同智证券投资基金 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同智证券投资基金(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。

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、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,安永华明会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

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:同智证券投资基金
(二)基金简称:基金同智
(三)基金交易代码:184702
(四)基金运作方式:契约型封闭式
(五)基金合同生效日:1992年3月13日
(六)基金清理规范日:2000年3月8日
(七)报告期末基金份额总额:5亿份
(八)基金合同存续期:1992年3月13日至2007年1月5日
(九)基金份额上市的证券交易所:深圳证券交易所
(十)基金上市日期:2000年5月15日

二、基金产品说明

(一)投资目标

本基金为成长型基金,主要投资对象为深、沪证券交易所成长性较高、发展前景良好的上市公司。

(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,并在此基础上确定资产配置比例。当判断后市多头特征明显时,将显著增加股票投资在资产总额中的比重,现金和债券比重将相应减少;反之,当判断后市空头特征明显时,将显著减少股票投资在资产总额中的比重,现金和债券比重将相应增加。

2、投资策略

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)占利润总额的比例较大;
(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)预期公司发展将发生积极变化,从而使其未来盈利能力有实质改善;
(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。

根据对上市公司上述若干方面的分析,确定成长型股票的初选范围,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特征。在投资时,按投资决策委员会确定的资产配置比例,选取成长型特征最明显的股票进行组合投资。

(三)业绩比较基准

无。

(四)风险收益特征

无。

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:中国银行股份有限公司
(二)信息披露负责人:宁敏
(三)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)登载年度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,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、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)	378,956,289.22	22,265,149.82	40,186,358.55
2	基金份额本期净收益(元/份)	0.7579	0.0445	0.0804
3	期末可供分配基金份额收益(元/份)	0.2628	0.0495	0.0500
4	期末基金资产净值(元)	774,962,810.62	576,124,019.75	544,237,007.91
5	期末基金份额净值(元/份)	1.5499	1.1522	1.0885
6	本期基金份额净值增长率	85.02%	10.16%	7.70%

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

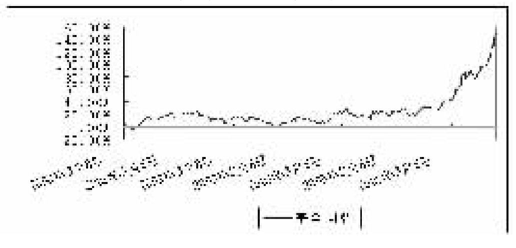
阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)
过去三个月	26.84%	0.0220
过去六个月	31.16%	0.0221
过去一年	85.02%	0.0249
过去三年	119.51%	0.0236
过去五年	120.31%	0.0215
自基金成立起至今	148.64%	0.0201

注:本基金无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

基金同智累计份额净值增长率历史走势图

(2000年3月8日至2006年12月31日)



注:

1、本基金无同期业绩比较基准收益率。

由于本基金由老基金规范后设立,基金资产存在一个调整期,调整期为自移交基准日2000年3月8日起六个月。截至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。

2、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%;

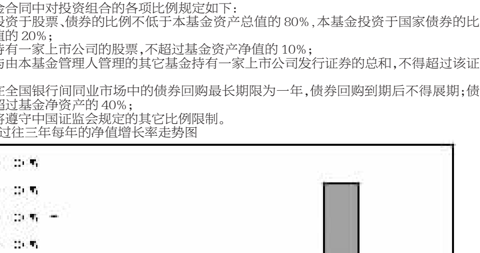
(2)本基金持有一家上市公司的股票,不超过基金资产净值的10%;

(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)本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为一年,债券回购到期后不得展期;债券回购的资金余额不得超过基金净资产的40%;

(5)本基金将遵守中国证监会规定的其它比例限制。

(三)本基金过往三年每年的净值增长率走势图



注:本基金无同期业绩比较基准收益率。

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	5.000元	2006年12月29日除权
	0.446元	2006年3月16日除权
2005	0.450元	2005年4月28日除权
2004	0.000元	2004年度未分配收益
合计	5.896元	

第三章 管理人报告

第一节 基金管理人及基金经理介绍

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%。截至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,首批取得了社保基金管理资格。

二、基金经理介绍

肖强,现任本基金经理。男,1967年12月出生。学士。曾任中信证券股份有限公司北太平庄营业部交易部经理、营业部总经理助理,中信证券股份有限公司研究咨询部副总经理、高级分析师,中信证券股份有限公司交易部高级交易员。2002年6月加入长盛基金管理有限公司,历任基金同盛基金经理助理、基金同益基金经理、长盛动态精选基金基金经理。

