

长城货币市场证券投资基金

更新的招募说明书摘要

基金管理人:长城基金管理有限公司 基金托管人:华夏银行股份有限公司

长城货币市场证券投资基金经中国证监会2005年4月12日证监基金字【2005】62号文批准发起设立。基金合同于2005年5月30日正式生效。

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书;基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。

本摘要根据本基金的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份额持有人和本基金合同的当事人,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,应仔细阅读基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2007年11月29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)。本招募说明书更新已经本基金托管人华夏银行股份有限公司复核。

基金管理人

(一)基金管理人概况

- 1.名称:长城基金管理有限公司
- 2.注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
- 3.办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
- 4.法定代表人:杨光裕
- 5.组织形式:有限责任公司
- 6.设立日期:2001年12月27日
- 7.电话:0755-23982338 传真:0755-23982328
- 8.联系人:于晓岚

9.管理基金情况:目前管理长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)、久嘉证券投资基金、长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰中信标普300指数型证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城品牌优选股票型证券投资基金八只基金

持股单位	占总股本比例
长城证券有限责任公司	47.66%
东方证券股份有限公司	17.67%
中原信托投资有限公司	17.67%
北方国际信托投资股份有限公司	17.67%
合计	100%

(二)基金管理人主要人员情况

1.董事、监事及高级管理人员介绍

(1)董事

杨光裕先生,中共党员,硕士研究生毕业。历任江西省审计厅办公室主任,长城证券有限责任公司副总裁,现任长城基金管理有限公司董事长。

赵玉华先生,南开大学经济学硕士。历任君安证券有限责任公司投资银行部项目经理、总经理助理、业务董事、北京投行部副总经理,国泰君安证券股份有限公司企业融资部副总经理、常务董事,北京企业融资部董事总经理、部门负责人。现任长城证券有限责任公司投资银行部业务副主管。

杨平先生,北京大学国际MBA学历。历任北京国际信托投资公司外汇部首席交易员、加拿大蒙特利尔银行北京分行资金部和市场部高级经理、中国人民保险(香港)投资有限公司、中国人保资产管理(香港)有限公司、中国人保财险(香港)有限公司投资部总经理。现任长城证券有限责任公司总裁助理。

王国斌先生,中共党员,硕士研究生毕业。历任上海万国证券公司投资银行部融资经理、申银万国证券公司国际业务部融资经理、中国经济开发信托投资公司证券总部总经理助理、东方证券有限责任公司证券投资部总经理、总经理助理兼证券投资业务总部总经理、东方基金管理有限公司总裁、东方证券股份有限公司副总经理兼证券投资管理部业务总部总经理,2006年9月至今任职于东方证券股份有限公司,任公司副总经理。

崔晋军先生,中共党员,硕士研究生毕业,高级会计师。历任中原信托投资有限公司财务部副经理、经理,公司副总经理,现任中原信托投资有限公司总经理。

陆妍女士,1965年出生,1991年毕业于天津理工大学管理信息系统专业,获工学学士学位,1997年毕业于天津大学管理学院,获工学硕士学位。曾任天津国际信托投资公司进出口贸易咨询部部门经理、天津泰达集团证券投资部项目经理,现任北京国际信托投资股份有限公司证券管理总部总经理。

任俊杰先生,大学本科毕业。历任中国人民银行深圳分行处长、深圳金融行业同业协会前任秘书长、赛格投资有限公司(香港注册)董事总经理、祥安证券有限公司(香港联交所会员)董事、中国投资环境协会副理事长,现任深圳怀新企业投资顾问有限公司副总经理。

马原女士,中共党员,研究生毕业。历任最高人民法院法官、副院长、庭长、副院长,中国女法协副会长,中国人民大学兼职教授。

谢志华先生,中共党员,经济学博士。历任湖南国营大通湖农场教师、湘西自治州商业学校教师、北京商学院(现北京工商大学)副院长、北京工商大学校长助理。2003年至今任北京工商大学副校长。

