

上投摩根货币市场基金

二零零六年年度报告

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期： 2007 年 03 月 27 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 年 3 月 26 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。

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财产，但不保证基金一定盈利。

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

二、	<u>基金简介</u>	3
	<u>(一) 基金概况</u>	3
	<u>(二) 基金投资概况</u>	3
	<u>(三) 基金管理人</u>	4
	<u>(四) 基金托管人</u>	5
	<u>(五) 信息披露指定报纸</u>	5
	<u>(六) 其他服务机构</u>	5
二、	<u>主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况</u>	6
	<u>(一) 主要财务指标</u>	6
	<u>(二) 基金净值表现</u>	7
	<u>(三) 基金收益分配情况</u>	8
三、	<u>基金管理人报告</u>	9
	<u>(一) 基金管理人及基金经理简介</u>	9
	<u>(二) 基金运作的遵规守信情况说明</u>	9
	<u>(三) 基金经理工作报告</u>	9
	<u>(四) 基金内部监察报告</u>	10
四、	<u>托管人报告</u>	11
五、	<u>审计报告</u>	11
六、	<u>财务会计报告</u>	12
七、	<u>基金投资组合报告(截止 2006 年 12 月 31 日)</u>	25
	<u>(一) 报告期末基金资产组合情况</u>	25
	<u>(二) 报告期债券回购融资情况</u>	25
	<u>(三) 基金投资组合平均剩余期限</u>	26
	<u>(四) 报告期末债券投资组合</u>	26
	<u>(五) “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离</u>	27
	<u>(六) 投资组合报告附注</u>	28
八、	<u>基金份额持有人户数、持有人结构</u>	29
九、	<u>开放式基金份额变动</u>	29
十、	<u>重大事件揭示</u>	29
	<u>(一) 基金份额持有人大会</u>	29
	<u>(二) 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动</u>	29

(三) 诉讼事项	29
(四) 基金投资策略的改变	29
(五) 基金收益分配事项	30
(六) 会计师事务所	30
(七) 基金管理人、托管人及高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况	30
(八) 本基金租用专用交易席位的情况	30
(九) 其他重要事项	30
十一、 备查文件目录	31

一、 基金简介

(一) 基金概况

基金名称：上投摩根货币市场基金

基金简称：A 类——上投货币 A

B 类——上投货币 B

交易代码：A 类——370010A

B 类——370010B

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2005 年 4 月 13 日

报告期末基金份额总额：A 类—— 342,165,141.04 份

B 类——1,020,171,368.33 份

基金合同存续期：不定期

(二) 基金投资概况

1、基金投资目标

通过合理的资产选择，在有效控制投资风险和保持较高流动性的前提下，为投资者提供资金的流动性储备，进一步优化现金管理，并力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。

2、基金投资策略

本基金投资管理将充分运用收益率策略与估值策略相结合的方法，对各类可投资资产进行合理的配置和选择。投资策略首先审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征，在

风险与收益的配比中，力求将各类风险降到最低，并在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益。

利率预期策略：市场利率因应景气循环、季节因素或货币政策变动而产生波动，本基金将首先根据对国内外经济形势的预测，分析市场投资环境的变化趋势，重点关注利率趋势变化；其次，在判断利率变动趋势时，我们将重点考虑货币供给的预期效应(Money-supply Expectations Effect)、通货膨胀与费雪效应(Fisher Effect)以及资金流量变化(Flow of Funds)等，全面分析宏观经济、货币政策与财政政策、债券市场政策趋势、物价水平变化趋势等因素，对利率走势形成合理预期，从而做出各类资产配置的决定。

估值策略：建立不同品种的收益率曲线预测模型，并通过这些模型进行估值，确定价格中枢的变动趋势。根据收益率、流动性、风险匹配原则以及债券的估值原则构建投资组合，合理选择不同市场中有投资价值的券种，并根据投资环境的变化相机调整。

久期管理：久期作为衡量债券利率风险的指标，反映了债券价格对收益率变动的敏感度。本基金努力把握久期与债券价格波动之间的量化关系，根据未来利率变化预期，以久期和收益率变化评估为核心。通过久期管理，合理配置投资品种。在预期利率下降时适度加大久期，在预期利率上升时适度缩小久期。

流动性管理：由于货币市场基金要保持高流动性的特性，本基金会紧密关注申购/赎回现金流情况、季节性资金流动、日历效应等，建立组合流动性预警指标，实现对基金资产的结构化管理，并结合持续性投资的方法，将回购/债券到期日进行均衡等量配置，以确保基金资产的整体变现能力。

随着国内货币市场的进一步发展，以及今后相关法律法规允许本基金可投资的金融工具出现时，本基金将予以深入分析并加以审慎评估，在符合本基金投资目标的前提下适时调整本基金投资对象。

3、基金业绩比较基准

6个月定期存款利率(税后)。鉴于本基金产品自身及目标市场定位，特制订此业绩比较基准。当法律法规发生变化或市场有更加适合的业绩比较基准时，基金管理人有权对此基准进行调整，并提前三个工作日在至少一种指定媒体上公告。

4、风险收益特征

本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险品种，其预期风险和预期收益率都低于股票基金、债券基金和混合基金。

