成都营业部副总经理兼财务部经理，深圳一部副总经理兼财务部副经理、公司审计部副经理，现任长城证券有限责任公司审计部副经理。
张耀辉先生，中共党员，硕士研究生毕业。历任上海浦东发展银行总行证券发行部科员，东方证券股份有限公司经济业务管理部副经理，辽宁资产管理集团投资、信托发行东方证券股份有限公司资产管理部副经理。
田德良，男，1982年生，2006年毕业于中央广播电视大学会计学专业，经济师。曾任职于中国建设银行天津开发区分行，任经理助理、事后稽核。现任职于北方国际信托投资有限公司，曾任会计部经理助理、会计部副经理、会计部副经理、监察稽核部副经理、项目评估部项目经理、业务发展总部客户经理。现任资产管理部项目经理。
李建中先生，研究生毕业。历任长城证券有限责任公司资金计划部副经理、资产管理部副经理，长城基金管理有限公司董事会秘书，并先后兼任运行保障部副经理、综合管理部经理，现任长城基金管理有限公司督察长，兼任公司董事会秘书。

(3)公司高级管理人员

杨光裕先生，中共党员，硕士研究生毕业。历任江西省审计厅办公室主任，长城证券有限责任公司副总裁，现任长城基金管理有限公司董事长。
关林戈先生，中共党员，经济学硕士。历任中国汽车贸易公司办公室主任，中共天津市委领导同志秘书，南方证券天津分公司副总经理、常务副总经理、代总经理，长城证券有限责任公司总裁助理，长城基金管理有限公司副总经理、常务副总经理，现任长城基金管理有限公司董事、总经理。
余骏先生，硕士研究生毕业。曾任教于中国地质大学经济学院，历任中国人民银行湖北省分行科负责人，君安证券有限公司研究发展部负责人，长城证券有限责任公司营业部总经理，长城基金管理有限公司督察长兼监察稽核部副经理。现任长城基金管理有限公司副经理兼综合管理部副经理。
汪次生，中共党员，博士研究生毕业。曾就职于中国人民银行湖南省分行教育处，海南港澳国际信托投资公司证券部，历任三证友方证券股份有限公司副总经理，国信证券有限责任公司研究所科长，长城基金管理有限公司总经理助理，并先后兼任研究策划部经理、市场开发部经理，现任长城基金管理有限公司副经理兼市场开发部经理。
韩先生，硕士研究生毕业。历任长城证券有限责任公司资产管理部副经理，长城基金管理有限公司投资管理部副经理，“久嘉证券投资基金”基金助理、总经理助理，“长城久恒平衡证券投资基金”基金助理，现任长城基金管理有限公司副经理、投资总监。
李建中先生，研究生毕业。历任长城证券有限责任公司资金计划部副经理、资产管理部副经理，现任长城基金管理有限公司董事会秘书，并先后兼任运行保障部副经理、综合管理部经理，现任长城基金管理有限公司督察长，兼任公司董事会秘书。

二、基金托管人

(一)基金托管人概况
1、名称：华夏银行股份有限公司
2、注册地址：北京市东城区建国门内大街22号
3、办公地址：北京市东城区建国门内大街22号
4、法定代表人：刘海燕
5、组织形式：股份有限公司
6、成立日期：1992年10月14日

