金鑫证券投资基金 2006年年度报告摘要

一、重要提示

（一）重要提示

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称：中国建设银行）根据本基金合同规定，于2007年3月9日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

二、基金简介

（一）基金名称：金鑫证券投资基金

基金简称：基金金鑫

交易代码：500011

基金运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：1999年10月21日

报告期末基金份额总额：3,000,000,000份

基金合同存续期：至2014年10月20日止

基金份额上市交易的证券交易所：上海证券交易所

上市日期：1999年11月26日

（二）基金产品说明

（1）投资目标：本基金是以具有良好成长性的国企股为投资重点的成长型基金；所追求的投资目标是在尽可能分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资产长期稳定增值。

（2）投资策略：本基金的投资组合由股票投资和债券投资两部分组成，其中股票投资部分主要包括稳定成长型国企股和快速成长型国企股。

稳定成长型股票的判断标准为：成长性来自于企业自身主营业务的增长潜力，具体表现为企业主营业务的行业地位和市场地位突出，主营业务的增长是公司利润长期持续增长的主要源泉，有产品、技术、销售渠道、特许权等方面的竞争优势等特点。

快速成长型股票的判断标准为：成长性来自于因企业的重大实质性变化而带来的公司业绩的高速增长潜力。本基金的快速成长国企股部分将侧重于具有资产重组题材股票的投资。

在遵循以上投资组合目标和范围的基础上，基金管理人将根据具体情况变化，适时调整投资组合。

（3）业绩比较基准：无。

（4）风险收益特征：承担中等风险，获取中等的超额收益。

（三）基金管理人

名称：国泰基金管理有限公司

信息披露负责人：丁昌海

联系电话：021-23060282

传真：021-23060283

电子邮箱：xinxipilu@gtfund.com

（四）基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司

信息披露负责人：尹东

联系电话：010-67595104

传真：010-66275830

电子邮箱：yindong@ccb.cn

（五）信息披露情况

登载半年度报告正文的管理人网址：http://www.gtfund.com

年度报告置备地点：上海市延安东路700号港泰广场22-23楼

北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

(100032-33)

三、主要财务指标、基金净值表现和收益分配情况

（一）各主要财务指标

	2006年度	2005年度	2004年度
基金本期净收益	791,560,408.76元	-346,452,113.19元	210,052,704.86元
基金份额本期净收益	0.2639元	-0.1155元	0.0700元
期末可供分配基金收益	410,449,809.94元	-261,110,598.82元	-46,623,358.50元
期末可供分配基金份额收益	0.1368元	-0.0870元	-0.0155元
期末基金资产净值	4,838,255,442.45元	2,853,730,061.55元	2,953,376,641.50元
期末基金份额净值	1.6128元	0.9512元	0.9845元
基金加权平均净值收益率	20.09%	-12.23%	6.44%
本期基金份额净值增长率	74.45%	-3.38%	-3.84%
基金份额累计净值增长率	110.88%	20.88%	25.11%

