

富国天时货币市场基金 二 00 六年年度报告

报告期年份：二 00 六年

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行

送出日期：二 00 七年三月三十日

重要提示

富国基金管理有限公司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。

基金托管人中国农业银行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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、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。

目 录

一、基金简介	1
二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况	2
(一) 2006 年度的主要会计数据和财务指标	2
(二) 基金净值表现	3
(三) 自基金合同生效以来富国天时货币市场基金每年的收益分配情况	5
三、管理人报告	6
(一) 基金管理人及基金经理小组情况	6
(二) 遵规守信说明	6
(三) 对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明与解释	6
(四) 对宏观经济、证券市场及行业走势的展望	7
(五) 内部监察报告	7
四、托管人报告	9
五、审计报告	9
六、财务会计报告	10
(一) 会计报告书	10
(二) 会计报表附注	13
七、投资组合报告 (2006 年 12 月 31 日)	25
(一) 基金资产组合情况	25
(二) 报告期债券回购融资情况	25
(三) 基金投资组合平均剩余期限	25
(四) 债券投资组合	26
(五) “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	27
(六) 投资组合报告附注	27
八、基金份额持有人户数和持有人结构	28
九、基金份额变动	28
十、重大事件揭示	28
十一、备查文件目录	30

一、基金简介

(一) 基金名称：富国天时货币市场基金

基金简称：富国货币

A 级基金简称：富国货币 A 级

B 级基金简称：富国货币 B 级

交易代码：

A 级基金交易代码：100025

B 级基金交易代码：100028

运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2006 年 6 月 5 日

报告期末基金份额总额：712,711,522.07 份

其中：A 级基金份额总额：367,350,556.34 份

B 级基金份额总额：345,360,965.73 份

(二) 投资目标：在充分重视本金安全的前提下，确保基金资产的高流动性，追求超越业绩比较基准的稳定收益。

投资策略：本基金管理人借鉴外方股东加拿大蒙特利尔银行金融集团 (BMO Financial Group) 的投资管理经验及技能，结合国内市场的特征，应用“富国 FIPS—MMF 系统(Fixed Income Portfolio System—Money Market Fund)”，构建优质组合。

在投资管理过程中，本基金管理人将基于“定性与定量相结合、保守与积极相结合”的原则，根据短期利率的变动和市场格局的变化，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略。

业绩比较基准：本基金的业绩比较基准为当期银行个人活期存款利率（税前）。

风险收益特征：本基金属于风险较低、收益稳定、流动性较高的证券投资基金品种，但并不意味着投资本基金不承担任何风险。

(三) 基金管理人：富国基金管理有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦 13、14 层

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层

邮政编码：200120

法定代表人：陈敏

信息披露负责人：林志松
电话：95105686、4008880688
传真：021-68597799
电子邮箱：public@fullgoal.com.cn

(四) 基金托管人：中国农业银行
注册地址：北京市复兴路甲 23 号
办公地址：北京市西三环北路 100 号金玉大厦 7—8 层
邮政编码：100037
法定代表人：杨明生
信息管理负责人：李芳菲
联系电话：010—68424199
传真：010—68424181
电子邮箱：lifangfei@abchina.com

(五) 本基金选用的信息披露报刊：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.fullgoal.com.cn
基金年度报告置备地点：
富国基金管理有限公司 上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层
中国农业银行 北京市西三环北路 100 号金玉大厦 7—8 层

(六) 聘请的会计师事务所名称：安永大华会计师事务所有限责任公司
会计师事务所办公地址：上海市长乐路 989 号世纪商贸广场
注册登记机构名称：富国基金管理有限公司
注册登记机构办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层

二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

(一) 2006 年度的主要会计数据和财务指标

本基金自 2006 年 6 月 5 日成立。自 2006 年 11 月 29 日起，本基金实行销售服务费分级收费方式，分设两级基金份额：A 级基金份额和 B 级基金份额。A 级基金份额与 B 级基金份额的管理费、托管费相同，A 级基金份额按照 0.25% 的年费率计提销售服务费，B 级基金份额按照 0.01% 的年费率计提销售服务费。因 A 级基金的管理费、托管费及销售服务费与分级前基金相同，在计算主要财务指标时，

A 级基金与分级前基金连续计算，B 级基金按新设基金计算。

	项目	A 级 (2006.6.5—2006.12.31)	B 级 (2006.11.29—2006.12.31)
1	基金本期净收益	12,165,006.79	854,305.68
2	期末基金资产净值	367,350,556.34	345,360,965.73
3	期末基金份额净值	1.0000	1.0000
4	基金本期净值收益率	1.1380%	0.2085%
5	基金累计净值收益率	1.1380%	0.2085%

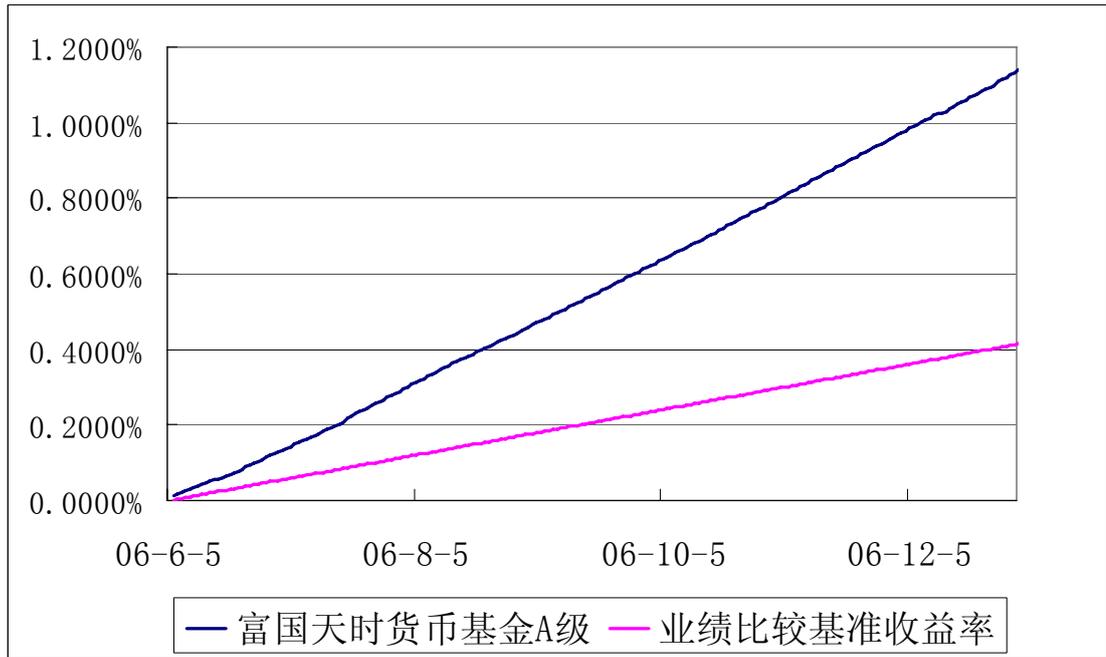
提示：本基金收益分配是按月结转份额。所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(二) 基金净值表现

