同益证券投资基金 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益证券投资基金(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。

本基金托管人中国工商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。

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:同益证券投资基金

(二)基金简称:基金同益

(三)基金交易代码:184690

(四)基金运作方式:契约型封闭式

(五)基金合同生效日:1999年4月8日

(六)报告期末基金份额总额:20亿份

(七)基金合同存续期:1999年4月8日至2014年4月7日,共15年

(八)基金份额上市的证券交易所:深圳证券交易所

(九)上市日期:1999年4月21日

二、基金产品说明

(一)投资目标:本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。

(二)投资策略:始终如一地奉行“价值投资”的基本原则,并在不同的市场环境以及市场发展变化的不同阶段,灵活运用适合自身运作特点的投资原则、投资理念和投资技巧,这是本基金经理人投资管理的基本信条。

目前,通过对我国证券市场有效性的实证分析,得出结论是主动型投资有一定的适用性,通过学习、吸收、灵活运用国内外先进的投资分析方法,深入分析国际国内宏观经济、行业、企业的基本情况,有可能会发现和创造投资机会从而获得超额回报。当然,随着市场效率的不断提高,在证券市场获取超额投资回报的机会在减少,本基金经理人将更多借鉴国外成熟市场的投资经验和投资技巧。

投资管理分若干层面,本基金经理人力求在战略资产和战术资产等若干层面优化资源配置以实现单位风险下的收益最大化。在战略资产配置层,我们寻求现金、债券、股票资产的动态收益–风险最优配置;在战术资产配置层,我们寻求成长型股票和价值型股票的动态收益–风险最优配置。

投资分析和投资管理密不可分,投资分析要考虑各种影响因素对公司价值进行综合判断,对分析假设和分析方法的合理性进行科学、严谨的论证,必须做到博与精的有效统一,这也是职业基金经理人追求的境界。

(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)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:中国工商银行股份有限公司

(二)信息披露负责人:蒋松云

(三)电话:010–66106912

(四)传真:010–66106904

(五)电子邮箱:custody@icbc.com.cn

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,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、基金净值表现及收益分配情况

下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)	1,020,426,906.12	–83,625,497.25	68,063,685.56
2	基金份额本期净收益(元/份)	0.5102	–0.0418	0.0340
3	期末可供分配基金份额收益(元/份)	0.3536	–0.0066	–0.0413
4	期末基金资产净值(元)	3,918,974,752.41	2,109,986,004.63	1,917,490,550.35
5	期末基金份额净值(元/份)	1.9595	1.0550	0.9587
6	本期基金份额净值增长率	100.22%	10.04%	–12.35%

二、基金净值表现

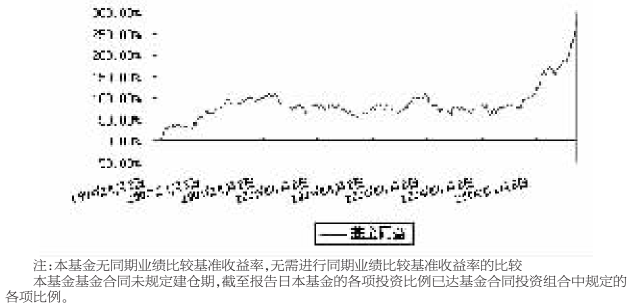
(一)本基金历史各时间段基金份额净值增长率

阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)
过去三个月	32.09%	0.0227
过去六个月	37.76%	0.0231
过去一年	100.22%	0.0235
过去三年	93.11%	0.0239
过去五年	109.96%	0.0220
自基金成立起至今	277.23%	0.0229

注:本基金无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。

(二)自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况

基金同益累计份额净值增长率历史走势图
(1999年4月8日至2006年12月31日)



注: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

本基金基金合同未规定建仓期,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。

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%;

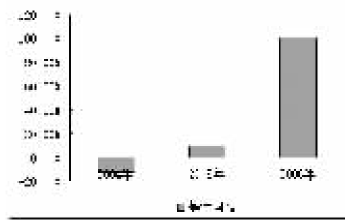
2、本基金持有一家上市公司的股票,不超过基金资产净值的10%;

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。

(三)本基金过往三年每年的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较:

