

## Disclosure

## 益民基金管理有限公司

## 关于旗下基金投资资产支持证券的公告

根据中国证监会《关于证券投资基金投资资产支持证券有关事项的通知》(证监基金字[2006]93号)以及益民基金管理有限公司(以下简称“本公司”)所管理基金的基金合同,本公司旗下基金可以投资于资产支持证券。现将本公司旗下基金投资资产支持证券的投资方案及相关事项公告如下:

一、投资策略  
本公司旗下基金投资资产支持证券将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,进行资产支持证券产品的投资。本公司旗下基金将特别注重资产支持证券品种的信用风险和流动性管理,本着风险调整后收益最大化的原则,确定资产支持证券类别资产的合理配置比例,保证本金相对安全和基金资产流动性,以期获得长期稳定收益。主要的投资流程如下:  
首先,运用“宏观策略表”决定对债券市场的基本看法及久期策略。  
其次,通过收益率曲线分析、利率趋势分析,决定收益率曲线策略及组合的利率期限配置。

最后,运用内部信用评级体系对资产支持证券进行信用风险评估,只有内部信用评级达到投资级别以上的资产支持证券,本管理人人才会纳入投资组合。

## 二、投资比例限制

投资于资产支持证券,除了遵守基金合同中已有的投资比例限制外,还将遵守下述有关资产支持证券投资比例的限制:

1、单只证券投资基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%。  
2、单只证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过该基金资产净值的10%。  
3、单只证券投资基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过该基金资产净值的20%。  
4、本公司管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%。  
因市场波动、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使证券投资基金投资资产支持证券不符合第2条和第3条规定比例的,基金管理人应当在10个交易日內调整完毕。

5、益民货币市场证券投资基金可投资于剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券。浮动利率资产支持证券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算。其他证券投资基金投资于资产支持证券的剩余期限,依照证监会的相关规定和基金合同的约定执行。

6、证券投资基金投资的资产支持证券须具有评级资质的信用评级机构进行持续信用评级。益民货币市场证券投资基金投资的资产支持证券的信用评级,应不低于国内信用评级机构评定的AAA级或相当于AAA级的信用等级。除益民货币市场证券投资基金以外的其他证券投资基金投资的资产支持证券的信用评级应为BBB以上。

证券投资基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降,不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。

## 三、风险控制

本公司针对资产支持证券投资决策、交易、评估等重要环节,制定了事前、事中和事后的风险控制流程。

## (一)事前风险控制

1、针对资产支持证券的投资,公司制定专项的投资管理制度和投资审批程序,确定资产支持证券风险控制的原则和标准。  
2、固定收益小组对资产支持证券产品进行事前的研究分析和投资估值,提出产品的风险收益分析报告。

3、固定收益小组负责密切跟踪影响资产支持证券收益率变化的各种因素,并评估其对资产支持证券持有期收益的影响,并提出相应的投资建议。

## (二)事中风险控制

1、基金经理在投资决策过程中,要评估资产支持证券的流动性安排对基金资产流动性的影响,分散投资,确保所投资的资产支持证券具有适当的流动性,同时密切关注影响债务人提前偿还的各种因素,评估其对资产支持证券投资价值的影

响,并进行相应的投资操作。  
2、交易室负责具体的交易执行,履行一线监控的职责,监控内容包括基金资产支持证券投资比例及交易对手风险;同时对基金经理下达的资产支持

证券投资指令进行审查,发现违规和异常交易及时报告。

3、监察稽核部通过交易风险监控系

统,设定风险控制参数,每日监控资产支持证券的投资头寸和各类比例限制,严格防范投资交易风险。

(三)事后风险控制  
1、固定收益小组密切跟踪影响基金持有的资产支持证券信用质量变化的各种因素,向基金经理进行风险提示,以规避信用风险的上升。

2、金融工程组通过独立的风险管理和绩效评估系统,对资产支持证券投资进行事后的投资风险评估,定期、不定期出具投资风险控制和绩效评价报告,提交基金经理、投资决策委员会和风险控制委员会。

