金盛证券投资基金 2006年年度报告摘要

一、重要提示及目录

（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）基金简称：基金金盛
交易代码：184703
基金运作方式：契约型封闭式
基金合同生效日：2000年4月26日
报告期末基金份额总额：500,000,000份
基金合同存续期：至2009年11月30日止
基金份额上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
上市日期：2000年6月30日

（二）基金产品说明

（1）投资目标：本基金是以涉及新兴产业的上市公司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，谋求基金资产增值和收益的最大化。

（2）投资策略：根据国家宏观经济环境决定投资的总体策略；根据利率的走势和通货膨胀预期决定本基金的债券投资比例；根据国家的产业政策以及行业发展的状况决定行业投资战略；根据对上市公司的价值分析和其在行业中的竞争优势分析选择所要投资的股票。

本基金在行业资产配置中坚持相对集中的投资策略，挖掘具有良好发展态势的行业，将资产权重的较大部分配置到处于起步或成长阶段的行业。

（3）业绩比较基准：无。

（4）风险收益特征：承担较高风险，获取较高的超额收益。

（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：010-66275853
电子邮箱：yindong.zh@ccb.cn

（五）信息披露情况
登载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、基金净值表现及收益分配情况

（一）各主要财务指标

	2006年	2005年	2004年
基金本期净收益	241,738,560.34元	-20,139,108.72元	81,878,248.56元
基金份额本期净收益	0.4835元	-0.0403元	0.1638元
期末可供分配基金收益	181,647,525.30元	-20,091,035.04元	948,066.00元
期末可供分配基金份额收益	0.3633元	-0.0402元	0.0019元
期末基金资产净值	1,105,315,032.91元	525,232,171.63元	509,828,831.06元
期末基金份额净值	2.2106元	1.0505元	1.0197元
基金加权平均净值收益率	31.12%	-4.00%	14.27%
本期基金份额净值增长率	120.15%	3.20%	2.60%
基金份额累计净值增长率	153.35%	15.08%	11.51%

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。

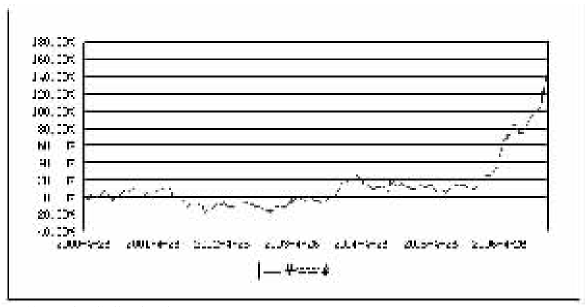
（二）基金净值表现

1、基金金盛净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

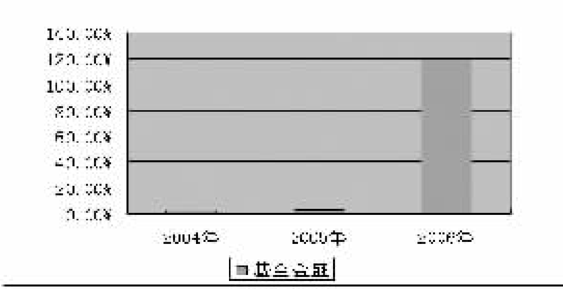
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	30.92%	2.22%	-	-	-	-
过去六个月	37.89%	2.19%	-	-	-	-
过去一年	120.15%	2.42%	-	-	-	-
过去三年	133.09%	2.35%	-	-	-	-
过去五年	179.79%	2.19%	-	-	-	-
自基金成立起至今	153.35%	2.16%	-	-	-	-

注：本基金根据基金合同无业绩比较基准。

2、基金金盛净值增长率历史走势图



3、基金金盛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	0.800元	
2005年	0.018元	2004年度收益分配
2004年	1.000元	2004年度收益分配
合计	1.818元	