同益证券投资基金净值增长率走势图



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	1.500元	2006年12月29日除息,分配2006年度收益
2005	0.000元	2004年度未分配收益
2004	0.200元	2004年4月6日除息,分配2003年度收益
合计	1.700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、基金经理小组简介

许彤,男,1969年出生,获理学硕士学位,现任本基金基金经理。1997年1月至1998年3月就职于君安证券有限责任公司。1998年4月至2004年2月就职于中信证券股份有限公司。2004年3月加入长盛基金管理有限公司,先后担任基金同益基金经理助理、基金经理。

冯耀东,男,1975年出生,获理学硕士学位,现任本基金基金经理助理。2001年2月至2002年12月就职于长城证券金融研究所。2002年12月加入长盛基金,担任高级研究员。

第二节 对报告期内基金运作的遵规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内,严格按照《基金法》和《同益证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,管理和运用基金资产。投资活动中力求勤勉尽责,努力为提高基金收益工作。基金同益投资组合符合有关法规及基金合同的约定,无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年证券市场的运行情况回顾

2006年,证券市场的制度变革进一步深化,股权分置改革继续推进并稳步完成。全流通背景下,大股东、公司和投资者的利益取向开始趋同,这使得上市公司快速发展的动力得到激发。宏观经济方面,投资和出口继续保持快速增长,消费继续高位平稳增长,GDP全年增长达到10.70%,企业利润也逐月回升,总体上宏观经济保持了“高增长、低通胀”的良好态势,利率水平虽有所上升,但仍然保持较低水平,人民币升值幅度尤其在下半年逐步加快,全年人民币相对美元升值幅度达3.30%以上。

针对流动性过剩、投资与信贷增长过快、部分地区房地产价格虚高等问题,政府也出台了相关调控政策,同时,市场IPO和再融资规模明显加大,频率明显加快,非流通股票也开始逐步分批流通。

虽有部分不利因素,但在诸多利好因素的带动下,中国A股市场出现了近年来少见的上涨幅度,上证指数从1161.06点上升到2675.47点,区间上涨幅度达到130.43%。上半年,有色金属、军工、机械等成为持续热点,下半年市场则在金融、地产、指数权重股、二线蓝筹的带动下快速上涨,而零售、消费类股票则全年都表现不错。

二、本基金的投资回顾

本基金从2005年底就明确了A股市场进入牛市阶段的判断,始终保持了较高的仓位,全年下来,本基金基本把握住了市场的主要投资主线,在金融、地产、消费、零售等重点行业始终保持了较重的配置,并在下半年确认了钢铁行业的复苏的前提下,重点增持钢铁股,分享到了市场上涨的收益。但纵观全年,本基金仍有部分工作值得反思和总结,一是对牛市思维的执行、贯彻还不够坚决,存在强调组合的安全、稳健有余,而组合的攻击力稍显不足的问题;二是由于全年行情变化迅猛,热点转化较快,本基金在部分热点板块捕捉、布局调整上不够敏锐,比如没能把握好有色金属,军工板块的阶段性行情,组合结构与市场热点之间的匹配还没有达到满意之程度。我们将认真总结这些不足,在以后工作中弥补、提高。截止报告期末,本基金份额净值为1.9595元,期间每份基金份额分红0.15元,本报告期份额净值增长率为100.22%,同期上证指数上涨130.44%,本基金总体净值表现弱于上证指数。

第四节 对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

一、对宏观经济和证券市场展望

展望后市,我们仍然认为市场中长线较为乐观。首先,全流通大背景下各方利益趋同,市值考核和市值管理成为上市公司考虑的主要问题之一,将继续激发上市公司快速发展;其次,宏观经济在“十一五”乃至更长时间内将继续保持较快的增长速度,从而带动企业盈利继续持续增长;第三,汇率的升值预期继续引发资产价值(包括股市)的上升;第四,中国目前的低利率和储蓄过剩,市场流动性相对过剩,使得中国A股市场的估价值水平不断抬高。尽管持续有宏观调控的存在,我们仍然对证券市场未来的中长期走势抱有相当乐观之期待。

从短期来看,由于市场经历了大幅上涨,目前市场的估值水平已经和国际市场接轨,多数公司进入估值合理的区间,甚至部分行业和公司已经进入全球估值的高位区域,市场短期的风险较前期有所提高,但基于对市场中长期的乐观看法,我们认为市场风险将更多体现在行业与个股的分化走势上,而非指数的大幅下跌,前期板块整体上扬的格局会渐渐弱化,至下而上地挖掘股票尤为重要。

