

天元证券投资基金 2006年第四季度报告

一、重要提示
基金管理人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预示其未来表现。

二、基金产品概况
基金简称：基金天元
基金运作方式：契约型封闭式
基金合同生效日：1999年8月26日

三、主要财务指标和基金净值表现
(一)主要财务指标
基金本期净收益 514,920,678.30
基金本期基金份额净值收益 0.1716

四、管理人报告
(一)基金管理团队
陈健男，1977年生，中共党员，中国人民银行研究生班毕业，经济学硕士。

(二)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》等有关法律法规及各项实施准则。

(三)基金的投资策略和业绩表现说明
报告期内，本基金管理人根据对宏观经济形势、政策取向、利率走势、通胀预期、国内需求增长有所放缓、出口增速也出现了下降，但随后随工业增加值和固定资产投资数据都出现小幅反弹。

(四)基金投资组合报告
(一)期末基金资产组合情况
项目 金额 占基金总资产的比例
股票 5,279,769,362.09 73.65%

Table with 4 columns: Item, Amount, Proportion of Total Assets, Proportion of Net Assets. Rows include Stocks, Bonds, Derivatives, Cash, etc.

(二)期末按行业分类的股票投资组合
A 农林牧渔业 147,580,096.28 2.22%

(三)期末按市值占基金总资产比例大小排序的前十名股票明细
序号 股票代码 股票名称 数量 市值 市值占净值比例
1 000002 万科A 36,173,784 510,568,438.48 7.70%

(四)期末按券种分类的债券投资组合
债券类别 债券市值 市值占净值比例
国家债券 718,039,561.20 10.82%

(五)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。

六、管理人持有本基金的情况
截止2006年12月31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10,000,000.00单位，占基金总份额的0.33%。

七、备查文件目录
1.《天元证券投资基金基金合同》。
2.《天元证券投资基金托管协议》。

八、基金管理人及基金托管人
基金管理人：南方基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

九、其他重要事项
(一)基金管理人公告
自一凡先生，基金经理，1970年出生，经济学硕士，9年证券从业经历。

(二)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》等有关法律法规及各项实施准则。

(三)基金的投资策略和业绩表现说明
报告期内，本基金管理人根据对宏观经济形势、政策取向、利率走势、通胀预期、国内需求增长有所放缓、出口增速也出现了下降，但随后随工业增加值和固定资产投资数据都出现小幅反弹。

(四)基金投资组合报告
(一)期末基金资产组合情况
项目 金额 占基金总资产的比例
股票 7,770,764,838.05 69.78%

Table with 4 columns: Item, Amount, Proportion of Total Assets, Proportion of Net Assets. Rows include Stocks, Bonds, Derivatives, Cash, etc.

(二)期末按行业分类的股票投资组合
A 农林牧渔业 147,580,096.28 1.91%

(三)期末按市值占基金总资产比例大小排序的前十名股票明细
序号 股票代码 股票名称 数量 市值 市值占净值比例
1 000002 万科A 36,173,784 510,568,438.48 6.58%

(二)期末按行业分类的股票投资组合
A 农林牧渔业 147,580,096.28 2.22%

(三)期末按市值占基金总资产比例大小排序的前十名股票明细
序号 股票代码 股票名称 数量 市值 市值占净值比例
1 000002 万科A 36,173,784 510,568,438.48 7.70%

(四)期末按券种分类的债券投资组合
债券类别 债券市值 市值占净值比例
国家债券 718,039,561.20 10.82%

(五)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。

六、管理人持有本基金的情况
截止2006年12月31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10,000,000.00单位，占基金总份额的0.33%。

七、备查文件目录
1.《天元证券投资基金基金合同》。
2.《天元证券投资基金托管协议》。

八、基金管理人及基金托管人
基金管理人：南方基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

九、其他重要事项
(一)基金管理人公告
自一凡先生，基金经理，1970年出生，经济学硕士，9年证券从业经历。

(二)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》等有关法律法规及各项实施准则。

(三)基金的投资策略和业绩表现说明
报告期内，本基金管理人根据对宏观经济形势、政策取向、利率走势、通胀预期、国内需求增长有所放缓、出口增速也出现了下降，但随后随工业增加值和固定资产投资数据都出现小幅反弹。

(四)基金投资组合报告
(一)期末基金资产组合情况
项目 金额 占基金总资产的比例
股票 7,770,764,838.05 69.78%

Table with 4 columns: Item, Amount, Proportion of Total Assets, Proportion of Net Assets. Rows include Stocks, Bonds, Derivatives, Cash, etc.

