

中信经典配置证券投资基金 2006 年年度报告摘要

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 期末市值(人民币元), 占基金资产净值比例, 期末市值(人民币元), 占基金资产净值比例. Lists top 20 stocks held by the fund.

以上未流通股票因处于网下申购锁定期间暂时未能调整,其期末估值净值是根据最近一个交易日在证券交易所上市交易前一股票的价格确定。

22. 资产负债表日后事项: 本基金以 2007 年 3 月 15 日为权益登记日,以 2007 年 3 月 16 日为除息日,于 2007 年 3 月 19 日向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利人民币 5.000 元,共派发红利人民币 671,030,748.00 元。

23. 或有事项: 截至资产负债表日,本基金并无需要披露的重大或有事项。

24. 承诺事项: 截至资产负债表日,本基金并无需要披露的重大承诺事项。

第八节 投资组合报告

Table with columns: 期末各类资产, 金额(单位:人民币元), 占基金总资产比例. Summary of the fund's asset composition.

“债券类资产”包括可转换债券、剩余持有期大于 365 天的国家债券、金融债券、央行票据和其他债券,以及本基金“短期金融工具”投资类别中持有期 365 天以内(包括 365 天)的国家债券、金融债券、央行票据和其他债券。

(二) 期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 行业分类, 期末市值(人民币元), 占基金资产净值比例. Industry breakdown of the fund's equity investments.

(三) 基金投资前十名股票明细

Table with columns: 证券代码, 证券名称, 持仓数量(股), 证券市值(人民币元), 市值占净值%. Top 10 stock holdings.

提示:投资者若欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊载于 http://fund.cs.ecitic.com 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和卖出金额前 20 名股票统计

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 期末市值(人民币元), 占基金资产净值比例. Top 20 stocks bought and sold.

(五) 期末按品种分类的债券组合

Table with columns: 品种分类, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例. Bond portfolio breakdown.

(六) 报告期末基金投资前五名明细

Table with columns: 证券代码, 证券名称, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例. Top 5 fund investments.

(七) 投资组合报告附注

1. 本基金本报告期前十大证券的发行主体均未被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2. 本基金本报告期前十大证券中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

3. 其他资产的构成

Table with columns: 资产项目, 金额(单位:人民币元). Other assets breakdown.

(8) 报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(9) 报告期末按公允价值计量的金融资产及负债的明细表

Table with columns: 权证代码, 权证名称, 类别, 数量(份), 成本. Warrant portfolio details.

第九节 基金份额持有人户数、持有人结构

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份), 占总份额比例. Shareholder structure.

(截止日期:2006 年 12 月 31 日)

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份), 占总份额比例. Shareholder structure.

(截止日期:2006 年 12 月 31 日)

第十节 开放式基金份额变动

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份). Open-ended fund share changes.

第十一节 重大事件揭示

(一) 本报告期没有举行基金份额持有人大会。

(二) 基金管理人及基金托管人的专门资产托管部门无重大变动。

(三) 基金管理人于 2006 年 10 月 26 日发布公告,经公司第一届董事会 2006 年第九次临时会议审议,同意陈清先生由于个人原因辞去中信基金管理有限责任公司副总经理职务。

2. 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,通过了委任张建强先生担任中国建设银行行长助理的议案;2006 年 10 月 20 日,中国建设银行股份有限公司 2006 年第一次临时股东大会,委任张建强先生为执行执行董事,同时担任副董事长。2006 年 7 月,常振明先生升任建行副董事长,执行董事及行长的职务。

3. 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”。

(四) 本报告期基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务没有发生诉讼事项。

(五) 本报告期基金会计核算没有变更。

(六) 本报告期基金审计机构变更:2006 年 12 月 29 日,本基金聘请安永华明会计师事务所作为本基金的审计事务所。

(七) 本基金基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

(八) 基金租用证券公司专用交易席位的情况

1. 本报告期内基金租用交易席位的情况

Table with columns: 证券公司名称, 股票投资成交金额, 占本期股票投资成交总额的比例. Brokerage usage for equity investments.