7、批准设立机关及批准设立文号：中国人民银行【银复（1992）391号】
8、基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字【2006】25号
9、注册资本：42亿元人民币
10、存续期间：持续经营
11、联系人：郑翔
12、电话：010-85239418
13、传真：0755-82133680
14、客户服务电话：96577
(二)基金托管业务主要人员情况
华夏银行基金托管部成立于2004年7月，内设市场综合室、管理室和稽察室3个职能部门，并在上海、深圳分行设立2个托管分部。基金托管部共有员工12人，全部具备基金从业资格，高管人员均拥有硕士学位或高级职称。
(三)基金托管业务经营情况
华夏银行于2006年2月23日经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会核准，获得证券投资基金托管资格，是《证券投资基金法》和《证券投资基金托管业务管理办法》实施后取得证券投资基金托管资格的第一家银行。自成立以来，华夏银行基金托管部本着“诚实信用、勤勉尽责”的行业精神，始终遵循“安全保管基金资产，提供优质托管服务”的原则，坚持以客户为中心的服务理念，依托严格的内控管理体系、先进的技术系统、优秀的业务团队、丰富的业务经验，严格履行法律和托管协议所规定的各项义务，为广大基金份额持有人和资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异成绩。截至2006年5月30日，托管长城货币市场基金、国联安德盛精选股票基金和万家货币市场基金等3只证券投资基金，托管规模59.92亿份，托管资产净值60.67亿元。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构
1、直销机构
名称：长城基金管理有限公司
注册地址：深圳市福田区深南中路2066号华能大厦25层
法定代表人：杨光裕
成立时间：2001年12月27日
电话：0755-83662888
传真：0755-83662900
联系人：吴晨欣
客户服务中心电话：0755-83680399
2、代销机构
(1)华夏银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区西单北大街111号
法定代表人：刘海燕
电话：010-88238961
传真：010-88238962
联系人：王茂华
(2)招商银行股份有限公司
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：秦晓
行长：马蔚华
设立日期：1987年4月8日
电话：(0755) 83195634、82000060
传真：(0755) 83195649、83195650
联系人：宋小姐、刘小姐
(3)中国建设银行
注册地址：北京市西城区金融大街25号
法定代表人：刘青
服务热线：96533
网址：www.ccb.cn
(4)中信银行股份有限公司
注册地址：北京市朝阳门内大街68号
办公地址：北京市新中街1号内大街188号
法定代表人：董建岳
电话：010-65186758
联系人：权燕
(5)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
电话：021-53890794
联系人：高莉
(6)国联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：杨国平
电话：021-62580818
联系人：方敏祺
(7)东方证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东大道720号20楼
法定代表人：王益民
联系人：刘方
电话：021-50367888
传真：021-50368898
客户服务专线：021-9625206
网址：www.dfzq.com.cn
(8)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
电话：021-68419974
联系人：杨盛芳
客户服务热线：021-68419974
网站：www.xyxz.com.cn
(9)长城证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：魏尚彬
联系人：高峰
电话：0755-83516094
传真：0755-83516199
客户服务电话：0755-82288868
长城证券网址：www.cc168.com.cn
(10)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36号国际企业大厦C座
法定代表人：朱利
联系人：邵国京
客户服务电话：010-68016665
(11)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40—45层
法定代表人：宫小生
电话：0755-82943511
传真：0755-82943317
联系人：黄健
客户服务电话：4008889111、0755-28961111
公司网址：www.newchina.com.cn
(12)北京证券有限责任公司
注册地址：北京市西城区车公庄西大街19号(乙)华通大厦B座10层
法定代表人：秦晓源
电话：(010)68431166
联系人：毛义斌
北证网址：http://www.bjzq.com.cn
(13)平安证券有限责任公司
办公地址：深圳福田区益田路八卦岭八卦三路平安大厦三楼
法定代表人：杨宇光
联系人：任泽松
电话：0755-82422251、82440136
传真：0755-82433794、82400862
全国统一客户服务热线：95511
(14)华泰证券有限责任公司
地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
电话：025-84467777-882、721
联系人：张雪梅、袁林峰
客户服务电话：025-84879897
(15)申银万国证券股份有限公司
客户服务热线：021-962505
公司网站：www.sw2000.com.cn
(16)渤海证券股份有限公司
注册地址：天津经济技术开发区
客户服务电话：022-28456888
公司网站：ewww.com.cn
(17)江南证券有限责任公司
客户服务电话：0755-83686612
公司网站：www.jszq.com.cn
(18)华西证券有限责任公司
客户服务电话：4008-888-818
公司网站：www.hx168.com.cn
(19)国盛证券有限责任公司
注册地址：江西省南昌市永叔路15号
办公地址：江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼
法定代表人：管晋升
联系电话：0791-6289771
传真电话：0791-6289396
联系人：万齐志