注：所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

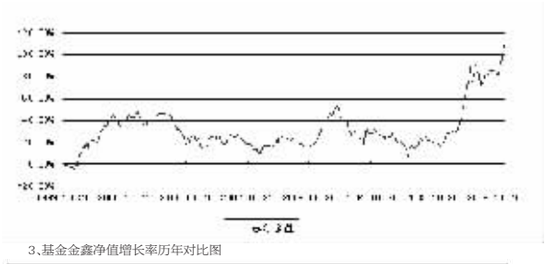
（二）基金净值表现

1、基金金鑫净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

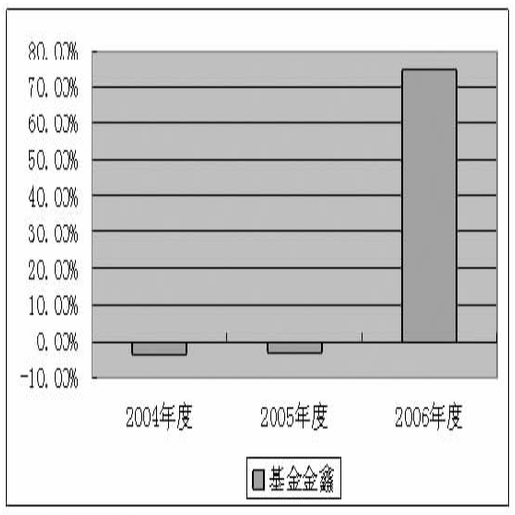
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.75%	2.15%	-	-	-	-
过去六个月	14.32%	2.34%	-	-	-	-
过去一年	74.45%	2.73%	-	-	-	-
过去三年	62.07%	2.43%	-	-	-	-
过去五年	69.97%	2.22%	-	-	-	-
自基金成立起至今	110.88%	2.21%	-	-	-	-

注：本基金根据基金合同无业绩比较基准。

2、基金金鑫累计净值增长率历史走势图



3、基金金鑫净值增长率历年对比图



（三）收益分配情况

年度	每10份基金份额分红数	备注
2006年	0.400元	
2005年	-	
2004年	0.300元	2004年度收益分配
合计	0.700元	

四、基金管理人报告

（一）基金管理人报告

1、 基金管理人介绍

国泰基金管理有限公司成立于1998年3月5日，是经中国证监会证监基字[1998]5号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为1.1亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京设有分公司。

截至2006年12月31日，本基金管理人共管理4只封闭式证券投资基金：基金金泰、基金金鑫、基金金盛、基金金鼎，以及7只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括2只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰金象保本增值混合证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金等。另外，本基金管理人于2004年获得社保基金委托资产管理人资格，目前受托管理社保基金投资组合。

2、 基金经理介绍

陈则敏，男，工学硕士，10年证券从业经历，曾任国泰证券有限公司项目经理，国泰基金管理有限公司研究开发部副经理，大成基金管理有限公司研究发展部副经理，景阳基金基金经理助理，金信证券有限公司资产管理部副总经理。2004年3月起担任金鑫基金的基金经理。

（二）基金管理合规性声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

（三）2006年证券市场与投资管理回顾

2006年中国证券市场在人民币升值和股权分置改革顺利实施的大背景下走出了波澜壮阔的行情，全年从1160点左右起步，上升到2700点附近，出乎所有人意料，充分体现出证券市场的魅力。

2006年与过去行情的最大区别就是市场很少出现普涨行情，板块和行业间阶段性差异非常大。例如上半年大盘蓝筹、交通运输类和部分周期性行业的股票被市场冷落，而在下半年大盘蓝筹、交通运输、机械、钢铁类的股票则出现较大涨幅。我们认为，这种大特征的轮换其实也是符合牛市轮动行情特征的，市场运行健康。但经过整年的单边上涨后，目前市场的估值水平已经有了明显的上升。

本基金自2005年下半年以来对投资策略进行了相应的调整，开始采用相对集中的投资策略，在06年上半年增加了进攻性行业的投资。选择良好的时机增持了有色金属、食品饮料、传媒、新能源等行业的龙头公司，同时压缩了钢铁、电力、交通运输等防御性行业的投资，取得了良好的投资效果。

下半年本基金一方面部分延续了今年以来的投资策略，继续重点配置食品饮料、传媒、商业零售等行业，另一方面也对基金投资组合进行了调整，基于人民币升值预期不断加强，增加了银行、证券、地产等行业的配置；同时基于对国际金属价格调整的担心，大幅降低了有色金属等行业的配置。另外，由于本基金第一重仓股双汇发展一直处于停牌中，对本基金当期收益率有一定影响。

（四）2007年的展望

对于2007年，我们仍然抱以乐观的预期。中国经济这一轮上升周期的动力依然强劲、国际经济环境依然良好、人民币持续升值的预期不断增强；国民经济高速增长直接带来企业盈利实实在在的大幅提高。从目前了解的情况看，06年上市公司整体业绩增长超过20%预期水平的概率很大，因此至少一季度A股市场将会延续06年的牛市格局。

但是，随着股价的不断上涨，目前上市公司的估值已明显提高。因此2007年大部分时间内市场将处于业绩持续增长和估值偏高的矛盾之中，而这种矛盾的最直接体现很可能就是指数的较大波动。

