

易方达货币市场基金 2006年半年度报告摘要

基金管理人:易方达基金管理有限公司 基金托管人:中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2006年8月11日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告期间:2006年1月1日至2006年6月30日。本报告财务数据未经审计。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读登载于本基金管理人网站www.efunds.com.cn的半年度报告正文。

一、基金简介

Table with 2 columns: Item and Value. Includes basic info like name (易方达货币市场基金), type (货币市场基金), and investment objectives.

(一)基金基本资料

Table with 2 columns: Item and Value. Lists management details including the manager (易方达基金管理有限公司) and custodian (中国银行股份有限公司).

二、主要财务指标和基金净值表现

重要提示:下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。

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics like return on assets and net asset value changes for the period.

Table with 6 columns: Period, Net Asset Value, and other metrics. Compares performance against benchmarks like the CBI index.

注:本基金收益分配是按月结转份额。本基金合同生效以来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。

Table with 6 columns: Period, Net Asset Value, and other metrics. Compares performance against benchmarks like the CBI index.

注: 1.基金合同中关于基金投资比例的约定; (1) 投资于同一公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的10%;

因规模规模或市场变化等原因导致投资组合超出上述约定的规定,基金管理人应在合理期限内进行调整,以符合有关限制规定。

在本报告期内,除出现因赎回导致基金投资定期存款被动超过基金资产净值的30%、因连续大额赎回导致债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%以及因赎回导致基金投资剩余期限不超过397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计超过基金资产净值的20%的情形外,遵守法律、法规和基金合同的比例限制进行证券投资。

三、管理人报告

1.基金管理人及其管理基金的经验 经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准,易方达基金管理有限公司成立于2001年4月17日,注册资本1.2亿元。

截至2006年6月30日,公司旗下有基金科汇、基金科瑞、基金科讯、基金科瑞四只封闭式基金和易方达平稳增长基金、易方达策略成长基金、易方达50指数基金、易方达积极成长基金、易方达货币市场基金、易方达月月收益中短期债券投资基金、易方达深证100交易型开放式指数基金、易方达价值精选股票型基金八只开放式基金。

2.基金经理介绍 林海,男,1972年5月生,经济学硕士。1993至1997年在万国证券公司湖北武汉营业部从事客户管理和投资研究工作。

(二)报告期内本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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资者为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。

(三)报告期内本基金投资策略和业绩表现的说明与分析 (1)行情回顾及运作分析

今年上半年,货币和信贷继续高速增长,固定资产投资居高不下,央行明确了宏观调控的政策,并于6月调高了定向央票和上调了准备金率。

随着对市场利率的更高的期待,以及部分资金重新进入申购新股市场,货币基金的规模有所下降。为适应市场变化,本基金在保持流动性的同时,滚动更新了部分短期资产,使基金资产的收益逐步反映市场利率。

(四)宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 展望下半年货币市场,我们认为三季度货币市场利率仍将小幅上升,而四季度将有所回落。

本托管人依据《易方达货币市场基金基金合同》与《易方达货币市场基金基金托管协议》,自2006年2月2日起托管易方达货币市场基金(以下称“易方达货币市场基金”或“本基金”)的全部资产。

(一)本托管人在托管本基金期间,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》和本基金合同以及托管协议的规定,诚信地履行了基金托管人的职责,不存在损害本基金持有人利益的行为。

(二)本托管人严格执行《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》和本基金合同以及托管协议的规定,诚信地履行了基金托管人的职责,不存在损害本基金持有人利益的行为。

(三)本托管人对与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

(四)本托管人作为与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

(五)本托管人作为与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

(六)本托管人作为与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

(七)本托管人作为与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

(八)本托管人作为与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

(九)本托管人作为与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

(十)本托管人作为与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

(十一)本托管人作为与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

(十二)本托管人作为与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

(十三)本托管人作为与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

(十四)本托管人作为与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

(十五)本托管人作为与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

(十六)本托管人作为与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

(十七)本托管人作为与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

(十八)本托管人作为与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

(十九)本托管人作为与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

(二十)本托管人作为与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

(二十一)本托管人作为与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

(二十二)本托管人作为与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

(二十三)本托管人作为与本基金资产相关的重大合同原件,因履行基金托管人职责而生成或收讫的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

所附附注为本报财务报表的组成部分 易方达货币市场基金 收益分配表

Table with 4 columns: Item, Value, and others. Shows the distribution of income for the period from Jan 1 to Jun 30, 2006.

所附附注为本报财务报表的组成部分 易方达货币市场基金 基金净值变动表

Table with 4 columns: Item, Value, and others. Shows the change in net asset value for the period from Jan 1 to Jun 30, 2006.

