汇添富货币市场基金

更新招募说明书摘要

基金管理人:汇添富基金管理有限公司 基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
(2007 年第 1 号)

重 要 提 示

汇添富货币市场基金(以下简称"本基金")经 2006 年 2 月 15 日中国证券监督管理委员会证监基金字【2006】21 号文核准募集。本基金基金合同于 2006 年 3 月 23 日正式生效。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。

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。基金投资者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《中华人民共和证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者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。

基金管理人承诺恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉地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预示其未来表现。

本招募说明书所载内容截止日为 2007 年 3 月 23 日, 有关财务数据和净值表现截止日为 2006 年 12 月 31 日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

第一部分 基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:汇添富基金管理有限公司
注册地址:上海市黄浦区大沽路 288 号 6 幢 538 室
办公地址:上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼
法定代表人:桂水发
成立时间:2005 年 2 月 3 日
证监会批准设立文号:中国证监会证监基金字[2005]5 号
注册资本:1 亿元
联系人:李文
联系电话:021-28932888
股东名称及其出资比例:

东方证券股份有限公司	47%
文汇新民联合报业集团	26.5%
东航金戎控股有限责任公司	26.5%

(二)主要人员情况

1、董事会成员

桂水发先生,董事长。国籍:中国,1965 年出生,香港大学工商管理硕士,上海财经大学经济学学士。现任东方证券股份有限公司副总裁。曾在上海财经大学审计监察处任职、历任上海证券交易所上市部高级经理、北京办事处总经理、市场部总监等。

肖顺喜先生,董事。国籍:中国,1963 年出生,华东师范大学国际金融系研究生班。现任东航金戎控股有限责任公司总经理、东航集团财务有限责任公司总经理。历任东航期货公司总经理助理、副总经理、总经理,东航集团财务有限责任公司常务副总经理等。

陈保平先生,董事。国籍:中国,1953 年出生,高级编审,华东师范大学学士。现任文汇新民联合报业集团副社长、文汇新民联合报业集团投资公司总经理、新民晚报社副总编辑。历任上海青年报社编辑、记者、部主任、副总编,上海三联书店总编辑、沪港三联副董事长,上海文艺出版总社党委书记、副社长、总社总编辑等。

林利军先生,董事,总经理。国籍:中国,1973 年出生,美国哈佛大学商学院工商管理硕士,复旦大学世界经济系硕士,历任上海证券交易所办公室主任助理、上市部总监助理,曾任职于中国证监会创业板筹备工作组,哈佛大学毕业后就职于美国道富金融集团(State Street Global Advisor)从事投资和风险管理工作。

周荣亚先生(Joseph W. Chow),独立董事。国籍:美国,美国麻省理工学院斯隆商学院金融硕士、麻省理工学院建筑工程学院城市规划专业硕士、布朗代斯大学经济学士。现任美国道富金融集团执行副总裁和首席风险官,曾任道富集团风险管理委员会主席、信用审查委员会主席以及证券金融风险管理委员会主席,同时担任集团战略委员会、投资委员会和金融政策委员会的成员。历任波士顿银行(现为美洲银行)亚太分部和公司信贷部贷款高级官员、贷款高级发展培训项目的信贷培训主管(2007 年 4 月 19 日基金管理人发布《汇添富基金管理有限公司关于变更独立董事的公告》,周荣亚先生因个人原因不再担任公司独立董事,并聘请知名国际金融管理专家韦杰夫(Jeffrey R. Williams)先生担任公司独立董事)。

华民先生,独立董事。国籍:中国,1950 年出生,复旦大学经济学博士,教授,博士生导师。现任复旦大学经济学院学术委员会主任,复旦大学世界经济研究所所长,兼任世界经济系主任。上海市人民政府决策咨询专家,中国世界经济学会副会长,"国家中长期科技发展规划战略研究"咨询专家,上海市国际友人协会副会长等。

周瑞金先生,独立董事。国籍:中国,1939 年出生,复旦大学新闻系毕业。现任中国生产力学会副会长,上海生产力学会会长,中国社会科学院研究生院博士生导师,复旦大学新闻学院、北京广播学院兼职教授。1992 年获国务院表彰为有突出贡献的专家学者,终身享受政府特殊津贴。历任《解放日报》记者、编辑、评论部主任、副总编辑、党委书记兼副总编辑,《人民日报》社副总编辑兼华东分社社长。