2007年本基金将以相对积极的策略进行资产配置，行业选择上继续看好扩大内需相关的消费服务类行业，包括信息传媒、金融、食品饮料、旅游等，“十一五规划”相关的装备制造业等行业以及受益于人民币升值的地产行业；适当关注航空、航运、煤炭、电力等行业。

最后，我们将在总结2006年经验教训的基础上，在有纪律的投资原则指导下，继续诚信尽责，努力工作，力争实现基金资产的长期稳定增长。

五、基金托管人报告

中国建设银行股份有限公司根据《金鑫证券投资基金基金合同》和《金鑫证券投资基金托管协议》，托管金鑫证券投资基金（以下简称基金金鑫）。

本报告期，中国建设银行股份有限公司在基金金鑫的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，依法安全保管了基金财产，按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

本报告期，按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金管理人－国泰基金管理有限公司在基金金鑫投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人。基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

由基金金鑫管理人－国泰基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

六、审计报告

本基金2006年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。

七、财务会计报告

（一）基金会计报表

1、资产负债表

资产负债表

2006年12月31日

单位：元

项目	2006年12月31日	2005年12月31日
资 产		
银行存款	649,057,525.66	31,103,498.56
清算备付金	24,619,979.88	3,987,906.44
交易保证金	1,193,291.80	885,802.28
应收证券清算款	10,546,861.36	7,212,824.15
应收利息	9,382,184.41	7,347,633.94
股票投资市值	3,783,572,553.73	2,195,693,046.46
其中：股票投资成本	2,355,842,951.75	2,080,616,021.40
债券投资市值	1,030,995,067.50	764,331,131.45
其中：债券投资成本	1,032,049,138.89	765,440,822.86
权证投资市值	14,748,612.11	873,326.72
其中：权证投资成本	13,618,510.19	-
资产总计	5,524,116,076.45	3,011,435,170.00
负债及持有人权益		
负债：		
应付证券清算款	478,364,976.51	-
应付管理人报酬	5,875,278.35	3,551,735.58
应付托管费	979,213.06	591,955.89
应付佣金	4,841,860.11	1,544,359.05
应付利息	111,884.40	22,115.36
其他应付款	2,697,421.57	2,694,942.57
卖出回购证券款	192,700,000.00	149,000,000.00
预提费用	290,000.00	300,000.00
负债合计	685,860,634.00	157,705,108.45
持有人权益：		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未实现利得	1,427,805,632.51	114,840,660.37
未分配收益	410,449,809.94	-261,110,598.82
持有人权益合计	4,838,255,442.45	2,853,730,061.55
负债及持有人权益总计	5,524,116,076.45	3,011,435,170.00

期末基金份额净值：2006年为1.6128元，2005年为0.9512元。

2、经营业绩表

经营业绩表

2006年度

单位：元

项目	2006年度	2005年度
一、收入	869,420,858.46	-295,782,102.48
1、股票差价收入	792,110,157.30	-377,693,668.63
2、债券差价收入	-4,288,664.03	-3,113,436.46
3、权证差价收入	10,708,358.68	16,144,697.93
4、债券利息收入	25,528,218.61	19,537,331.78
5、存款利息收入	1,655,626.69	848,032.80
6、股利收入	43,706,381.78	48,463,350.68
7、其他收入	779.43	31,589.42
二、费用	77,860,449.70	50,670,010.71
1、基金管理人报酬	58,520,112.63	42,556,690.88
2、基金托管费	9,753,352.04	7,092,781.80
3、卖出回购证券支出	8,755,199.09	618,360.96
4、其他费用	831,785.94	402,177.07
其中：上市年费	60,000.00	60,000.00
信息披露费	200,000.00	200,000.00
审计费用	90,000.00	100,000.00
三、基金净收益	791,560,408.76	-346,452,113.19
加：未实现利得	1,312,964,972.14	246,805,533.24
四、基金经营业绩	2,104,525,380.90	-99,646,579.95

3、基金收益分配表

基金收益分配表

2006年度

单位：元

项目	2006年度	2005年度
本期基金净收益	791,560,408.76	-346,452,113.19
加：期初基金净收益	-261,110,598.82	85,341,514.37
加：本期损益平准金	-	-
可供分配基金净收益	530,449,809.94	-261,110,598.82
减：本期已分配基金净收益	120,000,000.00	-
期末基金净收益	410,449,809.94	-261,110,598.82

