中信现金优势货币市场基金

更新招募说明书摘要

基金管理人:中信基金管理有限责任公司 基金托管人:招商银行股份有限公司

中信现金优势货币市场基金于2005年3月18日由中国证券监督管理委员会证监基金字[2005]038号批准募集。本基金的基金合同于2005年4月20日正式生效。

重要提示

投资有风险,投资人认购(或申购)基金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。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,应详细查阅基金合同。

本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。

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。本更新招募说明书所载内容截止日2007年10月20日,有关财务数据和净值表现截止日为2007年9月30日(财务数据未经审计)。本基金托管人招商银行股份有限公司已于2007年11月19日复核了本次更新的招募说明书。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

机构名称:中信基金管理有限责任公司

设立日期:2003年10月15日

注册地址:广东省深圳市笋岗路12号中民时代广场B座33层

办公地址:北京市朝阳区裕民路12号中国国际科技会展中心A座8层

法定代表人:王东明

联系人:杨军智

联系电话:010-82028888

组织形式:有限责任公司

注册资本:1亿元人民币

中信基金管理有限责任公司由中信证券股份有限公司、国家开发投资公司、上海久事公司、中海信托投资有限责任公司共同发起设立,经中国证监会证监基金字[2003]107号文批准,于2003年10月15日正式成立,注册资本金为1亿元人民币。经中国证监会证监基金字(2007)120号文批准,国家开发投资公司、上海久事公司、中海信托投资有限责任公司分别将其持有的本公司31%、10%和10%的股权转让给中信证券股份有限公司,上述股权转让完成后,公司现由中信证券股份有限公司全资持有。

中信基金管理有限责任公司目前下设十一个部门,分别是:股权投资部、固定收益投资部、研究开发部、基金运营部、市场业务部、客户服务部、信息技术部、综合管理部、监察稽核部、产品创新部、集中交易室。公司设立了投资管理委员会。投资管理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。截至2007年10月20日,中信基金管理有限责任公司旗下管理着中信经典配置证券投资基金、中信现金优势货币市场基金、中信红利精选股票型证券投资基金和中信稳定双利债券型证券投资基金。

(二)主要人员情况

1、董事、监事以及高级管理人员概况

王东明先生,董事长,硕士研究生学历、高级经济师。北京外国语学院法语系学士,美国南加州大学政治经济学硕士,美国乔治城大学国际经济硕士。历任北京华远经济建设开发总公司副总经理,加拿大枫叶银行证券公司副总裁,华夏证券公司发行部副总经理,南方证券公司副总经理,中信证券有限责任公司副总经理、总经理、董事长、中国中信集团公司总经理协理等职务。

黄卫东先生,董事,硕士研究生。先后毕业于长沙铁道学院,清华大学经济管理学院。历任中信证券股份有限公司债券部总经理、资产管理部总经理、资金运营部总经理、金融产品开发小组组长、中信证券股份有限公司襄理。现任中信证券公司股份有限公司副总经理。

傅强先生,董事,北京大学光华管理学院工商管理硕士,中级经济师。历任北京市人民银行行员、北京证券有限公司投资部交易员、研究发展部研究员、中兴信托投资有限公司资产运营部经理、综合开发部经理、国融资产管理公司证券投资部副经理等职务。现任国家开发投资公司金融投资部高级项目经理。

张建伟先生,董事,硕士研究生学历、高级经济师。历任上海玻璃厂副厂长、上海光通信器材公司副总经理、上海久事公司实业管理总部总经理、资产管理一、二部总经理、发展策划部经理、资产经营部经理、上海久事公司总经理助理兼发展策划部、资产经营部经理等职务。现任上海久事公司副总经理。

储晓明先生,董事,香港大学国际工商管理硕士,高级经济师。历任工商银行商业信贷部科员、主任科员、技改信贷部项目评估处负责人、技改信贷部调查评估处副处长、固定资产信贷部调查评估处处长、资产风险管理部副总经理、中国海洋石油财务公司副总经理、中海信托投资有限责任公司常务副总经理。现任中海信托投资有限责任公司总经理兼党委书记。

