# 安信现金管理货币市场基金更新招募说明书摘要

（2013年第1号）

## 基金管理人：安信基金管理有限责任公司
## 基金托管人：中国建设银行股份有限公司

本招募说明书（更新）摘要内容截止日：2013年8月5日

**重要提示**

安信现金管理货币市场基金的募集申请于2012年12月10日经中国证监会证监许可[2012]1649号文核准。本基金基金合同于2013年2月5日正式生效。

投资有风险，投资者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，应详细查阅本基金的基金合同。

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。

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，投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金管理人不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩中的数据已经本基金托管人复核。除非另有说明，本招募说明书（更新）所载内容截止日为2013年8月5日，有关财务数据和净值表现截止日为2013年6月30日（财务数据未经审计）。

**一、基金管理人**

（一）基金管理人概况

名称：安信基金管理有限责任公司

住所：广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层

法定代表人：牛冠兴

成立时间：2011年12月6日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监许可〔2011〕1895号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2亿元人民币

存续期间：永续经营

联系人：王阳

联系电话：0755-82509999

公司的股权结构如下：

| 股东名称 | 持股比例 |
|---|---|
| 安信证券股份有限公司 | 49% |
| 五矿资本控股有限公司 | 36% |
| 中广核财务有限责任公司 | 15% |

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

牛冠兴先生，董事长，经济学硕士。历任武汉市人民银行硚口支行信贷员，武汉市工商银行古田办事处主任，武汉市工商银行汉岸支行行长，武汉市工商银行副行长，招商银行总行信贷部总经理，招商证券股份有限公司总经理，招商基金管理有限公司董事长，南方证券行政接管组及广东证券托管组组长。现任安信证券股份有限公司董事长、安信基金管理有限责任公司董事长，中国证券业协会副会长。

王连志先生，董事，经济学硕士。历任长城证券有限责任公司投行部经理，中信证券股份有限公司投行部经理，第一证券有限责任公司副总经理，安信证券股份有限公司副总经理。现任安信基金管理有限责任公司总经理。

李军先生，董事，经济学硕士。历任深圳市罗湖工业研究所经理，深圳证券电脑公司经理，深圳证券交易所人事部助理总监、西南中心主任、上市审查部副总监、市场监察部副总监、会员管理部副总监，中国科技证券有限责任公司托管组组长。现任安信证券股份有限公司副总经理。

任珠峰先生，董事，经济学博士。历任中国五金矿产进出口总公司财务部科员、有色部经理、上海公司副总经理，英国金属矿产有限公司小有色、铁合金及矿产部经理，五矿投资发展有限责任公司资本运营部总经理、五矿投资发展有限责任公司副总经理。现任五矿资本控股有限公司（原五矿投资发展有限责任公司）总经理兼五矿证券有限公司董事长。

王晓东先生，董事，经济学硕士。历任中国五金矿产进出口总公司财务部科员，日本五金矿产株式会社财务部科员，中国外贸金融租赁有限公司副总经理，中国五矿集团公司财务总部副总经理。现任五矿资本控股有限公司（原五矿投资发展有限责任公司）副总经理。

李益翔先生，董事，工商管理硕士。历任岭澳核电有限公司电气工程师，中国广东核电集团有限公司财务部电力市场分析员、研究中心战略与策略研究员、战略规划部规划管理主任，中广核财务有限责任公司资金部战略规划高级经理。现任中广核财务有限责任公司投资银行部总经理。

徐景安先生，独立董事，1964年毕业于复旦大学新闻学专业。历任中央马列主义研究院干部，中共中央宣传部研究室干部，北京军区炮兵政治部教员，国家计划委员会研究室科长，国务院经济体制改革办公室科长，国家经济体制改革委员会处长，中国经济体制改革研究会副所长，深圳市经济体制改革委员会主任，深圳市士必达国际投资公司董事长，深圳市徐景安投资顾问公司董事长。现任深圳市景安文化传播公司董事长。