3、基金经理根据市场变化、投资计划的实施情况和执行效果、投资分析报告(包括投资表现评估报告、风险分析报告)等,进一步分析判断,并据此进行投资调整。

## 四、信息披露方式

本基金经理将依照《证券投资基金信息披露管理办法》、《关于证券投资基金投资资产支持证券有关事项的通知》、各基金的基金合同、招募说明书及其他有关规定的要求,在基金法定信息披露文件中及时、充分地披露本基金投资资产支持证券的相关信息。

## 五、相关提示

本基金经理人承诺以恪尽职守、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,也不保证最低收益。投资者申购本公司旗下各基金时,应认真阅读各基金的基金合同、招募说明书和本投资方案。

特此公告。

益民基金管理有限公司  
二〇〇六年十二月二十二日

益民红利成长混合型证券投资基金  
第一次分红公告

益民红利成长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”,代码560002)自2006年11月21日基金合同生效以来取得了良好的投资业绩,本着及时回报投资者的原则,益民基金管理有限公司(以下简称“本公司”)决定对本基金进行第一次分红。截至2006年12月21日本基金可分配收益为24,418,602.96元。根据《益民红利成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,经基金管理人计算并由本基金托管人华夏银行复核,本公司决定以截至2006年12月21日的可分配收益为基准,向本基金的持有人进行收益分配。具体方案公告如下:

一、收益分配方案  
本基金每10份基金份额派发红利0.28元

二、收益分配时间:  
1、权益登记日:除息日:2006年12月25日

2、现金红利发放日:2006年12月26日

3、选择红利再投资的投资者其现金红利转为基金份额的份额净值确定日:2006年12月26日

三、收益分配对象:  
权益登记日在益民基金管理有限公司登记在册的本基金的全

体基金份额持有人。

## 四、收益发放办法:

1、选择现金红利方式的投资者的红利款将于2006年12月26日自基金托管账户划出。

2、选择红利再投资方式的投资者由红利转得的基金份额将以2006年12月26日的基金份额净值为计算基准确定再投资价值,红利再投资所转换的基金份额于2006年12月26日直接划入其基金帐户”。本公司对红利再投资所产生的基金份额进行确认并通知各销售机构。2006年12月27日起投资者可以查询。

五、有关税收和费用的说明

1、根据财政部、国家税务总局的财税字[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,基金向投资者分配的基金收益,暂免征收所得税。

2、本次分红免收分红手续费。

3、选择红利再投资方式的投资者其由红利所得的基金份额免收申购费用。

## 六、提示

1、权益登记日申请申购的基金份额不享有本次分红权益。

2、权益登记日申请申购的金额以2006年12月25日除权后的基金份

额净值为计算基准确定申购份额。

3、对于未选择具体分红方式的投资者,本基金默认的分红方式为现金分红。

4、投资者可以在每个基金开放日的交易时间内到各销售网点修改分红方式,本次分红方式将按照投资者在权益登记日前(不含2006年12月25日)最后一次选择的分红方式为准。请投资者到销售网点或通过我公司客户服务电话(010-63105559)以及代销机构确认分红方式是否正确。如希望修改分红方式,请务必在2006年12月25日前(不含2006年12月25日)到销售网点办妥变更手续。

5、由于部分投资者在开户时填写的地址不够准确完整,为确保投资者能够及时准确地收到对账单,本公司特此提示:请各位投资者核对开户信息,若需补充或更改,请及时致电本公司的客户服务电话(010-63105559)或到原开户网点变更相关资料。

## 七、咨询方式

1、益民基金管理有限公司

客户服务电话:010-63105559

网 站:http://www.yimfund.com

2、本公司直销中心:

名 称:益民基金管理有限公司

联系人:孟旭

电 话:010-63105559

传 真:010-63100608

办公地址:北京市宣武区宣外大街6号庄胜广场中央办公楼南翼13A

邮 编:100052

3、本基金各代销机构:

