万家货币市场证券投资基金

更新招募说明书摘要

(2007 年第 1 号)

基金管理人:万家基金管理有限公司　　基金托管人:华夏银行股份有限公司

重要提示

本基金经中国证监会证监基金字[2006]69 号文批准募集,基金合同于 2006 年 5 月 24 日生效。

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读本基金招募说明书。

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《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,应详细查阅本基金的基金合同。

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资产, 但投资者投资于本基金不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,基金管理人不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2006 年 11 月 24 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2006 年 9 月 30 日(财务数据未经审计)。

第一部分　基金管理人

一、基金管理人概况

（一）名称:万家基金管理有限公司
（二）注册地址:上海市浦东新区源深路 273 号
（三）办公地址:上海市浦东新区福山路 450 号新天国际大厦 23 楼
（四）法定代表人:柳亚男
（五）总经理（代）:张健
（六）成立日期:2002 年 8 月 23 日
（七）批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字【2002】44 号
（八）经营范围:基金管理业务;发起设立基金;中国证监会批准的其他业务
（九）组织形式:有限责任公司
（十）注册资本:1 亿元人民币
（十一）存续期间:持续经营
（十二）联系人:吴涛
（十三）电话:021–38619999　　传真:021–38619888

二、主要人员情况

（一）基金管理人董事会成员

董事长柳亚男先生,1954 年生,中共党员,硕士研究生,高级经济师。历任中国人民银行烟台分行办公室副主任、中国人民银行威海分行办公室主任、中国人民银行山东省分行金管处副处长、山东证券（天同证券）有限责任公司总裁、副董事长等职。2002 年至今任万家基金管理有限公司董事长。

董事鲁国锋先生,1969 年生,经济学博士,经济师、会计师、注册会计师。曾任上海久事公司董事会秘书、上海申通地铁股份有限公司总经理助理、上海久事公司综合策划部经理等职,现任上海久事公司资产经营部、投资发展部经理。

董事曲为民先生,1957 年生,中共党员,大学本科学历,高级经济师。历任烟台市经济体制改革委员会副科长、烟台市人民政府研究室科长、烟台张裕集团有限公司董事、副总经理等职。现任烟台张裕葡萄酿酒股份有限公司董事、副总经理兼董秘。

董事付光明先生,1964 年 11 月出生,中共党员,大学学历,中国注册会计师,高级会计师、审计师。曾任湘西自治州审计事务所副所长、所长职务。现任湖南湘泉集团有限公司副总经理、财务总监及湖南酒鬼酒股份有限公司董事。

独立董事孙健先生,1953 年生,中共党员,硕士研究生,教授。历任中国科学技术大学副教授、中国科学院副教授、教授、管理工程系主任、研究中心主任、中国电子工业部部长顾问组顾问、政策法规委员会委员、人教司研究员等职。现任中国科学技术大学国际经济研究所所长、教授。

独立董事任辉先生,1945 年生,中共党员,大学本科学历。历任山东菏泽商业局会计科长、山东经济学院院长等职。

独立董事吴育华先生,1944 年生,天津大学管理学院教授,博士生导师,享受国务院政府特殊津贴专家。曾任天津大学管理学院管理科学研究所所长和信息管理与管理科学系主任,现为中国运筹学会副理事长、天津市运筹学会理事长、并任多家大学兼职教授和上市公司独立董事。

（二）基金管理人监事会成员

杨波先生,监事。1957 年生,中共党员,法学博士,经济师。曾先后担任吉首市政府办公室主任、吉首市副市长,现任湖南湘泉集团有限公司董事长、总经理及湖南酒鬼酒股份有限公司董事。

王慧英女士,监事。1963 年生,大学本科,高级会计师。历任山东省二轻厅工艺美术总公司财务部主任、天同证券有限责任公司计划财务部副总经理等职。现任天同证券有限责任公司稽核监察总部总经理。