1、富国天时货币市场基金历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

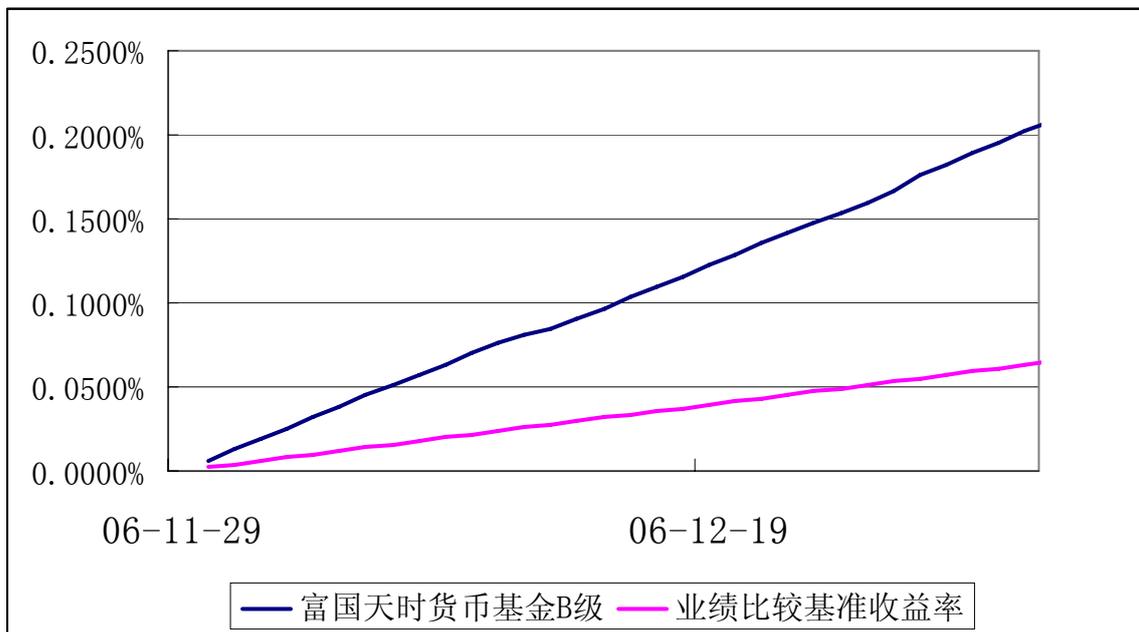
阶段	基金名称	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	富国货币 A 级	0.5181%	0.0006%	0.1815%	0.0000%	0.3366%	0.0006%
	富国货币 B 级	0.2085%	0.0009%	0.0651%	0.0000%	0.1434%	0.0009%
过去六个月	富国货币 A 级	1.0131%	0.0008%	0.3630%	0.0000%	0.6501%	0.0008%
	富国货币 B 级	0.2085%	0.0009%	0.0651%	0.0000%	0.1434%	0.0009%
自基金成立 起至今	富国货币 A 级	1.1380%	0.0010%	0.4142%	0.0000%	0.7238%	0.0010%
	富国货币 B 级	0.2085%	0.0009%	0.0651%	0.0000%	0.1434%	0.0009%

2、(1) 自基金合同生效以来富国天时货币市场 A 级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（自基金合同生效日至截止日不足一年）：



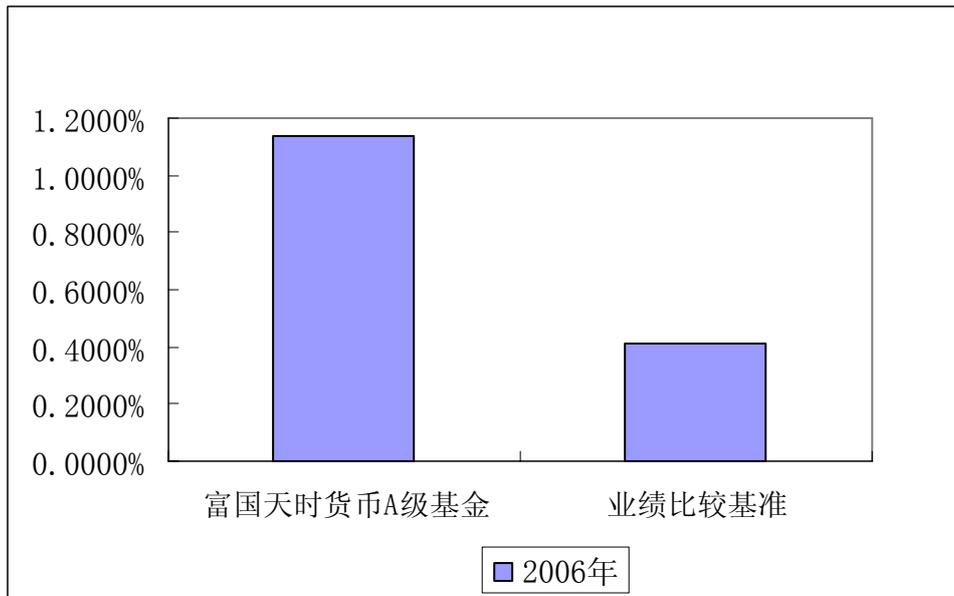
注：截止日期为 2006 年 12 月 31 日。

(2) 自基金分级以来富国天时货币市场 B 级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（自基金合同生效日至截止日不足一年）：

