长盛中信全债指数增强型债券投资基金 2006年年度报告摘要

重要提示

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。

本基金管理人长盛基金管理有限公司(以下简称"本公司")的董事会及董事保证长盛中信全债指数增强型债券投资基金(以下简称"本基金")2006年年度报告(以下简称"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。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定,于2007年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告和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。

本报告财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告会计期间:2006年1月1日至2006年12月31日。

第一章 基金简介

一、基金基本资料

(一)基金名称:长盛中信全债指数增强型债券投资基金
(二)基金简称:长盛债券基金
(三)基金交易代码:510080(前端收费模式);511080(后端收费模式)
(四)基金运作方式:契约型开放式
(五)基金合同生效日:2003年10月25日
(六)报告期末基金份额总额:126,222,587.34份
(七)基金合同存续期:不定期
(八)基金份额上市的证券交易所:无
(九)上市日期:无

二、基金产品说明

(一)投资目标

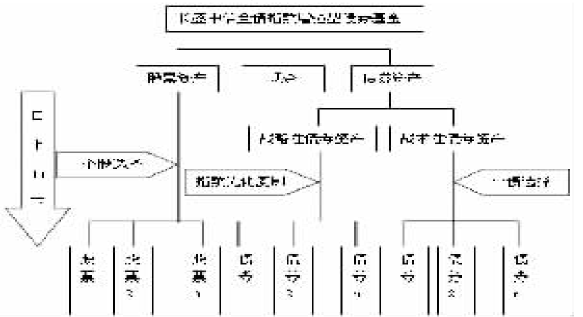
本基金为开放式债券型基金,将运用增强的指数化投资策略,在力求本金安全的基础上,追求基金资产的当期收益和超过比较基准的长期稳定增值。

(二)投资策略

本基金采用"自上而下"的投资策略对各类资产进行合理配置。通过指数化债券投资策略确保债券资产的长期稳定增值,同时运用一些积极的、低风险的投资策略来提高债券投资组合的收益。

1、在对宏观经济形势和证券市场走势进行科学分析的基础上,自上而下进行资产配置。

本基金将重点关注经济增长率、工业总产值增长率、产品产销率、外贸进出口额、物价指数等宏观经济指标,通过对宏观经济形势、财政政策及货币政策的深入分析,对未来经济走势、投资环境变化及利率走势做出科学、合理地判断,并在此基础上采用"自上而下"的资产配置策略,首先确定基金资产在债券、股票和现金资产之间的配置,再确定债券资产中战略性与战术性债券资产间的配置比例,最后按照不同方法具体构建债券、股票投资组合。



2、运用指数化的增强性投资策略,获得超过目标指数的收益水平。

在指数化投资的基础上,针对债券市场当前存在的结构性失衡,通过控制债券投资组合久期与指数久期有限度偏离,运用收益率差异策略、资产选择策略等积极资产组合管理策略,依据总收益分析实现对各类属资产的合理配置。

同时,遵循稳健投资原则,积极参与股票增发,并运用投资组合保险策略适当进行股票投资,提高组合的整体收益。

3、充分利用市场无风险套利机会,适当运用杠杆原理,有效提高投资组合的收益水平。

本基金还将充分利用以下无风险套利机会提高资产盈利水平

(1)利用同一债券品种在不同债券市场上的价格差异,通过无风险套利操作获得由于市场分割带来的超额收益;

(2)利用同期限债券回购品种在不同市场上的利率差异,通过开展无风险套利操作,提高投资组合的盈利能力;

(3)利用同期限债券品种在一、二级市场上的收益率差异,通过投资品种的转换获得一、二级市场的差价收入;

(4)通过债券回购所获得的资金参与新股申购和新股配售,获得稳定的股票一级市场收益;

(5)随着未来利率期货、利率期权、利率互换等可以有效规避利率风险的金融衍生产品的推出,在主管机关批准后积极开展套利操作。

此外,多层次的风险监控体系和组合动态调整机制将确保各种积极投资策略和无风险套利操作的有效实施和执行。

(三)业绩比较基准

中信全债指数收益率×92%+中信综合指数收益率×8%。

(四)风险收益特征

本基金属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均风险和预期收益均低于股票型基金。

三、基金管理人

(一)名称:长盛基金管理有限公司
(二)信息披露负责人:叶金松
(三)联系电话:010-82255818
(四)传真:010-82255988
(五)电子邮箱:yejs@csfunds.com.cn

四、基金托管人

(一)名称:中国农业银行
(二)信息披露负责人:李芳菲
(三)联系电话:010-68424199
(四)传真:010-68424181
(五)电子邮箱:lifangfei@abchina.com