公司网址：www.gstts.com
(20)国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦
9、注册地：深圳市福田区
法人代表：何如
联系人：林慧娟
电话：0755-82133066
传真：0755-82133680
客户服务电话：800-3110-8888
公司网址：www.guosen.com.cn
基金管理人可以根据情况变化增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。
(二)基金注册登记机构
名称：长城基金管理有限公司
注册地址：深圳市福田区深南中路2066号华能大厦25层
法定代表人：杨光裕
成立时间：2001年12月27日
电话：0755-83662888
传真：0755-83662600
联系人：杜京果
客户服务中心电话：0755-83680399
本基金注册登记机构为：
(一)律师事务所与经办律师
律师事务所名称：北京市金杜律师事务所
注册地址：北京市朝阳区光华路1号嘉里中心北楼30层
负责人：王玲
经办律师：靳庆军、宋萍萍
电话：0755-82125135
传真：0755-82125600
联系人：宋萍萍
(四)会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所名称：深圳大华天诚会计师事务所
注册地址：深圳市福田区滨河大道5022号联合广场B座11楼
负责人：李寒欣
经办注册会计师：李寒心
电话：0755-82900952
传真：0755-82900965

四、基金的名称

本基金名称：长城货币市场证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约开放式

六、基金的投资目标

在本基金安全和足够流动性的前提下，寻求货币资产的稳健收益。

七、基金的投资对象

本基金投资于国内依法发行、高信用等级、具有一定剩余到期期的债券、央行票据、回购，以及法律法规允许投资的其他金融工具。包括：现金；一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；剩余期限在397天以内（含397天）的债券；期限在一年以内（含一年）的债券回购；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具有良好流动性的货币市场工具。

八、基金的投资策略

1、一级资产配置策略
根据不同类别资产的剩余期限结构、流动性指标、二级市场存量、二级市场交易量、交易场所等，收益水平（到期收益率、票面利率、付息方式、利息税务条款、附加期权价值、类别资产配置差异等）、市场流动性、法律法规对货币市场基金的限制、基金合同、目标收益、业绩比较基准、估值方式等决定不同类别资产的配置比例。
2、二级资产配置策略
根据不同类别资产的剩余期限结构、流动性指标、二级市场存量、二级市场交易量、交易场所等，收益水平（到期收益率、票面利率、付息方式、利息税务条款、附加期权价值、类别资产配置差异等）、市场流动性、法律法规对货币市场基金的限制、基金合同、目标收益、业绩比较基准、估值方式等决定不同类别资产的配置比例。
3、三级资产配置策略
根据不同类别资产的剩余期限、信用等级、流动性指标，确定构建基金投资组合的投资品种。
根据对个券收益率水平、剩余期限、流动性状况的权衡，参照收益目标确定个券投资组合与投资组合数量。
4、四级资产配置策略
根据前市场研究的实际情况以及相关法规的规定，长城货币市场基金的投资组合配置比例范围为：央行票据0—80%，回购0—70%，短期债券0—80%，同业存款/现金比例0—70%。
5、五级资产配置策略
根据前市场研究的实际情况以及相关法规的规定，长城货币市场基金的投资组合配置比例范围为：央行票据0—80%，回购0—70%，短期债券0—80%，同业存款/现金比例0—70%。

6、六级资产配置策略
根据前市场研究的实际情况以及相关法规的规定，长城货币市场基金的投资组合配置比例范围为：央行票据0—80%，回购0—70%，短期债券0—80%，同业存款/现金比例0—70%。
7、七级资产配置策略
根据前市场研究的实际情况以及相关法规的规定，长城货币市场基金的投资组合配置比例范围为：央行票据0—80%，回购0—70%，短期债券0—80%，同业存款/现金比例0—70%。
8、八级资产配置策略
根据前市场研究的实际情况以及相关法规的规定，长城货币市场基金的投资组合配置比例范围为：央行票据0—80%，回购0—70%，短期债券0—80%，同业存款/现金比例0—70%。
9、九级资产配置策略
根据前市场研究的实际情况以及相关法规的规定，长城货币市场基金的投资组合配置比例范围为：央行票据0—80%，回购0—70%，短期债券0—80%，同业存款/现金比例0—70%。