二、本基金下阶段投资策略

基于对市场中长期的乐观看法,我们会继续保持相对积极的运作思路,相对淡化对大盘的时机选择,利用市场不同阶段出现的调整机会,对投资组合结构的调整与优化。本基金在组合配置上,一方面将继续注重企业的持续增长,另一方面将在注重估值安全边际,在均衡配置的前提条件下保持组合的适度弹性和冲击力,吸取06年操作偏保守的教训。从长期来看,自上而下,我们继续看好消费升级、产业升级、重工业化、城市化等经济趋势下,给相关行业和公司所带来的持续增长和投资机会,特别是中国有比较优势的产业,以及汇率升值所带来的相关行业和资产的继续重估。同时我们密切关注部分复苏和景气度上升的周期性行业的投资机会,另外我们继续关注奥运、3G及税改对相关行业公司所带来的主题性投资机会。除此之外,我们认为,自下而上的深入挖掘个股投资机会相比去年变得尤为重要,市场已经进入了精耕细作阶段,06年出现的行业重估主题将大为淡化,我们在这一方面将进一步加强研究,争取获得更多超额收益。

第五节 基金内部监察报告

基金内部监察稽核工作主要由监察稽核部工作人员通过采用各种工作方法和步骤对基金投资运作各环节的具体情况进行独立检查。在本报告期内,监察稽核工作的原则是“以实现企业核心价值为轴心、以防范不当利益输送为目标、以实现内控三个目的为基点、以独立监督跟踪修正为方法开展监察稽核工作。”公司监察稽核部以内部控制制度为依据,及时协调并解决各种问题,并通过对有关部门及业务的监察稽核对相关制度流程加以补充、修改和完善,从而增强了制度的操作性及岗位人员责任的明晰性。

一、进一步完善了公司内部控制制度

完善适用、适时的内部控制制度,是公司各项业务规范、有序运转的基本前提。2006年根据法律法规的新要求及业务发展的需要,公司对内部控制制度进行了完善与更新。

二、梳理与投资运作有关的法律、法规及公司规定,全面掌控公司及基金运作的风险点

全面、清晰掌控公司及基金投资运作的风险点,是保证基金规范运作的基本前提。为此,我们全面梳理与投资运作相关的法律、法规、基金合同及公司规定,分别从法规限制、合同限制、公司制度限制三个层面完善风险控制要素,明确风险点并标识各风险点所采用的控制工具与控制方法,使得对各风险点的监控真正落到实处。

三、运用风险监控系统,提升风险监控的准确性及效率

监察稽核部运用投资风险管理信息系统中的风险监控组合管理功能,实现对各基金(组合)投资运作过程合法合规性的及时监控。为提升风险监控的准确性及效率,监察稽核部定期复核指标设置的正确性与及时性。

四、采用定期与不定期相结合的专项稽核方式,检查制度执行情况,规范业务运转工作流程

公司内部控制制度的切实执行,是公司各项业务规范、有序运转的重要保证。2006年,我们采用定期与不定期相结合的专项稽核方式,检查公司内控制度执行情况。所作的专项稽核包括投资交易、基金销售、投资研究、投资管理、信息系统、投资决策等各个环节。

本报告期内,本基金管理人所管理的基金整体运作合规合法,保障了基金份额持有人的利益。

第四章 托管人报告

2006年度,本托管人在对同益证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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。

2006年度,同益证券投资基金的管理人——长盛基金管理有限公司在同益证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、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,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人依法对长盛基金管理有限公司在2006年度所编制和披露的同益证券投资基金年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部
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60468668_A03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