田荣华,现任本基金经理。男,1967年11月出生。毕业于武汉大学管理学院,获经济学硕士学位。曾任北京证券深圳业务部总经理、国信证券深圳红荔路营业部总经理。2004年4月加入长盛基金管理有限公司,历任基金同盛基金经理助理、长盛成长价值基金、基金同智和基金同德基金经理。

第二节 对报告期内基金运作的遵规守信情况说明

报告期间,国债投资比例自2006年12月14日起,连续10个交易日低于资产净值20%。原因如下:(1)证券市场连续上涨,带来基金同智资产净值的连续上涨;(2)2006年12月15日、2006年12月21日,总计1697.20万元的国债到期兑付,致使国债投资比例进一步降低;(3)基金同智自2006年12月25日起,进入封闭式基金转为开放式的特殊转型期(详见附:基金同智转型具体进程)。转型期间,基金同智实施分红,并于2006年12月27日(第10个交易日)将2.5亿元分红款自基金资产划出至中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司,但会计核算上,该日尚未做除权处理。2006年12月29日,分红除权处理后,国债投资比例达标。托管人对上述情况进行了提示。

此外,报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《同智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,诚实信用、勤勉尽责地管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础前提下,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。

附:基金同智转型具体进程:

2006年12月4日,基金同智持有人大会以现场方式在北京召开,会议审议通过了《关于同智证券投资基金转型有关事项的议案》;

2006年12月25日,中国证券监督管理委员会下发《关于核准同智证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》(证监基金字[2006]260号),同智证券投资基金基金份额持有人大会决议生效。同意按照《同智证券投资基金转型方案说明书》,对基金同智实施转型。转型后,同智证券投资基金更名为长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF);

2006年12月28日,深圳证券交易所收市后,基金同智向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同智的全体份额持有人实施分红;

2007年1月5日,基金同智终止上市。《长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金合同》自该日起生效,原《同智证券投资基金基金合同》自该日起失效;

2007年1月8日,长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)开放集中申购,集中申购期为2007年1月8日至2007年1月18日。

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、行情回顾及运作分析

2006年度,在全球流动性充沛的环境里,世界各主要资本市场也跌创新高,外部运行环境有利于中国股市持续向好。

本基金在2006年底进入"封转开"程序,由于要实施大规模的分红和送份额,我们在临近年底时做了较大的减仓,影响了本基金净值的上涨。

从长期看,基于对中国股市的乐观预期,我们认为在操作上做好证券选择比做时机选择更有意义。因此我们基本保持了较高的仓位,主要精力放在了股票的转换上。

在2007年年初,在新募集的资金到位后,我们即按照既定计划买入目标证券,当大盘短期快速下跌后,基金面值跌到1元以下。未来,我们和基金持有人都将面临着艰巨的考验,大幅波动的市场将考验我们的选股能力和风险控制水平;将考验本基金持有人的耐心和平和心态。我们有信心、有能力为广大持有人创造持续、稳定的收益。

二、本基金业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为1.5499元,本报告期份额净值增长率为85.02%,同期上证A股增长率为130.43%,本基金净值表现低于大盘。

第四节 对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

在2007年,我们认为A股市场唯港股和H股马首是瞻的格局将部分改变,股票定价权的回归将是长期趋势。在长期牛市里,A股市场的价值底线不再是以美国、香港等国际市场为参照标准,而是我们自己市场的无风险收益率倒数。因此未来A股市场的平均PE可以达到30倍,市场整体仍然有足够的上升空间。我们认为,基于长期向好的中国经济,股市及上市公司所谓的估值,所谓的泡沫都是相对和暂时的,只有用发展的眼光来认识问题,解决问题,才能够保证市场的长期健康发展。

在2007年我们具体的选股思路是四大板块、三大主题。就是泛金融类、泛地产类、泛先进制造类、泛消费类四大板块;高成长、人民币升值、整体上市三大主题。我们在选择个股时基本是在上述四条经线和三条纬线的交叉区域里。

同智基金在基金合同里明确规定,主要投资于业绩能够持续高成长的成长型上市公司,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。我们在未来会延续和强化这种策略,分享中国经济的长期成长,为基金份额持有人创造良好收益。

第四章 托管人报告

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对同智证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管合同的有关规定,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应尽的义务。

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管合同的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核;报告期间,该基金的国债投资比例自12月14日起,连续10个交易日低于资产净值20%,托管人向基金管理人进行了提示,2006年12月29日,该基金的国债投资比例达标。

本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真实、准确和完整。

中国银行股份有限公司
2007年3月28日

第五章 审计报告

安永华明会计师事务所注册会计师张小东、李欣于2007年3月23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安永华明(2007)审字第60468688_A05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