(三) 基金管理人

基金管理人名称：上投摩根基金管理有限公司

注册及办公地址：上海市浦东富城路 99 号震旦国际大楼 20 层

邮政编码：200120

法定代表人：陈开元

信息披露负责人：王峰

联系电话：8621-38794888

传真：8621-68881170

电子信箱：alan.wang@jpmf-sitico.com

(四) 基金托管人

基金托管人名称：中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）

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

邮政编码：100032

法定代表人：郭树清

信息披露负责人：尹东

联系电话：010-67595104

传真：010-66275853 010-66275865

电子信箱：yindong.zh@ccb.cn

(五) 信息披露指定报纸

本基金信息披露指定报纸：《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》

登载年度报告正文的管理人互联网网址：www.51fund.com

基金年度报告置备地点：基金管理人、基金托管人和基金代销机构的办公场所和营业场所。

(六) 其他服务机构

会计师事务所：普华永道中天会计师事务所有限公司
 办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

注册登记机构名称：上投摩根基金管理有限公司
 办公地址：上海市浦东富城路 99 号震旦国际大楼 20 层

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 (2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日)

单位：人民币元

序号	主要财务指标		2006-01-01 至 2006-12-31	2005 年 4 月 13 日 (基金成立日) 至 2005 年 12 月 31 日 止期间
1	基金本期净收益	A 类	2,594,911.48	1,233,381.41
		B 类	12,819,420.72	1,869,840.49
2	基金份额本期净收益	A 类	0.0159	0.0063
		B 类	0.0177	0.0085
3	期末可供分配基金收 益	A 类	0.00	0.00
		B 类	0.00	0.00
4	期末可供分配基金份 额收益	A 类	0.00	0.00
		B 类	0.00	0.00
5	期末基金资产净值	A 类	342,165,141.04	71,720,202.94
		B 类	1,020,171,368.33	243,951,186.13
6	期末基金份额净值	A 类	1.0000	1.0000

		B类	1.0000	1.0000
7	基金加权平均净值收益率	A类	1.5879%	0.63%
		B类	1.7704%	0.85%
8	基金本期净值收益率	A类	1.4773%	0.6628%
		B类	1.7199%	0.8377%
9	基金累计净值收益率	A类	2.1499%	0.6628%
		B类	2.5720%	0.8377%

注：本基金收益分配按月结转份额。

所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（二）基金净值表现

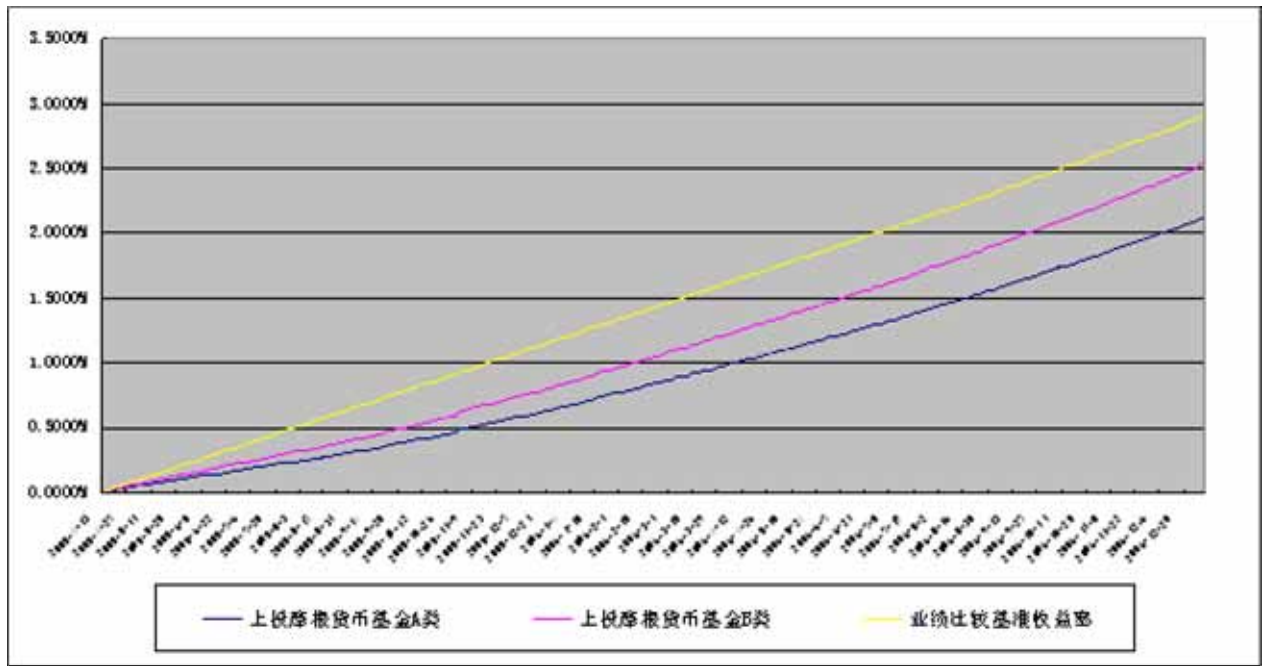
1、上投摩根货币市场基金历史各时间段基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段		基金净值收益率	基金净值收益率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去3个月	A类	0.4358%	0.0460%	0.4537%	0.0000%	-0.0179%	0.0460%
	B类	0.4962%	0.0532%	0.4537%	0.0000%	0.0425%	0.0532%
过去6个月	A类	0.8258%	0.0367%	0.8881%	0.0002%	-0.0623%	0.0365%
	B类	0.9470%	0.0424%	0.8881%	0.0002%	0.0589%	0.0422%
过去一年	A类	1.4773%	0.0274%	1.7093%	0.0002%	-0.2320%	0.0272%
	B类	1.7199%	0.0313%	1.7093%	0.0002%	0.0106%	0.0311%
自基金成立	A类	2.1499%	0.0325%	2.9025%	0.0001%	-0.7526%	0.0324%

金成 立至 今	B 类	2.5720%	0.0351%	2.9025%	0.0001%	-0.3305%	0.0350%
---------------	--------	---------	---------	---------	---------	----------	---------

