

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】52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，投资人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。

本摘要根据本基金的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，应仔细阅读基金合同。

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11月30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）。

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：0755-83662688
- 8、传真：0755-83662600
- 9、联系人：王大治
- 10、客户服务中心电话：400-8868-666、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%

13、本基金管理人长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2001]65号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、西北证券有限责任公司、中原信托投资有限公司以及北方国际信托投资股份有限公司共同发起设立，于2001年12月27日正式开业，注册资本为1亿元人民币。

公司在董事会下设了风险控制与审计委员会、资格审查与薪酬委员会、公司内投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作，确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制与审计委员会负责公司内部控制的监督、审查和公司的审计工作。资格审查与薪酬委员会负责公司董事、监事、高级管理人员及相关人员的资格审查、董事、监事的提名和公司薪酬体系审定，对公司高级管理人员及其他相关人员进行考核、评价及奖惩。

公司下设十一个部门，分别是：基金管理部、市场开发部、固定收益部、创新业务部、北京管理部、上海管理部、深圳管理部、监察稽核部、运行保障部、信息技术部、综合管理部。公司现有员工62人，62%以上具有研究生以上学历，大部分员工具有理工科及经济类专业背景，主要业务人员均具有5年以上证券或基金从业经历。所有人员在最近三年内均没有受到所在单位或有关管理部门的处罚。

公司已经建立健全了内部控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、财务管理、人事管理制度、风险会计制度、信息披露制度等公司管理制度。

（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海口助理。

龙熙霖先生，硕士研究生毕业，经济师。历任长城证券有限责任公司海口营业部总经理助理、总经理，公司经纪业务管理总部副总经理，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。

吕莉女士，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、监事长。

贺岩先生，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总经理，北方研究所总经理，资产经营部副总经理，东方证券股份有限公司办公室副主任兼战略办主任，总裁助理兼人力资源管理部总经理、总裁助理兼资产管理业务总部总经理，现任东方证券股份有限公司总裁助理兼并购业务总部总经理。

崔泽军先生，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年毕业于天津理工学院管理信息系统专业，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长、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。

任俊杰先生，大学本科毕业。历任中国人民银行深圳分行处长、深圳金融同业业协会首任秘书长、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，现任深圳怀新企业投资顾问有限公司副总经理。

马原女士，中共党员，研究生毕业。历任最高人民法院法官、副庭长、庭长、副院长，中国女法官协会会长，人民大学兼职教授。

麦建光先生，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，现任华创创业投资管理（深圳）有限公司董事总经理。

刘杉，男，1964年生，经济学博士。曾任中华工商时报社海外编辑、副主任、中华工商时报社经济新闻部主任；中国人民银行深圳分行金融早报社总编辑。现任教于中华工商时报社，曾任总编助理，现任副总编辑，兼任北京工商大学教授、中国人民大学信托与基金研究所研究员。

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投资管理部经理，并担任长城基金管理有限公司监事会监事长。

杨传女士，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交易营业部主任，宁夏证券登记公司经理，宁夏证券财务总监兼财务部经理，西北证券有限责任公司总裁助理。

罗世蓉女士，大学本科毕业，会计师。历任四川轻工厅盐业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经理，长城证券有限责任公司成都营业部副经理兼财务部经理、深圳一部副经理兼财务部经理、公司审计部总经理、公司审计部副经理。现任长城证券有限责任公司财务部副经理。

张建辉先生，中共党员，硕士研究生毕业。历任上海浦东发展银行信托证券发行部科员，东方证券股份有限公司经济业务管理部辽宁管理总部副经理、总经理，现任东方证券股份有限公司资产管理部总经理。

田德良，男，1966年生，2005年毕业于中央广播电视大学会计学专业，经济师。曾任教于中国建设银行天津地区区分行，任经理助理、事后总稽核。现任教于北方国际信托投资股份有限公司，曾任会计部经理助理、会计部副经理、会计部经理、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，现任自营业务总部项目经理。

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总经理、资产管理部总经理，长城基金管理有限公司董事会秘书、运行保障部经理、综合管理部经理，长城基金管理有限公司督察长。

（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。

李骏先生，博士研究生毕业。曾任教于中国地质大学经管学院，历任中国人民大学湖北省分行科室负责人，君安证券有限公司研究部宏观室负责人，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总经理，现任长城基金管理有限公司副总经理兼运行保障部总经理。