(六) 基金租用证券公司专用交易席位的情况

(七) 投资组合报告附注

1. 本基金本报告期前十大证券的发行主体均未被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2. 本基金本报告期前十大证券中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

3. 期末其他资产的构成

Table with columns: 资产项目, 金额(单位:人民币元). Other assets breakdown.

(8) 报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(9) 报告期末按公允价值计量的金融资产及负债的明细表

Table with columns: 权证代码, 权证名称, 类别, 数量(份), 成本. Warrant portfolio details.

第九节 基金份额持有人户数、持有人结构

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份), 占总份额比例. Shareholder structure.

(截止日期:2006 年 12 月 31 日)

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份), 占总份额比例. Shareholder structure.

(截止日期:2006 年 12 月 31 日)

第十节 开放式基金份额变动

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份). Open-ended fund share changes.

第十一节 重大事件揭示

(一) 本报告期没有举行基金份额持有人大会。

(二) 基金管理人及基金托管人的专门资产托管部门无重大变动。

(三) 基金管理人于 2006 年 10 月 26 日发布公告,经公司第一届董事会 2006 年第九次临时会议审议,同意陈清先生由于个人原因辞去中信基金管理有限责任公司副总经理职务。

2. 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,通过了委任张建强先生担任中国建设银行行长助理的议案;2006 年 10 月 20 日,中国建设银行股份有限公司 2006 年第一次临时股东大会,委任张建强先生为执行执行董事,同时担任副董事长。2006 年 7 月,常振明先生升任建行副董事长,执行董事及行长的职务。

3. 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”。

(四) 本报告期基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务没有发生诉讼事项。

(五) 本报告期基金会计核算没有变更。

(六) 本报告期基金审计机构变更:2006 年 12 月 29 日,本基金聘请安永华明会计师事务所作为本基金的审计事务所。

(七) 本基金基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

(八) 基金租用证券公司专用交易席位的情况

1. 本报告期内基金租用交易席位的情况

Table with columns: 证券公司名称, 股票投资成交金额, 占本期股票投资成交总额的比例. Brokerage usage for equity investments.

(六) 基金租用证券公司专用交易席位的情况

(七) 投资组合报告附注

1. 本基金本报告期前十大证券的发行主体均未被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2. 本基金本报告期前十大证券中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

3. 期末其他资产的构成

Table with columns: 资产项目, 金额(单位:人民币元). Other assets breakdown.

(8) 报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(9) 报告期末按公允价值计量的金融资产及负债的明细表

Table with columns: 权证代码, 权证名称, 类别, 数量(份), 成本. Warrant portfolio details.

第九节 基金份额持有人户数、持有人结构

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份), 占总份额比例. Shareholder structure.

(截止日期:2006 年 12 月 31 日)

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份), 占总份额比例. Shareholder structure.

(截止日期:2006 年 12 月 31 日)

第十节 开放式基金份额变动

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份). Open-ended fund share changes.

第十一节 重大事件揭示

(一) 本报告期没有举行基金份额持有人大会。

(二) 基金管理人及基金托管人的专门资产托管部门无重大变动。

(三) 基金管理人于 2006 年 10 月 26 日发布公告,经公司第一届董事会 2006 年第九次临时会议审议,同意陈清先生由于个人原因辞去中信基金管理有限责任公司副总经理职务。

2. 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,通过了委任张建强先生担任中国建设银行行长助理的议案;2006 年 10 月 20 日,中国建设银行股份有限公司 2006 年第一次临时股东大会,委任张建强先生为执行执行董事,同时担任副董事长。2006 年 7 月,常振明先生升任建行副董事长,执行董事及行长的职务。

3. 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”。

(四) 本报告期基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务没有发生诉讼事项。

(五) 本报告期基金会计核算没有变更。

(六) 本报告期基金审计机构变更:2006 年 12 月 29 日,本基金聘请安永华明会计师事务所作为本基金的审计事务所。

(七) 本基金基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

(八) 基金租用证券公司专用交易席位的情况

1. 本报告期内基金租用交易席位的情况

Table with columns: 证券公司名称, 股票投资成交金额, 占本期股票投资成交总额的比例. Brokerage usage for equity investments.