同智证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	167,299,721.59	29,322,525.74
清算备付金	5,842,442.32	493,609.28
交易保证金	389,781.75	374,793.55
应收股利	0.00	0.00
应收证券清算款	13,010,966.49	9,905,315.37
应收申购款	0.00	0.00
其他应收款	0.00	0.00
应收利息	1,132,639.41	528,480.73
股票投资市值	578,884,308.72	415,882,968.29
其中:股票投资成本	436,980,951.74	366,534,287.34
债券投资市值	180,354,759.73	121,660,011.88
其中:债券投资成本	178,704,495.05	119,637,572.81
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
资产总计	946,914,620.01	578,167,704.84
负债及持有人权益		
负 债		
应付证券清算款	0.00	0.00
应付管理人报酬	1,241,803.10	702,702.76
应付托管费	206,967.16	117,117.11
应付佣金	1,327,650.64	216,357.31
应付利息	167,880.58	0.00
应付收益	428,874.52	428,874.52
应交税金	0.00	0.00
其他应付款	528,633.39	528,633.39
卖出回购证券款	168,000,000.00	0.00
短期借款	0.00	0.00
预提费用	50,000.00	50,000.00
其他负债	0.00	0.00
负债合计	171,951,809.39	2,043,685.09
持有人权益		
实收基金	500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得	143,553,621.66	51,371,120.02
未分配收益	131,409,188.96	24,752,899.73
持有人权益合计	774,962,810.62	576,124,019.75
负债及持有人权益总计	946,914,620.01	578,167,704.84
基金份额净值(元/份)	1.5499	1.1522

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

同智证券投资基金经营业绩表

单位:人民币元

项目	2006年度	2005年度
收入	394,865,106.05	32,413,266.29
股票差价收入	374,939,033.52	19,054,299.62
债券差价收入	-817,558.77	1,964,699.81
权证差价收入	8,549,150.17	534,654.50
债券利息收入	4,257,314.55	3,603,874.59
存款利息收入	552,071.41	394,291.35
股利收入	7,359,325.55	6,846,915.21
买入返售证券收入	0.00	6,301.00
其他收入	25,769.62	8,230.21
费用	15,908,816.83	10,148,116.47
基金管理人报酬	11,170,500.25	8,184,649.99
基金托管费	1,861,749.99	1,364,108.29
卖出回购证券支出	1,538,670.83	124,632.42
其他费用	1,337,895.76	474,725.77
其中:上市年费	60,000.00	60,000.00
信息披露费	270,000.00	270,000.00
审计费用	50,000.00	50,000.00
基金净收益	378,956,289.22	22,265,149.82
未实现利得	92,182,501.64	32,121,862.02
基金经营业绩	471,138,790.86	54,387,011.84

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

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(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。

同智证券投资基金收益分配表

单位:人民币元

项 目	2006年度	2005年度
本期基金净收益	378,956,289.22	22,265,149.82
加:期初基金净收益	24,752,899.73	24,987,749.91
可供分配基金净收益	403,709,188.95	47,252,899.73
减:本期已分配基金净收益	272,299,999.99	22,500,000.00
期末基金净收益	131,409,188.96	24,752,899.73

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

同智证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	576,124,019.75	544,237,007.91
本期经营活动:		
基金净收益	378,956,289.22	22,265,149.82
未实现利得	92,182,501.64	32,121,862.02
经营活动产生的基金净值变动数	471,138,790.86	54,387,011.84
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	-272,299,999.99	-22,500,000.00
期末基金净值	774,962,810.62	576,124,019.75

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、会计报表编制基础:本基金的财务报表乃按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、中国证券监督管理委员会颁布的《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》和《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《财务报表附注的编制及披露》及基金合同的规定而编制。

本基金本年度编制的财务报表以持续经营假设为基础。

二、本报告期对非公开发行股票投资所采用的会计政策、会计估计的相关列示见本报告正文。

三、本报告期无重大会计差错和内容的更正金额。

四、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	基金发起人、基金管理人股东
中信证券股份有限公司	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

