

诺安货币市场基金 2006 年年度报告

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二零零七年三月二十七日

重要提示

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。本年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

本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 2007 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、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。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

目 录

重要提示.....	2
一、基金简介.....	4
二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况.....	5
三、管理人报告.....	6
四、托管人报告.....	8
五、审计报告.....	9
六、财务会计报告（已经审计）.....	10
七、投资组合报告.....	21
八、基金份额持有人户数、持有人结构.....	24
九、开放式基金份额变动.....	24
十、重大事件揭示.....	24
十一、备查文件目录、存放地点和查阅方式.....	27

一、基金简介

(一) 基金名称：诺安货币市场基金

基金简称：诺安货币基金

交易代码：320002

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2004 年 12 月 6 日

期末基金份额总额：2,346,237,112.68 份

(二) 投资目标：确保本金的安全性和资产的流动性，力争为投资者提供高于投资基准的稳定收益。

投资策略：根据宏观经济、央行货币政策操作及短期资金市场供求情况，判断短期利率的走势，进行自上而下的整体资产策略配置和资产组合配置；同时，根据定量和定性方法，在个别回购品种、债券品种和市场时机方面进行主动式选择。

业绩比较基准：以当期银行个人活期储蓄利率(税后)作为衡量本基金操作水平的比较基准。

风险收益特征：本基金流动性高，风险低并且收益稳定。

(三) 基金管理人：诺安基金管理有限公司

注册地址：深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层

办公地址：深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层

邮政编码：518048

法定代表人：刘德树

信息披露负责人：陈勇

联系电话：0755-83026688

传真：0755-83026677

电子信箱：info@lionfund.com.cn

(四) 基金托管人：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

邮政编码：100032

法定代表人：姜建清

信息披露负责人：蒋松云

联系电话：010-66106912

传真：010-66106904

电子信箱：custody@icbc.com.cn

(五) 会计师事务所：利安达信隆会计师事务所有限责任公司

办公地址：中国北京市朝阳区八里庄西里 100 号住邦 2000A 座东区 2008 室

(六) 注册登记机构：诺安基金管理有限公司

办公地址：深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层

(七) 信息披露的报纸：《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

登载年度报告正文的管理人互联网网址：www.lionfund.com.cn

基金年度报告置备地点：深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺安基金管理有限公司。

二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

(一) 主要财务指标

主要财务指标	2006 年	2005 年	2004 年 12 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2004 年 12 月 31 日
基金本期净收益	51,602,839.80	71,424,052.01	2,788,831.38
加权平均基金份额本期净收益	0.0197	0.0216	0.0018
期末基金资产净值	2,346,237,112.68	2,841,886,054.05	1,524,282,562.93
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
基金本期净值收益率	2.00%	2.41%	0.18%
基金累计净值收益率	4.64%	2.59%	0.18%