同益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	272,516,894.11	58,618,385.48
清算备付金	4,614,607.29	679,743.14
交易保证金	598,780.49	598,780.49
应收证券清算款	1,777,276.70	15,935,861.11
应收股利	0.00	0.00
应收利息	8,893,593.90	4,591,669.44
其他应收款	29,400,000.00	0.00
股票投资市值	3,090,537,377.68	1,589,452,107.76
其中:股票投资成本	1,878,917,591.48	1,465,975,500.45
债券投资市值	836,549,485.80	461,964,176.10
其中:债券投资成本	836,347,952.26	462,181,305.33
权证投资市值	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	4,244,888,015.97	2,131,840,723.52
负债及持有人权益		
负债		
应付证券清算款	236,289,432.16	17,148,690.42
应付管理人报酬	4,980,245.73	2,572,320.81
应付托管费	830,040.93	428,720.16
应付佣金	1,887,371.30	545,406.52
应付利息	16,592.46	0.00
应付收益	0.00	0.00
应交税金	0.00	0.00
其他应付款	1,064,580.98	1,064,580.98
卖出回购证券款	80,750,000.00	0.00
短期借款	0.00	0.00
预提费用	95,000.00	95,000.00
其他负债	0.00	0.00
负债合计	325,913,263.56	21,854,718.89
持有人权益		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未实现利得	1,211,821,319.74	123,259,478.08
未分配收益	707,153,432.67	–13,273,473.45
持有人权益合计	3,918,974,752.41	2,109,986,004.63
负债及持有人权益总计	4,244,888,015.97	2,131,840,723.52
基金份额净值(元/份)	1.9595	1.0550

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

同益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	1,075,000,704.63	–48,413,432.27
股票差价收入	989,208,277.45	–82,031,986.73
债券差价收入	–226,912.21	–8,361,946.28
权证差价收入	32,643,249.85	2,870,331.46
债券利息收入	16,484,863.75	13,680,251.19
存款利息收入	1,157,548.49	1,384,064.16
股利收入	35,723,677.30	24,015,397.57
买入返售证券收入	0.00	18,496.00
其他收入	10,000.00	11,960.36
费用	54,573,798.51	35,212,064.98
基金管理人报酬	43,339,161.14	29,674,613.29
基金托管费	7,223,193.52	4,945,768.88
卖出回购证券支出	2,643,405.75	144,305.16
利息支出	0.00	0.00
其他费用	1,368,038.10	447,377.65
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	95,000.00	95,000.00
基金净收益	1,020,426,906.12	–83,625,497.25
加:未实现利得	1,088,561,841.66	276,120,951.53
基金经营业绩	2,108,988,747.78	192,495,454.28

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

同益证券投资基金基金收益分配表

单位:人民币元

项目	附注	2006度	2005年度
本期基金净收益		1,020,426,906.12	–83,625,497.25
加:期初基金净收益		–13,273,473.45	70,352,023.80
可供分配基金净收益		1,007,153,432.67	–13,273,473.45
减:本期已分配基金净收益	(十六)	300,000,000.00	0.00
期末基金净收益		707,153,432.67	–13,273,473.45

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

同益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	2,109,986,004.63	1,917,490,550.35
本期经营活动:		
基金净收益	1,020,426,906.12	–83,625,497.25
未实现利得	1,088,561,841.66	276,120,951.53
经营活动产生的基金净值变动数	2,108,988,747.78	192,495,454.28
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	300,000,000.00	0.00
期末基金净值	3,918,974,752.41	2,109,986,004.63

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。

二、本报告期无重大会计差错和内容的更正金额。

三、关联方关系及其交易

(一)关联方关系

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
中国工商银行股份有限公司	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、通过关联方席位进行的交易

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
国元证券有限责任公司	1,482,263,519.97	24.65%	759,141,846.78	24.27%
长江证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	1,482,263,519.97	24.65%	759,141,846.78	24.27%

关联方名称	2006年度		2005年度	
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	43,750,711.00	18.78%	47,342,435.88	13.98%
长江证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	43,750,711.00	18.78%	47,342,435.88	13.98%

关联方名称	2006年度		2005年度	
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
国元证券有限责任公司	200,000,000.00	7.23%	0.00	0.00%
长江证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	200,000,000.00	7.23%	0.00	0.00%

关联方名称	2006年度		2005年度	
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
国元证券有限责任公司	1,179,086.22	24.38%	611,234.70	24.17%
长江证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	1,179,086.22	24.38%	611,234.70	24.17%

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成果和市场信息服务。

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43,339,161.14元(2005年应支付管理费金额为人民币29,674,613.29元),其中已支付基金管理人人民币38,358,915.41元,尚余人民币4,980,245.73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7,223,193.52元(2005年应支付托管费金额为人民币4,945,768.88元),其中已支付基金托管人人民币6,393,152.59元,尚余人民币830,040.93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工商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	272,516,894.11	58,618,385.48
	2006年度	2005年度
银行存款产生的利息收入	1,096,427.88	1,330,723.34