(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、通过关联方的席位进行的证券交易及交易佣金

单位:人民币元

关联方名称	2006年度		2005年度	
股票买卖	股票买卖年度成交金额	占全年交易金额比例	股票买卖年度成交金额	占全年交易金额比例
长江证券有限责任公司	102,164,348.16	2.91%	0.00	0.00%
国元证券有限责任公司	976,009,286.40	27.76%	267,618,777.16	24.00%
中信证券股份有限公司	347,129,564.36	9.87%	176,738,325.69	15.85%
合计	1,425,303,198.92	40.54%	444,357,102.85	39.85%
债券买卖	债券买卖年度成交金额	占全年交易金额比例	债券买卖年度成交金额	占全年交易金额比例
国元证券有限责任公司	16,441,866.80	29.77%	44,015,070.00	21.57%
中信证券股份有限公司	0.00	0.00%	13,852,734.33	6.79%
合计	16,441,866.80	29.77%	57,867,804.33	28.36%
证券回购	证券回购年度成交金额	占全年交易金额比例	证券回购年度成交金额	占全年交易金额比例
长江证券有限责任公司	120,000,000.00	6.20%	0.00	0.00%
国元证券有限责任公司	928,000,000.00	47.96%	121,000,000.00	46.72%
合计	1,048,000,000.00	54.16%	121,000,000.00	46.72%
佣金	支付的佣金	占全年佣金比例	支付的佣金	占全年佣金比例
长江证券有限责任公司	83,174.81	2.94%	0.00	0.00%
国元证券有限责任公司	796,028.97	28.13%	217,901.89	24.38%
中信证券股份有限公司	271,631.83	9.60%	138,299.03	15.47%
合计	1,150,835.61	40.67%	356,200.92	39.85%

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。债券及权证交易不计佣金。

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为本基金提供的证券投资研究结果和市场信息服务。

2、关联方报酬

(1)基金管理人报酬: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、基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人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。本基金于本期应支付基金管理人管理费共人民币11,170,500.25元(2005年:8,184,649.99元),其中已支付基金管理人人民币9,928,697.15元,尚余人民币1,241,803.10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;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。本基金于本期应支付基金托管人托管费共人民币1,861,749.99元(2005年:1,364,108.29元),其中已支付基金托管人人民币1,654,782.83元,尚余人民币206,967.16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,本年度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12月31日	2005年12月31日
银行存款余额	167,299,721.59	29,322,525.74
	2006年度	2005年度
银行存款产生的利息收入	511,385.74	364,867.72

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年度	2005年度
债券买卖		
全年交易量	28,192,587.81	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年度	2005年度
年初持有基金份额(份)	7,797,818.00	1,339,346.00
本年增加(份)	40,508,549.00	6,458,472.00
本年减少(份)	0.00	0.00
年末持有基金份额(份)	48,306,367.00	7,797,818.00
年末持有份额占基金总份额的比例	9.66%	1.56%

(2)基金管理人股东及基金发起人所持有的本基金份额

关联方名称	2006年12月31日		2005年12月31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
中信证券股份有限公司	500,000	0.10%	500,000	0.10%
长江证券有限责任公司	500,000	0.10%	500,000	0.10%
天津北方国际信托投资股份有限公司	500,000	0.10%	500,000	0.10%
国元证券有限责任公司	500,000	0.10%	500,000	0.10%
合计	2,000,000	0.40%	2,000,000	0.40%

四、报告期末流通受限制不能自由转让的基金资产

截至2006年12月31日,本基金持有的流通受到限制的基金资产明细如下

(一)因为暂时停牌而流通受限制的股票

单位:人民币元

股票名称	股票代码	停牌日期	年末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	股票成本	年末估值总额
S双汇	000895	2006.06.01	31.02	未公布	未公布	700,000	8,452,045.04	21,714,000.00
合计							8,452,045.04	21,714,000.00

本基金持有以上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。其年末估值单价是根据最近一个交易日的市场平均价确定。

(二)未上市股票

单位:人民币元

股票名称	股票数量	股票成本	年末估值总额	购入日期	上市日期	可流通日期	备注
中国人寿	71,000	1,340,480.00	1,340,480.00	2006.12.28	2007.01.09	2007.01.09	网上
中国人寿	114,660	2,164,780.80	2,164,780.80	2006.12.28	2007.01.09	2007.04.09	网下
合计		3,505,260.80	3,505,260.80				

以上流通转让受到限制的股票是因网上及网下申购而暂时流通受限。网上申购部分于2007年1月9日上市日可以流通,网下申购部分锁定期至2007年4月9日。由于该股票尚未上市流通,其年末估值单价是根据其成本价确定。

(三)非公开定向增发新股

单位:人民币元

股票名称	股票数量	股票成本	年末估值总额	购入日期	增发部分上市日期	可流通日期
苏宁电器	1,000,000	24,000,000.00	44,480,000.00	2006.06.22	2006.06.23	2007.06.22
合计		24,000,000.00	44,480,000.00			

以上流通转让受到限制的股票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,其年末估值单价是根据估值日或最近一个交易日同一股票的市场平均价确定。

