

招商现金增值证券投资基金 2006年半年度报告摘要

基金管理人：招商基金管理有限公司 基金托管人：招商银行股份有限公司

第一节 重要提示

招商现金增值基金管理人—招商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...

本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、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为...

第六节 财务会计报告

一、招商现金增值基金 2006 年 6 月 30 日及 2005 年 12 月 31 日的比较式资产负债表

Table with columns: 项目, 2006年6月30日期末数, 2005年12月31日期末数. Lists assets and liabilities.

二、招商现金增值基金本报告期及上年度可比期间的比较式经营业绩表

Table with columns: 项目, 2006年1月1日至2006年6月30日止, 2005年1月1日至2005年6月30日止. Lists income and expenses.

三、招商现金增值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

Table with columns: 项目, 2006年1月1日至2006年6月30日止, 2005年1月1日至2005年6月30日止. Lists net value changes.

四、招商现金增值基金本报告期及上年度可比期间的比较式收益分配表

Table with columns: 项目, 2006年1月1日至2006年6月30日止, 2005年1月1日至2005年6月30日止. Lists distributions.

注：以前年度损益调整为 2006 年调整 2005 年应属于预提性质的费用。

(二)招商现金增值基金半年度会计报表附注

二、基金基本情况
基金名称：招商现金增值开放式证券投资基金
基金简称：招商现金增值基金

基金管理人：招商基金管理有限公司
注册地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

基金托管人：招商银行股份有限公司
注册地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

基金投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金管理人：招商基金管理有限公司
法定代表人：牛冠兴
信息披露负责人：赵生章

基金托管人：招商银行股份有限公司
法定代表人：秦晓
信息披露负责人：姜晓

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

一、招商现金增值基金 2006 年 6 月 30 日及 2005 年 12 月 31 日的比较式资产负债表

Table with columns: 项目, 2006年6月30日期末数, 2005年12月31日期末数. Lists assets and liabilities.

二、招商现金增值基金本报告期及上年度可比期间的比较式经营业绩表

Table with columns: 项目, 2006年1月1日至2006年6月30日止, 2005年1月1日至2005年6月30日止. Lists income and expenses.

三、招商现金增值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

Table with columns: 项目, 2006年1月1日至2006年6月30日止, 2005年1月1日至2005年6月30日止. Lists net value changes.

四、招商现金增值基金本报告期及上年度可比期间的比较式收益分配表

Table with columns: 项目, 2006年1月1日至2006年6月30日止, 2005年1月1日至2005年6月30日止. Lists distributions.

注：以前年度损益调整为 2006 年调整 2005 年应属于预提性质的费用。

(二)招商现金增值基金半年度会计报表附注

1. 基金的基本情况

基金名称：招商现金增值开放式证券投资基金
基金简称：招商现金增值基金

基金管理人：招商基金管理有限公司
注册地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

基金托管人：招商银行股份有限公司
注册地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

基金投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金管理人：招商基金管理有限公司
法定代表人：牛冠兴
信息披露负责人：赵生章

基金托管人：招商银行股份有限公司
法定代表人：秦晓
信息披露负责人：姜晓

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

基金的投资目标：保持本基金的安全性、追求稳健的当期收益。
投资策略：以严谨的市场价值分析为基础，采用均衡的投资组合策略。

Table with columns: 序号, 平均剩余期限, 各期限资产占基金资产净值比例(%), 各期限负债占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 债券品种, 成本(元), 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 债券名称, 债券面值(元), 成本(元), 占资产净值比例(%).

(六)“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

Table with columns: 项目, 偏离情况(2006.1.1-2006.6.30).

报告期内偏离度的绝对值在 0.25%（含）—0.5% 间的次数
报告期内偏离度的最高值

报告期内偏离度的最低值
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值

(七)投资组合报告摘要
(1) 本基金的计价方法
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每日计提利息。

(2) 本报告期内，本基金
(3) 不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报告期末基金资产净值的 20% 的情况；

(4) 本报告期内，本基金
(5) 本报告期内，本基金
(6) 本报告期内，本基金

(7) 本报告期内，本基金
(8) 本报告期内，本基金
(9) 本报告期内，本基金

(10) 本报告期内，本基金
(11) 本报告期内，本基金
(12) 本报告期内，本基金

(13) 本报告期内，本基金
(14) 本报告期内，本基金
(15) 本报告期内，本基金

(16) 本报告期内，本基金
(17) 本报告期内，本基金
(18) 本报告期内，本基金

(19) 本报告期内，本基金
(20) 本报告期内，本基金
(21) 本报告期内，本基金

(22) 本报告期内，本基金
(23) 本报告期内，本基金
(24) 本报告期内，本基金

(25) 本报告期内，本基金
(26) 本报告期内，本基金
(27) 本报告期内，本基金

(28) 本报告期内，本基金
(29) 本报告期内，本基金
(30) 本报告期内，本基金

(31) 本报告期内，本基金
(32) 本报告期内，本基金
(33) 本报告期内，本基金

(34) 本报告期内，本基金
(35) 本报告期内，本基金
(36) 本报告期内，本基金

(37) 本报告期内，本基金
(38) 本报告期内，本基金
(39) 本报告期内，本基金

(40) 本报告期内，本基金
(41) 本报告期内，本基金
(42) 本报告期内，本基金

(43) 本报告期内，本基金
(44) 本报告期内，本基金
(45) 本报告期内，本基金

(46) 本报告期内，本基金
(47) 本报告期内，本基金
(48) 本报告期内，本基金

(49) 本报告期内，本基金
(50) 本报告期内，本基金
(51) 本报告期内，本基金

(52) 本报告期内，本基金
(53) 本报告期内，本基金
(54) 本报告期内，本基金

(55) 本报告期内，本基金
(56) 本报告期内，本基金
(57) 本报告期内，本基金