

南方现金增利基金 2006年第三季度报告

一、重要提示
基金管理人及董事会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...

二、基金产品概况
基金简称:南方现金增利
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2004年3月5日

三、主要财务指标和基金净值表现
(一)主要财务指标
本期净收益 110,170,576.35
基金本期净收益 0.0049
期末基金资产净值 18,540,390,589.40

(二)基金净值表现
1.历史各时间段基金净值收益率与同期业绩基准收益率比较

Table with columns: 阶段, 基金净值收益率(1), 业绩比较基准收益率(2), 比较基准收益差(3), 比较基准收益差率(4), (1)-(3), (2)-(4). Rows include 过去3个月, 过去12个月, 过去36个月.

四、管理人报告
(一)基金管理人
张纪林先生,基金经理,1971年生,南开大学金融学博士,具有9年国内银行固定收益类证券投资从业经验...

(二)基金运作的遵规守信情况
在报告期内,本基金运作严格遵守《证券法》、《基金法》等相关法律法规,恪守基金合同...

(三)基金的投资策略和业绩表现说明
在第三季度,监管当局采取了市场化与行政性紧缩政策并举的策略来防

范经济过热。从陆续公布的固定资产投资增速、银行贷款增速数据来看,虽然固定资产投资数据和长期银行贷款数据仍处于相对高位,但其增速下降已比较明显...

基于对调控节奏的预期,根据部分组合资产陆续到期的情况,本基金进行了适度投资...

新设IPO及股市一、二级市场对于债市资金分流效应相对减弱;大型IPO对债市资金流动性的冲击也将越来越弱...

五、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 15,596,060,160.26 82.88%

Table with columns: 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例. Rows include 债券投资, 买入返售证券, 银行存款和清算备付金合计, 其他资产, 合计.

(二)报告期末债券回购融资情况
(三)基金投资组合平均剩余期限
(四)投资组合平均剩余期限基本情况

Table with columns: 项目, 天数. Rows include 报告期末投资组合平均剩余期限, 报告期末投资组合平均剩余期限最高值, 报告期末投资组合平均剩余期限最低值.

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明:
(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 columns: 序号, 债券名称, 市值, 市值占净值比例. Rows include 国债, 央行票据, 政策性金融债, 企业债, 可转债.

2.基金投资前十名债券明细
(五)“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: 序号, 债券名称, 市值, 市值占净值比例. Rows include 06中电债, 06广发债, 06浦发债, 06招商债, 06华安债, 06民生债, 06华信债, 06华融债.

Table with columns: 项目, 偏离情况. Rows include 报告期内偏离度的绝对值在0.5%以上(含)的次数, 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.

(六)投资组合报告附注
1.基金计价方法说明:本基金采用“摊余成本法”计价,即计价对象以买入成本列示,按照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...

Table with columns: 序号, 其他资产, 金额(元). Rows include 交易保证金, 应收利息, 应收申购款, 其他应收款, 合计.

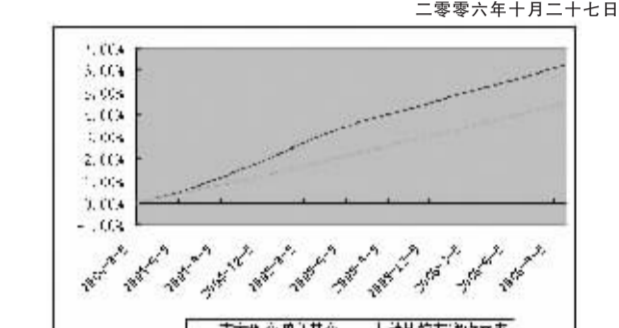
Table with columns: 序号, 债券名称, 债券数量(张), 成本(元), 占基金资产净值的比例. Rows include 网通02, 浦发03, 吴中01.