2、监事会成员

任瑞良先生,监事长。国籍:中国,1963 年出生,大学学历,中国注册会计师。现任文汇新民联合报业集团投资公司副总经理。历任文汇新民联合报业集团财务中心财务主管,文汇新民联合报业集团投资公司财务主管、总经理助理等。

涂殷康先生,监事。国籍:中国,1970 年出生,上海财经大学硕士研究生,经济师职称。现任东航金戎控股有限责任公司行政管理部经理。曾任职于中国东方航空公司总经理办公室。历任东航期货经纪有限责任公司部门经理、副总经理,东航金戎控股有限责任公司投资管理部经理。

杨玉成先生,监事。国籍:中国,1965 年出生,上海财经大学硕士研究生。现任东方证券股份有限公司副总裁,历任君安证券有限责任公司证券投资部总经理助理,上海大众科技创业股份有限公司董事副总经理,上海申能资产管理有限公司董事副总经理,东方证券股份有限公司财务总监等。

麦峥嵘先生,员工监事,国籍:中国,1972 年出生,武汉工业大学毕业,大学本科。现任汇添富基金管理有限公司营运支持部副总经理,历任海南港澳国际信托投资有限公司电脑技术中心副总经理,中银国际证券有限责任公司助理副总裁。

3、高管人员

桂水发先生,董事长。(简历请参见上述董事会成员介绍)

林利军先生,总经理。(简历请参见上述董事会成员介绍)

李文先生,督察长。国籍:中国,1967 年出生,厦门大学管理学博士,高级经济师,中国注册会计师。历任中国人民银行厦门市分行稽核监督处科员,中国人民银行杏林支行副行长,中国人民银行厦门中心支行银行管理处处长助理、金融机构监管二处副处长,东方证券股份有限公司稽核总部总经理、资金财务管理总部总经理等。

张晖先生,副总经理。国籍:中国,1971 年出生,经济学硕士,历任申银万国研究所高级分析师、富国基金管理有限公司高级分析师、研究主管和基金经理。2005 年 4 月加盟汇添富基金管理有限公司,担任投资总监。

林军女士,副总经理。国籍:中国,1966 年出生,经济学硕士,历任浙江证券有限责任公司投资银行部副总经理、香港办事处负责人、西南证券有限责任公司国际业务部总经理、招商基金管理有限公司总经理助理兼营销总监。2006 年 7 月加盟汇添富基金管理有限公司,担任市场总监。

4、基金经理

王珏池先生,31 岁,管理学硕士,13 年债券研究投资经验。曾任申银万国证券股份有限公司固定收益总部投资部经理。2005 年 4 月加入汇添富基金管理有限公司。

5、投资决策委员会

主席:林利军先生(总经理)
副主席:张晖先生(副总经理、投资总监)
成员:庞飒先生(基金经理),袁建军先生(研究主管、基金经理)

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

名称: 上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路 500 号
办公地址:上海市中山东一路 12 号
法定代表人:金运
成立时间: 1992 年 10 月 19 日
组织形式: 股份有限公司
注册资本: 43.5488 亿元人民币
存续期间: 持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基金字[2003]105 号
联系人: 张轶美
联系电话:(021)61618888

上海浦东发展银行经过十年来的稳健经营和业务开拓,各项业务发展一直保持较快的增长,各项经营指标在新兴股份制商业银行中处于领先水平。截止到 2006 年 12 月 31 日, 全行总资产规模已达 6893.44 亿元人民币,各项存款余额 5964.88 亿元人民币,各项贷款余额 4608.93 亿元人民币。2006 年全年,实现净利润 33.53 亿元人民币,每股收益达 0.77 元。

上海浦东发展银行总行设资产托管部,资产托管部下设市场发展部、托管运作部、技术保障部、内控管理部四个职能部门,在深圳设立托管分部,现有员工 22 人。

第三部分 相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构:汇添富基金管理有限公司直销中心
注册地址:上海市黄浦区大沽路 288 号 6 幢 538 室
办公地址:上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼
法定代表人:桂水发
电话:021-28932823
传真:021-28932803
联系人:丛菲
客户服务电话:400-888-6333
网址:http://www.99fund.com

2、代销机构:

1)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路 500 号
法定代表人:金运
电话:021-61616152、61616153
传真:021-63602431
联系人:汤嘉惠、倪苏云
客户服务热线:95528
网址:www.spdb.com.cn