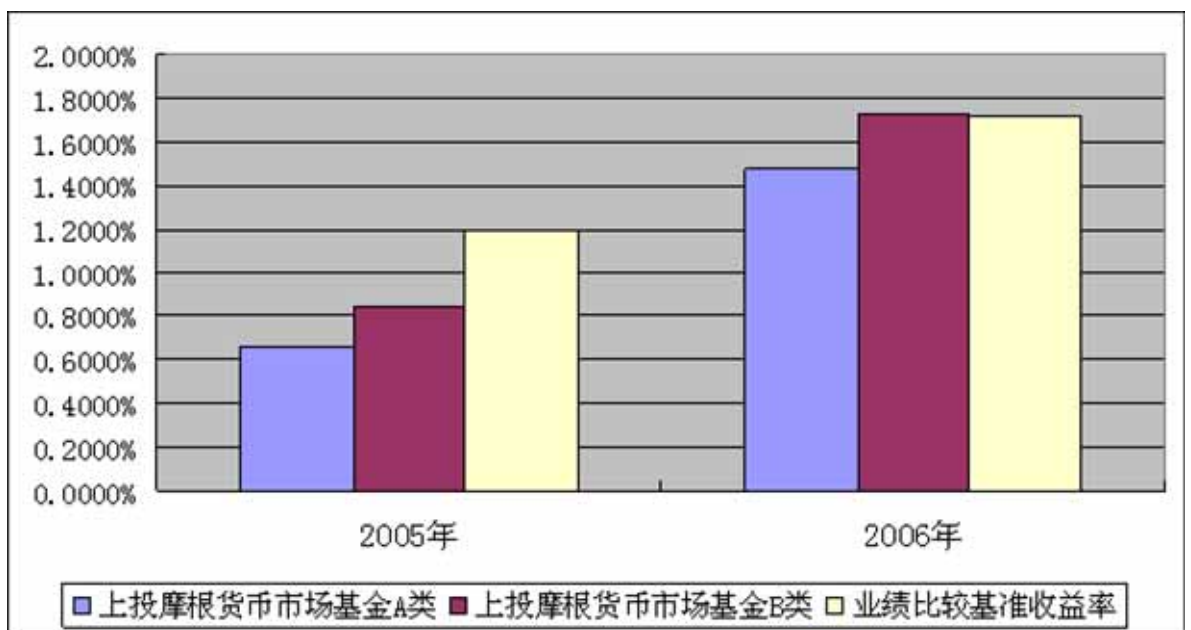
注：本基金合同生效日为 2005 年 4 月 13 日。

2、上投摩根货币市场基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图：



注：本基金合同生效日为 2005 年 4 月 13 日。图示时间段为 2005 年 4 月 13 日至 2006 年 12 月 31 日。

3、上投摩根货币市场基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率对比图：



注：本基金合同生效日为 2005 年 4 月 13 日。图示时间段为 2005 年 4 月 13 日至 2006 年 12 月 31 日。

(三) 基金收益分配情况

年度	每 10 份基金份额分红数 (元)		备注
2005 年	A 类	0.066	本基金于 2005 年 4 月 13 日正式成立。自基金合同生效日至 2005 年 12 月 31 日, 本基金运作时间未满一年。
	B 类	0.083	
2006 年	A 类	0.147	
	B 类	0.171	
合计	A 类	0.213	
	B 类	0.254	

三、基金管理人报告

(一) 基金管理人及基金经理简介

上投摩根基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准, 于 2004 年 5 月 12 日正式成立。公司由上海国际信托投资有限公司与摩根富林明资产管理(英国)有限公司合资设立, 注册资本为 1.5 亿元人民币, 注册地上海。截止 2006 年底, 公司管理的基金共有五只, 均为开放式基金: 1、上投摩根中国优势证券投资基金, 于 2004 年 9 月 15 日成立, 首发规模为 1,669,305,034.88 份; 2、上投摩根货币市场基金, 于 2005 年 4 月 13 日成立, 首发规模为 991,360,522.73 份; 3、上投摩根阿尔法股票型证券投资基金, 于 2005 年 10 月 11 日成立, 首发规模为 767,620,088.15 份; 4、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金, 于 2006 年 4 月 26 日成立, 首发规模为 6,435,738,977.50 份; 5、上投摩根成长先锋股票型证券投资基金, 于 2006 年 9 月 20 日成立, 首发规模为 5,480,692,618.04 份。

基金经理, 李颖女士, 1975 年出生, 管理学博士, 中国注册会计师, 8 年证券从业经历。曾任上海金信证券研究所研究员; 湘财证券资产管理总部投资经理; 长信基金管理公司长信利息收益基金基金经理。2005 年 9 月加入上投摩根基金管理有限公司。

（二）基金运作的遵规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循《上投摩根货币市场基金基金合同》，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，力求使公司成为“中国投资人的国际投资专家，国际投资人的中国投资专家”。

本报告期内，货币市场基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

（三）基金经理工作报告

1. 2006 年上投摩根货币市场基金运作回顾

2006 年中国经济在经历了两次加息，三次提高存款准备金率及一系列行政调控之后，增速有所放缓。而债券市场也体现了较明显的波段运行的特征。但总体而言，宽松的资金面，CPI 的低位运行以及央行持续不断的公开市场回笼操作使得 2006 年收益率曲线形变以短端上升以及长端维持不变为主要特征，而收益率曲线也因此更加扁平化。