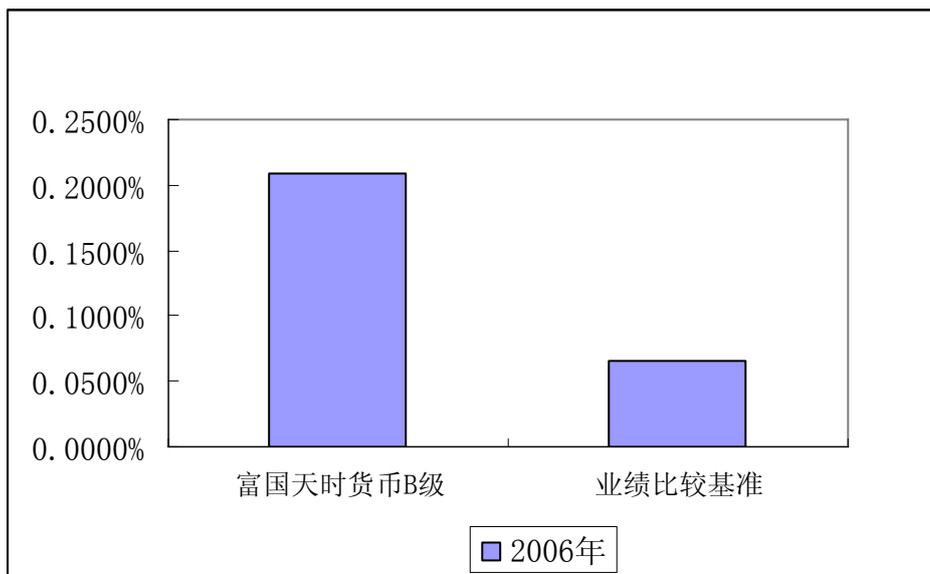


注：起始日期为 2006 年 11 月 29 日，截止日期为 2006 年 12 月 31 日。

3、(1) 自基金合同生效以来富国天时货币市场 A 级基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



(2) 自基金分级以来富国天时货币市场 B 级基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



(三) 自基金合同生效以来富国天时货币市场基金的收益分配情况

本基金自 2006 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日止期间累计分配收益为人民币 13,019,312.47 元,其中富国货币 A 级 12,165,006.79 元,富国货币 B 级 854,305.68 元。

三、 管理人报告

（一）基金管理人及基金经理小组情况

1、基金管理人

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一，公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。截止 2006 年 12 月 31 日，本基金管理人管理汉盛证券投资基金、汉兴证券投资基金、汉鼎证券投资基金、汉博证券投资基金四只封闭式证券投资基金和富国动态平衡证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金七只开放式证券投资基金。

2、基金经理

钟智伦先生，生于 1968 年，经济学硕士，13 年证券从业经历。历任平安证券部门经理、上海新世纪投资服务有限公司研究员、海通证券投资经理、富国基金管理有限公司债券研究员。

（二）遵规守信说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国天时货币市场基金的管理人严格按照《基金法》、《证券法》、《富国天时货币市场基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，管理和运用基金资产，无损害基金份额持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

（三）对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明与解释

本基金的基金合同从 2006 年 6 月 5 日起正式生效，截至 2006 年 12 月 31 日，本报告期每万份基金 A 类份额实现收益 113.2490 元，收益率为 1.1380%，期间业绩比较基准为 0.4142%；B 类份额 2006 年 11 月 29 日至 2006 年 12 月 31 日实现收益 20.8512 元，收益率为 0.2085%，期间业绩比较基准为 0.0651%。（注：本基金于 2006 年 11 月 29 日实施 A、B 类分级）

本基金合同生效后，正值货币市场利率上升期。为防止经济过热和经济增长结构失衡，国家出台了一系列控制投资和信贷过快增长的调控措施，央行除了常规的公开市场操作外，还出台了发行定向票据、提高存款准备金率、提高存贷款利率等系列措施，货币市场利率逐级上升，1 年期存款利率从 2.25% 升至 2.52%，1 年期央行票据利率从 6 月初的 2.41% 最高升至 2.89%，同时，股票市场恢复新股发行又对短期利率和货币市场基金规模造成较大的冲击。

本基金成立以来，管理人严格按照基金合同进行投资管理，在控制投资风险和保证基金流动性的前提下为基金持有人获取稳定收益，收益率基本保持稳定，充分体现了本基金“稳健运作、精细管理、注重风险控制、寻求稳定回报”的投资风格和货币市场基金的“现金管理工具”职能。为了能更灵活地为投资者提供理财服务，本基金于 2006 年 11 月 29 日实施了基金份额分级。

（四）对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望 2007 年，解决因人民币汇率体制改革而带来的银行体系流动性过剩问题会是央行货币政策面临的主要问题，预计人民银行还会综合运用多种货币政策工具大力回收流动性，除了加大公开市场操作力度以外，上调存款准备金率和发行定向票据会变成常规操作。

另外，股票市场好转会分流部分市场资金，新股发行特别是大盘蓝筹股的回归发行，为债券投资提供了较好的替代选择，大盘蓝筹股发行时一方面会对货币市场利率造成扰动，同时也会分流部分货币市场基金份额。