4、与关联方银行间同业市场的交易

单位:人民币元

中国工商银行股份有限公司	2006年度	2005年度
卖出回购证券		
全年交易量	386,000,000.00	260,000,000.00
年末余额	0.00	0.00
全年支出	326,257.53	69,347.94
债券买卖交易		
全年购入交易量	150,386,958.79	0.00
全年卖出交易量	0.00	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12月31日	2005年12月31日
年初持有基金份额(份)	20,000,000	20,000,000
本年增加(份)	8,000,079	0.00
本年减少(份)	0.00	0.00
年末持有基金份额(份)	28,000,079	20,000,000
年末持有份额占基金总份额的比例	1.40%	1.00%

(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	2006–12–31		2005–12–31	
	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	6,000,000	0.30%	6,000,000	0.30%
长江证券有限责任公司	6,000,000	0.30%	6,000,000	0.30%
天津北方国际信托投资股份有限公司	4,000,000	0.20%	4,000,000	0.20%
国元证券有限责任公司	4,000,000	0.20%	4,000,000	0.20%
合计	20,000,000	1.00%	20,000,000	1.00%

四、报告期流通受限制不能自由转让的基金资产

截至2006年12月31日止,本基金持有的流通转让受到限制的基金资产明细如下:

(一)因股权分置改革而暂时停牌的股票

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	股票数量	股票成本	年末估值总额
S首 旅	600258	2006–12–21	18.88	2007–01–18	18.80	204,100	2,873,072.02	3,853,408.00
S阿 胶	000423	2006–12–04	13.72	未公布	未公布	828,673	4,115,641.34	11,369,393.56
中原环保	000544	2006–11–21	3.56	2007–01–16	4.50	3,610,554	13,025,083.78	12,853,572.24
S川美丰	000731	2006–12–06	12.17	2007–01–15	12.76	2,443,072	23,028,033.77	29,732,186.24
S江 钻	000852	2006–10–31	12.33	未公布	未公布	60,000	752,523.65	739,800.00
S双 汇	000895	2006–06–01	31.02	未公布	未公布	93,962	1,257,334.36	2,914,701.24
合计							45,051,688.92	61,463,061.28

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

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	82,000	1,548,160.00	1,548,160.00	2006–12–28	2007–01–09	2007–01–09	网上
中国人寿	584,325	11,032,056.00	11,032,056.00	2006–12–28	2007–01–09	2007–04–09	网下
合计		12,580,216.00	12,580,216.00				

以上流通转让受到限制的股票是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

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
栖霞建设	7,500,000	52,100,000.00	85,125,000.00	2006–08–26	2006–08–26	2007–08–26
苏宁电器	1,200,000	28,800,000.00	53,376,000.00	2006–06–22	2006–06–23	2007–06–22
合计		80,900,000.00	138,501,000.00			

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

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	1,682,950	8,330,602.50	13,615,065.50	2006–07–26	2006–08–01	2007–02–01
广深铁路	2,395,300	9,006,328.00	17,174,301.00	2006–12–18	2006–12–21	2007–03–22
北辰实业	898,428	2,156,227.20	6,055,404.72	2006–09–28	2006–10–16	2007–01–16
中国银行	2,782,265	8,569,376.20	14,662,536.55	2006–06–28	2006–07–05	2007–01–05
大唐发电	373,000	2,491,640.00	3,841,900.00	2006–12–12	2006–12–20	2007–03–20
众和股份	53,328	471,419.52	733,793.28	2006–12–12	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
高新张铜	159,378	677,356.50	1,504,528.32	2006–10–12	2006–10–25	2007–01–25
雪 莱 特	32,558	223,347.88	611,764.82	2006–10–12	2006–10–25	2007–01–25
大港股份	131,651	697,750.30	1,137,464.64	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
中材科技	50,455	453,085.90	984,881.60	2006–11–07	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
孚日股份	175,045	1,171,051.05	1,508,887.90	2006–11–14	2006–11–24	2007–02–26
海鸥卫浴	71,104	570,965.12	1,594,151.68	2006–11–14	2006–11–24	2007–02–26
东方海洋	66,640	499,133.60	777,022.40	2006–11–14	2006–11–28	2007–02–28
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
山河智能	51,885	518,850.00	1,689,894.45	2006–12–12	2006–12–22	2007–03–22
合 计		40,917,105.74	75,421,876.61			