刘彬先生,1964年生,经济学博士。曾任中华工商时报海外部编辑、副主任,中华工商时报财经新闻部主任;中国人民银行深圳分行金融早报社总编辑。现任职于中华工商时报社,曾任总编辑助理,现任副总编辑,兼任北京工商大学教授、中国人民大学信托与基金研究所研究员。

关林戈先生,中共党员,经济学硕士。历任中国汽车贸易公司办公室主任,中共天津市委领导同志秘书,南方证券天津分公司副总经理、常务副总经理,现任长城基金管理有限公司总裁助理,长城基金管理有限公司副总经理、常务副总经理,现任长城基金管理有限公司总经理。

(2)监事

阮争先生,大学本科毕业。历任黄河证券有限责任公司发行部经理,港澳信托投资有限公司信托基金部投资经理,中国电力信托投资有限公司投资基金部经理,现任中原信托投资有限公司投资管理部副经理,并担任长城基金管理有限公司监事长。

罗世蓉女士,大学本科毕业,会计师。历任四川轻工业学院学校财经教研室主任,海南信托投资公司证券部主办会计,长城证券总部财务主管、长城证券总部深圳二部财务部经理,长城证券有限责任公司成都营业部副总经理兼财务部经理,深圳一部副总经理兼财务部经理,公司审计部总经理,公司审计部副经理,现任长城基金管理有限公司财务部副经理。

张建强先生,中共党员,硕士研究生毕业。历任上海浦东发展银行信托证券发行部科员,东方证券股份有限公司经济业务管理总部辽宁管理总部副经理、总经理,现任东方证券股份有限公司资金管理总部总经理。

田德良先生,1966年生,2006年毕业于中央广播电视大学会计学专业,经济师。曾任任职于中国建设银行天津开发区分行,任经理助理、事后稽核。现任职于北方国际信托投资公司,曾任会计部副经理助理,会计部副经理、会计部经理、监察稽核部副经理、项目评估部项目经理、业务发展总部客户经理,现任自营业总部项目经理。

桑晓先生,中共党员,经济学学士。曾任职于中国人民银行山东日照市分行,中国建设银行山东省分行、中国建设银行总行基金托管部。2002年8月进入长城基金管理有限公司,历任市场发展部业务主管、运行保障部副经理、运行保障部副经理,现任公司总经理助理兼市场部开发部副经理。

韩朝先生,中共党员,1969年毕业于中国人民银行研究生部,经济学硕士。曾任国信证券发展研究中心研究员。2001年7月进行长城基金管理有限公司,历任研究员、长城久恒基金经理,现任基金管理部副经理。

(3)高级管理人员

杨光裕先生,长城基金管理有限公司董事长,简历同上。

关林戈先生,长城基金管理有限公司董事、总经理,简历同上。

余俊先生,硕士研究生毕业。曾任教于中国地质大学经济学院,历任中国民生银行湖北分行科委负责人,君安证券有限公司研究部宏观室负责人,长城证券有限责任公司营业部总经理,长城基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总经理,现任长城基金管理有限公司副总经理兼综合管理部副经理。

汪秋先生,中共党员,博士研究生毕业。曾就职于中国人民银行河南省分行教育处,海南港澳国际信托投资公司证券部,历任三亚东方实业股份有限公司副总经理,国信证券有限责任公司研究所所长,长城基金管理有限公司总经理助理,并先后兼任研究策划部总经理、市场开发部总经理,现任长城基金管理有限公司副经理。

韩浩先生,硕士研究生毕业。历任长城证券有限责任公司资产管理部副经理,长城基金管理有限公司投资总监兼投资管理总部总经理,“久嘉证券投资基金”基金经理、总经理助理,“长城久恒平衡型证券投资基金”基金经理,现任长城基金管理有限公司副总经理、投资总监兼基金管理部副经理。

