

长城货币市场证券投资基金 2006年第四季度报告

一、重要提示
本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...

二、基金基本情况
基金名称:长城货币市场基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2006年5月30日

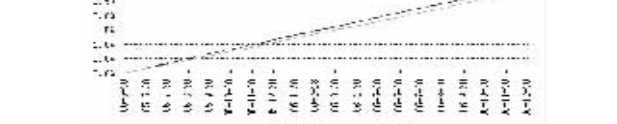
三、主要财务指标和基金净值表现
1.主要财务指标(2006年10月1日-2006年12月31日)
2.基金净值表现

Table with 2 columns: 项目, 金额. Rows include 基金本期净收益, 期末基金资产净值, etc.

注:本基金收益分配方式按日结转份额
2.长城货币市场基金本报告期净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比:

Table with 4 columns: 阶段, 基金净值增长率, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率-基金净值增长率

3.长城货币市场基金自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的历史走势对比图:



四、管理人报告
1.基金经理简介
刘海先生,生于1978年,1999年毕业于清华大学经济管理学院国际金融与财务专业...

管理(有限)公司,曾任“长城货币市场证券投资基金”基金助理,自2006年3月9日起任“长城货币市场证券投资基金”基金经理。

2.合规性说明
本报告期内,本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为,严格按照《证券投资基金法》、《长城货币市场证券投资基金合同》和其他有关法律法规的规定...

3.投资策略及业绩回顾
(1)基金业绩
2006年第四季度,本基金净值收益率为0.4612%,折算年化收益率为1.842%。

(2)市场展望
2006年四季度,宏观经济出现预期中的稳步回落,工业增加值、固定资产投资、货币供应量、信贷投放等各项经济数据增幅不同程度放缓...

本基金经理在报告期内始终将货币市场基金作为现金管理工具的本质要求,着重把握投资组合的流动性管理放在首位,积极应对了四季度内工、国寿等大蓝筹股的发行...

五、投资组合报告
1.报告期末基金资产组合
(1) 资产组合

Table with 3 columns: 资产组合, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

2.报告期末债券回购融资情况
(1) 报告期末债券回购融资情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

3.投资组合平均剩余期限基本情况
(1) 投资组合平均剩余期限基本情况

Table with 3 columns: 项目, 天数, 占基金总资产的比例(%)

4.期末投资组合平均剩余期限分布比例
(1) 投资组合平均剩余期限分布比例

Table with 4 columns: 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

5.报告期末按债券品种分类的债券投资组合
(1) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 成本(元), 占基金资产净值的比例(%)

6.报告期末按资产种类分类的债券投资组合
(1) 报告期末按资产种类分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券名称, 债券数量(元), 成本(元), 占基金资产净值的比例(%)

7.“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离
(1) 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

8.投资组合报告附注
(1) 基金资产估值方法说明
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...

(2) 基金管理人报告期内不存在报告期内小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的持仓

(3) 本报告期内需调整的证券投资决策程序
本基金的投资管理采用团队投资和基金经理负责制相结合的方式。投资团队由基金经理、固定收益研究员、交易员以及金融工程师共同构成...

(4) 其他资产的构成
(1) 其他资产的构成

Table with 2 columns: 序号, 其他资产, 金额(元)

六、开放式基金份额变动
(1) 基金份额变动

Table with 2 columns: 项目, 金额(元)

七、备查文件目录及查询方式
1.本基金设立等相关批准文件
2.《长城货币市场证券投资基金合同》
3.《长城货币市场证券投资基金托管协议》

长城久泰中信标普300指数证券投资基金 2006年第四季度报告

一、重要提示
本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...