四、基金管理人报告

（一）基金管理人及基金经理介绍

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

王雄辉，男，经济学硕士，10年证券从业经历。曾任南开大学教师，国泰基金管理有限公司研究开发部行业研究员，金泰基金基金经理助理，金泰基金基金经理，投资决策委员会秘书，理财部投资经理。2004年3月起担任金盛基金的基金经理。

2007年3月2日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于调整基金经理的临时公告》，由周传根同志担任本基金的基金经理，王雄辉同志不再担任本基金的基金经理。

周传根，男，CFA，货币银行学硕士，7年证券投资从业经历。曾任职于国家外汇管理局、法国兴业证券上海代表处，2003年1月加盟国泰基金管理有限公司，任研究开发部总监，现兼任基金金盛的基金经理。

（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。

报告期内本基金未发生任何损害基金份额持有人利益的行为，投资运作符合法律法规和基金合同的规定，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人所管理的其他基金资产、与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障了投资人的合法权益。

（三）2006年证券市场与投资管理回顾

当经济基本面的持续向好和股票市场基本制度变革完成最终相遇的时候，2006年的A股牛市无可避免地爆发了。此次行情爆发的过程和从前的牛市有很多相似之处：从股改除权效应开始的价值回归，到以消费升级、制造升级和人民币升值、资产升值为主题的价值发现，再到全流通条件下、公司主体对股票市场认识变化导致的以整体上市为主要内容的价值创造。这是一波大牛市惯常的运行模式。但在相似的运行模式背后，却有不同之处：一是中国经济在WTO五年过渡期后进入新阶段和"十一五"规划指出的增长模式变革，二是资本市场在中国经济运行和人民日常生活中将起到更重要作用；三是上市公司主体、投资者结构、法律监管环境发生根本性变化，这些不同注定了今后的市场将不同于过往的市场。

在A股市场这一年波澜壮阔的背景下，我们看到市场运行机制逐步完善，价值投资理念进一步深化，以及证券投资基金行业大发展。本基金的投资也经历了又一年的历练。总体来说，我们坚持了价值判断原则，在行业和个股方面做出了相对正确的选择，努力去提高市场判断和时机选择能力，从而使得交易效率有一定提高。具体来说，本基金2006年的股票投资过程就是，长期持有具备长期增长能力的消费、金融等行业的重点股票；阶段性地持有了另外一些行业板块的重点股票，其中一季度主要是有色金属行业，二季度是工程机械行业，三季度是金融和地产板块，四季度是证券行业。

投资是一个长期地认识市场运行规律的过程，本基金在经历了熊市牛市之后体现出来的稳健增长、风险收益较高的特征，也是一件值得回顾的事情。

（四）2007年证券市场与投资管理展望

2007年我们仍然抱以乐观的预期。影响中国经济这一轮上升周期的因素并没有消失，而政府的宏观调控也不希望经济出现大的波动，国际经济环境依然良好，07年也许会重复这几年经济运行超预期的历史。我们认为，强劲的经济增长直接体现在企业盈利实实在在的大幅增长上，上市公司预测的盈利增长率都在不断被市场调高。这样的盈利增长速度是股市上涨最为扎实的基础。股权分置改革、税制改革、股权激励、优质新股的加入等因素也将成为企业盈利增长的额外惊喜。

充裕的流动性甚至过剩的状况将不断提高A股的流动性溢价。充裕的流动性既来自外汇储备增加所导致的货币被动投放，更来源于储蓄向股票市场的转移，而且将是未来几年时间的一种常态。充裕的流动性加上充沛的信心，成为股市上涨的强大驱动因素。

因此，本基金在大类资产配置中重点向股票资产倾斜将成为一个自然的选择。在行业选择上，我们认为经济增长的结构性变化、人民币升值、周期性行业的价值重估、税制改革可能是2007年最主要的投资主题。另外奥运会、3G、台湾选举等也有可能成为阶段性的投资主题。结合对行业的定量分析，本基金主要看好金融、地产、食品饮料、零售、医药、装备制造（包括3G）、钢铁等行业，另外还看好酒店旅游、交通运输、传媒等行业。