销售机构名称	客户服务电话
1 华夏银行	96577
2 北京银行	010-96169
3 深圳发展银行股份有限公司	95501
4 国泰君安证券股份有限公司	400-8888-666
5 中国银河证券股份有限公司	010-68016655
6 联合证券有限责任公司	400-8888-555
7 中信证券股份有限公司	各地营业部网点电话
8 西南证券有限责任公司	各地营业部网点电话
9 山西证券有限责任公司	各地营业部网点电话
10 东海证券有限责任公司	北京(010)186525006 上海(021)62196752
11 中信建投证券股份有限公司	4008888108
12 南京证券有限责任公司	各地营业部网点电话

投资者可详见《益民红利成长混合型证券投资基金招募说明书》及《益民红利成长混合型证券投资基金增加代销机构的公告》中各代销机构的营业网点的咨询电话。

特此公告。

益民基金管理有限公司  
二〇〇六年十二月二十二日

益民红利成长混合型证券投资基金  
开放日常申购业务的公告

益民红利成长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)基金合同已于2006年11月21日正式生效。根据《益民红利成长混合型证券投资基金基金合同》和《益民红利成长混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,现将本基金开放日常申购业务有关事项公告如下:

一、重要提示

1、本基金类型为契约型开放式,基金代码:560002。

2、基金管理人、注册登记机构为益民基金管理有限公司(以下简称“本公司”),基金托管人为华夏银行。

3、本公司仅对本基金开放日常申购的有关事项予以说明,投资者欲了解本基金的详细情况,请认真阅读2006年10月19日刊登在《上海证券报》上的本基金招募说明书,亦可登录本公司网站(http://www.yimfund.com)进行查询。

4、投资者可拨打本公司的客户服务电话:010-63105559或登录本公

司网站了解基金交易等事宜。

5、本公告的解释权归本公司所有。

二、日常申购安排

1、申购开放日

本基金自2006年12月27日起办理日常申购业务。本基金的申购开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日(本公司公告暂停申购时除外)。由于各销售机构系统及业务安排等原因,投资者应以各销售机构具体规定的业务办理时间为准。

2、申购数额限制

①投资者通过直销中心首次单笔最低申购金额为人民币500元(含申购费),已在直销中心进行认购的投资者欲追加申购的单笔最低金额为人民币500元(含申购费)。

②投资者通过代销机构营业网点申购的单笔最低金额为500元人民币(含申购费)。

3、本基金的申购费用

本基金自公告当日至本基金开放日常赎回业务当日(含当日)止执行优惠申购费率,具体费率如下:

申购额(含申购费)	申购费率
50万元以下	1.00%
50万元(含)-200万元	0.80%
200万元(含)-500万元	0.50%
500万元(含)以上	1,000元/笔

申购费用=申购金额×申购费率

三、本基金销售机构

投资人可通过如下销售机构办理本基金申购业务。

●直销中心:益民基金管理有限公司

直销中心咨询电话:010-63105559

传真:010-63100608

客户服务电话:010-63105559

●代销机构:

销售机构名称	客户服务电话
1 华夏银行	96577
2 北京银行	010-96169
3 深圳发展银行股份有限公司	95501
4 国泰君安证券股份有限公司	400-8888-666
5 中国银河证券股份有限公司	010-68016655
6 联合证券有限责任公司	400-8888-555
7 中信证券股份有限公司	各地营业部网点电话
8 西南证券有限责任公司	各地营业部网点电话
9 山西证券有限责任公司	各地营业部网点电话
10 东海证券有限责任公司	北京(010)186525006 上海(021)62196752
11 中信建投证券股份有限公司	4008888108
12 南京证券有限责任公司	各地营业部网点电话

