

长城货币市场证券投资基金

二〇〇六年年度报告



报告期间： 2006 年 1 月 1 日至 12 月 31 日

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

披露日期： 2007 年 3 月 29 日

第一节 重要提示及目录

（一）重要提示

本基金管理人的董事会及董事保证本报告内容的真实性、准确性与完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并就其保证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。

基金托管人华夏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，保证复核内容的真实性、准确性和完整性，并承诺其中不存在虚假记载、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资产，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。

(二) 目 录

第一节 重要提示及目录	2
(一) 重要提示	2
(二) 目 录.....	3
第二节 基金简介	4
(一) 基金基本情况.....	4
(二) 基金投资基本情况.....	4
(三) 基金管理人	4
(四) 基金托管人	5
(五) 信息披露方式.....	5
(六) 其他有关资料.....	5
第三节 主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况	5
(一) 主要财务指标 (2005 年 5 月 30 日—2006 年 12 月 31 日)	5
(二) 基金净值表现.....	6
(三) 收益分配情况.....	7
第四节 管理人报告	7
(一) 基金管理人及基金经理情况.....	7
(二) 基金运作合规守信情况声明.....	8
(三) 投资策略和业绩表现说明及解释.....	8
(四) 2007 年宏观经济及货币市场展望	8
(五) 基金内部监察报告.....	10
第五节 托管人报告	11
第六节 审计报告	11
第七节 财务会计报告	13
(一) 长城货币市场基金年度财务报表(已经审计).....	13
(二) 长城货币市场基金年度财务报表附注.....	15
第八节 投资组合报告	23
(一) 报告期末基金资产组合.....	23
(二) 报告期债券回购融资情况.....	24
(三) 基金投资组合平均剩余期限.....	24
(四) 报告期末债券投资组合.....	25
(五) “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	26
(六) 投资组合报告附注.....	26
第九节 基金份额持有人户数、持有人结构	27
第十节 开放式基金份额变动	28
第十一节 重大事件揭示	28
第十二节 备查文件目录	30

第二节 基金简介

（一）基金基本情况

基金名称：长城货币市场证券投资基金

基金简称：长城货币市场基金

交易代码：200003

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2005 年 5 月 30 日

报告期末基金份额总额：1,462,597,154.37

（二）基金投资基本情况

投资目标：在本金安全和足够流动性的前提下，寻求货币资产稳定的收益。

投资策略：在严格控制风险的前提下，保证资金的安全性和高流动性，通过积极主动的三级资产配置和投资组合管理实现收益率的最大化。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准为税后一年期银行定期存款利率。

风险收益特征：本基金在证券投资基金中属于高流动性、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。

（三）基金管理人

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区深南中路2066号华能大厦25层

办公地址：深圳市福田区深南中路2066号华能大厦25层

邮政编码：518031

法定代表人：杨光裕

信息披露负责人：彭洪波

联系电话：0755-83680399

传真：0755-83662600

电子邮箱：support@ccfund.com.cn

（四）基金托管人

名称： 华夏银行股份有限公司（以下简称“华夏银行”）

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦

邮政编码：100005

法定代表人：刘海燕

信息披露负责人：郑鹏

联系电话：010-85238418

传真：010-85238680

电子邮箱：zhjjtgb@hxb.com.cn

（五）信息披露方式

基金选定的信息披露报纸名称：中国证券报、上海证券报

登载年度报告正文的管理人互联网网址：www.ccfund.com.cn

基金年度报告置备地点：深圳市福田区深南中路2066号华能大厦25层

（六）其他有关资料

1、会计师事务所

名称：深圳大华天诚会计师事务所

办公地址：深圳市福田区滨河大道 5022 号联合广场 B 座 11 楼

2、注册登记机构

名称：长城基金管理有限公司

办公地址：深圳市福田区深南中路 2066 号华能大厦 25 层

第三节 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（2005 年 5 月 30 日—2006 年 12 月 31 日）

单位：人民币元

项目	2006 年度	2005 年 5 月 30 日(基金合同生效日) 至 2005 年 12 月 31 日
1. 基金本期净收益	42,777,297.85	33,224,254.61
2. 期末基金资产净值	1,462,597,154.37	3,046,567,128.91
3. 期末基金份额净值	1.0000	1.0000
4. 本期净值收益率	1.8773%	1.1590%
5. 累计净值收益率	3.0580%	1.1590%

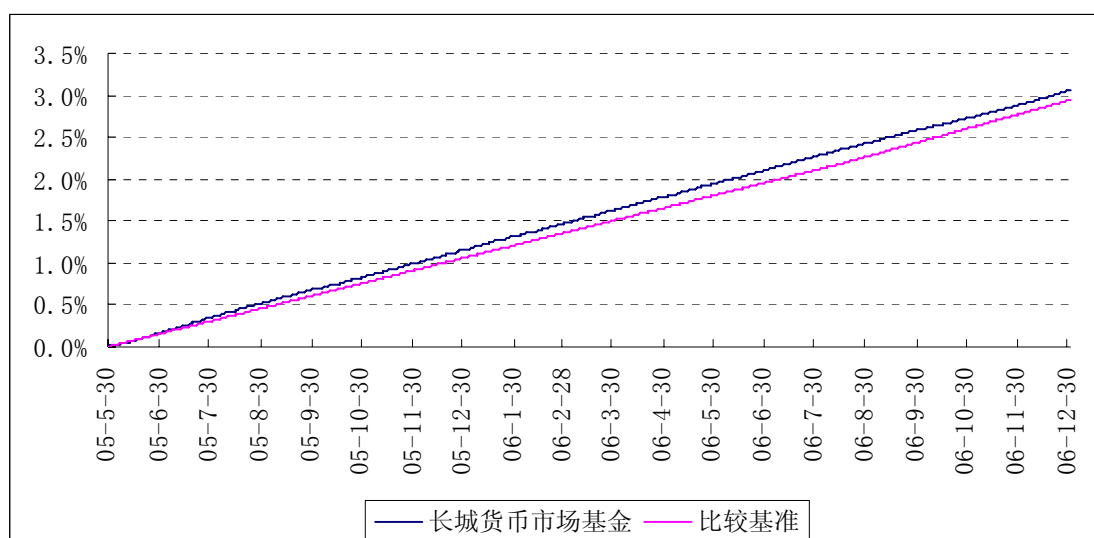
重要提示：本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。本基金的收益分配为按日结转基金份额。