彭洪斌先生,经济学硕士,MBA。曾就职于长城证券有限责任公司,历任深圳龙岗营业部电脑部经理,公司电子商务部项目经理,公司计部技术主管。2002年3月加盟长城基金管理有限公司,历任监察稽核部业务主管、部门副经理、部门经理,现任长城基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总经理。

2.本基金基金经理简历

刘海先生,生于1978年,1999年毕业于清华大学经济管理学院国际金融与财务管理专业,经济学学士。曾就职于深圳发展银行总行,任信贷交易员。2005年6月进入长城基金管理有限公司,曾任“长城货币市场证券投资基金”基金经理,自2006年3月9日起任“长城货币市场证券投资基金”基金经理。

“长城货币市场证券投资基金”历任基金经理如下:黄瑞庆先生自2005年5月30日至2005年9月24日任基金经理,王元庆先生自2005年9月25日至2006年3月8日任基金经理。

3.本基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务如下:

关林戈先生,投资决策委员会主席,公司董事、总经理。

韩浩先生,投资决策委员会执行委员,公司副总经理、投资总监兼基金管理部总经理。

汪秋先生,投资决策委员会委员,公司副总经理。

4.上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基本情况

- 1.名称:华夏银行股份有限公司
- 2.注册地址:北京市东城区建国门内大街22号
- 3.办公地址:北京市东城区建国门内大街22号
- 4.法定代表人:董炳祥
- 5.组织形式:股份有限公司
- 6.成立日期:1992年10月14日

7.批准设立机关及批准设立文号:中国人民银行[银复(1992)391号]

8.基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基金字[2005]125号

9.注册资本:42亿元人民币

10.存续期间:持续经营

11.联系人:郑鹏

12.电话:010-85238418

13.传真:010-85238830

14.客户服务电话:95677

(二)基金托管业务主要人员情况

华夏银行基金托管部成立于2004年7月,内设市场综合室、交易管理室和稽核室3个职能处室,并在上海、深圳分别设立2个托管分部。基金托管部共有员工17人,全部具有基金从业资格,高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

(三)基金托管业务经营情况

华夏银行于2005年2月23日经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会核准,获得证券投资基金托管资格,是《证券投资基金法》和《证券投资基金托管业务管理办法》实施取得证券投资基金托管资格的第一家银行。自成立以来,华夏银行基金托管部本着“诚实信用、勤勉尽责”的行业精神,始终遵循“安全保管基金资产,提供优质托管服务”的原则,坚持以客户为中心的服务理念,依托严格的内控管理、先进的技术系统、优秀的业务团队、丰富的业务经验,严格履行法律和托管协议所规定的各项义务,为“大基金”份额持有人和资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优异业绩。截至2007年9月末,已托管长城货币市场基金、国联安德德精选股票基金、万家货币市场基金、诺安