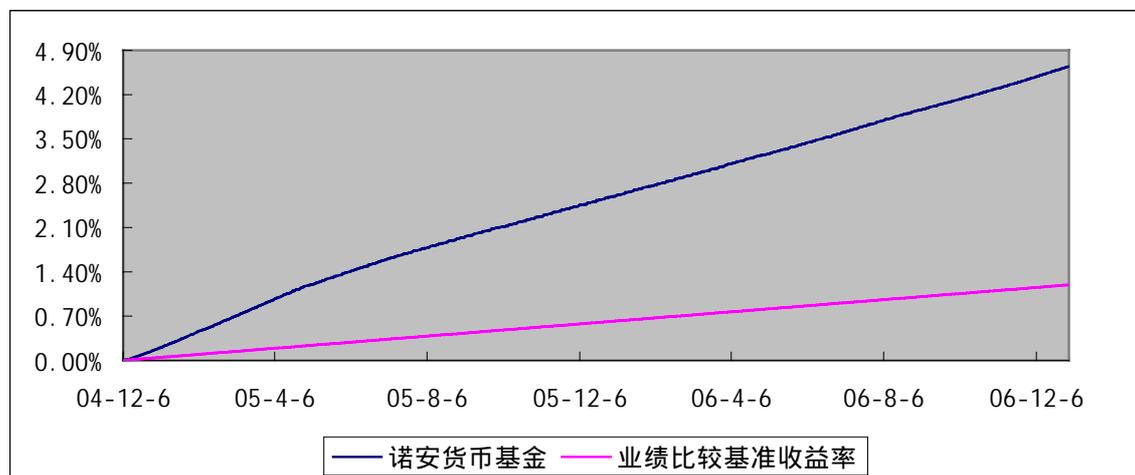
提示：本基金收益分配是按月结转份额。

(二) 基金净值表现

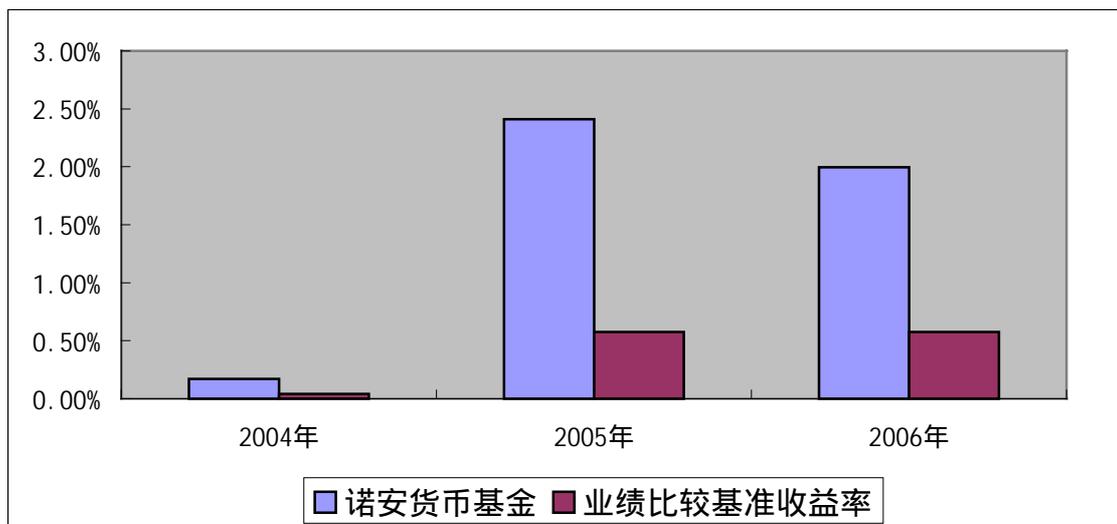
1、报告期本基金收益率与同期业绩比较基准收益率比较表

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 3 个月	0.5204%	0.0004%	0.1452%	0.0000%	0.3752%	0.0004%
过去 6 个月	1.0288%	0.0018%	0.2904%	0.0000%	0.7384%	0.0018%
过去 1 年	1.9956%	0.0029%	0.5760%	0.0000%	1.4196%	0.0029%
自基金合同生效起至今	4.6418%	0.0035%	1.1930%	0.0000%	3.4488%	0.0035%

2、自基金合同生效以来本基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3、本基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



提示：本基金基金合同于 2004 年 12 月 6 日生效，2004 年本基金净值增长率按本基金实际存续期计算。

(三) 收益分配情况

年度	收益分配金额	备注
2006	51,602,839.80	
2005	71,424,052.01	
2004	2,788,831.38	2004.12.6-2004.12.31
合计	125,815,723.19	

三、管理人报告

(一) 基金管理人介绍

诺安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字【2003】132 号文批准，由中国对外经济贸易信托投资有限公司、中国新纪元有限公司、北京中关村科学城建设股份有限公司共同发起设立，公司注册资本为 1.1 亿元人民币。公司建立了完善的内部风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、财务管理制度、人力资源管理制度、信息披露制度、信息技术管理制度、基金会计核算制度、基金销售管理制度、保密制度、危机处理制度、授权管理制度、资料档案管理制度等公司管理制度体系。目前公司管理五只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安中短期债券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金。

(二) 基金经理介绍

张乐赛先生，基金经理，毕业于南京财经大学金融学院。2001 年 7 月至 2004 年 12 月任职于南京市商业银行资金营运中心。2004 年 12 月加入诺安基金管理有限公司。2006 年 1 月起担任诺安货币市场基金基金经理助理，2006 年 8 月起担任诺安货币市场基金基金经理。

(三) 基金运作的合规守信情况

报告期间，本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》及其他有关法律法规，遵守了《诺安货币市场基金基金合同》的规定，遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

（四）基金的投资策略和业绩表现说明

2006 年诺安货币市场基金继续坚持“确保本金的安全性、资产的流动性，力争为投资者提供高于投资基准的稳定收益”的投资目标，始终将投资安全性与资产的流动性放在首位，在投资管理过程中严格控制投资与交易风险，注重资产的流动性管理，对基金资产进行了合理配置。

2006 年股票市场行情火爆，加之打新股可以获得稳定的高回报，资金流向股票市场，货币市场基金整体赎回严重，流动性风险突显。在这种严峻的形势下，诺安货币市场基金资产依然保持了较强的流动性，保障了投资者随时申购、赎回的需求，突出体现了诺安货币市场基金较强的管理能力。诺安货币市场基金取得的投资收益率，大大超过业绩比较基准，为基金份额持有人取得了良好的投资回报。

诺安货币市场基金于本报告期内买入了面额 6000 万元的福禧短期融资券，该券已于 2007 年 3 月 7 日到期，本息获全额兑付。

由于福禧短期融资券发行人及其股东在该券发行时违规操作，隐瞒了若干重大信息，导致该券一度面临流动性风险和信用风险。对此，本管理人立足于最大限度保护基金份额持有人利益的原则，一方面对发行人的资产状况，债务偿还能力进行了深入的分析、研究；另一方面，立即向托管行及监管机构汇报了相关情况及公司的应急处理方案，在主承销行及监管部门的积极配合下，展开该券的兑付维权工作，制定了周详的诉讼、代偿应急方案。经过不懈的努力，保证了该券本息的及时、足额兑付。

同时，本基金管理人也进一步加强了对债券投资的风险管理，细化了投资内控流程，对《诺安基金管理有限公司固定收益产品内部评级及投资管理办法》进行了修订和完善。通过对固定收益产品更加深入的分析研究、严格内部评级、进行分散投资，使得对固定收益产品信用风险和流动性风险的防范更加有效。

在投资组合方面，诺安货币市场基金依旧以中央银行票据、短期金融债，以及高评级短期融资券为主要投资对象，并坚持对各投资品种进行分散投资。

（五）基金管理展望

2007 年中国宏观经济将继续保持较快速度增长，中国金融市场也将加速发展、不断完善，流动性依然保持充裕。面对目前较为过剩的流动性，央行将会在保持利率相对稳定的情况下，施行各种紧缩措施，上调准备金率、灵活运用公开市场操作、提高存款和贷款利率等等。短期债券品种的利率水平随着一年期央行票据发行利率的稳定而稳定，中长期品种的利率与短期债券的利率差将逐渐拉大，短期债券还是具有较好的投资价值。

下一阶段，诺安货币市场基金将继续注重跟踪分析宏观经济变化与货币政策趋向，根据短期债券市场形势变化，积极研究投资品种与投资机会，在保证基金投资安全、保障基金资产流动性的前提下，为基金份额持有人争取较好的投资回报，实现本基金作为投资者“现金管理工具”的职能。