(二) 基金净值表现

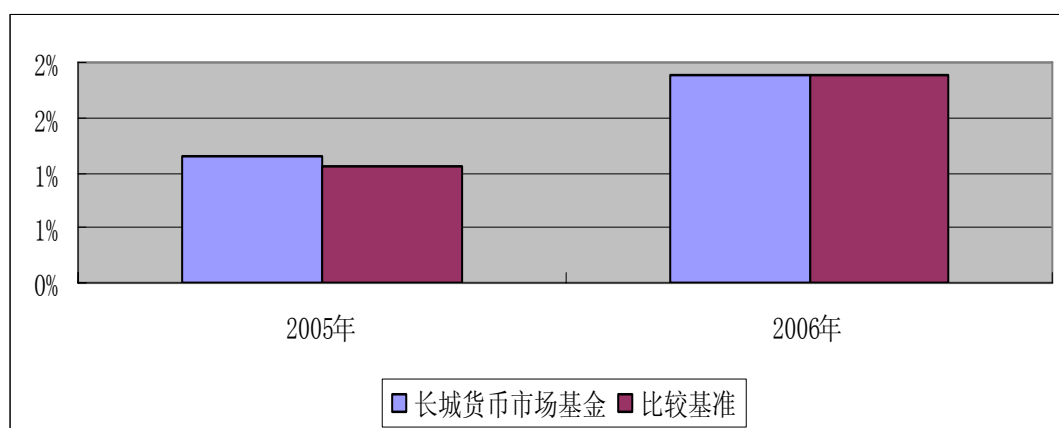
1、长城货币市场基金本报告期净值收益率与同期业绩比较基准收益率比较表：

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
过去 3 个月	0.4612%	0.0014%	0.5081%	0.0000%	-0.0469%	0.0014%
过去 6 个月	0.9297%	0.0018%	0.9873%	0.0003%	-0.0576%	0.0015%
过去 1 年	1.8773%	0.0030%	1.8799%	0.0003%	-0.0026%	0.0027%
自基金合同 生效起至今	3.0580%	0.0034%	2.9451%	0.0003%	0.1129%	0.0031%

2、长城货币市场基金自基金合同生效以来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、长城货币市场基金净值收益率与业绩比较基准历年收益率对比图



附注：本基金合同生效当年的净值收益率按当年实际存续期计算，计算期间为：2005 年 5 月 30 日至 2005 年 12 月 31 日。

（三）收益分配情况

本基金采用单位面值1.00元固定单位净值交易方式。根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月集中支付收益。本基金每日收益计算并分配时，以人民币元方式簿记，每月累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式。本基金于本年度累计分配收益42,777,297.85元，全部以红利再投资方式结转入实收基金。

第四节 管理人报告

（一）基金管理人及基金经理情况

1、基金管理人简介

长城基金管理有限公司是由长城证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、西北证券有限责任公司、北方国际信托投资股份有限公司、中原信托投资有限公司共同发起设立，经中国证监会批准设立的第15家基金管理公司，2001年12月27日在深圳注册成立，注册资本为1亿元人民币。公司经营范围是发起设立基金、管理基金及中国证监会批准的其他业务。目前，公司管理的基金有封闭式基金：久富证券投资基金和久嘉证券投资基金；开放式基金：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。

2、基金经理简介

刘海先生，1978年出生，CFA，清华大学经济学学士。曾就职于深圳发展银行总行，任债券交易员。2005年6月加入长城基金管理有限公司，任长城货币市场证券投资基金基金助理。2006年3月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，王定元先生自 2005 年 9 月 25 日至 2006 年 3 月 8 日任基金经理。

（二）基金运作合规守信情况声明

本报告期内，本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，严格按照《证券投资基金法》、《长城货币市场证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作，在控制和防范风险的前提下，为基金持有人谋求基金资产的长期稳定增值。长城货币市场基金的投资运作遵守了有关法律法规的规定及基金合同的约定，无损害投资者利益的行为。

（三）投资策略和业绩表现说明及解释

2006 年本基金年度净值收益率为 1.8773%，较业绩比较基准低 0.0026%。主要原因是 8 月份人民银行加息后，央行票据等货币市场债券收益率实际涨幅低于本次存款利率的增加幅度，从而造成此后基金收益率暂时落后于业绩比较基准。

2006 年在人民币稳步升值的背景下，我国贸易顺差继续大幅增长，外汇储备一举突破了 1 万亿美元，从而加剧了国内流动性的过剩状况。过剩的流动性不仅造成了上半年银行信贷的大量投放，从而引发投资过热的危险；而且也催生了房地产以及股票市场的不断繁荣，资产价格出现大幅上升。自下半年开始人民银行相应出台了连续多次的紧缩性货币政策，其中包括先后三次提高法定存款准备金率、两次提高贷款利率以及一次提高存款利率，以此来冻结过多的银行流动性并提高社会资金成本。受此影响，货币市场利率也逐节上升，年底 1 年期央行票据收益率达到 2.8%，比去年末升高约 90 个基点。与此同时，货币市场基金收益率也水涨船高，年末七日年化收益率平均升到了 2.12%。