中短债基金、益民红利成长混合型基金等5只开放式证券投资基金和10只其它受托资产产品,托管各类资产规模134.48亿元。

三、相关服务机构

(一)直销机构

- 1.直销机构名称:长城基金管理有限公司
- 2.注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
- 3.办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
- 4.法定代表人:杨光裕
- 5.电话:0755-23982338
- 6.传真:0755-23982328
- 7.联系人:黄金奕
- 8.客户服务热线:400-8868-666
- 9.网站:www.cfwfund.com.cn
- 10.代销机构名称:华夏银行股份有限公司
- 11.注册地址:北京市东城区建国门内大街22号
- 12.办公地址:北京市东城区建国门内大街22号
- 13.法定代表人:董炳祥
- 14.联系人:陈宇
- 15.电话:010-85238423
- 16.传真:010-85238880
- 17.客户服务热线:95677
- 18.网站:www.hxb.com.cn
- 19.招商银行股份有限公司
- 20.注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
- 21.法定代表人:秦晓
- 22.电话:0755-82909000
- 23.联系人:刘薇
- 24.客户服务热线:95555
- 25.网站:www.cmbchina.com
- 26.中国建设银行股份有限公司
- 27.注册地址:北京市西城区金融大街25号
- 28.办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
- 29.法定代表人:郭树清
- 30.客户服务热线:95533
- 31.网站:www.ccb.com
- 32.交通银行股份有限公司
- 33.注册地址:上海市仙霞路18号
- 34.办公地址:上海市银城中路188号
- 35.法定代表人:蒋超良
- 36.电话:021-58781234
- 37.传真:021-58408842
- 38.联系人:曹榕
- 39.客户服务热线:95599
- 40.网站:www.bank.com.cn
- 41.中信建投证券股份有限公司
- 42.注册地址:北京市朝阳区安立路66号
- 43.办公地址:北京市朝阳门内大街188号
- 44.法定代表人:鞠晓冬
- 45.电话:010-65186758
- 46.联系人:刘畅
- 47.客户服务热线:4008888108
- 48.网站:www.cscs10.com
- 49.海通证券股份有限公司
- 50.注册地址:上海市淮海中路98号
- 51.法定代表人:王开国
- 52.电话:021-53594656
- 53.联系人:金芸
- 54.客户服务热线:021-962503
- 55.网站:www.htsec.com
- 56.国泰君安证券股份有限公司
- 57.注册地址:上海江苏路969号
- 58.办公地址:上海江苏路135号
- 59.法定代表人:祝幼一
- 60.联系人:芮静祺
- 61.电话:021-62580818-213
- 62.传真:021-62589400
- 63.客户服务热线:4008888666
- 64.网站:www.gtja.com
- 65.东方证券股份有限公司
- 66.注册地址:上海市浦东大道720号20楼
- 67.法定代表人:王益民
- 68.电话:0755-83516094
- 69.传真:0755-83516198
- 70.客户服务热线:0755-82288968
- 71.网站:www.cf8.com.cn
- 72.中国银河证券股份有限公司
- 73.注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
- 74.法定代表人:朱利
- 75.联系人:郭京华
- 76.客户服务热线:9008201888
- 77.网站:www.chinastock.com.cn
- 78.招商证券股份有限公司
- 79.注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
- 80.法定代表人:宫少生
- 81.电话:0755-82943371
- 82.传真:0755-82943237
- 83.联系人:黄健
- 84.客户服务热线:4008888111、0755-26951111
- 85.网站:www.newone.com.cn
- 86.平安证券股份有限公司
- 87.办公地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦二楼
- 88.法定代表人:李宇
- 89.联系人:杨秀勇
- 90.客户服务热线:0755-82456026
- 91.传真:0755-82433794
- 92.客户服务热线:95511
- 93.华泰证券股份有限公司
- 94.注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
- 95.法定代表人:吴万善
- 96.电话:025-84457777-882、721
- 97.联系人:张雪瑾、袁红彬
- 98.客户服务热线:025-84579897
- 99.申银万国证券股份有限公司
- 100.注册地址:上海市常熟路171号
- 101.办公地址:上海市常熟路171号
- 102.法定代表人:丁国荣
- 103.电话:021-54032888
- 104.传真:021-54033333
- 105.客户服务热线:021-962503
- 106.公司网站:www.sw2000.com.cn
- 107.渤海证券股份有限公司
- 108.办公地址:天津市河西区大道3号
- 109.法定代表人:张卫军
- 110.联系人:徐焕强
- 111.客户服务热线:022-28455588
- 112.公司网站:www.eew.com.cn
- 113.江南证券有限责任公司
- 114.注册地址:江西省南昌市抚河北路291号
- 115.法定代表人:姚江涛
- 116.联系人:方敏才
- 117.电话:0791-6772501
- 118.传真:0791-6789414
- 119.网站:www.jzsc.com.cn
- 120.华西证券有限责任公司
- 121.注册地址:四川省成都市陕西路239号
- 122.办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼(深圳总部)
- 123.法定代表人:张慎峰
- 124.联系人:杨玲
- 125.电话:0755-83025430
- 126.传真:0755-83025991
- 127.客户服务热线:4008-888-818
- 128.公司网站:www.hx168.com.cn
- 129.国盛证券有限责任公司
- 130.注册地址:江西省南昌市永叔路15号
- 131.办公地址:江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼
- 132.法定代表人:曾荣升
- 133.联系电话:0791-6296337
- 134.联系人:徐美云
- 135.网站:www.gststock.com
- 136.国信证券股份有限公司
- 137.注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦
- 138.法定代表人:何如
- 139.联系人:林建雄
- 140.电话:0755-82133066
- 141.传真:0755-82133302