所附附注为本报财务报表的组成部分 (二)会计报表附注 附注1. 本基金半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

附注2. 重大会计差错的内容和更正金额 本基金2006半年度并无重大会计差错。

附注3. 关联方关系及关联方交易 (1)主要关联方关系

Table with 3 columns: Company Name, Relationship, and Details. Lists related parties like the fund manager and custodian.

(2)通过主要关联方席位进行的交易 本基金2006半年度及2006半年度均未通过主要关联方席位进行的重大交易。

(3)关联方报酬 A 基金管理人报酬 基金管理人报酬按前一日基金资产净值的0.33%的年费率计提。

(4)与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银行股份有限公司保管,并按银行同业存款利率计息。

(5)与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易 本基金2006半年度及2006半年度与基金托管人中国银行股份有限公司通过银行间同业市场进行的债券交易如下:

Table with 4 columns: Item, Value, and others. Shows transactions with related parties for the period.

(6)关联方持有本基金份额 A 基金管理人持有本基金份额情况 本基金基金管理人2006半年度及2005半年度未持有本基金份额。

Table with 4 columns: Item, Value, and others. Shows the number of shares held by related parties.

(7)关联方持有本基金份额 B 基金管理人主要股东及其控制的机构持有本基金份额情况

Table with 4 columns: Item, Value, and others. Shows the number of shares held by major shareholders.

(8)关联方持有本基金份额 C 基金管理人主要股东及其控制的机构持有本基金份额情况

Table with 4 columns: Item, Value, and others. Shows the number of shares held by major shareholders.

(9)关联方持有本基金份额 D 基金管理人主要股东及其控制的机构持有本基金份额情况

Table with 4 columns: Item, Value, and others. Shows the number of shares held by major shareholders.

(10)关联方持有本基金份额 E 基金管理人主要股东及其控制的机构持有本基金份额情况

Table with 4 columns: Item, Value, and others. Shows the number of shares held by major shareholders.

(11)关联方持有本基金份额 F 基金管理人主要股东及其控制的机构持有本基金份额情况

Table with 4 columns: Item, Value, and others. Shows the number of shares held by major shareholders.

(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:

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the average remaining maturity of the portfolio.

报告期内投资组合平均剩余期限未超过180天的情况。 2.期末投资组合平均剩余期限分布比例:

Table with 4 columns: Item, Value, and others. Shows the distribution of remaining maturities.

(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

Table with 4 columns: Item, Value, and others. Shows the composition of the bond portfolio.

注:上表中,债券投资的成本包括债券价值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应计利息。

Table with 5 columns: Item, Value, and others. Shows the composition of the top 10 bond holdings.

注:上表中,“债券数量”中的“自有投资”和“买断式回购”指自有的债券投资和通过债券买断式回购进行债券买入的债券卖出后的余额。

Table with 3 columns: Item, Value, and others. Shows the deviation of portfolio value from the benchmark.

(六)投资组合报告附注 1.基金计价方法说明 本基金资产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,每日计提损益。

2. 本基金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未超过当日基金资产净值的20%的情况。

3. 本报告期内无需说明的证券投资程序。 4. 其他资产的构成

Table with 3 columns: Item, Value, and others. Shows the composition of other assets.

5. 本报告期内投资资产支持证券的情况 本报告期内本基金未投资资产支持证券。

6. 本基金基金管理人2006半年度及2005半年度未持有本基金份额。 七. 基金份额持有人情况

(一)报告期末基金份额持有人户数 报告期末基金份额持有人户数: 29,613户

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the structure of the fund's shareholders.

(二)报告期末基金份额持有人结构 本基金份额变动情况如下: 单位:份

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the change in the number of shares.

9. 本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。 2. 本报告期内本基金管理人和基金托管人的托管业务部门无发生重大人事变动。

3. 本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。 4. 本报告期内本基金的投资策略、基金管理人内部决策程序未有重大变化。

5. 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,每月以红利再投资方式集中支付累计收益,即按份额面值1.00元转为基金份额。 6. 本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

7. 本报告期内基金管理人和其他基金托管人及其相关高级管理人员未受到任何处罚。

8. 本基金租用专用交易席位的说明 本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》(证监基金[1998]29号)的有关规定要求及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》,决定由国泰君安证券股份有限公司一个交易席位。 本报告期内,本基金通过证券经纪机构的交易席位成交及佣金情况见下表:

Table with 6 columns: Item, Value, and others. Shows the transaction and commission details for the reporting period.

注:信息披露报纸名称为:中国证券报、上海证券报、证券时报。 易方达基金管理有限公司 2006年8月26日