孙江先生,监事。1965 年生,中共党员,本科学历,企业法律顾问。先后任职于华东政法学院法律系、上海上菱电器股份有限公司。现任职于上海久事公司。

张虹霞女士,监事。1955 年生,中共党员,大专学历,高级会计师。历任烟台张裕葡萄酿酒公司财务科、烟台张裕集团有限公司财务处副处长等职。现任烟台张裕葡萄酿酒公司监事兼企业审计处处长。

刘国华女士,监事。1970 年生,博士。曾在山东国际信托投资公司从事国际融资转租赁、外汇信贷等工作。2002 年 8 月至今在公司从事投资研究工作。

（三）基金管理人高管人员

总经理（代）:张健先生,1966 年生,管理学硕士。1988 年至 1992 年于中国工商银行总行科技部、资金计划部工作;1992 年至 1993 年,就职于北京证券登记结算公司,担任业务部负责人;1993 至 2002 年,就职于中国工商银行总行存款证券处、基金托管部,先后任部门经理、副处长、处长等职。2002 年 3 月至今,先后担任公司运营总监、财务总监、副总经理等职,2005 年 5 月起,担任公司代总经理。

督察长:甘世雄先生,1963 年生,中共党员,工商管理硕士（MBA）,博士研究生在读。曾任山东金泰集团股份有限公司副总裁、天同证券有限责任公司业务总监、投资银行总部总经理,从事股份制改造及股票发行、购并重组工作多年,具有丰富的资本运作经验。2004 年至今担任公司督察长。

（四）本基金基金经理

现任基金经理:张旭伟,男,1975 年生,复旦大学经济学硕士,曾在招商证券股份有限公司从事投资管理、在东方证券有限公司从事固定收益投资工作,在东吴基金管理有限公司担任基金经理助理,2006 年 2 月加入万家基金管理有限公司,2006 年 8 月起担任本基金基金经理。

原基金经理肖侃宁,男,1973 年生,华中科技大学工商管理硕士,1995–2002 年任职于南方证券武汉管理总部,曾任固定收益小组投资负责人,投资理财部业务负责人;2002 年 4 月起先后担任万家 180 指数基金基金经理助理、万家保本增值基金基金经理,万家 180 指数基金基金经理等职。自本基金成立起担任本基金基金经理,2006 年 8 月离职。

（五）投资决策委员会成员

委员会主任:张健
委员:杨峰、潘江、张珣、路志刚、张旭伟
张健先生,现任万家基金管理有限公司代总经理。
杨峰先生,现任万家基金管理有限公司总经理助理
潘江先生,现任首席股票策略师,万家 180 基金基金经理
张珣先生,研究总监,万家公用事业基金基金经理
路志刚先生,万家保本增值基金、万家和谐增长基金基金经理
张旭伟先生,万家货币市场基金基金经理

（六）上述人员之间不存在近亲属关系。

第二部分　基金托管人

一、基本情况

1、名称:华夏银行股份有限公司（以下简称“华夏银行”）
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[2005]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:郑鹏
12、电话:010–85238418
13、传真:010–85238680

二、主要人员情况

华夏银行基金托管部内设市场综合室、交易管理室和稽察室 3 个职能处室,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,全部具有基金从业资格。

三、基金托管业务经营情况

华夏银行于 2005 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。截至 2006 年 12 月,已托管长城货币市场基金、国联安德盛精选股票基金、万家货币市场基金、益民红利成长混合型基金等 4 只开放式证券投资基金和 3 只其它受托资产产品,托管资产规模 37 亿元。

第三部分　相关服务机构

一、本基金销售机构

（一）直销机构

名称:万家基金管理有限公司
办公地址:上海市浦东新区福山路 450 号新天国际大厦 23 楼
法定代表人:柳亚男
总经理（代）:张健
联系人:娄明
电话:021–38619999
传真:021–38619888
客服电话:021–68644599
网址:www.wjasset.com

（二）代销机构

1、华夏银行股份有限公司
办公地址:北京市东城区建国门内大街 22 号
法定代表人:刘海燕
电话:?010–85238512,85238038
传真:010–85239626
联系人:吴霞蕊
客服电话:95577
网址:www.hxb.com.cn

