长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金 2006年年度报告摘要

基金管理人:长城基金管理有限公司　　基金托管人:招商银行股份有限公司

第一节 重要提示

长城久泰中信标普 300 指数证券投资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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2007 年 3 月 26 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。

第二节 基金简介

(一)基金基本情况

基金名称:长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金

基金简称:长城久泰

基金代码:200002(前端收费)\201002(后端收费)

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2004 年 5 月 21 日

报告期末基金份额总额:228,735,502.44 份

(二)基金投资基本情况

投资目标:以增强指数化投资方法跟踪目标指数,分享中国经济的长期增长,在严格控制与目标指数偏离风险的前提下,力争获得超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。

投资策略:(1)、资产配置策略:本基金为增强型指数基金,以中信标普 300 指数作为目标指数。除非因为分红或基金持有人赎回或申购等原因,本基金将保持相对固定的股票投资比例,通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术,控制与目标指数的跟踪误差,追求适度超越目标指数的收益。在正常情况下,本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90~95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%。(2)、股票投资策略:本基金的指数化投资采用分层抽样法,实现对中信标普 300 指数的跟踪,即按照中信标普 300 指数的行业配置比例构建投资组合,投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整。股票投资范围以中信标普 300 指数的成份股为主,少量补充流动性好、可能成为成份股的其他股票,并基于基本面研究进行有限度的优化调整。(3)债券投资策略:本基金债券投资部分以保证基金资产流动性、提高基金投资收益为主要目标,主要投资于到期日一年以内的政府债券等。

业绩比较基准:95%×中信标普 300 指数收益率+5%×银行同业存款利率。

风险收益特征:承担市场平均风险,获取市场平均收益。

(三)基金管理人

名称:长城基金管理有限公司

注册地址:深圳市福田区深南中路 2066 号华能大厦 25 层

办公地址:深圳市福田区深南中路 2066 号华能大厦 25 层

邮政编码:518031

法定代表人:杨光裕

信息披露负责人:彭洪波

联系电话:0755-83680399

传真:0755-83662600

电子邮箱:support@ccfund.com.cn

(四)基金托管人

名称:招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")

注册地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

邮政编码:518040

法定代表人:秦晓

信息披露负责人:姜然

联系电话:0755—83195226

传真:0755—83195201

电子邮箱:jiangran@cmbchina.com

(五) 信息披露方式

基金选定的信息披露报纸名称:证券时报、中国证券报、上海证券报

登载年度报告正文的管理人互联网网址:www.ccfund.com.cn

基金年度报告置备地点:深圳市福田区深南中路 2066 号华能大厦 25 层

第三节 主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

下述基金业绩指标不包括持有人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

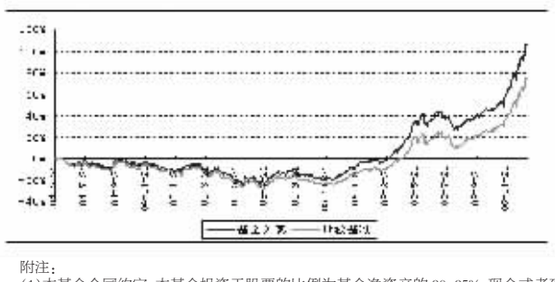
	2006年度	2005年度	2004年度(2004.5.21-2004.12.31)
1.基金本期净收益(元)	217,834,853.93	(101,550,487.53)	4,163,261.11
2.基金份额本期净收益(元)	0.4354	(0.0630)	0.0024
3.期末可供分配基金收益(元)	109,584,296.03	(153,325,521.84)	(181,917,647.44)
4.期末可供分配基金份额收益(元)	0.4791	(0.1248)	(0.0920)
5.期末基金资产净值(元)	458,841,366.60	1,075,277,567.07	1,796,315,918.93
6.期末基金份额净值(元)	2.0060	0.8752	0.9080
7.基金加权平均净值收益率	37.90%	(7.36%)	0.25%
8.本期基金份额净值增长率	135.48%	(3.61%)	(9.20%)
9.基金份额累计净值增长率	106.09%	(12.48%)	(9.20%)