(六) 基金租用证券公司专用交易席位的情况

(七) 投资组合报告附注

1. 本基金本报告期前十大证券的发行主体均未被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2. 本基金本报告期前十大证券中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

3. 期末其他资产的构成

Table with columns: 资产项目, 金额(单位:人民币元). Other assets breakdown.

(8) 报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(9) 报告期末按公允价值计量的金融资产及负债的明细表

Table with columns: 权证代码, 权证名称, 类别, 数量(份), 成本. Warrant portfolio details.

第九节 基金份额持有人户数、持有人结构

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份), 占总份额比例. Shareholder structure.

(截止日期:2006 年 12 月 31 日)

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份), 占总份额比例. Shareholder structure.

(截止日期:2006 年 12 月 31 日)

第十节 开放式基金份额变动

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份). Open-ended fund share changes.

第十一节 重大事件揭示

(一) 本报告期没有举行基金份额持有人大会。

(二) 基金管理人及基金托管人的专门资产托管部门无重大变动。

(三) 基金管理人于 2006 年 10 月 26 日发布公告,经公司第一届董事会 2006 年第九次临时会议审议,同意陈清先生由于个人原因辞去中信基金管理有限责任公司副总经理职务。

2. 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,通过了委任张建强先生担任中国建设银行行长助理的议案;2006 年 10 月 20 日,中国建设银行股份有限公司 2006 年第一次临时股东大会,委任张建强先生为执行执行董事,同时担任副董事长。2006 年 7 月,常振明先生升任建行副董事长,执行董事及行长的职务。

3. 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”。

(四) 本报告期基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务没有发生诉讼事项。

(五) 本报告期基金会计核算没有变更。

(六) 本报告期基金审计机构变更:2006 年 12 月 29 日,本基金聘请安永华明会计师事务所作为本基金的审计事务所。

(七) 本基金基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

(八) 基金租用证券公司专用交易席位的情况

1. 本报告期内基金租用交易席位的情况

Table with columns: 证券公司名称, 股票投资成交金额, 占本期股票投资成交总额的比例. Brokerage usage for equity investments.

(六) 基金租用证券公司专用交易席位的情况

(七) 投资组合报告附注

1. 本基金本报告期前十大证券的发行主体均未被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2. 本基金本报告期前十大证券中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

3. 期末其他资产的构成

Table with columns: 资产项目, 金额(单位:人民币元). Other assets breakdown.

(8) 报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(9) 报告期末按公允价值计量的金融资产及负债的明细表

Table with columns: 权证代码, 权证名称, 类别, 数量(份), 成本. Warrant portfolio details.

第九节 基金份额持有人户数、持有人结构

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份), 占总份额比例. Shareholder structure.

(截止日期:2006 年 12 月 31 日)

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份), 占总份额比例. Shareholder structure.

(截止日期:2006 年 12 月 31 日)

第十节 开放式基金份额变动

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份). Open-ended fund share changes.

第十一节 重大事件揭示

(一) 本报告期没有举行基金份额持有人大会。

(二) 基金管理人及基金托管人的专门资产托管部门无重大变动。

(三) 基金管理人于 2006 年 10 月 26 日发布公告,经公司第一届董事会 2006 年第九次临时会议审议,同意陈清先生由于个人原因辞去中信基金管理有限责任公司副总经理职务。

2. 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,通过了委任张建强先生担任中国建设银行行长助理的议案;2006 年 10 月 20 日,中国建设银行股份有限公司 2006 年第一次临时股东大会,委任张建强先生为执行执行董事,同时担任副董事长。2006 年 7 月,常振明先生升任建行副董事长,执行董事及行长的职务。

3. 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”。

(四) 本报告期基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务没有发生诉讼事项。

(五) 本报告期基金会计核算没有变更。

(六) 本报告期基金审计机构变更:2006 年 12 月 29 日,本基金聘请安永华明会计师事务所作为本基金的审计事务所。

(七) 本基金基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

(八) 基金租用证券公司专用交易席位的情况

1. 本报告期内基金租用交易席位的情况

Table with columns: 证券公司名称, 股票投资成交金额, 占本期股票投资成交总额的比例. Brokerage usage for equity investments.