2、深圳发展银行
地址: 深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦
法定代表人:法兰克纽曼
电话: 0755–82088888
传真: 0755–82080714
联系人: 周勤
客服电话: 95501
公司网址: www.sdb.com.cn

3、齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路 128 号
法定代表人:李玮
电话:0531–82024184、 0531–82024147
传真:0531–82024197
联系人:傅咏梅
网址:www.qlzq.com.cn

4、海通证券股份有限公司
地址:上海市淮海中路 98 号
法定代表人:王开国
电话:021 – 53594566
联系人:金芸
客服电话: 400–8888–001、021–962503
公司网址:www.htsec.com

5、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
电话:021–62580818–213
传真:021–62569400
联系人:芮敏祺
客服电话:4008 – 888 – 666
公司网址:http://www.gtja.com

6、中国银河证券有限责任公司
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 – 66568613,66568587
传真:010 – 66568532
联系人:郭京华
客服电话:010 – 68016655
公司网址:http://www.chinastock.com.cn

7、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:宫少林
电话:0755–82943511
传真:0755–82943237
联系人:黄健
客户服务热线:4008888111、0755–26951111
公司网址:http://www.newone.com.cn

8、东吴证券股份有限公司
注册地址:苏州市石路爱河桥路 28 号
法定代表人:吴永敏
电话:0512–65581136
传真:0512–65588021
联系人:方晓丹
客户服务电话:0512–96288
网址: http://www.dwzq.com.cn

9、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
电话:021–50367888
传真:021–50366868
联系人:吴宇
客户服务热线:021–962506
公司网站:http://www.dfzq.com.cn

10、东北证券有限责任公司
注册地址:长春市人民大街 138 – 1 号
办公地址:长春市自由大路 1138 号
法定代表人:李树
电话:（0431）96688 – 99　0431 – 5096733
传真:（0431）5680032
联系人:高新宇
公司网站: http://www.nesc.cn

11、广发证券股份有限公司
注册地址: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
公司网站:http://www.gf.com.cn

12、上海证券有限责任公司
注册地址:上海市九江路 111 号
法定代表人:蒋元真
联系电话:021–65076608*557
传真:021–65081069
联系人:刘永
客服电话:021–962518
公司网址:http://www.962518.com

13、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
公司网址:　http://www.xyzq.com.cn

14、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
办公地址:北京市朝阳门内大街 188 号
法定代表人:黎晓宏
电话:010–65183888–86080
传真:（010）65182261
联系人:魏明
公司网站: www.csc108.com

15、国信证券有限责任公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦
法人代表人:何如
电话:0755 – 82130833
传真:0755–82133302
联系人:林建闽
客户服务电话:800–810–8868
公司网址:www.guosen.com.cn

16、民生证券有限责任公司
地址: 北京市朝阳区朝阳门外大街 16 号中国人寿大厦 1901 室
法定代表人: 岳献春
联系电话: 010–85252605
传真电话: 010–85252655
联系人: 杨甦华
客服电话: 0371–67639999
公司网址: www.mszq.com

17、西南证券有限责任公司
注册地址:重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢 22–25 层
办公地址:重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢 22–25 层
法定代表人:蒋辉
电话:023–63786397
传真:023–63786312
联系人:杨卓颖
公司网址:www.swsc.com.cn

18、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
联系人:袁红彬
电 话:(025)84457777–721
邮政编码:210002
公司网址:www.htsc.com.cn

19、湘财证券有限责任公司
地址:上海市浦东银城东路 139 号华能联合大厦 5F
法定代表人:陈学荣
电话, 021–68634518
联系人:陈伟
客服电话:021–68865020 或当地营业部客服电话
公司网址:www.xcsc.com

（三）除上述销售机构外,投资者亦可通过“上证基金通”办理本基金的上海证券交易所场内申购与赎回(基金简称:万家货币;基金代码:519508),通过具有基金代销业务资格并开通“上证基金通”业务的上交所会员均可办理本基金的场内申购与赎回。

二、注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
注册地址:北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层
法定代表人:陈耀先
电话:010 – 58598888
传真:010 – 58598824
联系人:刘玉生