如果以上几个因素叠加在一起，将会造成市场流动性的短暂紧张和货币市场利率的大幅度波动，因此，本基金除了一如既往做好对基金投资各类风险管理外，将更加重视对流动性风险的管理，严格按照有关法规和基金合同进行规范运作，在控制风险的前提下为基金持有人获取相对稳定的投资回报。

（五）内部监察报告

2006 年，本基金管理人在总结去年基金运作的基础上，继续坚持“事先防范”为主的内部控制策略，坚持规范经营、合规运作，重视公司和基金运作的风险管理，内部监察工作坚持一切从防范风险，保障基金持有人利益出发，内部风险管理部门和各业务部门紧密配合，继续通过进一步完善规章制度和业务流程、加强基金投资限制的系统控制功能和日常监控、组织定期的法律法规培训和定期、不定期内控检查等方式，对公司各项工作进行全方位、实时的监察稽核，并对基金投资决策与执行情况进行重点专项监察稽核。

在本报告期内，管理人对本基金运作实施内部控制措施如下：

1、继续强化对本基金日常投资运作合法性、合规性及遵守基金合同情况的监

控，完善投资规章制度和业务流程。

公司在进一步完善投资管理工作各项制度的基础上，重点修订了股票库管理制度、流通受限品种投资管理制度等相关制度，投资管理的相关工作职责和业务流程更加清晰和明确，进一步提高了投资风险管理能力。

进一步改进和提高公司交易系统的基金投资控制功能，加强了监察稽核对基金投资的事前控制能力。

进一步加强投资流程电子化和研究量化工作，实现股票出入库管理流程电子化及研究和交易考核量化，提高了业务审批效率，提供了可供采集的业务数据。其中，网下新股申购、增发等特殊业务须经监察稽核部电子审批，便于及时、有效地对投资管理工作进行监察和稽核。

公司开发了新的风险管理业务模板，实现了投资项目开仓、流通受限证券申购、权证投资的电子化事前风险控制和基金投资日常监控报告的自动化管理，提高了基金投资日常监控工作的效率。在此基础上，监察稽核部加大了对投资风险日常提示的频率，确保相关风险得到有效控制。

2、进一步完善公司制度，控制公司运作风险。

2006 年，公司在 2005 年开始的制度修订工作的基础上，结合相关法律法规和业务实际以及制度试运行情况对公司制度和业务流程进行修订和完善，进一步细化了各业务环节协作、监督和信息沟通的运作流程。

公司以后台运作协调小组为依托，定期和不定期对公司运营中出现的问题进行磋商并提出解决方案。

3、提高公司员工特别是投资人员法律意识、强调有效风险管理下的基金投资。

公司组织相关人员对不时公布的法律法规进行学习、培训，并通过考试检查学习效果。通过上述工作的开展，公司提高了投资风险管理的效率。

公司通过定期监察稽核、风险控制委员会会议等形式检查、监督“研究为本、淡化选时、均衡配置、风险管理”的投资理念的落实、执行情况坚持以风险调整后的收益作为评价投资业绩的指标、以均衡投资为投资团队统一的投资理念。

4、继续加强风险管理，做好风险绩效报告工作

2006 年公司进一步强化基金投资的量化风险评估工作，通过月度报告和季度报告的形式，定期对基金投资的流动性风险、持股集中度、股票库表现等问题进行了分析，为管理投资风险提供依据。

我们认为，建立并切实运行科学严密的内部控制体系，对揭示和防范风险，保障基金投资的科学、高效，提高公司管理水平至关重要。我们将继续高度重视防范各种风险，不断完善和优化操作流程，充实和改进内控技术方法与手段，提高内部监察工作的科学性和效率性，切实保障基金运作的安全。

四、托管人报告

在托管富国天时货币市场基金的过程中，本基金托管人——中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《富国天时货币市场基金基金合同》、《富国天时货币市场基金托管协议》的约定，对富国天时货币市场基金管理人—富国基金管理有限公司 2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

本托管人认为，富国基金管理有限公司在富国天时货币市场基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》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。

本托管人认为，富国天时货币市场基金的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的富国天时货币市场基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行基金托管业务部

2007 年 3 月 26 日

五、审计报告

安永大华业字（2007）第072号

富国天时货币市场全体基金份额持有人：

我们审计了后附的富国天时货币市场基金（以下简称“贵基金”）财务报表，包括 2006 年 12 月 31 日的资产负债表和 2006 年 6 月 5 日（基金合同生效日）至 2006 年 12 月 31 日止期间的经营业绩表、基金净值变动表及基金收益分配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、《金融企业会计制度》和《证券投资基金会计核算办法》的规定编制财务报表是贵基金的基金管理人富国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，贵基金财务报表已经按照企业会计准则、《金融企业会计制度》和《证券投资基金会计核算办法》的规定编制，在所有重大方面公允反映了贵基金 2006 年 12 月 31 日的财务状况以及 2006 年 6 月 5 日（基金合同生效日）至 2006 年 12 月 31 日止期间的经营成果、净值变动及收益分配情况。

安永大华会计师事务所有限责任公司

中国 上海

中国注册会计师 徐艳

中国注册会计师 蒋燕华

2007 年 3 月 22 日

六、财务会计报告

（一）会计报告书

1、2006 年 12 月 31 日资产负债表

金额单位：人民币元

项 目	期末数	年初数
资 产:		
银行存款	16,160,884.89	
清算备付金	1,518,201.07	
交易保证金		
应收证券清算款		
应收股利		
应收利息	2,039,793.11	
应收申购款	9,686,691.38	
其他应收款	8,421.00	
股票投资市值		
其中: 股票投资成本		
债券投资市值	504,739,831.92	
其中: 债券投资成本	504,739,831.92	
权证投资	0.00	
其中: 权证投资成本	0.00	
买入返售证券	180,200,000.00	
待摊费用		
其他资产		
资产合计	714,353,823.37	
负债及基金持有人权益		
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	230,716.66	
应付托管费	69,914.15	
应付销售服务费	90,621.60	
应付佣金		
应付利息		
应付收益	896,716.96	
未交税金		
其他应付款	274,331.93	
卖出回购证券款		
短期借款		
预提费用	80,000.00	
其他负债		
负债合计	1,642,301.30	