五、基金托管人报告

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在基金金盛的托管过程中，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盛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。

由基金金盛管理人－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

		2006年12月31日	2005年12月31日
资 产			
银行存款		144,624,749.41	28,919,257.70
清算备付金		2,896,820.82	356,735.62
交易保证金		390,741.00	390,741.00
应收证券清算款		-	2,477,363.56
应收利息		2,297,268.47	1,020,869.91
股票投资市值		865,894,966.67	383,859,550.52
其中：股票投资成本		442,853,281.62	338,902,523.14
债券投资市值		227,516,733.13	114,274,264.33
其中：债券投资成本		226,890,910.57	113,908,085.04
权证投资市值		-	-
其中：权证投资成本		-	-
资产总计		1,243,621,279.50	531,298,782.64
负债及持有人权益			
负债：			
应付证券清算款		125,280,493.84	3,982,919.25
应付管理人报酬		1,295,738.74	643,864.94
应付托管费		215,956.47	107,310.83
应付佣金		325,032.48	140,210.33
应付利息		900.00	-
应付收益		283,104.68	283,104.68
其他应付款		550,020.38	549,200.98
卖出回购证券款		10,000,000.00	-
预提费用		355,000.00	360,000.00
负债合计		138,306,246.59	6,066,611.01
持有人权益：			
实收基金		500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得		423,667,507.61	45,323,206.67
未分配收益		181,647,525.30	-20,091,035.04
持有人权益合计		1,105,315,032.91	525,232,171.63
负债及持有人权益总计		1,243,621,279.50	531,298,782.64

期末基金份额净值：2006年为2.2106元，2005年为1.0505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		257,156,739.95	-10,844,188.15
1、股票差价收入		236,326,714.74	-20,108,420.15
2、债券差价收入		1,221,489.94	-157,340.56
3、权证差价收入		6,543,601.70	3,190,875.53
4、债券利息收入		4,491,159.22	446,507.73
5、存款利息收入		500,147.03	230,375.66
6、股利收入		8,050,243.92	5,542,559.56
7、买入返售证券收入		11,400.00	-
8、其他收入		11,983.40	11,254.08
二、费用		15,418,179.61	9,294,920.57
1、基金管理人报酬		11,480,846.27	7,569,774.58
2、基金托管费		1,913,474.43	1,261,629.06
3、卖出回购证券支出		1,446,264.46	16,345.20
4、其他费用		577,594.45	447,171.73
其中：上市年费		60,000.00	60,000.00
信息披露费		300,000.00	300,000.00
审计费用		55,000.00	60,000.00
三、基金净收益		241,738,560.34	-20,139,108.72
加：未实现利得		378,344,300.94	36,442,441.61
四、基金经营业绩		620,082,861.28	16,303,332.89

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		241,738,560.34	-20,139,108.72
加：期初基金净收益		-20,091,035.04	948,066.00
加：本期损益平准金		-	-
可供分配基金净收益		221,647,525.30	-19,191,042.72
减：本期已分配基金净收益		40,000,000.00	899,992.32
期末基金净收益		181,647,525.30	-20,091,035.04

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	525,232,171.63	509,828,831.06
二、本期经营活动：		
基金净收益	241,738,560.34	-20,139,108.72
未实现利得	378,344,300.94	36,442,441.61
经营活动产生的基金净值变动数	620,082,861.28	16,303,332.89
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	-40,000,000.00	-899,992.32
五、期末基金净值	1,105,315,032.91	525,232,171.63

（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。

基金资产的估值原则中新增：2006年11月13日之前取得的由于定向增发形成的暂时流通受限股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价估值。2006年11月13日之后基金新投资的非公开发行股票按《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》中的精神进行估值。

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，相关工商变更登记已办理完毕。

(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	381,613,633.99	20.32%	36,318,786.30	22.49%	121,453,968.14	12.62%	12,032,600.00	20.37%

