同盛证券投资基金 2006年半年度报告摘要

重要提示

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同盛证券投资基金（以下简称“本基金”）2006年半年度报告（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。本半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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2005年8月25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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告会计期间：2006年1月1日至2006年6月30日，本报告期的财务资料未经审计。

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。

第一章 基金简介

一、基金产品概况

（一）基金简称：基金同盛

（二）交易代码：184699

（三）基金运作方式：契约型封闭式

（四）基金合同生效日：1999年11月5日

（五）2006年6月30日基金份额总额：30亿份

（六）基金合同存续期：1999年11月5日至2014年11月4日，共15年

（七）基金份额上市的证券交易所：深圳证券交易所

（八）基金上市日期：1999年11月26日

二、基金产品说明

（一）投资目标

本基金属于成长价值复合型基金，主要投资于业绩能够持续高速增长的成长型上市公司和市场价值被低估的价值型上市公司，利用成长型和价值型两种投资方法的复合效果更好地分散和控制风险，实现基金资产的稳定增长。

（二）投资策略

1、资产配置策略

投资决策委员会根据市场发展情况，确定在一段时间内市场发展的总体趋势，并在此基础上确定股票和国债的配置比例以及股票投资中成长型投资和价值型投资的配置比例。当判断后市多头特征明显时，成长型股票最多可增持至股票投资总额的70%，相应地，价值型股票可减持到股票投资总额的30%；反之，当判断后市空头特征明显时，价值型股票最多可增持到股票投资总额的70%，相应地，成长型股票可减持到股票投资总额的30%。

2、股票投资策略

（1）成长型股票的主要特征是业绩保持高速增长，因此本基金在选择成长型股票进行投资时主要考虑以下几方面：

①预期未来几年公司净利润的增长速度高于同行业平均水平；

②公司主营业务利润（含与主营业务性质相同或相似的投资收益）占利润总额的比例大于70%；

③保持一定净资产收益率的前提下，预期公司未来几年的股本扩张速度高于市场平均水平；

④属于ST及低价重组板块，但预期其发展将发生积极变化，从而使公司未来盈利能力有实质性改善；

⑤公司在管理、科研开发、营销网络、对资源或市场的垄断等方面具有优势。

（2）价值型股票的主要特征是市场价值的低估，因此本基金在选择价值型股票进行投资时主要考虑以下几方面：

①相对于公司自身的盈利能力或资产质量，公司账面价值与市场价值之比大于市场平均水平（即市净率小于市场平均水平）；

②公司市盈率低于行业或市场平均水平，但价值被低估并非由于公司基本面情况的不利变化，而是由于某些突发事件或不利传言等短期因素的影响；

③具有隐蔽资产（有形或无形资产）。

根据对上市公司上述若干方面的分析，确定成长型和价值型股票的初选范围，并在此基础上，对每只股票进行个案分析，确定其基本投资价值（成长/价值投资特征）。在投资时，按投资决策委员会确定的成长型投资和价值型投资的配置比例，分别选取成长型特征最明显的股票和价值型特征最明显的股票进行组合投资。

由于我国证券市场发展时间较短，相关数据的数量和可比性均不理想，很难像西方成熟市场运用大量的统计数据对成长型和价值型股票进行严格的定量分析，因此本基金主要运用经验的、定性的标准来对成长型股票和价值型股票进行界定；但在实际操作中，也将会尽可能建立起量化指标体系。

（三）业绩比较基准

无。

（四）风险收益特征

无。

三、基金管理人

（一）法定名称：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）法定名称：中国银行股份有限公司

（二）信息披露负责人：宁敏

（三）联系电话：010-66594977

（四）传真：010-66594942

（五）电子邮箱：tgxxpl@bank-of-china.com

五、信息披露

（一）登载半年度报告正文的管理人互联网网址：

http://www.csfunds.com.cn

（二）基金半年度报告置备地点：本报告分别置备于基金管理人和基金托管人的办公地址，以及基金上市交易的证券交易所，供公众查阅、复制。

第二章 主要财务指标和基金净值表现

所述基金业绩指标不包括基金份额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

序号	主要财务指标	2006年上半年度
1	基金本期净收益（元）	387,323,985.74
2	基金份额本期净收益（元/份）	0.1291
3	期末可供分配基金收益（元）	170,236,902.40
4	期末基金资产净值（元）	3,846,571,788.00
5	期末基金份额净值（元/份）	1.2822
6	本期基金份额净值增长率	36.88%