六、开放式基金份额变动
期初基金份额总额 19,929,205,905.17
期间基金总申购份额 26,832,614,991.50
期间基金总赎回份额 28,221,430,307.27
期末基金份额总额 18,540,390,589.40

七、备查文件目录
1.南方现金增利基金基金合同。
2.南方现金增利基金托管协议。
3.南方现金增利基金2006年3季度报告原文。

存放地点:深圳市深南大道4009号投资大厦7楼
查询方式:公司网站: http://www.southernfund.com

南方基金管理有限公司
二零零六年十月二十七日



隆元证券投资基金 2006年第三季度报告

一、重要提示
基金管理人及董事会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...

二、基金产品概况
基金简称:隆元
基金运作方式:契约型封闭式
基金合同生效日:1992年12月29日

三、主要财务指标和基金净值表现
(一)主要财务指标
本期净收益 21,767,315.26
基金本期净收益 0.0435
期末基金资产净值 658,220,237.59

(二)基金净值表现
1.净值增长率与同期业绩基准收益率比较

Table with columns: 阶段, 净值增长率(1), 业绩比较基准收益率(2), 比较基准收益差(3), 比较基准收益差率(4), (1)-(3), (2)-(4). Rows include 过去3个月, 过去12个月, 过去36个月.

四、管理人报告
(一)基金管理人
吕一凡先生,基金经理,1970年出生,经济学硕士,8年证券从业经历...

(二)基金运作的遵规守信情况
在报告期内,本基金运作严格遵守《证券法》、《基金法》等相关法律法规,恪守基金合同...

(三)基金的投资策略和业绩表现说明
在第三季度,监管当局采取了市场化与行政性紧缩政策并举的策略来防

2003年进入南方基金管理有限公司,先后从事研究、基金投资等工作。此外,基金隆元管理小组还配备了若干名证券投资分析人员,协助基金

(一)基金运作的遵规守信情况
本报告期内,本基金管理人严格遵守《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《证券投资基金销售管理办法》等法律法规...

(二)基金投资组合平均剩余期限
(三)基金投资组合平均剩余期限基本情况

Table with columns: 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例. Rows include 股票, 债券, 权证投资, 银行存款和清算备付金合计, 其他资产, 合计.

(四)投资组合平均剩余期限基本情况
(五)投资组合平均剩余期限基本情况

Table with columns: 行业分类, 市值, 占基金资产净值比例. Rows include A 农林牧渔, B 采掘业, C 制造业, D 电力、煤气及水的生产和供应业, E 建筑业, F 交通运输、仓储业, G 信息技术业, H 批发和零售贸易, I 金融、保险业, J 房地产业, K 社会服务业, L 传播与文化产业, M 综合类.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 市值, 市值占净值比例. Rows include 招商局, 万科, 福耀玻璃, 中国平安, 中信国安, 五粮液, 广州友谊, 伊利股份, 吉林敖东.

Table with columns: 债券类别, 债券市值, 市值占净值比例. Rows include 国家债券, 政策性银行金融债券, 企业债券, 央行票据, 可转债.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 市值, 市值占净值比例. Rows include 五粮液, 华联控股, 华联矿业, 华联矿业, 华联矿业.

C2 木材、家具
C3 造纸、印刷
C4 石油、化学、塑胶、塑料
C5 电子
C6 金属、非金属
C7 机械、设备、仪表
C8 医药、生物制品
C9 其他制造业
D 电力、煤气及水的生产和供应业
E 建筑业
F 交通运输、仓储业
G 信息技术业
H 批发和零售贸易
I 金融、保险业
J 房地产业
K 社会服务业
L 传播与文化产业
M 综合类

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 市值, 市值占净值比例. Rows include 招商局, 万科, 福耀玻璃, 中国平安, 中信国安, 五粮液, 广州友谊, 伊利股份, 吉林敖东.

Table with columns: 债券类别, 债券市值, 市值占净值比例. Rows include 国家债券, 政策性银行金融债券, 企业债券, 央行票据, 可转债.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 市值, 市值占净值比例. Rows include 五粮液, 华联控股, 华联矿业, 华联矿业, 华联矿业.