夏斌先生,独立董事,经济学硕士。历任中国人民银行总行处长、副所长、中国证监会主任、深圳证券交易所总经理、中国人民银行总行司长等职务。现任国务院发展研究中心研究所所长。

王国樑先生,独立董事,硕士研究生。历任中国石油天然气总公司财务局副处长、处长、中油财务有限责任公司副总裁、中国石油天然气勘探开发公司副总经理兼总会计师等职务。现任中国石油天然气股份有限公司财务总监。

朱武祥先生,独立董事,经济学博士。历任清华大学经济管理学院经济系助教、讲师、副教授、系副主任等职务。现任清华大学经济管理学院经济系教授、系副主任,承担教学工作。

郝如玉先生,独立董事,注册会计师、注册税务师,教授、博士生导师。历任中央财经大学税务系助教、讲师、副教授、系副主任、中央财经大学税务系主任、教授等职务。现任中央财经大学税收经济研究所所长。兼任中国注册税务师协会副会长、全国政协委员、北京市人民代表大会常务委员、全国工商联执委、北京市工商联副会长等职务。

陈颖先生,监事,大学学历。曾在上海市人民政府国资办秘书处就职。现任上海久事公司法律事务部企业法律顾问。

李涛先生,监事,硕士研究生学历。曾在国家投资煤炭公司从事财务工作,先后担任国家开发投资公司金融资产管理部、国融资产管理公司项目经理。现任国家开发投资公司金融投资部业务经理。

李志文先生,监事,大学学历,曾任中国新闻社人事部干部、中信证券股份有限公司人力资源部主管,现任中信基金管理有限责任公司综合管理部负责人。

吕涛先生,总经理,英国克拉费尔德大学管理学院工商管理硕士。14年证券、金融从业经历,具有基金从业人员资格证书和证券从业人员资格证书。曾任中信兴业信托投资公司金融证券处外汇交易员、中信证券股份有限公司资产管理部副总经理、总经理。现任中信基金管理有限责任公司总经理。

章月平女士,督察长,经济学学士、高级会计师。24年财务从业经历、13年证券从业经历。历任煤炭部财务司主任科员、中寰会计师事务所注册会计师、中信证券有限责任公司计财部副总经理、稽核室副主任、主任、中信证券股份有限公司计财部总经理等职务。现任中信基金管理有限责任公司督察长。

2、基金经理介绍

李广云先生,1976年7月出生,英国华威大学管理科学与运筹学专业硕士研究生毕业。8年证券(基金)从业经历,已获得证券投资基金从业资格。历任招商证券公司研究部研究员,中信基金管理公司固定收益、投资策略研究员,货币基金助理等职。自2007年7月12日起担任中信现金优势货币市场基金的基金经理。

本基金历任基金经理:

王洪涛先生,管理本基金时间为2005年4月20日至2007年7月11日。

3、投资管理委员会成员

公司目前投资管理委员会共由9人组成:

投资管理委员会主任委员	吕 涛
投资管理委员会委员	戴 波
投资管理委员会委员	郑 煜
投资管理委员会委员	郭楷泽
投资管理委员会委员	赵楠
投资管理委员会委员	王征
投资管理委员会委员	孙建波
投资管理委员会风控委员	王江平
投资管理委员会委员	张国强

上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人概况

1、基本情况

名称:招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")

设立日期:1987年4月8日

注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本:147.03亿元

法定代表人:秦晓

行长:马蔚华

资产托管业务批准文号:中国证监会证监基字【2002】83号

电话:0755—83195226

传真:0755—83195201

资产托管部信息披露负责人:姜然

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日,是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行,总行设在深圳。自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于2002年3月成功地发行了15亿A股,4月9日在上交所挂牌(股票代码:600036),是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股,9月22日在香港联交所挂牌交易(股票代码:3968),10月5日行使H股超额配售,共发行了24.2亿H股。截止2007年6月30日,招商银行总资产1.108万亿元人民币,核心资本净额577.94亿元人民币。

