陕西煤业股份有限公司首次公开发行A股网下发行结果及网上中签率公告

联席主承销商：中国国际金融有限公司 中银国际证券有限责任公司 中信证券股份有限公司

重要提示

1、陕西煤业股份有限公司（以下简称“发行人”或“陕西煤业”）首次公开发行不超过100,000万股人民币普通股（A股）（以下简称“本次发行”）的申请已获中国证券监督管理委员会证监许可[2013]1664号文核准。本次发行的联席主承销商为中国国际金融有限公司、中银国际证券有限责任公司、中信证券股份有限公司（以下简称“联席主承销商”）。发行人的股票简称为“陕西煤业”，股票代码为“601225”。

2、本次发行采用向战略投资者定向配售（以下简称“战略配售”）、网下向网下投资者询价配售（以下简称“网下发行”）与网上向社会公众投资者定价发行（以下简称“网上发行”）相结合的方式进行。发行人与联席主承销商协商确定本次发行股份数量为100,000万股，回拨机制启动前，战略配售初始发行数量为50,000万股，占本次发行数量的50%；网下初始发行数量为35,000万股，占本次发行数量的35%；网上初始发行数量为15,000万股，占本次发行数量的15%。

3、本次发行的战略投资者认购和网下申购工作已于2014年1月17日结束。战略投资者申购资金已经希格玛会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并出具了验资报告。在初步询价阶段提交有效报价的21家配售对象均参与了网下申购，并按照2014年1月16日公布的《陕西煤业股份有限公司首次公开发行A股发行公告》（以下简称“《发行公告》”）的要求及时足额缴纳了申购款，缴付申购资金已经立信会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并出具了验资报告。战略配售及网下发行过程已经北京观韬律师事务所见证，并出具了专项法律意见书。

4、本次发行价格为4.00元/股，发行数量为100,000万股。根据网上申购情况，网上初步有效申购倍数为20.53倍，低于50倍。根据《发行公告》公布的回拨安排，发行人和联席主承销商决定不启动回拨机制。本次发行最终确定战略配售发行数量为50,000万股，占本次发行数量的50%；网下最终发行数量为35,000万股，占本次发行数量的35%；网上最终发行数量为15,000万股，占本次发行数量的15%。

5、本公告披露了本次战略配售及网下发行配售的结果，包括获配投资者名称、获配投资者的报价、申购数量、获配数量等。根据2014年1月16日公布的《发行公告》，本公告一经刊出亦视同向战略投资者及网下发行获得配售的所有配售对象送达获配通知。

一、网下发行申购及缴款情况

初步询价阶段提供有效报价的21家配售对象中，有21家配售对象参与了网下申购并及时足额缴纳了申购款。根据《证券发行与承销管理办法》（证监会令[2013]第95号）的要求，联席主承销商对参与网下申购的投资者资格进行了核查和确认。依据上海证券交易所网下申购电子化平台和中国证券登记结算有限责任公司上海分公司结算参与人远程操作平台最终收到的资金有效申购结果，联席主承销商作出如下统计：

经核查确认，有效报价并有效申购的配售对象数量为21家，21家配售对象均按照《发行公告》的要求及时、足额缴纳了申购款，有效申购资金为458,520万元，有效申购数量为114,630万股。

二、网上申购情况及网上发行结果

根据上海证券交易所提供的数据，本次网上发行有效申购户数为233,134户，有效申购股数为3,079,975,000股。经立信会计师事务所（特殊普通合伙）审验，网上冻结资金量为12,319,900,000元，网上发行中签率为4.87016940%。配号总数为3,079,975个，号码范围为10,000,001—13,079,975。

三、发行结构和回拨机制实施情况

经发行人与联席主承销商协商，本次发行股份的最终数量为100,000万股。根据《发行公告》公布的回拨机制，由于网上初步有效申购倍数为20.53倍，低于50倍，发行人和联席主承销商决定不启动回拨机制。本次发行最终确定发行结构如下：战略配售发行数量为50,000万股，占本次发行数量的50%；网下最终发行数量为35,000万股，占本次发行数量的35%；网上最终发行数量为15,000万股，占本次发行数量的15%。网上最终中签率为4.87016940%。

四、战略配售结果

7家战略投资者承诺的认购资金已于规定时间内全部汇至联席主承销商指定的银行账户，总金额为人民币20亿元。本次发行最终向战略投资者定向配售的股数为50,000万股，占本次发行数量的比例为50%。