（六）基金内部监察报告

报告期内本基金管理人共管理了五只开放式基金——诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安中短期债券投资基金及诺安价值增长股票证券投资基金。为了适应所管理资产规模逐步扩大的情况，在内部监察工作中本着合法合规运作、最大限度保障基金份额持有人利益的宗旨，建立并完善了以监察、稽核为主导的工作体系和流程。内部监察稽核人员依照独立、客观、公正的原则，认真履行职责，严格按照监察稽核工作计划、方法和程序开展工作，确保了公司勤勉尽责地管理基金资产。其中公司合法合规运作和内部风险控制的具体情况主要有：

- 1、根据新的法律法规、监管机构的要求及公司业务发展的需要，主持或协助其他部门一道制订了公司的若干管理制度，并对一些制度进行了修订。同时，有针对性地组织了对公司员工的法律法规、公司内部控制制度的培训。这些工作，一方面完善了公司的制度体系，

满足了法律法规及证监会的监管要求,另一方面对公司的业务运作也起到了较好的支持、指导作用,有效地推进了相关业务的发展,防范了相关风险。

2、根据中国证监会和公司内部控制制度的要求,监察稽核部在报告期内对公司各个部门进行了四次全面的监察稽核和多次临时性监察稽核。内容涉及公司及员工遵纪守法情况,内部控制制度、业务操作流程执行情况;涵盖基金销售、投资运作、后台保障等公司所有业务环节和工作岗位。对于每次监察稽核工作中发现的问题,都责成各相关部门认真总结、提出整改意见和措施,切实进行改善,并由监察稽核部跟踪问题的处理情况,确保了公司在各方面规范运作,切实地保障了基金份额持有人的利益。

3、根据中国证监会的有关规定并结合公司的实际情况,建立了以事前控制为主体的监察体系,充分利用先进的交易系统对投资行为的合规性进行监控,并通过录音电话、门禁管理、投资相关人员手机集中保管等多种手段对公司的运营情况进行全面实时监控。

4、根据基金合同的要求,加强了债券投资风险管理,协助固定收益投资部门对《诺安基金管理有限公司固定收益产品内部评级及投资管理办法》进行了修订和完善,通过对制度执行情况的有效监督,较好地防止了固定收益产品的信用风险和流动性风险。

5、公司所有对外发布的文件、资料及宣传材料,都事先由监察稽核部进行合规性审查,确保其内容真实、准确、合规,符合中国证监会对信息披露的相关要求。

本报告期内,本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规,无内幕交易和不正当关联交易,保障了基金份额持有人的利益。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在合规运作、稳健经营的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

四、托管人报告

托管人报告

2006年度,本托管人在对诺安货币市场基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

2006年度,诺安货币市场基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金收益分配、基金费用开支等问题上,基本遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

2006年度,诺安货币市场基金因证券市场波动或基金规模变动发生过不符合基金合同中所规定的投资比例限制的情况,出现过投资福禧短期融资券的情况,本托管人就此以函件形式进行了提示,诺安基金管理公司对投资组合进行了处理。

本托管人依法对诺安基金管理有限公司在2006年度所编制和披露的诺安货币市场基金年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2007年3月23日

五、审计报告

审计报告

利安达审字[2007]第 1018 号

诺安货币市场基金全体持有人：

我们审计了后附的诺安货币市场基金(以下简称诺安货币基金)2006年12月31日的资产负债表以及2006年度的经营业绩表、基金净值变动表和基金收益分配表。这些财务报表的编制是诺安货币基金的基金管理人的责任,我们的责任是在实施审计工作的基础上对这些财务报表发表意见。

一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和《金融企业会计制度》的规定编制财务报表是贵基金管理人诺安基金管理有限公司的责任。这种责任包括：(1)设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；(2)选择和运用恰当的会计政策；(3)作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,我们考虑与财务报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为,上述财务报表符合国家颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》以及《诺安货币市场基金基金合同》的规定,在所有重大方面公允反映了诺安货币基金 2006 年 12 月 31 日的财务状况以及 2006 年度的经营成果和净值变动及收益分配情况。

利安达信隆会计师事务所
有限责任公司

中国·北京

中国注册会计师 门 熹

中国注册会计师 周俊海

二〇〇七年二月十四日

六、财务会计报告（已经审计）

（一）基金会计报表

诺安货币市场基金 资产负债表

资产	金额单位：人民币元	
	2006年12月31日	2005年12月31日
银行存款	318,796,090.49	869,613,833.03
应收利息	6,353,960.01	9,846,054.96
应收申购款	0.00	5,247,600.00
债券投资	2,023,842,687.12	1,900,270,213.35
买入返售证券	0.00	60,804,000.00
资产总计	<u>2,348,992,737.62</u>	<u>2,845,781,701.34</u>
负债		
应付管理人报酬	558,397.39	1,122,792.49
应付托管费	169,211.35	340,240.15
应付销售服务费	423,028.34	850,600.38
应付收益	1,248,906.26	1,464,104.27
其他应付款	31,581.60	13,410.00
预提费用	324,500.00	104,500.00
负债合计	<u>2,755,624.94</u>	<u>3,895,647.29</u>
持有人权益		
实收基金	2,346,237,112.68	2,841,886,054.05
持有人权益合计	<u>2,346,237,112.68</u>	<u>2,841,886,054.05</u>
负债及持有人权益总计	<u>2,348,992,737.62</u>	<u>2,845,781,701.34</u>
基金份额净值	<u>1.0000</u>	<u>1.0000</u>