客户服务电话:800-810-8868
公司网址:www.quoson.com.cn
(21)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10.25层
法定代表人:王政
联系人:范雪玲
电话:0755-82492000
客户服务热线:400-8888-555、0755-26125666
网站:www.lhzq.com

(22)广州证券有限责任公司
注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼5楼
法定代表人:吴志明
联系人:薛琳
电话:020-87322668
传真:020-87325036
客户服务电话:020-9613003
网站:www.gzsc.com.cn
(23)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40-42楼
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
法定代表人:段强
联系人:刘亚辉
电话:0755-83199511
传真:0755-83199545
客户服务热线:0755-83199511
网站:www.ssc.com.cn

(24)齐鲁证券有限责任公司
注册地址: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:李伟
电话:0531-81283728
传真:0531-81283735
联系人:傅咏梅
网站:www.qzq.com.cn
客户服务电话:0531-82084184
(25)中信万通证券有限责任公司
注册地址:青岛市市南区香港东路316号
办公地址:青岛市东海西路28号
法定代表人:史吉涛
联系电话:0632-86022026
传真:0632-86022025
联系人:丁鹏辉
公司网站:www.zwt.com.cn
客户咨询电话:0532-96577
基金管理人可根据情况增加或者减少代销机构,并另行公告。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)基金注册登记机构
名称:长城基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
法定代表人:杨光裕
电话:0755-23982338
传真:0755-23982328
联系人:杜京泉
客户服务电话:400-8868-666

(三)律师事务所与经办律师
律师事务所名称:北京市金杜律师事务所
注册地址:北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层
负责人:王玲
经办律师:靳庆军、宋萍萍
电话:0755-22163333
传真:0755-22163380

联系人:宋萍萍
(四)会计师事务所/经办注册会计师
会计师事务所名称:深圳大华天诚会计师事务所
注册地址:深圳市福田区滨河大道5022号联合广场B座11楼
负责人:李秉心
经办注册会计师:李秉心、徐海宁
电话:0755-82900962
传真:0755-82900965

四、基金名称
本基金名称:长城货币市场证券投资基金
五、基金类型
本基金类型:契约型开放式
六、基金的投资目标
在本金安全和保持流动性的前提下,寻求货币资产稳定的收益。
七、基金的投资对象
本基金投资于国内依法发行、高信用等级,具有一定剩余额到期限的债券、央行票据、回购,以及法律法规允许投资的其他金融工具。包括: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397天以内(含397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它具有良好流动性的货币市场工具。

八、基金的投资策略
1、一级资产配置策略
根据宏观经济研究(利率水平、CPI指标、GDP增长率、货币供应量、可比市利率水平、主要币种汇率水平等),分析市场趋势和政府政策变化,决定基金投资组合的平均剩余期限。
根据债券的信用评级及担保状况,决定组合的信用风险级别。
根据当前市场的实际情况以及相关法律法规的规定,长城货币市场基金的投资组合配置比例范围为:二级市场配置0—80%,回购0—70%,短期债券0—80%,同业存款、现金比例0—70%。
2、资产配置策略
根据不同类别资产的剩余期限结构、流动性指标、二级市场存量、二级市场交易量、交易场所等,收益水平、回购收益率、票面利率、付息方式、利息税务条款、附加期权价值、类别资产配置率差异等,市场偏好、法律法规对货币市场基金的限制、基金合同、目标收益、业绩比较基准、估值方式等因素决定不同类别资产的配置比例。
3、三级资产配置策略
根据投资组合的剩余期限、资信等级、流动性指标,确定构建基金投资组合的投资品种。