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

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80,750,000.00元(2005年12月31日:无),系以如下债券作为抵押:

债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末成本总额
06国开02	2007–01–08	99.86	850,000	84,881,000.00

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
股票市值	3,090,537,377.68	72.81%
债券市值	836,549,485.80	19.71%
权证市值	0.00	0.00%
资产支持证券	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金	277,131,501.40	6.53%
其他资产	40,669,651.09	0.95%
资产合计	4,244,888,015.97	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	5,608,006.05	0.14%
B 采掘业	222,599,047.54	5.68%
C 制造业	1,196,889,837.46	30.55%
C0食品、饮料	212,283,753.40	5.42%
C1纺织、服装、皮毛	2,242,681.18	0.06%
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	126,193,253.92	3.22%
C5电子	1,161,290.42	0.03%
C6金属、非金属	449,371,039.92	11.47%
C7机械、设备、仪表	251,682,438.76	6.42%
C8医药、生物制品	153,296,393.56	3.91%
C99 其他制造业	658,986.30	0.02%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	28,216,900.00	0.72%
E 建筑业	0.00	0.00%
F交通运输、仓储业	210,184,737.92	5.36%
G信息技术业	216,484,423.46	5.52%
H批发和零售贸易	291,761,907.92	7.44%
I金融、保险业	332,462,752.55	8.48%
J房地产业	438,001,107.02	11.18%
K社会服务业	54,880,004.50	1.40%
L传播与文化产业	92,311,188.62	2.36%
M综合类	1,137,464.64	0.03%
合 计	3,090,537,377.68	78.86%

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	600748	上实发展	22,837,239	270,392,909.76	6.90%
2	600036	招商银行	16,000,000	259,680,000.00	6.63%
3	002024	苏宁电器	5,700,364	253,552,190.72	6.47%
4	000858	五 粮 液	6,502,153	147,728,916.16	3.77%
5	600019	宝钢股份	16,176,660	137,825,143.20	3.52%
6	000709	唐钢股份	24,162,138	133,616,623.14	3.41%
7	600005	武钢股份	19,089,655	121,601,102.35	3.10%
8	600028	中国石化	12,098,200	110,456,566.00	2.82%
9	600583	海油工程	3,159,885	110,216,788.80	2.81%
10	002073	青岛软控	2,305,500	109,004,040.00	2.78%

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名的股票明细

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	600748	上实发展	196,994,363.30	9.34%
2	600036	招商银行	138,953,027.93	6.59%
3	000709	唐钢股份	127,265,561.26	6.03%
4	600362	江西铜业	120,499,892.17	5.71%
5	002073	青岛软控	115,306,007.66	5.46%
6	000858	五 粮 液	110,601,717.95	5.24%
7	600016	民生银行	106,479,005.13	5.05%
8	600028	中国石化	98,274,411.39	4.66%
9	600879	火箭股份	90,652,643.49	4.30%
10	600005	武钢股份	89,223,073.82	4.23%
11	600019	宝钢股份	86,227,273.69	4.09%
12	002052	同洲电子	68,605,322.07	3.25%
13	000069	华侨城 A	63,071,385.16	2.99%
14	600050	中国联通	62,994,109.20	2.99%
15	600675	中华企业	54,463,051.42	2.58%
16	600533	栖霞建设	52,100,000.00	2.47%
17	000623	吉林敖东	49,871,840.14	2.36%
18	600037	歌华有线	49,420,958.64	2.34%
19	000729	燕京啤酒	45,457,427.94	2.15%
20	000402	金 融 街	41,998,456.66	1.99%

