汇添富货币市场基金

更新招募说明书摘要

（2007年第2号）

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

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。

基金管理人保证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。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资人拟认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本摘要根据本基金的基金合同和本基金的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。本基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和本基金合同当事人，其持有本基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解本基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2007年9月23日，有关财务数据和净值表现截止日为2007年6月30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。

韦杰夫（Jeffrey R. Williams）先生，独立董事。国籍：美国，哈佛大学商学院工商管理硕士，哈佛大学肯尼迪政府学院资深访问学者。现为独立金融咨询顾问。历任美国花旗银行香港分行副总裁、深圳分行行长，美国运通银行台湾分行副总裁，台湾美国运通国际股份有限公司副总裁，渣打银行台湾分行总裁，深圳发展银行行长。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。

涂股康先生，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。现任上海申能资产管理有限公司总经理，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，东方证券股份有限公司副总裁等。

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、投资决策委员会副主席、兼任汇添富均衡增长基金基金经理。

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，管理学硕士，13年债券研究投资经验，曾参与上交所买断式回购及债券做市商的制度建设，对宏观经济和债券有深刻认识和理解。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，曾任交易主管，现任汇添富货币市场基金基金经理及固定收益主管。

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：韩贤旺先生（研究总监）、庞飒先生（基金经理），袁建军先生（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：吉晓辉
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2007年6月30日，全行总资产规模已达7698.54亿元人民币，各项存款余额6414.71亿元人民币，各项贷款余额5242.72亿元人民币。2007年上半年，实现净利润25.54亿元人民币，每股收益达0.586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23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：400-888-9918
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：吉晓辉
电话：021-61616196；021-61616201
传真：021-63602431
联系人：徐伟、虞谷云
客户服务热线：95528
网址：www.spdb.com.cn

2）交通银行股份有限公司
住所：上海市银城中路188号
法定代表人：蒋超良
电话：021-58781234
传真：021-58408842
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：深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人：秦晓
电话：0755-83198888
传真：0755-83195050
联系人：王楠
客户服务热线：95555
网址：www.cmbchina.com

4）中国光大银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人：王明权
电话：010-68098777
传真：010-68560661
联系人：薛军丽
客户服务热线：95595
网址：www.cebbank.com

5）东方证券股份有限公司
住所：上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人：王益民
电话：021-63325888-3105
传真：021-63326173
联系人：盛云
客户服务热线：962506
网址：www.dfzq.com.cn

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
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：021-62152814
联系人：芮敏祺
客户服务咨询电话：400-8888-666
网址：www.gtja.com

7）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：021-63410340
传真：021-63410624
联系人：李笑鸣
客户服务热线：400-8888-001
网址：www.htsec.com

8）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：010-85130577
传真：010-65182261
联系人：权唐
客户服务热线：400-8888-108
网址：www.csc108.com

9）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：肖时庆
电话：010-66568888
传真：010-66568536
联系人：李洋
客户服务热线：010-68016655
网址：www.chinastock.com.cn

10）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

11）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
客户服务热线：96688
网址：www.nesc.cn

12）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
客户服务热线：021-52574550、0519-8166222、0379-64912266
网址：www.longone.com.cn

13）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：张劾春
客户服务热线：961130；0769-22119341
网址：www.dgzq.com.cn

14）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
客户服务热线：020-87555888
网址：www.gf.com.cn

15）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：侯巍
电话：0351-8686703
联系人：张治国
客户服务热线：0351-8686868
网址：www.i618.com.cn

16）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：马昭明
电话：0755-82492000
联系人：范雪玲
客户服务热线：400-8888-555（限固话）、0755-25125666
网址：www.lhzq.com

17）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：刘军辉
客户服务热线：0755-83199599
网址：www.csco.com.cn

18）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：021-68634818-8503
联系人：钟康莺
客户服务热线：021-68865111
网址：www.xcsc.com；www.eestart.com

19）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
客户服务热线：95565、4008888111、0755-26951111
网址：www.newone.com.cn

20）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：0791-6285337
联系人：徐美云
客户服务热线：0791-6285337
网址：www.gsstock.com

21）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：0531-81957130
联系人：傅咏梅
客户服务热线：0531-81283868
网址：www.qlzq.com.cn

22）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
法定代表人：吴万善
电话：025-84457777-248
联系人：张小波
客户服务热线：025-84457777
网址：www.htsc.com.cn

23）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

24）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：汤世生
电话：010-62267799-6416
联系人：张智红
开放式基金咨询电话：（010）62267799-6789
公司网站：www.ehongyuan.com

25）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：0512-65588066
网址：www.dwzq.com.cn

26）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：胡运钊
电话：027-65799560
传真：027-85481532
联系人：毕艇
客户服务热线：4008-888-999
网址：www.cz318.com.cn

27）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
法定代表人：李庆阳
电话：021-68405392
联系人：吴李红
客户服务热线：0471-4960762
网址：www.cnht.com.cn

28）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：010-84588888
传真：010-84865560
联系人：陈忠
客户服务热线：010-84588336
网址：www.ecitic.com

29）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
联系电话：010-64482828*390
联系人：马泽承
全国免费业务咨询电话：800-810-8809
开放式基金业务传真：010-64482090
网址：www.guodu.com

30）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
法定代表人：陈敬达
电话：0755-82450826
传真：0755-82433794
联系人：余江、欧阳林侃
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
A级基金名称：汇添富货币市场基金A级
B级基金名称：汇添富货币市场基金B级

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本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7月18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2007年6月30日报告期末的季报数据，其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	393,491,508.02	97.67%
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	1,706,777.94	0.42%
其他资产	7,673,618.91	1.91%
合 计	402,871,904.87	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	658,590,000.00	1.59%
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	30,380,000.00	8.59%
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	90
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	146
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	19