高正平先生，独立董事，管理学博士。曾任天津财经大学教授。现任天津财经大学珠江学院院长、教授。

郑斌先生，独立董事，法学硕士。历任中央组织部干部，国家国有资产管理局综合司副处长，北京市正平律师事务所主任。现任北京市金诚同达律师事务所高级合伙人。

2、基金管理人监事会成员

王晓荷女士，监事会主席，经济学硕士。曾任中国证券监督管理委员会干部。现任安信证券股份有限公司监事会主席。

刘国威先生，监事，工商管理硕士。历任五矿集团财务有限责任公司资金部副经理、经理，香港企荣财务有限公司资金部高级经理，五矿投资发展有限责任公司综合管理部副总经理、规划发展部总经理、资本运营部总经理，中国五矿集团公司金融业务中心资本运营部总经理兼五矿投资发展有限责任公司纪委委员。现任中国五矿集团公司金融业务中心副总经理兼金融业务中心资本运营部总经理。

姜志刚先生，职工监事，理学硕士。历任中国银行股份有限公司深圳软件开发中心高级程序员，深圳发展银行股份有限公司总行电脑部项目经理，招商证券股份有限公司信息技术中心主机开发工程师，安信证券股份有限公司信息技术部副总经理。现任安信基金管理有限责任公司运营部总经理。

3、公司高管人员

王连志先生，董事，总经理，经济学硕士。简历同上。

汪建先生，副总经理，经济学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究所研究员，衍生产品部一级研究员、董事总经理，资产委托管理总部副总经理。现任安信基金管理有限责任公司副总经理，分管投资、研究业务。

孙晓奇先生，督察长，经济学硕士。历任上海石化董事会秘书室高级经理，上海证券交易所债券基金部执行经理。现任安信基金管理有限责任公司督察长。

4、本基金基金经理

李勇先生，经济学硕士。历任中国农业银行股份有限公司总行金融市场部交易员、高级投资经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部总经理。2013年2月5日至今，任安信现金管理货币市场基金的基金经理；2012年9月25日至今，任安信目标收益债券型证券投资基金的基金经理；2012年12月18日至今，任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理。

5、基金投资决策委员会成员

主任委员：

王连志先生，董事，总经理，经济学硕士。简历同上。

委员：

汪建先生，副总经理，经济学硕士。简历同上。

陈振宇先生，经济学硕士。历任大鹏证券有限责任公司证券投资部经理、资产管理部总经理，招商证券股份有限公司福民路证券营业部总经理，安信证券股份有限公司资产管理部副总经理（主持工作）、证券投资部副总经理（主持工作）。现任安信基金管理有限责任公司总经理助理兼基金投资部总经理。

姜诚先生，经济学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司资产委托管理总部助理研究员、研究员、投资经理。现任安信基金管理有限责任公司研究部总经理。

李勇先生，经济学硕士。简历同上。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

**二、基金托管人**

（一）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：王洪章

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010) 67595096

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，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原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继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：939)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股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

截至2012年12月31日，中国建设银行资产总额139,728.28亿元，较上年末增长13.77%。2012年，中国建设银行实现净利润1,936.02亿元，较上年同期增长14.26%。年化资产回报率为1.47%，年化加权净资产收益率为21.98%。利息净收入3532.02亿元，较上年同期增长15.97%。净利差为2.58%，净利息收益率为2.75%，均较上年同期提高0.01个百分点。手续费及佣金净收入962.18亿元，较上年同期增长7.51%。

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、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、墨尔本设有分行，在莫斯科、台北设有代表处，海外机构已覆盖到全球13个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行26家，拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

2012年，本集团各方面良好表现，得到市场与社会各界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的30多个重要奖项。在英国《银行家》杂志联合Brand Finance发布的"世界银行品牌500强"以及Interbrand发布的"2012年度中国最佳品牌"中，位列中国银行业首位；在美国《财富》杂志"世界500强排名"中列第77位，较上年上升31位。此外，本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、投资者关系和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工210人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

杨新丰，投资托管业务部总经理，曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2012年12月31日，中国建设银行已托管285只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行在2005年及自2009年起连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为"中国最佳托管银行"，在2007年及2008年连续被《财资》杂志评为"国内最佳托管银行"奖，并获和讯网2011年度和2012年度中国"最佳资产托管银行"奖，和境内权威经济媒体《每日经济观察》2012年度"最佳基金托管银行"奖。