本次发行的战略投资者未参与初步询价和网下申购。根据《发行公告》的规定，本公告一经刊出即视同已向战略投资者送达获配通知。

战略投资者获配股数及退款金额如下：

序号	战略投资者名称	到账金额（亿元）	获配股数（万股）	退款金额（万元）
1	湖北能源集团股份有限公司	5.0	12,500	0.0
2	中国北方工业公司	4.0	10,000	0.0
3	陕西凯利实业有限公司	3.0	7,500	0.0
4	上海申丰投资发展有限公司	2.0	5,000	0.0
5	内蒙古伊泰煤炭股份有限公司	2.0	5,000	0.0
6	国华人寿保险股份有限公司	2.0	5,000	0.0
7	阳光财产保险股份有限公司	2.0	5,000	0.0

五、网下配售结果

根据网下申购及资金到账情况，经北京观韬律师事务所见证、立信会计师事务所（特殊普通合伙）审验，本次网下获得配售的为21个配售对象，对应的有效申购股数为114,630万股，有效申购资金总额为458,520万元。网下最终配售股数为35,000万股。根据回拨前网下发行股票数量计算，认购倍数约为3.28倍。根据《发行公告》的规定，本公告一经刊出即视同已向参与网下申购的配售对象送达获配通知。

（一）公募基金及社保基金的配售情况

最终有效申购的配售对象数量为21家，其中有2家属于以公开募集方式设立的证券投资基金（以下简称“公募基金”）及1家社保基金投资管理人管理的社会保障基金（以下简称“社保基金”）。本次网下发行中公募基金及社保基金的有效申购总量为9,500万股，小于网下实际发行数量的40%（即14,000万股），根据《陕西煤业股份有限公司首次公开发行A股发行安排及初步询价公告》（以下简称“《发行安排及初步询价公告》”）中规定的网下配售原则，入围的公募基金及社保基金全额获配。

（二）其他配售对象的配售情况

除去公募基金及社保基金的获配数量后，剩余可配售部分向其他配售对象进行同比例配售。其他配售对象对应的配售数量25,500万股。零股配售给报价最早的获配配售对象。

（三）网下配售情况

根据《发行安排及初步询价公告》中公布的网下配售原则，最终各配售对象获配情况如下：

序号	配售对象名称	拟申报价格（元）	拟申购数量（万股）	申购价格（元）	申购数量（万股）	获配数量（股）
1	上海合邦投资有限公司	4.25	11,000	4	22,000	53,362,503
		4	11,000			
2	上海安锦投资管理中心（有限合伙）	4.21	1,200	4	3,600	8,732,046
		4.12	1,200			
		4.02	1,200			
3	湖南轻盐创业投资管理有限公司	4.2	1,900	4	1,900	4,608,579
4	全国社保基金五零四组合	4.2	3,000	4	3,000	30,000,000
5	深圳市汇鑫股权投资基金合伙企业（有限合伙）	4.2	2,000	4	4,000	9,702,273
		4.1	2,000			
6	张寿清	4.2	3,000	4	9,000	21,830,115
		4.16	3,000			
		4.1	3,000			
7	徐州矿务集团有限公司	4.19	1,200	4	1,200	2,910,687
8	首创证券有限责任公司	4.18	1,200	4	1,200	2,910,682
9	陈学东	4.18	9,000	4	19,000	46,085,798
		4.08	10,000			
10	安华农业保险股份有限公司养殖保险	4.17	1,210	4	3,630	8,804,813
		4.12	1,210			
		4.07	1,210			
11	毕永生	4.12	1,500	4	1,500	3,638,352
12	中国华电集团财务有限公司	4.1	12,000	4	12,000	29,106,820
13	新理益集团有限公司	4.1	10,000	4	10,000	24,255,683
14	夏嘉斌	4.02	1,500	4	1,500	3,638,352
15	上海汽车集团财务有限责任公司	4.01	4,000	4	4,000	9,702,273
16	江苏瑞华投资控股集团有限公司	4.01	7,000	4	7,000	16,978,978
17	中邮证券有限责任公司	4	1,200	4	1,200	2,910,682
18	中国工商银行—易方达价值成长混合型证券投资基金	4	1,500	4	1,500	15,000,000
19	兴业银行股份有限公司—兴全趋势投资混合型证券投资基金	4	5,000	4	5,000	50,000,000
20	林建华	4	1,200	4	1,200	2,910,682
21	厦门海翼热电有限公司	4	1,200	4	1,200	2,910,682