在股票、房地产等周边资产价格持续上涨的财富效应刺激下，2006 年居民金融资产的持有结构发生较大变化，大量资金从低风险的货币市场基金及银行存款中撤出并流向了高风险的股

票及房地产市场，从而导致 2006 年货币市场基金整体份额出现了较大下降。另外，新股恢复发行也为大机构资金通过“打新”提供了新的盈利方式，此时作为现金管理工具的货币市场基金经常会面临较大的临时性赎回需要，其日常投资管理工作被动地受到了新股发行节奏的牵制，这对基金管理人的流动性管理能力也提出了更高的要求。

本基金管理人一贯坚持“安全、稳健”的投资理念，密切跟踪和研究判断市场利率走势，较好地把握住了今年市场的总体变动节奏。基金通过阶段性的久期和资产配置策略进行滚动化投资取得了良好的配置收益；利用市场利率的短期波动买入卖出债券，取得一定的交易收益；以及利用跨市场定价差异获取较好的套利收益，这些投资及交易策略的实施切实保证了基金收益的稳健增加。在风险防范方面，基于今年货币市场基金整体流动性风险不断增大的现状，本基金自年中开始果断地调整了投资组合的持仓结构，提高了对央票、金融债等高流动性资产的投资比例，减少定期存款、浮息债、短期融资券等低流动性资产的投资权重。在期限配置上，基金采取哑铃型投资方式始终保证了短期资产的最低持有比例，并控制合理的组合久期。在每次大盘新股发行前，本基金都会在分析持有人结构的基础上提前进行流动性预测，并及时通过融资、变现资产等方式保证持有人的正常赎回需要。报告期内本基金投资了 1500 万元福禧短期融资券，占期末基金资产净值的 1.0256%，后因该债券出现信用风险和流动性风险，本基金管理人立即与主承销商及相关部门联系，积极寻求化解风险的各种措施，包括参加债权人维权委员会，做了大量细致的债权维护工作，最终该券按时全额本息兑付，最大程度地保障了基金持有人利益。在此过程中，我们进行了深刻的反思，重点加强了内部风险控制工作，特别是对信用风险的评估与控制，建立了完善的企业债券信用评级体系，提高了短期融资券的投资标准，进一步严格了投资决策流程。在以上各项措施的有力保证下，基金在今年波动性较大的市场环境下继续保持着平稳运行，七日年化收益率走势稳健并随货币市场利率的上升而逐步提高，充分体现出货币市场基金作为一种低风险投资工具的本质特征。

（四）2007 年宏观经济及货币市场展望

2007 年在政府继续改善加强宏观调控的作用下，预计中国经济增长速度将会有所回落，但流动性过剩状况在短期内尚难以改变，这将会逐步增加经济运行中通货膨胀的压力。鉴于人民银行年初已将对冲流动性列为了今年的重点工作之一，因此再度提高存款准备金率以及加息等紧缩性政策工具将可能陆续出台。受此影响，预计 2007 年货币市场利率将会保持逐步上行的态势。

本基金管理人将继续恪尽职责，不断加强加深对货币市场的研究，时刻关注市场的发展和变化，在严控风险的前提下去积极寻找更多更好的投资获利机会，为基金持有人不断创造新的价值。

（五）基金内部监察报告

本报告期内，本基金管理人根据健全、独立、有效、相互制约和成本效益原则，进一步完善了各项基本管理制度、业务规则和工作流程，认真执行了各项管理制度，有效实施了三层风险防范和控制措施，建立了比较完善的内部控制体系。

本报告期内公司督察长、监察稽核人员根据《基金管理公司内部控制指导意见》及其他法律法规和公司相关制度的规定，认真履行了工作职责，结合公司实际运作需要，进一步完善了监察稽核程序、方法和制度。督察长、监察稽核部独立地开展工作，实时监控关键业务风险点，每季进行定期稽核，监察稽核内容涵盖了基金投资、基金交易、研究策划、产品创新、基金销售等各项业务的每个环节和公司信息技术、运作保障、综合管理等工作。监察稽核人员在历次监察稽核工作中，认真、有效地提出了各部门工作中存在的问题及改进意见，督促各部门及时进行了整改，防范和化解了业务风险。本年度公司督察长根据法律法规和公司制度的要求按时向中国证券监督管理委员会、公司董事会提交了监察稽核工作报告。

监察稽核和内部控制的重点是确保公司经营及所管理基金运作的合法合规性，建立健全投资监控体系和风险评价体系，加强投资决策流程的内部控制和风险管理，严格防范操纵市场行为、内幕交易行为和其他有损基金持有人利益的关联交易，严格防范基金销售业务中的违规行为，严格履行信息披露义务，保证履行基金合同的承诺。在本报告期内，本基金运作中无操纵市场行为、内幕交易和不当关联交易，维护了基金持有人的利益。

本基金管理人将坚持“诚信、稳健、规范、创新”的经营理念，继续完善法人治理结构和内部控制制度，不断提高公司员工的守法意识和风险防范意识，加强实时监督和控制，进一步完善电子监控手段，使内部控制的全面性、及时性和有效性不断得到提高。本基金管理人将本着“取信于市场，取信于社会”的宗旨，诚实信用，勤勉尽责，为基金持有人谋求最佳利益并使本基金管理公司稳步健康发展。

第五节 托管人报告

托管人声明：在本报告期内，基金托管部严格遵守《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》、其他有关法律法规和基金合同的规定，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。

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用的开支等方面，严格遵守了基金法等有关法律法规、在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