4、基金净值变动表

基金净值变动表

2006年度

单位：元

项目	2006年度	2005年度
一、期初基金净值	2,853,730,061.55	2,953,376,641.50
二、本期经营活动：		
基金净收益	791,560,408.76	-346,452,113.19
未实现利得	1,312,964,972.14	246,805,533.24
经营活动产生的基金净值变动数	2,104,525,380.90	-99,646,579.95
三、本期基金份额交易：		
基金申购款	-	-
基金赎回款	-	-
基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-
四、本期向持有人分配收益：		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	-120,000,000.00	-
五、期末基金净值	4,838,255,442.45	2,853,730,061.55

（二）基金会计报表附注

1、主要会计政策、会计估计及其变更

本基金年度会计报表所采用的会计政策、会计估计除下述变更外与上年度会计报表相一致。

(1)基金资产的估值原则变更为：

权证投资，从获赠确认日、买入成交日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出成交日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易均价估值；未上市交易的权证投资(包括配股权证)按公允价估值。

(2)证券投资基金成本计价方法变更为：

① 债券投资：认购新发行的分离交易可转债于成交日先按支付的全部价款确认为债券投资，后于权证实际取得日按权证投资中所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

② 权证投资：因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本。

2、关联方关系及关联方交易

(1) 关联方关系

关联方名称	关联关系
国泰基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
上海国有资产经营有限公司	基金管理人的股东
国泰君安证券股份有限公司	基金发起人、基金管理人的股东
上海爱建信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
浙江省国际信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
万联证券有限责任公司	基金管理人的股东
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
上海仪电控股（集团）公司	基金管理人的股东

注：经中国证监会证监基金字[2006]4号文批准，本基金管理人股东浙江省国际信托投资有限责任公司将其所持有的本公司20%股权全部转让给万联证券有限责任公司，2006年1月13日本基金管理人及时进行了公告，工商变更登记手续已经办理完毕。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 通过关联方席位进行的交易（单位：元）

	2006年				2005年			
	股票投资		债券投资		股票投资		债券投资	
	成交金额	比例	成交金额	比例	成交金额	比例	成交金额	比例
国泰君安	4,071,991,301.91	24.52%	20,297,180.08	4.00%	1,481,112,759.71	20.96%	105,297,487.50	34.14%

	2006年				2005年			
	债券回购		交易佣金		债券回购		交易佣金	
	成交金额	比例	金额	比例	成交金额	比例	金额	比例
国泰君安	1,872,000,000.00	21.42%	3,290,632.79	24.56%	270,000,000.00	21.95%	1,205,218.85	21.06%

注：根据本基金管理人与关联方签订的席位租赁协议，对关联方席位发生的交易佣金计算方式等同于其他证券公司，该佣金比例达到了关联方在席位租赁期内为本基金提供证券综合研究和信息服务相对应的水平。

(3) 与关联方进行银行间同业市场的债券及回购交易（单位：元）

	2006年			2005年		
	债券投资	债券回购		债券投资	债券回购	
	成交金额	成交金额	利息支出	成交金额	成交金额	利息支出
中国建设银行	-	387,000,000.00	1,316,446.58	-	110,020,000.00	99,855.93

(4) 基金管理人报酬

①基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。本基金成立三个月后，若持有现金的比例超过本基金资产净值20%，超出部分不计提管理费。计算方法如下：

H＝E×1.5%／当年天数

H 为每日应支付的管理费

E 为前一日的基金资产净值

②基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；并于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

③在本报告期内，基金应支付基金管理人管理费共58,520,112.63元，其中已支付基金管理人52,644,834.28元，尚余5,875,278.35元未支付。2005年度共计提管理费42,556,690.88元，已全部支付。

(5) 基金托管费

①基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.25%／当年天数

H 为每日应支付的托管费

E 为前一日的基金资产净值

②基金托管人的托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；并于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

③在本报告期内，基金应支付基金托管人托管费共9,753,352.04元，其中已支付基金托管人8,774,138.98元，尚余979,213.06元未支付。2005年度共计提托管费7,092,781.80元，已全部支付。