**三、相关服务机构**

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

名称：安信基金管理有限责任公司

住所：广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈婕

电话：0755－82509820

传真：0755－82509920

客户服务电话：4008-088-088

公司网站：www.essencefund.com

2、代销机构

（1）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：王洪章

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

（2）中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：蒋超良

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

（3）安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

法定代表人：牛冠兴

客户服务电话：400-800-1001

网址：www.essence.com.cn

（4）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

法定代表人：宫少林

客户服务电话：95565

网址：www.newone.com.cn

（5）海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路98号

法定代表人：王开国

客户服务电话：95553

网址：www.htsec.com

（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

法定代表人：万建华

客户服务电话：400-888-8666

网址：www.gtja.com

（7）中信证券股份有限公司

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层

法定代表人：王东明

客户服务电话：95558

网址：www. citics.com

（8）中信证券（浙江）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

法定代表人：沈强

客户服务电话：0571-95698

网址：www.bigsun.com.cn

（9）中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人：张智河

客户服务电话：96577

网址：www.zxwt.com.cn

（10）上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼

法定代表人：其实

客户服务电话：400-181-8188

网址：www.1234567.com.cn

（11）上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路526号2幢

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：400-089-1289

网址：www.erichfund.com

（12）杭州数米基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：400-076-6123

网址：www.fund123.cn

（13）和讯信息科技有限公司

住所：上海市浦东新区东方路18号保利大厦E座18层

法定代表人：王莉

客户服务电话：400-920-0022

网址：licaike.hexun.com

（二）基金份额登记机构

名称：安信基金管理有限责任公司

住所：广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层

法定代表人：牛冠兴

联系人：魏峰

电话：0755－82509861

传真：0755－82560289

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路68号19楼

办公地址：上海市银城中路68号19楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

法定代表人：Ng Albert Kong Ping 吴港平

电话：（010）58153000、（0755）25028288

传真：（010）85188298、（0755）25026188

签章注册会计师：张小东、陈立群

联系人：李妍明

**四、基金名称**

安信现金管理货币市场基金

**五、基金类型**

契约型开放式

**六、投资目标**

在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，通过积极主动的投资组合，力求为投资者获得超过业绩比较基准的收益。

**七、投资范围**

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括：

1、现金；

2、通知存款；

3、短期融资券；

4、1年以内（含1年）的银行定期存款、大额存单；

5、剩余期限在397天以内（含397天）的债券；

6、剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券；

7、剩余期限在397天以内（含397天）的中期票据；

8、期限在1年以内（含1年）的债券回购；

9、期限在1年以内（含1年）的中央银行票据；

10、中国证监会认可的其他具有良好流动性的金融工具。

如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后可以将其纳入投资范围。

**八、投资策略**

1、资产配置策略

本基金通过对国内市场资金供求、利率水平、通货膨胀率、GDP增长率、就业率水平以及国际市场利率水平等宏观经济指标的跟踪和分析，形成对宏观层面的判研。同时，结合对央行公开市场操作、债券供给等情况，对短期利率走势进行综合判断。基于对货币市场利率趋势变化的合理预测，决定并动态调整投资组合平均剩余期限和比例分布。

此外，通过对市场资金供求、基金申赎情况进行动态分析，确定本基金流动性目标，相应调整基金资产在高流动性资产和相对流动性较低资产之间的配比。结合各类资产的收益率水平、流动性特征、信用风险等因素来确定并动态调整投资组合中央行票据、国债、债券回购等投资品种各类属品种的配置比例，以满足投资人对基金流动性的需求，并达到获取投资收益的目的。

2、个券选择策略

本基金将首先考虑安全性因素，优先选择国债、央行票据等高信用等级的债券品种以规避信用风险。同时，在满足信用评级要求的前提下，根据我公司制订的债券评分标准对企业债、金融债等信用债券进行评分筛选。符合标准的个券，将进入备选池，通过收益率拟合，找出收益率明显偏高的券种，并客观分析收益率出现偏离的原因。若出现因市场原因所导致的收益率高于公允水平，该券种价格出现低估，本基金将对此类低估值品种进行重点关注。