(二)主要人员情况

秦晓先生,英国剑桥大学经济学博士,高级经济师。第十届全国政协委员,招商局集团有限公司董事长,招商银行董事长,清华大学管理学院和中国人民银行研究生部兼职教授。曾任中国国际信托投资公司总经理、副董事长,中信实业银行董事长,国家外汇管理局外汇政策顾问,国际商会中国国家委员会副主席,亚太经济合作组织工商咨询理事会(ABAC)2001年主席,第九届全国人大代表。

马蔚华先生,经济学博士,高级经济师。第十届全国人大代表,政协深圳市第四届委员会常委。招商银行董事、行长。兼任招银国际金融有限公司董事长、招商信诺人寿保险有限公司董事长、招商局集团有限公司董事、TOM在线有限公司独立董事。同时担任中国企业家协会副会长、深圳市国内银行同业公会会长、深圳上市公司协会会长、中国金融学会常务理事、中国红十字会第八届理事会常务理事和北京大学、南京大学、吉林大学、西南财经大学等十多所高校兼职教授等职。曾任中国人民银行办公厅副主任,中国人民银行计划资金司副司长,中国人民银行海南省分行行长兼国家外汇管理局海南分局局长。曾经获评"2001-CCTV中国经济年度人物"、英国《银行家》杂志(The Banker)"2004年度银行业希望之星"(Rising Stars of Banking)。

张光华先生,1957年3月出生,1983年吉林大学经济系本科毕业,1986年获吉林大学经济学硕士学位,2000年获西南财经大学经济学博士学位,高级经济师。同时担任中国金融学会常务理事,广东金融学会副会长,广东商业联合会副会长。1986年7月至1992年10月任国家外汇管理局政研室副主任、计划处处长,1992年10月至1994年6月任中国人民银行海南省分行行长助理,1994年6月至1998年11月任中国人民银行海南省分行副行长兼国家外汇管理局海南分局副局长,1998年11月至2002年9月,任中国人民银行广州分行副行长,2002年9月至2007年4月任广东发展银行行长。

夏博辉先生,男,1963年11月出生,湖南人,管理学博士(厦门大学)、教授、注册会计师。现任招商银行资产托管部总经理,财政部会计准则咨询专家、金融会计组负责人,中国会计学会理事、中国金融会计学会专家委员会委员。1992–1999年历任湖南财经学院会计系副主任、科研处副处长、科研研究生处长、科研处处长及讲师、副教授、教授,2000–2005年6月历任深圳发展银行会计出纳部总经理、财务会计部总经理、计划财会部总经理、财务执行总监等职;2005年7月,加盟招商银行。1993–1996年,受聘担任世界银行技术援助中国人民银行会计改革体系项目金融会计准则研究组中方工作组组长。曾获"全国优秀教师并授予全国优秀教师奖章"(1993)、湖南省普通高校优秀教学成果一等奖(1993)、湖南省第五届优秀社会科学成果(著作)二等奖(1999)、中国青年科技论坛二等奖(1999)。

胡家伟先生,大学本科学历,现任招商银行资产托管部副总经理。30多年银行业务及管理工作经历,已获得基金从业资格。历任招商银行总行国际业务部副总经理、招商银行蛇口支行副行长、招商银行总行单证中心主任。曾任中国银行湖北省分行国际结算处副科长、副处长、中国银行十堰分行副行长、香港南洋商业银行押汇部高级经理、香港中银集团港澳管理处业务部高级经理等职务。

(三)基金托管业务经营情况

截至2007年9月30日,招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金(含招商安泰股票型投资基金、招商平衡型证券投资基金和招商债券投资基金),招商现金增值证券投资基金、中信经典配置证券投资基金、长城久泰中信标普300指数证券投资基金、中信现金优势货币市场基金、光大保德信货币市场证券投资基金、友邦华泰中短期债券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、光大新增长股票型证券投资基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、德盛优势股票型证券投资基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金及其它托管资产,托管资产为1233.56亿元人民币。