注：拟申报价格为初步询价阶段提交的有效报价；拟申购数量为初步询价阶段提交的有效报价对应的申购数量；申购数量为申购阶段提交的申购数量。

公募基金及社保基金的最终获配数量为9,500万股，占本次网下最终发行数量的27.14%。

以上配售结果符合事先公布的网下配售原则。

六、投资价值研究报告的估值结论

联席主承销商的分析师对本次陕西煤业A股发行出具了独立的投资价值分析报告，中国国际金融有限公司认为陕西煤业2014年合理股权价值为433–512亿元；中银国际证券有限责任公司认为陕西煤业A股合理价值区间为4.86–5.94元/股；中信证券股份有限公司认为陕西煤业A股合理价值区间为4.48–5.18元/股。初步询价截止日（2014年1月14日），中证指数有限公司发布的B06煤炭开采和洗选业最近一个月行业平均滚动市盈率为9.75倍，最近一个月行业平均静态市盈率为7.56倍。

七、持股锁定期限

战略投资者获配股票的锁定期为12个月，锁定期自本次网下、网上发行的股票在上海证券交易所上市交易之日起开始计算；本次网下发行有效报价投资者的获配股票无流通限制及锁定期安排。

上述股票配售对象对本公告所公布的网下配售结果如有疑问，请与本次发行的联席主承销商联系。具体联系方式如下：

联系电话：010–6505 8507

联系人：资本市场部

发行人：陕西煤业股份有限公司
联席主承销商：中国国际金融有限公司
中银国际证券有限责任公司
中信证券股份有限公司
2014年1月21日

中银货币市场证券投资基金更新招募说明书摘要

（2014年第1号）

基金管理人：中银基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

二〇一四年一月

重要提示

本基金经中国证监会2005年4月25日证监基金字[2005] 65号文件批准募集，本基金基金合同于2005年6月7日正式生效。

基金管理人保证本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。

投资者购买本货币市场证券投资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，基金管理公司不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

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，投资者认购（或申购）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。

本摘要根据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。

本更新招募说明书所载内容截止日2013年12月7日，有关财务数据和净值表现截止日为2013年9月30日(财务数据未经审计)。本基金托管人中国工商银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书。

一、基金合同生效日

2005年6月7日

二、基金管理人

(一) 基金管理人概况

公司名称：中银基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、45楼

设立日期：2004年8月12日

法定代表人：谭炯

电话：（021）38834999

传真：（021）68872488

联系人：高爽秋

注册资本：1亿元人民币

股权结构：

股东	出资额	占注册资本的比例
中国银行股份有限公司	人民币8350万元	83.5%
贝莱德投资管理(英国)有限公司	相当于人民币1650万元的美元	16.5%

(二) 主要人员情况

1. 董事会成员

谭炯（TAN Jiong）先生，董事长。国籍：中国。武汉大学硕士研究生，高级经济师、云南省人民政府特殊津贴专家。历任中国银行武汉市青山支行行长、党总支书记、中国银行西藏自治区分行行长、党委书记、中国银行云南省分行行长、党委书记等职。

李道滨（LI Daobin）先生，董事。国籍：中国。清华大学法学博士。中银基金管理有限公司执行总裁。2000年10月至2012年4月任职于嘉实基金管理有限公司，历任市场部副总监、总监、总经理助理和公司副总经理。具有14年基金行业从业经验。

梅非奇（MEI Feiqi）先生，董事。国籍：中国。现任中国银行总行个人金融总部总经理。哈尔滨工业大学硕士研究生，高级工程师，高级经济师。曾先后在地质矿产部、国务院办公厅工作，加入中国银行后，历任中国银行总行办公室副主任、中国银行北京市分行副行长等职。

葛岱炜（David Graham）先生，董事。国籍：英国。现任贝莱德投资管理有限公司董事总经理，主要负责管理贝莱德合资企业关系方面的事务。葛岱炜先生于1977年—1984年供职于Deloitte Haskins & Sells（现为普华永道）伦敦和悉尼分公司，之后，在拉扎兹（Lazards）银行伦敦、香港和东京分公司任职。1992年，加入美林投资管理有限公司（MLIM），曾担任欧洲、中东、非洲、太平洋地区客户关系部门的负责人。2006年贝莱德与美林投资管理有限公司合并后，加入贝莱德。