五、信息披露

(一)登载本报告正文的管理人互联网网址:http://www.csfunds.com.cn
(二)基金年度报告置备地点:本报告分别置备于基金管理人和基金托管人的办公地址,供公众查阅、复制。

第二章 主要财务指标、基金净值表现和收益分配情况

所述基金业绩指标不包括基金份额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。

一、主要财务指标

序号	主要财务指标	2006年	2005年	2004年
1	基金本期净收益(元)	27,460,434.26	20,657,595.80	23,058,205.59
2	基金份额本期净收益(元/份)	0.2300	0.0933	0.0539
3	期末可供分配基金份额收益(元/份)	0.0822	0.0468	-0.0022
4	期末基金资产净值(元)	143,517,499.04	137,040,064.33	340,732,927.45
5	期末基金份额净值(元/份)	1.1370	1.0468	0.9978
6	本期基金份额净值增长率	32.71%	10.59%	0.18%

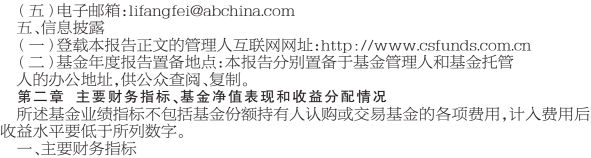
二、基金净值表现

(一)本基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较列表

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	10.56%	0.0034	2.47%	0.0012	8.09%	0.0022
过去六个月	13.72%	0.0032	3.78%	0.0012	9.94%	0.0020
过去一年	32.71%	0.0038	7.99%	0.0013	24.72%	0.0025
过去三年	47.03%	0.0032	15.49%	0.0015	31.54%	0.0017
自基金成立起至今	53.09%	0.0032	17.08%	0.0015	36.01%	0.0017

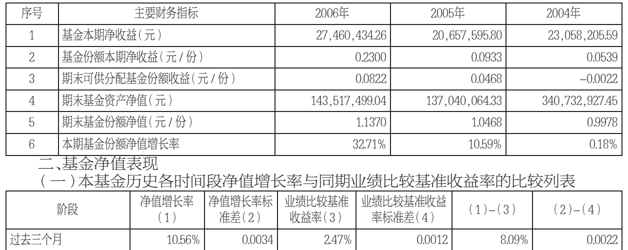
(二)本基金合同生效以来基金份额净值变动情况,及与同期业绩比较基准的变动比较

长盛中信全债指数增强型债券投资基金累计份额净值增长率
及同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2003年10月24日至2006年12月31日)



(三)本基金过往三年的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛中信全债指数增强型债券投资基金净值增长率
与业绩比较基准历史收益率的对比图



三、过往三年每年的基金收益分配情况

年度	每10份基金份额分红数	备注
2006年	1.600元	除息日:2006年11月7日
	0.600元	除息日:2006年1月20日
2005年	0.320元	除息日:2005年9月19日
	0.220元	除息日:2005年6月6日
2004年	0.300元	除息日:2004年2月24日
合计	3.040元	

第三章 管理人报告

第一节 基金管理人及基金经理情况

一、基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基字[1999]6号文件批准,于1999年3月成立,注册资本为人民币10000万元。目前,本公司股东及其出资比例为:国元证券有限责任公司49%、安徽省创新投资有限公司26%、安徽省投资集团有限责任公司25%。截止2006年12月31日,基金管理人共管理四支封闭式基金、五支开放式基金,并于2002年12月,首批取得了全国社保基金管理资格。

二、基金经理介绍

王茜女士,武汉大学工商管理硕士,10年金融、证券从业经验。作为全国银行间市场的首批成员组建人,具有丰富的全国银行间市场投资经验和跨市场操作经验。1997年起历任武汉市商业银行信贷管理部交易员、副经理、总经理助理,2002年任职于中信证券固定收益部。2002年9月至今,就职于长盛基金管理公司投资管理部,先后负责封闭式基金债券组合管理,开放式基金债券组合管理,历任全国社保基金债券资产委托基金经理助理,长盛中信全债指数增强型债券基金经理、2005年起兼任长盛货币市场基金经理。

第二节 对报告期内基金运作的遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《基金法》及其各项实施准则、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

第三节 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

一、2006年债券市场运行特点

2006年债券市场总体是高位震荡向上的一年。这一年中,由于央行货币政策取向的变化和股票市场出现了由熊转牛的战略性转折,债券市场未能延续2005年的大涨行情,而仅仅是在市场流动性依然过剩的支持下,在经历了上半年债券市场的较大波动后,在下半年才逐步走出了小幅曲折上扬的局面。截至12月末,上证国债指数当年小幅上涨2.136%。而同期,股票市场在经历了制度性变革后,在中国经济持续快速发展的背景下,演绎出一轮气势如虹的牛市行情,截至12月末,上证指数全年暴涨130.43%;转债市场在股票市场的带动下,也走出了一轮上涨行情,天相转债指数当年上涨45.89%。