3、套利策略

由于市场环境差异、交易市场分割、市场参与者差异、资金供求失衡、流动性等因素造成不同交易市场或不同交易品种出现定价差异现象，从而使债券市场上存在套利机会。在保证安全性和流动性的前提下，本基金将在充分验证这种套利机会可行性的基础上，适当参与市场的套利，捕捉和把握无风险套利机会，以获取安全的超额收益。

4、回购策略

在有效控制风险的条件下，本基金将密切跟踪不同市场和不同期限之间的利率差异，在精确投资收益测算的基础上，积极采取回购杠杆操作，为基金资产增加收益。当债券回购利率低于债券收益率时，通过循环回购以放大债券投资收益。同时，密切关注由于新股申购、增发等原因导致短期资金需求激增的机会，通过逆回购融出资金以把握短期资金利率陡升的投资机会。

5、流动性管理策略

本基金作为现金管理工具，必须保持较高的流动性。在遵循流动性优先的原则下，本基金将建立流动性预警指标，动态调整基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例。同时，密切关注本基金申购/赎回、季节性资金流动等情况，适时通过现金留存、提高流动性券种比例等方式提高基金资产整体的流动性，以确保基金资产的整体变现能力。

**九、业绩比较基准**

本基金的业绩比较基准：七天通知存款利率（税后）

通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金，具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取同期七天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，经基金管理人和基金托管人协商一致后，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

**十、风险收益特征**

本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

**十一、基金投资组合报告**

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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的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截至2013年6月30日，来源于《安信现金管理货币市场基金2013年第2季度报告》。本投资组合报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 固定收益投资 | 100,087,508.41 | 45.99 |
| | 其中：债券 | 100,087,508.41 | 45.99 |
| | 资产支持证券 | — | — |
| 2 | 买入返售金融资产 | 49,600,284.40 | 22.79 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | — | — |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 66,141,905.53 | 30.39 |
| 4 | 其他资产 | 1,790,272.10 | 0.82 |
| 5 | 合计 | 217,619,970.44 | 100.00 |

2、报告期债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 1.45 |
| | 其中：买断式回购融资 | 0.00 |

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | — | — |
| | 其中：买断式回购融资 | — | — |

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

| 序号 | 发生日期 | 融资余额占基金资产净值比例（%） | 原因 | 调整期 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 2013年05月08日 | 20.28 | 基金赎回 | 2个交易日 |
| 2 | 2013年05月09日 | 20.60 | 基金赎回 | 1个交易日 |

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 | 64 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 123 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 59 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

| 序号 | 发生日期 | 平均剩余期限（天数） | 原因 | 调整期 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 2013年05月03日 | 123 | 由于持有的浮动利率债券调息导致该债券剩余期限重新计算 | 2个交易日 |
| 2 | 2013年05月06日 | 123 | 由于持有的浮动利率债券调息导致该债券剩余期限重新计算 | 1个交易日 |

注：本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。根据本基金基金合同的约定，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天。

（2）报告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 | 68.90 | 10.14 |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | — | — |
| 2 | 30天(含)—60天 | 25.29 | — |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 15.25 | — |
| 3 | 60天(含)—90天 | — | — |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | — | — |
| 4 | 90天(含)—180天 | — | — |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | — | — |
| 5 | 180天(含)—397天（含） | 15.21 | — |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | — | — |
| | 合计 | 109.40 | 10.14 |

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | — | — |
| 2 | 央行票据 | — | — |
| 3 | 金融债券 | 30,089,192.38 | 15.25 |
| | 其中：政策性金融债 | 30,089,192.38 | 15.25 |
| 4 | 企业债券 | — | — |
| 5 | 企业短期融资券 | 69,998,316.03 | 35.48 |
| 6 | 中期票据 | — | — |
| 7 | 其他 | — | — |
| 8 | 合计 | 100,087,508.41 | 50.73 |
| 9 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | 30,089,192.38 | 15.25 |