所附附注为本会计报表的组成部分

**诺安货币市场基金
经营业绩表**

	金额单位：人民币元	
	<u>2006年度</u>	<u>2005年度</u>
收入：	72,086,725.85	95,457,081.32
债券差价收入	10,013,084.03	20,898,311.62
债券利息收入	41,243,880.27	60,084,055.16
存款利息收入	12,788,803.91	8,101,800.14
买入返售证券收入	8,040,957.64	6,372,914.40
费用：	20,483,886.05	24,033,029.31
基金管理人报酬	8,671,544.67	10,736,702.81
基金托管费	2,627,740.96	3,253,546.21
基金销售服务费	6,569,352.12	8,133,865.92
卖出回购证券支出	1,953,591.88	1,390,024.37
其他费用	661,656.42	518,890.00
其中：信息披露费	320,000.00	330,000.00
审计费用	100,000.00	100,000.00
基金净收益	51,602,839.80	71,424,052.01
基金经营业绩	51,602,839.80	71,424,052.01

所附附注为本会计报表的组成部分

**诺安货币市场基金
基金收益分配表**

	金额单位：人民币元	
	<u>2006年度</u>	<u>2005年度</u>
本期基金净收益	51,602,839.80	71,424,052.01
加：期初基金净收益	0.00	0.00
加：本期损益平准金	0.00	0.00
可供分配基金净收益	<u>51,602,839.80</u>	<u>71,424,052.01</u>
减：本期已分配基金净收益	<u>51,602,839.80</u>	<u>71,424,052.01</u>
期末基金净收益	<u>0.00</u>	<u>0.00</u>

所附附注为本会计报表的组成部分

**诺安货币市场基金
基金净值变动表**

	金额单位：人民币元	
	2006年度	2005年度
一、期初基金净值	2,841,886,054.05	1,524,282,562.93
二、本期经营活动		
基金净收益	51,602,839.80	71,424,052.01
未实现利得	0.00	0.00
经营活动产生的基金净值变动数	51,602,839.80	71,424,052.01
三、本期基金份额交易		
基金申购款	10,567,815,156.94	12,011,444,099.88
基金赎回款	-11,063,464,098.31	-10,693,840,608.76
基金份额交易产生的基金净值变动数	-495,648,941.37	1,317,603,491.12
四、本期向持有人分配收益		
向基金份额持有人分配收益产生的基金净值变动数	-51,602,839.80	-71,424,052.01
五、期末基金净值	2,346,237,112.68	2,841,886,054.05

所附附注为本会计报表的组成部分

(二) 基金会计报表附注

1. 基金的基本情况

诺安货币市场基金(简称“本基金”),经中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)证监基金字[2004]162号文《关于同意诺安货币市场基金募集的批复》核准,于2004年11月8日至2004年11月30日向社会进行公开募集,经利安达信隆会计师事务所验资,共募集资金人民币1,573,321,100.00元,折合1,573,321,100.00份基金份额。有效认购金额产生的利息为人民币489,376.35元,其中在基金募集期产生的利息为人民币276,940.62元,折合276,940.62份基金份额,其余利息为人民币212,435.73元于基金合同生效后归入本基金。基金合同生效日为2004年12月6日,合同生效日基金份额为1,573,598,040.62份基金单位。

本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。《诺安货币市场基金基金合同》、《诺安货币市场基金招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

2. 主要会计政策及会计估计

编制基金财务报表所遵循的主要会计制度及其他有关规定

本基金的会计报表乃按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《半年度报告的内容与格式》和《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第5号《货币市场基金信息披露特别规定》及基金合同的规定而编制。

会计年度

自公历1月1日至12月31日止。比较财务报表的实际编制期间为2005年1月1日至2005年12月31日。

记账本位币

以人民币为记账本位币。记账单位为元。

记账基础和计价原则

以权责发生制为记账基础。债券投资和待回购债券按摊余成本法计价,并以公允价值进行估值监控。除此之外,所有报表项目均以历史成本计价。

基金资产的估值原则

(1) 本基金的债券(含资产支持证券)投资和待回购债券采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率扣除应由债券发行单位代扣代缴的个人所得税后每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。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。在有关法律法规允许证券交易所交易的短期债券可以采用摊余成本法前,本基金暂不投资于证券交易所交易的短期债券;

(2) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一计价日,采用市场利率、交易价格及“货币市场基金影子定价小组”的意见,对基金持有的计价对象进行重新评估,即“影子定价”。当基金资产净值与影子定价的偏离达到或超过基金资产净值的0.25%时,或基金管理人认为发生了其他的重大偏离时,基金管理人根据风险控制的需要调整组合,其中,对于偏离程度达到或超过0.5%的情形,基金管理人编制并披露临时报告。使得以摊余成本法计算的基金资产净值不会对基金持有人造成实质性的损害;

(3) 如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况,在与基金托管人商议后,按最能反映基金资产公允价值的方法估值;

(4) 如有新增事项,按国家最新规定估值。

债券投资的成本计价方法

按移动加权平均法计算债券的成本。当日有买入和卖出时,先计算成本后计算买卖债券价差。

(1) 债券

A. 买入银行间同业市场交易的债券(含资产支持证券)于实际支付价款时确认为债券投资,按实际支付的全部价款入账,如果实际支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,作为应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

B. 买入交易所交易的资产支持证券于成交日确认为债券投资,如果应支付的价款中包含其起息日或上次除息日至购买日止的利息,作为应收利息单独核算,不构成其投资成本;深交所和上交所买入资产支持证券成本:由买入金额、买入经手费和买入结算费组成;

C. 买入以贴现方式发行的债券(含资产支持证券)、央行票据和零息债券无需单独核算应收利息;

D. 本基金在本报告期内未投资资产支持证券。

(2) 买入返售证券

买入返售证券成本:通过银行间市场进行融券业务,按实际支付的价款确认买入返售证券投资。

待回购债券

通过银行间同业市场进行买断式回购业务时,将所有权转出的债券投资自回购首期转入待回购债券,将融入资金记入卖出回购证券款。待回购债券于回购到期时转回债券投资。

待摊费用的摊销方法和摊销期限

待摊费用按直线法在受益期内平均摊销。

收入的确认和计量

(1) 债券差价收入:

卖出银行间市场交易债券(含资产支持证券)--于实际收到价款时确认债券差价收入,并按实际收到的全部价款与其成本、溢折价、应收利息的差额入账;

卖出交易所交易资产支持证券--于成交日确认其差价收入,并按应收取的全部价款与其成本、溢折价、应收利息和相关费用的差额入账;

- (2). 付息债券(含资产支持证券)利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额,并经债券投资溢价或折价摊销额调整后的金额在债券实际持有期内逐日计提入账;以贴现方式发行的债券(含资产支持证券)央行票据或零息债券的利息收入在债券持有期内,按债券面值扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额与买入成本之间的差额在债券剩余期间逐日计提入账;
- (3). 债券手续费返还收入按权责发生制原则,视为折溢价计入债券成本,并在债券剩余存续期内摊销;
- (4). 活期存款利息收入、清算备付金利息收入按本金与适用的利率逐日计提的金额入账;
- (5). 定期存款利息收入按本金与约定的利率逐日计提的金额入账;
- (6). 买入返售证券收入按证券持有期内采用直线法逐日计提的金额入账;
- (7). 其他收入于实际收到时确认收入。

费用的确认和计量

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%的年费率逐日计提;
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率逐日计提;
- (3) 销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提;
- (4) 卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率,在回购期限内采用直线法逐日计提;
- (5) 信息披露费、审计费用和债券托管账户维护费按期初合理预估数额逐日预提;
- (6) 债券交易(含回购)发生的手续费按权责发生制原则直接确认费用;
- (7) 其他费用于实际支付时确认费用。

基金申购、赎回、转换的确认

在收到基金投资人申购或赎回或转换申请之日后,于下一个工作日内对该交易的有效性进行确认。于确认日确认为实收基金的增加或减少。

实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购、赎回、转换引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日、转换确认日认列。

基金的收益分配政策

- (1). 基金收益分配根据每日基金收益公告,以每万份基金份额收益为基准,为投资者每日计算并分配,每月集中支付收益;
- (2). 基金收益分配根据每日基金收益情况,将当日收益全部分配,若当日净收益大于零时,为投资者记正收益;若当日净收益小于零时,为投资者记负收益;若当日净收益等于零时,为投资者不记收益;
- (3). 基金收益分配只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式,投资者可通过赎回基金份额获得现金收益;
- (4). 每一基金份额享有同等分配权;
- (5). 当日申购的基金份额不享有当日分红权益,赎回的基金份额享有当日分红权益;
- (6). 本基金收益每月集中支付一次,成立不满1个月不支付;
- (7). 法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

3. 税项

营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。

个人所得税

对基金取得的股票的股息、红利收入及债券的利息收入，由上市公司及债券发行企业在向基金派发股息、红利收入及债券的利息收入时代扣代缴20%的个人所得税。

4. 银行存款

	<u>2006年12月31日</u>	<u>2005年12月31日</u>
活期银行存款	318,796,090.49	169,613,833.03
定期银行存款	0.00	700,000,000.00
合计	<u>318,796,090.49</u>	<u>869,613,833.03</u>

5. 应收利息

	<u>2006年12月31日</u>	<u>2005年12月31日</u>
银行存款利息	41,544.29	4,999,459.33
债券利息	6,312,415.72	4,718,657.39
其中：资产支持证券利息	0.00	0.00
买入返售证券利息	0.00	127,938.24
合计	<u>6,353,960.01</u>	<u>9,846,054.96</u>

6. 债券投资成本

	<u>2006.12.31</u>	<u>2005.12.31</u>
债券投资成本	2,023,842,687.12	1,900,270,213.35
其中：资产支持证券投资成本	0.00	0.00
合计	<u>2,023,842,687.12</u>	<u>1,900,270,213.35</u>

7. 应付收益

	<u>2006年12月31日</u>	<u>2005年12月31日</u>
本期基金净收益	51,602,839.80	71,424,052.01
加：期初未支付收益金额	1,464,104.27	2,610,379.67
减：本期集中支付收益金额	48,017,455.78	70,123,212.17
减：本期赎回结算支付的收益金额	3,800,582.03	2,447,115.24
应付收益	<u>1,248,906.26</u>	<u>1,464,104.27</u>

8. 其他应付款

	<u>2006年12月31日</u>	<u>2005年12月31日</u>
银行间回购交易费	6,906.60	2,760.00
银行间债券交易费	24,675.00	10,650.00

合计	31,581.60	13,410.00
----	-----------	-----------

9. 预提费用

	2006年12月31日	2005年12月31日
信息披露费用	220,000.00	0.00
审计费用	100,000.00	100,000.00
账户维护费	4,500.00	4,500.00
合计	324,500.00	104,500.00

10. 实收基金

	2006年度		2005年度	
	基金份额数	实收基金	基金份额数	实收基金
期初数	2,841,886,054.05	2,841,886,054.05	1,524,282,562.93	1,524,282,562.93
加：				
本期申购、转入	10,567,815,156.94	10,567,815,156.94	12,011,444,099.88	12,011,444,099.88
减：				
本期赎回、转出	11,063,464,098.31	11,063,464,098.31	10,693,840,608.76	10,693,840,608.76
期末数	2,346,237,112.68	2,346,237,112.68	2,841,886,054.05	2,841,886,054.05

