

华宝兴业现金宝货币市场基金

更新的招募说明书(摘要)

重要提示

本摘要根据《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,投资人自取得《基金合同》所发售的基金份额,即成为基金份额持有人和《基金合同》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《基金合同》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定享有权利、承担义务;基金份额持有人了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅《基金合同》。

投资有风险,投资人在申购本基金前应仔细阅读《招募说明书》。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

摘要所述内容更新至2007年9月30日,有关财务数据和净值表现截止日为2007年9月30日,数据未经审计。

一、《基金合同》生效日期

本系列基金自2005年2月28日到2005年3月25日向个人投资者和机构投资者同时发售,《基金合同》于2005年3月31日生效。

二、基金管理人

(一)基金管理人概况

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
住所:上海市世纪大道88号金茂大厦48层
办公地址:上海市世纪大道88号金茂大厦48层
法定代表人:郑安国
总经理:裴长江
成立日期:2003年3月7日
注册资本:1.5亿元
电话:021-50499588
联系人:陈卓彦
股权结构:中方股东华宝信托投资有限责任公司持有51%的股份,外方股东法国兴业资产管理有限公司持有49%的股份。

二、主要人员情况
1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况
郑安国先生,董事长,博士,高级经济师。曾任南方证券有限公司发行部经理,投资部经理,南方证券有限公司投资银行部总经理助理,南方证券有限公司上海分公司副总经理,南方证券有限公司研究所总经理级副所长,华宝信托投资有限责任公司副总经理、总经理。现任华宝兴业基金管理有限公司董事长。

Christian D'ALLEST先生,董事,法学硕士。曾任法国兴业银行国际部业务经理,国际部主管,资本市场负责人,资产管理负责人。现任法国兴业资产管理有限公司国际部业务经理。

王晓薇女士,董事,本科。曾任宝钢国际贸易有限公司财务部业务经理、宝钢美洲贸易有限公司国际部财务经理。现任华宝信托投资有限公司副总经理。

袁志鹏先生,独立董事,博士,教授、博导。法国巴黎社会科学高等研究院(H.E.S.S.)经济学博士,曾任复旦大学经济学院副教授、教授、经济系系主任。现任复旦大学经济学院教授。

Christian CLERC-BATUT先生,独立董事,商学本科。曾任S.N.S.阿尔及利亚子公司总经理,欧洲集团独立董事、芝加哥子公司总经理、审计部总经理。现任欧洲集团欧洲及亚太区总经理。

谢安生先生,独立董事,博士,教授。曾任上海财经大学助教、讲师、副教授、教授,华东师范大学会计事务所合伙人。现任上海国家会计学院院长。

吴志攀先生,独立董事,法学博士,教授。曾任北京大学法律系讲师、副教授、教授、博导,经济法教研室副主任、系主任,北京大学法学院院长,北京大学校长助理。现任北京大学副校长。

裴长江先生,董事,总经理,硕士,经济师。曾任上海万国证券公司副北营业部经理助理、经理,申万国证券股份有限公司浙江管理总部总经理,申万国证券股份有限公司经纪总部副总经理,华宝信托投资有限责任公司投资总监。

陈云飞 Denis IFRANCE先生,董事,财务总监,文学士,法学士。曾任法国期货市场委员会审计员,法国兴业银行法律顾问,法国兴业银行资本市场及资产管理部副经理,BARCEL资产管理公司(法国兴业银行集团子公司)首席法律顾问,法国兴业资产管理有限公司首席法律顾问。现任华宝兴业基金管理有限公司董事兼副总经理。

陆晔女士,董事,监事会召集人,现任兴资兴产(香港)首席执行官。
贺佳先生,监事,毕业于江西财经大学。曾任华宝信托投资有限公司研究部副总经理,现任公司营运副总监。

詹婧女士,监事,女,金融硕士,曾在TCL销售公司人力资源部,华宝信托投资有限公司人力资源部,基金筹备组,华宝兴业基金管理有限公司投资管理部工作,现在公司人力资源部工作。