2006 年我们一如既往地秉承了谨慎投资的原则，并在投资过程中对风险保持了一贯地高度警惕并进行了有效地防范。作为目前国内唯一被国际评级机构--穆迪和惠誉同时授予 AAA 信用等级的货币市场基金，借鉴国际市场的经验，上投摩根货币市场基金将组合久期限制在 75 天以内，远低于目前国内通行的 180 天组合久期限制。上投摩根货币市场基金也不进行正回购放大操作。在以市场利率为基准的浮动利率债券投资上，也仅投资实际存续期在 3 年以内的浮动利率债券。在对短期融资券的投资及逆回购交易对手方面也有非常严格的规定和限制。此外，为保持高度的流动性，上投摩根货币市场基金对现金及 7 天以内短期品种也设定了最低投资比例要求。这些限制和规定，一方面制约了基金收益的提高，但另一方面增强了基金抵御各种风险的能力。

我们的组合保持了高度的流动性，在 2006 年我们较好地把握了波段性的投资机会，并且积极捕捉市场中存在的套利机会，基金收益有了较大幅度的提高。同时基金的投资风格也逐步得到投资者的认同，基金规模也有了大幅度的增加。

2. 2007 年投资展望

2007 年中国经济仍将维持较高的增长。外贸顺差将进一步增长，人民币升值压力不减。流动性过剩仍将成为市场的常态。而受企业利润强劲增长及银行追求利润等因素的影响，信贷反弹的可能性较大，从而对流动性增长也有较强的刺激。与 2006 年相比，通货膨胀及通货膨胀预期都将有所增加。对货币政策而言，流动性管理将成为贯穿 2007 年的主题，多次

提高存款准备金率可以预期。同时由于实际利率过低，加息的必要性也有所增加。

2007年我们将密切关注市场情况，及时制定相应的投资策略。同时我们仍将秉承一贯的谨慎投资的原则，在保证基金资产流动性、安全性的前提下，努力为投资者获取更多的回报。

（四）基金内部监察报告

报告期内，本基金管理人在内部监察工作中一切从合规运作、保障基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部门对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，推动内部控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实，发现问题及时提出建议并督促有关部门改进。

在本报告期内，本基金管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：

- （1）根据基金监管法律法规的重大变化，推动公司各部门完善制度建设和业务流程，并加强内部法规培训；
- （2）全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资的合法合规。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，完善内部控管，保证了本基金的合法合规运作，没有出现违规行为。
- （3）按照中国证监会的要求，在公司内部严格推行风险控制自我评估制度。通过各部门的参与和自我评估，明确了各部门的风险点，对控制不足的风险点，制订了进一步的控制措施。
- （4）根据监管部门的要求，完成与基金投资业务相关的定期监察报告，报送中国证监会和董事会；
- （5）制定了规范公司员工操守的有关规定，严格防范利益冲突。

公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。本基金运作合法合规，保障了基金份额持有人的利益。我们将继续以风险控制为核心，提高内部监察工作的科学性和有效性，保障基金合规运作。

四、托管人报告

中国建设银行股份有限公司根据《上投摩根货币市场基金基金合同》和《上投摩根货币市场基金托管协议》，托管上投摩根货币市场基金（以下简称上投货币基金）。

本报告期，中国建设银行股份有限公司在上投货币基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，依法安全保管了基金财产，按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

本报告期，按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金管理人 - 上投摩根基金管理有限公司在上投货币基金投资运作方面进行了监督，对基金资产

净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

由上投货币基金管理人 - 上投摩根基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的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真实、准确和完整。

五、 审计报告

审计报告

普华永道中天审字(2007)第 20278 号

上投摩根货币市场基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的上投摩根货币市场基金 2006 年 12 月 31 日的资产负债表、2006 年度的经营业绩表、基金净值变动表以及会计报表附注。

一、 管理层对会计报表的责任

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》、《上投摩根货币市场基金基金合同》及中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制会计报表是上投摩根货币市场基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 设计、实施和维护与会计报表编制相关的内部控制，以使会计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会计报表发表审计意见。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会计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，以获取有关会计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会计报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与会计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，以及评价会计报表的总体列报。

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，上述会计报表已经按照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》、《上投摩根货币市场基金基金合同》及中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了上投摩根货币市场基金 2006 年 12 月 31 日的财务状况以及 2006 年度的经营成果和基金净值变动。

普华永道中天
会计师事务所有限公司

注册会计师 汪棣
注册会计师 薛竞

中国·上海市
2007 年 2 月 27 日

六、财务会计报告

上投摩根货币市场基金

2006 年 12 月 31 日资产负债表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

资产	附注	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
银行存款	(a)	144,824,002.05	4,263,928.07
清算备付金		21,557,733.16	9,371,471.01
交易保证金		0.00	0.00
应收证券清算款		170,196,450.00	45,017,300.00
应收股利		0.00	0.00
应收利息	(b)	719,714.74	37,341.97
应收申购款		0.00	30,834,686.10
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值		0.00	0.00
其中：股票投资成本		0.00	0.00
债券投资市值		79,962,831.52	39,256,259.06
其中：债券投资成本		79,962,831.52	39,256,259.06

权证投资		0.00	0.00
其中：权证投资成本		0.00	0.00
买入返售证券	(c)	965,000,000.00	206,000,000.00
待摊费用	(d)	9,571.53	2,305.67
其他资产		0.00	0.00
资产总计		1,382,270,303.00	334,783,291.88

负债及持有人权益

负债

应付证券清算款		0.00	0.00
应付赎回款		18,576,230.04	18,605,000.00
应付赎回费		0.00	0.00
应付管理人报酬		400,000.17	94,735.52
应付托管费		121,212.16	28,707.72
应付销售服务费		83,723.56	18,086.54
应付佣金	(e)	20,879.48	22,054.11
应付利息		0.00	0.00
应付收益		660,923.22	85,089.33
未交税金		0.00	0.00
其他应付款	(f)	23,325.00	13,500.00
卖出回购证券款		0.00	0.00
短期借款		0.00	0.00
预提费用	(g)	47,500.00	244,729.59
其他负债		0.00	0.00
负债合计		19,933,793.63	19,111,902.81