2)交通银行股份有限公司
注册地址:上海市仙霞路 18 号
法定代表人:蒋超良
电话:021-58781234
传真:021-58408836
联系人:曹榕
客户服务热线:95559
网址:www.bankcomm.com

3)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
电话:0755-83195487,82090060
传真:0755-83195049,83195050
联系人: 刘薇
客户服务热线:95555
网址:www.cmbchina.com

4)东方证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东大道 720 号
法定代表人:王益民
电话:021-63325888-3105
传真:021-63326173
联系人:盛云
客服热线:962506
网址:www.dfzq.com.cn

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
办公地址:上海市延平路 135 号
法定代表人:祝幼一
电话:021-62580818-213
传真:021-62583439
联系人:芮敏祺
客户服务咨询电话:400-8888-666
网址:www.gtja.com

6)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:021-53594566-4125
传真:021-53858549
联系人:金芸
客户服务咨询电话:400-8888-001
网址:www.htsec.com

7)中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市东城区新中街 68 号
办公地址:北京市东城区朝内大街 188 号
法定代表人:黎晓宏
电话:010-85130588
传真:010-65182261
联系人:权唐
客户服务咨询电话:400-8888-108
网址:www.csc108.com

8)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
电话:010-66568587
传真:010-66568536
联系人:郭京华
客户服务热线:010-68016655
网址:www.chinastock.com.cn

9)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
网址:www.xyzq.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
法定代表人:李树
电话:0431-85096710
联系人:高新宇
网址:www.nesc.cn

11)东海证券有限责任公司
注册地址:常州延陵西路 59 号常信大厦 18、19 楼
法定代表人:顾森贤
电话:021-50588876
联系人:龙涛
网址: www.longone.com.cn

12)东莞证券有限责任公司
注册地址:东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼
法定代表人:周建辉
电话:0769-2119353
联系人:张劲春
网址: www.dgzq.com.cn

13)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
法定代表人:王志伟
电话:020-87555888-875
联系人:肖中梅
网址: www.gf.com.cn

14)山西证券有限责任公司
注册地址:太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼
法定代表人:吴晋安
电话:0351-8686703
联系人:张治国
网址: www.i618.com.cn

15)联合证券有限责任公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层
法定代表人:马国强
电话:0755-82492000
联系人:刘育兵
网址:www.lhzq.com

16)世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 41 层
法定代表人:段强
电话:0755-83199511
联系人:沈力
网址: www.csco.com.cn

17)湘财证券有限责任公司
注册地址:湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼
法定代表人:陈学荣
电话:021-68634518-8631
联系人:陈伟
网址: www.xcsc.com

18)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
联系人:黄健
网址:www.newone.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
法定代表人:管荣升
电话:0791-6289771
联系人:万齐志
网址:www.gsstock.com

20)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
联系人:傅咏梅
网址: www.qlzq.com.cn

21)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:张小波
电话:(025)84457777-248
网址:www.htsc.com.cn

22)中银国际证券有限责任公司
住所:上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F
法定代表人:平岳
联系电话:(021)68604866-8918
联系人:赵国富
公司网址:www.bocichina.com

23)宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市建设路 2 号
办公地址:北京市海淀区西直门北大街甲 43 号金运大厦 B 座 6 层
法定代表人:高冠江
联系人:师敬泽
开放式基金咨询电话:(010)62267799-6789
公司网站:www.ehongyuan.com

24)东吴证券股份有限公司
注册地址:苏州市十梓街 298 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

25)长江证券有限责任公司
注册地址:武汉市新华路特 8 号
法定代表人:明云成
联系人:毕艇
电话:027-65799560
传真:027-85481532
客户服务热线: 4008-888-999
网址:www.cz318.com.cn

26)恒泰证券有限责任公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区东风路 111 号
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区东风路 111 号
法定代表人:李庆阳
联系人:吴李红
联系电话:021-68405772
网址:www.cnht.com.cn

27)中信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区湖贝路 1030 号海龙王大厦
法定代表人:王东明
电话:010-84588266
联系人:陈忠
网址:www.ecitic.com

28)国都证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格广场 45 层
办公地址:北京市东城区安外大街安贞大厦 3 层
法定代表人:王少华
联系人:马泽承
联系电话:010-64482828*390
网址:www.guodu.com

29)平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼
办公地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼
法定代表人:叶黎成
联系人:余江、庄维佳
电话:0755-82262888
传真:0755-82433794
全国统一客户服务热线:95511
网址:www.pa18.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所: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:010-58598835
传真:010-58598907
联系人:任瑞新