(6) 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，并按银行间同业存款利率计息。基金托管人于2006年12月31日保管的银行存款余额为649,057,525.66元(2005年：31,103,498.56元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为1,453,815.36元(2005年：766,198.45元)。

(7) 各关联方投资本基金情况

①本基金管理人本报告期末及2005年12月31日持有本基金的情况

	2006年12月31日		2005年12月31日	
	持有基金份额	占总份额比例	持有基金份额	占总份额比例
国泰基金管理有限公司	7,500,000份	0.25%	7,500,000份	0.25%

截止本报告期末，本基金管理人持有的基金份额系本基金发行时本基金管理人作为基金发起人认购的份额。报告期内所持有的基金份额无变动。

②本基金管理人主要股东及其控制的机构在本报告期末及2005年12月31日持有本基金情况如下：

	2006年12月31日		2005年12月31日	
	持有基金份额	占总份额比例	持有基金份额	占总份额比例
浙江省国际信托投资有限公司	7,499,900份	0.25%	7,500,000份	0.25%
上海爱建信托投资有限责任公司	7,500,000份	0.25%	7,500,000份	0.25%
国泰君安证券股份有限公司	6,128,400份	0.20%	6,128,400份	0.20%

3、流通转让受限制的基金资产

(1) 流通转让受限制的股票

①截至2006年12月31日止基金持有的流通转让受限制的股票资产明细如下：

A、因股权分置改革协商阶段或实施阶段而停牌：

股票代码	股票名称	停牌日期	期末估值单价(元)	复牌日期	复牌开盘单价(元)	数量(股)	期末成本总额(元)	期末估值总额(元)
方案沟通协调阶段停牌：								
600211	S藏药业	06/12/25	17.20	07/01/08	17.62	3,762,472	26,465,392.00	64,714,518.40
方案实施阶段停牌：								
600258	S首旅	06/12/21	18.88	07/01/18	18.80	3,805,201	58,669,492.11	71,842,194.88
000895	S双汇	06/06/01	31.02	-	-	17,226,755	197,900,256.21	534,373,940.10
600158	S中体产	06/12/15	16.48	07/02/01	16.90	3,462,252	53,355,582.15	57,057,912.96
000504	S赛迪	06/12/14	5.78	07/01/15	5.36	4,219,886	25,224,751.19	24,390,941.08
合 计							361,615,473.66	752,379,507.42

B、因新股配售或增发流通受限：

序号	股票名称	配售日期	可流通日	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)	备注
1	中国银行	2006-6-28	2007-1-5	424,413	1,307,192.04	2,236,656.51	网下申购
2	大秦铁路	2006-7-26	2007-2-1	1,240,200	6,138,990.00	10,033,218.00	网下申购
3	北辰实业	2006-9-28	2007-1-16	1,941,381	4,659,314.40	13,084,907.94	网下申购
4	日照港	2006-9-28	2007-1-18	222,034	1,043,559.80	1,594,204.12	网下申购
5	工商银行	2006-10-23	2007-1-29	14,021,000	43,745,520.00	84,546,630.00	网下申购
6	金螳螂	2006-11-6	2007-2-26	36,846	471,628.80	887,251.68	网下申购
7	青岛金王	2006-12-6	2007-3-15	55,377	425,849.13	658,986.30	网下申购
8	网盛科技	2006-12-6	2007-3-15	17,772	250,407.48	992,388.48	网下申购
9	广深铁路	2006-12-18	2007-3-22	2,818,000	10,595,680.00	20,205,060.00	网下申购
10	中国人寿	2006-12-28	2007-4-9	441,000	8,326,080.00	8,326,080.00	网下申购
11	中国人寿	2006-12-28	2007-1-9	60,000	1,132,800.00	1,132,800.00	网上申购
	合计				78,097,021.65	143,698,183.03	