持有人权益

实收基金	(h)	1,362,336,509.37	315,671,389.07
其中：A类基金份额		342,165,141.04	71,720,202.94
B类基金份额		1,020,171,368.33	243,951,186.13
未实现利得	(i)	0.00	0.00

未分配收益	0.00	0.00
持有人权益合计	1,362,336,509.37	315,671,389.07
负债及持有人权益总计	1,382,270,303.00	334,783,291.88

(后附会计报表附注为本会计报表的组成部分)

上投摩根货币市场基金

2006 年度经营业绩表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

		2006 年度	2005 年 4 月 13 日 (基金成立日) 至 2005 年 12 月 31 日止 期间
收入	<u>附注</u>		
股票差价收入		0.00	0.00
债券差价收入	(j)	1,416,870.50	244,755.97
权证差价收入		0.00	0.00
债券利息收入		7,413,751.01	1,509,090.12
存款利息收入		1,788,586.21	339,152.50
股利收入		0.00	0.00
买入返售证券收入		9,713,418.73	3,175,169.27
其他收入	(k)	0.00	0.00
收入合计		20,332,626.45	5,268,167.86
费用			
基金管理人报酬		(2,928,810.94)	(992,054.65)
基金托管费		(887,518.54)	(300,622.64)
卖出回购证券支出		0.00	0.00
利息支出		0.00	0.00
基金销售服务费	(l)	(480,951.04)	(374,171.58)
其他费用	(m)	(621,013.73)	(498,097.09)

其中：上市年费	0.00	0.00
信息披露费	(161,770.41)	(198,229.59)
审计费用	(43,000.00)	(42,000.00)
费用合计	<u>(4,918,294.25)</u>	<u>(2,164,945.96)</u>
基金净收益	15,414,332.20	3,103,221.90
加：未实现利得	0.00	0.00
基金经营业绩	<u>15,414,332.20</u>	<u>3,103,221.90</u>

(后附会计报表附注为本会计报表的组成部分)

上投摩根货币市场基金

2006 年度基金净值变动表 (除特别注明外,金额单位为人民币元)

	2006 年度	2005 年 4 月 13 日 (基金成立日) 至 2005 年 12 月 31 日止期间
年/期初基金净值	<u>315,671,389.07</u>	<u>991,360,522.73</u>
本年/期经营活动		
基金净收益	<u>15,414,332.20</u>	<u>3,103,221.90</u>
经营活动产生的基金净值变动数	<u>15,414,332.20</u>	<u>3,103,221.90</u>
本年/期基金单位交易		
基金申购款	6,694,769,752.31	1,065,061,811.10
其中：分红再投资	13,785,349.14	2,659,539.46
基金赎回款		<u>(1,740,750,944.76)</u>

	(5,648,104,632.01))
基金单位交易产生的基金净值变动数	1,046,665,120.30	(675,689,133.66)
本年/期向基金份额持有人分配收益 向基金份额持有人分配收益产生的基金净值变动数	(15,414,332.20)	(3,103,221.90)
期末基金净值	1,362,336,509.37	315,671,389.07

(后附会计报表附注为本会计报表的组成部分)

上投摩根货币市场基金

2006 年度收益分配表 (除特别注明外,金额单位为人民币元)

	2006 年度	2005 年 4 月 13 日 (基金成立日) 至 2005 年 12 月 31 日止期间
本期基金净收益	15,414,332.20	3,103,221.90
加: 期初基金净收益	0.00	0.00
本期损益平准金	0.00	0.00
可供分配基金净收益	15,414,332.20	3,103,221.90
减: 本期已分配基金净收益	(15,414,332.20)	(3,103,221.90)
期末基金净收益	0.00	0.00

(后附会计报表附注为本会计报表的组成部分)

上投摩根货币市场基金

2006 年度会计报表附注 (除特别注明外,金额单位为人民币元)

1 基金基本情况

上投摩根货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2005]第 15 号《关于同意上投摩根货币市场基金募集的批复》核准,由

上投摩根富林明基金管理有限公司(后更名为上投摩根基金管理有限公司,附注 5(o)1)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 991,196,238.02 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第 38 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上投摩根货币市场基金基金合同》于 2005 年 4 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 991,360,522.73 份基金份额。本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《上投摩根货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金;一年以内的银行定期存款、大额存单;剩余期限在 397 天以内的债券;期限在一年以内的债券回购;期限在一年以内的中央银行票据以及中国证监会、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。

2 会计报表编制基础

本基金的会计报表按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《上投摩根货币市场基金基金合同》和中国证监会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

3 主要会计政策和会计估计

(a) 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期会计报表的实际编制期间为 2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日。

(b) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

(c) 记账基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。债券投资采用摊余成本法计价,同时按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。

(d) 基金资产的估值原则

本基金的债券投资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。

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和交易价格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，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

如有确凿证据表明按上述方法进行计价不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法计价。

(e) 证券投资基金成本计价方法 - 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账，其中所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。买入贴现债券和零息债券无需单独核算应收利息。

卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(f) 待摊费用的摊销方法和摊销期限

待摊费用采用直线法在受益期内逐日摊销。

(g) 收入的确认和计量

银行间同业市场交易的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，并根据买入债券时溢价与折价的摊销数调整后的金额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债券的利息收入按买入时折价的摊销数扣除个人所得税后的净额认列。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提。