本基金销售机构的营业网点,详见2006年10月19日在《上海证券报》刊登的本基金份额发售公告。2006年10月23日在《上海证券报》刊登的《益民基金管理有限公司关于增加南京证券有限责任公司为益民红利成长股票型证券投资基金代销机构的公告》。

本基金若增加新的销售机构,本公司将及时公告。

四、基金份额净值公告

从2006年12月27日起,本公司将根据《益民红利成长混合型证券投资基金基金合同》和《益民红利成长混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,通过中国证监会指定的信息披露媒体,各销售机构的指定网点营业场所、基金管理人的客户服务电话、基金管理人网站等媒介公布上一开放日

本基金份额净值和份额累计净值,敬请投资者留意。

## 五、风险提示

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,也不保证最低收益。投资者投资于本基金时应仔细阅读本基金的招募说明书。

特此公告。

益民基金管理有限公司  
二〇〇六年十二月二十二日

富国天惠精选成长混合型证券投资基金(LOF)  
第五次分红公告

根据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》的有关规定及《富国天惠精选成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的约定,富国天惠精选成长混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)管理人决定对本基金实施自生效以来的第五次分红。经基金管理人计算并由基金托管人中国工商银行复核,对本基金份额持有人的分配方案为每10份基金份额分配红利2.00元。

经基金管理人计算并由基金托管人中国工商银行核算,本基金实际分配收益为:48,155,058.14元,截止2006年12月20日,本基金除权后基金份额净值为:1.8532元。

本基金已于2006年12月20日完成权益登记。具体收益发放办法请查阅2006年12月16日刊登于《中国证券报》和《上海证券报》上的《富国天惠精选成长混合型证券投资基金(LOF)第五次分红公告》。

投资者欲了解有关分红的情况,可到办理业务的当地销售网点查询,或向富国基金管理有限公司咨询。网址:www.fullgoal.com.cn,客户服务热线:95105686(全国统一),021-53594678。

特此公告。

富国基金管理有限公司  
二〇〇六年十二月二十二日

关于中信基金管理有限责任公司  
赎回其持有的中信现金优势货币市场基金的相关公告

中信现金优势货币市场基金是中信基金管理有限责任公司(以下简称“本公司”)旗下管理的一只基金。根据证监基金字[2006]98号《关于基金管理公司运用固有资金进行基金投资有关事项的通知》中的规定,现就本公司赎回其持有的中信现金优势货币市场基金份额的相关事宜公告如下:

赎回日期:2006年12月26日

赎回基金名称:中信现金优势货币市场基金

赎回基金代码:288101

赎回日期:2006年12月26日

赎回份额:61,653,477,50份

赎回费率:0%

赎回代理机构:中信证券股份有限公司

本公司将严格按照中国证监会、公司章程和有关投资管理制度、《中信现金优势货币市场基金开放式证券投资基金基金合同》及《中信现金优势货币市场基金开放式证券投资基金招募说明书》的规定,遵循谨慎、稳健、公开、公平、合理上述基金的赎回业务,并严格履行相关信息披露义务,积极维护基金份额持有人利益。

特此公告。

中信基金管理有限责任公司  
二〇〇六年十二月二十一日

富国天惠精选成长混合型证券投资基金(LOF)  
第五次分红公告

根据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》的有关规定及《富国天惠精选成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的约定,富国天惠精选成长混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)管理人决定对本基金实施自生效以来的第五次分红。经基金管理人计算并由基金托管人中国工商银行复核,对本基金份额持有人的分配方案为每10份基金份额分配红利2.00元。

经基金管理人计算并由基金托管人中国工商银行核算,本基金实际分配收益为:48,155,058.14元,截止2006年12月20日,本基金除权后基金份额净值为:1.8532元。

本基金已于2006年12月20日完成权益登记。具体收益发放办法请查阅2006年12月16日刊登于《中国证券报》和《上海证券报》上的《富国天惠精选成长混合型证券投资基金(LOF)第五次分红公告》。