本托管人依法对基金年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查、认为其真实、准确和完整。

华夏银行股份有限公司

2007 年 3 月 26 日

第六节 审计报告

审 计 报 告

深华(2007)审字 346 号

长城货币市场证券投资基金全体持有人：

我们审计了后附的长城货币市场证券投资基金的财务报表，包括 2006 年 12 月 31 日的资产负债表、2006 年度的经营业绩表、2006 年度的收益分配表和基金净值变动表以及财务报表附注

一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算办法》、《金融企业会计制度》和《长城货币市场证券投资基金基金合同》的规定编制财务报表是 长城货币市场证券投资基金管理人的责任。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，上述财务报表已按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》和《长城货币市场证券投资基金基金合同》的规定编制，在所有重大方面公允地反映了 长城货币市场证券投资基金 2006 年 12 月 31 日的财务状况和 2006 年度的经营成果。

深圳大华天诚会计师事务所

中国注册会计师：李秉心

中国 深圳

中国注册会计师：徐海宁

2007 年 3 月 23 日

第七节 财务会计报告

(一) 长城货币市场基金年度财务报表(已经审计)

1、 长城货币市场基金 2006 年 12 月 31 日及 2005 年 12 月 31 日资产负债表

单位：人民币元

资产	注释	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	1	423,696,034.04	1,384,696,411.04
清算备付金		3,640,361.21	360,000.00
交易保证金		250,000.00	250,000.00
应收证券清算款		-	-
应收股利		-	-
应收利息	2	1,710,324.37	6,816,141.78
应收申购款		83,988,150.93	42,199,588.51
其他应收款		-	-
股票投资市值		-	-
其中：股票投资成本		-	-
债券投资市值		731,022,241.99	1,954,628,648.93
其中：债券投资成本		731,022,241.99	1,954,628,648.93
权证投资市值		-	-
其中：权证投资成本		-	-
配股权证		-	-
买入返售证券		220,000,000.00	-
待摊费用		-	-
其他资产		-	-
资产合计		1,464,307,112.54	3,388,950,790.26
负债：			
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付赎回费		-	-
应付管理人报酬		251,187.99	957,048.69
应付托管费		76,117.59	290,014.77
应付销售服务费		190,293.93	725,036.86
应付佣金		-	-
应付利息		-	85,512.30
应付收益		-	-
未交税金		-	-
其他应付款	3	1,127,858.66	281,548.73
卖出回购证券款		-	340,000,000.00
短期借款		-	-

预提费用	4	64,500.00	44,500.00
其他负债		-	-
负债合计		1,709,958.17	342,383,661.35
持有人权益：			
实收基金	5	1,462,597,154.37	3,046,567,128.91
未实现利得		-	-
未分配收益		-	-
持有人权益合计		1,462,597,154.37	3,046,567,128.91
负债及持有人权益合计		1,464,307,112.54	3,388,950,790.26
附注：每份基金份额净值		1.0000	1.0000

2、 长城货币市场基金本报告期及上年度可比期间的比较式经营业绩表

单位：人民币元

项目	注释	2006 年度	2005.5.30— 2005.12.31
一、收入			
1、股票差价收入		-	-
2、债券差价收入	6	11,664,660.86	12,415,134.21
3、权证差价收入		-	-
4、债券利息收入		31,248,661.20	12,082,390.02
5、存款利息收入		17,393,450.17	22,242,690.85
6、股利收入		-	-
7、买入返售证券收入		2,559,699.96	1,382,883.00
8、其他收入		-	-
收入合计		62,866,472.19	48,123,098.08
二、费用			
1、基金管理人报酬		7,548,517.34	5,690,992.39
2、基金托管费		2,287,429.42	1,724,543.19
3、基金销售服务费		5,718,573.66	4,311,357.86
4、卖出回购证券支出		3,985,447.11	2,818,080.62
5、利息支出		-	-
6、其他费用	7	549,206.81	353,869.41
其中：上市年费		-	-
信息披露费		200,000.00	150,000.00
审计费用		60,000.00	40,000.00
费用合计		20,089,174.34	14,898,843.47
三、基金净收益		42,777,297.85	33,224,254.61
加：未实现利得		-	-
四、基金经营业绩		42,777,297.85	33,224,254.61

3、 长城货币市场基金本报告期及上年度可比期间的比较式基金收益分配表

单位：人民币元

项目	注释	2006 年度	2005. 5. 30—2005. 12. 31
本期基金净收益		42, 777, 297. 85	33, 224, 254. 61
加：期初未分配收益		-	-
本期损益平准金		-	-
可供分配基金净收益		42, 777, 297. 85	33, 224, 254. 61
减：本期已分配基金净收益	8	42, 777, 297. 85	33, 224, 254. 61
期末基金净收益		-	-

4、 长城货币市场基金本报告期及上年度可比期间的比较式基金净值变动表

单位：人民币元

项目	注释	2006 年度	2005. 5. 30— 2005. 12. 31
一、期初基金净值		3, 046, 567, 128. 91	2, 934, 887, 104. 33
二、本期经营活动			
已实现基金净收益		42, 777, 297. 85	33, 224, 254. 61
未实现利得		-	-
经营活动产生的基金净值变动数		42, 777, 297. 85	33, 224, 254. 61
三、本期基金单位交易			
基金申购款		11, 396, 667, 483. 60	7, 535, 363, 771. 69
基金赎回款		12, 980, 637, 458. 14	7, 423, 683, 747. 11
基金单位交易产生的基金净值变动数		(1, 583, 969, 974. 54)	111, 680, 024. 58
四、本期向持有人分配收益			
向持有人分配收益产生的基金净值变动		(42, 777, 297. 85)	(33, 224, 254. 61)
五、期末基金净值		1, 462, 597, 154. 37	3, 046, 567, 128. 91

