

信息披露 Disclosure

上投摩根货币市场基金

2006年年度报告摘要

重要提示：基金管理人、基金托管人及基金服务机构... 基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则...

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

基金运作方式：契约型开放式 基金合同生效日：2006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

二、基金投资策略 1.基金投资目标 通过合理的资产配置，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...

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...

3.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...

4.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...

5.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...

6.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...

7.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...

8.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...

9.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...

10.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...

11.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...

12.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...

13.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...

14.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...

15.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...

16.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...

17.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...

18.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...

Table with 3 columns: Year, Category, and Remarks. Shows performance data for 2006 and 2005.

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监会批准，于2004年5月12日正式成立...

(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》、中国证监会的有关法规和基金合同的规定...

(三)基金业绩报告 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...

2. 2007年投资展望 2007年中国经济仍将保持较高的增长。外贸顺差将进一步增长，人民币升值压力不减...

3. 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：上证国债指数收益率*60%+上证126国债指数收益率*40%

4. 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：上证国债指数收益率*60%+上证126国债指数收益率*40%

5. 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：上证国债指数收益率*60%+上证126国债指数收益率*40%

6. 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：上证国债指数收益率*60%+上证126国债指数收益率*40%

7. 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：上证国债指数收益率*60%+上证126国债指数收益率*40%

8. 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：上证国债指数收益率*60%+上证126国债指数收益率*40%

9. 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：上证国债指数收益率*60%+上证126国债指数收益率*40%

10. 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：上证国债指数收益率*60%+上证126国债指数收益率*40%

11. 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：上证国债指数收益率*60%+上证126国债指数收益率*40%

12. 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：上证国债指数收益率*60%+上证126国债指数收益率*40%

13. 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：上证国债指数收益率*60%+上证126国债指数收益率*40%

14. 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：上证国债指数收益率*60%+上证126国债指数收益率*40%

15. 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：上证国债指数收益率*60%+上证126国债指数收益率*40%

16. 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：上证国债指数收益率*60%+上证126国债指数收益率*40%

17. 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：上证国债指数收益率*60%+上证126国债指数收益率*40%

18. 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：上证国债指数收益率*60%+上证126国债指数收益率*40%

Table with 3 columns: Year, Category, and Remarks. Shows performance data for 2006 and 2005.

四、基金托管人报告 本报告期内，基金托管人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的有关法规和基金合同的规定...

五、财务会计报表附注 (一)资产负债表 2006年12月31日资产负债表 资产总计 1,382,270,303.00

(二)利润表 2006年度利润表 利润总额 334,783,291.88

(三)所有者权益变动表 2006年度所有者权益变动表 期末基金份额总额 1,362,336,509.37

(四)关联方关系及其交易 1. 关联方名称 2. 关联方交易 3. 关联方交易定价政策

(五)或有事项 1. 资产负债表日存在的或有事项 2. 或有事项对财务状况和经营成果的影响

(六)其他重要事项 1. 基金销售服务费 2. 基金托管费 3. 基金管理人报酬

(七)其他重要事项 1. 基金销售服务费 2. 基金托管费 3. 基金管理人报酬

(八)其他重要事项 1. 基金销售服务费 2. 基金托管费 3. 基金管理人报酬

(九)其他重要事项 1. 基金销售服务费 2. 基金托管费 3. 基金管理人报酬

(十)其他重要事项 1. 基金销售服务费 2. 基金托管费 3. 基金管理人报酬

(十一)其他重要事项 1. 基金销售服务费 2. 基金托管费 3. 基金管理人报酬

(十二)其他重要事项 1. 基金销售服务费 2. 基金托管费 3. 基金管理人报酬

(十三)其他重要事项 1. 基金销售服务费 2. 基金托管费 3. 基金管理人报酬

(十四)其他重要事项 1. 基金销售服务费 2. 基金托管费 3. 基金管理人报酬

(十五)其他重要事项 1. 基金销售服务费 2. 基金托管费 3. 基金管理人报酬

(十六)其他重要事项 1. 基金销售服务费 2. 基金托管费 3. 基金管理人报酬

(十七)其他重要事项 1. 基金销售服务费 2. 基金托管费 3. 基金管理人报酬

(十八)其他重要事项 1. 基金销售服务费 2. 基金托管费 3. 基金管理人报酬

(十九)其他重要事项 1. 基金销售服务费 2. 基金托管费 3. 基金管理人报酬

Table with 3 columns: Year, Category, and Remarks. Shows performance data for 2006 and 2005.

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

(二)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%

(三)基金投资组合平均剩余期限 1. 投资组合平均剩余期限 2. 投资组合平均剩余期限分布比例

(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 2. 按行业分类的债券投资组合

(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 报告期末偏离度的绝对值在 0.25% (含) - 0.5% 之间的次数 0

(六)投资估值采用摊余成本法 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，按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价...

(七)基金投资组合平均剩余期限 1. 投资组合平均剩余期限 2. 投资组合平均剩余期限分布比例

(八)基金投资组合平均剩余期限 1. 投资组合平均剩余期限 2. 投资组合平均剩余期限分布比例

(九)基金投资组合平均剩余期限 1. 投资组合平均剩余期限 2. 投资组合平均剩余期限分布比例

(十)基金投资组合平均剩余期限 1. 投资组合平均剩余期限 2. 投资组合平均剩余期限分布比例

(十一)基金投资组合平均剩余期限 1. 投资组合平均剩余期限 2. 投资组合平均剩余期限分布比例

(十二)基金投资组合平均剩余期限 1. 投资组合平均剩余期限 2. 投资组合平均剩余期限分布比例

(十三)基金投资组合平均剩余期限 1. 投资组合平均剩余期限 2. 投资组合平均剩余期限分布比例

(十四)基金投资组合平均剩余期限 1. 投资组合平均剩余期限 2. 投资组合平均剩余期限分布比例

(十五)基金投资组合平均剩余期限 1. 投资组合平均剩余期限 2. 投资组合平均剩余期限分布比例

(十六)基金投资组合平均剩余期限 1. 投资组合平均剩余期限 2. 投资组合平均剩余期限分布比例

(十七)基金投资组合平均剩余期限 1. 投资组合平均剩余期限 2. 投资组合平均剩余期限分布比例

(十八)基金投资组合平均剩余期限 1. 投资组合平均剩余期限 2. 投资组合平均剩余期限分布比例

(十九)基金投资组合平均剩余期限 1. 投资组合平均剩余期限 2. 投资组合平均剩余期限分布比例

(二十)基金投资组合平均剩余期限 1. 投资组合平均剩余期限 2. 投资组合平均剩余期限分布比例