10、十级资产配置策略
根据前市场研究的实际情况以及相关法规的规定，长城货币市场基金的投资组合配置比例范围为：央行票据0—80%，回购0—70%，短期债券0—80%，同业存款/现金比例0—70%。
11、十一级资产配置策略
根据前市场研究的实际情况以及相关法规的规定，长城货币市场基金的投资组合配置比例范围为：央行票据0—80%，回购0—70%，短期债券0—80%，同业存款/现金比例0—70%。

12、十二级资产配置策略
根据前市场研究的实际情况以及相关法规的规定，长城货币市场基金的投资组合配置比例范围为：央行票据0—80%，回购0—70%，短期债券0—80%，同业存款/现金比例0—70%。
13、十三级资产配置策略
根据前市场研究的实际情况以及相关法规的规定，长城货币市场基金的投资组合配置比例范围为：央行票据0—80%，回购0—70%，短期债券0—80%，同业存款/现金比例0—70%。
14、十四级资产配置策略
根据前市场研究的实际情况以及相关法规的规定，长城货币市场基金的投资组合配置比例范围为：央行票据0—80%，回购0—70%，短期债券0—80%，同业存款/现金比例0—70%。
15、十五级资产配置策略
根据前市场研究的实际情况以及相关法规的规定，长城货币市场基金的投资组合配置比例范围为：央行票据0—80%，回购0—70%，短期债券0—80%，同业存款/现金比例0—70%。

资产组合	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
债券投资	2,266,594,816.97	67.07%
买入返售证券	0.00	0.00%
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合计	1,089,530,861.33	32.53%
其他资产	13,454,676.30	0.40%
合计	3,379,580,354.60	100.00%
银行存款和清算备付金合计中包括	900,000,000.00元	元商业银行存款投资。

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	37,273,600,000.00	10.22%
	其中：买断式回购融资	0.00	0.00%
2	报告期内债券回购融资余额	0.00	0.00%
	其中：买断式回购融资	0.00	0.00%

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	151
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	104

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国债	0.00	0.00%
2	金融债	436,161,802.36	12.89%
3	其中：政策性金融债	292,301,994.70	8.66%
4	央行票据	619,132,176.35	18.34%
4	同业债	1,212,240,828.26	35.90%
5	其他	0.00	0.00%
合计	合计	2,266,594,816.97	67.12%
报告期内投资组合平均剩余期限	499,065,924.47	14.78%	

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例(%)	
1	06年国债04	3,000,000	296,172,799.41	87.4%
2	06央行附息07	1,700,000	169,614,417.68	5.02%
3	06央行附息07	1,400,000	142,849,807.66	4.23%
4	04国债01	1,100,000	112,421,326.16	3.33%
5	06央行附息1	1,000,000	101,560,772.23	3.01%
6	06央行附息4	1,000,000	99,613,736.46	2.95%
7	06央行附息CP01	900,000	88,437,263.52	2.62%
8	06央行附息07	800,000	79,179,985.58	2.36%
9	06央行附息CP01	800,000	78,890,767.61	2.33%
10	06央行附息07	600,000	61,957,071.34	1.83%

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国债	0.00	0.00%
2	金融债	436,161,802.36	12.89%
3	其中：政策性金融债	292,301,994.70	8.66%
4	央行票据	619,132,176.35	18.34%
4	同业债	1,212,240,828.26	35.90%
5	其他	0.00	0.00%
合计	合计	2,266,594,816.97	67.12%
报告期内投资组合平均剩余期限	499,065,924.47	14.78%	

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例(%)	
1	06央行附息04	3,000,000	296,172,799.41	87.4%
2	06央行附息07	1,700,000	169,614,417.68	5.02%
3	06央行附息07	1,400,000	142,849,807.66	4.23%
4	04国债01	1,100,000	112,421,326.16	3.33%
5	06央行附息1	1,000,000	101,560,772.23	3.01%
6	06央行附息4	1,000,000	99,613,736.46	2.95%
7	06央行附息CP01	900,000	88,437,263.52	2.62%
8	06央行附息07	800,000	79,179,985.58	2.36%
9	06央行附息CP01	800,000	78,890,767.61	2.33%
10	06央行附息07	600,000	61,957,071.34	1.83%