(二)基金净值表现

1、长城久泰历史各时间段份额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 3 个月	44.09%	1.35%	40.99%	1.34%	3.10%	0.01%
过去 6 个月	45.54%	1.32%	42.28%	1.34%	3.26%	-0.02%
过去 1 年	135.48%	1.30%	114.36%	1.33%	21.12%	-0.03%
自基金合同生效起至今	106.09%	1.21%	74.47%	1.24%	31.62%	-0.03%

2、长城久泰累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

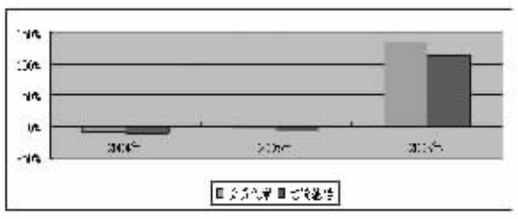


附注:

(1)本基金合同约定:本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90~95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%。本基金在投资运作中严格遵守了基金合同的约定。

(2)本基金业绩比较基准的选择符合基金合同、基金招募说明书的规定。

3、长城久泰净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



附注:本基金合同生效当年的净值增长率按当年实际存续期计算,计算期间为:2004 年 5 月 21 日至 2004 年 12 月 31 日。

(三)收益分配情况

年度	每 10 份基金份额分红数(单位:元)	备注
2006年	0.30	除息日:2006 年 4 月 25 日
2005年	无	
2004年	无	
合计	0.30	

第四节 管理人报告

(一) 基金管理人及基金经理情况

1、基金管理人简介

长城基金管理有限公司是由长城证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、西北证券有限责任公司、北方国际信托投资股份有限公司、中原信托投资有限公司共同发起设立,经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司,2001 年 12 月 27 日在深圳注册成立,注册资本为 1 亿元人民币。公司经营范围是发起设立基金、管理基金及中国证监会批准的其他业务。目前,公司管理的基金有封闭式基金:久富证券投资基金和久嘉证券投资基金;开放式基金:长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金。

2、基金经理简介

杨建华先生,1969 年出生,北京大学力学系理学学士,北京大学光华管理学院经济学硕士,注册会计师。曾就职于华为技术有限公司财务部、长城证券有限责任公司投资银行部,2001 年 10 月进入长城基金管理公司基金投资部任基金经理助理, 自 2004 年 5 月 21 日基金成立至今任"长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金"基金经理。

(二)基金运作遵规守信情况声明

本报告期内,本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为,严格按照《证券投资基金法》、《长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作,在控制和防范风险的前提下,为基金持有人谋求基金资产的长期稳定增值。长城久泰的投资运作遵守了有关法律法规的规定及基金合同的约定,无损害投资者利益的行为。

(三)投资策略和业绩表现说明及解释

2006 年可以称得上是国内证券市场的改革与发展年,各方面都面临前所未有的发展机遇。在这一年,股权分置改革基本完成,证券市场恢复了其固有的面貌,融资功能得以恢复,在大盘蓝筹股陆续回归后,A 股市场的总市值快速增加,成为全球发展最快、最具活力、最具吸引力的证券市场之一。同时,监管层也陆续推出包括管理层股权激励、对大股东违规占用上市公司资金加大清欠力度在内的配套措施,上市公司治理结构进一步完善,资产质量进一步提高。这些构成了国内证券市场长期健康发展的坚实基础。在人民币加速升值、货币流动性过剩、国际商品期货价格大幅攀升、国内宏观经济健康发展的大背景下,上述措施的成效逐步体现,上市公司的经营业绩总体上也重新步入上升轨道。不断上涨的指数和基金净值带来的财富效应激发了广大投资者的投资热情,基金发行规模迭创新高,上证综合指数在年底创出历史新高,中信标普 300 指数全年取得超过 120%的涨幅。