②估值方法

上述A类股票已上市，但本基金持有的部分因股权分置改革协商阶段或实施阶段而停牌。在编制本报表时，根据有关规定，在2006年12月31日按“停牌前估价”进行估值。

上述B类股票中，“中国人寿”为网上、网下中签未上市新股，在编制本报表时，根据有关规定，在2006年12月31日按成本价估值。“中国银行”、“大秦铁路”、“北辰实业”、“日照港”、“工商银行”、“金螳螂”、“青岛金王”、“网盛科技”、“广深铁路”为网下申购新股，9只股票均已上市，但本基金持有部分未流通。在编制本报表时，根据有关规定，在2006年12月31日按市场均价进行估值。

③流通受限期限及原因

上述A类股票截至2006年12月31日因股权分置改革而暂时停牌，这些股票将在上市公司完成与流通股股东的沟通协商程序后或在股权分置改革规定的程序结束后复牌。

上述B类股票为基金网上申购和网下申购中签的新股。“中国人寿”网上申购部分于2007年1月9日上市。网下部分除“中国人寿”、“广深铁路”外，其他8只股票均已上市流通。“中国人寿”和“广深铁路”的受限期限均为三个月。

(2) 流通转让受限制的债券

① 本基金截至2006年12月31日止从事证券交易所债券回购交易形成的卖出回购证券款余额70,000,000.00元(2005年：50,000,000.00元)，于2007年1月4日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

② 本基金截至2006年12月31日止从事银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券款余额122,700,000.00元(2005年：99,000,000.00元)，系以如下债券作为抵押：

债券名称	回购到期日	期末估价(元)	数量(张)	期末成本总额(元)
01国开07	2007-01-10	101.40	400,000	40,560,100.00
01国开21	2007-01-10	115.00	200,000	23,000,000.00
04国开20	2007-01-10	101.59	400,000	40,636,100.00
06国开02	2007-01-10	100.47	350,000	35,164,587.50

八、基金投资组合报告

（一）基金资产组合情况

分 类	市 值（元）	占总资产比例
股票	3,783,572,553.73	68.49%
债券	1,030,995,067.50	18.66%
权证	14,748,612.11	0.27%
银行存款和清算备付金	673,677,505.54	12.20%
其他资产	21,122,337.57	0.38%
合 计	5,524,116,076.45	100.00%

（二）按行业分类的股票投资组合

序号	分 类	市 值(元)	占净值比例
1	农、林、牧、渔业	70,184,292.33	1.45%
2	采掘业	-	-
3	制造业	1,243,466,159.52	25.70%
	其中：食品、饮料	617,972,669.10	12.77%
	造纸、印刷	3,291,300.00	0.07%
	石油、化学、塑胶、塑料	60,731,717.82	1.26%
	电子	131,280,516.00	2.71%
	金属、非金属	108,085,201.11	2.23%
	机械、设备、仪表	91,384,313.23	1.89%
	医药、生物制品	180,523,772.02	3.73%
	其他	50,196,670.24	1.04%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
5	建筑业	12,396,342.08	0.26%
6	交通运输、仓储业	54,159,866.40	1.12%
7	信息技术业	308,519,219.24	6.38%
8	批发和零售贸易	502,146,643.00	10.38%
9	金融、保险业	440,508,166.51	9.10%
10	房地产业	380,253,907.94	7.86%
11	社会服务业	278,942,145.44	5.77%
12	传播与文化产业	281,889,869.51	5.83%
13	综合类	211,105,941.76	4.36%
	合 计	3,783,572,553.73	78.20%

（三）基金投资的前十名股票明细（按市值占净值比例排序）

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	市值（元）	占净值比例
1	000895	双汇发展	17,226,755	534,373,940.10	11.04%
2	600628	新世界	24,750,533	261,860,639.14	5.41%
3	600030	中信证券	7,800,000	212,706,000.00	4.40%
4	600832	东方明珠	18,178,404	207,960,941.76	4.30%
5	000002	万 科 A	13,000,000	201,110,000.00	4.16%
6	600048	保利地产	3,650,000	156,804,000.00	3.24%
7	600088	中视传媒	10,015,117	149,125,092.13	3.08%
8	600016	民生银行	13,000,000	131,560,000.00	2.72%
9	600563	法拉电子	10,390,736	127,286,516.00	2.63%
10	600050	中国联通	25,500,000	119,085,000.00	2.46%