(h) 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率逐日计提。

本基金 A 类基金和 B 类基金的基金销售服务费分别按前一日该类基金资产净值 0.25%和 0.01%的年费率逐日计提。

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。

(i) 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。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

(j) 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每月以红利再投资方式集中支付累计收益。

A 类基金份额的每万份收益分配比例= $\frac{\text{当日 A 类基金份额的可分配收益}}{\text{当日 A 类基金份额发售在外的总份额}} \times 10,000$

B 类基金份额的每万份收益分配比例= $\frac{\text{当日 B 类基金份额的可分配收益}}{\text{当日 B 类基金份额发售在外的总份额}} \times 10,000$

(k) 本报告期内未发生为处理对基金财务状况及基金运作有重大影响的事项而采取的其他会计政策和会计估计。

(l) 本报告期内未发生会计政策，会计估计的变更。

(m) 本报告期内未发生重大会计差错的内容和更正金额

4 主要税项

根据财政部、国家税务总局财税字 [2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b) 基金买卖债券的差价收入，自 2004 年 1 月 1 日起继续免征营业税和企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。

5 会计报表重要项目说明：(单位：人民币元)

(a) 银行存款

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
活期存款	144,824,002.05	4,263,928.07
定期存款	0.00	0.00
	<u>144,824,002.05</u>	<u>4,263,928.07</u>

截至 2006 年 12 月 31 日止，银行存款余额均为活期银行存款(2005 年：同)。

(b) 应收利息

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
应收买入返售证券利息	595,804.00	26,529.27
应收银行存款利息	62,351.97	6,173.78
应收债券利息	50,887.67	0.00
应收清算备付金利息	10,671.10	4,638.92
	<u>719,714.74</u>	<u>37,341.97</u>

(c) 买入返售证券

截至 2006 年 12 月 31 日止，买入返售证券余额均在交易所市场发生。

(d) 待摊费用

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
回购交易费用	5,317.48	947.27
回购风险金	4,254.05	1,358.40
	<u>9,571.53</u>	<u>2,305.67</u>

(e) 应付佣金

截至 2006 年 12 月 31 日止，应付佣金余额均为应付申银万国证券股份有限公司的交易所回购

交易
佣金(2005年：同)。

(f) 其他应付款

	2006年12月31日	2005年12月31日
应付银行间债券交易手续费	12,825.00	0.00
应付债券托管账户维护费	10,500.00	13,500.00
	<u>23,325.00</u>	<u>13,500.00</u>

(g) 预提费用

	2006年12月31日	2005年12月31日
审计费用	43,000.00	42,000.00
债券托管账户维护费	4,500.00	4,500.00
信息披露费	0.00	198,229.59
	<u>47,500.00</u>	<u>244,729.59</u>

(h) 实收基金

	A类基金		
	基金份额(份)	基金面值	基金份额(份)
2005年12月31日	71,720,202.94	71,720,202.94	243,951,186.13
本年申购	3,107,206,182.61	3,107,206,182.61	3,587,563,569.70
其中：红利再投资	2,260,563.01	2,260,563.01	11,524,786.13
本年赎回	(2,836,761,244.51)	(2,836,761,244.51)	(2,811,343,387.50)
2006年12月31日	<u>342,165,141.04</u>	<u>342,165,141.04</u>	<u>1,020,171,368.33</u>

注 红利再投资包括本年收益分配中以红利再投资方式结转入实收基金 13,700,259.81 元(附注 n)以及截至 2005 年 12 月 31 日止尚未结转的应付收益 85,089.33 元。

	A类基金		B类基金	
	基金份额	基金	基金份额(基金
募集期间认购资金				
本金(a)	577.8	5	413,345.	413,345
募集期间认	1		50.	

购资金				
利息折份				
额(a)				
期初基金净值				
值	577,9	5	413,395,	413,395
本期申购(b)	595,0		470,039,	470,039
其中:红利再投资	1,0		1,607,	1,607
本期赎回(b)	(1,101,2	(1,	(639,48	(639,48
2005年12月31日	71,7		243,951,	243,951

注：本基金自 2005 年 3 月 28 日至 2005 年 4 月 8 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 991,196,238.02 元。根据《上投摩根货币市场基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 164,284.71 元在本基金成立后，折算为 164,284.71 份基金份额，划入投资者账户。

(i) 未实现利得：无

(j) 债券差价收入

	2006年度	2005年4月13日(基金成立日)至2005年12月31日止期间
卖出债券结算金额	12,348,005,849.24	840,872,469.64
减：应收利息总额	(25,633,108.49)	(581,657.21)
减：卖出债券成本总额	(12,320,955,870.25)	(840,046,056.46)
债券差价收入	1,416,870.50	244,755.97

(k) 其他收入：无

(l) 基金销售服务费

	2006年度	2005年4月13日(基金成立日)至2005年12月31日止期间
向 A 类基金份额持有人收取	408,540.79	358,447.33
向 B 类基金份额持有人收取	72,410.25	15,724.25
	480,951.04	374,171.58

(m) 其他费用

	2006年度	2005年4月13日(基金成立日)至2005年12月31日止期间
信息披露费	161,770.41	198,229.59
交易所回购交易费用	255,009.42	162,310.04
交易席位使用费	98,825.37	72,054.11
银行汇款手续费	44,308.53	11,103.35
审计费用	43,000.00	42,000.00
债券托管账户维护费	18,000.00	12,000.00
其他	100.00	400.00
	621,013.73	498,097.09

(n) 收益分配

	2006年度	2005年4月13日基金成立日)至2005年12月31日止期间
向 A 类基金份额持有人分配收益	2,594,911.48	1,233,381.41
向 B 类基金份额持有人分配收益	12,819,420.72	1,869,840.49
	15,414,332.20	3,103,221.90