三、出具法律意见书的律师事务所

名称:上海源泰律师事务所
住所:上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼
负责人:廖海
电话:021-51150298
传真:021-51150398
联系人:廖海
经办律师:廖海、田卫红

四、审计基金财产的会计师事务所

名称:安永大华会计师事务所有限责任公司
法定代表人:沈钰文
注册地址:上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 23 楼
办公地址:上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 23 楼
邮政编码:200031
公司电话:021-24052000
公司传真:021-54075507
签章会计师:徐艳、杨晓梅
业务联系人:杨晓梅

第四部分 基金的名称

本基金名称:汇添富货币市场基金

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

力求本金稳妥和基金资产高流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的投资收益。

第七部分 基金的投资方向

本基金投资于法律法规允许的金融工具包括:

1. 现金;
2. 通知存款;
3. 一年以内(含一年)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. 期限在一年以内(含一年)的债券回购;
6. 期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;
7. 短期融资券;
8. 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。

第八部分 基金的投资策略

1. 决策依据

以《基金法》、《暂行规定》等有关法律法规、本基金合同以及基金管理人公司章程等有关规定为决策依据,并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

2. 投资程序

研究人员根据对宏观经济趋势、货币政策取向、货币信贷数据、国际资本流动、其他决定短期资金供求的因素以及市场结构的研究,提出投资策略建议。

金融工程小组运用风险监测模型以及各种风险监控指标,对投资组合的风险进行测算,并提供分析报告,向基金经理指出风险隐患,并提供风险控制建议。

投资理财部每日提供基金申购、赎回的数据分析报告,供基金经理决策参考。

投资决策委员会根据上述报告,定期召开会议,确定基金的资产配置方案。

基金经理根据投资决策委员会的资产配置方案、金融工程小组的风险控制建议和基金的申购、赎回情况,制定基金资产的期限结构配置、类属配置、个券配置以及调整计划。

基金经理结合市场情况向集中交易室下达交易指令,以实现上述投资组合。集中交易室依据指令制定交易策略,并将交易情况及时向基金经理反馈。

稽核监察部对投资组合的执行过程进行实时风险监控。

3. 投资策略

本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略,力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。

1)本基金的投资策略将基于以下研究分析

(1)市场利率研究

A、宏观经济趋势

宏观经济状况是央行制定货币政策的基础,也是影响经济总体货币需求的关键因素,因此宏观经济趋势基本上确定了未来较长时期内的利率水平。在分析宏观经济趋势时,我们重点关注两个因素。一是经济增长前景;二是通货膨胀率及其预期。

B、央行的货币政策取向

包括基准存、贷款利率,法定存款准备金率,公开市场操作的方向、力度,以及央行的窗口指导等。央行的货币政策取向是影响货币市场利率的最直接因素。在央行紧缩货币、提高基准利率时,市场利率一般会相应上升;而央行放松货币、降低基准利率时,市场利率则相应下降。

C、商业银行的信贷扩张

商业银行的信贷扩张是央行实现其货币政策目标的重要途径,也是经济总体货币需求的体现。因此商业银行的信贷扩张对货币市场利率具有举足轻重的影响。一般来说,商业银行信贷扩张越快,表明经济总体的货币需求越旺盛,货币市场利率也越高;反之,信贷扩张越慢,货币市场利率也越低。

D、国际资本流动

中国日益成为一个开放的国家,国际资本进出也更加频繁,并导致央行被动的投放或收回基础货币,造成货币市场利率的波动。在人民币汇率制度已经从钉住美元转为以市场供求为基础、参考一篮子货币进行调节、有管理的浮动汇率制度的情况下,国际资本流动对国内市场利率的影响也越发重要。

E、其他影响短期资金供求关系的因素

包括财政存款的短期变化,市场季节性、突发性的资金需求等。

(2)市场结构研究

银行间市场与交易所市场在资金供给者和需求者结构上均存在差异,利率水平因此有所不同。不同类型市场工具由于存在税负、流动性、信用风险上的差异,其收益率水平也略有不同。资金供给者、需求者结构的变化也会引起利率水平的变化。积极利用这些利率差异、利率变化就可能在保证流动性、安全性的基础上为基金资产带来更高的收益率。

