

博时裕富证券投资基金 2006年第四季度报告

2006年第4号

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、基金产品概况

基金名称:博时裕富 基金运作方式:契约型、开放式 基金合同生效日:2003年8月26日

三、主要财务指标和基金净值表现

本报告期主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额. Rows include 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末基金资产净值, 期末基金份额净值.

注: 1. 上述财务指标采用的计算公式, 详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则第1号《主要财务指标的计算及披露》...

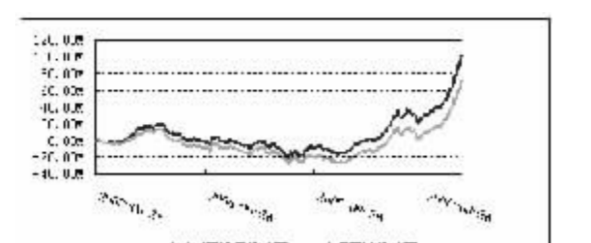


图1: 基金资产净值及基金份额净值变动情况

3. 本基金业绩比较基准的构建以及再平衡过程 本基金的业绩比较基准为新华富时A200指数由新华富时指数公司构建和发布...

四、管理人报告

陈亮先生, 硕士, 1996年毕业于北京中国地质大学, 获得工学学士学位, 1999年毕业于中国人民大学国民经济学系...

(一) 报告期内基金的投资策略和业绩表现

博时裕富为指数型基金 博时裕富为指数型基金, 其核心任务是有效地跟踪指数, 也就是严格地将跟踪误差控制在合同规定的4%之内...

五、投资组合报告

(一) 报告期末基金资产组合

Table with 3 columns: 资产组合, 金额(元), 占基金总资产的比例. Rows include 股票投资, 债券投资, 权益投资, 银行存款和清算备付金合计, 其他资产, 合计.

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 序号, 行业, 股票市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 农林、牧、渔, 采掘业, 制造业, etc.

(三) 报告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 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 股票数量, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例. Rows include 600036 招商银行, 600000 中信银行, etc.

(四) 报告期末按券种分类的债券投资组合

本基金截至2006年12月31日止无债券投资。

(五) 投资组合报告附注

1. 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚;

Table with 3 columns: 序号, 其他资产, 金额(元). Rows include 交易保证金, 应收证券清算款, etc.

4. 本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券; 5. 本基金报告期末未持有支持证券;

七、基金份额变动

Table with 3 columns: 序号, 项目, 份额(份). Rows include 报告期末基金份额总额, 报告期基金份额总额, etc.

八、备查文件目录

- 1. 中国证监会基金监管部批准博时裕富证券投资基金设立的文件; 2. 《博时裕富证券投资基金基金合同》...

本基金管理人: 博时基金管理有限公司 2007年1月19日

博时精选股票证券投资基金 2006年第四季度报告

2006年第4号

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, 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...

二、基金产品概况

基金名称:博时精选 基金运作方式:契约型、开放式 基金合同生效日:2004年6月22日

三、主要财务指标和基金净值表现

本报告期主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额. Rows include 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末基金资产净值, 期末基金份额净值.

注: 1. 上述财务指标采用的计算公式, 详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则第1号《主要财务指标的计算及披露》...

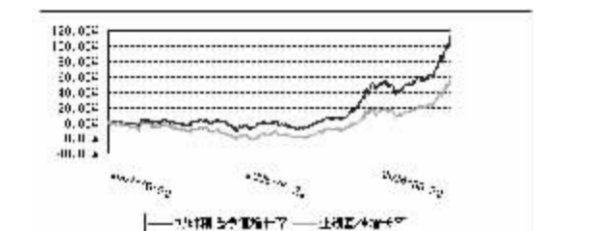


图1: 基金资产净值及基金份额净值变动情况

2. 本基金业绩比较基准的构建以及再平衡过程 本基金的业绩比较基准为: 75% × 新华富时中国A600指数 + 20% × 新华富时中国国债指数 + 5% × 现金收益率。

四、管理人报告

余洋先生, 1975年出生, 经济学硕士。2001年毕业于北京大学光华管理学院, 获经济学硕士学位。2001年至2002年任职于西南证券公司证券投资部...

(一) 报告期内基金的投资策略和业绩表现

市场在经历了第三季度的调整后, 第四季度走出了极强的上涨行情, 上证指数从1752点一路上涨到2075点, 涨幅高达53%, 且中途并未出现明显的调整。

报告期内, 流动性是主导整个市场走势的最主要因素。在流动性的推动下, 大盘蓝筹股在沉寂了大半年之后突然发力, 以银行、石化、钢铁等行业的大市值股票为主要代表...

报告期内, 我们的操作策略遵循了我们三季报中对市场的判断和组合调整策略, 继续减持了军工股、券商概念股, 以及一些低市值的消费类成长股...