(六) 基金租用证券公司专用交易席位的情况

(七) 投资组合报告附注

1. 本基金本报告期前十大证券的发行主体均未被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2. 本基金本报告期前十大证券中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

3. 期末其他资产的构成

Table with columns: 资产项目, 金额(单位:人民币元). Other assets breakdown.

(8) 报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(9) 报告期末按公允价值计量的金融资产及负债的明细表

Table with columns: 权证代码, 权证名称, 类别, 数量(份), 成本. Warrant portfolio details.

第九节 基金份额持有人户数、持有人结构

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份), 占总份额比例. Shareholder structure.

(截止日期:2006 年 12 月 31 日)

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份), 占总份额比例. Shareholder structure.

(截止日期:2006 年 12 月 31 日)

第十节 开放式基金份额变动

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份). Open-ended fund share changes.

第十一节 重大事件揭示

(一) 本报告期没有举行基金份额持有人大会。

(二) 基金管理人及基金托管人的专门资产托管部门无重大变动。

(三) 基金管理人于 2006 年 10 月 26 日发布公告,经公司第一届董事会 2006 年第九次临时会议审议,同意陈清先生由于个人原因辞去中信基金管理有限责任公司副总经理职务。

2. 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,通过了委任张建强先生担任中国建设银行行长助理的议案;2006 年 10 月 20 日,中国建设银行股份有限公司 2006 年第一次临时股东大会,委任张建强先生为执行执行董事,同时担任副董事长。2006 年 7 月,常振明先生升任建行副董事长,执行董事及行长的职务。

3. 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”。

(四) 本报告期基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务没有发生诉讼事项。

(五) 本报告期基金会计核算没有变更。

(六) 本报告期基金审计机构变更:2006 年 12 月 29 日,本基金聘请安永华明会计师事务所作为本基金的审计事务所。

(七) 本基金基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

(八) 基金租用证券公司专用交易席位的情况

1. 本报告期内基金租用交易席位的情况

Table with columns: 证券公司名称, 股票投资成交金额, 占本期股票投资成交总额的比例. Brokerage usage for equity investments.

(六) 基金租用证券公司专用交易席位的情况

(七) 投资组合报告附注

1. 本基金本报告期前十大证券的发行主体均未被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2. 本基金本报告期前十大证券中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

3. 期末其他资产的构成

Table with columns: 资产项目, 金额(单位:人民币元). Other assets breakdown.

(8) 报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(9) 报告期末按公允价值计量的金融资产及负债的明细表

Table with columns: 权证代码, 权证名称, 类别, 数量(份), 成本. Warrant portfolio details.

第九节 基金份额持有人户数、持有人结构

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份), 占总份额比例. Shareholder structure.

(截止日期:2006 年 12 月 31 日)

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份), 占总份额比例. Shareholder structure.

(截止日期:2006 年 12 月 31 日)

第十节 开放式基金份额变动

Table with columns: 序号, 项目, 份额(份). Open-ended fund share changes.

第十一节 重大事件揭示

(一) 本报告期没有举行基金份额持有人大会。

(二) 基金管理人及基金托管人的专门资产托管部门无重大变动。

(三) 基金管理人于 2006 年 10 月 26 日发布公告,经公司第一届董事会 2006 年第九次临时会议审议,同意陈清先生由于个人原因辞去中信基金管理有限责任公司副总经理职务。

2. 2