二、基金净值表现

（一）本基金历史各时间段基金份额净值增长率

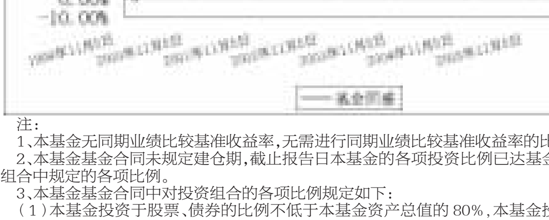
阶段	净值增长率（1）	净值增长率标准差（2）
过去一个月	2.19%	0.0361
过去三个月	23.81%	0.0324
过去六个月	36.88%	0.0247
过去一年	46.60%	0.0208
过去三年	30.90%	0.0214
自基金成立起至今	61.04%	0.0202

注：本基金无同期业绩比较基准收益率

（二）自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况

基金同盛累计份额净值增长率历史走势图

（1999年11月5日至2006年6月30日）



注：

1、本基金无同期业绩比较基准收益率，无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。

2、本基金基金合同未规定建仓期，截止报告日本基金的各项投资比例已达基金合同投资组合中规定的各项比例。

3、本基金基金合同中对投资组合的各项比例规定如下：

（1）本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的80%，本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%；

（2）本基金持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的10%；

（3）本基金与由本基金管理人管理的其它基金持有一家上市公司发行证券的总和，不得超过该证券总股本的10%；

（4）本基金遵守中国证监会规定的其它比例限制。

第三章 管理人报告

一、基金管理人及基金经理介绍

（一）基金管理人

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6月30日，基金管理人共管理四支封闭式基金、四支开放式基金，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

林继东先生，1966年出生，1995毕业于比利时LIMBURG大学，获工商管理硕士学位（MBA）。1997年开始从事证券业务，历任南方证券研究所研究员、中信证券交易部投资经理等职。2003年4月加入长盛基金管理有限公司，先后担任基金同德基金经理、基金同盛基金经理。现任本基金基金经理。

二、报告期内本基金运作的遵规守信情况说明

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、《同盛证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。

三、报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

（一）行情回顾及运作分析

上半年，宏观经济保持强劲的增长势头，工业企业利润增速逐月回升，投资增速不断加快。外汇储备的大幅增长为经济增长提供了宽松的货币环境，信贷投放完成全年计划的87%，人民币升值逐渐加快，经济增长出现过快苗头。央行货币政策开始收紧，国家酝酿进一步的宏观调控措施。

股票市场上半年出现了快速上涨，上证综合指数上涨44.02%，食品饮料、有色金属、机械、商业等板块涨幅超过100%，通信、电力、钢铁、交通运输等板块涨幅低于大盘。整体来看，宏观经济的快速增长以及股权分置改革带来的制度性变化奠定了股市上涨的基础，“寻宝游戏”带来的财富效应引导大量场外资金纷纷涌入，食品饮料、商业、装备制造业等稳定增长类公司不断受到市场的追捧，钢铁、地产等行业的公司在宏观调控预期下表现平平，有色金属板块受国际金属价格影响股价发生大幅波动，石化板块在成品油改革以及股改预期的作用下表现也相当不错。随着股改的推进，短期缺乏业绩支撑、未来有较快增长预期的军工、滨海新区、资产重组等板块逐渐成为市场的热点，资金推动型市场特征显现。新老划断后的快速扩容以及金融创新的推出预期成为左右市场发展的主要因素。

本基金自去年底就做出看多大势的判断，因此在保持较高仓位的前提下，不断增强组合的进攻性，积极进行结构调整，一季度及时增加了对地产、传媒等优质个股的配置，二季度及时增加了对零售、食品饮料等优质个股的配置，同时利用市场整体上扬的有利时机，逐步减持了一些累计涨幅较大的个股。由于行情变化较快，同时又受到流动性的影响，在部分板块投资思路的调整上还是略显迟缓，如有色金属、机械等板块，今后我们将通过持续研究与综合判断加以弥补。