2、本基金基金经理
曾丽娟女士,经济学学士。曾在杭州华商业银行总行资产管理运营部从事流动性管理及债券交易,2004年9月加入华宝兴业基金管理有限公司,任宝康灵活配置基金、现金宝货币市场基金基金经理。2007年2月起担任现金宝货币市场基金的基金经理。

现任现金宝货币市场基金的历史基金经理为王祖槐先生,任职期间为2005年3月至2007年2月。

3、投资决策委员会成员
任志强先生,投资总监。
Gabriel Gondard先生,投资副总监,宝康灵活配置基金基金经理,先进成长基金基金经理。
魏东先生,投资副总监,投资部总经理,宝康灵活配置基金基金经理,先进成长基金基金经理。

王祖槐先生,宝康债券基金基金经理。
雷勇先生,海外投资管理部总经理。
牟旭东先生,多策略增长基金基金经理。

三、基金管理人内部控制制度
1、风险管理体系

本系列基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、信贷风险和事件风险(如灾难)。

针对上述各种风险,本公司建立了一套完善的风险管理体系,具体包括以下内容:
① 针对风险管理目标,具体包括制定风险管理战略、目标,设置相应的组织机构,建立清晰的责任体系和报告渠道,配备适当的人力资源,开发运用的技术支持系统等内容。

② 识别风险。辨识公司运作和基金管理中存在的风险。
③ 分析风险。检查存在的控制措施,分析风险发生的可能性及其引起的后果并将风险归类。

④ 度量风险。评估风险水平的高低,既要有定量的度量手段,也有定性的度量手段。定性的度量是指风险水平划分为若干级别,每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标,测量其数值的大小。

⑤ 处理风险。将风险水平与设定的标准相比较,对于那些级别较低,在公司所定标准范围以内的风险,控制相对宽松一点,但仍加以定期监控,以防其超过预定标准;而对于较为严重的风险,制定适当的控制措施;对于一些后果可能极其严重的风险,则除了严格控制以外,还准备了相应的应急处理措施。

⑥ 监测与控制。对已有的风险管理体系进行实时监测,并定期评价其管理措施,在必要时结合新的需求加以改进。

⑦ 报告与咨询。建立风险管理报告系统,使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门及时了解公司风险管理状况,并寻求咨询意见。

2、内部控制制度
① 内部风险控制原则
健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节;

有效性原则。通过设置科学清晰的业务流程,结合程序控制,建立合理的内控程序,维护内部控制制度的有效执行;

独立性原则。公司必须在精简高效的基础上设立能充分履行职责、开展经营运作需要的部门和岗位,各部和岗位间在职能上保持相对独立性;公司固有财产、各项委托基金财产,其他资产分离运作,独立进行;

相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约,并通过切实可行的相互制衡措施来消除内控中的盲点;

防火墙原则。公司资产管理、交易、清算登记、信息技术、研究、市场营销等相关部门,应当在物理上和制度上适当隔离,对因业务需要必须知悉内幕信息的人员,应制定严格的批准程序和信息披露防范措施;

成本效益原则。公司应当充分发挥各部门及每位员工的工作积极性,尽量降低经营运作成本,保证以合理的控制成本达到最佳的控制效果;

合法合规性原则。公司内部控制制度的制定应当符合国家法律法规、规章制度和各项规定,并在此基础上遵循国际行业的惯例制订;

全面性原则。内部控制制度必须涵盖公司经营管理的各个环节,并普遍适用于公司每一位员工,不留制度上的空白或漏洞;

审慎性原则。公司内部控制的核心理念是风险控制,内部控制制度的制订要以审慎经营、防范和化解风险为目的;

适应性原则。内部控制制度的制订应当具有前瞻性,并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的变化及时进行调整或完善。

② 内部控制制度的要求和内容
内部控制制度要求不相容职务分离,建立完善的岗位责任制和规范的岗位管理措施,建立完整的信息安全系统,建立授权控制制度,建立有效的风险的内系统和快速反应机制。

③ 内部风险控制的内容包括投资管理业务控制、市场管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、档案管理制度,建立保密制度以及内部稽核控制。