	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	60,000,000.00	4.75%	307,091.99	20.35%	5,000,000.00	20.00%	99,082.47	12.74%

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
建设银行	-	-	-	-	20,020,000.00	7,026.20

(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。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11,480,846.27元，其中已支付基金管理人10,185,107.53元，尚余1,295,738.74元未支付。

2005年共计提管理费7,569,774.58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本报告期内，基金应支付基金托管人托管费共1,913,474.43元，其中已支付基金托管人1,697,517.96元，尚余215,956.47元未支付。

2005年共计提托管费1,261,629.06元，已全部支付。

(6) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。基金托管人于2006年12月31日保管的银行存款余额为144,624,749.41元(2005年：28,919,257.70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472,890.15元(2005年：219,742.39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	
	基金份额	占总份额比例	基金份额	占总份额比例
国泰基金管理有限公司	9,227,806份	1.85%	2,307,692份	0.46%

注：截止本报告期末，本基金管理人运用固有资金投资本基金的基金份额为9,227,806份，较上年末增持了6,920,114份。

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
国泰君安证券股份有限公司	2,692,308份	0.54%	2,692,308份	0.54%

3、流通转让受限制的基金资产

(1) 流通转让受限的股票

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、因股权分置改革实施阶段而停牌：

股票代码	股票名称	停牌日期	年末估值单价(元)	复牌日期	复牌开盘单价(元)	数量(股)	年末成本总额(元)	年末估值总额(元)
000895	S双汇	06/06/01	31.02	未知	未知	2,291,540	29,947,431.98	71,083,570.80
000549	S湘火炬	06/12/19	8.47	未知	未知	1,499,908	8,774,892.74	12,704,220.76
合计							38,722,324.72	83,787,791.56

B、因新股认购获配或增发流通受限：

序	名称	配售日期	可流通日	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)	备注
1	华联综超	06/05/17	07/05/17	650,000	8,398,000.00	15,054,000.00	定向增发
2	工商银行	06/10/23	07/01/29	1,121,600	3,499,392.00	6,763,248.00	网下申购
3	广深铁路	06/12/18	07/03/22	648,140	2,437,006.40	4,647,163.80	网下申购
4	大秦铁路	06/07/26	07/02/01	354,700	1,755,765.00	2,869,523.00	网下申购
5	中国人寿	06/12/28	07/04/09	132,300	2,497,824.00	2,497,824.00	网下申购
6	招商轮船	06/11/23	07/03/01	241,030	894,221.30	1,928,240.00	网下申购
7	北辰实业	06/09/28	07/01/16	269,636	647,126.40	1,817,346.64	网下申购
8	山河智能	06/12/12	07/03/22	51,885	518,850.00	1,689,894.45	网下申购
9	平煤天安	06/11/10	07/02/26	124,498	1,015,903.68	1,334,618.56	网下申购
10	鲁阳股份	06/11/21	07/02/28	38,917	428,087.00	1,048,813.15	网下申购
11	恒宝股份	06/12/27	07/04/10	120,803	1,018,369.29	1,018,369.29	网下申购
12	网盛科技	06/12/06	07/03/15	17,772	250,407.48	992,388.48	网下申购
13	太阳纸业	06/11/03	07/02/16	50,493	843,233.10	963,406.44	网下申购
14	日照港	06/09/28	07/01/18	133,220	626,134.00	956,519.60	网下申购
15	金螳螂	06/11/06	07/02/20	36,846	471,628.80	887,251.68	网下申购
16	东方海洋	06/11/14	07/02/28	66,640	499,133.60	777,022.40	网下申购
17	中材科技	06/11/07	07/02/26	37,275	334,729.50	727,608.00	网下申购
18	金智科技	06/11/28	07/03/08	27,174	385,870.80	602,175.84	网下申购
19	中国银行	06/06/28	07/01/05	94,314	290,487.12	497,034.78	网下申购
	合计				26,812,169.47	47,072,448.11	