Table with columns: 债券类别, 债券市值, 市值占净值比例. Rows include 国家债券, 政策性银行金融债券, 企业债券, 央行票据, 可转债.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 市值, 市值占净值比例. Rows include 五粮液, 华联控股, 华联矿业, 华联矿业, 华联矿业.

Table with columns: 债券类别, 债券市值, 市值占净值比例. Rows include 国家债券, 政策性银行金融债券, 企业债券, 央行票据, 可转债.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 市值, 市值占净值比例. Rows include 五粮液, 华联控股, 华联矿业, 华联矿业, 华联矿业.

Table with columns: 债券类别, 债券市值, 市值占净值比例. Rows include 国家债券, 政策性银行金融债券, 企业债券, 央行票据, 可转债.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 市值, 市值占净值比例. Rows include 五粮液, 华联控股, 华联矿业, 华联矿业, 华联矿业.

Table with columns: 债券类别, 债券市值, 市值占净值比例. Rows include 国家债券, 政策性银行金融债券, 企业债券, 央行票据, 可转债.

(六)投资组合报告附注
1.本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

Table with columns: 项目, 金额. Rows include 交易保证金, 应收利息, 待摊费用, 合计.

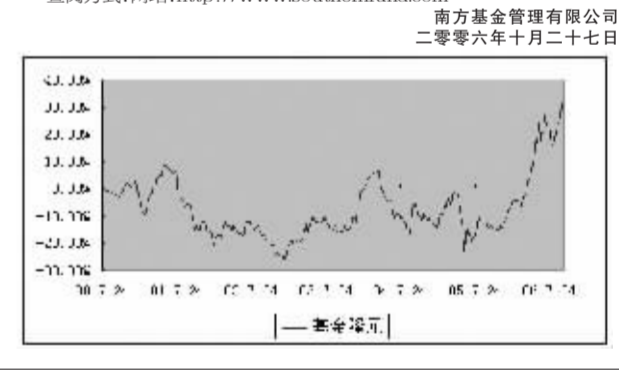
4.期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5.权证投资情况:无。

六、管理人持有本基金份额情况
截止2006年9月30日,南方基金管理有限公司作为基金发起人持有本基金份额19,099,161.00单位,占基金总份额的3.82%,本季度增加基金份额1,891,261.00单位。

七、备查文件目录
1.隆元证券投资基金基金合同。
2.隆元证券投资基金托管协议。
3.隆元证券投资基金2006年3季度报告原文。

存放地点:深圳市深南大道4009号投资大厦7楼
查询方式:网站: http://www.southernfund.com

南方基金管理有限公司
二零零六年十月二十七日



南方稳健成长证券投资基金 2006年第三季度报告

一、重要提示
基金管理人及董事会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...

二、基金产品概况
基金简称:南方稳健成长
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2001年9月28日

三、主要财务指标和基金净值表现
(一)主要财务指标
本期净收益 57,914,020.85
基金本期净收益 0.0316
期末基金资产净值 2,862,150,786.09

(二)基金净值表现
1.净值增长率与同期业绩基准收益率比较

Table with columns: 阶段, 净值增长率(1), 业绩比较基准收益率(2), 比较基准收益差(3), 比较基准收益差率(4), (1)-(3), (2)-(4). Rows include 过去3个月, 过去12个月, 过去36个月.

四、管理人报告
(一)基金管理人
王宏远先生,基金经理,1973年生,中共党员,西安交通大学经济学硕士...

(二)基金运作的遵规守信情况
在报告期内,本基金运作严格遵守《证券法》、《基金法》等相关法律法规,恪守基金合同...

(三)基金的投资策略和业绩表现说明
在第三季度,监管当局采取了市场化与行政性紧缩政策并举的策略来防

天元基金经理、开元基金经理,2002年公派赴美国皇家国际事务研究所及美国哥伦比亚大学学习,期间曾任职林林证券股票部,2005年7月回公司,现任公司投资总监。

(一)基金运作的遵规守信情况
本报告期内,本基金管理人严格遵守《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《证券投资基金销售管理办法》等法律法规...