（二）本基金业绩表现

截止2006年6月30日，本基金份额净值为1.2822元，上半年份额净值增长率为36.88%，同期上证指数涨幅为44.02%，本基金弱于上证指数的表现。

四、对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国际经济快速增长的背景下，中国经济保持快速增长有其必然性，宏观调控不会改变经济的增长势头，国际产业的转移、人民生活水平的提高以及城市建设的不断加快是推进中国经济增长的主要动力，短期波动不会改变经济增长的中长期趋势。

随着市场强势板块的不断上涨，市场的整体估值风险不断集聚，资金推动特征明显。虽然投资人的长期信心已经确立，场外资金入市愿望强烈，但理性估值与牛市情绪困扰着主流资金的投资方向，市场将在这个位置进行震荡调整，阶段性利空释放后市场仍将保持长期向上趋势。当前市场应该主要观察的三个因素是：一、国际经济特别是OECD国家经济增长的趋势；二、国家可能出台的进一步宏观调控措施；三、IPO和再融资的速度。我们认为，市场的上涨需要真实业绩的支撑，成长性已经并将一直成为市场发展的主线。

在投资策略方面，以成长性为主线，进行自下而上的选股策略将进一步强化，同时我们将密切关注在国家相关汇率和产业政策下可能得到快速发展的产业，仔细研究在人民币长期升值背景下各行业国际竞争力的变化趋势，适当参与其中业绩可能出现快速增长的公司。具体来看，第一类重点关注稳定增长类公司，包括品牌中药、高档白酒等品牌消费品、商业零售行业中的优势企业、银行等服务业以及具有自主创新能力的制造业企业；第二类重点关注业绩出现反转迹象的部分周期性行业和成本压力减缓的中下游行业，如钢铁、电解铝、机械制造的部分子行业等；第三类是金融衍生品的推出对于大盘蓝筹股公司的战略价值提升而引发的获利机会。此外，我们也不会轻易放弃资产重组、军工、铁路、滨海新区等主题投资可能带来的投资机会。个股选择上，将以成长性为主线对组合进行不断的梳理，除了继续持有部分现有的优质公司外，将更加积极主动地挖掘在各种因素作用下、经营基本面有望出现大幅改善且估值偏低的公司，动态调整组合的进攻性与防守性。

第四章 托管人报告

本基金托管人中国银行股份有限公司依据《同盛证券投资基金基金合同》与《同盛证券投资基金托管协议》，自1999年11月5日起托管同盛证券投资基金（以下称“基金同盛”或“本基金”）的全部资产。现根据《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3号<半年度报告的内容与格式>》及其他相关规定，出具本托管人报告。

一、本托管人在托管本基金期间，严格遵守《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》和本基金合同以及托管协议的规定，诚信地履行了基金托管人的职责，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

（一）本托管人履行安全保管基金资产的全部资产的职责，保证基金资产与自有资产等非基金资产严格分开，维护基金的独立账户，与本托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行了严格的分账管理。

（二）本托管人严格根据《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》和本基金合同以及托管协议的规定执行基金管理人的投资指令，及时、准确地完成了本基金的各项资金清算交割。本托管人对于本基金的任何资产的运用、处分和分配，均具备正当依据。

（三）本托管人对与本基金资产相关的重大合同原件、因履行基金托管人职责而生成或收悉的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

二、本托管人在2006年上半年度依照《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》、《同盛证券投资基金基金合同》及《同盛证券投资基金托管协议》对长盛基金管理有限公司管理的本基金的运作进行了必要的监督。

（一）其在基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面遵守了《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》、《证券投资基金会计核算办法》、本基金合同以及托管协议的规定；未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

（二）本托管人如实、及时、独立地向中国证监会提交了关于本基金投资运作方面的报告。

三、本托管人认真复核了本半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、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