11. 债券差价收入

项 目	2006 年度	2005 年度
卖出及兑付债券成交总额	14,047,735,453.22	13,747,382,858.04
其中：资产支持证券成交总额	0.00	0.00
减：		
卖出及兑付债券成本总额	13,948,929,439.70	13,648,353,428.40
其中：资产支持证券成本总额	0.00	0.00
应收利息总额	88,792,929.49	78,131,118.02
其中：资产支持证券利息总额	0.00	0.00
债券差价收入	10,013,084.03	20,898,311.62
其中：资产支持证券差价收入	0.00	0.00

12. 其他费用

	2006年度	2005年度
信息披露费	320,000.00	330,000.00
审计费用	100,000.00	100,000.00
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
回购交易手续费	66,513.44	22,240.00
债券交易手续费	106,170.00	48,650.00
汇划费	50,572.98	0.00

证券账户开户费	400.00	0.00
合计	661,656.42	518,890.00

13. 已分配基金净收益

	<u>2006年度</u>	<u>2005年度</u>
累计收益分配金额	51,602,839.80	71,424,052.01

14. 关联方关系及其交易

(1) 关联方关系

<u>企业名称</u>	<u>与本基金的关系</u>
中国对外经济贸易信托投资有限公司	管理人股东
中国新纪元有限公司	管理人股东
北京中关村科学城建设股份有限公司	管理人股东
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人
中国工商银行股份有限公司	托管人
中国中化集团公司	管理人股东母公司
中化国际(控股)股份有限公司	管理人股东母公司控股子公司
中国金茂(集团)股份有限公司	管理人股东母公司控股子公司

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 关联方报酬

1. 基金管理人报酬

基金管理费

A. 基金管理费按前一日的基金资产净值的0.33%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

B. 基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。本基金于本期应支付基金管理人管理费共人民币8,671,544.67元，其中已支付基金管理人人民币9,235,939.77元，尚余人民币558,397.39元未支付。(2005年应支付基金管理人管理费共人民币10,736,702.81元，其中已支付基金管理人人民币9,965,543.13元，尚余人民币1,122,792.49元未支付。)

2. 基金托管人报酬

基金托管费

- A. 基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

- B. 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。本基金于本期应支付基金托管人托管费共人民币2,627,740.96元，其中已支付基金托管人人民币2,798,769.76元，尚余人民币169,211.35元未支付。（2005年应支付基金托管人托管费共人民币3,253,546.21元，其中已支付基金托管人人民币3,019,861.49元，尚余人民币340,240.15元未支付。）

3. 基金代销机构

基金销售服务费

- A. 基金销售服务费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

- B. 基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给销售机构。本基金于本期应支付基金销售机构销售服务费共人民币6,569,352.12元，其中已支付基金销售机构人民币6,996,924.16元，尚余人民币423,028.34元未支付。（2005年应支付基金销售机构销售服务费共人民币8,133,865.92元，其中已支付基金销售机构人民币7,549,654.02元，尚余人民币850,600.38元未支付。）
- C. 需支付给关联方的销售服务费

关联方名称	2006 年度	2005 年度
诺安基金管理有限公司（管理人）	2,500,141.47	4,324,707.51
中国工商银行股份有限公司（托管人）	3,913,527.00	3,649,407.06
合计	6,413,668.47	7,974,114.57

(3) 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

- A. 本基金于本年与基金托管人进行了银行间债券买卖交易，成交金额为9,589,291,602.20元。其中：债券买入交易成交金额为4,643,858,674.60元，债券卖出交易成交金额为4,945,432,927.60元；（2005年与基金托管人进行了银行间债券买卖交易，成交金额为200,751,488.22元。其中：债券买入交易成交金额为100,381,052.02元，债券卖出交易成交金额为100,370,436.20元。）

B. 本基金本年与基金托管人进行了银行间卖出回购债券交易，交易金额为 689,500,000.00 元，回购利息支出 286,875.90 元。（2005 年与基金托管人进行了银行间卖出回购债券交易，交易金额为 100,000,000.00 元，回购利息支出 8,876.71 元。）

(4) 关联方投资本基金的情况

关联方单位	期初持有 基金份额 数(份)	本期认购 (申购、红利) 份额数(份)	本期赎回 份额数(份)	期末持有 基金份额 数(份)	占基金 份额比例
中国中化集团公司	410,664,024.03	6,500,746.11	417,164,770.14	0.00	0.00%
中化国际(控股)股份有限公司	0.00	40,030,666.58	40,030,666.58	0.00	0.00%
中国金茂(集团)股份有限公司	16,718.09	130,258,781.78	130,275,499.87	0.00	0.00%
合计	410,680,742.12	176,790,194.47	587,470,936.59	0.00	0.00%

(5) 存放于基金托管人的银行存款以及产生的利息收入

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
银行存款	318,796,090.49	169,613,833.03
利息收入	1,294,136.23	3,164,131.04

15. 流通转让受到限制的基金资产

无。

16. 资产负债表日后事项

本基金于 2007 年 1 月 22 日宣告本基金收益支付公告（2007 年第 1 号），对本基金自 2006 年 12 月 22 日至 2007 年 1 月 21 日的累计收益进行集中支付，并按 1 元面值直接结转为基金份额，不进行现金支付。

七、投资组合报告

(一) 报告期末基金资产组合情况

项 目	金 额(元)	占基金总资产的比例(%)
债券投资	2,023,842,687.12	86.16%
买入返售证券	0.00	0.00%
其中：买断式回购的买入返售证券	0.00	0.00%
银行存款及清算备付金合计	318,796,090.49	13.57%
其他资产	6,353,960.01	0.27%
合计	2,348,992,737.62	100.00%

(二) 报告期债券回购融资情况

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	20,834,100,000.00	3.97%
	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	0.00	0.00%
	其中：买断式回购融资	0.00	0.00%