注：1、截止报告期末，双汇发展因股权分置改革因素长时间停牌，本基金因股权分置改革停牌、基金资产净值波动等因素，持有双汇发展市值占基金资产净值比例超过10%的规定，属于被动超比例，本基金将在双汇发展复牌后根据法律法规和基金合同的规定及时调整达标。

2、投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本管理人网站的年度报告正文。

（四）股票投资组合的重大变动

1、累计买入价值超过2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额（元）	占期初净值比例
1	600050	中国联通	479,835,901.63	16.81%
2	600028	中国石化	392,653,677.24	13.76%
3	600489	中金黄金	223,323,871.17	7.83%
4	600030	中信证券	201,193,112.82	7.05%
5	600855	航天长峰	191,058,381.85	6.70%
6	601398	工商银行	185,364,375.49	6.50%
7	000002	万 科 A	175,842,696.01	6.16%
8	600016	民生银行	159,143,808.27	5.58%
9	600036	招商银行	153,918,597.80	5.39%
10	000063	中兴通讯	144,209,610.81	5.05%
11	000878	云南铜业	132,321,546.72	4.64%
12	600895	张江高科	128,775,088.35	4.51%
13	600432	吉恩镍业	128,459,500.32	4.50%
14	600088	中视传媒	126,615,135.91	4.44%
15	600015	华夏银行	119,919,844.55	4.20%
16	600547	山东黄金	113,067,353.40	3.96%
17	600631	百联股份	107,370,973.74	3.76%
18	600500	中化国际	103,327,273.00	3.62%
19	600048	保利地产	97,586,381.14	3.42%
20	000069	华侨城A	94,679,600.21	3.32%
21	601006	大秦铁路	91,390,309.50	3.20%
22	600198	大唐电信	82,673,845.66	2.90%
23	600900	长江电力	78,135,811.11	2.74%
24	000630	铜都铜业	76,632,772.53	2.69%
25	000657	中钨高新	72,323,472.60	2.53%
26	600018	上港集团	70,108,547.00	2.46%
27	600961	株冶火炬	67,785,878.34	2.38%
28	600460	士兰微	67,348,884.13	2.36%
29	600110	中科英华	66,990,638.71	2.35%
30	600331	宏达股份	66,512,407.95	2.33%
31	600531	豫光金铅	65,799,078.51	2.31%
32	600808	马钢股份	65,140,502.95	2.28%
33	002069	獐子岛	64,175,073.40	2.25%
34	000917	电广传媒	63,493,201.55	2.22%
35	000960	锡业股份	63,066,008.34	2.21%
36	000882	华联股份	62,901,923.45	2.20%
37	600519	贵州茅台	61,858,895.26	2.17%
38	600485	中创信测	61,677,449.29	2.16%
39	600832	东方明珠	61,027,583.21	2.14%
40	600289	亿阳信通	59,999,298.07	2.10%
41	000983	西山煤电	59,950,614.27	2.10%
42	000569	长城股份	59,884,559.51	2.10%
43	600258	首旅股份	58,669,492.11	2.06%
44	600628	新世界	58,662,922.78	2.06%
45	600887	伊利股份	58,258,930.06	2.04%
46	600158	S中体产	57,882,548.07	2.03%

2、累计卖出价值超过2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额（元）	占期初净值比例
1	600028	中国石化	471,424,858.51	16.52%
2	600050	中国联通	456,310,396.64	15.99%
3	600489	中金黄金	222,861,794.32	7.81%
4	600855	航天长峰	174,920,018.70	6.13%
5	600500	中化国际	170,781,674.58	5.98%
6	600036	招商银行	166,218,229.21	5.82%
7	600895	张江高科	151,586,989.56	5.31%
8	601398	工商银行	143,221,312.09	5.02%
9	600037	歌华有线	142,928,062.27	5.01%
10	600432	吉恩镍业	140,336,581.19	4.92%
11	000878	云南铜业	135,366,640.44	4.74%
12	000063	中兴通讯	130,433,771.77	4.57%
13	600015	华夏银行	129,363,652.68	4.53%
14	600631	百联股份	125,806,703.53	4.41%
15	000866	扬子石化	112,436,924.00	3.94%
16	600547	山东