中国银行股份有限公司
2006年8月25日

第五章 财务会计报告

一、基金会计报表（未经审计）

（一）资产负债表

同盛证券投资基金资产负债表

单位：人民币元

项 目	2006年6月30日	2005年12月31日
资产		
银行存款	19,646,555.56	292,286,294.19
清算备付金	9,617,452.91	1,832,115.82
交易保证金	1,083,095.19	965,453.60
应收证券清算款	31,779,849.77	0.00
应收股利	37,497.06	0.00
应收利息	8,366,566.82	9,558,704.23
应收申购款	0.00	0.00
其他应收款	0.00	0.00
股票投资市值	3,041,378,243.97	1,960,319,172.28
其中：股票投资成本	2,361,559,215.52	1,933,724,773.73
债券投资市值	786,800,080.49	589,470,504.19
其中：债券投资成本	790,284,223.34	588,921,063.37
权证投资	0.00	0.00
其中：权证投资成本	0.00	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	3,898,709,341.77	2,854,432,244.31
负债及持有人权益		
负债		
应付证券清算款	0.00	37,203,085.25
应付赎回款	0.00	0.00
应付赎回费	0.00	0.00
应付管理人报酬	4,544,184.53	3,461,907.45
应付托管费	757,364.08	576,984.59
应付销售服务费	0.00	0.00
应付佣金	2,628,348.33	1,058,443.33
应付利息	1,860.00	0.00
应付收益	0.00	0.00
未交税金	0.00	0.00
其他应付款	1,980,167.66	1,980,067.66
卖出回购证券款	42,000,000.00	0.00
短期借款	0.00	0.00
预提费用	225,629.17	95,000.00
其他负债	0.00	0.00
负债合计	52,137,553.77	44,375,488.28
持有人权益		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未实现利得	676,334,885.60	27,143,839.37
未分配收益	170,236,902.40	-217,087,083.34
持有人权益合计	3,846,571,788.00	2,810,056,756.03
负债及持有人权益总计	3,898,709,341.77	2,854,432,244.31
基金份额净值（元/份）	1.2822	0.9367

（二）经营业绩表及收益分配表

同盛证券投资基金经营业绩表

单位：人民币元

项 目	2006年上半年度	2005年上半年度
收 入	416,055,106.17	-62,756,053.53
股票差价收入	361,164,101.42	-104,855,298.79
债券差价收入	-653,777.42	-3,158,247.09
权证差价收入	5,867,647.75	0.00
债券利息收入	9,539,913.36	9,191,550.10
存款利息收入	884,391.51	1,964,961.37
股利收入	39,252,249.55	34,073,794.70
买入返售证券收入	0.00	14,000.00
其他收入	580.00	13,186.18
费 用	28,731,120.43	23,995,803.62
基金管理人报酬	24,162,488.28	20,201,084.36
基金托管费	4,027,081.42	3,366,847.45
基金销售服务费	0.00	0.00
卖出回购证券支出	299,058.52	181,700.38
利息支出	0.00	0.00
其他费用	242,492.21	246,171.43
其中：上市年费	29,752.78	29,752.78
信息披露费	148,767.52	148,767.52
审计费用	47,108.87	52,068.27
基金净收益	387,323,985.74	-86,751,857.15
加：未实现利得	649,191,046.23	-6,916,384.06
基金经营业绩	1,036,515,031.97	-93,668,241.21

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（例如，交易佣金等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

同盛证券投资基金基金收益分配表

单位：人民币元

项 目	2006年上半年度	2005年上半年度
本期基金净收益	387,323,985.74	-86,751,857.15
加：期初基金净收益	-217,087,083.34	-97,216,559.66
可供分配基金净收益	170,236,902.40	-183,968,416.81
减：本期已分配基金净收益	0.00	0.00
期末基金净收益	170,236,902.40	-183,968,416.81

（三）基金净值变动表

同盛证券投资基金基金净值变动表

单位：人民币元

项 目	2006年上半年度	2005年上半年度
期初基金净值	2,810,056,756.03	2,717,356,801.26
本期经营活动		
基金净收益	387,323,985.74	-86,751,857.15
未实现利得	649,191,046.23	-6,916,384.06
经营活动产生的基金净值变动数	1,036,515,031.97	-93,668,241.21
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	0.00	0.00
期末基金净值	3,846,571,788.00	2,623,688,560.05

二、会计报表附注（未经审计）

（一）主要会计政策、会计估计及其变更

本基金半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

（二）本报告期重大会计差错的内容和更正金额：无。

（三）本报告期关联方关系发生变化的情况，本报告期及上年度可比期间的关联方交易

1、关联方关系发生变化的情况：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	基金发起人、基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
国元证券有限责任公司（“国元证券”）	基金发起人、基金管理人股东
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金发起人
长江证券有限责任公司	基金发起人
天津北方国际信托投资股份有限公司	基金发起人
安徽省创新投资有限公司	基金管理人股东
安徽省投资集团有限责任公司	基金管理人股东