5、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量（张） | 摊余成本（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 130211 | 13国开11 | 300,000 | 30,089,192.38 | 15.25 |
| 2 | 011316002 | 13华电股SCP002 | 200,000 | 20,000,107.17 | 10.14 |
| 3 | 071314001 | 13银河CP001 | 200,000 | 19,999,442.63 | 10.14 |
| 4 | 041359025 | 13三江化工CP001 | 100,000 | 10,000,355.38 | 5.07 |
| 5 | 041359039 | 13镇城投CP001 | 100,000 | 10,000,066.57 | 5.07 |
| 6 | 041360033 | 13青国信CP002 | 100,000 | 9,998,344.28 | 5.07 |

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

6、"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 | 6 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.0663% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.3967% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0727% |

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8、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，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。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

（2）本报告期内本基金持有剩余期限小于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当日基金资产净值20%的情况

| 序号 | 发生日期 | 该类浮动债占基金资产净值的比例 | 原因 | 调整期 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 2013年05月07日 | 22.19 | 大额赎回 | 8个交易日 |
| 2 | 2013年05月30日 | 20.01 | 大额赎回 | 2个交易日 |
| 3 | 2013年06月04日 | 20.13 | 大额赎回 | 10个交易日 |

（3）报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（4）其他资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | — |
| 2 | 应收证券清算款 | — |
| 3 | 应收利息 | 903,017.93 |
| 4 | 应收申购款 | 887,254.17 |
| 5 | 其他应收款 | — |
| 6 | 其他 | — |
| 7 | 合计 | 1,790,272.10 |

**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。

本基金合同生效日为2013 年2月5日，基金合同生效以来（截至2013 年6 月30 日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

1、安信现金管理货币A：

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2013.2.5-2013.6.30 | 1.2217% | 0.0053% | 0.5400% | 0.0000% | 0.6817% | 0.0053% |

2、安信现金管理货币B：

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2013.2.5-2013.6.30 | 1.3201% | 0.0053% | 0.5400% | 0.0000% | 0.7801% | 0.0053% |

**十三、基金的费用概览**

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、基金销售服务费；

4、基金财产拨划支付的银行费用；

5、基金合同生效后的基金信息披露费用；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

8、基金的证券交易费用；

9、基金的开户费用、账户维护费用；

10、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。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为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.10%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、基金销售服务费

本基金A类基金份额的销售服务费年费率为0.25%，对于由B类降级为A类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额持有人的费率。B类基金份额的销售服务费年费率为0.01%，对于由A类升级为B类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其达到B类条件的开放日后的下一个工作日起享受B类基金份额持有人的费率。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

H＝E×年销售服务费率÷当年天数

H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。销售服务费由基金管理人按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

上述"一、基金费用的种类中第4－10项费用"，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）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财产的损失，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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（四）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

**十四、对招募说明书更新部分的说明**

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金原招募说明书进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

1、对"重要提示"部分进行了更新。

2、在"第三部分 基金管理人"部分，更新了基金管理人职工监事、本基金基金经理、基金投资决策委员会成员的情况简介，职工监事、基金经理、基金投资决策委员会成员未发生变更。

3、"第四部分 基金托管人"部分，更新了基金托管人情况的内容。

4、"第五部分 相关服务机构"部分，更新了基金份额发售机构和审计基金财产的会计师事务所的内容。

5、更新了"第七部分 基金的募集"的内容。

6、更新了"第八部分 基金合同的生效"的内容。

7、"第九部分 基金份额的申购与赎回"，更新了"二、申购和赎回的开放日及开放时间"、"十二、基金转换"和"十五、定期定额投资计划"的内容。

8、"第十部分 基金的投资"部分，更新了"四、投资决策依据和流程"部分的内容，并增加"十一、基金投资组合报告"部分。

9、增加 "第十一部分 基金的业绩"，并更新后续编号。

10、增加"第二十三部分 其他应披露事项"，并更新后续编号。

11、在"附件二：托管协议的内容摘要"部分，更新了基金托管人注册资本的内容。

安信基金管理有限责任公司

2013年9月16日

---

证券代码：002292　　证券简称：奥飞动漫　　公告编号：2013-058

## 广东奥飞动漫文化股份有限公司关于重大资产重组进展的公告

**本公司及本公司董事、监事、高级管理人员保证公告内容的真实、准确和完整，并对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。**

广东奥飞动漫文化股份有限公司（以下简称"公司"）于2013年7月23日披露了《重大事项停牌公告》，公司股票已于2013年7月23日开市时起停牌。公司已于2013年7月29日发布了《重大事项继续停牌公告》、已于8月5日发布了《关于筹划发行股份购买资产事项的停牌公告》、已于8月12日，8月19日，8月26日分别披露了《关于发行股份购买资产事项的进展公告》、已于9月2日披露了《关于重大资产重组延期复牌的公告》、已与9月9日披露了《关于重大资产重组进展的公告》。详见公司法定披露媒体证券时报、巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）。