本基金在本会计期间累计分配收益 15,414,332.20 元,其中以红利再投资方式结转入实收基金

13,700,259.81 元(其中不包括年初应付收益转入 85,089.33 元)(附注 h)。

(o) 重大关联方关系及关联交易

1) 关联方

关联方名称	与本基金的关系
上投摩根基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
上海国际信托投资有限公司(“上国投”)的股东	基金管理
摩根富林明资产管理(英国)有限公司	基金管理
上海国际集团有限公司(“上海国际”)控股公司	基金管理人的最终

根据 2006 年 6 月 6 日发布的公告，基金管理人上投摩根基金管理有限公司(原名为上投摩根富林明基金管理有限公司)，由于公司股东摩根富林明资产管理(英国)有限公司更名为摩根资产管理(英国)有限公司，因此公司名称相应变更为上投摩根基金管理有限公司，该更名申请已于 2006 年 4 月 29 日获得中国证监会的批准，并于 2006 年 6 月 2 日在国家工商总局完成所有变更相关手续。本基金 2006 年度未使用关联方席位进行交易（2005 年 4 月 13 日至 2005 年 12 月 31 日同）。

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) 基金管理人报酬

支付基金管理人上投摩根基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.33% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬 2,928,810.94 元(2005 年：992,054.65 元)。

3) 基金托管费

支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金托管费 887,518.54 元(2005 年：300,622.64 元)。

4) 基金销售服务费

支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给上投摩根基金管理有限公司，再由上投摩根基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额持有人和 B 类基金份额持有人约定的年基金销售服务费率分别为 0.25% 和 0.01%。其计算公式分别为：

A 类基金每日应计提的基金销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

B 类基金每日应计提的基金销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.01% / 当年天数。

本基金在本会计期间需向关联方支付的基金销售服务费如下：

2006年1月1日至 2006年12月31日	2005年4月13日(基金成立 日) 至2005年12月31日止期
---------------------------	---

间

由 A 类基金份额持有人承担		
上投摩根基金管理有限公司 (管理人)	208,603.59	5,435.64
中国建设银行(托管人)	166,772.78	315,405.25
由 B 类基金份额持有人承担		
上投摩根基金管理有限公司 (管理人)	69,817.24	14,527.22
中国建设银行(托管人)	96.32	304.15
	445,289.93	335,672.26

5) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,并按银行间同业存款利率计息。基金托管人于2006年12月31日保管的银行存款余额为144,824,002.05元(2005年:4,263,928.07元)。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为1,595,245.37元(2005年:220,793.20元)。

6) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券(含回购)交易

本基金在本会计期间与基金托管人中国建设银行通过银行间同业市场进行的债券(含回购)交易如下:

	2006年度	2005年4月13日(基金成立日)至2005年12月31日止期间
买入债券成交金额	119,104,178.08	9,723,000.00
卖出债券成交金额	0.00	29,457,000.00

7) 从关连方购入分销债券

本基金在本年度向基金托管人中国建设银行购入由其分销的债券如下:

	2006年度	2005年4月13日(基金合同生效日)至2005年12月31日止期间
买入债券结算金额	0.00	9,716,000.00

8) 本基金在报告期末未发生本基金管理公司持有基金份额的情况,且未发生本基金管理公司主要股东及其控制的机构持有基金份额的情况。

9) 流通转让受到限制的基金资产

本基金在报告期内无流通转让受到限制的基金资产。

(p) 资产负债表日后事项：

	宣告日	分配收益所属期间
2007年度		
第1号收益支付公告	2007/01/25	2006/12/26-2007/01/24
第2号收益支付公告	2007/02/26	2007/01/25-2007/02/25

七、基金投资组合报告（截止 2006 年 12 月 31 日）

（一）报告期末基金资产组合情况

资产组合	金额（元）	占基金总资产的比例
债券投资	79,962,831.52	5.78%
买入返售证券	965,000,000.00	69.81%
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	166,381,735.21	12.04%
其他资产	170,925,736.27	12.37%
合计	1,382,270,303.00	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	0.00	0.00%
	其中：买断式回购融入的资金	0.00	0.00%
2	报告期末债券回购融资余额	0.00	0.00%
	其中：买断式回购融入的资金	0.00	0.00%

本基金在报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的情况。

(三) 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(天)
报告期末投资组合平均剩余期限	6
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	70
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

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	99.21%	0.00%
2	30天(含)—60天	2.20%	0.00%
3	60天(含)—90天	0.00%	0.00%
4	90天(含)—180天	0.00%	0.00%
5	180天(含)—397天(含)	0.00%	0.00%
	合计	101.41%	0.00%

(四) 报告期末债券投资组合

1、按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值比例
1	国家债券	0.00	0.00%
2	金融债券	29,997,179.57	2.20%
	其中：政策性金融债	29,997,179.57	2.20%
3	央行票据	49,965,651.95	3.67%
4	企业债券	0.00	0.00%
5	其他	0.00	0.00%
	合计	79,962,831.52	5.87%
	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	0.00	0.00%

2、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	06 央行票据 02	500000		49,965,651.95	3.67%
2	06 国开 17	200000		19,939,282.65	1.46%
3	04 国开 17	100000		10,057,896.92	0.74%
4					
5					
6					
7					
8					
9					
10					

(五)“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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0648%
报告期内偏离度的最低值	-0.0599%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0181%

(六) 投资组合报告附注

1、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。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。