基金持有人权益:		
实收基金	712,711,522.07	
未实现利得		
未分配收益		
持有人权益合计	712,711,522.07	
负债与持有人权益总计	714,353,823.37	

所附附注为本会计报表的组成部分

2、2006 年度经营业绩表

金额单位：人民币元

项 目	本年数	上年数
一、收入	18,490,745.87	
1、股票差价收入		
2、债券差价收入	374,075.24	
3、权证差价收入	0.00	
4、债券利息收入	10,427,779.83	
5、存款利息收入	1,706,972.89	
6、股利收入		
7、买入返售证券收入	5,981,285.37	
8、其他收入	632.54	
二、费用	5,471,433.40	
1、基金管理人报酬	2,228,852.77	
2、基金托管费	675,409.86	
3、基金销售服务费	1,600,854.24	
4、卖出回购证券利息支出	640,329.42	
5、利息支出		
6、其他费用	325,987.11	
其中：上市年费		
信息披露费	100,000.00	
审计费用	80,000.00	
三、基金净收益	13,019,312.47	
加：未实现利得		
四、基金经营业绩	13,019,312.47	

所附附注为本会计报表的组成部分

3、2006 年度基金收益分配表

金额单位：人民币元

项目	本年数	上年数
本期基金净收益	13,019,312.47	
加：期初基金净收益		
加：本期损益平准金		
可供分配基金净收益	13,019,312.47	
减：本期已分配基金净收益	13,019,312.47	
期末基金净收益	0.00	

所附附注为本会计报表的组成部分

4、2006 年度基金净值变动表

金额单位：人民币元

项目	本年数	上年数
一、期初基金净值	3,518,813,010.23	
二、本期经营活动：		
基金净收益	13,019,312.47	
未实现利得		
经营活动产生的基金净值变动数	13,019,312.47	
三、本期基金单位交易：		
基金申购款	3,159,939,053.53	
基金赎回款	-5,966,040,541.69	
基金单位交易产生的基金净值变动数	-2,806,101,488.16	
四、本期向持有人分配收益：		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	-13,019,312.47	
五、期末基金净值	712,711,522.07	

所附附注为本会计报表的组成部分

(二) 会计报表附注

1、 基金设立说明

富国天时货币市场基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会证监基金字[2006]59号文《关于同意富国天时货币市场基金募集的批复》的核准,由富国基金管理有限公司作为发起人于2006年5月10日至2006年5月31日面向社会公开募集,募集期结束经安永大华会计师事务所有限责任公司验证并出具安永大华业字(2006)第517号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2006年6月5日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除

认购费后的实收基金（本金）为人民币3,518,465,243.11元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币347,767.12元，以上实收基金（本息）合计为人民币3,518,813,010.23元，折合3,518,813,010.23份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记人为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行。

2006年11月29日（“分级日”），本基金按照500万份基金份额的界限划分为A级基金份额和B级基金份额，单一持有人持有500万份基金份额以下的为A级，达到或超过500万份的为B级。本基金份额分级规则于分级日起生效。基金分级后，当份额持有人在单个基金帐户保留的基金份额减少至500万份以下时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金帐户持有的B级基金份额降级为A级基金份额；相应地，当达到或超过500万份时，A级基金份额自动升级为B级基金份额。两级基金份额单独计算及公布基金日收益和基金七日收益率，升级后的B级基金份额将从2006年11月30日起享受B级基金收益。分级后，本基金已于2007年1月19日公告更新的招募说明书，该更新招募说明书已经中国证监会上海监管局核准。

2、 财务报表编制基础

本基金的财务报表系按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、基金合同、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《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》、《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》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

3、 主要会计政策

（1） 会计年度：

自公历1月1日至12月31日。本期财务报表的实际编制期间系2006年6月5日（基金合同生效日）至2006年12月31日。

（2） 记帐本位币：人民币

（3） 记帐基础和计价原则：

以权责发生制为记账基础，除债券投资按本附注所述的估值原则计价外，其余所有报表项目均以历史成本计价。

（4） 基金资产的估值原则

- A 本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议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，每日计提损益。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。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。

本基金目前投资工具的估值方法如下：

- a 基金持有的付息债券采用折溢价摊销后的成本列示，按票面利率计提应收利息；
 - b 基金持有的贴现债券采用购入成本和内含利息列示，按购入成本和到期兑付面值之间的收益，在剩余期限内每日计提应收利息；
 - c 基金持有的浮动利率债券采用溢折价摊销后的成本列示，按浮动利率计提应收利息；
 - d 基金持有的质押式回购以成本列示，按协议利率在实际持有期间内逐日计提利息；
 - e 基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；
 - f 基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息。
- B** 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较大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生不利影响，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“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值的偏离度的绝对值达到或超过 0.25% 时，基金管理人应与基金托管人商定后根据风险控制的需要调整投资组合，其中对于偏离度的绝对值达到或超过 0.5% 的情形，基金管理人应当在事件发生之日起 2 日内就此事项进行临时报告，至少披露发生日期、偏离度、原因及处理方法，并与基金托管人商定后参考成交价、市场利率等信息对投资组合进行价值重估，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；
- C** 如有确凿证据表明按上述方法进行估值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定后，按最能反映公允价值的方法估值；
- D** 如有新增事项，按国家最新规定估值。

(5) 证券投资的成本计价方法

- A** 买入未上市债券和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。债券投资按实际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，对于贴息债券，应作为债券投资成本。对于债券手续费返还收入，应按权责发生制原则，视为折价计入债券成本，并在债券剩余存续期内摊销；