回顾2006年的债券市场,尽管全年市场流动性总体保持宽松,但是投资人对资金使用效率及效益的追逐和对宏观调控与货币政策取向预期的变化引发了债券市场的供求变化,主导了市场的波动,最终形成了小幅曲折上扬的格局。我们可将06年的债市分为以下几个主要阶段:1、2006年上半年,随着债券市场收益率水平的下降,债券投资能够给投资人带来的利息回报及资本利得空间不断缩小。国有商业银行在完成或即将完成股份制改造后,合格的资本充足率及股东利益最大化要求都刺激商业银行将盈利性放在首位,其信贷投放的动力空前强化,而商业银行信贷资产规模的快速增长必然导致债券市场资金的较大分流,债券市场初现滞涨。5月份,在新股发行重新启动后,新股一级市场认购所带来的可观的无风险收益更加剧了债券市场的资金分流现象,债券市场小幅回落;2、2006年中期,由于信贷投放和固定资产投资的快速增长,国内经济再次呈现局部过热的状况,为此国家出台了一系列包括数量调控和利率调整在内的紧缩性货币政策,债券市场投资人对政策预期发生了根本性的转变。投资人预期的变化及对未来可能出台的紧缩性策略的担心使得债券市场在2006年的中期出现了加速回落;3、2006年中后期,随着货币政策的明朗及投资人政策预期的稳定,在新股资金分流作用弱化和商业银行资金大幅回流债市的情况下,在外汇占款持续较快增长和CPI小幅增长的背景下,债券市场随着投资人对短期资金供求状况预期波动开始了曲折上扬。综合来看,2006年的债券市场在经历了一年的波动和震荡后,在多种因素的相互作用和制约下,期限结构不合理的情况更加突出,债券市场收益率曲线更趋于平坦化,曲线长端的风险不断累积。

二、2006年本基金操作回顾

2006年,长盛债券基金准确地把握了不同市场各类投资工具风险收益特征的变化趋势,在保持对固定收益类债券的战略性配置比例以获得稳定债券利息收入的基础上,在基金合同允许范围内始终保持对权益类资产(尤其股票资产)较高配置,从而提高了资产配置效率,使投资人较好地分享到牛市的上涨。同时,本基金基于对当年债券市场走势的判断,适时对固定收益类资产组合中类属资产的配置进行了调整,并在基金合同允许范围内对久期进行了小幅调整,获得了较好的效果。此外,本基金还积极运用投资杠杆参与新股发行、再融资等无风险或低风险投资,当年取得了理想的投资回报。截至2006年12月末,长盛债券基金累计份额净值1.4570元,当年净值增长率为32.71%,超越同期比较基准24.72个百分点。

第四节 对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

展望2007年,在市场流动性过剩难以短期根本性扭转、人民币持续升值的大背景下,尽管投资人对通胀预期有所加强,并存在年内小幅升息的可能,我们仍认为债券市场总体上会是波澜不惊的一年,但不排除由于投资人对国内外经济形势、国内宏观调控政策取向及外汇占款变化趋势预期的变化、以及短期资金供求的变化引起债券市场阶段性的较大波动。就不同期限结构的债券品种而言,我们认为长期债券风险不容忽视。同时,就权益类资产的投资而言,尽管我们看好股票市场的中长期趋势,但是在经历了去年的快速大幅上涨后,市场存在一定的非理性成分,短期内其风险收益特征已不具有明显优势,股票及转债市场年内均可能面临较大幅度的震荡调整。基于以上判断,2006年本基金将坚持一贯的稳健投资风格,对固定收益类债券保持基础性配置,通过获取利息收入确保基金资产的稳定增值;同时在风险收益合理配比的原则下,动态调整战术性组合中权益类资产、低风险债券资产、现金资产的配置比例,以期提高资产配置效率。此外,本基金将重点运用融资杠杆参与新股一级市场认购,并积极关注优质股票的再融资投资机会,力争为投资人带来低风险超额收益。

第四章 托管人报告

在托管长盛中信全债指数增强型债券投资基金的过程中,本基金托管人——中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》、相关法律法规的规定以及《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金托管协议》的约定,对长盛中信全债指数增强型债券投资基金管理人—长盛基金管理有限公司2006年1月1日至2006年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

本托管人认为,长盛基金管理有限公司在长盛中信全债指数增强型债券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人认为,长盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的长盛中信全债指数增强型债券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