三、律师事务所

名称:上海源泰律师事务所
住所:上海浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 层
负责人:廖海
经办律师:廖海、田卫红
电话:021–51150298
联系人:廖海

四、会计师事务所

名称: 上海众华沪银会计师事务所
注册地址:上海浦东大道 288 号 7 楼
负责人: 林东模
联系电话:021 – 58799970
传真:　021 – 58872507
经办注册会计师:林东模 冯家俊

第四部分　基金的名称

本基金名称:万家货币市场证券投资基金

第五部分　基金的类型

本基金为契约型开放式货币市场基金

第六部分　基金的投资目标

在力保本金稳妥和基金资产高流动性的基础上, 为投资者提供资金的流动性储备,并追求高于业绩比较基准的稳定收益。

第七部分　基金的投资方向

本基金投资于下列法律法规允许的金融工具:

（一）现金;
（二）通知存款;
（三）1 年以内（含 1 年）的银行定期存款、大额存单;
（四）剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券;
（五）期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购;
（六）期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据;
（七）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。

对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

第八部分　基金的投资策略

（一）决策依据

1、国家有关法律法规、监管规定和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、投研团队提供的宏观经济分析报告、策略分析报告、固定收益类债券分析报告、定量分析报告、风险测算报告等。

（二）决策程序

1、资产配置计划的拟定

基金管理小组根据利率预测报告,于每月月末拟定下月的资产配置计划。

资产配置计划的拟定,是根据投研团队对未来宏观经济形势、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, 以及据此作出的对短期未来市场利率的预测报告,在此基础上基金管理小组制定资产配置计划。该计划包括大类资产配置、类属资产配置比例、期限结构配置、品种选择等。

如果基金管理小组认为影响利率的因素产生了重大变化,还可以临时提出新的资产配置计划,并报投资决策委员会审批。

2、资产配置计划的决策

投资决策委员会对基金管理小组提出的资产配置计划进行决策。

投资决策委员会的决策依据,是投研团队提供的各类研究分析报告、利率预测报告、基金管理小组提供的资产配置计划、监察稽核部金融工程小组对该计划进行风险测算后的分析报告、监察稽核部金融工程小组绩效评估人员对投资组合中类属配置、期限配置、品种选择、买卖成本等因素对整体业绩的贡献进行的归因分析报告。

3、资产配置计划的实施

资产配置计划的实施, 由基金管理小组在投资决策委员会通过的计划规定限制下,在投资决策委员会授权的范围内,根据市场的实际情况,构建具体的投资组合。

在计划实施过程中,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。

4、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。

5、组合监控与调整

基金管理小组与监察稽核部金融工程小组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基金份额持有人的赎回要求。

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。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下,有权根据环境变化和实际需要对上述投资决策程序作出调整。

（三）投资管理的方法

本基金在投资组合的管理中,将通过短期市场利率预期策略、类属资产配置策略和无风险套利操作策略构建投资组合,谋求在满足流动性要求、控制风险的前提下,实现基金收益的最大化。

1、短期市场利率预期策略

短期市场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。在科学、合理的短期利率预测的基础上决定本基金组合的平均剩余期限;同时,依据对未来短期利率水平的判断,合理调整组合的大类资产配置比例。

如果预期利率下降,将增加组合的平均剩余期限;反之,如果预期利率将上升,则缩短组合的平均剩余期限。

2、类属资产配置策略

在满足投资组合平均剩余期限的前提下,根据各类属资产的市场规模、收益性和流动性,确定同类资产中不同品种的配置比例,在保证投资组合高流动性和低风险的前提下尽可能提高组合收益率。

3、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。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,但在较长一段时间内市场中仍然会存在无风险套利机会,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,为基金份额持有人带来更大收益。

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。

（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。

第九部分　业绩比较基准

本基金业绩比较基准为一年期银行定期存款税后利率。

当法律法规发生变化或根据市场变化有更加适合的业绩比较基准时,基金管理人可对此业绩比较基准进行调整。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致,并按法律法规和基金合同的规定由基金管理人予以公告并报中国证监会备案。