流通股A股获得非流通股股东支付的2.1股股票的对价；在对价支付完成后，公司的非流通股股东持有的非流通股股份即获得上市流通权。
非流通股股份的对价安排为：非流通股股东同意按一定比例向流通股A股股东支付对价，以换取其持有的非流通股股份的股票。根据股分置改革方案，流通股A股股东每持有10股流通股A股获得非流通股股东支付的2.1股股票的对价；在对价支付完成后，公司的非流通股股东持有的非流通股股份即获得上市流通权。
2、独立董事关于调整股分置改革方案的独立意见
根据《关于上市公司股权分置改革的指导意见》、《上市公司股权分置改革管理办法》、《上市公司股权分置改革业务操作指引》、《关于在上市公司建立独立董事制度的指导意见》、《关于上市公司股权分置改革中国有控股股权管理有关问题的通知》、《上海证券交易所上市公司上市规则》及《四川金顶（集团）股份有限公司章程》等有关规定，本公司独立董事杨瑞瑞、王东、郭国民就公司股权分置改革方案调整的相关事项发表独立意见如下：
1、自公司董事会于2006年7月3日公告《股权分置改革说明书》后，公司非流通股股东通过电话、网上沟通、走访投资者等多种方式与非流通股股东进行了沟通，应广大流通股A股股东的要求，非流通股股东经反复协商后，对股权分置改革方案进行了部分调整，并由董事会提出方案。本次调整股分置改革方案的程序符合法律、法规和《公司章程》的有关规定。
2、本次调整股分置改革方案，进一步保护了流通股股东的利益。
3、同意本次对公司《股权分置改革说明书》的修订。
4、本次独立意见是公司独立董事基于公司股权分置改革方案进行调整所发表的独立意见，不构成对前次意见的修改。
3、补充保荐意见的结论性意见
就公司本次调整股分置改革方案，中国民族证券有限责任公司出具补充保荐意见如下：
流通股A股获得非流通股股东支付的2.1股股票的对价；在对价支付完成后，公司的非流通股股东持有的非流通股股份即获得上市流通权。根据股分置改革方案，流通股A股股东每持有10

7、“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	1
报告期内偏离度的最高值	0.2536%
报告期内偏离度的最低值	-0.0977%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0934%

8、投资组合报告附注
(1)基金资产估值方法说明
本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益（亏损）。本基金不采用市场利率或上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。
本基金通过每日分红使得基金份额净值始终维持在1.0000元。
(2)本基金本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

(3)本报告期末需调整的证券投资基金程序
本基金的投资管理采用团队模式和基金经理和基金经理相结合的方式。投资团队由基金经理、固定收益研究员、交易员以及金融工程师共同构成，具有投研协同一体化的便利，并充分利用通过金融工程平台从事定价分析这一独特优势，为基金持有人创造更多的价值。
本基金的投资决策程序主要包括以下四个重要环节：
①公司投资决策委员会每季度根据基金合同的约定以及公司投资风格的选择确定基金投资风险控制的各个主要约束条件，如剩余期限、信用风险级别、流动性限制等，并就此投资范围向基金经理进行授权；
②基金经理根据授权对货币基金进行日常具体的投资和风险管理，基金经理负责每月向投资决策委员会总结上期基金投资操作情况以及风险状况，并提出下期投资策略和风险控制方案，经投资决策委员会通过后严格执行；
③固定收益研究员和金融工程师负责向基金经理提供对市场变化及债券品种等方面的研究支持，并协助基金经理制定每月的投资策略以及风险控制方案。金融工程师还负责每日对基金资产各项指标的合规性进行风险监控；
④监察稽核部门每日对基金操作进行严格监控，监测运用“影子价格”确定的基金资产净值与运用“摊余成本法”确定的基金资产净值之间的偏离度，并定期对基金操作的合法性、合规性等内容进行详细审查。

(4)其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	交易保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收利息	9,011,419.69
4	应收申购款	4,193,256.61
5	其他应收款	0.00
6	待摊费用	0.00
7	其他	0.00
合计	合计	13,454,676.30

十二、基金的费用概览

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，但投资者购买本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，本基金管理人不能保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险，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。
本基金合同生效于2006年5月30日，本基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的对比如下表所示：

阶段	比较基准①	基金净值收益增长率
----	-------	-----------