(四)网下申购未流通新股

单位:人民币元

股票名称	股票数量	股票成本	年末估值总额	购入日期	上市日期	可流通日期
大秦铁路	496,380	2,457,081.00	4,015,714.20	2006.07.26	2006.08.01	2007.02.01
广深铁路	1,211,740	4,556,142.40	8,688,175.80	2006.12.18	2006.12.22	2007.03.22
北辰实业	448,674	1,076,817.60	3,024,062.76	2006.09.28	2006.10.16	2007.01.16
平煤天安	207,497	1,693,175.52	2,224,367.84	2006.11.10	2006.11.23	2007.02.26
大唐发电	222,000	1,482,960.00	2,286,600.00	2006.12.12	2006.12.20	2007.03.20
众和股份	53,328	471,419.52	733,793.28	2006.09.20	2006.10.12	2007.01.12
江苏宏宝	102,417	397,377.96	716,919.00	2006.09.21	2006.10.12	2007.01.12
青岛软控	29,813	775,138.00	1,409,558.64	2006.09.28	2006.10.18	2007.01.18
东源电器	42,423	334,293.24	596,043.15	2006.09.27	2006.10.18	2007.01.18
雪莱特	32,558	223,347.88	611,764.82	2006.10.12	2006.10.25	2007.01.25
大港股份	109,709	581,457.70	947,885.76	2006.11.01	2006.11.16	2007.02.16
苏州固锝	53,560	342,248.40	549,525.60	2006.11.01	2006.11.16	2007.02.16
金螳螂	36,846	471,628.80	887,251.68	2006.11.06	2006.11.20	2007.02.26
栋梁新材	64,597	410,836.92	802,940.71	2006.11.07	2006.11.20	2007.02.26
鲁阳股份	38,917	428,087.00	1,048,813.15	2006.11.21	2006.11.30	2007.02.28
新海宜	47,619	412,380.54	641,427.93	2006.11.21	2006.11.30	2007.02.28
金智科技	27,174	385,870.80	602,175.84	2006.11.28	2006.12.08	2007.03.08
江苏国泰	82,965	663,720.00	1,002,217.20	2006.11.28	2006.12.08	2007.03.08
国脉科技	25,125	253,762.50	509,283.75	2006.12.06	2006.12.15	2007.03.15
青岛金王	55,377	425,849.13	658,986.30	2006.12.06	2006.12.15	2007.03.15
网盛科技	17,772	250,407.48	992,388.48	2006.12.06	2006.12.15	2007.03.15
广东鸿图	10,125	115,526.25	195,210.00	2006.12.20	2006.12.29	2007.03.29
合计		18,209,528.64	33,145,105.89			

以上未流通新股是因处于网下申购锁定期而暂时流通受限,其年末估值单价是根据估值日或最近一个交易日同一股票的市场平均价确定。

(五)流通受限债券

1、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为人民币100,000,000.00元(2005年12月31日:人民币0.00元),于2007年1月4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。

2、本基金截至2006年12月31日止从事银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币68,000,000.00元(2005年12月31日:人民币0.00元),系以如下债券作为抵押

债券名称	回购到期日	年末估值单价(元)	数量(张)	年末成本总额
06国开15	2007.01.09	98.71	100,000	9,871,249.13
06进出04	2007.01.09	98.67	480,000	47,362,164.42
99国债05	2007.01.09	103.44	100,000	10,343,520.98
合计				67,576,934.53

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	578,884,308.72	61.13%
债券投资市值	180,354,759.73	19.05%
权证投资市值	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金	173,142,163.91	18.28%
资产支持证券	0.00	0.00%
其他资产	14,533,387.65	1.54%
资产合计	946,914,620.01	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	4,150,060.58	0.54%
C制造业	305,896,958.07	39.48%
C0食品、饮料	21,714,000.00	2.80%
C1纺织、服装、皮毛	733,793.28	0.10%
C2木材、家具	0.00	0.00%
C3造纸、印刷	46,581,142.30	6.01%
C4石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00%
C5电子	1,161,290.42	0.15%
C6金属、非金属	57,049,067.39	7.36%
C7机械、设备、仪表	177,998,678.38	22.97%
C8医药、生物制品	0.00	0.00%
C99其他制造业	658,986.30	0.09%
D电力、煤气及水的生产和供应业	2,286,600.00	0.30%
E建筑业	887,251.68	0.11%
F交通运输、仓储业	12,703,890.00	1.64%
G信息技术业	2,745,276.00	0.35%
H批发和零售贸易	78,957,420.40	10.19%
I金融、保险业	27,850,260.80	3.59%
J房地产业	142,458,705.43	18.38%
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	947,885.76	0.12%
合计	578,884,308.72	74.70%