中国农业银行托管业务部
2007年3月28日

第五章 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司注册会计师汪棣、陈宇2007年3月26日对本基金2006年12月31日的财务状况以及2006年度的经营成果和基金净值变动出具了普华永道中天审字(2007)第20268号无保留意见的审计报告。

第六章 财务会计报告

第一节 基金会计报表(经审计)

一、资产负债表

长盛中信全债指数增强型债券投资基金资产负债表

单位:人民币元

项 目	2006年12月31日	2005年12月31日
资 产		
银行存款	53,958,843.10	6,039,895.75
清算备付金	806,387.55	738,797.62
交易保证金	710,000.00	710,000.00
应收证券清算款	0.00	121,341.63
应收股利	0.00	0.00
应收利息	549,858.77	1,062,140.60
应收申购款	1,030,288.43	169,635.57
其他应收款	0.00	0.00
股票投资市值	22,776,529.05	20,949,899.54
其中:股票投资成本	14,688,265.75	21,012,520.76
债券投资市值	92,910,756.67	117,033,065.20
其中:债券投资成本	90,283,836.24	116,187,128.89
权证投资	915,500.00	0.00
其中:权证投资成本	376,300.00	0.00
买入返售证券	0.00	0.00
待摊费用	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产总计	173,658,163.57	146,824,775.91
负债及持有人权益		
负债		
应付证券清算款	28,465,888.93	0.00
应付赎回款	1,087,023.05	1,095,923.56
应付赎回费	2,315.24	909.88
应付管理人报酬	87,697.58	87,303.42
应付托管费	23,386.04	23,280.91
应付佣金	39,293.06	117,258.21
应付利息	0.00	1,482.87
应付收益	0.00	0.00
应交税金	0.00	0.00
其他应付款	385,060.63	383,552.73
卖出回购证券款	0.00	8,000,000.00
短期借款	0.00	0.00
预提费用	50,000.00	75,000.00
其他负债	0.00	0.00
负债合计	30,140,664.53	9,784,711.58
持有人权益		
实收基金	126,222,587.34	130,913,024.82
未实现利得	6,924,792.41	-3,204,938.53
未分配收益	10,370,119.29	9,331,978.04
持有人权益合计	143,517,499.04	137,040,064.33
负债及持有人权益总计	173,658,163.57	146,824,775.91

注:2006年末每份额基金资产净值:1.1370元,2005年末每份额基金资产净值:1.0468元。后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

二、经营业绩表及收益分配表

长盛中信全债指数增强型债券投资基金经营业绩表及收益分配表

单位:人民币元

项 目	2006年度	2005年度
收 入		
股票差价收入	19,957,201.13	880,751.92
债券差价收入	4,202,560.02	16,077,926.99
权证差价收入	2,167,174.60	0.00
债券利息收入	2,735,900.38	5,587,196.05
存款利息收入	254,996.27	349,468.88
股利收入	283,591.28	538,937.35
买入返售证券收入	5,250.00	220.00
其他收入	96,287.95	121,502.90
收入合计	29,702,961.63	23,556,004.09
费 用		
基金管理人报酬	986,246.82	1,720,863.91
基金托管费	262,999.20	458,897.01
卖出回购证券支出	631,797.37	358,328.67
利息支出	0.00	0.00
其他费用	361,483.98	360,318.70
其中:上市年费	0.00	0.00
信息披露费	270,000.00	270,000.00
审计费用	25,000.00	50,000.00
费用合计	2,242,527.37	2,898,408.29
基金净收益	27,460,434.26	20,657,595.80
加:未实现估值增值/(减值)变动数	10,471,068.64	993,219.18
基金经营业绩	37,931,502.90	21,650,814.98
本期基金净收益	27,460,434.26	20,657,595.80
加:期初基金净收益	9,331,978.04	6,722,805.27
本年申购基金份额的损益平准金	14,696,671.48	1,093,220.32
本年赎回基金份额的损益平准金	-13,119,867.35	-8,456,497.38
可供分配基金净收益	38,369,216.43	20,017,124.01
减:本年/期已分配基金净收益	27,999,097.14	10,685,145.97
期末基金净收益	10,370,119.29	9,331,978.04

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

三、基金净值变动表

长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金净值变动表

单位:人民币元

项 目	2006年度	2005年度
期初基金净值	137,040,064.33	340,732,927.45
本期经营活动		
基金净收益	27,460,434.26	20,657,595.80
未实现估值增值/(减值)变动数	10,471,068.64	993,219.18
经营活动产生的基金净值变动数	37,931,502.90	21,650,814.98
本期基金份额交易		
基金申购款	169,340,447.09	21,606,734.08
其中:分红再投资	2,621,690.13	1,165,880.09
基金赎回款	-172,795,418.14	-236,265,266.21
基金份额交易产生的基金净值变动数	-3,454,971.05	-214,658,532.13
本期向基金份额持有人分配收益		
向基金份额持有人分配收益产生的基金净值变动数	-27,999,097.14	-10,685,145.97
期末基金净值	143,517,499.04	137,040,064.33

