

Disclosure

中信稳定双利债券型证券投资基金 2006年第四季度报告

一、重要提示
中信稳定双利债券型证券投资基金管理人—中信基金管理有限责任公司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...

2006年7月20日成立,截至本报告披露时点未满6个月,本基金仍处于建仓期。
2.本基金自成立之日起至披露时点不满一年。
四、管理人报告
(一)基金概况介绍
1.基金概况介绍
(1)基金概况介绍

基金名称:中信稳定双利债券型证券投资基金
基金简称:中信稳定双利债券基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2006年7月20日
报告期末基金资产净值:7,650,407,602.32元

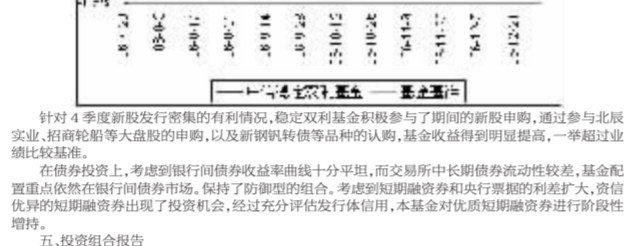
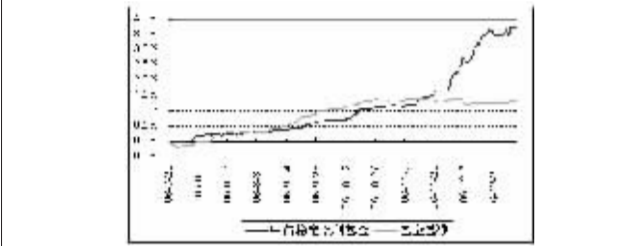
1.期末基金资产组合情况
股票 151,546,113.56 0.809
债券 1,479,316,405.86 78.96
权证 18,938,700.00 1.01
银行存款和清算备付金合计 198,217,616.85 10.58
其它资产 25,624,317.69 1.37
合计: 1,873,642,153.96 100.00

投资目标:本基金主要投资于固定收益类资产,投资目标是在确保本金安全的基础上,积极主动追求资产的长期稳定增值。
投资策略:本基金根据宏观经济运行状况、货币政策走势及利率走势的综合判断,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险等基础上,采取积极策略控制组合久期的波动范围,充分运用各种套利策略提升组合持有回报效率,实现基金的投资增值。

2.期末按行业分类的股票投资组合
行业分类 期末市值(单位:人民币元) 占基金资产净值比例%
A 农、林、牧、渔业 3,380,342.72 0.19
B 采掘业 16,660,001.40 0.91
C 制造业 51,512,228.72 2.79

中信稳定双利债券型基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较列表
阶段 净值增长率 业绩比较基准收益率 ①-③ ②-④
本报告期 3.06% 0.10% 0.31% 0.03% 2.75% 0.07%

3.报告期内基金投资回顾
(一)基金投资回顾
四季度,两市市场整体呈现震荡上行态势,大盘在前期连续调整后,在11月20日创出年内新高,随后在12月10日创出年内新高,随后在12月10日创出年内新高...



附注:1.本基金的基金合同约定:本基金的建仓期为自本基金成立之日起6个月以内。本基金于...

附注:1.本基金的基金合同约定:本基金的建仓期为自本基金成立之日起6个月以内。本基金于...

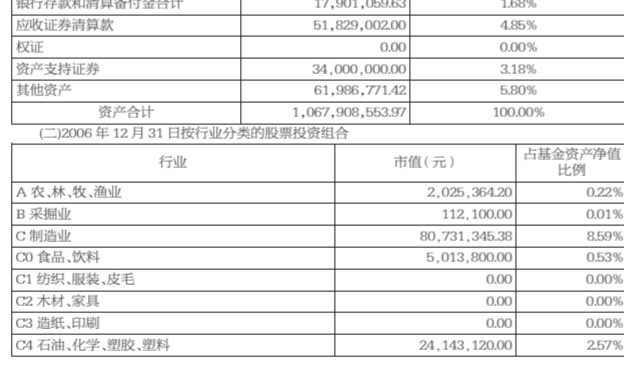
万家保本增值证券投资基金 2006年第四季度报告

一、重要提示
基金管理人、基金托管人及基金保证人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,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