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)	期末市值(人民币元)	市值占基金资产净值比例
1	002024	苏宁电器	1,752,590	77,955,203.20	10.06%
2	600748	上实发展	5,875,879	69,570,407.36	8.98%
3	000651	格力电器	5,535,112	65,148,268.24	8.41%
4	600067	冠城大通	7,071,739	51,835,846.87	6.69%
5	000910	大亚科技	6,460,630	46,581,142.30	6.01%
6	002073	青岛软控	884,454	41,816,985.12	5.40%
7	600675	中华企业	3,014,500	33,069,065.00	4.27%
8	000006	深振业A	1,809,127	24,477,488.31	3.16%
9	600036	招商银行	1,500,000	24,345,000.00	3.14%
10	600019	宝钢股份	2,600,000	22,152,000.00	2.86%

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	600675	中华企业	60,464,328.22	10.50%
2	000651	格力电器	59,588,734.89	10.34%
3	000039	中集集团	55,759,109.24	9.68%
4	600748	上实发展	52,116,352.53	9.05%
5	002024	苏宁电器	45,653,462.35	7.92%
6	600067	冠城大通	44,707,689.85	7.76%
7	002073	青岛软控	43,963,506.75	7.63%
8	000910	大亚科技	43,207,608.59	7.50%
9	600000	浦发银行	41,440,767.62	7.19%
10	600028	中国石化	41,240,921.77	7.16%
11	600019	宝钢股份	37,344,164.51	6.48%
12	600694	大商股份	30,885,064.47	5.36%
13	600150	沪东重机	29,728,257.76	5.16%
14	601699	潞安环能	28,926,890.42	5.02%
15	600016	民生银行	28,449,672.16	4.94%
16	601006	大秦铁路	28,110,611.23	4.88%
17	600795	国电电力	27,992,115.91	4.86%
18	600808	马钢股份	27,930,968.76	4.85%
19	000792	盐湖钾肥	27,652,018.75	4.80%
20	600809	山西汾酒	24,812,707.32	4.31%
21	600428	中远航运	24,188,145.52	4.20%
22	000060	中金岭南	23,604,082.39	4.10%
23	600829	三精制药	23,325,307.25	4.05%
24	600595	中孚实业	20,815,299.57	3.61%
25	000006	深振业A	20,519,266.11	3.56%
26	000987	广州友谊	19,791,077.77	3.44%
27	600009	上海机场	18,877,434.24	3.28%
28	600533	栖霞建设	18,661,606.55	3.24%
29	600104	上海汽车	18,562,469.19	3.22%
30	600064	南京高科	18,542,251.49	3.22%
31	000858	五粮液	18,252,242.25	3.17%
32	000807	云铝股份	18,107,124.37	3.14%
33	600826	兰生股份	17,642,307.79	3.06%
34	000729	燕京啤酒	17,100,719.83	2.97%
35	600583	海油工程	16,857,577.70	2.93%
36	600362	江西铜业	15,761,660.02	2.74%
37	600036	招商银行	15,357,875.31	2.67%
38	601588	北辰实业	15,168,910.18	2.63%
39	000562	宏源证券	14,933,888.06	2.59%
40	000731	S川美丰	14,638,705.82	2.54%
41	600547	山东黄金	13,685,441.61	2.38%
42	600033	福建高速	13,682,725.37	2.37%
43	000402	金融街	13,668,079.97	2.37%
44	000528	柳工	13,648,804.23	2.37%
45	000983	西山煤电	13,417,281.47	2.33%
46	600438	通威股份	13,353,319.48	2.32%
47	000758	中色股份	13,072,584.03	2.27%
48	600879	火箭股份	12,482,548.68	2.17%
49	600549	厦门钨业	12,388,222.17	2.15%
50	600460	士兰微	12,012,129.27	2.08%