(二) 长城货币市场基金年度财务报表附注

附注 1. 基金基本情况

长城货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”）系由长城基金管理有限公司发起，经中国证券监督管理委员会以《关于同意长城货币市场证券投资基金募集的批复》（证监基金字[2005]52 号）核准，于 2005 年 5 月 30 日成立的契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 2, 934, 887, 104. 33 份基金单位，基金管理人为长城基金管理有限公司，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长城货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为：现金；一年以内（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、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。

附注 2. 财务报表编制基准

本基金财务报表依照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《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—年度报告的内容与格式》、《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》及基金合同的规定编制和披露。

附注 3. 重要会计政策

(1). 会计年度

本基金会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

(2). 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

(3). 记账基础和计价原则

本基金以权责发生制为记账基础，以历史成本为计价原则，债券按摊余成本法计价。

(4). 基金资产的估值原则

本基金资产的估值原则系依据《证券投资基金会计核算办法》和《长城货币市场证券投资基金基金合同》制定。

估值对象为基金所拥有的一切有价证券等资产。

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（亏损）。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交易所短期债券可以采用摊余成本法前，本基金暂不投资于交易所短期债券。

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，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用市场利率和交易价格，对基金持有的估值对象进行重新评估，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 0.5%时，或基金管理人认为发生了其他的重大偏离时，基金管理人可以与基金托管人商定后进行调整，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值，确保以摊余成本法计算的基金资产净值不会对基金份额持有人造成实质性的损害。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值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价格估值。

如有新增或变更事项，按国家最新规定估值。

(5). 债券投资的成本计价方法

买入银行间同业市场的债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，如果应支付的全部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。

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于交割日结转。

(6). 待回购债券

本基金在从事银行间同业市场的买断式交易过程中，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。

(7). 待摊费用的摊销方法和摊销期限

待摊费用核算已发生的影响每基金份额净值小数后五位，应分摊计入本期和以后各期的费用。按其受益期限在 1 年内（含 1 年）逐日平均摊销入费用。

(8). 实收基金

实收基金为对外发行的基金总份额，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于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

(9). 收入的确认和计量

A. 债券差价收入：卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到价款时确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息的差额入账。

B. 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应由债券发行单位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在债券实际持有期内逐日计提入账。

C. 存款利息收入：按存款本金与适用的利率逐日计提的金额入账。

D. 买入返售证券收入：按融出金额与约定利率，在融券期限内采用直线法逐日计提入账。

E. 其他收入：在实际收到时确认收入。

(10). 费用的确认和计量

A. 基金管理人报酬：基金管理人报酬根据《长城货币市场证券投资基金基金合同》的规定按前一日的基金资产净值 0.33% 的年费率逐日计提入账。

B. 基金托管费：基金托管费根据《长城货币市场证券投资基金基金合同》的规定按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率逐日计提入账。

C. 基金销售服务费：基金销售服务费根据《长城货币市场证券投资基金基金合同》的规定按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提入账。

D. 卖出回购证券支出：卖出回购证券支出按融入资金额及成交利率，在融资期限内采用直线法逐日计提入账。

(11). 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：

A. “每日分配、按月支付”。本基金收益根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月集中支付收益。投资者当日收益的精度为 0.01 元，第三位采用去尾的方式，因去尾形成的余额进行再次分配。

B. 本基金根据每日收益情况，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。

C. 本基金每日收益计算并分配时，以人民币元方式簿记，每月累计收益支付方式只采用红利再投资（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；若投资者在每月累计收益支付时，其累计收益为负值，则将缩减投资者基金份额。若投资者全部赎回基金份额时，其收益将立即结清，若收益为负值，则将从投资者赎回基金款中扣除。

D. T 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。

E. 本基金收益每月中旬集中支付一次，成立不满一个月不支付。每一基金份额享有同等分配权。

F. 在不影响投资者利益情况下，若基金管理人和基金托管人协商一致，并报有关监管机构批准后，基金管理人可酌情调整基金收益分配方式，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

(12). 税项

A. 营业税

根据财政部、国家税务总局财税字〔1998〕55 号、财税〔2001〕61 号文《关于证券投资基金税收问题的通知》和财税〔2002〕128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》规定：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；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，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。

B. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字（1998）55 号文《关于证券投资基金税收问题的通知》规定：对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；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，基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

C. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税（2002）128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》规定：对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。

附注 4. 主要财务报表项目注释

注释 1. 银行存款

项 目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
活期存款	423,696,034.04	834,696,411.04
定期存款	---	550,000,000.00
合 计	423,696,034.04	1,384,696,411.04

*本基金本报告期内无提前支取定期存款的情况。

注释 2. 应收利息

项 目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
银行存款利息	70,504.85	3,972,606.06
其中：银行存款投资利息	---	3,677,277.30
清算备付金利息	1,802.02	178.2
债券利息	1,492,097.50	2,843,357.52
买入返售证券利息	145,920.00	---
合 计	1,710,324.37	6,816,141.78

注释 3. 其他应付款

项目名称	经济内容	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
------	------	------------------	------------------

长城证券有限责任公司	代垫席位保证金	250,000.00	250,000.00
中央国债登记结算有限责任公司	债券交易结算服务费用	12,150.00	17,850.00
中央国债登记结算有限责任公司	回购交易结算服务费用	3,840.00	5,760.00
中国外汇交易中心全国银行间同业拆借中心	债券交易手续费	6,177.50	---
中国外汇交易中心全国银行间同业拆借中心	回购交易手续费	2,491.16	---
华夏银行股份有限公司	银行划付手续费	---	7,938.73
税务局	税金	853,200.00	---
合 计		1,127,858.66	281,548.73

注释 4. 预提费用

项 目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日	结存原因
审计费	60,000.00	40,000.00	未支付
债券托管账户维护费	4,500.00	4,500.00	未支付
合 计	64,500.00	44,500.00	