④ 督察长制度
公司设督察长,督察长由公司总经理提名,董事会聘任,并应当经全体独立董事同意。督察长的任免须报中国证监会核准。

督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告,并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长发现基金及公司运作中存在同时,应当及时告知公司总经理和相关业务负责人,提出处理意见和整改建议,并监督整改措施的制定和落实;公司总经理对存在问题整改或不整改或整改未达到要求的,督察长应当向公司董事会、中国证监会及相关派出机构报告。

⑤ 内部控制风险管理制度的
内控审计风险管理部依据公司的内部控制制度,在所赋予的权限内,按照所规定的程序和适当的方法,进行公正客观的检查和评价。

内控审计风险管理部负责调查、评价公司有关部门执行公司各项规章制度的情况;进行日常风险监控工作;负责调查评价公司内控制度的健全性、合理性;评价各项内控制度执行的有效性,对内控制度的缺失提出补充建议;协助评价基金财产风险状况;负责公司主要领导离任前的审计;调查公司内部的经济违法案件等。

3、基金管理人关于内部合规控制声明书
① 本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确;
② 本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

三、基金托管人

1、基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:郭树清
成立时间:2004年9月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟玖佰肆拾叁亿玖仟零贰拾伍亿元人民币
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[1998]12号
联系人:尹东
联系电话:(010) 6759 5003

中国建设银行股份有限公司在中国拥有悠久的历史,其前身“中国人民建设银行”于1954年成立,1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。

中国建设银行股份有限公司由中国建设银行于2004年9月分立而成,继承了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:HK0939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。

2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司登陆恒生指数。于2006年末,中国建设银行市值达1,429.94亿美元,跻身全球十大上市银行之列。截至2006年12月31日止,中国建设银行总资产为人民币54,485.11亿元,客户存款为人民币47,216.56亿元。2006年,中国建设银行实现净利润人民币463.19亿元,较上年增长18.02%,每股盈利为人民币0.21元,平均资产回报率为0.92%,平均股东权益回报率为15%。中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京及首尔设

有分行,在伦敦、纽约设有代表处。2006年8月24日,中国建设银行在香港与美国银行签署协议,收购美国银行在香港的全资子公司美国银行(亚洲)股份有限公司100%的股权,并于2006年12月29日完成收购交割,美国银行(亚洲)有限公司更名为中国建设银行(亚洲)股份有限公司。中国建设银行在《银行家》2006年公布的全球银行按一级资本排名中,名列中国银行业榜首,在世界大银行中列第11位。中国建设银行在《福布斯》2006年全球领先企业排行榜中为第65名,列中国第二位。在《亚洲周刊》2006年7月公布的亚洲银行300强排名中,中国建设银行在“利润收入净值最高的银行”和“盈利最高的银行”两项排名中均列第一位,被誉为“亚洲最赚钱的银行”。此外,在2006年度《亚洲金融》亚洲最佳公司评选中,中国建设银行入选“最佳管理公司”、“最佳公司治理”、“最佳社会责任”排行榜。

中国建设银行总行设投资托管服务部,下设综合制度处、基金业务处、资产托管处、QHJ托管处、数据核算处、基金清算处、监督稽核处和投资委托托管团队等8个职能处室,现有员工80余人。

2、主要人员情况
罗中海,投资托管服务部总经理,曾就职于国家统计局、中国建设银行总行信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作,对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的领导经验。

李春信,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行人力资源部,计划部、筹资储蓄部,国际业务部工作,对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有较丰富相关工作经验。

3、基金托管业务经营情况
截止到2007年6月30日,中国建设银行已托管兴华、兴和、泰和、金鑫、金盛、金通、鸿飞、银丰等31只封闭式证券投资基金,以及华夏成长、融通新蓝筹、博时价值增长、华宝兴业宝康系列(包括宝康消费品、宝康债券、宝康灵活配置3只子基金)、博时裕富、长城久恒、银华保本增值、华夏现金增利、华夏双业多策略增长、国泰金马稳健回报、银华-道琼斯88精选、上投摩根中国优势、东方龙、博时主题行业、华夏高分优先债、华夏现金宝、上投摩根货币市场、华夏复兴、博时稳定价值、银华核心价值、上投摩根阿尔法、中信红利精选、工银瑞信货币市场、长城消费增值、华安上证180ETF、上投摩根双息平衡、泰达荷银稳健增值、华夏深圳中小企业ETF、交银施罗德稳健配置、华宝兴业收益增长、华富货币市场、工银瑞信稳健增长、鹏华价值优势、中信稳定债券、华安红利、上投摩根成长先锋、博时价值增长长、海富通风格优势、银华富裕主题、华夏优势增长、信诚核心成长、工银瑞信稳健成长、信达澳银领先优势、诺德价值优势、工银瑞信债券、国泰金鹰增长、富国天丰、融通领先成长、华宝兴业行业精选等51只开放式证券投资基金。

