天治天得利货币市场基金更新的招募说明书(摘要)

(2007 年 2 月)

基金管理人:天治基金管理有限公司　基金托管人:中国民生银行股份有限公司

重要提示

基金合同生效日期:2006 年 7 月 5 日

投资有风险,投资人申购基金份额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。

本摘要依据基金合同和招募说明书编写,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,应详细查阅基金合同。

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,基金管理人不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本次更新的招募说明书已经本基金托管人中国民生银行股份有限公司复核,除特别说明外,本次更新的招募说明书所载内容截止日为 2007 年 1 月 5 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2006 年 12 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:天治基金管理有限公司

2、住所:上海市延平路 83 号 501–503 室

3、成立日期:2003 年 5 月 27 日

4、法定代表人:赵玉彪

5、办公地址:上海市复兴西路 159 号

6、电话:021–64371155

7、联系人:张丽红

8、注册资本:1 亿元人民币

9、股权结构:吉林省信托投资有限责任公司出资人民币 4000 万,占注册资本的 40%,吉林市国有资产经营有限责任公司出资人民币 2000 万,占注册资本的 20%,中国吉林森林工业(集团)总公司出资人民币 2000 万,占注册资本的 20%,吉林省汉维实业有限公司出资人民币 2000 万,占注册资本的 20%。

10、简要情况介绍:天治基金公司下设投资管理部、研究发展部、定量研究部、市场营销部、机构理财部、基金清算部、信息技术部、监察稽核部和综合管理部共九个职能部门以及北京分公司。目前公司共管理四只开放式基金,分别是天治财富增长证券投资基金、天治品质优选混合型证券投资基金、天治核心成长股票型证券投资基金和本基金。天治财富增长基金于 2004 年 6 月 25 日募集结束,2004 年 6 月 29 日基金合同生效,托管行为上海浦东发展银行。天治品质优选基金于 2005 年 1 月 7 日募集结束,2005 年 1 月 12 日基金合同生效,托管行为中国民生银行。天治核心成长基金于 2006 年 1 月 12 日募集结束,2006 年 1 月 20 日基金合同生效,托管行为交通银行。本基金于 2006 年 6 月 30 日募集结束,2006 年 7 月 5 日基金合同生效,托管行为中国民生银行。

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理层成员

赵玉彪先生:董事长,在读研究生,历任吉林省信托投资公司上海证券业务部交易部经理、吉林省信托投资公司上海洪山路证券营业部经理兼驻上海证券交易所出市代表、上海金路达投资管理有限公司总经理,现任天治基金管理有限公司董事长。

张兴波先生:董事,硕士,高级会计师,历任吉林省食品公司财会科长、吉林省财政厅商贸处副处长和基建处处长、吉林省信托投资公司常务副总经理、吉林省信托投资公司总经理,现任吉林省信托投资有限责任公司董事长兼党委书记。

祖煜先生:董事,总经理,硕士,历任原上海万国证券公司国际业务部高级项目经理、安徽省证券公司国际业务部负责人、广发证券股份有限公司国际业务部副总经理、广发中外合资基金筹备负责人、天治基金管理有限公司副总经理,现任天治基金管理有限公司总经理。

肖景瑞先生:董事,澳门工业大学 MBA 在读,高级工程师,1980 年至 1996 年在部队服役,后任中国建设银行吉林省分行营业部办公室主任,现任吉林省汉维实业有限公司副总经理。

陶武平先生:独立董事,硕士,历任上海市司法学校教务科长、上海市联合律师事务所律师、上海浦东律师事务所律师,现任上海申达律师事务所主任。

张屹山先生:独立董事,学士,历任吉林大学数学系助教、吉林大学经济管理学院讲师、副教授,现任吉林大学商学院教授、商学院院长。

郭洪林先生:独立董事,博士,曾任中国人民大学经济学院助教、讲师,现任中国人民大学经济学院副教授兼中国人民大学人事处处长。

侯丹宇女士:监事长,学士,历任吉林省信托投资公司上海证券业务部营业部经理、东北证券有限责任公司上海洪山路证券营业部总经理、天治基金管理有限公司督察长、副总经理,现任天治基金管理有限公司监事长。