(3)企业信用分析

直接融资的发展是一个长期趋势,企业债、企业短期融资券因此也将成为货币市场基金重要的投资对象。为了保障基金资产的安全,本基金将按照相关法规仅投资于具有最高信用等级的企业债、企业短期融资券。与此同时,本基金还将深入分析发行人的财务稳健性,判断发行人违约的可能性,严格控制企业债、企业短期融资券的违约风险。

2)本基金具体投资策略

(1)滚动配置策略

根据具体投资品种的市场特性采用持续投资的方法,既能提高基金资产变现能力的稳定性又能保证基金资产收益率与市场利率的基本一致。

(2)久期控制策略

根据对货币市场利率趋势的判断来配置基金资产的久期。在预期利率上升时,缩短基金资产的久期,以规避资本损失或获得较高的再投资收益;在预期利率下降时,延长基金资产的久期,以获取资本利得或锁定较高的收益率。

(3)套利策略

套利策略包括跨市场套利和跨品种套利。跨市场套利是利用同一金融工具在各个子市场的不同表现进行套利。跨品种套利是利用不同金融工具的收益率差别,在满足基金自身流动性、安全性需要的基础上寻求更高的收益率。

(4)时机选择策略

股票、债券发行以及年末效应等因素可能会使市场资金供求情况发生暂时失衡,从而推高市场利率。充分利用这种失衡就能提高基金资产的收益率。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为银行一年期定期存款的税后利率:(1-利息税率)×银行一年期定期储蓄存款利率。

本基金选取这个业绩比较基准的理由:

(1)本基金为货币市场基金,其自身的特性决定了它的业绩收益与股票型或债券型基金不具有可比性。由于主要投资品种均为货币市场工具,先天决定了其低风险、高流动性与稳定收益的业绩收益特征。

(2)由于存款人能取得的利息是税后收益,所以一年期定期存款的税后利率与本基金的业绩有更好的可比性。

(3)市场同行一般采用一年期定期存款的税后利率作为业绩比较基准。

第十部分 基金的风险收益特征

本货币市场基金是具有较低风险、中低收益、流动性强的证券投资基金品种。

第十一部分 基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证基金投资组合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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据基金合同规定,于 2007 年 1 月 17 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为截至 2006 年 12 月 31 日("报告期末")的季报数据,本报告中所列财务数据未经审计。

1. 期末基金资产组合情况

资产类别	金额(元)	占基金总资产的比例
债券投资	761,217,102.06	99.21%
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	314,537.58	0.04%
其他资产	5,728,445.31	0.75%
合计	767,260,084.95	100.00%

2. 报告期债券回购融资情况

项目	金额(元)	占基金资产净值比例
报告期内债券回购融资余额	1,510,000,000.00	2.54%
其中:买断式回购融入的资金	0.00	0.00%
报告期末债券回购融资余额	44,100,000.00	6.12%
其中:买断式回购融入的资金	0.00	0.00%

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	83天
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	126天
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	64天

报告期内投资组合平均剩余期限违规超过 180 天的说明:本报告期内无。

(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天内	6.97%	6.12%
2	30天(含)-60 天	26.30%	0.00%
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	6.94%	0.00%
3	60天(含)-90 天	44.32%	0.00%
4	90天(含)-180 天	25.32%	0.00%
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	8.39%	0.00%
5	180天(含)-397 天(含)	2.78%	0.00%
合计		105.68%	6.12%

4. 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	254,918,020.83	35.38%
	其中:政策性金融债	254,918,020.83	35.38%
3	央行票据	203,953,535.59	28.30%
4	企业债券	302,345,545.64	41.96%
5	其他	0.00	0.00%
合计		761,217,102.06	105.64%
剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券		110,455,512.37	15.33%

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)	占基金资产净值的比例
		自有投资	买断式回购		
1	06央票 08	900,000.00	0.00	89,658,579.02	12.44%
2	04国开 21	850,000.00	0.00	85,188,762.63	11.82%
3	06央票 14	650,000.00	0.00	64,672,741.64	8.97%
4	06京投债	600,000.00	0.00	60,474,680.30	8.39%
5	06沪电气 CP01	500,000.00	0.00	50,132,782.01	6,96%
6	06甘电投 CP01	500,000.00	0.00	50,115,437.20	6.95%
7	06国开 08	500,000.00	0.00	49,980,832.07	6.94%
8	06国开 15	500,000.00	0.00	49,914,613.13	6.93%
9	06国开 17	500,000.00	0.00	49,869,280.00	6.92%
10	06央票 24	500,000.00	0.00	49,622,214.93	6.89%