作为一只增强型指数基金,本基金严格遵循基金合同的各项规定,将跟踪目标指数、控制跟踪误差作为首要目标。本报告期内部分成份股由于股权分置改革而长时间停牌,早期完成股改的成份股随着部分受限制的流通股获准流通而导致其在目标指数中的权重发生变化,这些给本基金跟踪指数带来一定的困难。在增强操作方面,本基金继续秉承价值投资的理念,通过对成份股基本面的深入分析、估值水平的判断,重点超额配置了具有核心竞争力、完善的公司治理结构、业绩成长稳定可靠的成份股,并结合人民币升值等外部因素,根据市场资金偏好对成份股权重进行适度的动态调整。经过本基金管理人的努力,本报告期本基金获得了令人满意的投资回报,各项指标均比较理想。本报告期内,中信标普 300 指数涨幅为 122.75%,本基金比较基准涨幅为 114.36%,本基金净值增长率为 135.48%,超额收益为 21.12%,本报告期日累计跟踪误差为 0.1603%(年化指标为 2.483%),比较好地实现了控制跟踪误差、适度获得超过比较基准的投资目标。

(四)宏观经济、证券市场及行业走势简要展望

面向 2007 年,我们判断,国内宏观经济将继续保持又好又快的发展势头。在人民币预期平稳升值、外贸易顺差有望继续保持的情况下,国内货币资金流动性依然充沛。A 股市场经过 2006 年的大幅度攀升,短期内分析估值水平已经处于合理水平,未来的投资机会将主要来自上市公司业绩的增长,这种增长包括两种方式:一是依靠内生性的增长,上市公司可比业绩 2006 年前三个季度经历了下滑、持平、增长的转变,在公司治理结构不断完善、资产质量不断提高、管理层积极性被不断激发的情况下,在良好的宏观环境下,上市公司经营业绩 07 年有望保持快速增长;二是外延式增长,全流通的证券市场的魅力正在逐步显现,越来越多优秀的企业积极通过整体上市、注入优质资产、借壳上市等手段成为 A 股市场的中坚力量,上市公司的估值水平将变得更加有吸引力。2007 年 A 股市场还面临制度变革带来的投资机遇,融资融券、股指期货的推出、新会计准则的实施、所得税并轨预期等制度性的变革将催生新的投资机会。因此我们总体上判断,2007 年 A 股市场将更加活跃,总体上将呈现振荡攀升的态势。

本基金在 2007 年将继续按照基金合同的规定,努力控制跟踪偏差,争取获得适度超越目标指数的超额收益。我们相信,随着国内市场牛市格局的形成,指数化投资的优势将逐步显现,指数基金将获得更多的投资者的青睐,成为比较适合的投资方式之一。

第五节 托管人报告

托管人声明:在本报告期内,基金托管人不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

本报告期内基金管理人在投资运作、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,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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。

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的。

招商银行股份有限公司

2007 年 3 月 26 日

第六节 审计报告

深圳大华天诚会计师事务所为本基金出具了标准无保留意见的审计报告。

第七节 财务会计报告

(一)长城久泰年度会计报表(已经审计)