2、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）通过关联方的席位进行的证券交易及交易佣金

①通过关联方的席位进行的证券交易 单位：人民币元

项目	2006上半年度		2005上半年度	
	成交量	占半年成交量的比例	成交量	占半年成交量的比例
国元证券：				
买卖股票	1,199,788,470.97	24.97%	671,497,687.61	29.62%
买卖债券	89,491,905.80	38.12%	35,812,884.89	16.45%
债券回购	632,000,000.00	91.65%	200,000,000.00	33.33%
买卖权证	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中信证券：				
买卖股票	677,915,167.06	14.11%	203,769,198.53	8.99%
买卖债券	23,105,504.40	9.84%	0	0.00%
债券回购	0.00	0.00%	0.00	0.00%
买卖权证	0.00	0.00%	0.00	0.00%

②通过关联方的席位进行的证券交易佣金 单位：人民币元

项目	2006年上半年度		2005年上半年度	
	佣金	占半年佣金总量的比例	佣金	占半年佣金总量的比例
中信证券股份有限公司	540,048.87	13.96%	159,451.01	8.75%
国元证券有限责任公司	955,747.87	24.71%	539,085.43	29.57%
合计	1,495,796.74	38.67%	698,536.44	38.32%

上述佣金按市场佣金率计算，并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。

向关联方支付的交易佣金采用公允的交易佣金比率计算。关联方席位租用合同范围还包括佣金收取方法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基金管理报酬：基金管理费

A、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为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

B、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；并于次月两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

C、本基金于2006年上半年度应支付基金管理费共计人民币24,162,488.28元（2005年上半年度应支付人民币20,201,084.36元），其中已支付基金管理人管理费人民币19,618,303.75元，尚余人民币4,544,184.53元未支付。

②基金托管人报酬：基金托管费

A、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为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

B、基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；于次月两个工作日内从基金资产中一次性支取。

C、本基金2006年上半年度应支付基金托管费共计人民币4,027,081.42元（2005年上半年度应支付人民币3,366,847.45元），其中已支付基金托管人托管费人民币3,269,717.34元，尚余人民币757,364.08元未支付。

（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银行股份有限公司保管，并按银行间同业存款利率计息，本报告期由基金托管人保管的银行存款余额及产生的利息收入情况如下：

单位：人民币元

项 目	2006年6月30日
银行存款余额	19,646,555.56
	2006上半年度
银行存款产生的利息收入	849,632.70

（4）与关联方银行间同业市场的债券（含回购）交易 单位：人民币元

中国银行股份有限公司	2006年上半年度	2005年上半年度
卖出回购证券		
本期交易量	0.00	0.00
期末余额	0.00	0.00
本期支出	0.00	0.00
债券买卖交易		
本期购入交易量	80,905,677.27	0.00
本期卖出交易量	20,987,771.78	0.00

（5）基金各关联方投资本基金的情况

①基金管理人所持有的本基金份额

项 目	2006年上半年度	2005年上半年度
期初持有基金份额（份）	6,000,000	6,000,000
本期增加（份）	0.00	0.00
本期减少（份）	0.00 0.00	0.00
期末持有基金份额（份）	6,000,000	6,000,000
其中作为发起人持有份额（份）	6,000,000	6,000,000

②基金其他关联方及其控制的机构所持有的本基金份额

关联方名称	2006年6月30日		2005年6月30日	
	持有基金份额（份）	占基金总份额比例	持有基金份额（份）	占基金总份额比例
国元证券有限责任公司	3,000,000	0.10%	3,000,000	0.10%
中信证券股份有限公司	3,000,000	0.10%	5,049,800	0.17%
长江证券有限责任公司	3,000,000	0.10%	3,000,000	0.10%
北方国际信托投资股份有限公司	3,000,000	0.10%	3,000,000	0.10%

（四）报告期流通受限制不能自由转让的基金资产

1、因股权分置改革停牌的股票

本基金截止2006年6月30日，持有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票，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。其期末估值单价是根据最近一个交易日的市场平均价确定。 单位：人民币元