(四)托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念;形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制,防范和化解经营风险,确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整;建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患,保证业务稳健运行的风险控制制度,确保托管业务信息真实、准确、完整、及时;确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系:

一级风险防范是在总行行长层面对风险进行预防和控制。招商银行实行董事会领导下的行长负责制,重大事项的决策经行长办公会讨论决定,行长室下设风险控制委员会、内部控制状况评审委员会、稽核监督管理委员会、信息规划委员会等机构。

二级风险防范是总行资产托管部在业务室、专业岗位设置时,必须遵循内控制衡原则,监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

总行资产托管部内设立稽核监察室,负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下,独立于部门内其他业务室和托管分部,对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督。

三级风险防范是各业务室对自身业务风险进行自我防范和控制。业务室根据法律法规、监管规定、业务规则及本部门具体情况制定工作流程及风险控制措施。

3、内部控制原则

(1)全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位,并由全部人员参与。

(2)审慎性原则。内部控制的核心是有效防范各种风险,托管组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点,应当体现"内控优先"的要求。

(3)独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立,不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于内部控制的建立和执行部门,稽核监察室应保持高度的独立性和权威性,负责对部门内部控制工作进行评价和检查。

(4)有效性原则。内部控制应当符合国家法律法规和监管机关的规章,具有高度的权威性,成为所有员工严格遵守的行动指南;执行内部控制制度不能存在任何例外,部门任何员工不得拥有超越制度或违反规章的权力。

(5)适时性原则。内部控制应随着托管业务经营战略、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改变及时进行相应的修订和完善。

(6)防火墙原则。核算、清算、稽核监察等相关部门,应当在制度上和人员上适当分离,办公网和业务网分离,部门业务网和全行业务网分离,以达到风险防范的目的。

4、内部控制措施

(1)完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务管理办法》、《招商银行托管业务内控管理办法》和《招商银行证券投资基金托管业务操作规程》等一系列规章制度,从资产托管业务操作流程、会计核算、岗位管理、档案管理、保密管理和信息管理等方面,保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。为保障托管资产安全和托管业务正常运作,切实维护托管业务各当事人的利益,避免托管业务危机事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理,招商银行还制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》,并建立了灾难备份中心,各种业务数据能及时在灾难备份中心进行备份,确保灾难发生时,托管业务能迅速恢复和不间断运行。

(2)经营风险控制。招商银行资产托管部托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理、差错处理等一系列完整的操作规程,有效地控制业务运作过程中的风险。

(3)业务信息风险控制。招商银行资产托管部通过数据加密传输、业务信息启动异地自动备份功能、业务信息磁带备份并由专人签收保存等措施保证业务信息及数据传递的安全性。业务信息不得泄漏,有关人员如需调用,须经总经理室审批,并做好调用登记。

(4)客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务运作过程中形成的客户资料,视同会计资料保管。客户资料不得泄露,有关人员如需调用,须经总经理室成员审批,并做好调用登记。

(5)信息技术系统风险控制。招商银行资产托管部对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房空间隔离并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、与全行业务网双分离制度,与外部业务机构实行防火墙保护等,保证信息技术系统的安全。

(6)人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制,有效的进行人力资源控制。

(五)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

根据《基金法》、《运作办法》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定,应及时以书面形式通知基金管理人进行整改,整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定,应当拒绝执行,立即通知基金管理人限期改正,如基金管理人未能在通知期限内纠正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示,基金管理人应在规定时间内答复并改正,或就基金托管人的疑义进行解释或举证;对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的,基金托管人应报告中国证监会。