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

第二节 年度会计报表附注(经审计)

一、本报告期对投资分离交易可转债以及获取的权证所采用的会计政策、会计估计的相关列示见本报告正文。

二、本报告期无重大会计差错和内容的更正金额。

三、关联方关系及关联方交易

(一)关联方关系

本报告期内,本基金无关联方关系的变化情况。

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行	基金托管人、基金代销机构
国元证券有限责任公司(以下简称"国元证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
安徽省创新投资有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团有限责任公司	基金管理人的股东

(二)关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

1、通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

单位:人民币元

	2006年度		2005年度	
	成交量	占全年成交量的比例	成交量	占全年成交量的比例
国元证券				
买卖股票	137,367,559.76	68.28%	168,015,698.05	73.99%
买卖债券	91,089,039.40	76.30%	400,632,240.00	80.96%
债券回购	786,000,000.00	100.00%	361,700,000.00	100.00%
买卖权证	1,284,919.50	42.81%	0.00	0.00%
	佣金	占全年佣金总量的比例	佣金	占全年佣金总量的比例
国元证券	110,542.27	68.89%	137,772.09	74.88%

上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取,并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

2、关联方报酬

(1)基金管理人报酬

支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬986,246.82元(2005年:1,720,863.91元)。

(2)基金托管报酬

支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.2%/当年天数。

本基金在本年度需支付基金托管费262,999.20元(2005年:458,897.01元)。

3、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农业银行保管,并按银行间同业利率计息。基金托管人于2006年12月31日保管的银行存款余额为53,958,843.10元(2005年:6,039,895.75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231,813.34元(2005年:310,820.80元)。

4、与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易:无

5、关联方持有的基金份额

(1)基金管理人所持有的本基金份额

基金管理人名称	2006年12月31日			2005年12月31日		
	基金份额数(份)	净值(元)	占基金总份额的比例	基金份额数(份)	净值(元)	占基金总份额的比例
长盛基金管理有限公司	17,004,858.53	19,334,524.15	13.47%	17,004,858.53	17,800,685.91	12.99%

(2)基金其他关联方及其控制的机构所持有的本基金份额

本基金其他关联方及其控制的机构于本报告期及上年度可比期间均未持有本基金份额。

四、报告期末流通受限制不能自由转让的基金资产

基金可使用以基金名义开设的股票账户,比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股或增发新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

本基金截至2006年12月31日止投资的流通受限制的股票情况如下

股票代码	股票名称	成功申购日期	可流通日期	申购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
601398	工商银行	06-10-23	07-01-29	3.12	6.20	560,800	1,749,696.00	3,476,960.00
601333	广深铁路	06-12-18	07-03-22	3.76	7.20	309,980	1,165,524.80	2,231,856.00
601588	北辰实业	06-09-28	07-01-16	2.40	6.68	172,567	414,160.80	1,152,747.56
601006	大秦铁路	06-07-26	07-02-01	4.95	8.10	132,825	657,483.75	1,075,882.50
002073	青岛软控	06-09-28	07-01-18	26.00	47.35	22,360	581,360.00	1,058,746.00
002088	鲁阳股份	06-11-21	07-02-28	11.00	26.98	37,420	411,620.00	1,009,591.60
002097	山河智能	06-12-12	07-03-22	10.00	32.41	29,693	296,930.00	962,350.13
002080	中材科技	06-11-07	07-02-26	8.98	19.40	46,594	418,414.12	903,923.60
601628	中国人寿	06-12-28	07-01-09	18.88	18.88	47,000	887,360.00	887,360.00
002095	网盛科技	06-12-06	07-03-15	14.09	55.12	13,033	183,634.97	718,378.96
601628	中国人寿	06-12-28	07-04-09	18.88	18.88	35,280	666,086.40	666,086.40
002070	众和股份	06-09-20	07-01-12	8.84	13.80	29,626	261,893.84	408,838.80
合计							7,694,164.68	14,552,721.55

五、其他事项

截至2006年12月31日止,本基金投资于股票和债券的比例低于基金资产总值的80%。2006年末及2007年初,本基金处于连续净申购状态,并在2007年1月8日、11日、12日和16日分别出现了占资产净值比例达9.55%、6.66%、5.60%、13.70%的大金额净申购。经本基金连续调整投资组合,该比例已于2007年1月30日符合相关规定。