二、基金托管人的内部控制制度
1、内部控制目标
作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规,行业监管规章和本行内有关管理规定,守法经营、规范运作,严格监督,确保基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构
中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管服务部专门设置了监督稽核处,配备了专职内部控制监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施
投资托管服务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格,业务管理实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保密,制约机制严格有效,业务操作程序正确,封闭操作,实时监控、影像监控、业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序
1、监督方式
依照《证券投资基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统—基金监督系统”,严格按照相关法律法规及基金合同的规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资对象等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与支付情况进行检查监督。

2、监督流程
每日工作时段通过基金监督子系统,对各基金投资运作比例控制指标进行实时监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国证监会。
收到基金管理人的书面通知后,如涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作进行合法合规性、投资组合比例和投资风格等情况进行评价,报送中国证监会。
通过技术或非法手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

四、相关服务机构

(一)直销机构:
1、直销中心:
① 直销中心:
本公司上海开设直销中心,
地址:上海市世纪大道88号金茂大厦48层
邮政编码:200121
直销中心电话:021-50499588-301、302
直销中心传真:021-50499663、50499667

② 网上交易
投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的申购、赎回、转换等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址:www.fund.com

2、代销机构:
① 国信证券
地址:深圳市福田区福源路101号
电话:021-62580188
邮编:200002
② 上海证券
地址:上海市浦东新区商城路618号
电话:021-6888-1088
③ 中国民生银行股份有限公司
注册地址: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:董文标
电话:010-83916166
传真:010-83914283
联系人:吴杰
公司网址:www.cmbc.com.cn
客户服务电话:95568
④ 国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海浦东新区商城路618号
办公地址:上海市延平路135号
法定代表人:杨晓
电话:021-62580188
传真:021-62583439
联系人:芮敏祺
服务热线:400-8888-666;021-962588
公司网址:www.gtja.com
⑤ 海通证券股份有限公司
注册地址:上海淮海中路98号
办公地址:上海淮海中路98号
法定代表人:王宇辉
电话:021-53594000
服务热线:021-9555203
联系人:孔莹
公司网址:www.htsec.com
⑥ 中建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安化门66号A号楼
办公地址:北京市东城区朝内大街188号
法定代表人:张佑君
电话:400-8888-1088(免长途费);
联系人:权涛
公司网址:www.csc108.com
⑦ 中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际大厦C座
法定代表人:李伟
联系人:李洋
电话:010-66568047
客户服务电话:800-800-1868
网站:www.chinastock.com.cn
⑧ 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:广州市天河区北路大都会广场36、36、41和42楼
法定代表人:王卫伟
联系人:肖尚梅
电话:020-87555888
传真:020-87557899
客户服务电话:020 87555888 转各营业网点
公司网址:广发证券网 http://www.gf.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
客户服务电话:021-68419974
公司网址:www.xyzq.com.cn
⑩ 东吴证券股份有限公司
注册地址:江苏省苏州市观前街26号
办公地址:江苏省苏州市观前街26号
法定代表人:吴永敏
联系人:方晓丹
电话:0512-6581136
传真:0512-6588021
客户服务电话:0512-96288
公司网址:www.dwzq.com.cn
⑪ 长江证券有限责任公司
注册地址:武汉市新华路特8号
办公地址:武汉市新华路特8号
法定代表人:胡润
电话:021-62423632
传真:021-51062920
联系人:甘霖
服务热线:4008-888-999
公司网址:www.c318.com.cn
⑫ 联合证券有限责任公司
注册地址:深圳前海深港路5047号深圳发展银行大厦25、24、10层
办公地址:深圳前海深港路5047号深圳发展银行大厦25、24、10层
联系人:李海
电话:0755-82493561
联系人:薛文强
公司网址:www.lhzq.com
⑬ 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39—45层