二、基金基本情况
基金名称:长城久泰
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2004年5月21日

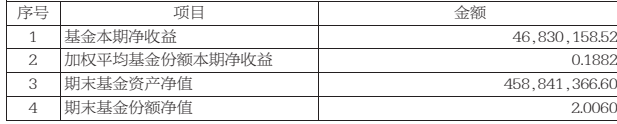
三、主要财务指标和基金净值表现
1.主要财务指标(2006年10月1日-2006年12月31日)
2.基金净值表现

Table with 2 columns: 项目, 金额. Rows include 基金本期净收益, 期末基金资产净值, etc.

注:本基金收益分配方式按日结转份额
2.长城久泰中信标普300指数基金本报告期净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比:

Table with 4 columns: 阶段, 基金净值增长率, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率-基金净值增长率

3.长城久泰中信标普300指数基金自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的历史走势对比图:



四、管理人报告
1.基金经理简介
杨建华先生,37岁,北京大学理学系理学学士,北京大学光华管理学院经济学硕士...

2.合规性说明
本报告期内,本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为,严格按照《证券投资基金法》、《长城久泰中信标普300指数证券投资基金合同》和其他有关法律法规的规定...

3.投资策略及业绩回顾
(1) 基金业绩
2006年第四季度,本基金净值收益率为45.98%,折算年化收益率为43.49%。

(2) 市场展望
2006年四季度,宏观经济出现预期中的稳步回落,工业增加值、固定资产投资、货币供应量、信贷投放等各项经济数据增幅不同程度放缓...

本基金经理在报告期内始终将货币市场基金作为现金管理工具的本质要求,着重把握投资组合的流动性管理放在首位,积极应对了四季度内工、国寿等大蓝筹股的发行...

五、投资组合报告
1.报告期末基金资产组合
(1) 资产组合

Table with 3 columns: 资产组合, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

2.报告期末债券回购融资情况
(1) 报告期末债券回购融资情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

注:本基金收益分配方式按日结转份额
2.长城久泰中信标普300指数基金本报告期净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比:

Table with 4 columns: 阶段, 基金净值增长率, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率-基金净值增长率

3.长城久泰中信标普300指数基金自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的历史走势对比图:



3.投资组合平均剩余期限基本情况
(1) 投资组合平均剩余期限基本情况

Table with 3 columns: 项目, 天数, 占基金总资产的比例(%)

4.期末投资组合平均剩余期限分布比例
(1) 投资组合平均剩余期限分布比例

Table with 4 columns: 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

5.报告期末按债券品种分类的债券投资组合
(1) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 成本(元), 占基金资产净值的比例(%)

6.报告期末按资产种类分类的债券投资组合
(1) 报告期末按资产种类分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券名称, 债券数量(元), 成本(元), 占基金资产净值的比例(%)

7.“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离
(1) 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

Table with 2 columns: 项目, 偏离情况

八、备查文件目录及查询方式
1.本基金设立等相关批准文件
2.《长城久泰中信标普300指数证券投资基金合同》
3.《长城久泰中信标普300指数证券投资基金托管协议》

九、重要提示
本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...

二、基金基本情况
基金名称:久富证券
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2006年10月1日

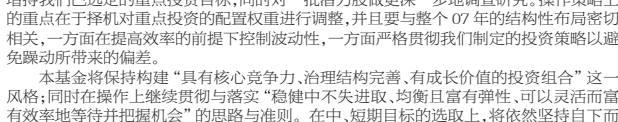
三、主要财务指标和基金净值表现
1.主要财务指标(2006年10月1日-2006年12月31日)
2.基金净值表现

Table with 2 columns: 项目, 金额. Rows include 基金本期净收益, 期末基金资产净值, etc.

注:本基金收益分配方式按日结转份额
2.久富证券本报告期净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比:

Table with 4 columns: 阶段, 基金净值增长率, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率-基金净值增长率

3.久富证券本报告期净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:



四、管理人报告
1.基金经理简介
项志祥先生,生于1969年,哈尔滨工业大学计算机工程及其应用系工学学士...

2.合规性说明
本报告期内,本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为,严格按照《证券投资基金法》、《久富证券投资基金合同》和其他有关法律法规的规定...