投资者欲了解有关分红的情况,可到办理业务的当地销售网点查询,或向富国基金管理有限公司咨询。网址:www.fullgoal.com.cn,客户服务热线:95105686(全国统一),021-53594678。

特此公告。

富国基金管理有限公司  
二〇〇六年十二月二十二日

关于中信基金管理有限责任公司  
赎回其持有的中信现金优势货币市场基金的相关公告

中信现金优势货币市场基金是中信基金管理有限责任公司(以下简称“本公司”)旗下管理的一只基金。根据证监基金字[2006]98号《关于基金管理公司运用固有资金进行基金投资有关事项的通知》中的规定,现就本公司赎回其持有的中信现金优势货币市场基金份额的相关事宜公告如下:

赎回日期:2006年12月26日

赎回基金名称:中信现金优势货币市场基金

赎回基金代码:288101

赎回日期:2006年12月26日

赎回份额:61,653,477,50份

赎回费率:0%

赎回代理机构:中信证券股份有限公司

本公司将严格按照中国证监会、公司章程和有关投资管理制度、《中信现金优势货币市场基金开放式证券投资基金基金合同》及《中信现金优势货币市场基金开放式证券投资基金招募说明书》的规定,遵循谨慎、稳健、公开、公平、合理上述基金的赎回业务,并严格履行相关信息披露义务,积极维护基金份额持有人利益。

特此公告。

中信基金管理有限责任公司  
二〇〇六年十二月二十一日

光大保德信基金管理有限公司关于旗下  
量化核心证券投资基金暂停大额申购及转入业务的公告

鉴于我司管理的光大保德信量化核心证券投资基金(以下简称“量化基金”)持有的部分股票处于股权分置改革阶段,预计对基金份额净值的影响较大。为切实维护现有基金份额持有人利益,根据《光大保德信量化核心证券投资基金基金合同》“九.基金的申购和赎回”之“九.1.拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式”中关于“基金管理人可以拒绝或暂停接受、办理申购申请”的情形之“(九)基金管理人认为接受某笔或某些申购可能会损害已有基金份额持有人利益”的规定,我司决定自2006年12月22日起,暂停光大保德信量化核心证券投资基金单笔申购人民币50万元以上(不含50万元)的申购和从我司管理的其他开放式基金单笔申购50万元以上(不含50万元)转入上述基金的业务,且单个基金份额持有人累计申购及/或转入金额不得超过50万元。

恢复量化基金的正常申购及转入业务的具体时间,我司将另行通知。

在新增量化基金的申购及转入业务期间,量化基金的赎回及转出业务正常进行。

请基金份额持有人注意:在导致基金资产可能发生低估的期间未消除之前,赎回基金份额可能导致部分损失。

投资者可以登录我司网站(www.epl.com.cn)或拨打客户服务电话021-53524620咨询基金相关信息。

特此公告。

光大保德信基金管理有限公司  
2006年12月22日

## 华泰证券有限责任公司

## 关于注销贵州茅台认沽权证的公告

依照上海证券交易所发布的《关于证券公司创设贵州茅台权证有关事项的通知》,华泰证券有限责任公司向上海证券交易所申请注销贵州茅台认沽权证并已获得核准,中国证券登记结算有限责任公司上海分公司已办理相应登记手续。本公司此次获准注销的贵州茅台认沽权证数量为500万份,该权证的条款与原贵州茅台认沽权证(交易简称茅台JCP1,交易代码580990,行权代码582990)的条款完全相同。

本公司此次注销的贵州茅台认沽权证的注销生效日期为2006年12月22日(相关信息请登陆华泰证券网www.htsc.com.cn查询)。

特此公告。

华泰证券有限责任公司  
2006年12月22日

## 华泰证券有限责任公司

## 关于注销国电电力认购权证的公告

依照上海证券交易所发布的《关于证券公司创设国电电力权证有关事项的通知》,华泰证券有限责任公司向上海证券交易所申请注销国电电力认购权证并已获得核准,中国证券登记结算有限责任公司上海分公司已办理相应登记手续。本公司此次获准注销的国电电力认购权证数量为300万份,该权证的条款与原国电电力认购权证(交易简称国电JTB1,交易代码580008,行权代码582008)的条款完全相同。