法定代表人:宣少林
电话:0755-82943167
联系人:黄健
客户服务热线:400888111-0755-2695111
公司网址:www.newone.com.cn
⑭ 光大证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南楼15-16楼
法定代表人:王明权
电话:021-50818887
联系人:刘晨
客户服务热线:021-68823685
公司网址:www.ebsn.com
⑮ 申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
电话:021-54033888
传真:021-54035333
客服电话:021-962505
公司网站:www.sw2000.com.cn
(15) 中信证券股份有限公司
注册地址:深圳市南山区科园1030号龙华中大厦
办公地址:北京朝阳门内大街2号京城大厦
法定代表人:王明
电话:010-84864818
传真:010-84865560
联系人:陈忠
公司网址:www.citic.com
(16) 方正证券股份有限公司
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:吴宇
电话:021-50367888
传真:021-50366868
客户服务电话:021-962506
公司网站:www.dfq.com.cn
⑯ 中信金通证券有限责任公司
住所:浙江杭州杭州中河南路11号万凯国际商务楼A座
法定代表人:刘军
客户服务电话:96958
联系人:王勤
电话:0571-85783715
公司网址:www.bjzq.com.cn
⑰ 平安证券股份有限公司
办公地址:深圳市福田区八卦四路八卦三路平安大厦三樓
法定代表人:叶举
联系人:余江 庄维佳
电话:0755-82450826 22622287
传真:0755-82433794
客户服务电话:95511
网站:www.pa18.com
⑱ 招商证券有限责任公司
住所:深圳市福田区香蜜湖分公司
注册地址:深圳市福田区益田路316号
办公地址:青岛市东海西路28号
法定代表人:史志弘
联系电话:0532-85022026
传真:0532-85022026
联系人:丁薇薇
公司网址:www.zxwt.com.cn
中信万通证券客户咨询电话:0532-96577
⑲ 国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区红岭中路1012号国信证券大厦
法定代表人:何如
联系人:林建刚
电话:0755-82130833
传真:0755-82133302
客户服务热线:800-810-8868
国信证券网站:www.guosen.com.cn
(21) 华泰证券有限责任公司
住所:南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万海
电话:025-84457777-950、248
传真:025-84459763
联系人:李金龙、张小波
客户服务电话:025-85479897
公司网站:WWW.HTSC.COM.CN
基金管理人可根据有关法律法规的要求选择其他机构代理销售基金,并及时公告。
(二) 注册登记机构:华宝兴业基金管理有限公司(同上)
3、律师事务所和会计师事务所
名称:中国建设银行股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:郭树清
客户服务电话:客户咨询电话:95533
网址:www.cb.com
② 中国民生银行股份有限公司
注册地址: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:董文标
电话:010-83916166
传真:010-83914283
联系人:吴杰
公司网址:www.cmbc.com.cn
客户服务电话:95568
③ 国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海浦东新区商城路618号
办公地址:上海市延平路135号
法定代表人:杨晓
电话:021-62580188
传真:021-62583439
联系人:芮敏祺
服务热线:400-8888-666;021-962588
公司网址:www.gtja.com
④ 海通证券股份有限公司
注册地址:上海淮海中路98号
办公地址:上海淮海中路98号
法定代表人:王宇辉
电话:021-53594000
服务热线:021-9555203
联系人:孔莹
公司网址:www.htsec.com
⑤ 中建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安化门66号A号楼
办公地址:北京市东城区朝内大街188号
法定代表人:张佑君
电话:400-8888-1088(免长途费);
联系人:权涛
公司网址:www.csc108.com
⑥ 中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际大厦C座
法定代表人:李伟
联系人:李洋
电话:010-66568047
客户服务电话:800-800-1868
网站:www.chinastock.com.cn
⑦ 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:广州市天河区北路大都会广场36、36、41和42楼
法定代表人:王卫伟
联系人:肖尚梅
电话:020-87555888
传真:020-87557899
客户服务电话:020 87555888 转各营业网点
公司网址:广发证券网 http://www.gf.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
客户服务电话:021-68419974
公司网址:www.xyzq.com.cn
⑨ 东吴证券股份有限公司
注册地址:江苏省苏州市观前街26号
办公地址:江苏省苏州市观前街26号
法定代表人:吴永敏
联系人:方晓丹
电话:0512-6581136
传真:0512-6588021
客户服务电话:0512-96288
公司网址:www.dwzq.com.cn
⑩ 长江证券有限责任公司
注册地址:武汉市新华路特8号
办公地址:武汉市新华路特8号
法定代表人:胡润
电话:021-62423632
传真:021-51062920
联系人:甘霖
服务热线:4008-888-999
公司网址:www.c318.com.cn
⑪ 联合证券有限责任公司
注册地址:深圳前海深港路5047号深圳发展银行大厦25、24、10层
办公地址:深圳前海深港路5047号深圳发展银行大厦25、24、10层
联系人:李海
电话:0755-82493561
联系人:薛文强
公司网址:www.lhzq.com
⑫ 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39—45层