报告期内投资组合平均剩余期限无超过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天内	0.55%	8.59%
2	30天(含)－60天	5.68%	0.00%
3	60天(含)－90天	95.69%	0.00%
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	16.98%	0.00%
4	90天(含)－180天	1.40%	0.00%
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.40%	0.00%
5	180天(含)－397天(含)	8.48%	0.00%
合计		111.80%	8.59%

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	60,065,779.49	15.26%
	其中：政策性金融债	60,065,779.49	15.26%
3	央行票据	278,381,143.25	70.75%
4	企业债券	55,044,585.28	13.99%
5	其他	0.00	0.00%
合 计		393,491,508.02	100.00%
剩余存续期超过397天的浮动利率债券		65,027,037.71	16.53%

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	07央票61	2,500,000		248,566,995.37	70.27%
2	05国开07	600,000		60,065,779.49	16.98%
3	06央票70	300,000		29,814,147.88	8.43%
4	06广晟CP02	200,000		20,104,870.91	5.68%
5	07大唐CP01	200,000		19,969,826.68	5.65%
6	07东控CP01	100,000		10,008,629.47	2.83%
7	06京投债	50,000		4,961,258.22	1.40%
8					
9					
10					

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	无
报告期内偏离度的绝对值在0.25%（含）-0.5%间的次数	无
报告期内偏离度的最高值	-0.03%
报告期内偏离度的最低值	-0.15%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.10%

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	0.00
3	应收申购款	850,916.32
4	其他应收款	6,572,702.59
5	待摊费用	0.00
6	其他	0.00
	合 计	7,673,618.91

5）截至本报告期末，本基金未投资于资产支持证券。

6）报告期末流通转让受限的基金资产

本基金进行银行间同业市场债券质押式回购交易以债券作为抵押，该类债券在约定的卖出回购期内暂时无法流通。2007年6月30日，因该原因引起的流通受限的债券如下：

债券名称	数量（张）	摊余成本(元)	估值方法	受限期限（回购到期日）
07央票61	310,000	30,822,307.43	摊余成本法	2007-7-2

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2007年6月30日。

阶段	基金分级	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)
2006年3月23日至2006年12月31日	A级	1.4437%	0.0045%	1.4804%	0.0003%	-0.0367%	0.0042%
2007年1月1日至2007年6月30日	A级	1.1214%	0.0042%	1.0873%	0.0005%	0.0341%	0.0037%
2007年5月22日至2007年6月30日	B级	0.3107%	0.0040%	0.2683%	0.0000%	0.0424%	0.0040%
自基金合同生效起至今	A级	2.5813%	0.0044%	2.5838%	0.0005%	-0.0025%	0.0039%
2007年5月22日起至今	B级	0.3107%	0.0040%	0.2683%	0.0000%	0.0424%	0.0040%

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

本基金各级基金份额按照不同的费率计提销售服务费，但各级基金份额的销售服务费率均不超过0.25%年费率。各级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

H = E × R ÷ 当年天数
H 为各级基金份额每日应计提的销售服务费
E 为前一日该级基金份额的基金资产净值
R 为该级基金份额的销售服务费率

各级基金份额的销售服务费在基金合同生效后每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首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。由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。

各级基金份额计提的销售服务费率参见《关于汇添富货币市场基金实施基金份额分级并修改基金合同、招募说明书和托管协议的公告》。基金管理人可以调整对各级基金份额计提的销售服务费率，但销售服务费年费率最高不超过0.25%。在基金合同规定的范围内调整基金销售服务费，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：
1、对购买本基金的风险进行了进一步提示。
2、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的截止日。
二、“释义”部分：
1、更新销售服务费约定。
2、增加了“基金份额等级”、“基金份额的升级”、“基金份额的降级”约定。
三、“三 基金管理人”部分：
1、更新了董事会成员信息。
2、更新了高管人员的个人信息。
3、更新了基金经理的个人信息。
4、更新了投资决策委员会人员情况。
四、“四、基金托管人”部分：
1、更新了基金托管人基本情况。
2、更新了基金托管人主要人员情况。
3、更新了基金托管业务经营情况。
五、“五、相关服务机构”部分：
1、更新了基金份额发售机构的联系人及客户服务电话。
2、增加了中国光大银行股份有限公司的相关信息。
六、“八、基金份额的申购、赎回与转换”部分：
1、增加了基金分级的相关情况。
2、更新了基金赎回金额的计算。
3、更新了申购份额的处理方式。
4、更新了基金转换受理时间。
5、更新了基金转换的计算公式。
6、增加了基金份额的升级和降级。
七、“九、基金的投资”部分：
更新了基金投资组合报告。
八、“十、基金的业绩”部分：
更新了基金业绩数据。
九、“十二、基金资产的估值”部分：
1、更新了基金资产计价目的。
2、更新了计价日。
3、更新了计价方法。
4、更新了计价对象。
5、更新了计价程序。
6、更新了计价错误的处理。
7、更新了暂停计价的情形。
十、“十三、基金的收益和分配”部分：
增加了各级基金份额的基金净收益的说明。
十一、“基金的费用与税收”部分：
更新了销售服务费内容。
十二、“十六、基金的信息披露”部分：
更新了每万分基金净收益和七日年化收益率的披露约定。
十三、“二十一、对基金份额持有人的服务”部分：
1、更新了交易资料的寄送。
2、更新了客户服务中心电话号码。
3、更新了网络在线服务。
十四、“二十二、其他应披露事项”部分：
更新了2007年3月24日至2007年9月23日期间涉及本基金的相关公告。

汇添富基金管理有限公司
2007年11月7日