- B 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。

(6) 收入的确认和计量

- A 债券差价收入于卖出债券实际收到价款时确认，并按实际收到的全部价款与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；
- B 债券利息收入按实际持有期内逐日计提。付息债券按债券票面价值与票面利率计提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，并根据买入债券时溢折价摊销数调整后的金额入账；贴息债券按买入成本与票面金额的差额，再扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的余额采用直线法逐日计提；
- C 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与帐面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会基金部通知(2006)22号文《关于货币市场基金提前支取定期存款有关问题的通知》的规定，因提前支取导致的利息损失由基金管理公司承担；
- D 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；
- E 其他收入于实际收到时确认收入；
- F 资产支持证券差价收入于卖出证券成交日确认，并按实际收到的全部价款与其成本、应收利息的差额入账；
- G 资产支持证券利息收入按该证券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由该证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在资产支持证券实际持有期内逐日计提。

(7) 费用的确认和计量

- A 基金管理费按前一日的基金资产净值的0.33%的年费率逐日计提；
- B 基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率逐日计提；
- C 2006年11月29日（本基金分级日）前，基金销售服务费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提。分级日及分级日后，A级基金份额的基金销售服务费计算同前；对于B级基金份额，基金销售服务费按前一日的基金资产净值的0.01%的年费率逐日计提；

- D 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；
- E 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第五位的，则采用待摊或预提的方法。

(8) 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。

(9) 基金的收益分配政策

本基金分级后，A、B 两级基金份额单独计算及公布基金日收益和基金七日收益率。B 级基金份额的基金日收益及基金七日收益率自 2006 年 11 月 30 日起计算，升级后的 B 级基金份额从 2006 年 11 月 30 日起享受 B 级基金收益。以下收益分配政策适用于本基金分级前全体基金份额；分级后，A、B 级基金份额分别按照以下收益分配政策独立进行收益分配。

- A 每一基金份额享有同等分配权；
- B “每日分配、按月支付”。本基金收益根据每日基金收益公告，以每万份基金净收益为基准，为投资者每日计算并分配当日收益，每月集中支付收益，使基金账面份额净值始终保持 1.00 元。投资者当日应付收益的精度为 0.01 元，第 3 位采用去尾的方式，因去尾形成的余额归入基金财产，参与下一个工作日的分配。
- C 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，当日投资者不记收益；
- D 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，基金份额持有人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，其累计收益恰好为负值，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；
- G 当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起不享有基金的分配权益；
- F 本基金收益每月集中结转一次，合同生效不满 1 个月不结转。每月结转

时，若投资者账户的当前累计收益为正收益，则该投资者账户的本基金份额体现为增加；反之，则该投资者账户的本基金份额体现为减少；除了每月的例行收益结转外，每天对涉及有赎回等交易的账户进行提前收益结转，处理方式和例行收益结转相同；

G 在符合相关法律法规及规范性文件的规定，且在不影响基金份额持有人利益情况下，基金管理人与基金托管人协商一致并获得中国证监会核准后可酌情调整基金收益分配方式，此项调整不需要基金持有人大会决议通过，基金管理人应于实施更改前依照有关规定在中国证监会指定媒体上公告；

H 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

(10) 本基金本报告期没有发生重大会计差错。

4、 税项

A 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。

B 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入、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、债券的利息收入时代扣代缴20%的个人所得税。

5、 关联方关系及其交易

(1) 关联方关系

企业名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人 注册登记人、基金销售机构
中国农业银行	基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申银万国证券股份有限公司（“申银万国证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
山东省国际信托投资有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 通过关联方席位进行的交易

本基金自 2006 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日止期间未通过关联方席位进行交易。

(3) 关联方报酬

A 基金管理人报酬——基金管理费

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后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。

	期初余额	本期计提	本期支付	期末余额
2006 年度		2,228,852.77	1,998,136.11	230,716.66

B 基金托管人报酬——基金托管费

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

	期初余额	本期计提	本期支付	期末余额
2006 年度		675,409.86	605,495.71	69,914.15

C 基金销售服务费

基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人支配使用。

在2006年11月29日（本基金分级日）之前，本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的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

本基金分级日之后，A级基金份额的基金销售服务费率 and 计算方法同分级之前；本基金B级基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.01%的年费率计提。计算方法如下：

$$H_b = E_b \times 0.01\% / \text{当年天数}$$

H_b为每日应支付的基金销售服务费

E_b为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金管理人向基金托管人发送基金销售费划付指令，经基金托管人复核后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。

	本期计提	本期支付	期末余额(注)
2006年6月5日(基金合同生效日)至2006年11月28日(分级日前日)止期间	1,500,487.33	1,329,274.27	171,213.06

注：该应付销售服务费余额于2006年12月份支付。

		期初余额	本期计提	本期支付	2006-12-31
2006年11月29日(分级日)至2006年12月31日止期间	A级基金份额		93,746.07	6,631.32	87,114.75
	B级基金份额		6,620.84	3,113.99	3,506.85

需支付给各关联方的销售服务费如下：

关联方名称	2006 年度 (金额: 元)
富国基金管理有限公司 (管理人)	1,600,854.24
合 计	1,600,854.24

D 与关联方进行银行间同业市场的债券 (含回购) 交易

本基金自2006年6月5日(基金合同生效日)至2006年12月31日止期间通过银行间同业市场与基金托管人中国农业银行进行了以下交易:

购入银行间债券, 交易金额合计为人民币351,365,400.00元;

融资回购证券业务, 交易金额合计为人民币 2,828,185,000.00 元, 相应的利息支出为人民币 251,447.52 元。

E 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农业银行保管, 并按1.62%的协议利率计息。由基金托管人保管的银行存款余额及产生的利息收入如下:

项目	2006-12-31
银行存款余额	16,160,884.89
项目	2006年度
银行存款产生的利息收入	1,626,808.27

(4) 关联方持有基金份额

基金管理人所持有的本基金份额:

本基金的基金管理人自2006年6月5日(基金合同生效日)至2006年12月31日止期间未持有本基金份额。

基金托管人、基金管理人主要股东及其控制的机构所持有的本基金份额:

本基金的基金托管人、基金管理人主要股东及其控制的机构于2006年年末均未持有本基金份额。

6、 会计报表主要项目

(1) 银行存款

项 目	2006-12-31
活期存款	16,160,884.89

本基金自2006年6月5日(基金合同生效日)至2006年12月31日止期间未投资于定期存款。

(2) 应收利息

项 目	2006-12-31
-----	------------

应收活期银行存款利息	27,547.57
应收清算备付金利息	683.20
应收买入返售证券利息	1,128,898.36
应收债券利息	882,663.98
合 计	2,039,793.11

(3) 待摊费用

本基金2006年末无待摊费用余额。

(4) 股票投资

本基金未投资股票。

(5) 债券投资

项 目	2006-12-31
银行间企业债	139,917,455.37
银行间贴现企业债	147,680,840.21
银行间贴现央行票据	217,141,536.34
合 计	504,739,831.92

(6) 应付佣金

本基金2006年末无应付佣金余额。

(7) 其他应付款

项 目	2006-12-31
应付债券交易费	12,450.00
应付回购交易费	6,681.93
应付企业债税金	255,200.00
合 计	274,331.93

(8) 预提费用

项 目	2006-12-31
审计费	80,000.00
合 计	80,000.00

(9) 实收基金

项 目	2006年6月5日（基金合同生效日） 至2006年11月29日（分级日）止期间
本期认购	3,518,465,243.11
加：募集期间认购资金利息折份额	347,767.12
期初基金净值	3,518,813,010.23
加：本期申购	2,585,461,662.15

其中：基金分红再投资	7,503,387.60	
减：本期赎回	5,089,761,566.77	
期末实收基金	1,014,513,105.61	
项 目	2006年11月30日（分级日次日） 至2006年12月31日止期间	
	A级基金份额	B级基金份额
期初实收基金	481,202,691.29	533,310,414.32
加：本期申购	259,380,067.05	315,097,324.33
其中：基金分红再投资	736,753.94	643,720.38
减：本期赎回	273,339,805.95	602,939,168.97
加：B级基金份额降级为A级基金份额	3,808,638.47	
减：A级基金份额升级为B级基金份额		3,808,638.47
加：A级基金份额升级为B级基金份额		103,701,034.52
减：B级基金份额降级为A级基金份额	103,701,034.52	
年末实收基金	367,350,556.34	345,360,965.73

注：2006年11月29日（“分级日”），本基金按照500万份基金份额的界限划分为A级基金份额和B级基金份额，单一持有人持有500万份基金份额以下的为A级，达到或超过500万份的为B级。基金管理人以投资者分级日的基金帐户份额余额（不含当日申购或赎回的份额）为基准进行份额级别划分。分级日，实收基金份额余额为1,014,513,105.61份，分别划分为A级基金481,202,691.29份和B级基金533,310,414.32份。分级后，本基金已于2007年1月19日公告更新的招募说明书，该更新招募说明书已经中国证监会核准。

(10) 未实现利得

本基金本期无未实现利得。

(11) 股票差价收入

本基金本期无股票差价收入。

(12) 债券差价收入

项 目	2006年（元）
卖出债券成交总额	2,925,646,215.31
卖出债券成本总额	2,915,906,186.64
卖出债券应收利息总额	9,365,953.43
债券差价收入	374,075.24

(13) 其他收入

项 目	2006年度（元）
基金募集期计息尾差	632.54
合计	632.54

(14) 其他费用

项目	2006年度(元)
审计费用	80,000.00
信息披露费	100,000.00
银行费用	33,377.93
债券账户服务费	4,500.00
回购交易费用	75,034.18
债券交易费用	32,675.00
其他	400.00
合计	325,987.11

(15) 本期已分配基金净收益

本基金自2006年6月5日(基金合同生效日)至2006年12月31日止期间累计分配收益为人民币13,019,312.47元,具体分配情况请参见下表:

项 目	2006年6月5日(基金合同生效日) 至2006年11月29日(分级日)止期间
期初应付收益	
加: 本期累计收益分配	11,396,883.52
减: 基金分红再投资	7,503,387.60
因基金赎回而支付给投资者	2,610,901.18
期末应付收益	1,282,594.74

项 目	2006年11月30日(分级日次日) 至2006年12月31日止期间	
	A级基金份额	B级基金份额
期初应付收益	705,816.66	576,778.08
加: 本期累计收益分配	768,123.27	854,305.68
减: 基金分红再投资	736,753.94	643,720.38
因基金赎回而支付给投资者	151,571.22	476,261.19
加: 因B级基金份额降级为A级而调整	200,764.34	-
减: 因A级基金份额升级为B级而调整		200,764.34
加: 因A级基金份额升级为B级而调整		203,055.51
减: 因B级基金份额降级为A级而调整	203,055.51	
年末应付收益	<u>583,323.60</u>	<u>313,393.36</u>

(16) 期末流通受限的基金资产

本基金年末未持有流通受限的资产。

7、或有事项

无需要说明的重大或有事项。

8、承诺事项

无需要说明的承诺事项。

9、 资产负债表日后的非调整事项

无需要说明的资产负债表日后的非调整事项。

10、 其他重要事项

无需要说明的其他重要事项。

七、 投资组合报告（2006 年 12 月 31 日）

（一） 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	504, 739, 831. 92	70. 66
买入返售证券	180, 200, 000. 00	25. 23
其中：买断式回购的买入返售证券	0. 00	0. 00
银行存款和清算备付金合计	17, 679, 085. 96	2. 47
其他资产	11, 734, 905. 49	1. 64
合计	714, 353, 823. 37	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	11, 148, 615, 000. 00	5. 55
	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

注：上表中报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数，报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。本报告期内无货币市场基金正回购的资金余额超过资产净值的 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
报告期末投资组合平均剩余期限	139

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	1

报告期内投资组合平均剩余期限违规超过 180 天的说明：本报告期内无。

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 天内	12.39	0.00
2	30 天(含)－60 天	12.24	0.00
3	60 天(含)－90 天	4.22	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	4.21	0.00
4	90 天(含)－180 天	57.15	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	4.18	0.00
5	180 天(含)－397 天(含)	12.60	0.00
	合 计	98.59	0.00