朱善利（ZHU Shanli）先生，独立董事。国籍：中国。现任北京大学光华管理学院教授、博士生导师，北京大学中国中小企业促进中心主任、21世纪创业投资中心主任、管理科学中心副主任，兼任中国投资协会理事、中国财政学会理事、中国企业投资协会常务理事、中原证券股份有限公司独立董事等职。曾任北京大学光华管理学院经济管理系讲师、副教授、主任、北京大学光华管理学院应用经济学系主任、北京大学光华管理学院副院长等职。

荆新（JING Xin）先生，独立董事。国籍：中国。现任中国人民大学商学院党委书记兼副院长、会计学教授、博士生导师、博士后合作导师，兼任财政部中国会计准则委员会咨询专家、中国会计学会理事、全国会计专业学位教指委副主任委员、中国青少年发展基金会监事、安泰科技股份有限公司独立董事、风神轮胎股份有限公司独立董事。曾任中国人民大学会计系副主任，中国人民大学审计处处长等职。

葛礼（Gary Rieschel）先生，独立董事。国籍：美国。启明维创投资咨询有限公司的创办者、现任董事总经理，同时供职于里德学院董事会、亚洲协会、中美合资企业清洁能源、清洁技术论坛的顾问委员会，并担任纳斯达克上市公司 THQ的独立董事。曾在美国知名技术公司思科、英特尔等任高级营运职位，并被多家杂志如福布斯、红鲱鱼、网络标准评为全球最主要的风险资本家之一。曾在美国英特尔公司担任品质保证经理，在美国NCube公司、思科公司以及日本Sequent公司担任管理职位，后为SOFTBANK/Mobius风险资本的创办者、董事总经理。哈佛商学院工商管理硕士，里德学院生物学学士。

2. 监事

赵经萍（ZHAO Huiping）先生，监事。国籍：中国。中央党校经济管理专业本科，人力资源管理师、经济师。曾任中国银行人力资源部信息团队主管、曾任中国银行人力资源部综合处副处长、处长、人事部技术干部处干部、副处长。

乐妮（YUE Ni）女士，职工监事。国籍：中国。工商管理硕士。曾分别在上海浦东发展银行、山西证券有限责任公司、友邦华泰基金管理公司工作。2006年7月加入中银基金管理有限公司，现任基金运营部总经理。

3. 管理层成员

李道滨（LI Daobin）先生，董事、执行总裁。简历见董事会成员介绍。

欧阳向军（Jason X. OUYANG）先生，督察长。国籍：加拿大。中国证券业协会–沃顿商学院高级管理培训班(Wharton–SAC Executive Program)毕业证书，加拿大西部大学毅伟商学院(Ivey School of Business, Western University)工商管理硕士（MBA）和经济学硕士。曾在加拿大太平洋集团公司、加拿大帝国商业银行和加拿大伦敦人寿保险公司等海外机构从事金融工作多年，也曾任蔚深证券有限责任公司（现英大证券）研究发展中心总经理、融通基金管理公司市场拓展总监、监察稽核总监和上海复旦大学国际金融系国际金融教研室主任、讲师。

张家文（ZHANG Jiawen）先生，副执行总裁。国籍：中国。西安交通大学工商管理硕士。历任中国银行苏州分行太仓支行副行长、苏州分行风险管理处处长、苏州分行工业园区支行行长、苏州分行副行长、党委委员。

4. 基金经理

现任基金经理：

白洁（BAI Jie）女士，中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），上海财经大学经济学硕士。曾任金盛保险有限公司投资部固定收益分析员。2007年加入中银基金管理有限公司，曾担任固定收益研究员。2011年3月至今任中银货币基金基金经理，2012年12月至今任中银理财7天债券基金基金经理。具有9年证券从业年限。具备基金、证券、银行间本币市场交易员从业资格。