由于按摊余成本法估值可能会出现被估值对象的市价和成本价偏离，为消除或减少因基金份额净值的背离导致基金持有人权益的稀释或其他不公平的结果，在实际操作中，基金管理人与基金托管人需对基金资产净值按市价法定期进行重新评估，当以摊余成本法计算的基金净值与影子定价的偏差达到或超过基金净值的 0.5%，或基金管理人认为发生了其他重大偏差时，基金管理人可以与基金托管人商定后将背离金额确认为估值增值或减值，并在有价债券剩余期间内采用直线法摊销。

2、本基金在报告期内曾经持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券（04 国开 17），但未存在该债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况。

3、本基金在报告期内未发生投资组合平均剩余期限违反基金合同规定的情况。

4、本基金在报告期内未出现过基金合同约定的“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值产生重大偏离的情况。

5、本基金在报告期内投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责，处罚的情况。

6、截至 2006 年 12 月 31 日，本基金的其他资产项目包括：

序号	其他资产项目	金额（元）
1	交易保证金	0.00
2	应收证券清算款	170,196,450.00

3	应收利息	719,714.74
4	应收申购款	0.00
5	其他应收款	0.00
6	待摊费用	9,571.53
7	其他	0.00
合计		170,925,736.27

八、基金份额持有人户数、持有人结构

份额级别		基金份额持有人户数(户)	平均每户持有基金份额(份)	期末持有人结构			
				机构投资者持有份额(份)	占总份额比例	个人投资者持有份额(份)	占总份额比例
2005年 12月31日	A类	1,680	42,690.60	7,786,622.10	10.86%	63,933,580.84	89.14%
	B类	6	40,658,531.02	233,620,443.85	95.77%	10,330,742.28	4.23%
2006年 12月31日	A类	4,995	68,501.53	9,943,878.32	2.91%	332,221,262.72	97.09%
	B类	36	28,338,093.56	807,940,041.31	79.20%	212,231,327.02	20.80%

九、开放式基金份额变动

份额级别	基金合同生效日的基金份额总额	本报告期内基金份额的变动情况			
		期初基金份额总额	本期总申购份额	本期总赎回份额	期末基金份额总额
A类	577,965,478.90	71,720,202.94	3,107,206,182.61	2,836,761,244.51	342,165,141.04
B类	413,395,043.83	243,951,186.13	3,587,563,569.70	2,811,343,387.50	1,020,171,368.33

注：本基金合同生效日为2005年4月13日，合同生效日的基金份额总额为991,360,522.73

单位：份

份。红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源，统一计入本期总申购份额，基金转换转出作为本期赎回资金的支付，统一计入本期总赎回份额，不单独列示。

十、重大事件揭示

（一）基金份额持有人大会

本年度没有召开基金份额持有人大会。

（二）基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2006年9月19日，上投摩根基金管理有限公司董事长由周有道变更为陈开元。

（三）诉讼事项

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）基金投资策略的改变

本年度无基金投资策略的改变。

（五）基金收益分配事项

本基金于成立后的每月25日进行收益分配，至今累积收益分配金额：18,517,554.10元

（六）会计师事务所

已支付给普华永道中天会计师事务所有限公司2005年审计费用。目前的审计机构已提供审计服务的连续年限为2年。

（七）基金管理人、托管人及高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本年度无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形。

（八）本基金租用专用交易席位的情况

本基金租用申银万国证券股份有限公司专用交易席位1个

序号	券商名称	租用券商席位的数量	回购交易量（元）	占回购交易总量比例	年佣金（元）	占全年佣金比例
1	申银万国	1	16,590,300,000.00	100%	110,163.63	100%
	合计	1	16,590,300,000.00	100%	110,163.63	100%

（九）其他重要事项

- 1) 2006年1月20日，上投摩根货币市场基金"春节"假期前暂停申购的公告。
 - 2) 2006年2月14日，上投摩根货币市场基金变更基金经理，基金理由唐建变更为李颖。
 - 3) 2006年4月25日，上投摩根货币市场基金"五一"假期前暂停申购及转入业务的公告。
 - 4) 2006年6月6日，“上投摩根富林明基金管理有限公司”更名为“上投摩根基金管理有限公司”。
 - 5) 2006年9月19日，上投摩根基金管理有限公司董事长由周有道更换为陈开元。
 - 6) 2006年10月13日，上投摩根基金管理有限公司任命冯忠信担任公司董事。
 - 7) 2006年11月28日，上投摩根基金管理有限公司任命郭平先生担任公司监事长，谭伟明、陈达先生担任公司监事。
 - 8) 2006年12月8日，Roger Ellis 辞去上投摩根基金管理有限公司独立董事职务。
 - 9) 2006年12月26日，上投摩根货币市场基金元旦假期前暂停申购及转入业务的公告。
- 上述公告均刊登于《上海证券报》、《证券时报》和《中国证券报》上。
- 10) 2006年7月27日，中国建设银行股份有限公司董事会召开会议，通过了委任张建国先生担任中国建设银行行长的议案；2006年10月20日，中国建设银行股份有限公司举行2006年第一次临时股东大会，委任张建国先生为建行执行董事，同时出任副董事长。2006年7月，常振明先生辞任建行副董事长、执行董事及行长的职务。
 - 11) 2006年12月28日，中国建设银行股份有限公司根据工作需要，将“基金托管部”更名为“投资托管服务部”。

十一、 备查文件目录

- 1、中国证监会批准上投摩根货币市场基金设立的文件；
- 2、《上投摩根货币市场基金基金合同》；
- 3、《上投摩根货币市场基金基金托管协议》；
- 4、《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照。

存放地点：基金管理人或基金托管人处

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。

网址：www.51fund.com

上投摩根基金管理有限公司

2007年03月27日