第七章 投资组合报告

一、报告期末基金资产组合情况

资产项目	金额(人民币元)	占基金资产总值比例
股票投资市值	22,776,529.05	13.12%
债券投资市值	92,910,756.67	53.50%
权证投资市值	915,500.00	0.53%
银行存款和清算备付金	54,765,230.65	31.53%
资产支持证券	0.00	0.00%
其他资产	2,290,147.20	1.32%
合计	173,658,163.57	100.00%

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

分 类	市值(人民币元)	占基金资产净值比例
A农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B采掘业	0.00	0.00%
C制造业	11,181,057.63	7.78%
C0食品、饮料	0.00	0.00%
C1纺织、服装、皮毛	408,838.80	0.28%
C2木材、家具	0.00	0.00%
C3造纸、印刷	0.00	0.00%
C4石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00%
C5电子	0.00	0.00%
C6金属、非金属	6,059,915.20	4.22%
C7机械、设备、仪表	4,712,303.63	3.28%
C8医药、生物制品	0.00	0.00%
C99其他制造业	0.00	0.00%
D电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00%
E建筑业	0.00	0.00%
F交通运输、仓储业	3,307,738.50	2.31%
G信息技术业	718,378.96	0.50%
H批发和零售贸易	0.00	0.00%
I金融、保险业	5,030,406.40	3.51%
J房地产业	2,538,947.56	1.77%
K社会服务业	0.00	0.00%
L传播与文化产业	0.00	0.00%
M综合类	0.00	0.00%
合 计	22,776,529.05	15.87%

三、按市值占基金资产净值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(股)	期末市值(人民币元)	市值占基金资产净值比例
1	601398	工商银行	560,800	3,476,960.00	2.42%
2	002073	青岛软控	56,810	2,689,953.50	1.87%
3	601333	广深铁路	309,980	2,231,856.00	1.56%
4	600019	宝钢股份	200,000	1,732,000.00	1.21%
5	601628	中国人寿	82,280	1,553,446.40	1.08%
6	000629	新钢钒	300,000	1,284,000.00	0.90%
7	601588	北辰实业	172,567	1,152,747.56	0.80%
8	000039	中集集团	60,000	1,130,400.00	0.79%
9	601006	大秦铁路	132,825	1,075,882.50	0.75%
10	600416	湘电股份	100,000	1,060,000.00	0.74%

四、报告期内股票投资组合重大变动

(一)报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值2%或前20名股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额(人民币元)	占期初基金资产净值的比例
1	000729	燕京啤酒	9,707,795.97	7.08%
2	600036	招商银行	8,615,368.68	6.29%
3	600196	复星医药	3,505,569.97	2.56%
4	000069	华侨城A	3,436,464.30	2.51%
5	601398	工商银行	3,387,696.00	2.47%
6	600019	宝钢股份	3,361,483.80	2.45%
7	600085	同仁堂	2,382,799.88	1.74%
8	600470	六国化工	2,266,945.23	1.65%
9	002073	青岛软控	2,219,897.01	1.62%
10	601006	大秦铁路	2,191,117.50	1.60%
11	600001	邯郸钢铁	2,137,535.14	1.56%
12	000024	招商地产	1,976,057.81	1.44%
13	600125	铁龙物流	1,953,028.30	1.43%
14	000002	万科A	1,892,035.53	1.38%
15	002045	广州国光	1,820,370.06	1.33%
16	600859	王府井	1,813,613.72	1.32%
17	600416	湘电股份	1,800,105.87	1.31%
18	600518	康美药业	1,739,572.06	1.27%
19	600177	雅戈尔	1,652,109.31	1.21%
20	601333	广深铁路	1,639,284.80	1.20%

(二)报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值2%或前20名股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额(人民币元)	占期初基金资产净值的比例
1	600036	招商银行	13,990,387.17	10.21%
2	000729	燕京啤酒	12,133,147.07	8.85%
3	600900	长江电力	5,739,466.44	4.19%
4	600196	复星医药	4,362,125.83	3.18%
5	000069	华侨城A	3,985,000.00	2.91%
6	000895	S双汇	3,222,468.74	2.35%
7	600018	上港集团	3,087,199.49	2.25%
8	600125	铁龙物流	3,026,817.03	2.21%
9	600177	雅戈尔	2,937,352.09	2.14%
10	600859	王府井	2,474,805.90	1.81%
11	600019	宝钢股份	2,336,534.56	1.71%
12	600085	同仁堂	2,302,773.63	1.68%
13	000002	万科A	2,282,046.79	1.67%
14	600518	康美药业	2,244,383.70	1.64%
15	600470	六国化工	2,225,373.47	1.62%
16	600001	邯郸钢铁	2,148,941.82	1.57%
17	600183	生益科技	2,137,122.56	1.56%
18	600050	中国联通	2,043,626.52	1.49%
19	600406	国电南瑞	1,985,092.34	1.45%
20	002045	广州国光	1,937,386.56	1.41%