第十部分　风险收益特征

本基金属于证券投资基金中低风险、高流动性的品种,其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。

第十一部分　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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2006 年 10 月 23 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 2006 年 9 月 30 日,本报告中所列财务数据未经审计。

（一）报告期末基金资产组合情况

资产组合	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
债券投资	401,050,381.50	54.12 %
买入返售证券	285,300,000.00	38.50 %
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	54,326,036.55	7.33 %
其中:定期存款	0.00	0.00 %
其他资产	384,511.78	0.05 %
合计:	741,060,929.83	100.00%

（二）报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	1,103,140,000.00	2.70 %
	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	0.00	0.00 %
	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:

本报告期内本基金未发生正回购的资金余额超过资产净值的 20%的情况。

（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	102
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	201
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	82

报告期内投资组合平均剩余期限违规超过 180 天的说明:

本期发生单日基金份额达基金净值 50%的巨额申购和赎回:2006 年 8 月 17 日, 发生巨额申购,应收申购款计入基金资产但并不计算在平均剩余期限中,导致当日投资组合平均剩余期限超过 180 天;2006 年 8 月 29 日,发生巨额赎回,基金无延期支付,优先卖出剩余期限短、流动性高的债券,导致单日投资组合平均剩余期限超过 180 天。

序号	发生日期	平均剩余期限（天）	原因	调整期
1	2006–8–29	201	巨额赎回	1天
2	2006–8–17	189	巨额申购	1天

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	50.04%	0.00%
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	4.16%	0.00%
2	30天(含)—60 天	0.00%	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	1.34%	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	22.78%	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)	25.89%	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		100.05%	0.00%

（四）报告期末债券投资组合

1、按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(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	0.00	0.00%
	其中:政策性金融债	0.00	0.00%
3	央行票据	247,481,048.51	33.43%
4	企业债券	153,569,332.99	20.74%
5	其他	0.00	0.00%
合计		401,050,381.50	54.17%
剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券		30,792,991.36	4.16%

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(张)		成本(元)	占基金资产净值比例(%)
		自有投资	买断式回购		
1	06央行票据 03	1,500,000.00	0.00	148,861,833.39	20.11%
2	06央行票据 30	500,000.00	0.00	49,286,741.90	6.66%
3	06央行票据 22	400,000.00	0.00	39,405,435.52	5.32%
4	06京投债	300,000.00	0.00	30,792,991.36	4.16%
5	06天医药 CP02	300,000.00	0.00	30,000,000.00	4.05%
6	06大众 CP01	300,000.00	0.00	29,524,538.81	3.99%
7	06南玻 CP01	200,000.00	0.00	19,811,078.88	2.68%
8	06长电 CP02	200,000.00	0.00	19,320,738.40	2.61%
9	06京能 CP01	150,000.00	0.00	14,475,540.78	1.96%
10	05央票 122	100,000.00	0.00	9,927,037.70	1.34%

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。

（五）“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	9
报告期内偏离度的最高值	0.0085%
报告期内偏离度的最低值	–0.3186%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1619%

（六）投资组合报告附注

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,按照票面利率或协议利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价和折价在其剩余期限内平均摊销。

本基金通过每日分红使基金份额净值维持在 1.00 元。

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超过当日基金资产净值 20%的情况

序号	发生日期	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占当日基金资产净值的比例
1	2006–7–18	20.58%
2	2006–7–20	35.76%
3	2006–7–24	36.74%
4	2006–7–25	37.37%
5	2006–7–26	26.23%
6	2006–7–27	26.55%
7	2006–7–28	20.99%

3、本报告期内,本基金的投资决策严格按照基金合同和招募说明书的规定进行,所投资品种无超出基金合同规定范围的情形,除本报告已说明的情形外,没有需要特别说明和补充的内容。

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,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

4、其他资产的构成

序号	其他资产	金额（元）
1	交易保证金	0.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收利息	384,511.78
4	应收申购款	0.00
5	其他应收款	0.00
6	待摊费用	0.00
7	其他	0.00
合 计		384,511.78