(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	600000	浦发银行	69,552,898.71	12.07%
2	600036	招商银行	69,188,408.80	12.01%
3	600016	民生银行	65,824,575.38	11.43%
4	600028	中国石化	61,541,504.13	10.68%
5	600583	海油工程	58,023,338.12	10.07%
6	000039	中集集团	54,683,601.73	9.49%
7	600320	振华港机	49,730,078.80	8.63%
8	002024	苏宁电器	48,830,155.41	8.48%
9	600795	国电电力	44,755,831.39	7.77%
10	600694	大商股份	38,328,900.91	6.65%
11	000792	盐湖钾肥	36,976,550.62	6.42%
12	600009	上海机场	36,976,528.26	6.42%
13	600019	宝钢股份	36,282,478.70	6.30%
14	600675	中华企业	35,773,953.69	6.21%
15	000807	云铝股份	30,603,722.64	5.31%
16	600150	沪东重机	30,367,733.16	5.27%
17	601006	大秦铁路	28,417,587.51	4.93%
18	000069	华侨城A	28,171,213.40	4.89%
19	600829	三精制药	27,225,245.44	4.73%
20	601699	潞安环能	26,602,068.50	4.62%
21	600900	长江电力	26,456,655.82	4.59%
22	600428	中远航运	26,171,027.72	4.54%
23	000063	中兴通讯	24,988,281.11	4.34%
24	000895	S双汇	24,427,917.64	4.24%
25	000987	广州友谊	24,280,396.50	4.21%
26	600406	国电南瑞	22,552,607.99	3.91%
27	000758	中色股份	22,300,783.87	3.87%
28	601588	北辰实业	22,037,942.49	3.83%
29	000060	中金岭南	21,993,646.63	3.82%
30	600809	山西汾酒	21,660,857.12	3.76%
31	600276	恒瑞医药	21,564,106.43	3.74%
32	000858	五粮液	21,560,205.46	3.74%
33	000031	中粮地产	19,364,716.41	3.36%
34	600879	火箭股份	19,306,750.23	3.35%
35	600595	中孚实业	19,235,959.01	3.34%
36	600826	兰生股份	18,396,508.22	3.19%
37	600547	山东黄金	18,307,125.87	3.18%
38	600533	栖霞建设	18,016,434.09	3.13%
39	000528	柳工	17,783,698.54	3.09%
40	000731	S川美丰	16,638,656.67	2.89%
41	600033	福建高速	16,530,452.89	2.87%
42	000729	燕京啤酒	16,092,801.48	2.79%
43	600018	上港集团	16,027,581.67	2.78%
44	600362	江西铜业	15,976,092.26	2.77%
45	600316	洪都航空	15,872,395.85	2.76%
46	000562	宏源证券	14,614,214.69	2.54%
47	000983	西山煤电	14,384,879.24	2.50%
48	600269	赣粤高速	14,314,802.80	2.48%
49	600697	欧亚集团	14,222,459.06	2.47%
50	000402	金融街	13,755,067.18	2.39%
51	600087	南京水运	13,735,461.99	2.38%
52	600438	通威股份	13,538,528.33	2.35%
53	600737	S*ST屯河	13,132,971.48	2.28%
54	600037	歌华有线	12,609,726.62	2.19%
55	600383	金地集团	12,070,773.80	2.10%
56	000002	万科A	11,981,713.56	2.08%
57	002020	京新药业	11,690,009.56	2.03%

(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	1,643,817,747.08
卖出股票收入总额	1,944,755,873.62

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	123,121,346.18	15.89%
金融债	57,233,413.55	7.38%
央行票据	0.00	0.00%
企业债	0.00	0.00%
可转债	0.00	0.00%
债券投资合计	180,354,759.73	23.27%

六、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序前五名债券明细

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	54,033,197.00	6.97%
2	06进出04	47,362,164.42	6.11%
3	02国债14	29,244,069.80	3.77%
4	21国债15	27,167,400.00	3.51%
5	99国债05	10,651,479.38	1.37%

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

本基金期末未持有权证。

(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	0.00	0.00
被动持有	580997	招行CMP1	2,880,000	0.00
	580996	沪场JTP1	750,000	0.00
	038006	中集ZYP1	279,996	0.00
	038008	钾肥JTP1	400,000	0.00
	031001	侨城HQC1	343,336	0.00

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,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

(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	389,781.75
应收证券清算款	13,010,966.49
应收利息	1,132,639.41
合 计	14,533,387.65

(五)报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有可转换债券。

(六)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	7,797,818	1.56%
本报告期增持份额	40,508,549	8.10%
截止2006年12月31日持有份额	48,306,367	9.66%
其中作为发起人持有份额	1,339,346	0.27%

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	21,548户
报告期末平均每户持有的基金份额	23,204.01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	500,000,000	100.00%
其中:机构投资者持有的基金份额	332,289,387	66.46%
个人投资者持有的基金份额	167,710,613	33.54%

三、报告期末本基金前十名持有人明细

序号	股东名称	持有份额(份)	占总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	48,400,557	9.68%
2	长盛基金管理有限公司	48,306,367	9.66%
3	中国人寿保险(集团)公司	48,283,348	9.66%
4	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	30,161,288	6.03%
5	银河-渣打-CITIGROUP GLOBAL MARKETS LIMITED	16,898,285	3.38%
6	中银国际-中行-法国爱德蒙得洛希尔银行	14,999,992	3.00%
7	招商证券-招行-招商证券基金宝集合资产管理计划	12,241,034	2.45%
8	UBS AG	11,175,913	2.24%
9	新华人寿保险股份有限公司	11,154,744	2.23%
10	宝钢集团有限公司	10,179,946	2.04%