(三)报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

项 目	金额(人民币元)
买入股票成本总额	109,224,221.28
卖出股票收入总额	134,901,492.71

五、报告期末按券种分类的债券投资组合

债券品种	市值(人民币元)	占基金资产净值比例
国 债	35,912,663.70	25.02%
金融债	29,778,000.00	20.75%
央行票据	0.00	0.00%
企业债	15,651,802.69	10.91%
可转债	11,568,290.28	8.06%
合 计	92,910,756.67	64.74%

六、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(人民币元)	占基金资产净值比例
1	20国债10	24,169,639.70	16.84%
2	06国开08	19,956,000.00	13.91%
3	05泰达债	9,997,484.39	6.97%
4	05工行03	9,822,000.00	6.84%
5	营港转债	6,694,000.00	4.66%

七、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

本基金期末未持有资产支持证券。

八、报告期末本基金投资权证明细

(一)报告期末持有权证明细

序号	权证名称	代码	数量(份)	市值(人民币元)	市值占基金净资产比例	获得方式
1	马钢CWB1	580010	200,000	341,600.00	0.24%	被动持有
2	钢钒GFC1	031002	300,000	573,900.00	0.40%	被动持有
合计				915,500.00	0.64%	

(二)报告期内获得权证明细

获取方式	权证代码	权证名称	数量(份)	成本总额(人民币元)
主动持有	无	无	0	0.00
被动持有	580006	雅戈QCB1	43,761	0.00
	580992	雅戈QCP1	306,328	0.00
	580997	招行CMP1	770,465	0.00
	580010	马钢CWB1	252,770	177,191.77
	580011	中化CWB1	94,650	895,114.13
	031002	钢钒GFC1	1,137,375	137,791.47

注:本基金本报告期内持有的权证马钢CWB1(580010)、中化CWB1(580011)和钢钒GFC1(031002)分别为申购马钢分离交易可转债(126001)、中化分离交易可转债(126002)和钢钒分离交易可转债(115001)时获配的权证。

九、投资组合报告附注

(一)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http://www.csfunds.com.cn网站的年度报告正文。

(二)报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(三)基金投资的前十名股票中,广深铁路、中国人寿、新钢钒按照本公司投资管理制度规定程序投资,其他股票均在基金合同规定备选股票库之内。

(四)报告期末基金其他资产的构成

其他资产项目	金额(人民币元)
交易保证金	710,000.00
应收利息	549,858.77
应收申购款	1,030,288.43
合 计	2,290,147.20

(五)报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

债券代码	债券名称	市值(人民币元)	占基金资产净值比例
110317	营港转债	6,694,000.00	4.66%
125822	海化转债	1,196,333.88	0.83%

(六)本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人在本报告期内未投资本基金。

第八章 基金份额持有人情况

一、报告期末基金份额持有人户数

报告期末基金份额持有人户数	6,471户
报告期末平均每户持有的基金份额	19,505.89份

二、报告期末基金份额持有人结构

项目	数量(份)	占总份额的比例
基金份额总额	126,222,587.34	100.00%
其中:机构投资者持有的基金份额	32,848,525.69	26.02%
个人投资者持有的基金份额	93,374,061.65	73.98%

第九章 开放式基金份额变动情况

本基金份额变动情况如下

单位:份

基金合同生效日(2003年10月25日)基金份额总额	925,088,683.98
本报告期期初基金份额总额	130,913,024.82
本报告期期间基金总申购份额	153,359,243.17
本报告期期间基金总赎回份额	158,049,680.65
本报告期期末基金份额总额	126,222,587.34

第十章 重大事件揭示

一、基金份额持有人大会决议情况:本基金在2006年度未召开基金份额持有人大会。

二、基金管理人高级管理人员的变更

根据长盛基金管理有限公司第三届董事会第九次会议决议,同意蒋月勤先生辞去公司总经理职务,聘任陈礼华先生担任公司总经理职务。陈礼华先生的总经理任职资格已获中国证监会核准(证监基金字[2006]52号文)。公告刊登于2006年4月10日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

经长盛基金管理有限公司第三届董事会第九次会议审议通过,决定聘任宋炳山先生担任公司副总经理,宋炳山先生任职资格已报中国证监会核准(证监基金字【2006】208号)。公告刊登于2006年11月23日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

三、本年度无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

四、根据证监基金字[2006]93号《关于证券投资基金投资资产支持证券有关事项的通知》(以下简称"《通知》")和长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同的规定,本基金可投资资产支持证券。《长盛中信全债指数增强型债券投资基金关于资产支持证券投资方案的公告》刊登于2006年8月16日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