汪钦先生，中共党员，博士研究生毕业。曾就职于中国人民大学银行河南省分行教育处，海南港澳国际信托投资公司证券部，历任三正东方实业股份有限公司副总经理，国信证券有限责任公司研究所所长，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总经理。

韩浩先生，硕士研究生毕业。历任长城证券有限责任公司资产管理部总经理，长城基金管理有限公司投资总监兼投资管理部副经理、“久嘉证券投资基金”基金经理、总经理助理、“长城久恒平衡型证券投资基金”基金经理，现任长城基金管理有限公司副总经理、投资总监兼基金管理部经理。

2、本基金基金经理简历

刘海先生，生于1978年，1999年毕业于清华大学经济管理学院国际金融与财务专业，经济学学士。曾就职于深圳发展银行总行，任职债券交易员。2005年6月进入长城基金管理有限公司，曾任“长城货币市场证券投资基金”基金助理，自2006年3月9日起任“长城货币市场证券投资基金”基金经理。

“长城货币市场证券投资基金”历任基金经理如下：黄瑞庆先生自2005年5月30日至2006年9月24日任基金经理，王定元先生自2006年9月25日至2006年3月8日任基金经理。

3、本公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

关林戈先生，投资决策委员会主任，公司董事、总经理。韩浩先生，投资决策委员会执行委员，公司副总经理、投资总监兼基金管理部经理。

汪钦先生，投资决策委员会委员，公司副总经理。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称：华夏银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦
办公地址：北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦

法定代表人：刘海燕
组织形式：股份有限公司
设立日期：1992年10月14日
电话：010-85238418
传真：010-85236890

联系人：郑刚
客户服务中心电话：95577
注册资本：42亿元人民币

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：0755-83662688
传真：0755-83662600

2、代销机构

（1）华夏银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区西便门大街111号
法定代表人：刘海燕
电话：010-85238512
传真：010-85239626
联系人：吴晨霞

（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）83195834、82090060
传真：（0755）83195049、83195050
联系人：朱小晶、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：郭树清
服务热线：95533
网址：www.ccb.cn

（4）华夏证券股份有限公司
注册地址：北京市新中街68号
办公地址：北京市朝阳区内大街188号
法定代表人：秦晓宏
电话：010-65186758
联系人：匡敏

（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：021-53830794
联系人：高莉

（6）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
联系人：冯敏

（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：021-50368688
客户服务热线：021-962506
网站：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.xyqz.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：魏云鹏
联系人：高峰
电话：0755-83516094
传真：0755-83516199
客户服务热线：0755-82288988
长城证券网站：www.cc168.com.cn

（10）中国银河证券有限责任公司
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：朱利
联系人：郭京华
客户服务热线：010-68016655

（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：宫少林
电话：0755-82943541
传真：0755-82943237
联系人：黄健
客户服务热线：4008881111、0755-26951111

（12）平安证券有限责任公司
办公地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三樓
法定代表人：李荣
联系人：任磊、苗永华
电话：0755-82422251、82440136
传真：0755-82433794、82400862

全国统一客户服务热线：95511
（13）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：025-84457777-882、721
联系人：张雪梅、袁红彬
客户咨询电话：025-84579897

（14）申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
（15）渤海证券有限责任公司
客户服务热线：022-28455588
公司网站：ewwww.com.cn

（16）江南证券有限责任公司
客户服务热线：0755-83366612
公司网站：www.scstock.com
（17）华西证券有限责任公司
客户服务热线：4008-888-818
公司网站：www.hx168.com.cn

（18）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：管荣升
联系电话：0791-6289771
传真电话：0791-6289395
联系人：万齐志
公司网址：www.gsstock.com

（19）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：何如
联系人：林建闽

电话：0755-82133066
传真：0755-82133302
客户服务电话：800-810-8868
公司网址：www.guosen.com.cn

基金管理人可以根据情况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）基金注册登记人
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：0755-83662688
传真：0755-83662600
联系人：杜京泉

客户服务中心电话：400-8868-666、0755-83680399
（三）律师事务所与经办律师
律师事务所名称：北京市光华律师事务所
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：0755-22163307
传真：0755-22163380
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：李秉心
经办注册会计师：李秉心
电话：0755-82900952
传真：0755-82900965