(四) 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	0.00	0.00
	其中：政策性金融债	0.00	0.00
3	央行票据	217,141,536.34	30.47
4	企业债券	287,598,295.58	40.35
5	其他	0.00	0.00
	合 计	504,739,831.92	70.82
	剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债券	59,879,553.75	8.40

2、报告期末基金债券投资明细：

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 44	2,200,000		217,141,536.34	30.47
2	06 方正 CP01	700,000		68,959,910.20	9.68
3	06 丰原 CP01	500,000		50,000,000.00	7.02
4	06 北建工 CP02	400,000		39,503,009.71	5.54
5	06 首都机场债	300,000		30,110,088.73	4.22
6	05 中信债 1	300,000		29,769,465.02	4.18
7	06 新矿 CP02	300,000		29,434,022.55	4.13
8	06 中牧 CP01	200,000		20,031,082.45	2.81
9	06 美丰 CP01	100,000		10,006,819.17	1.40
10	06 北建工 CP01	100,000		9,783,897.75	1.37

(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	0.3640%
报告期内偏离度的最低值	-0.0926%
报告期内每个工作日偏离度的绝对 值的简单平均值	0.0853%

注：以上数据按工作日统计

(六) 投资组合报告附注

1、基金计价方法说明：

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为人民币 1.00 元。

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，每日计提收益或损失。

2、本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的声明：

本报告期内本基金不存在该类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。

3、本报告期内需说明的证券投资决策程序：

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

4、其他资产的构成：

序号	其他资产	金额(元)
1	交易保证金	
2	应收证券清算款	
3	应收利息	2,039,793.11
4	应收申购款	9,686,691.38
5	其他应收款	8,421.00
6	待摊费用	
7	其他	
合计		11,734,905.49

八、期末基金份额持有人户数和持有人结构

份额类别	基金份额持有人户数(户)	平均每户持有的基金份额(份)	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额(份)	占总份额比例	持有份额(份)	占总份额比例
富国货币A级	7,902	46,488.30	11,818,243.15	3.22%	355,532,313.19	96.78%
富国货币B级	6	57,560,160.96	334,014,965.73	96.71%	11,346,000.00	3.29%
合计	7,908	90,125.38	345,833,208.88	48.52%	366,878,313.19	51.48%

九、开放式基金份额变动

份额类别	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
富国货币A级	3,518,813,010.23		3,329,853,058.96	6,481,315,512.85	367,350,556.34
富国货币B级			952,108,773.17	606,747,807.44	345,360,965.73
合计	3,518,813,010.23		4,281,961,832.13	7,088,063,320.29	712,711,522.07

注：基金合同生效日为 2006 年 6 月 5 日，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来源，统一计入本期总赎回份额。

十、重大事件揭示

- 1、本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。
- 2、本报告期本基金的基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。
- 3、本年度无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。
- 4、本报告期本基金投资策略无改变。
- 5、本基金本期收益分配情况如下：

本基金自 2006 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日止期间累计分配收益为人民币 13,019,312.47 元，其中富国货币 A 级 12,165,006.79 元，

富国货币 B 级 854,305.68 元。

6、本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所，本基金本年度支付给审计机构安永大华会计师事务所的报酬为 8 万元人民币，其已为本公司提供审计服务的连续年限为 4 年。

7、本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚的情况。

8、本基金 2006 年度席位交易情况如下：

券商名称	回购交易量		实付佣金	
	交易量（元）	占成交量比例	佣金（元）	占佣金比例
东方证券	6,605,300,000.00	100.00%	-79,951.50	100.00%
合计	6,605,300,000.00	100.00%	-79,951.50	100.00%

注：上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金。

本期新增上海席位一个，席位号是：22645，所属券商：东方证券。

9、本公司于 2006 年 4 月 8 日在中国证券报、上海证券报和证券时报上发布了《富国基金管理有限公司关于开通全国统一客户服务号码的公告》。

10、本公司于 2006 年 6 月 15 日开放本基金申购和赎回业务以及网上交易业务，并于 2006 年 6 月 12 日在上海证券报、证券时报和公司网站上发布了相关公告。

11、本公司于 2006 年 6 月 1 日起本基金网上交易开通“中国农业银行银基通”，业务，并在中国证券报、上海证券报和本公司网站上发布了相关公告。

12、本公司从 2006 年 6 月 15 日开通本基金与本公司其他开放式基金的转换业务，并于 2006 年 6 月 12 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上公告。

13、本公司于 2006 年 8 月 18 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上发布了《富国基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告》。

14、本公司于 2006 年 11 月 1 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和本公司网站上发布了《富国基金管理有限公司关于变更注册资本和设立深圳分公司的公告》。

15、本公司于 2006 年 11 月 6 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和本公司网站上发布了《富国基金管理有限公司关于在兴业证券股份有限公司开办富国基金“定期定额投资计划”业务的公告》，从 11 月 10 日起开通本基金在兴业证券的定期定投业务。本公司从 2006 年 12 月 4 日起在上海银行开通本基金的定期定投业务，并于 11 月 30 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和本公司网站

上发布了相关公告。

16、本公司于 2006 年 11 月 25 日在上海证券报、证券时报和本公司网站上发布了《关于富国天时货币市场基金实施基金份额分级的公告》，本基金自 2006 年 11 月 29 日起实施基金份额分级。

17、本基金本年度新增中信证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司为代销机构，并分别于 12 月 28 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和本公司网站上公告。

十一、备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立富国天时货币市场基金的文件
- 2、富国天时货币市场基金基金合同
- 3、富国天时货币市场基金托管协议
- 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
- 5、富国天时货币市场基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

查阅地点：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。

咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）

公司网址：<http://www.fullgoal.com.cn>

富国基金管理有限公司

二 00 七年三月三十日