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"、"恒宝股份"为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。 其他股票为网下申购和定向增发新股，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受限期限

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类股票为基金网下申购及参与定向增发中签的新股。"中国银行"、"大秦铁路"网下申购部分受限期限为六个月。"华联综超"为定向增发的非公开发行证券，受限期限为一年，其他股票受限期限为三个月。

(1) 流通转让受限的债券

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10,000,000.00元(2005年：无)，于2007年1月5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。

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	865,894,966.67	69.63%
债券	227,516,733.13	18.29%
权证	-	-
银行存款及清算备付金	147,521,570.23	11.86%
其他资产	2,688,009.47	0.22%
合 计	1,243,621,279.50	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	20,874,012.40	1.89%
2	采掘业	1,334,618.56	0.12%
3	制造业	342,287,982.89	30.97%
	其中：食品、饮料	108,837,570.80	9.85%
	造纸、印刷	10,887,406.44	0.99%
	石油、化学、塑胶、塑料	19,128,000.00	1.73%
	金属、非金属	16,680,421.15	1.51%
	机械、设备、仪表	118,888,715.21	10.76%
	医药、生物制品	66,847,500.00	6.05%
	其他制造业	1,018,369.29	0.09%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	22,230,000.00	2.01%
5	建筑业	26,969,251.68	2.44%
6	交通运输、仓储业	83,357,123.40	7.54%
7	信息技术业	74,525,972.32	6.74%
8	批发和零售贸易	39,154,800.00	3.54%
9	金融、保险业	179,249,958.78	16.22%
10	房地产业	75,911,246.64	6.87%
11	社会服务业	-	-
12	传播与文化产业	-	-
13	综合类	-	-
	合 计	865,894,966.67	78.34%

（三）基金投资的前十名股票明细(按市值占基金资产净值比例排序)

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	市值（元）	占净值比例
1	600036	招商银行	6,300,000	102,249,000.00	9.25%
2	600031	三一重工	2,880,000	92,937,600.00	8.41%
3	000895	S双汇	2,291,540	71,083,570.80	6.43%
4	000024	招商地产	2,090,000	58,457,300.00	5.29%
5	600406	国电南瑞	1,781,800	40,197,408.00	3.64%
6	601398	工商银行	6,620,000	39,918,600.00	3.61%
7	600519	贵州茅台	430,000	37,754,000.00	3.42%
8	000623	吉林敖东	1,110,000	36,907,500.00	3.34%
9	600030	中信证券	1,250,000	34,087,500.00	3.08%
10	601006	大秦铁路	4,180,000	33,816,200.00	3.06%

注：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、累计买入价值超出期初基金资产净值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	600031	三一重工	34,647,316.39	6.60%
2	000623	吉林敖东	30,218,066.33	5.75%
3	000039	中集集团	30,175,464.42	5.75%
4	000060	中金岭南	29,964,548.17	5.71%
5	000024	招商地产	27,442,121.56	5.22%
6	601006	大秦铁路	27,367,054.58	5.21%
7	601398	工商银行	27,123,182.37	5.16%
8	600030	中信证券	24,950,827.03	4.75%
9	600036	招商银行	24,655,835.29	4.69%
10	600019	宝钢股份	23,432,484.59	4.46%
11	600000	浦发银行	20,061,232.68	3.82%
12	600825	新华传媒	19,624,592.27	3.74%
13	002069	獐子岛	17,644,053.93	3.36%
14	600438	通威股份	17,635,300.00	3.36%
15	600592	龙溪股份	17,048,946.85	3.25%
16	600900	长江电力	16,626,698.09	3.17%
17	000682	东方电子	16,308,591.48	3.11%
18	600033	福建高速	15,566,347.63	2.96%
19	000792	盐湖钾肥	15,374,835.91	2.93%
20	000753	漳州发展	14,890,999.13	2.84%
21	600361	华联综超	14,613,924.29	2.78%
22	600386	北京巴士	13,669,192.22	2.60%
23	600688	S上石化	13,510,763.49	2.57%
24	600018	上港集团	13,324,148.97	2.54%
25	600050	中国联通	12,507,460.64	2.38%
26	600296	S兰铝	12,348,250.50	2.35%
27	000951	中国重汽	11,870,465.54	2.26%
28	000063	中兴通讯	11,810,528.26	2.25%
29	000006	深振业A	11,499,255.75	2.19%
30	600066	宇通客车	11,208,613.73	2.13%
31	600436	片仔癀	11,200,695.67	2.13%
32	600302	标准股份	11,188,040.51	2.13%
33	600406	国电南瑞	10,743,465.21	2.05%