自公司股票停牌以来，公司及有关各方积极推进本次重组的各项工作。目前，公司正在积极推进正式合同签订等相关事宜，公司董事会将会在相关工作完成后召开会议，审议本次重大资产重组的预案等相关事项。

根据《上市公司重大资产重组管理办法》及深交所关于上市公司信息披露工作备忘录的有关规定，停牌期间，公司将每五个交易日发布一次重大资产重组事项进展情况公告。本公司筹划的重大资产重组事项，尚存较大不确定性，敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

广东奥飞动漫文化股份有限公司

董事会

2013年9月13日

---

证券代码：002684　　证券简称：猛狮科技　　公告编号：2013-038

## 广东猛狮电源科技股份有限公司董事会关于重大资产重组停牌公告

**本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。**

一、停牌事由和工作安排

广东猛狮电源科技股份有限公司(以下简称"公司")因筹划重大事项，公司股票（猛狮科技：002684）于2013年9月2日下午开市起停牌。

经公司确认，因筹划事项涉及重大资产重组，为维护广大投资者利益，避免引起公司股价异常波动，根据深圳证券交易所的相关规定，经公司申请，公司股票自2013年9月16日起因重大资产重组事项继续停牌。

公司承诺争取停牌时间不超过30个自然日，即最晚将于2013年10月15日前按照《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第26号-上市公司重大资产重组申请文件》的要求披露重大资产重组信息，公司股票将在公司董事会审议通过并公告重大资产重组预案后复牌。

若公司未能在上述期限内召开董事会审议并披露相关事项，公司将根据重大资产重组预案推进情况确定是否向深圳证券交易所申请延期复牌。公司未提出延期复牌申请或延期复牌申请未获深圳证券交易所同意的，公司股票将于2013年10月15日开市起复牌，公司及公司控股股东、实际控制人承诺在证券恢复交易后三个月内不再筹划重大资产重组事项。公司提出延期复牌申请并获交易所同意的，公司累计停牌时间不超过三个月，如公司仍未能在延期期限内披露重大资产重组预案，公司及公司控股股东、实际控制人承诺自公司股票复牌之日起六个月内不再筹划重大资产重组事项。

如本公司在停牌期限内终止筹划重大资产重组的，公司将及时披露终止筹划重大资产重组相关公告，公司及公司控股股东、实际控制人承诺自复牌之日起三个月内不再筹划重大资产重组事项，公司股票将在公司披露终止筹划重大资产重组相关公告后恢复交易。

二、停牌期间安排

公司自停牌之日将按照相关规定，积极开展各项工作，履行必要的报批和审议程序，督促公司聘请的独立财务顾问、审计、评估等中介机构加快工作，公司预计将在停牌期满前五个交易日向交易所提交符合要求的披露文件。

三、必要风险提示

本公司筹划的重大资产重组事项，尚存较大不确定性，敬请广大投资者注意投资风险。

四、备查文件

1.经公司董事长签字的停牌申请；

2.有关资产重组的相关协议或证明文件；

3.本所要求的其他文件。

广东猛狮电源科技股份有限公司

董事会

2013年9月14日

---

## 景顺长城货币市场证券投资基金收益支付公告（2013年第9号）

公告送出日期：2013年9月16日

1.公告基本信息

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 景顺长城货币市场证券投资基金 |
| 基金简称 | 景顺长城货币 |
| 基金主代码 | 260102 |
| 基金合同生效日 | 2003年10月24日 |
| 基金管理人名称 | 景顺长城基金管理有限公司 |
| 公告依据 | 《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》、《景顺长城景系列开放式证券投资基金招募说明书》 |
| 收益集中支付并自动结转为基金份额的日期 | 2013年9月16日 |
| 收益累计期间 | 自2013年8月15日至2013年9月15日止 |