注释 5. 实收基金

项 目	金 额
2005 年 12 月 31 日	3,046,567,128.91
本期申购（转入）增加	11,396,667,483.60
其中：红利再投资	42,777,297.85
本期赎回（转出）减少	12,980,637,458.14
2006 年 12 月 31 日	1,462,597,154.37

注释 6. 债券差价收入

项目	2006 年度	2005. 5. 30-2005. 12. 31
卖出债券成交总额	13,060,961,231.64	5,682,278,167.86
减：卖出成本总额	13,013,220,243.58	5,663,335,811.52
卖出应收利息	36,076,327.20	6,527,222.13
债券差价收入	11,664,660.86	12,415,134.21

注释 7. 其他费用

费用项目	2006 年度	2005. 5. 30-2005. 12. 31
债券交易费用	137,000.01	41,250.00
信息披露费用	200,000.00	150,000.00
审计费用	60,000.00	40,000.00

回购交易费用	62,592.39	59,473.09
债券托管账户维护费	18,000.00	10,500.00
银行划付手续费	71,614.41	51,746.32
账户开户费	---	900.00
合 计	549,206.81	353,869.41

注释 8. 本期已分配基金净收益

本基金每日计算当日收益并全部分配，每月以红利再投资方式集中支付累计收益，即按单位面值 1.00 元转为基金份额。本基金于本年度累计分配收益 42,777,297.85 元，全部以红利再投资方式结转入实收基金(注释 5)。

附注 5. 关联方关系及交易

1. 关联方关系

关联方名称	与本基金关系
长城基金管理有限公司	本基金管理人及发起人、本基金管理人主要股东控制的机构、本基金注册与登记机构、本基金销售机构
华夏银行股份有限公司	本基金托管人、本基金销售机构
长城证券有限责任公司	本基金管理人的主要股东、租赁交易席位、本基金销售机构
东方证券股份有限公司	本基金管理人的股东、本基金销售机构
西北证券有限责任公司	本基金管理人的股东
中原信托投资有限公司	本基金管理人的股东
北方国际信托投资股份有限公司	本基金管理人的股东
景顺长城基金管理有限公司	本基金管理人主要股东控制的机构

2. 关联方交易：

(1) 本基金通过关联方席位进行的交易

本基金本期无通过关联方席位进行的交易。

(2) 本基金应支付的关联方报酬

A. 本期应支付的管理费

关联方名称	2006 年度	2005. 5. 30- 2005. 12. 31	计算标准	计算方式
长城基金管理有限公司	7,548,517.34	5,690,992.39	年费率 0.33%	按前一日基金资产净值乘以费率每天计提
合计	7,548,517.34	5,690,992.39		

B. 本期应支付的托管费

关联方名称	2006 年度	2005. 5. 30- 2005. 12. 31	计算标准	计算方式
华夏银行股份有限公司	2, 287, 429. 42	1, 724, 543. 19	年费率 0. 10%	按前一日基金资产净值乘以费率每天计提
合计	2, 287, 429. 42	1, 724, 543. 19		

C. 本期应支付的销售服务费

关联方名称	2006 年度	2005. 5. 30-2005. 12. 31
长城基金管理有限公司(基金管理人)	3, 379, 171. 99	1, 901, 287. 45
华夏银行股份有限公司(托管人)	1, 632, 044. 23	1, 702, 457. 47
长城证券有限责任公司(管理人股东)	61, 687. 65	88, 549. 76
东方证券股份有限公司(管理人股东)	42, 867. 71	54, 532. 58
合计	5, 115, 771. 58	3, 746, 827. 26

(3) 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

关联方名称	项目		2006 年度	2005. 5. 30- 2005. 12. 31
华夏银行股份有限公司	债券投资	买入	---	326, 652, 422. 83
		卖出	---	199, 330, 652. 17
		分销	34, 184, 500. 00	70, 000, 000. 00
	债券回购	回购交易金额	---	---
		回购利息收入	---	---
		回购利息支出	---	---

(4) 各关联方投资本基金的情况

A. 本基金管理人本期投资本基金的情况

本基金管理人本期及上期均未投资本基金, 期末也未持有本基金份额。

B. 基金管理人主要股东及其控制的机构在期末持有本基金份额的情况

本基金管理人主要股东及其控制的其它机构本期末未持有本基金。

(5) 关联方保管的银行存款余额

关联方名称	项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
华夏银行股份有限公司	银行存款	423, 696, 034. 04	634, 696, 411. 04

(6) 从关联方取得的利息收入

关联方名称	项目	2006 年度	2005. 5. 30- 2005. 12. 31
华夏银行股份有限公司	存款利息收入	5,853,876.06	11,710,026.04

(7) 关联方往来款项余额

往来项目	关联方名称	经济内容	2006年12月31日	2005年12月31日
应付管理人报酬	长城基金管理有限公司	管理费	251,187.99	957,048.69
应付基金托管费	华夏银行股份有限公司	托管费	76,117.59	290,014.77
其他应付款	长城证券有限责任公司	代垫席位交易保证金	250,000.00	250,000.00
其他应付款	华夏银行股份有限公司	银行划付手续费	---	7,938.73
应付销售服务费	长城基金管理有限公司	销售服务费	123,383.86	407,900.23
应付销售服务费	华夏银行股份有限公司	销售服务费	56,911.30	210,420.42
应付销售服务费	长城证券有限责任公司	销售服务费	1,349.30	11,531.98
应付销售服务费	东方证券股份有限公司	销售服务费	253.11	11,550.12
应收利息	华夏银行股份有限公司	存款利息	70,504.85	295,328.76
合计			829,708.00	2,441,733.70