2、累计卖出价值超出期初基金资产净值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	000060	中金岭南	63,447,999.14	12.08%
2	600019	宝钢股份	33,466,702.84	6.37%
3	600031	三一重工	31,770,554.42	6.05%
4	600438	通威股份	26,193,200.27	4.99%
5	600037	歌华有线	25,576,951.63	4.87%
6	600050	中国联通	25,369,624.65	4.83%
7	000063	中兴通讯	23,089,496.39	4.40%
8	600009	上海机场	22,865,953.73	4.35%
9	600018	上港集团	22,810,563.98	4.34%
10	600628	新世界	22,516,987.53	4.29%
11	000839	中信国安	22,104,029.38	4.21%
12	600694	大商股份	21,994,404.25	4.19%
13	600328	兰太实业	21,323,496.24	4.06%
14	000039	中集集团	19,884,433.17	3.79%
15	600900	长江电力	19,348,175.68	3.68%
16	600592	龙溪股份	19,197,999.90	3.66%
17	600085	同仁堂	19,163,379.58	3.65%
18	600000	浦发银行	18,933,411.57	3.60%
19	600036	招商银行	17,337,627.07	3.30%
20	600033	福建高速	17,010,589.34	3.24%
21	600497	驰宏锌锗	16,279,395.67	3.10%
22	600519	贵州茅台	16,251,980.83	3.09%
23	600547	山东黄金	15,632,494.73	2.98%
24	000538	云南白药	14,733,973.32	2.81%
25	600386	北京巴士	14,652,892.81	2.79%
26	600296	S兰铝	13,929,717.21	2.65%
27	000951	中国重汽	13,178,336.48	2.51%
28	600970	中材国际	12,897,344.47	2.46%
29	600688	S上石化	12,691,220.33	2.42%
30	600028	中国石化	12,358,755.77	2.35%
31	600066	宇通客车	12,174,196.36	2.32%
32	600761	安徽合力	12,143,077.12	2.31%
33	600436	片仔癀	11,369,429.43	2.16%
34	600302	标准股份	11,176,929.83	2.13%
35	600533	栖霞建设	10,933,351.18	2.08%
36	600764	中电广通	10,743,566.56	2.05%
37	600588	用友软件	10,694,947.17	2.04%

3、报告期内买入股票的成本总额：900,011,955.38元

4、报告期内卖出股票的收入总额：1,026,929,375.17元

（五）按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占净值比例
1	国家债券	207,220,733.13	18.75%
2	金融债券	20,296,000.00	1.84%
	合 计	227,516,733.13	20.58%

（六）按市值占基金资产净值比例的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	占净值比例
1	20国债(4)	63,546,303.00	5.75%
2	02国债(14)	50,370,540.00	4.56%
3	银行间00国债12	41,453,333.33	3.75%
4	20国债(10)	21,034,801.60	1.90%
5	05农发04	20,296,000.00	1.84%