2. 与收益支付相关的其他信息

| | |
|---|---|
| 累计收益计算公式 | 基金份额持有人累计收益=∑基金份额持有人每日收益 基金份额持有人每日收益=（基金份额持有人当日持有的基金份额/10000）X当日每万份基金净收益 基金份额持有人每日收益的精度为0.01元，第三位采用去尾的方法。 |
| 收益结转的基金份额可赎回起始日 | 2013年9月17日 |
| 收益支付对象 | 收益支付日前一个工作日在景顺长城基金管理有限公司登记在册的本基金全体基金份额持有人。 |
| 收益支付办法 | 本基金收益支付方式只采用红利再投资方式，本基金基金份额持有人收益结转的基金份额于2013年9月16日直接计入其基金账户，2013年9月17日起可查询及赎回。 |
| 税收相关事项的说明 | 根据财政部、国家税务总局的财税字[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。 |
| 费用相关事项的说明 | 本次收益支付免收收益支付手续费和再投资手续费。 |

注：1、2013年9月13日申购的有效基金份额不享有当日收益，2013年9月13日申请赎回的有效基金份额享有当日收益。

2、若本基金基金份额持有人于2013年9月13日赎回全部基金份额，其累计收益将自动计算，并与赎回款一起以现金形式支付。

3、本基金基金份额持有人的累计收益于每月集中支付并按1元面值自动转为基金份额。

4、咨询办法

（1）景顺长城基金管理有限公司网站 http://www.invescogreatwall.com。

（2）景顺长城基金管理有限公司客户服务热线：4008888606。

（3）向本基金各代销机构查询：中国银行、中国工商银行、中国农业银行、中国建设银行、交通银行、招商银行、广发银行、浦发银行、兴业银行、光大银行、民生银行、北京银行、中信银行、平安银行、渤海银行、浙商银行、温州银行、华夏银行、金华银行、嘉兴银行、花旗银行、包商银行、长城证券、广发证券、银河证券、国泰君安证券、中信建投证券、申银万国证券、招商证券、国都证券、兴业证券、光大证券、海通证券、中信证券（浙江）、中银国际证券、安信证券、国元证券、国信证券、中金公司、方正证券、天相投顾、西部证券、华宝证券、爱建证券、华福证券、信达证券、英大证券、宏源证券、华泰证券、华龙证券、国金证券、浙商证券、中航证券、中信证券、中投证券、长江证券、东莞证券、东方证券、齐鲁证券、国盛证券、国海证券、中信万通证券、西南证券、众禄基金、数米基金网、诺亚正行、长量基金、好买基金、展恒基金、和讯科技、天天基金、同花顺基金和万银财富等机构代销网点。

---

证券代码：200152　　证券简称：山航B　　公告编号：2013-61

## 山东航空股份有限公司股票继续停牌公告

**本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。**

山东航空股份有限公司（以下简称"公司"）因股东正筹划涉及公司的重大事项，为防止公司股票异常波动，切实维护广大投资者的利益，经深圳证券交易所批准，公司股票（股票简称"山航B",股票代码200152）自2012年10月29日开市起停牌。

经向控股股东山东航空集团有限公司（以下简称"山航集团"）询证，为公司长远可持续发展提供更好的平台和条件，使公司能为股东更好地提供回报，山航集团正与相关各方积极商讨和筹划解决B股公司遗留问题重大事项的具体方案（以下简称"方案"）。截至本公告之日，方案共识已得到企业主管部门的认可和同意。股东方正在积极推动相关工作，将在充分兼顾各方股东利益，尤其是更好地保护中小股东利益的前提下抓紧制定具体方案，在遵守中国法律法规和监管要求基础上，加快履行相关程序。

为防止公司股票异常波动，切实维护广大投资者的利益，经申请，公司股票（股票简称"山航B",股票代码200152）自2013年9月16日开市起继续停牌，待相关事项公告后复牌。

特此公告

山东航空股份有限公司董事会

2013年9月13日