三、相关服务机构

(一) 销售机构

1、直销机构

中信基金管理有限责任公司

注册地址:广东省深圳市笋岗路12号中民时代广场B座33层

法定代表人:王东明

直销中心地址:北京市朝阳区裕民路12号中国国际科技会展中心A座5层

直销咨询电话:(010)82251898

传 真:(010)82253378

联系人:刘妮

2、代销机构

(1)交通银行股份有限公司

住所:上海市浦东新区银城中路188号

办公地址:上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人:蒋超良

客户服务电话:95559

网站:www.bankcomm.com

(2)招商银行股份有限公司

住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人:秦晓

客户服务电话:95555

电话:0755-83195540

传真:0755-83195061

联系人:鲍剑

(3)中信银行股份有限公司

住所:北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座

办公地址:北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座

法定代表人:孔丹

客户服务电话:95558

电话:010-65541405

传真:010-65541281

联系人:秦莉

(4)北京银行

住所:北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人:阎冰竹

客户服务电话: 010-96169

电话: 010-66223248

传真: 010-66223314

联系人:杨永杰

(5)中信证券股份有限公司

住所:深圳市罗湖区湖贝路1030号海龙王大厦

办公地址:北京朝阳区新源南路6号京城大厦

法定代表人:王东明

电话:010-84683893

传真:010-84865560

联系人:陈忠

(6)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:上海市延平路135号

法定代表人:祝幼一

客户服务电话:400-8888-666

传真:021-62152814

联系人:芮敏祺

(7)中信建投证券有限责任公司

住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市朝阳门内大街188号

法定代表人:张佑君

客户服务电话:400-8888108

电话:010-85130588

传真:010-65182261

联系人:权唐

(8)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38–45层

办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38–45层

法定代表人:宫少林

电话:0755-82943666

传真:0755-82943636

联系人:黄健

(9)中信万通证券有限责任公司

住所:青岛市崂山区香港东路316号

办公地址:青岛市市南区东海西路28

法定代表人:史洁民

电话:0532-85022026

传真:0532-85022026

联系人:丁韶燕

(10)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A座26楼

办公地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心A座26楼

法定代表人:吴晋安

电话:0351-8686703

传真:0351-8686709

联系人:张治国

(11)中国银河证券股份有限公司

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:肖时庆

电话:010-66568047

传真:010-66568536

联系人:李洋

(12)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:上海市广东路689号

法定代表人:王开国

客户服务电话:400-8888-001

电话:021-23219275

传真:021-63410456

联系人:李笑鸣

(13)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

办公地址: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:025-84457777-950

传真:025-845798763

联系人:李金龙

(14)中信金通证券有限责任公司

住所:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

办公地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

法定代表人:刘军

电话:0571-85783750

传真:0571-85783771

联系人:龚晓

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。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市(网点),并另行公告。

(二) 注册登记机构

中信基金管理有限责任公司

注册地址:广东省深圳市笋岗路12号中民时代广场B座33层

办公地址:北京市朝阳区裕民路12号中国国际科技会展中心A座8层

法定代表人:王东明

联系人:杨军智

电话:(010)82028888

传真:(010)82553396

(三) 律师事务所和经办律师

名称:国浩律师集团(北京)事务所

地址:北京东城区建国门内大街贡院六号E座9层

负责人:张涌涛

电话:(010)65171188

传真:(010)65176800

经办律师:黄伟民、刘伟宁

联系人:刘伟宁

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称:安永华明会计师事务所

地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城东三办公楼16层

法定代表人:葛明

电话:(010)65246688

传真:(010)85188298

经办注册会计师:成超 张小东

联系人:杨振辉

四、基金的名称

中信现金优势货币市场基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

在保持安全性、高流动性的前提下获得高于业绩比较基准的回报。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的货币市场工具,主要包括以下:现金;一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)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。

在有关法律法规允许交易所短期债券可以采用摊余成本法估值前,本基金暂不投资于交易所短期债券。

八、基金的投资策略

结合货币市场利率的预测与现金需求安排,采取现金流管理策略进行短期货币工具投资,以便在保证基金资产的安全性和流动性的基础上,获得较高的收益。

结合货币市场利率的预测与现金需求安排,采取现金流管理策略进行货币市场工具投资,以便在保证基金资产的安全性和流动性的基础上,获得较高的收益。

研判货币市场利率:货币市场利率预测是进行货币市场投资的基础,本基金建立利率分析系统,通过分析国内外宏观经济走势、央行的货币政策以及公开市场操作、市场资金面的宽松程度等对货币市场利率的走势进行预测。