(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名的股票明细

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	000402	金 融 街	281,195,892.19	13.33%
2	000895	S双 汇	158,214,385.24	7.50%
3	600028	中国石化	154,605,610.18	7.33%
4	002024	苏宁电器	151,525,996.38	7.18%
5	600694	大商股份	140,208,746.33	6.65%
6	600362	江西铜业	134,142,675.22	6.36%
7	600016	民生银行	131,198,891.57	6.22%
8	600036	招商银行	112,187,477.65	5.32%
9	600887	伊利股份	105,805,993.37	5.01%
10	600050	中国联通	100,287,767.64	4.75%
11	600900	长江电力	94,669,973.11	4.49%
12	000069	华侨城 A	82,488,468.55	3.91%
13	600717	天津港	70,916,223.68	3.36%
14	600019	宝钢股份	70,013,505.69	3.32%
15	000858	五 粮 液	65,442,544.56	3.10%
16	600320	振华港机	62,530,051.00	2.96%
17	600143	金发科技	58,608,718.04	2.78%
18	600596	新安股份	57,726,991.91	2.74%
19	600269	赣粤高速	55,564,917.64	2.63%
20	000888	峨眉山 A	51,716,054.29	2.45%
21	600276	恒瑞医药	51,712,993.15	2.45%

(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
买入股票成本总额	2,826,375,609.89
卖出股票收入总额	3,399,399,664.50

五、报告期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	市值(人民币元)	占基金资产净值比例
国 债	308,946,757.10	7.89%
央行票据	0.00	0.00%
企 业 债	506,700.00	0.01%
金 融 债	527,096,028.70	13.45%
可 转 债	0.00	0.00%
债券投资合计	836,549,485.80	21.35%

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	06国开02	149,787,000.00	3.82%
2	20国债04	97,437,462.50	2.49%
3	02国债14	94,389,968.20	2.41%
4	06国开15	78,962,864.78	2.01%
5	04国开01	70,036,540.00	1.79%

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)报告期末所有权证明细: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	权证名称	权证代码	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	五粮YGC1	030002	701,403	0.00
	五粮YGP1	038004	737,373	0.00
	沪场JTP1	580996	3,747,821	0.00
	招行CMP1	580997	4,036,854	0.00
	长电CWB1	580007	1,200,000	0.00
	茅台JCP1	580990	478,029	0.00
	国电JTB1	580008	1,200,000	0.00
	伊利CWB1	580009	901,530	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)报告期末其他资产构成

项 目	金额(人民币元)
交易保证金	598,780.49
应收证券清算款	1,777,276.70
应收利息	8,893,593.90
应收股利	0.00
其他应收款	29,400,000.00
待摊费用	0.00
合计	40,669,651.09

(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)本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)	占基金总份额比例
截止2005年12月31日持有份额	20,000,000	1.00%
本期增持份额	8,000,079	0.40%
截止2006年12月31日持有份额	28,000,079	1.40%
其中作为发起人持有份额	20,000,000	1.00%

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	35,716户
报告期末平均每户持有的基金份额	55,997.31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	2,000,000,000	100.00%
其中:机构投资者持有的基金份额	1,182,275,056	59.11%
个人投资者持有的基金份额	817,724,944	40.89%

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	188,847,191	9.44%
2	中国人寿保险(集团)公司	166,159,547	8.31%
3	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	90,859,550	4.54%
4	中国平安保险(集团)股份有限公司	68,446,010	3.42%
5	中国人民财产保险股份有限公司	64,126,804	3.21%
6	UBS AG	54,976,843	2.75%
7	泰康人寿保险股份有限公司–分红–个人分红–019L–FH002深	44,156,663	2.21%
8	永安财产保险股份有限公司	39,652,140	1.98%
9	宝钢集团有限公司	34,974,450	1.75%
10	中国再保险(集团)公司	34,437,505	1.72%

第九章 重大事件揭示

一、本基金在2006年度未召开基金份额持有人大会。

二、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。

三、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

根据本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[2006]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。

经本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)。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。

四、聘请会计师事务所情况

本基金报告期内未改聘会计师事务所。

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95,000元。安永华明会计师事务所已连续为本基金提供审计服务8年。

五、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。

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、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。

八、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。

九、2006年8月30日,本公司发布了本基金投资非公开发行股票–栖霞建设公告。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、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。

十一、基金收益分配事项

2006年12月28日,本基金实施2006年度第一次收益分配,向全体基金份额持有人按每10份基金份额派发现金收益1.50元,共派发现金收益300,000,000.00元(以中国证券登记结算有限责任公司的确认数据为准)。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。