3.投资组合平均剩余期限基本情况
(1) 投资组合平均剩余期限基本情况

Table with 3 columns: 项目, 天数, 占基金总资产的比例(%)

4.期末投资组合平均剩余期限分布比例
(1) 投资组合平均剩余期限分布比例

Table with 4 columns: 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

5.报告期末按债券品种分类的债券投资组合
(1) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 成本(元), 占基金资产净值的比例(%)

6.报告期末按资产种类分类的债券投资组合
(1) 报告期末按资产种类分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券名称, 债券数量(元), 成本(元), 占基金资产净值的比例(%)

7.“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离
(1) 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

Table with 2 columns: 项目, 偏离情况

八、备查文件目录及查询方式
1.本基金设立等相关批准文件
2.《久富证券投资基金合同》
3.《久富证券投资基金托管协议》

九、重要提示
本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...

二、基金基本情况
基金名称:久富证券
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2006年10月1日

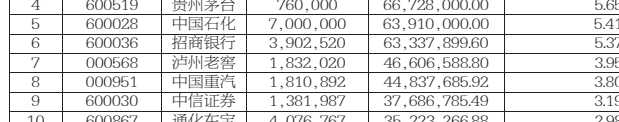
三、主要财务指标和基金净值表现
1.主要财务指标(2006年10月1日-2006年12月31日)
2.基金净值表现

Table with 2 columns: 项目, 金额. Rows include 基金本期净收益, 期末基金资产净值, etc.

注:本基金收益分配方式按日结转份额
2.久富证券本报告期净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比:

Table with 4 columns: 阶段, 基金净值增长率, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率-基金净值增长率

3.久富证券本报告期净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:



四、管理人报告
1.基金经理简介
项志祥先生,生于1969年,哈尔滨工业大学计算机工程及其应用系工学学士...

2.合规性说明
本报告期内,本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为,严格按照《证券投资基金法》、《久富证券投资基金合同》和其他有关法律法规的规定...

3.投资组合平均剩余期限基本情况
(1) 投资组合平均剩余期限基本情况

Table with 3 columns: 项目, 天数, 占基金总资产的比例(%)

4.期末投资组合平均剩余期限分布比例
(1) 投资组合平均剩余期限分布比例

Table with 4 columns: 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

5.报告期末按债券品种分类的债券投资组合
(1) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 成本(元), 占基金资产净值的比例(%)

6.报告期末按资产种类分类的债券投资组合
(1) 报告期末按资产种类分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券名称, 债券数量(元), 成本(元), 占基金资产净值的比例(%)

7.“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离
(1) 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

Table with 2 columns: 项目, 偏离情况

八、备查文件目录及查询方式
1.本基金设立等相关批准文件
2.《久富证券投资基金合同》
3.《久富证券投资基金托管协议》

九、重要提示
本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...

二、基金基本情况
基金名称:久富证券
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2006年10月1日

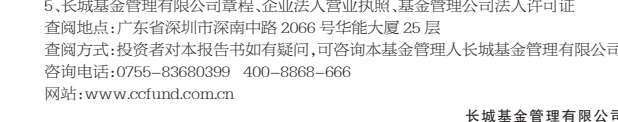
三、主要财务指标和基金净值表现
1.主要财务指标(2006年10月1日-2006年12月31日)
2.基金净值表现

Table with 2 columns: 项目, 金额. Rows include 基金本期净收益, 期末基金资产净值, etc.

注:本基金收益分配方式按日结转份额
2.久富证券本报告期净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比:

Table with 4 columns: 阶段, 基金净值增长率, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率-基金净值增长率

3.久富证券本报告期净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:



四、管理人报告
1.基金经理简介
项志祥先生,生于1969年,哈尔滨工业大学计算机工程及其应用系工学学士...

2.合规性说明
本报告期内,本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为,严格按照《证券投资基金法》、《久富证券投资基金合同》和其他有关法律法规的规定...