1、　长城久泰 2006 年 12 月 31 日及 2005 年 12 月 31 日的比较式资产负债表

单位:人民币元

资产	注释	期末数	期初数
资产:			
银行存款		10,211,452.71	56,248,883.32
清算备付金		140,000.00	93,616.41
交易保证金		1,080,000.00	1,750,000.00
应收证券清算款		-	29,113,158.20
应收股利		-	-
应收利息	1	8,173.27	16,649.71
应收申购款		20,602,985.50	32,505.00
其他应收款		144,735.92	-
股票投资市值		431,815,155.16	1,016,796,593.52
其中:股票投资成本		230,816,954.47	1,098,446,990.13
债券投资市值		-	1,943,317.60
其中:债券投资成本		-	1,944,671.94
权证投资市值		-	-
其中:权证投资成本		-	-
配股权证		-	-
买入返售证券		-	-
待摊费用		-	-
其他资产		-	-
合计		464,002,502.56	1,105,994,723.76
负债:			
应付证券清算款		1,597,557.09	-
应付赎回款		2,118,773.53	28,526,891.31
应付赎回费		7,990.14	107,513.51
应付管理人报酬		359,162.79	885,358.04
应付托管费		73,298.50	180,685.31
应付销售服务费		-	-
应付佣金	2	148,573.91	166,679.52
应付利息		-	-
应付收益		-	-
未交税金		-	-
其他应付款	3	751,280.00	750,029.00
卖出回购证券款		-	-
短期借款		-	-
预提费用	4	104,500.00	100,000.00
其他负债		-	-
负债合计		5,161,135.96	30,717,156.69
持有人权益:			
实收基金	5	228,735,502.44	1,228,603,088.91
未实现利得	6	120,521,568.13	(78,000,080.76)
未分配收益		109,584,296.03	(75,325,441.08)
持有人权益合计		458,841,366.60	1,075,277,567.07
负债及持有人权益合计		464,002,502.56	1,105,994,723.76
附注:每基金份额净值		2.0060	0.8752

2、　长城久泰本报告期及上年度可比期间的比较式经营业绩表

单位:人民币元

项目	注释	本期数	上期数
一、收入			
1.股票差价收入	7	194,008,387.56	(131,587,975.80)
2.债券差价收入	8	104,828.86	1,252,123.37
3.权证差价收入	9	21,016,886.04	11,435,145.74
4.债券利息收入		55,732.87	549,998.57
5.存款利息收入		338,324.13	765,322.46
6.股利收入		8,187,212.91	31,348,926.35
7.买入返售证券收入		-	-
8.其他收入	10	1,503,640.22	1,560,632.70
收入合计		225,215,012.59	(84,675,826.61)
二、费用			
1.基金管理人报酬		5,765,878.58	13,653,886.52
2.基金托管费		1,176,709.95	2,786,507.51
3.基金销售服务费		-	-
4.卖出回购证券支出		-	-
5.利息支出		-	-
6.其他费用	11	437,570.13	434,266.89
其中:上市年费		-	-
信息披露费		300,000.00	300,000.00
审计费用		100,000.00	100,000.00
费用合计		7,380,158.66	16,874,660.92
三、基金净收益		217,834,853.93	(101,550,487.53)
加:未实现利得		282,649,951.64	70,199,494.27
四、基金经营业绩		500,484,805.57	(31,350,993.26)

3、长城久泰本报告期及上年度可比期间的比较式收益分配表

单位:人民币元

项目	注释	本期数	上期数
本期基金净收益		217,834,853.93	(101,550,487.53)
加:期初未分配收益		(75,325,441.08)	6,219,949.06
本期损益平准金		(17,397,406.20)	20,005,097.39
可供分配基金净收益		125,112,006.65	(75,325,441.08)
减:本期已分配基金净收益	12	15,527,710.62	-
期末基金净收益		109,584,296.03	(75,325,441.08)

4、长城久泰本报告期及上年度可比期间的比较式基金净值变动表

单位:人民币元

项目	注释	本期数	上期数
一、期初基金净值		1,075,277,567.07	1,796,315,918.93
二、本期经营活动			
已实现基金净收益		217,834,853.93	(101,550,487.53)
未实现利得		282,649,951.64	70,199,494.27
经营活动产生的基金净值变动数		500,484,805.57	(31,350,993.26)
三、本期基金单位交易			
基金申购款		101,700,166.02	548,139,213.76
基金赎回款		1,203,093,461.44	(1,237,826,572.36)
基金单位交易产生的基金净值变动数		(1,101,393,295.42)	(689,687,358.60)
四、本期向持有人分配收益			
向持有人分配收益产生的基金净值变动数		(15,527,710.62)	-
五、期末基金净值		458,841,366.60	1,075,277,567.07