附注 6. 流通受限制不能自由转让的基金资产

本基金本报告期末无流通受限制不能自由转让的基金资产。

附注 7. 或有事项

本基金在本报告期内，无或有事项。

附注 8. 资产负债表日后事项

本基金管理人于 2007 年 1 月 15 日宣告本基金收益支付公告，对本基金自 2006 年 12 月 15 日至 2007 年 1 月 14 日的收益进行集中支付。

第八节 投资组合报告

(一) 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	731,022,241.99	49.92
买入返售证券	220,000,000.00	15.02
银行存款和清算备付金合计	427,336,395.25	29.18

其他资产	85,948,475.30	5.87
合计	1,464,307,112.54	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	86,903,404,000.00	8.96
	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

1、根据《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》（证监基金字[2005]41 号），自 2005 年 4 月 1 日起，除发生巨额赎回的情形外，货币市场基金的投资组合中，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。因发生巨额赎回致使货币市场基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的，基金管理人应当在 5 个交易日内进行调整。

本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%的情况具体如下表：

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	2006-6-13	20.60	大额赎回	一个交易日
2	2006-6-16	20.19	巨额赎回	二个交易日
3	2006-6-28	20.15	市场波动	一个交易日
4	2006-7-24	21.03	市场波动	一个交易日
5	2006-7-27	20.69	市场波动	一个交易日

2、本基金本报告期内未有买断式回购融资业务发生。

(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
报告期末投资组合平均剩余期限	81
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	177
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	65

注：根据《货币市场基金管理暂行规定》（证监发[2004]78 号）和《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》（证监基金字[2005]41 号），货币市场基金投资组合的平均剩余期

限在每个交易日均不得超过 180 天。本报告期内本基金投资组合平均剩余期限均未发生过 180 天的情况。

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	44.28	0.00
2	30 天(含)－60 天	0.00	0.00
3	60 天(含)－90 天	3.79	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	2.77	0.00
4	90 天(含)－180 天	40.18	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	11.05	0.00
5	180 天(含)－397 天(含)	6.01	0.00
	合计	94.26	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)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	0.00	0.00
2	金融债券	211,010,326.94	14.43
	其中：政策性金融债	99,073,591.21	6.77
3	央行票据	227,354,911.47	15.54
4	企业债券	292,657,003.58	20.01
5	其他	0.00	0.00
	合计	731,022,241.99	49.98
	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	202,180,233.25	13.82

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 28	1,000,000		99,093,380.33	6.78
2	06 国开 27	1,000,000		99,073,591.21	6.77
3	05 中信债 1	900,000		90,243,497.52	6.17
4	06 央行票据 33	800,000		79,339,281.64	5.42
5	04 建行 03 浮	700,000		71,408,780.90	4.88
6	06 中电信 CP01	500,000		50,103,076.07	3.43
7	06 邮科院 CP01	500,000		49,153,308.67	3.36
8	06 央行票据 76	500,000		48,922,249.50	3.34
9	05 中行 02 浮	400,000		40,527,954.83	2.77

10	06 铁通 CP01	300,000	29,343,666.56	2.01
----	------------	---------	---------------	------

(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	10
报告期内偏离度的最高值	0.2793
报告期内偏离度的最低值	-0.4105
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1124

(六) 投资组合报告附注

1、基金资产估值方法说明

本基金采用摊余成本法进行资产估值，即估值对象按购入成本进行列示，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或折价在其剩余期限内每日平均进行摊销。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价进行基金资产估值。

本基金通过每日分红使得基金份额的净值始终维持在 1.00 元。

2、本基金本报告期内存在剩余期限小于 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，但在规定期限内及时进行了调整，具体如下表：

序号	发生日期	该类债券的摊余成本占基金资产净值的比例(%)	调整期
1	2006-6-16	20.97	一个交易日
2	2006-6-28	23.15	一个交易日
3	2006-7-18	20.77	八个交易日
4	2006-7-19	20.77	
5	2006-7-20	26.95	
6	2006-7-21	26.97	
7	2006-7-24	24.03	
8	2006-7-25	26.95	
9	2006-7-26	22.12	
10	2006-7-27	21.04	
11	2006-8-31	21.06	一个交易日

3、本基金投资管理采用团队投资和基金经理负责相结合的方式。投资团队由基金经理、固定收益研究员、交易员及金融工程师共同组成，在实现投研交易一体化的基础上，积极利用自身构建的金融工程平台从事各种定量分析，为基金持有人实现更多的投资回报。

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根据基金合同规定以及拟选取的投资风格来确定基金投资风险预算的基本约束条件，如剩余期限，信用风险级别限制，流动性比例限制等，并就此向基金经理进行授权；

② 基金经理根据公司投委会每季度的授权对货币基金进行日常具体的投资和风险管理工作。基金经理每月负责向公司投委会总结汇报上期基金投资的具体操作情况及并分析当前风险状况，同时提出下期投资策略和风险预算预案，经公司投委会通过后遵照执行；

③ 固定收益研究员及金融工程师负责向基金经理提供对市场变化及新投资品种等方面的研究分析支持，并协助基金经理拟定每月的投资策略以及风险预算预案，金融工程师每日负责检查基金资产的各类合规性要求；

④ 监察稽核部门每日对基金具体的投资交易行为实施严密监控，监测运用“影子价格”确定的基金资产净值与运用“摊余成本法”确定的基金资产净值之间的偏离度，并对基金投资的合规性、操作流程的规范化等情况进行定期检查。

4、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情况，也没有在本报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

5、其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	交易保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收利息	1,710,324.37
4	应收申购款	83,988,150.93
5	其他应收款	0.00
6	待摊费用	0.00
7	其他	0.00
	合计	85,948,475.30