曾任基金经理：

奚鹏洲（XI Pengzhou）先生，2010年5月至2011年9月担任本基金基金经理。

李建（LI Jian）先生，2007年8月至2011年1月担任本基金基金经理。

孙庆瑞（SUN Qingrui）女士，2006年7月至2010年5月担任本基金基金经理。

苏淑敏（Tina SO）女士，2005年11月至2006年7月担任本基金基金经理。

黄健斌（HUANG Jianbin）先生，2005年6月至2005年11月担任本基金基金经理。

5. 上述人员之间不存在近亲属关系。

(三) 投资决策委员会成员的姓名及职务

主席：李道滨（执行总裁）

成员：陈军（执行委员）、杨军（资深投资经理）、奚鹏洲（固定收益投资部总经理）、张发余（研究部总经理）、李建（固定收益投资部副总经理）

列席成员：欧阳向军（督察长）

三、基金托管人

(一) 基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币349,018,545,827元

联系电话：010–66105799

联系人：赵会军

(二) 基金托管人托管业务主要人员情况

截至2013年9月末，中国工商银行资产托管部共有员工179人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三) 基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2013年9月，中国工商银行共托管证券投资基金337只，其中封闭式5只，开放式332只。自2003 年以来，本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的41项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

四、相关服务机构

(一) 基金发售机构

1. 直销机构

名称： 中银基金管理有限公司

注册地址： 上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼

办公地址： 上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、45楼

法定代表人：谭炯

电话： （021）38834999

传真： （021）68872488

联系人： 徐琳

2. 其他场外销售机构

1） 中国银行股份有限公司

注册地址： 北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址： 北京市西城区复兴门内大街1 号

法定代表人： 田国立

客户服务电话： 95566

联系人： 宋亚平

网址： www.boc.cn

2） 中国工商银行股份有限公司

注册地址： 北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址： 北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人： 姜建清

客户服务电话： 95588

联系人： 王佺

网址： www.icbc.com.cn

3） 交通银行股份有限公司

注册地址： 上海银城中路188号

办公地址： 上海市银城中路188号

法定代表人： 牛锡明

客户服务电话： 95559

联系人： 张作伟

网址： www.bankcomm.com

4） 中国民生银行股份有限公司

注册地址： 北京市西城区复兴门内大街2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

客户服务电话： 95568

联系人： 杨成茜

公司网站： www.cmbc.com.cn

5） 中信银行股份有限公司

注册地址： 北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址： 北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人： 常振明

客户服务电话： 95558

联系人： 赵树林

网址： http://bank.ecitic.com

6） 中国建设银行股份有限公司

注册地址： 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

联系人： 张静

网址： www.ccb.com

7） 招商银行股份有限公司

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

法定代表人： 傅育宁

客户服务电话： 95555

联系人： 邓炯鹏

网址： www.cmbchina.com

8） 华夏银行股份有限公司

注册地址： 北京市东城区建国门内大街22号

办公地址： 北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人： 吴建

客户服务电话： 95577

联系人： 刘军祥

公司网站： http://www.hxb.com.cn

9） 南洋商业银行（中国）有限公司

注册地址： 上海市浦东新区世纪大道800号三层、六层至九层

办公地址： 上海市浦东新区世纪大道800号三层、六层至九层

法定代表人： 和广北

客服电话： 800–830–2066；400–830–2066

联系人： 王晓明

网址： www.ncbchina.cn

10） 中银国际证券有限责任公司

注册地址： 上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39F

法定代表人： 许刚

联系人： 马瑾

联系电话： 61195566

公司网站： www.bocichina.com

11）海通证券股份有限公司

注册地址： 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

联系人： 李笑鸣

客服电话： 95553或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网站： www.htsec.com

12）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： 上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人： 万建华

联系人： 芮敏祺

客服电话： 95521

公司网站： www.gtja.com

13）申银万国证券股份有限公司

注册地址： 上海市常熟路171 号

办公地址： 上海市常熟路171号

法定代表人： 储晓明

联系人： 高夫

客服电话： 95523

公司网站： www.sw2000.com.cn

14） 兴业证券股份有限公司

注册地址： 福州市湖东路268号

办公地址： 上海市民生路1199弄证大五道口广场1号楼20楼

法定代表人：兰荣

联系人： 雷宇钦

客服电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

15）平安证券有限责任公司

注册地址： 深圳福田区金田路大中华国际交易广场8楼

办公地址： 深圳福田区金田路大中华国际交易广场8楼

法定代表人： 杨宇翔

联系人： 郑舒丽

客服电话： 95511–8

公司网站： http://stock.pingan.com

16）华安证券有限责任公司

注册地址： 安徽省合肥市长江中路357号

法定代表人： 李工

联系人： 甘霖

客户电话： 0551–96518

公司网址： http://www.huaans.com.cn

17）光大证券股份有限公司

注册地址： 上海市静安区新闸路1508号

办公地址： 上海市静安区新闸路1508号

法定代表人： 袁长清

联系人： 刘晨、李芳芳

客服电话： 95525

公司网站： www.ebscn.com

18） 广发证券股份有限公司

注册地址： 广州天河区天河北路183–187号大都会广场43楼（4301–4316房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