(二)长城久泰年度会计报表附注

货币单位:人民币元

附注 1. 基金基本情况

长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金(以下简称"本基金")系由长城基金管理有限公司发起,经中国证券监督管理委员会以"证监基金字[2004]51 号"《关于同意长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金设立的批复》核准,于 2004 年 5 月 21 日成立的契约型开放式证券投资基金,存续期限不定,首次设立募集规模为 1,512,020,891.32 份基金份额。基金管理人为长城基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

附注 2. 财务报表编制基准

本基金财务报表依照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《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 2 号-年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号-会计报表附注的编制及披露》及基金合同的规定编制和披露。

附注 3. 重要会计政策

本年度主要会计政策、会计估计与上年度报告相比发生变更的内容如下:

(1)基金资产的估值原则新增

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收盘价估值;未上市交易的权证投资按公允价估值。

(2)债券投资成本计价方法新增

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。

(3)权证投资成本计价方法新增

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。

附注 4. 重大会计差错的内容和更正金额

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

附注 5. 关联方关系及交易

1.关联方关系

关联方名称	与本基金关系
长城基金管理有限公司	本基金管理人及发起人、本基金管理人主要股东控制的机构、本基金注册与登记机构、本基金销售机构
招商银行股份有限公司	本基金托管人、本基金销售机构
长城证券有限责任公司	本基金管理人的主要股东、租赁交易席位
东方证券股份有限公司	本基金管理人的股东、租赁交易席位
西北证券有限责任公司	本基金管理人的股东、租赁交易席位
中原信托投资有限公司	本基金管理人的股东
北方国际信托投资股份有限公司	本基金管理人的股东
陕顺长城基金管理有限公司	本基金管理人主要股东控制的机构

2.关联方交易:

(1)本基金通过关联方席位进行的交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

关联方名称	项目	本期数		上期数	
		金额	占总额比例	金额	占总额比例
1.股票投资成交金额					
①长城证券有限责任公司	年成交量	429,073,668.19	28.80%	563,275,395.83	30.25%
②西北证券有限责任公司	年成交量	---	---	224,467,660.19	12.05%
③东方证券股份有限公司	年成交量	407,570,575.02	27.36%	489,572,104.95	26.29%
合计		836,644,243.21	56.16%	1,277,315,160.97	68.59%
2.债券投资成交金额					
①长城证券有限责任公司	年成交量	974,045.06	58.25%	55,732,379.60	23.27%
②西北证券有限责任公司	年成交量	---	---	159,168,668.70	66.46%
③东方证券股份有限公司	年成交量	698,129.90	41.75%	12,675,030.00	5.29%
合计		1,672,174.96	100.00%	227,576,078.30	95.02%
3.权证交易					
①长城证券责任有限公司	年成交量	13,269,779.48	62.45%	---	---
②西北证券有限责任公司	年成交量	---	---	3,998,298.19	34.96%
③东方证券股份有限公司	年成交量	1,044,719.70	4.92%	5,390,798.47	47.14%
合计		14,314,499.18	67.37%	9,389,096.66	82.10%
4.支付的佣金					
①长城证券有限责任公司	支付年佣金	344,699.57	28.66%	453,684.92	30.24%
②西北证券有限责任公司	支付年佣金	---	---	179,787.82	11.98%
③东方证券股份有限公司	支付年佣金	334,204.35	27.79%	401,320.99	26.75%
合计		678,903.92	56.45%	1,034,793.73	68.97%

*本基金对关联方席位交易佣金的计算方式及佣金比率与其他非关联方交易佣金的计算方式及佣金比率一致。

**佣金协议的服务范围:

除进行证券交易外,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)本基金支付的关联方报酬

关联方名称	本期数	上期数	计算标准	计算方式
长城基金管理有限公司	5,765,878.58	13,653,886.52	年费率 0.98%	按前一天基金资产净值乘以费率每天计提
招商银行股份有限公司	1,176,709.95	2,786,507.51	年费率 2‰	
合计	6,942,588.53	16,440,394.03		

(3)与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内,无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