根据货币市场利率水平的预测确定组合的平均剩余期限。当预测货币市场利率上升时,适当缩短投资组合的平均剩余期限,预测利率水平降低时,适当延长投资组合的剩余期限。平均剩余期限决定了组合的风险收益水平,本基金的平均剩余期限控制在180天之内。

结合收益率曲线的研究进行利率期限结构管理,确定组合期限结构的分布方式,合理配置不同期限品种的配置比例。

在确定组合剩余期限和期限结构分布的基础上,根据各品种的流动性、收益性以及信用风险等确定各子类资产的配置权重,即确定短期债券、央行票据、回购以及现金等资产的比例。

采取现金流管理策略,在动态分析、规划、测算组合内生现金流、申购赎回净现金流的基础上,合理配置和动态调整组合现金流。在满足日常流动性要求的基础上,最大限度减少冲击成本,实现组合流动性要求和收益率期望的合理配置。

运用系统化的量化分析策略,寻求无风险的套利机会,在规避市场波动的同时获取更高的投资收益。

本基金将本着谨慎性原则投资资产支持证券,按照资产支持证券定价模型对资产支持证券进行定价,通过持续的信用评级分析和跟踪、量化模型评估、投资限额控制等方法对资产支持证券投资进行有效的风险评估和控制,并在此基础上提高组合收益。基金管理人将综合运用久期管理、个券选择、信用产品交易策略等各种策略,精选品种,为基金持有人获取长期稳定收益。

九、基金的业绩比较标准

本基金以中国人民银行公布的一年期定期存款税后收益率作为业绩比较基准。

十、基金的风险收益特征

本基金投资于货币市场工具,属于低风险品种。

十一、基金的投资组合报告

1、报告期末基金资产组合

资产组合	金额(单位:人民币元)	占基金总资产比例(%)
债券投资	376,566,706.87	80.78
买入返售证券	70,000,789.90	15.02
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	18,812,119.13	4.04
其他资产	782,450.89	0.16
合计	466,162,066.79	100.00

注:银行存款和清算备付金合计中无定期存款。

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(单位:人民币元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	3,580,705,168.10	7.78
	其中:买断式回购融资	968,111,852.40	2.25
2	报告期末债券回购融资余额	0.00	0.00
	其中:买断式回购融资	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	105
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	163
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	73

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	16.93	0.00
2	30天(含)—60天	14.93	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	10.69	0.00
3	60天(含)—90天	10.66	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	6.42	0.00
4	90天(含)—180天	46.70	0.00
5	180天(含)—397天(含)	8.60	0.00
	合 计	97.82	0.00

4、报告期末债券投资组合

①期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(单位:人民币元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	0.00	0.00
2	金融债券	79,620,529.91	17.10
	其中:政策性金融债	79,620,529.91	17.10
3	央行票据	197,717,629.97	42.47
4	企业债券	99,228,546.99	21.31
5	其他	0.00	0.00
	合 计	376,566,706.87	80.88
	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	79,620,529.91	17.10

②基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量(张) 自有投资	债券数量(张) 买断式回购	成本(单位:人民币元)	占基金资产净值的比例(%)
1	07央行票据02	1,000,000		99,108,926.12	21.29
2	07央行票据18	1,000,000		98,608,703.85	21.18
3	07农发13	500,000		49,753,341.84	10.69
4	07济钢CP01	400,000		40,039,858.37	8.60
5	05农发06	300,000		29,867,188.07	6.42
6	06浦发CP01	200,000		19,765,855.96	4.25
7	06中铝CP02	200,000		19,739,555.17	4.24
8	07中铁建CP01	200,000		19,683,277.49	4.23

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	0.3093%
报告期内偏离度的最低值	0.0654%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1625%

6、投资组合报告附注

①本基金的计价方法

债券(包括票据)采用摊余成本法进行估值,即估值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,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。债券回购按成本法估值。基金持有的银行存款以本金列示,按商定利率逐日计提利息。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在1.0000元。