第十二部分　基金的业绩

基金业绩截止日为 2006 年 9 月 30 日。

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。

本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

阶段	基金净值收益率（1）	基金净值收益率标准差（2）	比较基准收益率（3）	比较基准收益率标准差（4）	(1)–(3)	(2)–(4)
2006年 3 季度	0.4525%	0.0034%	0.4791%	0.0003%	–0.0266%	0.0031%
2006.5.24 至 2006.9.30	0.6386%	0.0033%	0.6665%	0.0003%	–0.0279%	0.0030%

第十三部分　基金的费用与税收

一、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、基金销售服务费;
4、证券交易费用;
5、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费;
8、按照国家有关规定和基金合同约定可以在基金财产中列支的其它费用。

本基金不收取申购费用和赎回费用。

二、费用计提方法、计提标准和支付方式

（一）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,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前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

（二）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,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前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

（三）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前 2 个工作日内从基金财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,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

（四） 本部分第一条第 4 至 8 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。

三、不列入基金费用的项目

（一）本基金募集期间的律师费、会计师费和信息披露费用以及其他费用不得从基金财产中列支。

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

（三）其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

四、费率的调整

（一）基金管理人和基金托管人可以磋商酌情调低基金管理费、基金托管费和基金销售服务费,无须召开基金份额持有人大会。

（二）基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依据国家有关法律、法规的规定履行纳税义务。

第十四部分　对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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,对基金管理人于 2006 年 4 月 17 日刊登的本基金招募说明书内容进行了更新,并根据本基金管理人在本基金成立后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要更新内容如下:

1、在重要提示部分,明确了本基金的合同生效日期、更新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“三、基金管理人”部分,更新了基金管理人的办公地址、部分董事、高管人员、投资决策委员会成员和基金经理。

3、在“四、基金托管人”部分,更新了基金托管人的有关内容。

4、在“五、相关服务机构”部分,补充了本基金的新增代销机构以及有关通过“上证基金通”进行场内申购赎回部分的说明。

5、在“六、基金的募集”部分和“七、基金合同的生效”部分,增加了本基金首募起止日及首募份额、基金合同生效日期等数据,因本基金已成立,删去了有关募集方式、期限、场所,认购方式以及基金不能成立时的处理方式等内容。

6、在“八、申购与赎回”部分,补充了本基金开始办理申购赎回的日期、定期定额投资业务的办理日期和场所等内容。

7.在“九、基金的投资”部分补充了本基金最近一期（2006 年第三季度）投资组合报告内容。

8.在“十、基金的业绩”部分,增加了基金成立以来的投资业绩。

9.在“二十二、其他应披露事项”部分,补充了本基金自成立以来的公告事项。

万家基金管理有限公司
2007年 1 月 6 日

证券简称:湖北迈亚　　证券代码:000971　　编号:2006–17

湖北迈亚股份有限公司关于有限售条件流通股上市流通的提示性公告

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连带责任。

重要提示:

●本次有限售条件的流通股上市流通数量为 13164000 股

●本次有限售条件的流通股上市流通日为 2007 年 1 月 9 日

●本公告所提及的上市流通数量百分比以公司资本公积金转增股本后总股本 243100000 股为基数

一、通过股权分置改革方案的股东大会届次和日期

2005 年 12 月 23 日,公司 2005 年第一次临时股东大会审议通过了《湖北迈亚股份有限公司股权分置改革方案》,该方案于 2005 年 12 月 29 日实施（详见《湖北迈亚股份有限公司股份变动公告》,2005 年 12 月 29 日的《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》）。

二、股权分置改革中关于有限售条件的流通股上市流通的承诺

1、原非流通股股东分别承诺自非流通股获得上市流通权之日起,至少在 12 个月内不上市交易或者转让。

2、大股东仙桃毛纺集团作出如下特别承诺:仙桃毛纺集团持有的湖北迈亚股份自获得上市流通权之日起,至少在 12 个月内不上市交易或者转让,在获得上市流通权之日起 24 个月内不上市交易;上述 24 个月届满后 12 个月内, 仙桃毛纺集团通过证券交易所挂牌交易出售的湖北迈亚股份的数量不超过湖北迈亚股份总数的 5%,且出售价格不低于每股 4.42 元人民币。若有违反承诺的卖出交易,卖出资金将划归上市公司所有。