根据对个券收益率水平、剩余期限、流动性状况的权衡,参照收益目标确定个券投资品种与投资数量。
九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:税后一年期银行定期存款利率。
在合理的业绩比较基准提出的情况下,本基金管理人可根据投资目标、投资方向和投资策略,确定变更业绩比较基准,并提前公告。

基金的风险收益特征
本基金为货币市场基金,属于中属于高流动性、低风险品种,其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。
十、投资组合报告
本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,并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
本基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2007年10月19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。

本报告期为2007年7月1日至2007年9月30日止,本报告财务资料未经审计。

1.报告期末基金资产组合

资产组合	金额(元)	占基金总资产的比例
债券投资	258,002,418.65	78.03%
买入返售债券	67,000,753.79	20.26%
其中:买断式回购的买入返售债券	0.00	0.00%
资产支持证券	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金合计	3,001,740.25	1.15%
其他资产	1,841,703.98	0.56%
合计	330,646,651.47	100.00%

2.报告期末债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例
1.	报告期内债券回购融资余额	970,545,379.42	2.06%
	其中:买断式回购融资	0.00	0.00%
2.	报告期末债券回购融资余额	19,589,850.60	6.34%
	其中:买断式回购融资	0.00	0.00%

本报告期末,本基金未出现债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

3.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	82
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	129
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	4

在本报告期内,本基金投资组合平均剩余期限未发生违规超过180天的情况。

4.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	49.10%	6.34%
2.	30天(含)-60天	16.11%	0.00%
3.	60天(含)-90天	0.00%	0.00%
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	0.00%	0.00%	0.00%
4.	90天(含)-180天	32.03%	0.00%
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	12.84%	0.00%	0.00%
5.	180天(含)-397天(含)	9.40%	0.00%
合计		106.64%	6.34%

5.报告期末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	119,770,948.98	38.72%
其中:政策性金融债	80,041,767.11	25.88%	
3.	央行票据	138,231,469.67	44.69%
4.	企业债券	0.00	0.00%
5.	其他	0.00	0.00%
合计		258,002,418.65	83.41%
剩余存续期超过397天的浮动利率债券		39,729,181.87	12.84%

6.报告期末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国开13	800,000	0	80,041,767.11	25.88%
2.	07央行票据12	600,000	0	59,331,756.35	19.18%
3.	07央行票据89	500,000	0	49,819,394.57	16.11%
4.	05央行02序	400,000	0	39,729,181.87	12.84%
5.	07央行票据94	300,000	0	29,060,318.75	9.40%

7.报告期末基金投资前十名资产支持证券明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8、“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
报告期末偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.05%区间次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0644%
报告期内偏离度的最低值	-0.1904%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0353%

9.投资组合报告附注

(1)基金资产估值方法说明
本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。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。

本基金通过每日分红使得基金份额的净值始终维持在1.0000元。

(2)本基金在本报告期内未出现过剩余期限小于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20%的情况。

(3)本报告期内需说明的证券投资决策程序
本基金的投资决策程序采用团队投资和基金经理负责制相结合的方式。投资团队由基金经理、固定收益研究员、交易员以及金融工程师共同构成,具有研究交叉一体化的便利,并充分利用通过金融工程平台从事定量分析这一独特优势,为基金持有人创造更多的价值。

本基金的投资决策程序主要包括以下四个重要环节:

① 公司投资决策委员会每季度定期根据基金合同的约定以及公司投资风格的选择确定基金投资风险