②本报告期内,本基金不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过报告期末基金资产净值的20%的情况。

③本报告期内需说明证券投资决策程序

A、投资管理组织结构

基金管理人投资管理队伍强调结构化和专业化,实行投资管理委员会指导下的基金经理小组负责制。

B、投资管理程序

研究部和投资部通过国内外宏观经济分析、央行公开市场操作以及市场资金面等因素就货币市场利率进行预测,并向投资管理委员会提交投资策略报告,为本基金的投资管理提供决策依据。

投资管理委员会定期召开会议,并依据产品说明和研究结果确定各类资产配置。如遇重大事项,投资管理委员会及时召开临时会议做出决策。

基金经理小组根据投资管理委员会的决议,参考上述报告,并结合自身对货币市场的分析判断,形成基金投资计划并向交易部下达交易指令。

交易部依据指令制定交易策略,进行具体品种的交易。

研究部定期对投资组合进行风险评估,并提出调整建议,报监察部、股权投资部、固定收益投资部和投资管理委员会。监察稽核部对基金经理的决策是否遵守有关规定进行事后检查。基金经理小组依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险。

④其他资产的构成

序号	其他资产	金额(单位:人民币元)
1	交易保证金	0.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收利息	632,448.67
4	应收申购款	0.00
5	其他应收款	0.00
6	待摊费用	150,002.22
7	其他	0.00
	合计	782,450.89

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资产,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。

本基金合同生效日为2005年4月20日,基金合同生效以来的投资业绩与同期基准的比较如下表所示:

阶 段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差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1个月	0.5117%	0.0083%	0.2964%	0.0004%	0.2153%	0.0079%
过去3个月	0.9563%	0.0068%	0.7739%	0.0013%	0.1824%	0.0055%
过去6个月	1.5209%	0.0054%	1.3639%	0.0014%	0.1570%	0.0040%
过去1年	2.6293%	0.0040%	2.3915%	0.0013%	0.2378%	0.0027%
自基金合同生效起至2007.9.30	5.5459%	0.0035%	5.0623%	0.0011%	0.4836%	0.0024%

提示:过往业绩并不代表未来表现。

十三、费用概览

(一)与基金销售有关的费用

1、本基金不收取申购费用与赎回费用。

2、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。在通常情况下,基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times 0.25\% \div$ 当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提,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付指令,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(二)与基金运作有关的费用

基金管理人的管理费、基金托管人的托管费、证券交易费用、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费、按照国家有关规定可以列入的其它费用。

1、基金管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times 0.33\% \div$ 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,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times 0.10\% \div$ 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首日起2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

3、其它相关的基金运作费用根据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。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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)及其他有关规定,对本基金管理人于2007年12月5日刊登的本基金招募说明书作如下更新:

(一)"一、基金管理人"部分,增加本公司股东股权转让情况,丁楹先生辞去中信基金管理有限责任公司副总经理职务,变更投资管理委员会成员、变更基金经理为李广云先生。

(二)"四、基金托管人"部分,更新了最新发展和财务概况。

(三)"五、相关服务机构"部分,增加及更新了基金管理人、注册登记人及部分销售机构的部分信息,更新会计师事务所经办注册会计师信息。

(四)"六、基金份额的申购、赎回"部分,增加及更新了定期定投部分内容及机构信息。

(五)"七、基金的投资"部分,更新了"基金投资组合报告"部分最近一期基金投资组合报告。

(六)"八、基金的业绩"部分,更新了最近一期基金业绩和同期业绩比较基准的表现。

(七)"十、基金资产的估值"部分,根据证监会规定,因基金实施《企业会计准则》后修改基金资产的估值方法等相关内容。

(八)"十九、对基金份额持有人的服务"部分,更新部分直销机构开户及交易方式。

(九)"二十、其他应披露事项"部分,更新最近期间披露事项内容。

上述内容仅为摘要,须与本《招募说明书》(正文)所载之详细资料一并阅读。

中信基金管理有限责任公司

签署日期:2007年12月5日

上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金在暂停申购期间办理定期定额投资业务的提示性公告

我司管理的上投摩根中国优势证券投资基金(以下简称为"中国优势")自2007年5月11日起公告暂停办理申购及转入业务,上投摩根成长先锋股票型证券投资基金(以下简称为"成长先锋")自2007年6月25日起公告暂停办理申购及转入业务,上投摩根内需动力股票型证券投资基金(以下简称为"内需动力")自2007年6月27日起公告暂停办理申购及转入业务,上投摩根阿尔法股票型证券投资基金(以下简称为"阿尔法")自2007年8月8日起公告暂停办理申购及转入业务。

为满足基金暂停申购期间投资人定期定额投资的需要,我司已完成系统升级等相关准备工作,具备在基金暂停申购期间为基金投资人继续办理定期定额投资业务的能力。同时,各代销机构也积极配合,目前已有交通银行、招商银行、建设银行、广发证券、上海银行等代销机构开通了相关基金在暂停申购期间的定期定额投资业务,其他代销机构也将陆续开通,我司将不再特别公告。敬请广大基金投资者关注各代销机构开通上述业务的公告或垂询有关代销机构。

特此公告。

上投摩根基金管理有限公司

2007年12月5日

关于原隆元证券投资基金份额折算结果的公告

南方基金管理有限公司(以下简称"本公司")根据2007年11月15日发布的《南方隆元产业主题股票型证券投资基金集中申购期基金份额发售公告》于12月4日对原隆元证券投资基金(以下简称"本基金"或"基金隆元")的份额进行了份额折算。经本基金托管人中国工商银行股份有限公司确认,折算前基金隆元份额净值为3.851元,精确到小数点后第9位为3.851241435元。本基金管理人按照1:3.851241435的折算比例将原基金隆元的基金份额进行了折算。折算后,基金份额净值为1.000元,相应地,原基金隆元每份基金份额折算为3.851241435份,折算后基金份额计算保留到小数点后两位。原基金隆元持有人持有的基金总份额由5亿份变更为1,925,620,717.78份,并由注册登记机构进行了持有人份额的登记确认。

根据本公司于11月5日发布的《隆元证券投资基金终止上市公告》,对于原基金隆元份额持有人因未托管股份产生的未领取现金红利共计716,573.40元人民币,本基金管理人已于基金份额折算基准日(即12月4日)按折算后基金份额净值1.000元确认为基金份额716,573.40份,并由注册登记机构进行相应基金份额的登记确认。

投资者可以访问本公司网站(www.nffund.com)或拨打免长途话费的客户服务电话(400–889–8899)咨询相关情况。

特此公告。

南方基金管理有限公司

2007年12月5日

证券代码:600687 股票简称:华盛达 编号:临2007-034

浙江华盛达实业集团股份有限公司股权解押及质押公告

本公司董事会全体成员保证本报告内容的真实、准确和完整,对公告的虚假记载、误导性陈述或重大遗漏负连带责任。

接公司第一大股东华盛达控股集团有限公司和第二大股东浙江中策创业投资有限公司通知,分别将其持有的原质押给中国银行浙江省分行的本公司18105414股(其中限售流通股为18068872股、无限售流通股36542股)和2000000股(其中限售流通股为1085406股、无限售流通股914594股),于2007年11月30日全部解除质押;并于2007年11月30日分别将其持有的本公司18105414股(其中限售流通股为18068872股、无限售流通股36542股)和2000000股(其中限售流通股为1085406股、无限售流通股914594股)重新质押给中国银行浙江省分行,质押期限为2007年11月27日至2008年5月26日。为本公司向中国银行浙江省分行货款作担保。上述股份已在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司分别办理解除质押登记手续及股权质押登记手续。(中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券质押登记证明书编号:ZYD071053、ZYD071054、ZYD071055、ZYD071056)

特此公告。

浙江华盛达实业集团有限公司董事会

2007年12月4日