（七）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受到公开谴责、处罚的情况。

2、基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

3、其他资产的构成如下：

分 类	市值(元)
交易保证金	390,741.00
应收利息	2,297,268.47
合 计	2,688,009.47

4、报告期末本基金无处于转股期的可转换债券。

5、本报告期投资权证明细如下：

(1) 本报告期末本基金未持有权证。

(2) 报告期内获得的权证明细

权证代码	权证名称	获得日期	获得数量(份)	成本(元)	投资类别
580997	招行CMP1	2006/2/27	2,286,990	0.00	被动持有
580996	沪场JTP1	2006/3/2	525,000	0.00	被动持有
580990	茅台JCP1	2006/5/25	1,120,000	0.00	被动持有
038008	钾肥JTP1	2006/6/29	360,000	0.00	被动持有
合计			4,291,990	0.00	

6、本报告期内，未投资资产支持证券。

7、由于四舍五入原因，分项之合与合计可能有尾差。

（八）本基金管理人运用固有资金投资本基金情况

截止本报告期末，本基金管理人运用固有资金投资本基金的基金份额为9,227,806份，较上年末增持了6,920,114份。

九、基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数
基金份额持有人户数：5,750
平均每户持有人基金份额：86,956.52份

（二）持有人结构

	持有的基金份额（份）	占总份额比例
机构投资者	408,579,250	81.72%
个人投资者	91,420,750	18.28%
合计	500,000,000	100.00%

（三）前十名持有人

序号	持有人姓名	期末持有数（份）	持有比例
1	人寿集团	49,335,272	9.87%
2	人寿保险	49,111,011	9.82%
3	新华人寿	43,381,580	8.68%
4	平安保险	37,309,543	7.46%
5	太平洋保险	31,465,574	6.29%
6	UBS AG	20,506,443	4.10%
7	荷兰银行	18,119,762	3.62%
8	招商证券	17,115,800	3.42%
9	宝钢集团	13,976,700	2.80%
10	泰康人寿	12,990,466	2.60%

注：1、UBS AG即申银万国－花旗－UBS AG

2、以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的基金持有人名册编制。

二、重大事件揭示

1、2006年1月13日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于公司股东股权转让的公告》，经国泰基金管理有限公司股东会审议通过，并报经中国证监会证监基金字[2006]4号文批准，本公司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。

2、2006年6月14日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于投资资产支持证券方案的公告》，就本基金投资资产支持证券的相关事宜进行了公告。

3、2006年6月30日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于旗下基金获配中国银行股份有限公司首次公开发行A股的公告》，就本基金管理人获配中国银行新股的数量进行了公告。

4、2006年7月29日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司获配大秦铁路股份有限公司首次公开发行A股的公告》，就本基金获配大秦铁路新股的数量进行了公告。

5、2006年10月25日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》刊登了《金盛证券投资基金收益分配公告》，向全体基金份额持有人按每10份基金份额派发现金红利0.80元。

6、2006年10月26日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于旗下基金获配中国工商银行股份有限公司首次公开发行A股的公告》，就本基金获配中国工商银行新股的数量进行了公告。

7、2006年11月8日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于旗下基金获配山东太阳纸业股份有限公司首次公开发行A股的公告》，就本基金获配山东太阳纸业新股的数量进行了公告。

8、2006年12月7日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于董事变更的公告》，经本基金管理人股东会和董事会审议通过，王耀南女士当选为公司董事，周志平先生不再担任公司董事。

10、2007年1月5日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于住所变更的公告》，本基金管理人的住所变更为上海市浦东新区峨山路91弄98号201A。

11、2007年1月12日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于旗下四只封闭式基金2006年度收益分配预告》，本基金拟向全体基金份额持有人按每10份基金份额派发现金红利3.20元。

12、2007年3月2日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于调整基金经理的临时公告》，由周传根同志担任本基金的基金经理，王雄辉同志不再担任本基金的基金经理。

13、2006年7月27日，中国建设银行股份有限公司董事会召开会议，通过了委任张建国先生担任中国建设银行行长的议案；2006年10月20日，中国建设银行股份有限公司举行2006年第一次临时股东大会，委任张建国先生为建行执行董事，同时出任副董事长。2006年7月，常振明先生辞任建行副董事长、执行董事及行长的职务。