说明：(报告期内本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%)

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2006-12-04	20.27%	大额赎回	1 天

(三) 报告期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	147
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	175
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	74

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	22.10%	0.00%
2	30 天(含)—60 天	5.55%	0.00%
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.43%	0.00%
3	60 天(含)—90 天	11.91%	0.00%
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	5.57%	0.00%
4	90 天(含)—180 天	24.62%	0.00%
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	7.30%	0.00%
5	180 天(含)—397 天(含)	35.67%	0.00%
合 计		99.85%	0.00%

(四) 报告期末债券投资组合

1、 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	1,248,834,103.71	53.23%
	其中：政策性金融债	946,932,758.79	40.36%
3	央行票据	233,729,817.96	9.96%
4	企业债券	541,278,765.45	23.07%
5	其他	0.00	0.00%
合计		2,023,842,687.12	86.26%
剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券		311,994,657.58	13.30%

2、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	04 建行 03 浮	1,700,000		171,188,118.89	7.30%
2	06 进出 05	1,500,000		149,957,329.28	6.39%
3	05 中行 02 浮	1,300,000		130,713,226.03	5.57%
4	06 农发 14	1,000,000		99,955,342.61	4.26%
5	06 国开 22	1,000,000		99,829,999.99	4.25%
6	06 国开 15	1,000,000		99,823,175.00	4.25%
7	06 国开 23	1,000,000		99,130,384.47	4.23%
8	06 进出 06	1,000,000		98,909,502.84	4.22%
9	06 央行票据 78	1,000,000		97,794,876.88	4.17%
10	04 国开 17	900,000		90,118,718.10	3.84%

(五) 报告期“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	110
报告期内偏离度的最高值	0.46%
报告期内偏离度的最低值	0.08%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.26%

(六) 投资组合报告附注

1、本基金采用摊余成本法计价，即计价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，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。

2、本报告期内存在“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”的摊余成本超过当日基金资产净值的 20% 的情况，但均在规定时间内调整合规。

序号	发生日期	占基金资产净值的比例(%)	原因
1	2006-07-24	23.08%	组合调整等
2	2006-08-29	20.04%	大额赎回
3	2006-08-30	21.88%	大额赎回
4	2006-08-31	22.17%	大额赎回
5	2006-09-01	22.03%	大额赎回

3、本报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

4、期末其他资产构成

序号	其他资产	金额(元)
1	交易保证金	0.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收利息	6,353,960.01
4	应收申购款	0.00
5	其他应收款	0.00
6	待摊费用	0.00
7	其他	0.00
合计		6,353,960.01

八、基金份额持有人户数、持有人结构

基金份额持有人户数	23,984.00
平均每户持有的基金份额	97,825.10
机构投资者持有的基金份额	385,221,452.11
机构投资者持有的基金份额占总份额的比例	16.42%
个人投资者持有的基金份额	1,961,015,660.57
个人投资者持有的基金份额占总份额的比例	83.58%

九、开放式基金份额变动

(一) 基金合同生效日基金份额总额：1,573,598,040.62

(二) 本报告期内基金份额的变动情况

期初基金份额总额	2,841,886,054.05
期间基金总申购份额	10,567,815,156.94
期间基金总赎回份额	11,063,464,098.31
期末基金份额总额	2,346,237,112.68

十、重大事件揭示

(一) 本年度未召开本基金的基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

(二) 本基金管理人于 2006 年 2 月 22 日发布了关于调整基金经理的公告，决定聘任钟志伟先生担任诺安货币市场基金基金经理，赵永健先生不再担任诺安货币市场基金基金经理的职务；于 2006 年 4 月 29 日发布了关于公司高级管理人员变动的公告，王铁林先生辞去公司副总经理的职务；于 2006 年 8 月 19 日发布了关于调整诺安货币市场基金基金经理的公告，决定聘任张乐赛先生担任诺安货币市场基金基金经理，钟志伟先生不再担任诺安货币市场基金基金经理的职务；于 2006 年 9 月 29 日发布了关于公司聘任高级管理人员的公告，聘任奥成文先生担任公司总经理，易军先生、杨文先生担任公司副总经理，陈勇先生担任公司督察长。姜永凯先生不再担任公司总经理职务，奥成文先生不再担任公司督察长职务。基金托管人的专门基金托管部门在本报告期内没有发生重大人事变动。

(三) 本年度无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(四) 本报告期内基金的投资组合策略没有重大改变。

(五) 本基金在报告期内累计收益分配金额人民币 51,602,839.80 元，共进行了 12 次基金收益集中支付并结转为基金份额。

披露事项	披露报纸	披露日期
诺安货币市场基金收益支付公告(2006 年第 1 号)	《中国证券报》 《证券时报》 《上海证券报》	2006-1-23
诺安货币市场基金收益支付公告(2006 年第 2 号)		2006-2-22
诺安货币市场基金收益支付公告(2006 年第 3 号)		2006-3-22
诺安货币市场基金收益支付公告(2006 年第 4 号)		2006-4-24
诺安货币市场基金收益支付公告(2006 年第 5 号)		2006-5-22
诺安货币市场基金收益支付公告(2006 年第 6 号)		2006-6-22
诺安货币市场基金收益支付公告(2006 年第 7 号)		2006-7-24
诺安货币市场基金收益支付公告(2006 年第 8 号)		2006-8-22
诺安货币市场基金收益支付公告(2006 年第 9 号)		2006-9-22
诺安货币市场基金收益支付公告(2006 年第 10 号)		2006-10-23
诺安货币市场基金收益支付公告(2006 年第 11 号)		2006-11-22
诺安货币市场基金收益支付公告(2006 年第 12 号)		2006-12-22