(一)基金概况介绍
基金管理人:万家基金管理有限公司
基金简称:万家保本增值
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2004年9月28日
报告期末基金资产净值:810,347,382.84元

投资目标:本基金在确保保本的前提下,在严格控制风险的前提下,谋求基金资产的稳定增值。
投资策略:本基金的投资策略采用CPPI与TIPP相结合的动态调整投资组合风险控制策略。
业绩比较基准:与保本周期期限的3年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征:本基金为保本基金,为证券投资基金中的低风险投资品种。

(二)基金投资回顾
四季度,两市市场整体呈现震荡上行态势,大盘在前期连续调整后,在11月20日创出年内新高,随后在12月10日创出年内新高,随后在12月10日创出年内新高...



截至报告日本基金的各项投资比例符合法律法规和基金合同的要求。

截至报告日本基金的各项投资比例符合法律法规和基金合同的要求。

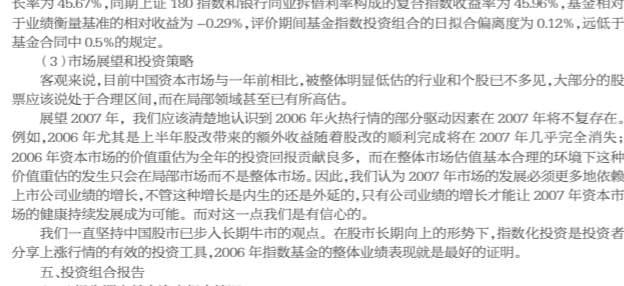
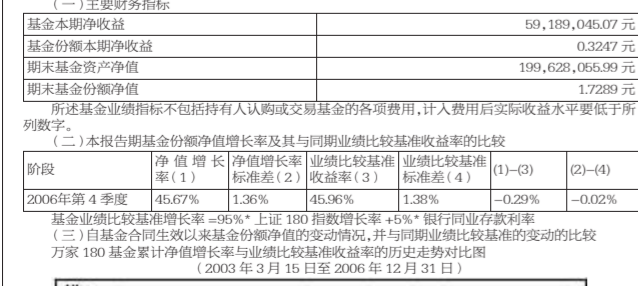
万家180指数证券投资基金 2006年第四季度报告

一、重要提示
基金管理人、基金托管人及基金保证人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,并对本报告期内内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

(一)基金概况介绍
基金管理人:万家基金管理有限公司
基金简称:万家180
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2003年3月17日
报告期末基金资产净值:115,462,260.71份

投资目标:本基金通过运用指数化投资方法,力求基金的股票组合收益率超过上证180指数的增长率。
投资策略:本基金以跟踪目标指数为策略,实现与市场同步成长为本基金。
业绩比较基准:95%*上证180指数收益率+5%*银行同业存款利率。
风险收益特征:本基金跟踪上证180指数,是一种风险适中、中长期资本收益稳健的投资产品,并具有长期稳定的投资风格。

(二)基金投资回顾
四季度,两市市场整体呈现震荡上行态势,大盘在前期连续调整后,在11月20日创出年内新高,随后在12月10日创出年内新高,随后在12月10日创出年内新高...



截至报告日本基金的各项投资比例符合法律法规和基金合同的要求。

截至报告日本基金的各项投资比例符合法律法规和基金合同的要求。

Table with 3 columns: 1.期末基金资产组合情况, 2.期末按行业分类的股票投资组合, 3.基金投资前十名股票明细.

Table with 3 columns: 债券种类, 市值(人民币元), 市值占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 资产项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 资产项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 资产项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 资产项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 资产项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 资产项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 资产项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 资产项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 资产项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 资产项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 资产项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 资产项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 资产项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 资产项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 资产项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(人民币元), 占基金资产净值比例%.

Table with 3 columns: 资产项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例%.