第九节 基金份额持有人户数、持有人结构

截止 2006 年 12 月 31 日长城货币市场基金持有人情况如下：

1、基金份额持有人户数

基金份额持有人户数	38,700 户
平均每户持有基金份额	37,793.21 份/户

2、基金份额持有人结构

	持有份额(份)	占基金总份额的比例 (%)
机构投资者	1,195,348,103.27	81.73
个人投资者	267,249,051.10	18.27
合计	1,462,597,154.37	100.00

第十节 开放式基金份额变动

序号	项目	份额(份)
1	期初基金份额总额	3,046,567,128.91
2	加：本期申购基金份额总额	11,396,667,483.60
3	减：本期赎回基金份额总额	12,980,637,458.14
4	期末基金份额总额	1,462,597,154.37

第十一节 重大事件揭示

(一) 本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

(二) 经长城基金管理有限公司股东会 2006 年第一次会议审议通过，选举陆妍女士任公司董事，刘杉先生任公司独立董事，田德良先生任公司监事。经长城基金管理有限公司第二届董事会第十五次会议审议通过，同意李建中先生辞去公司督察长职务；经长城基金管理有限公司第二届董事会第二十次会议审议通过，同意彭洪波先生任公司督察长。以上公司董事、独立董事、高级管理人员任职均已通过中国证券监督管理委员会核准。

(三) 本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

(四) 基金投资策略无改变。

(五) 基金收益分配事项

本基金采用单位面值1.00元固定单位净值交易方式。根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月集中支付收益。本基金每日收益计算并分配时，以人民币元方式簿记，每月累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式。

(六) 报告期内本基金会计师事务所无变更。本报告年度支付给本基金聘任会计师事务所2005年度审计服务费肆万元整；截止本报告期末，该会计师事务所已为本基金提供审计服务连续二十个月。

(七) 本报告期内无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚。

(八) 基金租用证券公司专用交易席位的有关情况

租用席位证券公司名称	租用席位数量	债券回购成交金额	占交易所回购成交总额的比例 (%)
银河证券	1	1,378,300,000.00	100.00
长城证券	1	0.00	0.00

(九) 其他重要事项

1、2006 年 1 月 14 日本公司刊登《长城货币市场证券投资基金收益支付公告》、《长城货币市场证券投资基金更新的招募说明书摘要》、《长城货币市场证券投资基金招募说明书(更新)》。

2、2006 年 1 月 20 日本公司刊登《关于长城货币市场基金春节假期前暂停申购和转换业务的公告》。

3、2006 年 2 月 15 日本公司刊登《长城货币市场证券投资基金收益支付公告》。

4、2006 年 3 月 9 日本公司刊登《长城基金关于更换长城货币市场基金基金经理的公告》。

5、2006 年 3 月 15 日本公司刊登《长城货币市场证券投资基金收益支付公告》。

6、2006 年 3 月 31 日本公司刊登《长城货币市场证券投资基金二〇〇五年年度报告》。

7、2006 年 4 月 15 日本公司刊登《长城货币市场证券投资基金收益支付公告》。

8、2006 年 4 月 19 日本公司刊登《长城基金增加国盛证券为代销机构的公告》、《长城货币市场证券投资基金季度报告(2006 年第 2 季度)》。

9、2006 年 4 月 26 日本公司刊登《关于长城货币市场基金五一假期前暂停申购和转换业务的公告》。

10、2006 年 5 月 15 日本公司刊登《长城货币市场证券投资基金收益支付公告》。

11、2006 年 6 月 15 日本公司刊登《长城货币市场证券投资基金收益支付公告》。

12、2006 年 7 月 15 日本公司刊登《长城货币市场证券投资基金收益支付公告》。

13、2006 年 7 月 19 日本公司刊登《长城货币市场证券投资基金季度报告(2006 年第 2 季度)》。

14、2006 年 8 月 15 日本公司刊登《长城货币市场证券投资基金收益支付公告》。

15、2006 年 8 月 28 日本公司刊登《长城货币市场证券投资基金二〇〇六年半年度报告摘要》、《长城货币市场证券投资基金二〇〇六年半年度报告摘要》。

16、2006 年 9 月 15 日本公司刊登《长城货币市场证券投资基金收益支付公告》。

17、2006 年 9 月 27 日本公司刊登《关于长城货币市场证券投资基金“十一”假期前暂停申购和转换业务的公告》。

18、2006 年 10 月 13 日本公司刊登《长城货币市场证券投资基金收益支付公告》。

19、2006 年 10 月 27 日本公司刊登《长城货币市场证券投资基金季度报告（2006 年第 3 季度）》

20、2006 年 11 月 2 日本公司刊登《长城基金管理有限公司关于举办旗下开放式基金申购费率优惠活动的公告》。

21、2006 年 11 月 15 日本公司刊登《长城货币市场证券投资基金收益支付公告》。

22、2006 年 12 月 15 日本公司刊登《长城货币市场证券投资基金收益支付公告》。

23、2006 年 12 月 27 日本公司刊登《关于长城货币市场证券投资基金“元旦”假期前暂停申购和转换业务的公告》。

24、本报告期刊登的其他公告。

第十二节 备查文件目录

（一）中国证监会批准长城货币市场证券投资基金设立的文件；

（二）《长城货币市场证券投资基金基金合同》；

（三）《长城货币市场证券投资基金托管协议》；

（四）《长城货币市场证券投资基金招募说明书》；

（五）法律意见书；

（六）基金发起人营业执照；

（七）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

（八）基金托管人业务资格批件、营业执照；

（九）代销机构业务资格批件、营业执照；

（十）中国证监会规定的其他文件。

查阅地点：广东省深圳市深南中路 2066 号华能大厦 25 层。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长城基金管理有限公司。

咨询电话：0755-83662688。

此页无正文

长城基金管理有限公司

二〇〇七年三月二十九日