股票代码	股票名称	期末估值单价	停牌日期	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
600033	福建高速	8.17	2006/6/29	2006/7/14	6.15	6,180,913	47,217,536.85	50,498,059.21
600110	中科英华	8.19	2005/6/9	2006/7/27	7.35	1,499,990	9,379,037.71	12,284,918.10
600383	金地集团	8.70	2006/3/27	2006/7/11	9.43	999,921	6,913,675.03	8,699,312.70
600573	惠泉啤酒	7.90	2006/6/17	2006/7/7	7.15	2,050,465	11,512,535.38	16,198,673.50
600811	东方集团	7.11	2006/6/26	2006/7/6	6.73	4,349,763	19,652,042.09	30,926,814.93
000159	国际实业	5.61	2006/6/23	2006/7/20	3.90	1,550,000	8,120,784.66	8,695,500.00
	合计						102,795,611.72	127,303,278.44

2、因新股处于锁定期不能流通的股票

基金作为一般法人或战略投资者认购的以下新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让。基金获配新股，从新股获配日至新股上市日或上市公司所公告的基金获配新股的禁售期限内不能自由流通。截止2006年6月30日，因处于锁定期不能流通的新股均以估值日证券交易所提供的同一股票的市场平均价估值，该日无交易的，以最近一个交易日市场平均价计算。 单位：人民币元

股票代码	股票名称	期末估值单价	申购日期	可流通日期	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额
601001	大同煤业	10.27	2006-06-08	2006-09-23	669,618	4,526,617.68	6,876,976.86
002052	同洲电子	40.77	2006-06-07	2006-09-27	34,423	550,768.00	1,403,425.71
002053	云南盐化	13.32	2006-06-08	2006-09-27	246,417	1,798,844.10	3,282,274.44
600642	G申 能	6.21	2006-05-23	2006-07-05	2,316,060	13,711,075.20	114,382,732.60
002024	苏宁电器	51.47	2006-06-20	2007-06-23	1,950,000	93,600,000.00	100,366,500.00
合 计						114,187,304.98	226,311,909.61

（五）其他重要事项

本基金无需要说明的其他重要事项。

第六章 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	3,041,378,243.97	78.01%
债券投资市值	786,800,080.49	20.18%
权证投资市值	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金合计	29,264,008.47	0.75%
其他资产	41,267,008.84	1.06%
资产合计	3,898,709,341.77	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	467,645,476.18	12.16%
C制造业	1,019,473,127.03	26.50%
C0食品、饮料	310,897,405.62	8.08%
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	122,220,699.15	3.18%
C5电子	27,269,000.00	0.71%
C6金属、非金属	181,808,368.43	4.73%
C7机械、设备、仪表	237,438,915.45	6.17%
C8医药、生物制品	127,553,820.28	3.31%
C99其他制造业	12,284,918.10	0.32%
D电力、煤气及水的生产和供应业	70,218,019.54	1.83%
E建筑业	29,157,327.97	0.76%
F交通运输、仓储业	255,673,605.32	6.65%
G信息技术业	175,228,071.14	4.55%
H批发和零售贸易	334,298,237.41	8.69%
I金融、保险业	278,755,496.16	7.25%
J房地产业	154,765,619.62	4.02%
K社会服务业	0.00	0.00%
L传播与文化产业	111,765,608.32	2.91%
M综合类	144,397,655.28	3.75%
合计	3,041,378,243.97	79.07%

三、报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	金额（人民币元）	市值占净值比例
1	600036	G招 行	30,169,570	234,115,863.20	6.09%
2	600028	中国石化	31,532,228	198,337,714.12	5.16%
3	000983	G西 煤	17,404,144	139,581,234.88	3.63%
4	000402	G金融街	16,451,642	135,890,562.92	3.53%
5	000063	G中 兴	4,428,030	127,084,461.00	3.30%
6	600631	G百 联	15,106,447	123,268,607.52	3.20%
7	000917	G电 广	10,197,592	111,765,608.32	2.91%
8	000898	G鞍 钢	18,331,322	110,904,498.10	2.88%
9	002024	苏宁电器	1,950,000	100,366,500.00	2.61%
10	600832	G明 珠	8,812,686	91,035,046.38	2.37%