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	偏离情况
报告期内偏离度在 0.5%(含)以上的次数	0
报告期内偏离度的绝对值在 0.25%(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	-0.03%
报告期内偏离度的最低值	-0.14%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.09%

6. 投资组合报告附注

1)基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法计价,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

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基金合同约定的范围,没有需要特别说明和补充的部分。

4)其他资产的构成

序号	其他资产	期末金额(元)
1	交易保证金	250,000.00
2	应收利息	5,478,445.31
3	应收申购款	0.00
4	其他应收款	0.00
5	待摊费用	0.00
6	其他	0.00
	合计	5,728,445.31

5)截至本报告期末,本基金未投资于资产支持证券。

7. 开放式基金份额变动

序号	项目名称	基金份额(份)
1	合同生效日基金份额总额	655,088,979.95
2	加:本报告期申购基金份额总额	657,661,565.54
3	减:本报告期赎回基金份额总额	592,144,524.03
4	本报告期期末基金份额总额	720,606,021.46

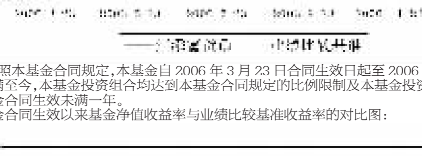
第十二部分 基金的业绩

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。基金业绩数据截至 2006 年 12 月 31 日。

一、本基金份额净值收益率与同期业绩比较基准收益率比较表:

阶段	净值收益率(1)	净值收益率标准差(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)
过去 3 个月	0.4851%	0.0030%	0.5081%	0.0000%	-0.0230%	0.0030%
自基金合同生效起至今	1.4437%	0.0045%	1.4804%	0.0003%	-0.0367%	0.0042%

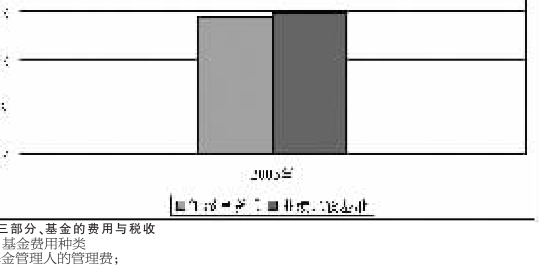
二、自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:



注:1、按照本基金合同规定,本基金自 2006 年 3 月 23 日合同生效日起至 2006 年 6 月 23 日为建仓期。建仓期满至今,本基金投资组合均达到本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

2、本基金合同生效未满一年。

3、自基金合同生效以来基金净值收益率与业绩比较基准收益率的对比图:



第十三部分、基金的费用与税收

(一)基金费用种类

1. 基金管理人的管理费;
2. 基金托管人的托管费;
3. 销售服务费;
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用;
5. 基金合同生效后与基金相关的会计师费与律师费;
6. 基金份额持有人大会费用;
7. 基金的证券交易费用;
8. 银行汇划费用;
9. 按照国家有关规定和本基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金合同终止时所发生的基金财产清算费用,按实际支出额从基金财产中扣除。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 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%的年费率计提。管理费的计算方法如下:

管理费的计算方法如下:

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付指令,基金托管人复核后于次月前 5 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。

2. 基金托管人的托管费

基金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 ×0.1% ÷ 当年天数
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日基金资产净值

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付指令,基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

3. 销售服务费

在通常情况下,本基金的销售服务费按前一日基金资产净值 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 为前一日基金资产净值

销售服务费在基金合同生效后每日计算,每日计提,按月支付,由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性划往基金注册登记清算账户,基金管理人支付给各销售机构,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

基金管理人可酌情降低基金销售服务费,无须召开基金份额持有人大会。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指定媒体上刊登公告。上述(一)中 4 到 9 项费用由基金托管人根据其它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)本基金不列入基金费用的项目

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基金资产的损失,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。基金合同生效前的相关费用,包括但不限于信息披露费、验资费、会计师费和律师费等不列入基金费用。

(四)基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费和基金托管费, 无须召开基金份额持有人大会。调高上述费用时,按《基金法》和本基金合同规定,需召开基金份额持有人大会决议。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的媒体上公告。

(五)税收

基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

一、"重要提示"部分:

更新了本招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现截止日。

二、"三、基金管理人":