姜佐成先生:监事,硕士,高级会计师,历任吉林省财政学校教师、吉林省信托投资公司计划财务处副处长、处长、吉林省信托投资公司总会计师兼计划财务部经理,现任吉林省信托投资有限责任公司副总经理。

黄薇女士:监事,学士,曾在广发证券上海石泉路营业部、斯米克微电子技术有限公司、上海则天灵投资管理有限公司、天治基金管理有限公司任职。

刘伟先生:督察长,学士,历任吉林省信托投资有限责任公司星火项目处项目负责人、自营基金业务部副经理、上海全路达创业投资公司董事长,现任天治基金管理有限公司督察长。

2、本基金基金经理

史向明女士,复旦大学概率论与数理统计专业硕士,证券投资研究、基金管理从业经验 6 年。曾任职于银河证券上海总部研究中心、天治基金管理有限公司研究发展部、投资管理部,期间从事固定收益研究与投资工作。自 2006 年 7 月 5 日(基金合同生效日)至今任本基金基金经理。

3、投资决策委员会成员

总经理祖煜先生、投资管理部副总监兼天治财富增长证券投资基金基金经理张岗先生、研究发展部副总监兼天治核心成长股票型证券投资基金基金经理吴鹏先生、天治品质优选混合型证券投资基金基金经理谢京先生、天治核心成长股票型证券投资基金基金经理余明元先生。

4、上述人员之间无亲属关系。

二、基金托管人

名称:中国民生银行股份有限公司

住所: 北京市东城区正义路 4 号

成立日期: 1996 年 2 月 7 日

注册资本: 2,586,721,300 元

法定代表人: 经叔平

办公地址:北京市西城区复兴门内大街 2 号

电话:010–58560666

联系人:辛洁

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

天治基金管理有限公司

办公地址:上海市徐汇区复兴西路 159 号

法定代表人:赵玉彪

直销中心电话:021–64718300

直销中心传真:021–64375409

联系人:邓智生

2、代销机构

(1)中国民生银行股份有限公司

住所: 北京市东城区正义路 4 号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人: 经叔平

电话:010–58560758,010–58560666–8988

传真:010–58560794

联系人:吴杰

客户服务电话:95568

(2)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

联系人:郭京华

客户服务电话:8008201868

网址:www.chinastock.com.cn

(3)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:上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人:祝幼一

联系人:芮敏祺

客户服务电话:4008888666

网址: www.gtja.com

(4)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

联系人:金芸

客户服务电话:021–962503

网址:www.htsec.com

(5)中信建投证券有限责任公司

住所:北京市新中街 68 号

办公地址:北京朝内大街 188 号

法定代表人:黎晓宏

联系人:权唐

客户服务电话:4008888108

网址:www.csc108.com

(6)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

电话:021–54033888

传真:021–54035333

联系人:王序微

客户服务电话:021–962505

网址:www.sw2000.com.cn

(7)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 40—45 层

办公地址: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

客户服务电话:4008888111、0755–26951111

网址:www.newone.com.cn

(8)华泰证券有限责任公司

住所:江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址: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:张雪瑾、袁红彬