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本公司互联网网址：http://www.csfunds.com.cn的半年度报告正文。

四、报告期内股票投资组合的重大变动

（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

累计买入金额前20名				
序号	股票代码	股票名称	累计买入金额（人民币元）	占期初净值比例
1	600036	G招 行	127,130,108.87	4.52%
2	600631	G百 联	103,706,830.48	3.69%
3	002024	苏宁电器	102,142,147.95	3.63%
4	000983	G西 煤	100,543,755.07	3.58%
5	600028	中国石化	95,738,939.87	3.41%
6	600331	G宏 达	84,436,128.12	3.00%
7	000069	G华侨城	79,684,026.57	2.84%
8	000423	东阿阿胶	69,717,956.78	2.48%
9	000402	G金融街	66,188,412.30	2.36%
10	000917	G电 广	54,771,373.38	1.95%
11	600018	G上 港	51,959,488.11	1.85%
12	000063	G中 兴	50,465,794.55	1.80%
13	000876	G新希望	48,440,879.94	1.72%
14	600162	香江控股	47,323,534.32	1.68%
15	600000	G浦 发	45,726,226.08	1.63%
16	002010	传化股份	45,518,012.89	1.62%
17	000926	G福 星	44,128,547.09	1.57%
18	600033	G闽高速	43,703,193.57	1.56%
19	000858	G五粮液	40,681,617.84	1.45%
20	600039	四川路桥	38,024,379.79	1.35%

（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

累计卖出金额前20名				
	股票代码	股票名称	累计卖出金额（人民币元）	占期初净值比例
1	600900	G长 电	103,970,056.00	3.70%
2	600418	G江 汽	95,240,402.31	3.39%
3	000069	G华侨城	94,903,371.44	3.38%
4	600018	G上 港	87,768,266.74	3.12%
5	600050	G联 通	77,225,458.35	2.75%
6	600036	G招 行	70,416,044.06	2.51%
7	600019	G宝 钢	64,821,342.40	2.31%
8	000022	G深赤湾	63,518,011.73	2.26%
9	000825	G太 钢	63,463,435.40	2.26%
10	600331	G宏 达	55,120,642.27	1.96%
11	000926	G福 星	47,972,152.80	1.71%
12	002010	传化股份	47,205,960.24	1.68%
13	600075	G天 业	46,605,445.11	1.66%
14	600016	G民 生	46,542,859.50	1.66%
15	600500	G中 化	41,333,546.77	1.47%
16	000933	G神 火	39,472,756.29	1.40%
17	600535	G天士力	36,718,036.08	1.31%
18	600162	香江控股	36,548,008.43	1.30%
19	600362	G江 铜	36,232,673.98	1.29%
20	600755	G厦国贸	36,186,720.62	1.29%

（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	2,498,736,944.38
卖出股票收入总额	2,422,031,711.57

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	640,637,800.49	16.65%
金融债	141,162,280.00	3.67%
央行票据	0.00	0.00%
企业债	5,000,000.00	0.13%
可转债	0.00	0.00%
债券投资合计	786,800,080.49	20.45%

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	149,134,960.00	3.88%
2	20国债04	129,935,000.00	3.38%
3	21国债03	126,653,455.60	3.29%
4	02国债14	120,492,000.00	3.13%
5	05国开07	100,978,000.00	2.63%

七、投资组合报告附注

（一）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。

（二）基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

（三）报告期内获得权证情况

1、报告期末所有权证明细

本基金期末未持有权证。

2、报告期内获得权证明细

序号	权证名称	代码	数量（份）	市值（人民币元）	占基金资产净值比例	获得方式
1	招行CMP1	580997	10,800,000	0.00	0.00%	被动持有

（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	1,083,095.19
应收证券清算款	31,779,849.77
应收利息	8,366,566.82
应收股利	37,497.06
合 计	41,267,008.84

（五）报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金期末未持有可转换债券。

（六）报告期末基金持有的资产支持证券明细

本基金期末未持有资产支持证券。

（七）报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项 目	持有基金份额（份）	占基金总份额的比例
截止2005年12月31日持有份额	6,000,000	0.20%
本报告期增持份额	0	0.00%
截止2006年6月30日持有份额	6,000,000	0.20%
其中作为发起人持有份额	6,000,000	0.20%