法定代表人： 孙树明

联系人： 黄岚

客服电话： 95575或致电各地营业网点

公司网站： www.gf.com.cn

19）招商证券股份有限公司

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

联系人： 黄健

客服电话： 95565

公司网站： www.newone.com.cn

20） 中国银河证券股份有限公司

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： 陈有安

联系人： 田薇

客服电话： 4008–888–888

公司网站： www.chinastock.com.cn

21）中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址： 浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

法定代表人： 沈强

联系人： 周妍

客服电话： （0571）96598

公司网站： www.bigsun.com.cn

22）中信万通证券有限责任公司

注册地址： 青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507–1510室）

办公地址： 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： 杨宝林

联系人： 吴忠超

客服电话： （0532）96577

公司网站： http://www.zxwt.com.cn

23）中信建投证券股份有限公司

注册地址： 北京安立路66号4号楼

法定代表人： 张佑君

联系人： 权唐

客服电话： 4008–888–108

公司网站： http://www.csc108.com/

24） 安信证券股份有限公司

注册地址： 深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单元

办公地址： 深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单元

法定代表人： 牛冠兴

联系人： 陈剑虹

客服电话： 4008001001

公司网址： www.essence.com.cn

25)国元证券股份有限公司

注册地址： 安徽省合肥市寿春路179号

办公地址： 安徽省合肥市寿春路179号 国元大厦

法定代表人： 蔡咏

联系人： 万士清

客服电话： 95578

公司网址： www.gyzq.com.cn

26)天相投资顾问有限公司

注册地址： 北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址： 北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层

法定代表人： 林义相

联系人： 林爽

客服电话： 010–66045678

公司网站： http://www.txsec.com 或www.jjm.com.cn

27)华宝证券有限责任公司

注册地址： 上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层

办公地址： 上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层

法定代表人： 陈林

联系人： 汪明丽

客服电话： 400–820–9898

公司网站： www.cnhbstock.com

28)国信证券股份有限公司

注册地址： 深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址： 深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人： 何如

联系人： 齐晓燕

客服电话： 95536

公司网站： http://www.guosen.com.cn

29)中国国际金融有限公司

注册地址： 北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人： 李剑阁

联系人： 罗春蓉、武明明

联系电话： 010–65051166或直接联系各营业部

公司网站： http:// www.cicc.com.cn

30） 信达证券股份有限公司

注册地址： 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址 ： 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人： 高冠江

联系人： 唐静

客服电话： 400–800–8899

公司网站： http://www.cindasc.com

31)宏源证券股份有限公司

注册地址： 新疆乌鲁木齐市文艺路233号

办公地址： 北京市西城区太平桥大街19号

法定代表人： 冯戎

联系人： 李巍

客服电话： 4008000562

公司网站： http://www.hysec.com

32)华福证券有限责任公司

注册地址： 福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址： 福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人： 黄金琳

联系人： 张腾

客服电话： 96326（福建省外加拨0591）

公司网站： www.hfzq.com.cn

33)华泰证券股份有限公司

办公地址： 南京市中山东路90号

法定代表人： 吴万善

联系人： 万鸣

客服电话： 95597

公司网站： www.htsc.com.cn

34） 渤海证券股份有限公司

注册地址： 天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址： 天津市南开区宾水西道8号

法定代表人： 杜庆平

联系人： 王兆权

客服电话： 4006515988

公司网站： http://www.bhzq.com

35)中信证券股份有限公司

注册地址： 广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址： 北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人： 王东明

联系人： 陈忠

联系电话： 95558

公司网站： www.cs.ecitic.com

36)国都证券有限责任公司

注册地址： 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址： 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人： 常喆