客户服务电话:4008888168

网址:www.htsc.com.cn

(9)兴业证券股份有限公司

住所:福建省福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址:福建省福州市湖东路 99 号标力大厦

法定代表人:兰荣

联系人:缪白

客户服务电话:4008888123

网址:www.xyzq.com.cn

(10)东方证券股份有限公司

住所:上海市浦东大道 720 号 20 楼

办公地址:上海市浦东大道 720 号 20 楼

法定代表人:王益民

联系人:盛云

客户服务电话:021–962506

网址:www.dfzq.com.cn

(11)金元证券有限责任公司

住所:深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 楼

办公地址:深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 楼

法定代表人:郑辉

电话:0755–83025695

联系人:金春

网址:www.jyzq.cn

(12)齐鲁证券有限公司

住所:山东省济南市经十路 128 号

办公地址:山东省济南市经十路 128 号

法定代表人:李玮

电话:0531–82024184

传真:0531–82024197

联系人:傅咏梅

客户服务电话:0531–82024184

网址:www.qlzq.com.cn

(13)长江证券有限责任公司

住所:武汉新华下路特 8 号长江证券大厦

办公地址:武汉新华下路特 8 号长江证券大厦

法人代表:明云成

电话:027–65799560

传真:027–85481532

联系人:毕艇

客户服务电话:4008888999

网址:www.cz318.com.cn

(14)东北证券有限责任公司

住所:吉林省长春市人民大街 138–1 号

办公地址:吉林省长春市人民大街 138–1 号

法定代表人:李树

联系人:高新宇

客户服务电话:0431–96688

网址:www.nesc.cn

(15)第一创业证券有限责任公司

住所:深圳罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层

办公地址:深圳罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层

法定代表人:刘学民

联系人:梁少珍

电话:0755–25832493

传真:0775–25831718

网址:www.firstcapital.com

(16)山西证券有限责任公司

住所:山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心

办公地址:山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心

法定代表人:吴晋安

联系人:邹连星 刘文康

客户服务电话:0351–8686868

网址:www.i618.com.cn

(二)注册登记机构

名称:天治基金管理有限公司

办公地址:上海市徐汇区复兴西路 159 号

法定代表人:赵玉彪

电话:021–64371155

传真:021–64715377

联系人:张佳珏

(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:安永大华会计师事务所有限责任公司

住所:上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 45 楼

办公地址:上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 23 楼

法定代表人:沈钰文

经办注册会计师:徐艳、蒋燕华

电话:021–24052000

传真:021–54075507

联系人:蒋燕华

四、基金的名称

天治天得利货币市场基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

在充分重视本金安全的前提下,确保基金资产的高流动性,追求稳健的当期收益。

七、基金的投资方向

本基金投资于国内依法发行、高信用等级、具有一定剩余期限限制的债券、央行票据、债券回购、银行存款以及中国证监会、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。具体包括:

1、现金;

2、通知存款;

3、1 年以内(含 1 年)的银行定期存款、大额存单;

4、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券;

5、期限在 1 年以内(含 1 年)的债券回购;

6、期限在 1 年以内(含 1 年)的中央银行票据;

7、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。

八、基金的投资策略

本基金以短期金融工具为投资对象,依据宏观经济、货币政策、资金供求决定的市场利率变动预期,综合考虑投资对象的收益性、流动性和风险性,进行自上而下与自下而上相结合的积极投资组合管理,保障本金安全性和资产流动性,追求稳健的当期收益(投资流程图见图 1)。基金的总体投资策略包括以下层面:

1、基金资产配置

(1)市场利率预期

本基金依据与利率变化相关性较强的经济增长、外贸、投资、消费、物价指数等指标进行宏观经济周期及货币政策目标研究。此外还研究以下影响货币市场资金供求关系的事项,预期市场利率的变动方向:

①央行公开市场操作的方向、强度、频率及中标利率水平变化;

②货币供应量、货币乘数变化,商业银行存贷款变化、超额备付率变化;

③资金年末、年初偏紧、年中相对宽松的一般季节性变化;

④新股发行、新债缴款、股市爆发性行情引起的短期资金供求关系变化;

⑤利率市场化改革的推进进程。

(2)组合剩余期限管理

在市场利率预期的基础上,预期市场利率上升时,缩短投资组合的平均剩余期限,预期市场利率下降时,延长投资组合的平均剩余期限。根据货币市场收益率曲线形状的变化预期,采用总收益分析法以子弹组合、杠铃组合或梯形组合安排投资组合的现金流分布。

(3)收益率利差分析

正确评估各投资品种的流动性利差,信用利差,依据市场供求关系及市场环境变化引发的利差变化趋势分析,确定国债、金融债、央行票据、企业债、企业短期融资券以及债券回购间的类属配置。

基金主要投资对象国债、金融债、央行票据均属高信用等级的债券,信用利差相对稳定且易于评估。企业债信用利差通过产业分析、企业分析、财务分析、资金投向分析和债券保护条款分析确定。