1、更新了独立董事周荣亚先生的信息。
2、增加了公司高管人员张晖先生的简历。
3、增加了公司高管人员林军女士的简历。
4、删除了投资顾问的信息。
5、更新了基金经理的信息。
6、更新了投资决策委员会信息。
7、更新了基金管理人的风险管理体系中的风险管理组织架构。

三、"四、基金托管人":

更新了基金托管人的信息。

四、"五、相关服务机构":

1、更新了汇添富基金管理有限公司直销中心的相关信息。
2、更新了上海浦东发展银行股份有限公司的相关信息。
3、更新了交通银行股份有限公司的相关信息。
4、更新了招商银行股份有限公司的相关信息。
5、更新了东方证券股份有限公司的相关信息。
6、更新了中信建投证券有限责任公司的相关信息。
7、更新了东北证券有限责任公司的相关信息。
8、更新了东海证券有限责任公司的相关信息。
9、更新了山西证券有限责任公司的相关信息。
10、更新了联合证券有限责任公司的相关信息。
11、更新了湘财证券有限责任公司的相关信息。
12、更新了招商证券股份有限公司的相关信息。
13、更新了华泰证券有限责任公司的相关信息。
14、更新了中银国际证券有限责任公司的相关信息。
15、更新了宏源证券股份有限公司的相关信息。
16、更新了恒泰证券有限责任公司的相关信息。
17、更新了中信证券股份有限公司的相关信息。
18、增加了国都证券有限责任公司的相关信息。
19、增加了平安证券有限责任公司的相关信息。
20、更新了注册登记机构的相关信息。

五、"八、基金份额的申购、赎回与转换":

1、更新了申购与赎回的数额限制的内容。
2、更新了基金转换部分的内容。

八、"九、基金的投资"

更新了基金投资组合报告。

九、"十、基金的业绩":

更新了基金业绩数据。

十、"二十、基金托管协议的内容摘要"

更新了基金托管人的办公地址。

十一、"二十一、对基金份额持有人的服务":

更新了基金份额持有人服务内容。

十二、"二十二、其他应披露事项":

1、2006 年 9 月 25 日,基金管理人发布了关于汇添富货币市场基金"十一"长假前暂停申购及基金转换转入交易的提示公告。

2、2006 年 10 月 27 日,基金管理人发布了汇添富货币市场基金季度报告(2006 年第 3 季度)。

3、2006 年 11 月 7 日,基金管理人发布了汇添富货币市场基金更新招募说明书摘要(2006 年第 1 号)。

4、2006 年 12 月 6 日,基金管理人发布了开放式基金网上交易费率的公告。

5、2006 年 12 月 14 日, 基金管理人发布了关于旗下基金调整最低赎回份额和最低保留份额的公告。

6、2006 年 12 月 26 日,基金管理人发布了关于汇添富货币市场基金"元旦"假期前暂停基金申购及转换转入交易的提示公告。

7、2007 年 1 月 4 日,基金管理人发布了旗下各基金 2006 年年度资产净值公告。

8、2007 年 1 月 20 日,基金管理人发布了汇添富货币市场基金季度报告(2006 年第 4 季度)。

9、2007 年 1 月 31 日,基金管理人发布了关于开通中国建设银行龙卡(储蓄卡)网上交易业务的公告。

10、2007 年 2 月 6 日,基金管理人发布了关于旗下基金调整最低赎回份额和最低保留份额的公告。

11、2007 年 2 月 8 日,基金管理人发布了关于通过招商银行开展基金定期定额投资业务的公告。

12、2007 年 2 月 9 日,基金管理人发布了关于汇添富货币市场基金"春节"假期前暂停基金申购及转换转入交易的提示公告。

十三、"二十三、招募说明书存放及查阅方式":

更新了招募说明书存放及查阅方式的内容。

汇添富基金管理有限公司
2007 年 4 月 30 日

证券代码:000583 证券简称:S*ST 托普 公告编号:20070425

四川托普软件投资股份有限公司股改进展的风险提示公告

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,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

公司在未来一定时间是否能披露股改方案存在不确定性,请投资者注意投资风险。目前,本公司没有非流通股股东提出股改动议。现将有关情况公告如下:

一、目前公司非流通股股东股改动议情况

公司有非流通股股东共计 14 家、目前,没有股东提出过股改动议。未提出股改动议的原因主要是持有公司 5%以上股份的大股东持有本公司的股权因涉诉全部被法院冻结,目前处于执行阶段,股改计划暂无法实施。