第七章 基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人

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（户）	116,129
报告期末平均每户持有的基金份额（份）	25,833.34

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：	3,000,000,000	100.00%
其中：机构投资者持有的基金份额	1,530,368,948	51.01%
个人投资者持有的基金份额	1,469,631,052	48.99%

三、报告期期末本基金前十名基金份额持有人明细

序号	基金份额持有人名称	持有份额（份）	占总份额比例
1	中国人寿保险（集团）公司	289,727,442	9.66%
2	中国人寿保险股份有限公司	284,720,194	9.49%
3	中国太平洋保险（集团）股份有限公司	138,468,843	4.62%
4	中国人民财产保险股份有限公司	91,032,899	3.03%
5	上海久事公司	85,200,000	2.84%
6	申银万国－花旗－UBS LIMITED	72,015,461	2.40%
7	中国平安保险（集团）股份有限公司	43,611,944	1.45%
8	湘财－汇丰－荷兰银行有限公司	40,961,352	1.37%
9	高华－汇丰－GOLDMAN,SACHS & CO	40,136,550	1.34%
10	中国再保险（集团）公司	36,242,280	1.21%

第八章 重大事件揭示

一、本基金在2006年上半年未召开基金份额持有人大会。

二、基金管理人、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

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，本公司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[2005]52号文）。关于变更高级管理人员的公告刊登于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。

三、本报告期内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、基金投资策略的改变情况

本基金本报告期内投资策略不曾改变。

五、基金收益分配事项

本基金于2006年1月1日至2006年6月30日期间未进行收益分配。

六、本基金所聘会计师事务所的情况

本基金聘任的会计师事务所为安永华明会计师事务所，安永华明会计师事务所已连续为本基金提供审计服务7.5年。

七、基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形：无

八、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，截止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	中信证券股份有限公司	1	1	2
2	国元证券有限责任公司	1	1	2
3	国泰君安证券股份有限公司	1	1	2
4	中国银河证券有限责任公司	1	1	2
5	泰阳证券有限责任公司	1		1
6	恒泰证券有限责任公司	1		1
7	华西证券有限责任公司	1		1
8	东方证券股份有限责任公司	1		1
9	海通证券股份有限公司	1		1
10	长江证券有限责任公司	1	1	2
11	招商证券股份有限公司		1	1
	合计	10	6	16

（二）2006年1-6月各券商股票交易量及佣金情况

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
中信证券股份有限公司	677,915,167.06	14.11%	540,048.87	13.96%
国元证券有限责任公司	1,199,788,470.97	24.97%	955,747.87	24.71%
招商证券股份有限公司	707,973,291.52	14.74%	553,996.08	14.33%
海通证券股份有限公司	595,060,527.83	12.39%	487,263.63	12.60%
恒泰证券有限责任公司	447,711,290.34	9.32%	367,021.59	9.49%
华西证券有限责任公司	157,921,612.60	3.29%	129,493.68	3.35%
东方证券股份有限公司	1,017,980,172.68	21.18%	833,707.92	21.56%
合计	4,804,350,533.00	100.00%	3,867,279.64	100.00%

（三）2006年1-6月各券商债券、回购交易量情况

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
中信证券股份有限公司	23,105,504.40	9.84%	0.00	0.00%
国元证券有限责任公司	89,491,905.80	38.12%	632,000,000.00	91.65%
海通证券股份有限公司	10,055,696.90	4.28%	57,600,000.00	8.35%
恒泰证券有限责任公司	10,069,560.70	4.29%	0.00	0.00%
东方证券股份有限公司	102,029,076.00	43.47%	0.00	0.00%
合计	234,751,743.80	100.00%	689,600,000.00	100.00%

（四）2006年1-6月各券商权证交易量情况

公司名称	权证交易量	占交易量比例
	（人民币元）	
海通证券股份有限公司	2,743,837.52	46.76%
东方证券股份有限公司	3,124,264.83	53.24%
合 计	5,868,102.35	100.00%

（五）报告期内租用证券公司席位的变更情况：报告期内证券公司租用席位无变更。

九、其他在报告期内发生的的重大事件

无。

长盛基金管理有限公司
二〇〇六年八月二十八日