本公司此次注销的国电电力认购权证的注销生效日期为2006年12月22日(相关信息请登陆华泰证券网www.htsc.com.cn查询)。

特此公告。

华泰证券有限责任公司  
2006年12月22日

## 华泰证券有限责任公司

## 关于注销青岛海尔认沽权证的公告

依照上海证券交易所发布的《关于证券公司创设青岛海尔权证有关事项的通知》,华泰证券有限责任公司向上海证券交易所申请注销青岛海尔认沽权证并已获得核准,中国证券登记结算有限责任公司上海分公司已办理相应登记手续。本公司此次获准注销的青岛海尔认沽权证数量为500万份,该权证的条款与原青岛海尔认沽权证(交易简称海尔JTP1,交易代码580991,行权代码582991)的条款完全相同。

本公司此次注销的青岛海尔认沽权证的注销生效日期为2006年12月22日(相关信息请登陆华泰证券网www.htsc.com.cn查询)。

特此公告。

华泰证券有限责任公司  
2006年12月22日

## 华泰证券有限责任公司

## 关于注销雅戈尔认购权证的公告

依照上海证券交易所发布的《关于证券公司创设雅戈尔权证有关事项的通知》,华泰证券有限责任公司向上海证券交易所申请注销雅戈尔认购权证并已获得核准,中国证券登记结算有限责任公司上海分公司已办理相应登记手续。本公司此次获准注销的雅戈尔认购权证数量为300万份,该权证的条款与原雅戈尔认购权证(交易简称雅戈OCB1,交易代码580006,行权代码582006)的条款完全相同。

本公司此次注销的雅戈尔认购权证的注销生效日期为2006年12月22日(相关信息请登陆华泰证券网www.htsc.com.cn查询)。

特此公告。

华泰证券有限责任公司  
2006年12月22日

## 华泰证券有限责任公司

## 关于注销烟台万华认沽权证的公告

依照上海证券交易所发布的《关于证券公司创设烟台万华权证有关事项的通知》,华泰证券有限责任公司向上海证券交易所申请注销烟台万华认沽权证并已获得核准,中国证券登记结算有限责任公司上海分公司已办理相应登记手续。本公司此次获准注销的烟台万华认沽权证数量为400万份,该权证的条款与原烟台万华认沽权证(交易简称万华HXP1,交易代码580993,行权代码582993)的条款完全相同。

本公司此次注销的烟台万华认沽权证的注销生效日期为2006年12月22日(相关信息请登陆华泰证券网www.htsc.com.cn查询)。

特此公告。

华泰证券有限责任公司  
2006年12月22日

证券代码:600071

股票简称:凤凰光学

编号:临2006-022

## 凤凰光学股份有限公司

## 关于控股子公司凤凰光学(上海)有限公司重大事项的公告

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有连带责任。

近日,从本公司控股子公司凤凰光学(上海)有限公司获悉:2006年12月20日,凤凰光学(上海)有限公司的股东之一——江西三清山旅游集团有限公司与日本富士能株式会社(FUJINON CORPORATION)签署了《股权转让协议书》,该《股权转让协议书》规定,江西三清山旅游集团有限公司将其持有凤凰光学(上海)有限公司的8.8%的股权(出资额为人民币1100万元)全部转让给日本富士能株式会社(FUJINON CORPORATION),该股权转让价格为每股人民币1.29元,合计总价款为人民币14,190,000.00元。

在上述股权转让完成之后,本公司对凤凰光学(上海)有限公司的出资额和出资比例保持不变;凤凰光学股份有限公司出资额仍为人民币5225万元,出资比例41.8%,仍然为凤凰光学(上海)有限公司的第一大股东。

特此公告。