为在经历了06年第四季度的大幅上涨之后, 市场需要经历一次充分的调整, 这次调整有可能在1季度完成。在股票配置的调整上, 我们继续维持较为平衡的配置...

五、投资组合报告

(一) 本报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例. Rows include 股票投资, 债券投资, 权益投资, etc.

(二) 本报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 序号, 行业, 股票市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 农林、牧、渔, 采掘业, 制造业, etc.

(三) 本报告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 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 股票数量, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例. Rows include 600000 浦发银行, 600036 招商银行, etc.

(四) 报告期末按券种分类的债券投资组合

本基金截至2006年12月31日止无债券投资。

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 股票数量, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例. Rows include 600000 浦发银行, 600036 招商银行, etc.

(五) 报告期末前五名债券明细

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 期末市值(元). Rows include 040201 04国债(01), etc.

(六) 投资组合报告附注

1. 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚;

Table with 3 columns: 序号, 项目, 份额(份). Rows include 报告期末基金份额总额, 报告期基金份额总额, etc.

七、备查文件目录

- 1. 中国证监会批准博时精选股票证券投资基金设立的文件; 2. 《博时精选股票证券投资基金基金合同》...

本基金管理人: 博时基金管理有限公司 2007年1月19日

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金 2006年第四季度报告

东吴基金管理有限公司 2006年4号

一、重要提示

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)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、基金产品概况

基金名称:东吴嘉禾 基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日:2006年2月1日

三、主要财务指标和基金净值表现

本报告期主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额. Rows include 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末基金资产净值, 期末基金份额净值.

注: 1. 上述财务指标采用的计算公式, 详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则第1号《主要财务指标的计算及披露》...

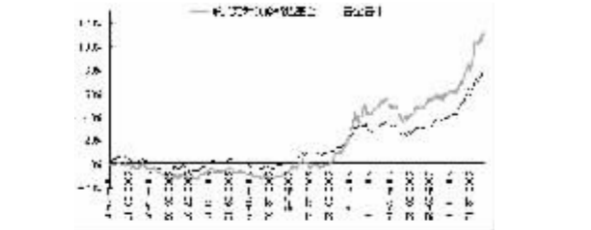


图1: 基金资产净值及基金份额净值变动情况

注: 东吴嘉禾基金从2006年2月2日起正式运作。 四、管理人报告 本基金管理人 曹晓波先生, 双学士, 曾任申银万国证券公司投资银行部项目经理, 平安保险资产管理中心基金研究员, 东吴证券有限公司投资总监助理...

(一) 报告期内基金的投资策略和业绩表现

6月4季度, 在股指期货政策预期下, 我们认为市场热点将会呈现两条主线: 一是对未来通胀预期较大的指标股将成为资金追捧的主要目标; 二是今年以来一直被市场冷落的钢铁、造纸、煤炭和交通运输等成长性较低但估值也很低的品种会有一次明显的补涨机会。

基于上述判断, 我们在继续坚持银行、地产和消费等长线主流品种的同时, 对石化、交通、电网等行业进行了加仓, 收到了较好的收益; 但考虑到宏观调控政策的影响, 我们减持了钢铁、煤炭和交通运输, 错过了这些板块4季度非常可观的获利机会...

我们认为未来市场空间的提升将主要来自估值水平的提升上, 市场将逐步摆脱长期熊市背景下形成的低市盈率或低市净率的防御型理念, 转向更高的P/E、P/B或PEG的进攻型估值模式。

我们判断为估值模式的变革本质上是我国新兴证券市场向传统估值模式的一场革命, 07年将成为33年革命的第4年, 革命的过程可能会引发市场反复的振荡, 但最终的结局将会以新估值模式的胜利而告终, 对我们的影响除了进一步打开上升空间以外, 对奠定我国证券市场的自主定价权也将起到决定性的作用, 因此我们认为07年将是我国证券市场开

五、投资组合报告

(一) 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 项目名称, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 股票, 债券, 权益投资, etc.

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 分类, 股票市值, 占基金资产净值比例. Rows include 农林、牧、渔, 采掘业, 制造业, etc.

(三) 报告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 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量, 期末市值, 市值占基金资产净值比例. Rows include 600036 招商银行, 600083 金地集团, etc.

(四) 报告期末按券种分类的债券投资组合

本基金截至2006年12月31日止无债券投资。

Table with 3 columns: 序号, 其他资产, 金额(元). Rows include 交易保证金, 应收利息, etc.

六、开放式基金份额变动

Table with 3 columns: 项目, 份额(份). Rows include 合同生效日的基金份额总额, 报告期基金份额总额, etc.

七、备查文件目录

- 1. 中国证监会批准东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金设立的文件; 2. 《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金合同》...

本基金管理人: 东吴基金管理有限公司 2007年1月19日