流动性利差主要通过比较类别资产平均收益率、收益率波动度、二级市场存量、月均交易量、月均交易量变动等指标加以判断。

2、基金资产选择

在资产配置比例基本确定的基础上,本基金选择剩余期限和信用等级符合标准、流动性高、价值被低估的投资品种。其中,资产流动性通过二级市场存量、日均交易量、上市时间等指标加以判断,资产价值通过利率期限结构、持有期总收益等指标评价。

3、为了在低风险基础上提高基金的收益和保持投资组合充分的流动性,本基金投资管理中还贯穿使用以下策略:

(1)无风险套利策略

无风险套利策略主要包括跨市场套利与跨品种套利策略。

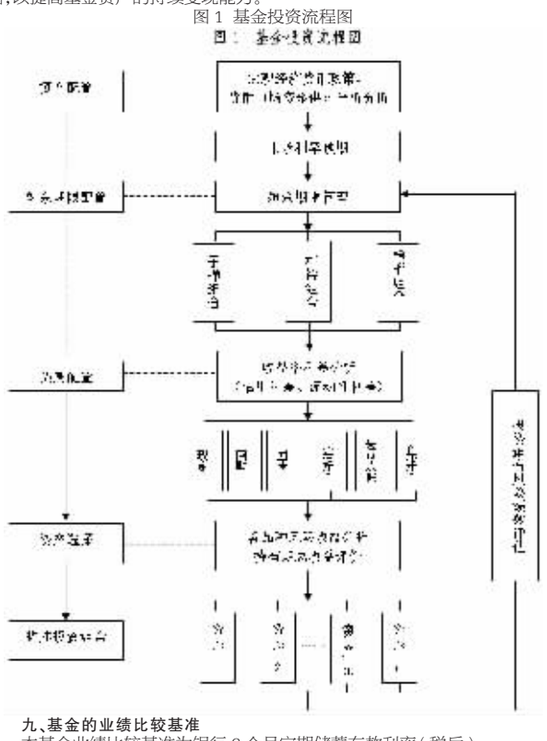
跨市场套利针对各细分投资市场因投资主体、交易方式等不同导致的资产定价偏离,进行套利操作,在低风险的基础上获得超额收益。

跨品种套利针对品种间因流动性、税收等不同导致的资产定价偏离,进行套利操作,在低风险的基础上获得超额收益。

(2)现金流预算管理策略

结合市场利率预期及未来现金流供给与需求的预测,在投资组合的构建中,采用合理的期限和权重配置对现金流进行预算管理,保持投资组合的高流动性。对回购、央行票据等部分投资品种,将依据其市场特性,采用滚动投资策略,以提高基金资产的持续变现能力。

图 1 基金投资流程图



九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为银行 6 个月定期储蓄存款利率(税后)。

十、基金的风险收益特征

货币市场基金投资于短期金融工具。由于短期国债、金融债、央行票据等主要投资品种信用等级高,利率风险小,因而本基金安全性高,流动性强,收益稳健。货币市场基金是证券投资基金中风险较低的品种,长期看风险和预期收益低于股票基金、混合基金、债券基金。

十一、基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据基金合同规定,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、误导性陈述或重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自本基金 2006 年第 4 季度报告。所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合

资产项目	金额(元)	占总资产比例(%)
债券投资	118,556,098.24	32.27%
买入返售证券	112,100,000.00	30.51%
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	136,434,131.68	37.14%
其中:定期存款	0.00	0.00%
其他资产	309,776.41	0.08%
合计	367,400,006.33	100.00%

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	434,700,000.00	1.12%
	其中:买断式回购融入的资金	0.00	0.00%
2	报告期末债券回购融资余额	0.00	0.00%
	其中:买断式回购融入的资金	0.00	0.00%

注: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。本报告期本基金无债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的情况。

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	60
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	60