(六) 本报告期内本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。本年度应付未付给所聘任会计师事务所的审计费为 10 万元，其已提供审计服务的连续年限：自本基金合同生效日起至今为 2 年。

(七) 本基金的基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

(八) 本基金租用专用交易席位的有关情况

1、证券公司名称及席位数量、债券回购交易及支付佣金情况

券商名称	席位数量	回购成交金额	占成交总额的比例	应付佣金	占佣金总量比例
金元证券有限责任公司	1	2,292,300,000.00	100.00%	0.00	0.00%
合计	1	2,292,300,000.00	100.00%	0.00	0.00%

2、本报告期租用证券公司席位的变更情况

本报告期新增 1 家证券公司 1 个席位：金元证券有限责任公司（1 个席位）。

3、专用席位的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服。

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订《专用证券交易席位租用协议》。

(九) 报告期内发生的其他重大事件的事项

1、本基金管理人于 2006 年 2 月 8 日发布公告,增加深圳发展银行代销机构的全国所有网点,办理本基金的开户、申购和赎回业务;于 2006 年 2 月 9 日发布公告变更华夏证券代销机构为中信建投证券代销机构,由中信建投证券代销机构的全国所有网点继续办理本基金的开户、申购和赎回业务;于 2006 年 4 月 20 日发布公告,增加南京证券代销机构的全国所有网点,办理本基金的开户、申购和赎回业务;于 2006 年 6 月 16 日发布公告,增加湘财证券代销机构的全国所有网点,办理本基金的开户、申购和赎回业务;于 2006 年 6 月 26 日发布公告,增加兴业证券代销机构的全国所有网点,办理本基金的开户、申购和赎回业务;于 2006 年 7 月 28 日发布公告,增加招商银行代销机构的全国所有网点,办理本基金的开户、申购和赎回业务;于 2006 年 10 月 27 日发布公告,增加东海证券代销机构的全国所有网点,办理本基金的开户、申购和赎回业务;于 2006 年 11 月 2 日发布公告增加德邦证券代销机构的全国所有网点,办理本基金的开户、申购和赎回业务。以上均在《中国证券报》、《上海证券报》及《证券时报》上公告。

2、本基金管理人于 2006 年 1 月 17 日分别在《中国证券报》、《证券时报》及《上海证券报》上发布公告,更新本基金招募说明书全文及摘要。

3、本基金管理人于 2006 年 1 月 20 日分别在《中国证券报》、《证券时报》及《上海证券报》上发布诺安货币市场基金春节长假前单日(2006 年 1 月 24 日)暂停申购的公告,以保护投资者利益。

4、本基金管理人于 2006 年 3 月 15 日分别在《中国证券报》、《证券时报》及《上海证券报》上发布公告,决定于 2006 年 3 月 17 日开始对直销投资者开通本基金与诺安股票证券投资基金之间的基金转换业务。

5、本基金管理人于 2006 年 4 月 25 日分别在《中国证券报》、《证券时报》及《上海证券报》上发布诺安货币市场基金“五一”长假前单日(2006 年 4 月 27 日)暂停申购的公告,以保护投资者利益。

6、本基金管理人于 2006 年 6 月 8 日分别在《中国证券报》、《证券时报》及《上海证券报》上发布公告,决定于 2006 年 6 月 12 日起变更基金直销专户账户,启用新的基金直销专户。

7、本基金管理人于 2006 年 7 月 12 日分别在《中国证券报》、《证券时报》及《上海证券报》上发布公告,更新本基金招募说明书全文及摘要。

8、本基金管理人于 2006 年 8 月 28 日分别在《中国证券报》、《证券时报》及《上海证券报》上发布公告,决定诺安货币市场基金自 2006 年 8 月 28 日起通过中国工商银行股份有限公司开办“利添利”账户理财业务。

9、本基金管理人于 2006 年 9 月 15 日分别在《中国证券报》、《证券时报》及《上海证券报》上发布公告,决定于 2006 年 9 月 18 日开始开通旗下四只基金(本基金、诺安平衡证券投资基金、诺安股票证券投资基金、诺安中短期债券投资基金)之间的基金转换业务。

10、本基金管理人于 2006 年 9 月 26 日分别在《中国证券报》、《证券时报》及《上海证券报》上发布诺安货币市场基金“十一”长假前单日(2006 年 9 月 28 日)暂停申购的公告,以保护投资者利益。

11、本基金管理人于 2006 年 9 月 30 日分别在《中国证券报》、《证券时报》及《上海证券报》上发布关于本基金管理人管理的本基金将可能运用本基金财产投资于在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持证券的公告。

12、本基金管理人于 2006 年 10 月 13 日分别在《中国证券报》、《证券时报》及《上海证券报》上发布公告,决定于 2006 年 10 月 16 日开始开通基金网上交易业务。

13、本基金管理人于 2006 年 12 月 26 日分别在《中国证券报》、《证券时报》及《上海证券报》上发布诺安货币市场基金“元旦”长假前单日(2006 年 12 月 28 日)暂停申购的公告,以

保护投资者利益。

十一、备查文件目录、存放地点和查阅方式

(一) 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准诺安货币市场基金设立的文件。
- 2、《诺安货币市场基金基金合同》。
- 3、《诺安货币市场基金托管协议》。
- 4、诺安基金管理有限公司批准成立批件、营业执照。
- 5、《诺安基金管理有限公司开放式基金业务规则》。
- 6、本报告期内在中国证监会指定报刊上公开披露的各项公告。

(二) 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

(三) 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可致电本基金管理人全国统一客户服务电话：
400-888-8998 或客户服务中心电话：0755-83026888，亦可登陆基金管理人网站
<http://www.lionfund.com.cn>查阅详情。

诺安基金管理有限公司

二零零七年三月二十七日