(二)基金投资组合平均剩余期限
(三)基金投资组合平均剩余期限基本情况

Table with columns: 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例. Rows include 股票, 债券, 权证投资, 银行存款和清算备付金合计, 其他资产, 合计.

(四)投资组合平均剩余期限基本情况
(五)投资组合平均剩余期限基本情况

Table with columns: 行业分类, 市值, 占基金资产净值比例. Rows include A 农林牧渔, B 采掘业, C 制造业, D 电力、煤气及水的生产和供应业, E 建筑业, F 交通运输、仓储业, G 信息技术业, H 批发和零售贸易, I 金融、保险业, J 房地产业, K 社会服务业, L 传播与文化产业, M 综合类.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 市值, 市值占净值比例. Rows include 五粮液, 华联控股, 华联矿业, 华联矿业, 华联矿业.

Table with columns: 债券类别, 债券市值, 市值占净值比例. Rows include 国家债券, 政策性银行金融债券, 企业债券, 央行票据, 可转债.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 市值, 市值占净值比例. Rows include 五粮液, 华联控股, 华联矿业, 华联矿业, 华联矿业.

Table with columns: 债券类别, 债券市值, 市值占净值比例. Rows include 国家债券, 政策性银行金融债券, 企业债券, 央行票据, 可转债.

(二)期末按行业分类的股票投资组合
行业分类 市值 占基金资产净值比例

Table with columns: 行业分类, 市值, 占基金资产净值比例. Rows include A 农林牧渔, B 采掘业, C 制造业, D 电力、煤气及水的生产和供应业, E 建筑业, F 交通运输、仓储业, G 信息技术业, H 批发和零售贸易, I 金融、保险业, J 房地产业, K 社会服务业, L 传播与文化产业, M 综合类.

(三)期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 市值, 市值占净值比例. Rows include 五粮液, 华联控股, 华联矿业, 华联矿业, 华联矿业.

Table with columns: 债券类别, 债券市值, 市值占净值比例. Rows include 国家债券, 政策性银行金融债券, 企业债券, 央行票据, 可转债.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 市值, 市值占净值比例. Rows include 五粮液, 华联控股, 华联矿业, 华联矿业, 华联矿业.

Table with columns: 债券类别, 债券市值, 市值占净值比例. Rows include 国家债券, 政策性银行金融债券, 企业债券, 央行票据, 可转债.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 市值, 市值占净值比例. Rows include 五粮液, 华联控股, 华联矿业, 华联矿业, 华联矿业.

Table with columns: 债券类别, 债券市值, 市值占净值比例. Rows include 国家债券, 政策性银行金融债券, 企业债券, 央行票据, 可转债.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 市值, 市值占净值比例. Rows include 五粮液, 华联控股, 华联矿业, 华联矿业, 华联矿业.

Table with columns: 债券类别, 债券市值, 市值占净值比例. Rows include 国家债券, 政策性银行金融债券, 企业债券, 央行票据, 可转债.

(六)投资组合报告附注
1.本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

Table with columns: 项目, 金额. Rows include 交易保证金, 应收利息, 待摊费用, 合计.

4.期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5.权证投资情况:本报告期内本基金无新增权证投资情况。

六、开放式基金份额变动
期初基金份额总额 1,866,384,298.39
期间基金总申购份额 109,519,623.02
期间基金总赎回份额 87,965,455.47
期末基金份额总额 1,877,938,465.94

七、备查文件目录
1.南方稳健成长证券投资基金基金合同。
2.南方稳健成长证券投资基金托管协议。
3.南方稳健成长证券投资基金2006年3季度报告原文。

存放地点:深圳市深南大道4009号投资大厦7楼
查询方式:网站: http://www.southernfund.com

南方基金管理有限公司
二零零六年十月二十七日