根据中国证监会发布的《关于股权分置改革中证券投资基金投资权证有关问题的通知》和长盛基金管理有限公司旗下相关基金合同的规定,本基金将可能运用基金财产投资权证。公告刊登于2006年8月16日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

五、基金收益分配事项

根据《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》的有关规定,经基金管理人计算并由基金托管人中国农业银行复核,本基金年度内向本基金份额持有人实施了两次收益分配:2006年1月20日向全体基金份额持有人按每10份基金份额派发现金红利0.600元进行收益分配,公告刊登于2006年1月18日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站;2006年11月7日向全体基金份额持有人按每10份基金份额派发现金红利1.60元进行收益分配,公告刊登于2006年11月3日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

六、本基金聘请会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司,报告年度共支付审计费50,000.00元。普华永道中天会计师事务所有限公司已连续为本基金提供审计服务4年。

七、基金管理人、托管人及其高级管理人员无被监管部门稽查或处罚的情形。

八、基金招募说明书更新情况

根据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第5号<招募说明书的内容与格式>等有关法规以及《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》的要求,本基金管理人经与托管人协商,分别于2006年7月3日、2006年12月11日对本基金的招募说明书进行了更新,本基金更新的招募说明书摘要分别于2006年7月3日、2006年12月11日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》,同时本基金更新的招募说明书正文及摘要登载于公司的网站上。

九、本基金增加代销机构

(一)自2006年3月2日起,恒泰证券代理长盛中信全债指数增强型债券投资基金(基金代码为:前端510080,后端511080)的销售业务。公告刊登于2006年2月27日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

(二)自2006年12月8日起,招商银行代理长盛中信全债指数增强型债券投资基金(基金代码为:前端510080后端511080)的开户、申购和赎回等业务。公告刊登于2006年12月6日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

十、2006年6月28日,本公司发布了开通全国统一客户服务号码400-888-2666的公告。公告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

十一、本基金租用证券公司专用交易席位的有关情况

(一)根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》、《关于基金证券交易量分配限制有关规定的解释》的有关要求,我司按照选择证券经营机构的标准,经认真研究后,截至本报告期末本基金选择的交易席位如下

序号	证券公司名称	租用上海席位数量	租用深圳席位数量	合计
1	国元证券有限责任公司	1		1
2	中山证券有限责任公司		1	1
	合计	1	1	2

(二)本公司选择证券经营机构的标准

1、研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时为本公司提供高质量的咨询服务,包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等,并能根据基金投资的特定要求,提供专门研究报告。

2、资力雄厚,信誉良好。

3、财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定。

4、经营行为规范,最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

5、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。

6、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要,并能为本公司基金提供全面的信息服务。

(三)本公司租用基金专用席位的程序

1、研究机构提出服务意向,并提供相关研究报告;

2、研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定;

3、研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后,按照研究服务评价规定,对研究机构进行综合评价;

4、试用期满后,评价结果符合条件,双方认为有必要继续合作,经公司领导审批后,我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商席位租用协议》,并办理基金专用席位租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用;

5、本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价,若本公司认为签约机构的服务不能满足要求,或签约机构违规受到国家有关部门的处罚,本公司有权终止签署的协议,并撤销租用的席位;

6、席位租用协议期限为一年,到期后若双方没有异议可自动延期一年。

(四)2006年1-12月各券商股票年交易量及年佣金情况如下

单位:人民币元

公司名称	股票交易量(人民币元)	占交易量比例	佣金(人民币元)	占佣金比例
国元证券有限责任公司	137,367,559.76	68.28%	110,542.27	68.89%
中山证券有限责任公司	63,801,302.82	31.72%	49,924.90	31.11%
合计	201,168,862.58	100.00%	160,467.17	100.00%

(五)2006年1-12月各券商债券、回购交易量情况如下

单位:人民币元

公司名称	债券交易量(人民币元)	占交易量比例	回购交易量(人民币元)	占交易量比例
国元证券有限责任公司	91,089,039.40	76.30%	786,000,000.00	100.00%
中山证券有限责任公司	28,287,514.42	23.70%	0.00	0.00%
合计	119,376,553.82	100.00%	786,000,000.00	100.00%

(六)2006年1-12月各券商权证交易量情况如下

单位:人民币元

公司名称	权证交易量	占交易量比例
国元证券有限责任公司	1,284,919.50	42.81%
中山证券有限责任公司	1,716,323.75	57.19%
合 计	3,001,243.25	100.00%

(七)报告期内租用证券公司席位的变更情况

报告期内未有席位变更。

长盛基金管理有限公司
二〇〇七年三月二十九日