四、基金名称：长城货币市场证券投资基金
本基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标
在本金安全和足够流动性的前提下，寻求货币资产稳定的收益。

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限的债券、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其他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
根据宏观经济研究（利率水平、CPI指标、GDP增长率、货币供应量、可比币种利率水平、主要币种汇率水平等）、分析市场趋势和政府政策变化，决定基金投资组合的平均持仓期限。

根据组合的信用评级及担保状况，决定组合的信用等级。
根据当前市场的实际情况以及相关法律法规的规定，长城货币市场基金的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、现金类资产：0—70%。

二、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、交易所等）、收益率水平（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、类别资产收益率差异等）、市场偏好、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。

三、三级资产配置策略
根据明细资产的剩余期限、资信等级、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数量。

九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为：税后一年期银行定期存款利率。
在合理的市场化利率基准推出的情况下，本基金管理人可根据投资目标、投资方向和投资策略，确定变更业绩比较基准，并提前公告。

十、基金的风险收益特征
本基金在证券投资基金中属于高流动性、低风险品种，其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。

十一、投资组合报告
本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。

本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20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。

1、报告期末基金资产组合

资产组合	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
债券投资	617,595,011.00	51.54
买入返售债券	367,800,000.00	30.70
其中：买断式回购的买入返售债券	0.00	0.00
银行存款和清算备付金合计	205,892,963.40	17.18
其他资产	6,950,877.12	0.58
合计	1,198,238,551.52	100.00
银行存款和清算备付金合计中包括200,000,000.00元商业银行存款投资。		

2、报告期末债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	其中：期内债券正回购余额	6,290,320,000.00	5.48
	其中：买断式回购融资	0.00	0.00
2	其中：买断式债券正回购余额	156,000,000.00	15.00
	其中：买断式回购融资	0.00	0.00

报告期内本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明：

序号	发生日期	融资金额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2006-7-24	21.03	市场波动	一个交易日
2	2006-7-27	20.69	市场波动	一个交易日

3、投资期末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	92
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	165
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	65

在本报告期内，本基金投资组合平均剩余期限未发生违规超过180天的情况。

4、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	57.46	15.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.26	0.00
2	30天—60天	4.79	0.00
3	60天—90天	8.42	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	8.42	0.00
4	90天—180天	8.65	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.89	0.00
5	180天—397天(含)	35.21	0.00
	合计	114.53	15.00

5、报告期末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	40,498,303.30	3.89
	其中：政策性金融债	0.00	0.00
3	央行票据	261,970,429.61	25.18
4	企业债券	315,126,278.09	30.29
5	其他	0.00	0.00
	合计	617,595,011.00	59.37
	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	451,911,523.04	14.60

6、报告期末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)	占基金资产净值的比例(%)
1	06央行票据 CP01	1,000,000	100,537,746.03	9.66
2	06央行票据 33	1,000,000	98,748,806.34	9.49
3	06央行票据 28	1,000,000	98,443,130.53	9.46
4	05中债信1	870,000	87,635,833.06	8.42
5	05央票 111	500,000	49,844,507.00	4.79
6	05央行 02 浮	400,000	40,498,303.30	3.89
7	06国债 276	230,000	22,777,386.68	2.29
8	06国债 CP01	200,000	19,784,965.92	1.90
9	06铁四局 CP01	200,000	19,672,273.86	1.89
10	06国债 CP01	200,000	19,652,025.27	1.89

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	9
报告期内偏离度的最高值	0.2793
报告期内偏离度的最低值	-0.4105
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1816

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，按照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的净值始终维持在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）本报告期内需说明的证券投资决策程序
本基金的投资管理采用团队模式和基金经理负责制相结合的方式。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，具有投研交易一体化的便利，并充分利用透过金融工程平台从事定量分析这一独特优势，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遵照执行；

③ 固定收益研究员及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撑，并协助基金经理拟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比例的合规性进行风险监控；

④ 监察稽核部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	6,700,877.12
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	6,950,877.12

十二、基金的业绩
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。

本基金合同生效于2006年5月30日。本基金合同生效以来到本报告期末及与同期业绩比较基准的比较如下表所示（数据截止日为2006年9月30日）：

<