(二)期末按行业分类的股票投资组合
A 农林牧渔业 147,580,096.28 1.91%

(三)期末按市值占基金总资产比例大小排序的前十名股票明细
序号 股票代码 股票名称 数量 市值 市值占净值比例
1 000002 万科A 36,173,784 510,568,438.48 6.58%

(四)期末按券种分类的债券投资组合
债券类别 债券市值 市值占净值比例
国家债券 718,039,561.20 9.15%

(五)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。

六、管理人持有本基金的情况
截止2006年12月31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10,000,000.00单位，占基金总份额的0.33%。

七、备查文件目录
1.《天元证券投资基金基金合同》。
2.《天元证券投资基金托管协议》。

八、基金管理人及基金托管人
基金管理人：南方基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

九、其他重要事项
(一)基金管理人公告
自一凡先生，基金经理，1970年出生，经济学硕士，9年证券从业经历。

(二)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》等有关法律法规及各项实施准则。

(三)基金的投资策略和业绩表现说明
报告期内，本基金管理人根据对宏观经济形势、政策取向、利率走势、通胀预期、国内需求增长有所放缓、出口增速也出现了下降，但随后随工业增加值和固定资产投资数据都出现小幅反弹。

(四)基金投资组合报告
(一)期末基金资产组合情况
项目 金额 占基金总资产的比例
股票 7,770,764,838.05 69.78%

Table with 4 columns: Item, Amount, Proportion of Total Assets, Proportion of Net Assets. Rows include Stocks, Bonds, Derivatives, Cash, etc.

金元证券投资基金 2006年第四季度报告

一、重要提示
基金管理人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预示其未来表现。

二、基金产品概况
基金简称：基金开元
基金运作方式：契约型封闭式
基金合同生效日：1992年5月28日

三、主要财务指标和基金净值表现
(一)主要财务指标
基金本期净收益 56,382,701.70
基金本期基金份额净值收益 0.1128

四、管理人报告
(一)基金管理团队
王敏刚先生，CFA，基金经理，1975年出生，经济学硕士，7年基金从业经历。

(二)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》等有关法律法规及各项实施准则。

(三)基金的投资策略和业绩表现说明
从最新的宏观经济数据与上市公司三季报来看，经济景气度仍然处于高位，投资、进出口和消费三大引擎在今年前9个月均保持10%以上的增长速度。

(四)基金投资组合报告
(一)期末基金资产组合情况
项目 金额 占基金总资产的比例
股票 910,843,577.39 71.83%

Table with 4 columns: Item, Amount, Proportion of Total Assets, Proportion of Net Assets. Rows include Stocks, Bonds, Derivatives, Cash, etc.

(二)期末按行业分类的股票投资组合
A 农林牧渔业 256,656,600.00 3.85%

(三)期末按市值占基金总资产比例大小排序的前五名股票明细
序号 股票代码 股票名称 数量 市值 市值占净值比例
1 200004 万科B 256,656,600.00 3.85%

(四)期末按券种分类的债券投资组合
债券类别 债券市值 市值占净值比例
政策性银行金融债券 622,603,583.77 9.39%

(五)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。

六、管理人持有本基金的情况
截止2006年12月31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24,276,307.00单位，占基金总份额的4.86%。

七、备查文件目录
1.《开元证券投资基金基金合同》。
2.《开元证券投资基金托管协议》。

八、基金管理人及基金托管人
基金管理人：南方基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

九、其他重要事项
(一)基金管理人公告
王敏刚先生，CFA，基金经理，1975年出生，经济学硕士，7年基金从业经历。

(二)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》等有关法律法规及各项实施准则。

(三)基金的投资策略和业绩表现说明
从最新的宏观经济数据与上市公司三季报来看，经济景气度仍然处于高位，投资、进出口和消费三大引擎在今年前9个月均保持10%以上的增长速度。

(四)基金投资组合报告
(一)期末基金资产组合情况
项目 金额 占基金总资产的比例
股票 910,843,577.39 71.83%

Table with 4 columns: Item, Amount, Proportion of Total Assets, Proportion of Net Assets. Rows include Stocks, Bonds, Derivatives, Cash, etc.

(二)期末按行业分类的股票投资组合
A 农林牧渔业 256,656,600.00 3.85%

(三)期末按市值占基金总资产比例大小排序的前五名股票明细
序号 股票代码 股票名称 数量 市值 市值占净值比例
1 200004 万科B 256,656,600.00 3.85%

(二)期末按行业分类的股票投资组合
A 农林牧渔业 34,694,000.00 3.01%

(三)期末按市值占基金总资产比例大小排序的前十名股票明细
序号 股票代码 股票名称 数量 市值 市值占净值比例
1 000025 宝钢不锈 8,828,000 112,821,840.00 9.80%

(四)期末按券种分类的债券投资组合
债券类别 债券市值 市值占净值比例
国家债券 170,434,329.20 14.80%

(五)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。

六、管理人持有本基金的情况
截止2006年12月31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24,276,307.00单位，占基金总份额的4.86%。

七、备查文件目录
1.《开元证券投资基金基金合同》。
2.《开元证券投资基金托管协议》。

八、基金管理人及基金托管人
基金管理人：南方基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

九、其他重要事项
(一)基金管理人公告
王敏刚先生，CFA，基金经理，1975年出生，经济学硕士，7年基金从业经历。

(二)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》等有关法律法规及各项实施准则。

(三)基金的投资策略和业绩表现说明
从最新的宏观经济数据与上市公司三季报来看，经济景气度仍然处于高位，投资、进出口和消费三大引擎在今年前9个月均保持10%以上的增长速度。

(四)基金投资组合报告
(一)期末基金资产组合情况
项目 金额 占基金总资产的比例
股票 910,843,577.39 71.83%

Table with 4 columns: Item, Amount, Proportion of Total Assets, Proportion of Net Assets. Rows include Stocks, Bonds, Derivatives, Cash, etc.