另因公司 2003、2004、2005 年连续三年亏损,公司股票自 2006 年 5 月 10 日起被深交所决定暂停上市。公司已分别在 2006 年 8 月 10 日披露的公司 2006 年中期报告及 2006 年 1—9 月份业绩预亏公告、2006 年 10 月 31 日披露的公司 2006 年第三季度报告及 2006 年全年业绩预亏公告、2007 年 4 月 13 日披露的业绩修正公告、2007 年 4 月 23 日披露的 2006 年年度报告中对股票退市作过风险提示并提醒广大投资者注意投资风险, 且于 2007 年 1 月 10 日、2007 年 2 月 10 日、2007 年 3 月 13 日、2007 年 3 月 21 日、2007 年 4 月 9 日、2007 年 4 月 16 日、2007 年 4 月 23 日刊登了终止上市风险提示公告。这将对股改工作造成实质影响。

公司董事会已多次就股改问题与大股东沟通,但因前述原因,股改工作无实质进展。

二、公司股改保荐机构情况

公司目前尚未聘请股改保荐机构。

三、公司董事会拟采取的措施

公司董事会将继续与大股东联系、沟通,并协调法院等部门,以促使被冻结的股权尽快解除冻结,为股改创造有利条件。

四、保密义务及董事责任

本公司全体董事确认并已明确告知相关当事人,按照《上市公司股权分置改革管理办法》第七条等的规定履行保密义务。

本公司全体董事保证将按照《上市公司股权分置改革管理办法》、《深圳证券交易所股票上市规则》及相关业务规则的规定及时披露股改相关事项。

本公司全体董事确认已知《刑法》、《证券法》、《上市公司股权分置改革管理办法》等对未按规定披露信息、内幕交易等的罚则。

特此公告。

四川托普软件投资股份有限公司董事会
二〇〇七年四月三十日

证券代码:000750 证券简称:S*ST 集琦 公告编号:2007-020

桂林集琦药业股份有限公司股改进展的风险提示公告

本公司董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

特别提示:

本公司在未来一定时间是否能披露股权分置改革方案存在不确定性,请投资者注意投资风险。

由于本公司的实际控制人将发生变化,该等事项尚未得到国务院国有资产监督管理委员会和中国证券监督管理委员会的批准。现本公司根据国务院国资委要求,正准备相关补充资料。目前,本公司控股股东与潜在控制人和国海证券有限责任公司正就本公司股权分置改革的相关事宜进行研究,尚无可供讨论的股权分置改革方案。

一、目前公司非流通股股东股改动议情况

本公司非流通股东共 2 家,其中控股股东桂林集琦集团有限公司(下称"集琦集团")持有公司非流通股 88,897,988 股(占公司股份总数的 41.34%,占非流通股总数的 95.74%)。

集琦集团于 2006 年 12 月 23 日与广西梧州索芙特美容保健品有限公司(下称"索美公司")签订《股份转让协议》,将其持有本公司 88,897,988 股国有法人股全部转让给索美公司。该次《股份转让协议》的签订属国海证券有限责任公司(下称"国海证券")借壳本公司上市系列事项之一。索美公司在支付完毕股份转让价款并办理完毕相关股份的过户手续后,将成为本公司的实际控制人。

目前,本公司控股股东与潜在控制人和国海证券正就本公司股权分置改革的相关事宜进行研究,尚无可供讨论的股权分置改革方案。

二、公司股改保荐机构情况

就股改保荐机构聘请事宜, 公司已与兴业证券股份有限公司达成意向,相关协议尚未签订。

三、公司董事会拟采取的措施

本公司拟进行股权分置改革,并在股权分置改革的同时进行重大资产重组,以实现国海证券借壳本公司上市的目的。本公司股权分置改革方案力争 2007 年上半年上报交易所。本公司董事会将协助索美公司完成股权转让并积极配合国海证券借壳事宜。

本公司董事会将及时披露相关事宜进展情况。

四、保密义务及董事责任

本公司全体董事确认并已明确告知相关当事人,按照《上市公司股权分置改革管理办法》第七条等的规定履行保密义务。

本公司全体董事保证将按照《上市公司股权分置改革管理办法》、《深圳证券交易所股票上市规则》及相关业务规则的规定及时披露股改相关事项。

本公司全体董事确认已知《刑法》、《证券法》、《上市公司股权分置改革管理办法》等对未按规定披露信息、内幕交易等的罚则。

特此公告。

桂林集琦药业股份有限公司
董 事 会
二〇〇七年四月三十日