联系人： 黄静

客服电话： 400 818 8118

公司网站： www.guodu.com

36）长江证券股份有限公司

注册地址： 湖北省武汉市江汉区新华路特8号长江证券大厦

法定代表人： 胡运钊

联系人： 李良

客服电话： 4008–888–999

公司网址： www.95579.com

37）天风证券股份有限公司

注册地址： 湖北武汉东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼

办公地址： 湖北武汉江汉区唐家墩路32号国资大厦B座

法定代表人： 余磊

联系人： 翟璟

客服电话： 028–86712334

公司网站： www.tfzq.com

(二) 基金注册与过户登记人

名称： 中国证券登记结算有限责任公司

注册地址： 北京市西城区太平桥大街17号

办公地址： 北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人： 周明

电话： （010）59378835

传真： （010）59378907

联系人： 任瑞新

(三) 出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称： 上海市通力律师事务所

住所： 上海市浦东南路528号

法定代表人： 韩炯

电话： （021）68818100

传真： （021）68816880

联系人： 秦悦民

经办律师： 秦悦民、傅轶

(四) 审计基金资产的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（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心50层

执行事务合伙人：吴港平

电话：021–22288888

传真：021–22280000

联系人：汤骏

经办会计师：徐艳、汤骏

五、基金的名称

中银货币市场证券投资基金

六、基金的类型

契约型开放式

七、基金的投资目标

在保持本金安全和资产流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的稳定收益。

八、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）一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；

3）剩余期限在397天以内（含397天）的债券；

4）期限在一年以内（含一年）的债券回购；

5）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。

九、基金的投资策略

(一) 决策依据

以《基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》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。

(二) 决策程序

本基金管理人的投资决策程序如下图所示：

(三) 投资程序

1. 整体配置策略

根据对宏观经济指标、货币政策和财政政策的预判，决定债券组合的平均剩余到期期限和比例分布。

根据各类资产的流动性、收益性和信用水平，决定组合中各类资产的投资比例。

在保证组合充分流动性的前提下，运用现代金融工具和分析方法，寻找被低估的投资品种并进行优化配置。

2. 投资管理方法

●短期利率预测

深入分析国家货币政策、短期资金市场利率波动、资本市场资金面的情况和流动性的变化，对短期利率走势形成合理预期，并据此调整基金货币资产的配置策略。

●组合久期制定

根据对宏观经济和短期资金市场的利率走势，来确定投资组合的平均剩余到期期限。具体而言，在预计市场利率上升时，适当缩短投资品种的平均期限；在预计利率下降时，适当延长投资品种的平均期限。

●类别品种配置

在保持组合资产相对稳定的条件下，根据各类短期金融工具的市场规模、收益性和流动性，决定各类资产的配置比例；再通过评估各类资产的流动性和收益性利差，确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。

●收益率曲线分析

本基金将根据债券市场收益率曲线以及隐含的即期收益率和远期利率提供的价值判断基础，结合对资金面的分析，匹配各期限的回购与债券品种的到期日，实现现金流的有效管理。

●无风险套利

跨市场套利：短期资金市场分为银行间市场和交易所市场两个子市场，其中投资群体、交易方式等市场要素不同，使得两个市场的资金面和市场短期利率在一定期间内可能存在定价偏离。本基金在充分论证这种套利机会可行性的基础上，寻找最佳介入时机，进行跨市场操作，获得安全的超额收益。

跨品种套利：由于投资群体的差异，对期限相近的品种，因为其流动性、税收等因素造成内在价值出现明显偏离时，本基金可以在保证流动性的基础上，进行品种间的套利操作，增加超额收益。

●滚动配置策略

根据具体投资品种的市场特性，采用持续滚动投资的方法，以提高基金财产的整体持续的变现能力。

十、业绩比较基准

根据本基金的投资对象和投资目标确立本基金的业绩比较基准为税后活期存款利率：（1 – 利息税率）×活期存款利率。

本基金选取这个业绩比较基准的理由：本基金定位于现金管理的工具，产品性质上与银行活期存款有着很强的相似性，活期存款税后利率能很好地体现本基金良好的流动性与安全性。

当市场上有更加适合的业绩比较基准，在不损害投资者利益的前提下，基金管理人有权按照相关规定对本基金的业绩比较基准进行调整并公告。

十一、风险收益特征

本基金属于证券投资基金中高流动性，低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票，债券和混合型基金。

十二、投资组合报告

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年12月20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截至2013年9月30日，本报告所列财务数据未经审计。

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益类投资	7,228,432,470.72	37.03
	其中：债券	7,228,432,470.72	37.03
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	2,527,319,992.01	12.95
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	659,815,990.76	3.38
3	银行存款和结算备付金合计	9,634,106,353.81	49.35
4	其他资产	131,898,906.53	0.68
	合计	19,521,757,723.07	100.00

（二）报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值比例