第九章 重大事件揭示

一、基金份额持有人大会决议

2006年12月4日,本公司就同智证券投资基金转型事宜召开了基金份额持有人大会,会议决议:同意按照《同智证券投资基金转型方案说明书》,对基金同智实施转型;为实施基金同智转型方案,同意授权基金管理人办理本次基金同智转型的有关具体事宜,包括但不限于根据市场情况确定转换的具体时间,在确保基金份额持有人利益的前提下对《同智证券投资基金基金合同》进行必要的修改和补充。上述决议已获中国证监会核准。关于持有人大会召开及决议具体进程如下:

(一)2006年11月3日,本公司发布本基金召开基金份额持有人大会的公告。
(二)2006年11月16日,本公司发布本基金召开基金份额持有人大会的提示性公告。
(三)2006年12月5日,本公司发布关于本基金份额持有人大会表决结果的公告。
(四)2006年12月26日,本公司发布关于本基金基金份额持有人大会决议的公告。

上述公告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

二、2006年12月28日,本公司发布关于本基金于2007年1月5日终止上市的公告。自本基金终止上市之日起,基金名称变更为长盛同智优势成长混合型证券投资基金,由《同智证券投资基金基金合同》修订而成的《长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金合同》生效,基金持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金合同》为准;自本基金终止上市之日起,基金同智转型成为上市开放式基金,在集中申购期间,可以通过深交所LOF平台办理集中申购业务。在基金开放并上市后可通过深交所LOF平台办理基金份额的日常申购、赎回及二级市场交易业务。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。

三、2007年1月4日,本公司发布关于本基金于2007年1月5日终止上市的提示性公告,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。

四、基金管理人、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

(一)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,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。

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,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)。关于公司聘任公司副总经理的公告刊登于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。

(二)基金经理的变更

因工作需要,根据公司第三届董事会第十次会议决议,公司决定聘任肖强先生为基金同智基金经理。公告刊登于2006年4月29日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

(三)本年度本基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

五、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。

六、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。

七、基金收益分配事项

2006年3月15日,本基金实施2005年度收益分配。向全体基金份额持有人按每10份基金份额派发现金收益0.446元,共派发现金收益22,299,999.99元。公告刊登于2006年3月6日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

2006年12月28日,基金同智实施2006年度收益分配。基金同智向全体基金份额持有人按每10份基金份额派发现金收益5.00元,共派发现金收益250,000,000.00元。公告刊登于2006年12月26日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

八、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,报告年度共支付审计费50,000.00元。安永华明会计师事务所已连续为本基金提供审计服务7年。

九、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。

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、2006年8月16日,本公司发布公司关于权证投资总体方案的公告。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。

十二、2006年5月13日,2006年7月15日,2006年10月24日,公司分别发布了运用固有资金投资本基金的公告。公告已刊登于上述日期的《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

十三、2006年12月12日,本公司发布公告,修改了本基金收益分配条款。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。

十四、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	中信证券股份有限公司		1	1
2	蔚深证券有限责任公司	1		1
3	广发华福证券有限责任公司	1		1
4	中山证券有限责任公司	1		1
5	国元证券有限责任公司	1		1
6	招商证券股份有限公司		1	1
7	长江证券有限责任公司	1		1
	合计	5	2	7

(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月各券商股票交易量及佣金情况如下

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
长江证券有限责任公司	102,164,348.16	2.91%	83,174.81	2.94%
招商证券股份有限公司	798,533,270.76	22.71%	624,858.70	22.08%
中信证券股份有限公司	347,129,564.36	9.87%	271,631.83	9.60%
国元证券有限责任公司	976,009,286.40	27.76%	796,028.97	28.13%
广发华福证券有限责任公司	961,395,621.73	27.34%	784,704.83	27.73%
中山证券有限责任公司	330,676,601.44	9.41%	269,486.30	9.52%
合计	3,515,908,692.85	100.00%	2,829,885.44	100.00%

(五)2006年1-12月各券商债券、回购交易量情况如下

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
长江证券有限责任公司	0.00	0.00%	120,000,000.00	6.20%
招商证券股份有限公司	204,040.00	0.37%	0.00	0.00%
国元证券有限责任公司	16,441,866.80	29.77%	928,000,000.00	47.96%
广发华福证券有限责任公司	22,124,058.80	40.06%	587,000,000.00	30.34%
中山证券有限责任公司	16,460,562.40	29.80%	300,000,000.00	15.50%
合计	55,230,528.00	100.00%	1,935,000,000.00	100.00%

(六)2006年1-12月各券商权证交易量情况如下

公司名称	权证交易量(人民币元)	占交易量比例
招商证券股份有限公司	5,751,142.22	67.26%
广东华福证券有限责任公司	1,320,743.51	15.45%
中山证券有限责任公司	1,478,056.50	17.29%
合计	8,549,942.23	100.00%

(七)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。

十五、其他在报告期内发生的重大事件

无。

长盛基金管理有限公司
二〇〇七年三月二十九日