(8)投资于可转换债券;
(9)投资于信用等级超过397天的债券;
(10)投资于信用等级在AAA级以下的企业债券;
(11)中国证监会、中国人民银行禁止从事的其他行为。
四、投资组合的平均剩余期限计算方法
1.投资组合的平均剩余期限计算公式如下:
$$\frac{\sum_{i=1}^n \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{该金融工具剩余期限} \times \text{该金融工具公允价值}}{\sum_{i=1}^n \text{投资于金融工具产生的资产公允价值} + \text{待摊费用}}$$

其中:投资于金融工具产生的资产包括现金类资产(含银行存款、清算备付金、证券清算款)、一年以内(含一年)的银行存款、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)的逆回购、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。

投资于金融工具产生的负债包括期限在一年以内(含一年)的逆回购等。

2.各类资产和负债剩余期限的确定
① 银行存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限为0天;证券清算款的剩余期限以实际到账日至交收日的剩余交易日天数计算;
② 一年以内(含一年)银行存款、大额存单的剩余期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算;

③ 组合中债券的剩余期限是指计算日至债券到期日为止所剩的天数,以下情况除外:
④ 回购(包括正回购和逆回购)的剩余期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算;

⑤ 回购(包括正回购和逆回购)的剩余期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算;

⑥ 中央银行票据的剩余期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算。

五、基金投资组合报告截止2007年9月30日“报告期末”的数据,本报告中所有财务报表数据未经审计。
1.报告期末基金资产配置

资产类别	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
债券投资	299,133,319.63	69.08
买入返售资产	134,091,399.61	28.63
其中:买断式回购的买入返售资产	0.00	0.00
银行存款及清算备付金合计	8,104,209.66	1.87
其他资产	1,981,997.14	0.46
合计	433,229,818.44	100.00

2.报告期末投资组合融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券正回购融入资金余额	1,288,683,683.84	2.96
2	报告期内债券正回购融入资金余额	8,999,866.50	2.12
3	其中:买断式回购融入资金余额	0.00	0.00

报告期末本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	大额回购	质押券
1	2007-09-10	27.74	大额回购	17%

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
报告期内本基金组合平均剩余期限	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	137
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	32

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	42.98	2.12
2	30天-60天	21.20	0.00
3	60天-90天	0.00	0.00
4	90天-180天	16.36	0.00
5	180天-397天	21.26	0.00
6	397天以上	10.80	2.12

本基金截至2007年9月30日持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。具体情况列示如下:

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	90天(含)-180天	16.36	0.00
2	其中:浮动利率债券	2.35	0.00

4.报告期末投资组合持仓
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	国债债券	0.00	0.00
2	央行票据	0.00	0.00
3	其中:政策性金融债	169,141,017.37	39.93
4	企业债券	120,042,064.62	28.34
5	其他	9,960,153.64	2.35
6	合计	299,133,635.63	70.62

② 基金投资组合前十名债券明细

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	07国债(附息)70	50		