(二)期末按行业分类的股票投资组合
A 农林牧渔业 256,656,600.00 3.85%

(三)期末按市值占基金总资产比例大小排序的前五名股票明细
序号 股票代码 股票名称 数量 市值 市值占净值比例
1 200004 万科B 256,656,600.00 3.85%

(四)期末按券种分类的债券投资组合
债券类别 债券市值 市值占净值比例
政策性银行金融债券 622,603,583.77 9.39%

(五)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。

六、管理人持有本基金的情况
截止2006年12月31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24,276,307.00单位，占基金总份额的4.86%。

七、备查文件目录
1.《开元证券投资基金基金合同》。
2.《开元证券投资基金托管协议》。

八、基金管理人及基金托管人
基金管理人：南方基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

九、其他重要事项
(一)基金管理人公告
王敏刚先生，CFA，基金经理，1975年出生，经济学硕士，7年基金从业经历。

(二)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》等有关法律法规及各项实施准则。

(三)基金的投资策略和业绩表现说明
从最新的宏观经济数据与上市公司三季报来看，经济景气度仍然处于高位，投资、进出口和消费三大引擎在今年前9个月均保持10%以上的增长速度。

(四)基金投资组合报告
(一)期末基金资产组合情况
项目 金额 占基金总资产的比例
股票 910,843,577.39 71.83%

Table with 4 columns: Item, Amount, Proportion of Total Assets, Proportion of Net Assets. Rows include Stocks, Bonds, Derivatives, Cash, etc.

开元证券投资基金 2006年第四季度报告

一、重要提示
基金管理人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预示其未来表现。

二、基金产品概况
基金简称：基金开元
基金运作方式：契约型封闭式
基金合同生效日：1992年5月28日

三、主要财务指标和基金净值表现
(一)主要财务指标
基金本期净收益 56,382,701.70
基金本期基金份额净值收益 0.1128

四、管理人报告
(一)基金管理团队
王敏刚先生，CFA，基金经理，1975年出生，经济学硕士，7年基金从业经历。

(二)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》等有关法律法规及各项实施准则。

(三)基金的投资策略和业绩表现说明
从最新的宏观经济数据与上市公司三季报来看，经济景气度仍然处于高位，投资、进出口和消费三大引擎在今年前9个月均保持10%以上的增长速度。

(四)基金投资组合报告
(一)期末基金资产组合情况
项目 金额 占基金总资产的比例
股票 910,843,577.39 71.83%

Table with 4 columns: Item, Amount, Proportion of Total Assets, Proportion of Net Assets. Rows include Stocks, Bonds, Derivatives, Cash, etc.

(二)期末按行业分类的股票投资组合
A 农林牧渔业 256,656,600.00 3.85%

(二)期末按行业分类的股票投资组合
A 农林牧渔业 34,694,000.00 3.01%

(三)期末按市值占基金总资产比例大小排序的前十名股票明细
序号 股票代码 股票名称 数量 市值 市值占净值比例
1 000025 宝钢不锈 8,828,000 112,821,840.00 9.80%

(四)期末按券种分类的债券投资组合
债券类别 债券市值 市值占净值比例
国家债券 170,434,329.20 14.80%

(五)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。

六、管理人持有本基金的情况
截止2006年12月31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24,276,307.00单位，占基金总份额的4.86%。

七、备查文件目录
1.《开元证券投资基金基金合同》。
2.《开元证券投资基金托管协议》。

八、基金管理人及基金托管人
基金管理人：南方基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

九、其他重要事项
(一)基金管理人公告
王敏刚先生，CFA，基金经理，1975年出生，经济学硕士，7年基金从业经历。

(二)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》等有关法律法规及各项实施准则。

(三)基金的投资策略和业绩表现说明
从最新的宏观经济数据与上市公司三季报来看，经济景气度仍然处于高位，投资、进出口和消费三大引擎在今年前9个月均保持10%以上的增长速度。

(四)基金投资组合报告
(一)期末基金资产组合情况
项目 金额 占基金总资产的比例
股票 910,843,577.39 71.83%

Table with 4 columns: Item, Amount, Proportion of Total Assets, Proportion of Net Assets. Rows include Stocks, Bonds, Derivatives, Cash, etc.

(二)期末按行业分类的股票投资组合
A 农林牧渔业 256,656,600.00 3.85%