十二、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	渤海证券有限责任公司	1		1
2	国元证券有限责任公司	1	1	2
3	招商证券股份有限公司	1		1
4	中信建投证券有限责任公司		1	1
5	申银万国证券股份有限公司	1	1	2
6	长城证券有限责任公司	1		1
7	广发华福证券有限责任公司	1		1
8	中山证券有限责任公司		1	1
9	平安证券有限责任公司		1	1
	合计	6	5	11

(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
渤海证券有限责任公司	463,949,917.74	7.72%	379,973.42	7.86%
国元证券有限责任公司	1,482,263,519.97	24.65%	1,179,086.22	24.38%
招商证券股份有限公司	193,007,156.78	3.21%	158,183.14	3.27%
中信建投证券有限责任公司	598,015,490.61	9.94%	467,949.95	9.67%
申银万国证券股份有限公司	1,384,564,637.01	23.03%	1,118,907.22	23.14%
长城证券有限责任公司	529,197,343.55	8.80%	424,601.36	8.78%
广发华福证券有限责任公司	1,362,229,273.19	22.65%	1,107,288.04	22.90%
合计	6,013,227,338.85	100.00%	4,835,989.35	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
渤海证券有限责任公司	47,099,111.50	20.21%	0.00	0.00%
国元证券有限责任公司	43,750,711.00	18.78%	200,000,000.00	7.23%
招商证券有限责任公司	32,426,480.00	13.92%	0.00	0.00%
中信建投证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
申银万国证券有限责任公司	75,593,124.00	32.44%	795,100,000.00	28.72%
长城证券有限责任公司	597,613.40	0.26%	250,000,000.00	9.03%
广发华福证券有限责任公司	33,539,371.80	14.39%	1,523,000,000.00	55.02%
合计	233,006,411.70	100.00%	2,768,100,000.00	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
渤海证券有限责任公司	7,526,419.32	23.06%
国元证券有限责任公司	1,902,343.70	5.83%
申银万国证券有限责任公司	1,698,815.30	5.20%
长城证券有限责任公司	6,810,284.10	20.86%
华福证券有限责任公司	14,707,960.13	45.05%
合 计	32,645,822.55	100.00%

(七)报告期内租用证券公司席位的变更情况:停止租用平安证券有限责任公司上海一个席位,停止租用长城证券有限责任公司深圳一个席位。

十三、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

同益证券投资基金 2006年度第二次收益分配公告

我司所管理的同益证券投资基金(以下简称“基金同益”,交易代码为184690)截至2006年12月31日已实现的可分配收益为70,715.34万元。本着及时回报投资者的原则,本基金决定实施2006年度第二次收益分配。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《同益证券投资基金合同》及其他相关的规定,我司拟定了基金同益2006年度第二次收益分配方案,并经基金同益的托管人中国工商银行股份有限公司复核,现公告如下:

一、收益分配方案

基金同益截至2006年12月31日实现净收益1,020,426,906.12元,期初未分配净收益–13,273,473.45元,基金同益于2006年12月29日进行了2006年度第一次收益分配,共计300,000,000.00元。截至2006年12月31日可分配收益为707,153,432.67元。

基金同益2006年第二次收益分配方案为:向全体基金份额持有人按每10份基金份额派发现金收益3.20元,共派发现金收益640,000,000.00元(以中国证券登记结算有限责任公司的确认数据为准),占可分配收益的90.50%,未分配基金净收益部分仍保留在基金资产中。基金同益2006年12月31日的基金份额净值为1.9595元,收益分配后,经调整的基金份额净值为1.6395元。

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于证券投资基金税收问题的通知》的规定,基金向投资者分配的基金收益,暂免征所得税。

二、收益分配对象

截至2007年4月3日下午深圳证券交易所收市后,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益的全体基金份额持有人。

三、权益登记日和除息日

权益登记日:2007年4月3日

除息日:2007年4月4日

四、收益发放办法

1、本次可流通部分基金派发的现金收益于2007年4月4日通过投资者托管的证券商直接划入其资金账户。

2、本基金发起人持有的不可流通部分基金份额应得现金收益由本基金直接向各发起人发放。

五、咨询机构

长盛基金管理有限公司
办公地址:北京市海淀区北太平庄路18号
城建大厦A座20–22层
邮政编码:100088
客户服务中心电话:400–888–2666,010–62350088
公司网址:http://www.csfunds.com.cn

特此公告。

长盛基金管理有限公司
二〇〇七年三月二十九日