14、2006年12月28日，中国建设银行股份有限公司根据工作需要，将"基金托管部"更名为"投资托管服务部"。

15、基金租用席位的选择标准是：
(1) 资力雄厚，信誉良好；
(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
(3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
(4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
(5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），经公司同意并报董事会批准。

16、报告期内，基金租用证券公司专用席位的有关情况如下： 单位：元

券商名称	席位数量	股票成交金额	比例	债券成交金额	比例
渤海证券有限责任公司	1	74,774,610.80	3.98%	3,577,611.00	2.22%
国泰君安证券股份有限公司	2	381,613,633.99	20.32%	36,318,786.30	22.49%
申银万国证券股份有限公司	2	446,380,083.92	23.77%	51,762,319.94	32.06%
海通证券股份有限公司	2	573,845,042.42	30.56%	41,433,156.00	25.66%
兴业证券股份有限公司	2	401,347,861.55	21.37%	28,387,229.61	17.58%
合计	9	1,877,961,232.68	100.00%	161,479,102.85	100.00%

券商名称	债券回购成交金额	比例	佣金	比例
渤海证券有限责任公司	-	-	61,278.36	4.06%
国泰君安证券股份有限公司	60,000,000.00	4.75%	307,091.99	20.35%
申银万国证券股份有限公司	320,000,000.00	25.32%	363,403.20	24.08%
海通证券股份有限公司	625,000,000.00	49.45%	460,303.44	30.50%
兴业证券股份有限公司	259,000,000.00	20.49%	317,308.15	21.02%
合计	1,264,000,000.00	100.00%	1,509,385.14	100.00%

注：在本报告期内，基金无新增租用专用交易席位。

17、报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况。报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为55,000.00元，目前的审计机构提供审计服务的年限为5年。

18、报告期内，未召开基金份额持有人大会；无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项；基金管理人无重大人事变动；基金投资策略无改变；为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况；基金管理人、托管人机构及高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

国泰基金管理有限公司
2007年3月16日

金盛证券投资基金
2006年度收益分配公告

为及时回报基金份额持有人，满足基金份额持有人现金分红需求，国泰基金管理有限公司决定实施金盛证券投资基金（以下简称"基金金盛"）收益分配，并已于2007年1月12日刊登了《国泰基金管理有限公司关于旗下四只封闭基金2006年度收益分配预告》。

根据《证券投资基金运作管理办法》、《金盛证券投资基金基金合同》等规定，国泰基金管理有限公司决定以截至2006年12月31日基金金盛期末可分配收益为准，向基金份额持有人实施现金分红。现将分红方案公告如下：

一、基金简称及代码

基金简称：基金金盛，基金代码：184703。

二、收益分配方案

经普华永道会计师事务所审计，截止2006年12月31日，基金金盛的份额净值为2.2106元，2006年年度单位可供分配收益为0.4433元，其中：2006年11月3日已向全体基金份额持有人按每一份基金份额派发现金红利0.08元，年末已实现的单位未分配收益为0.3633元。

本次收益分配方案为：向全体基金份额持有人按每10份基金份额派发现金红利3.20元，共派发现金红利160,000,000元。

本收益分配方案已经基金托管人中国建设银行股份有限公司复核。

三、权益登记日和除息日
权益登记日：2007年3月22日
除息日：2007年3月23日
红利发放日：2007年3月23日

四、收益分配对象

本次收益分配对象为：截止2007年3月22日下午深圳证券交易所收市后，在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的基金金盛全体基金份额持有人。

五、收益发放办法

1、本次可流通的基金份额发放的现金红利于2007年3月23日通过托管券商直接划入投资者账户。

2、基金金盛发起人持有的不可流通的基金份额应得现金收益由托管人直接办理发放手续。

六、有关税收说明

根据财政部、国家税务总局的规定，基金向投资者分配的基金收益，暂免征收所得税。

特此公告。

国泰基金管理有限公司
2007年3月16日