注:报告期内投资组合平均剩余期限没有超过 180 天的情况。

(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	94.01%	34.27%
2	30天(含)–60 天	11.38%	0.00%
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	10.87%	0.00%
3	60天(含)–90 天	0.00%	0.00%
4	90天(含)–180 天	19.97%	0.00%
5	180天(含)–397 天(含)	8.88%	0.00%
合计		134.24%	34.27%

4、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	69,317,888.83	25.35%
	其中:政策性金融债	69,317,888.83	25.35%
3	央行票据	0.00	0.00%
4	企业债券	49,238,209.41	18.01%
5	其他	0.00	0.00%
合计		118,556,098.24	43.36%
剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券		29,725,187.52	10.87%

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(元)	占基金资产净值的比例(%)
		自有投资	买断式回购		
1	06国开 27	400,000		39,592,701.31	14.48%
2	06国开 08	300,000		29,725,187.52	10.87%
3	06大唐 CP01	150,000		15,004,861.19	5.49%
4	06长电 CP02	150,000		14,577,269.10	5.33%
5	06津高速 CP01	100,000		9,943,489.36	3.64%
6	06淮南矿 CP01	100,000		9,712,589.76	3.55%

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	偏离程度
报告期内偏离度的绝对值在 0.25%(含)–0.5%间的次数	4
报告期内偏离度的最高值	0.2609%
报告期内偏离度的最低值	0.0829%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1939%

(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。

2、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的 20%的情况。

3、本报告期内需说明的证券投资决策程序。报告期内,基金管理人的投资决策严格按照招募说明书和基金合同进行,所有投资品种均没有超出债券池的范围,没有需要特别说明和补充的部分。

4、本报告期内没有投资资产支持证券。

5、其他资产的构成

项目	金额(元)
应收利息	309,776.41
合计	309,776.41

十二、基金的业绩

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。

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率比较表:

阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1)–(3)	(2)–(4)
2006年7月5日–2006年12月31日	0.9511%	0.0011%	0.8699%	0.0002%	0.0812%	0.0009%

十三、费用概览

1、与基金运作有关的费用

(1)基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.33%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H = E × 0.33% ÷ 当年天数

H 为每日计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费在基金合同生效后每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,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、公休假等,支付日期顺延。

(2)基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

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

基金托管费在基金合同生效后每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

(3)基金销售服务费

基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用,由基金管理人支配使用。本基金的销售服务费按基金资产净值的 0.25%年费率计算,销售服务费的计算方法如下:

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

基金销售服务费在基金合同生效后每日计提,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款指令,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、公休假等,支付日期顺延。

若遇不可抗力致使无法按时支付上述基金管理费、基金托管费、基金销售服务费的,顺延至最近可支付日支付。

证券交易费用、基金合同生效后的基金信息披露费用、基金合同生效后的会计师费和律师费、基金份额持有人大会费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,从基金财产中支付。

2、与基金销售有关的费用

(1)申购费

本基金的申购费率为零。

(2)赎回费

本基金的赎回费率为零。

十四、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方法》、《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 2006 年 5 月 26 日公布的《天治天得利货币市场基金招募说明书》进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在“基金管理人”中,对基金管理人的董事、监事及投资决策委员会成员进行了更新,增加了基金经理管理本基金时间的有关内容。

2、在“基金托管人”中,对基金托管人托管基金的只数及规模等信息进行了更新。

3、在“相关服务机构”中,更新了直销机构和代销机构的相关信息。

4、在“基金的募集”中,删除了与首次募集相关的内容,列明基金募集的依据及募集的基本情况。

5、在“基金合同的生效”中,删除了基金备案的条件和基金募集未达到法定要求的处理方式等已不适用的内容,增加了基金合同生效的日期。

6、在“基金份额的申购与赎回”中,增加了本基金开放申购和赎回业务的日期,根据公告内容更新了交易账户最低持有限额,增加了基金转换的有关内容。

7、在“基金的投资”中,增加了本基金最近一期投资组合报告的内容。

8、增加了“基金的业绩”部分,列示了基金合同生效以来的投资业绩。

9、在“对基金份额持有人的服务”中,更新了相关服务内容。

10、增加了“其他应披露事项”部分,列出了自 2006 年 7 月 5 日至 2007 年 1 月 4 日期间与本基金和本基金管理人有关的公告。

天治基金管理有限公司

2007 年 2 月 16 日

关于华宝兴业现金宝货币市场基金收益结转的公告

《华宝兴业现金宝货币市场基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2005 年 3 月 31 日生效。根据基金合同、《华宝兴业现金宝货币市场基金招募说明书》的约定,本基金管理人定于 2007 年 2 月 15 日对华宝兴业现金宝货币市场基金(以下简称“本基金”)自 2007 年 1 月 15 日起的收益集中结转为基金份额,现将有关具体事宜公告如下:

一、收益结转说明

本基金管理人定于 2007 年 2 月 15 日将每位投资人所拥有的累计收益进行集中结转,按 1 元面值直接结转为基金份额,不进行现金支付。

投资人的累计收益计算公式如下:

投资人累计收益 = ∑投资人日收益(即投资人日收益逐日累加)

注:本次累计收益计算期间为 2007 年 1 月 15 日–2007 年 2 月 14 日。

二、收益结转份额时间

1、收益结转基金份额日:2007 年 2 月 15 日。

2、收益结转的基金份额可查询日:2007 年 2 月 16 日。

三、有关税收和费用的说明

1、根据财政部、国家税务总局《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税字[2002]128 号),对投资人(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

2、本基金本次收益结转免收手续费。

四、提示

本基金投资人的收益每日进行分配,并于每月 15 日集中按 1 元面值自动转为基金份额。累计收益的计算期间为上次收益结转日至当月结转日的前一日,特殊情况将另行公告。

五、咨询渠道

1、华宝兴业基金管理有限公司客户服务电话(021–38784747),网站(www.fsfund.com)。

2、代销机构客户服务电话:中国建设银行股份有限公司(95533)、联合证券有限责任公司(400–8888–555)、国泰君安证券股份有限公司(021–962588、400–8888–666)、中信建投证券有限责任公司(400–8888–108)、长江证券有限责任公司(027–65799999)、海通证券股份有限公司(021–962503)、招商证券股份有限公司(4008888111、0755–26951111)、中国银河证券有限责任公司(800–820–1868)、广发证券股份有限公司(020–87555888 转各营业网点)、东吴证券有限责任公司(0512–96288)、兴业证券股份有限公司(021–68419974)、光大证券股份有限公司(021–68823685)、申银万国证券股份有限公司(021–962505)、中信证券股份有限公司(010–95558)、东方证券股份有限公司(021–962506)、平安证券有限责任公司(95511)、中信金通证券有限责任公司(96598)。

特此公告。

华宝兴业基金管理有限公司

2007 年 2 月 16 日

证券代码:600449　　股票简称:赛马实业　　编号:2007–002

宁夏赛马实业股份有限公司 2007 年第一次临时股东大会决议公告

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,对公告内容的虚假记载、误导性陈述或重大遗漏负连带责任。

宁夏赛马实业股份有限公司 2007 年第一次临时股东大会于 2007 年 2 月 15 日在公司会议室召开,会议由董事长李永进先生主持。出席会议股东代理人 2 人,代表股份 7200 万股,占公司总股本 14421.6 万股的 49.93%。符合《公司法》和《公司章程》的规定。

经与会股东审议,以记名方式投票表决,通过以下决议:

审议并通过了《关于更换公司 2006 年度财务审计服务机构的议案》。

经表决,72000000 股赞成,占本议案总有效表决票数的 100%,0 股反对,占本议案总有效表决票数的 0%,0 股弃权,占本议案总有效表决票数的 0%。

本次股东大会由宁夏兴业律师事务所律师柳向阳现场见证,并出具法律意见书,认为:公司本次股东大会的召集、召开、出席大会人员资格及表决程序符合有关法律、规章和公司章程的有关规定,表决结果合法有效。

附:《宁夏兴业律师事务所关于宁夏赛马实业股份有限公司 2007 年第一次临时股东大会的法律意见书》(详见 http://www.sse.com.cn)

特此公告

宁夏赛马实业股份有限公司

董事会

2007 年 2 月 15 日