(4)各关联方投资本基金的情况

A.本基金管理人本期投资本基金的情况

本基金管理人本期及上期均未投资本基金,期末也未持有本基金份额。

B.基金管理人主要股东及其控制的机构在期末持有本基金份额的情况

本基金管理人主要股东及其控制的其它机构本期末未持有本基金。

(5)关联方保管的银行存款余额

关联方名称	项目	期末数	期初数
招商银行股份有限公司	银行存款	10,211,452.71	56,248,883.32

(6)从关联方取得的利息收入

关联方名称	项目	本期数	上期数
招商银行股份有限公司	存款利息收入	319,363.33	744,940.02

(7)关联方往来款项余额

往来项目	关联方名称	经济内容	期末数	期初数
应付管理人报酬	长城基金管理有限公司	管理费	359,162.79	885,358.04
应付基金托管费	招商银行股份有限公司	托管费	73,298.50	180,685.31
应付佣金	长城证券有限责任公司	佣金	686.86	1,360.31
应付佣金	西北证券有限责任公司	佣金	---	5,098.88
应付佣金	东方证券股份有限公司	佣金	3,456.29	13,349.16
其他应付款	长城证券有限责任公司	代垫席位交易保证金	250,000.00	250,000.00
其他应付款	西北证券有限责任公司	代垫席位交易保证金	250,000.00	250,000.00
应收利息	招商银行股份有限公司	存款利息	7,816.87	13,446.32
合计			944,421.31	1,599,298.02

附注 6. 流通受限制不能自由转让的基金资产

本基金截至 2006 年 12 月 31 日止流通受限制不能自由转让的基金资产如下:

(1)因股权分置改革而暂时停牌的股票情况:

股票代码	股票名称	停牌日期	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末估值单价	期末估值总额	估值方法
000895	S双汇	2006-6-1	---	---	235,913	31.17	7,353,408.21	按股票停牌日的前一日市场收盘价估值
000423	S同胶	2006-12-2	---	---	95,149	13.69	1,302,589.81	
000554	S泰石油	2006-12-6	2007-2-12	6.10	101,810	5.81	591,516.10	
000731	S川美丰	2006-12-6	2007-1-15	12.76	37,575	12.15	456,536.25	
600102	莱钢股份	2006-9-20	2007-1-18	10.00	77,856	6.13	477,257.28	

(2)因配股而暂时停牌的股票情况:

股票代码	股票名称	停牌日期	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末估值单价	期末估值总额	估值方法
600601	方正科技	2006-12-22	2007-1-4	3.99	181,372	4.19	759,948.68	按股票停牌日的前一日市场收盘价估值

附注 7. 或有事项

本基金在本报告期内,无或有事项。

附注 8. 资产负债表日后事项

本基金在本报告期内,无资产负债表日后事项。

第八节 投资组合报告

(一) 期末基金资产组合情况

序号	资产项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	股票	431,815,155.16	93.06
2	债券	0.00	0.00
3	权证	0.00	0.00
4	银行存款和清算备付金合计	10,351,452.71	2.23
5	其他资产	21,835,894.69	4.71
	合计:	464,002,502.56	100.00

注:长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金于本报告期末, 有应收申购款 20,602,985.50 元,因此导致其持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金净资产的比例低于 5%。该资金已于 2007 年 1 月 4 日到账,到账后该比例已符合法律法规和基金合同的要求。

(二)期末按行业分类的股票投资组合

(1)本报告期末基金积极类股票投资按行业分类的投资组合:

分 类	市值(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	0.00	0.00
C0 食品、饮料	0.00	0.00
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00
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	0.00	0.00
C7 机械、设备、仪表	0.00	0.00
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	0.00	0.00
G 信息技术业	0.00	0.00
H 批发和零售贸易业	0.00	0.00
I 金融、保险业	4,327,532.27	0.94
J 房地产业	0.00	0.00
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	4,327,532.27	0.94

(2)本报告期末基金指数类股票投资按行业分类的投资组合:

分 类	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	1,127,641.28	0.25
B 采掘业	24,135,126.62	5.26
C 制造业	174,773,881.97	38.09
C0 食品、饮料	36,950,195.01	8.05
C1 纺织、服装、皮毛	4,848,218.17	1.06
C2 木材、家具	783,580.00	0.17
C3 造纸、印刷	2,315,868.84	0.50
C4 石油、化学、塑胶、塑料	16,007,679.27	3.49
C5 电子	4,423,692.74	0.96
C6 金属、非金属	54,354,280.94	11.85
C7 机械、设备、仪表	41,964,536.84	9.15
C8 医药、生物制品	11,783,634.87	2.57
C99 其他制造业	1,342,195.29	0.29
D 电力、煤气及水的生产和供应业	19,493,129.25	4.25
E 建筑业	2,984,801.79	0.65
F 交通运输、仓储业	28,187,767.51	6.14
G 信息技术业	25,253,793.27	5.50
H 批发和零售贸易业	20,354,234.52	4.44
I 金融、保险业	75,023,321.40	16.35
J 房地产业	29,830,847.16	6.50
K 社会服务业	6,257,562.31	1.36
L 传播与文化产业	3,013,608.52	0.66
M 综合类	17,051,907.29	3.72
合 计	427,487,622.89	93.17

(三)期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

(1)本报告期末基金积极投资类股票明细:

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600015	华夏银行	585,593	4,327,532.27	0.94

(注:报告期末基金共持有一种积极投资类股票)

(2)本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名指数投资类股票

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	占基金资产净值比例%
1	600016	民生银行	2,048,318	20,892,843.60	4.55
2	600030	中信证券	525,769	14,395,555.22	3.14
3	000002	万 科 A	906,309	13,993,410.96	3.05
4	600000	浦发银行	571,741	12,183,800.71	2.66
5	601398	工商银行	1,913,437	11,863,309.40	2.59
6	600019	宝钢股份	1,277,714	11,065,003.24	2.41
7	600050	中国联通	2,302,526	10,752,796.42	2.34
8	600028	中国石化	1,083,426	9,880,845.12	2.15
9	000001	S深发展 A	633,010	9,159,654.70	2.00
10	600900	长江电力	906,894	8,860,354.38	1.93

注:以上股票名称以 2006 年 12 月 29 日公布的股票简称为准。

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

(四) 投资组合的重大变动

1、本报告期内累计买入价值占期初基金资产净值比例由高到低前二十名股票明细如下:

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例(%)
1	600016	民生银行	26,524,485.96	2.47
2	000002	万 科 A	16,277,366.00	1.51
3	601398	工商银行	14,275,089.30	1.33
4	600028	中国石化	11,561,372.06	1.08
5	000063	中兴通讯	9,297,480.97	0.86
6	601988	中国银行	7,231,523.08	0.67
7	600320	振华港机	6,060,902.08	0.56
8	600030	中信证券	5,637,358.09	0.52
9	000069	华侨城 A	5,273,668.42	0.49
10	000402	金 融 街	5,218,139.84	0.49
11	601006	大秦铁路	4,842,230.31	0.45
12	600018	上港集团	3,357,426.01	0.31
13	000793	华闻传媒	3,158,868.26	0.29
14	600900	长江电力	2,656,485.08	0.25
15	600015	华夏银行	2,511,331.75	0.23
16	000652	泰达股份	2,490,471.07	0.23
17	600761	安徽合力	2,306,772.18	0.21
18	600688	S上石化	2,180,552.00	0.20
19	600256	广汇股份	2,145,097.81	0.20
20	600824	益民百货	2,016,819.94	0.19

2、本报告期内累计卖出价值占期初基金资产净值由高到低前二十名股票明细如下:

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值的比例(%)
1	600016	民生银行	58,054,450.08	5.40
2	000002	万 科 A	40,928,693.10	3.81
3	600028	中国石化	34,397,691.95	3.20
4	600900	长江电力	31,197,638.71	2.90
5	600019	宝钢股份	30,911,972.97	2.87
6	000063	中兴通讯	28,254,684.77	2.63
7	600000	浦发银行	27,842,797.03	2.59
8	600050	中国联通	27,623,847.47	2.57