3、公司原非流通股股东湖北省纺织品公司存在着垫付对价的情况。湖北仙桃毛纺集团已经代表仙桃市彩凤实业公司、仙桃市财务开发公司三家垫付者与湖北省纺织品公司协商达成一致,同意湖北省纺织品公司先解除禁售,待股票流通后再协商解决垫付对价问题。

4、原非流通股股东承诺,在遵守前项承诺的前提下,通过证券交易所挂牌交易出售的股份数量达到公司股份总数的 1%的,自该事实发生之日起两个工作日内作出公告。

锁定期起始日至本公告刊登日,公司的总股本已发生变化,2006 年 7 月 7 日因公司资本公积金转增股本实施后,总股本变化为 24310 万股,详见 2006 年 7 月 8 日的《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》。

三、本次有限售条件的流通股情况

1、本次有限售条件的流通股上市数量为 13464000 股

2、本次有限售条件的流通股上市流通日为 2007 年 1 月 9 日

3、有限售条件的流通股上市清单（单位:股）

序号	股东名称	持有有限售条件的流通股股份数量	本次上市数量	剩余有限售的流通股股东数量
1	仙桃市彩凤实业公司	5301000	5301000	0
2	仙桃市财务开发公司	4743000	4743000	0
3	湖北省纺织品公司	3120000	3120000	0

特此公告。

湖北迈亚股份有限公司
董 事 会
2007年 1 月 5 日

股票代码:600110　　股票简称:中科英华　　编号:临 2007–001

中科英华高技术股份有限公司关于为控股子公司提供担保公告

重要内容提示:

●被担保人:长春热缩材料有限公司

●本次为其担保金额:3,000 万人民币; 累计为其担保金额:3,000 万人民币

●对外担保累计数量: 12,900 万元人民币（本次贷款为续贷,因此公司对外担保总额未发生变化）

●本次担保无反担保

●对外担保逾期的累计数量:无

一、担保情况概述

近日,中科英华高技术股份有限公司（简称中科英华）与中信银行沈阳分行签订了贷款担保合同,为控股子公司长春热缩材料有限公司（本公司持有其 99%的股份） 向中信银行沈阳分行申请的一年期流动资金借款 3,000 万元（续贷）提供担保。该笔贷款已于 2006 年 12 月 30 日放款,担保合同也于该日生效。

中科英华于 2006 年 8 月 20 日召开的第五董事会第一次董事会会议审议通过了担保授权事项 （详见 2006 年 8 月 22 日公司临 2006–038 公告）。本次担保无须经股东大会批准。

二、被担保人基本情况

长春热缩材料有限公司（我公司持有其 99%的股份）,注册资本:5000 万元,注册地点长春市高新技术开发区火炬路 286 号,经营范围:热缩材料等高技术、新材料、新产品开发、生产、销售、安装、施工及技术咨询、技术服务（涉及前置审批的在审批后方可生产、经营）;本企业生产、科研所需的原辅材料、仪器仪表、机械设备、零配件经营。

截止 2005 年 12 月 31 日, 该公司总资产 14,656.82 万元, 净资产 8,055.76 万元,2005 年实现销售收入 5,522.73 万元, 净利润为 1,589.73 万元（已经审计）,资产负债率未超过 70%。

三、担保协议主要内容

本次为控股子公司向中信银行沈阳分行申请的流动资金借款 3,000 万元（续贷）提供担保,期限为一年。担保方式为连带责任担保。

四、董事会意见

中科英华于 2006 年 8 月 20 日召开了第五届董事会第一次董事会会议,董事会授权公司总裁在符合一定条件下, 对股份公司为控股子公司提供担保的事项行使审批权。本次担保事宜符合授权条件。

五、对外担保情况

截止目前, 我公司累计对外担保额为:12,900 万元人民币,（本次货款为续贷）,占经审计的公司最近一期净资产的 17.50％。

六、备查文件目录

1、担保协议

中科英华高技术股份有限公司董事会
2007年 1 月 5 日