

长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)摘要

基金管理人:长盛基金管理有限公司 基金托管人:中国银行股份有限公司

重要提示
长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)由同智证券投资基金转型而成。依据中国证监会2006年12月26日证监基金字[2006]260号文核准的同智证券投资基金基金份额持有人大会决议,同智证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金,调整存续期限、终止上市,调整投资目标、范围和策略,修订基金合同,并更名为“长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)”。自2007年1月5日起,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(LOF)基金合同》生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资者申购基金前应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。本招募说明书(更新)所载内容截止日为2007年7月5日,有关财务数据和净值表现截止日为2007年6月30日(财务数据未经审计)。

一、基金合同生效的日期
2007年1月5日
二、基金管理人
(一)基金管理人基本情况
1、基本信息
名称:长盛基金管理有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座1211室
办公地址:北京市海淀区北太平庄路18号城建大厦A座21层
法定代表人:吴长志
成立时间:1999年3月
电话:(010)82265818
传真:(010)82265898
联系人:叶金松
2、经营概况
本基金管理人经中国证监会证监基金字[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。截至目前,本公司股东及其出资比例为:国元证券有限责任公司占注册资本的41%;新加坡展展资产管理有限公司占注册资本的33%;安徽省创新投资管理有限公司占注册资本的13%;安徽省投资集团有限责任公司占注册资本的13%。截至2007年6月30日,基金管理人共管理三只封闭式基金、六只开放式基金和四只社保基金委托资产,公募基金管理资产规模约314.33亿元。

(二)主要人员情况
1、基金管理人董事会成员:
吴长志先生,董事长,博士,高级经济师。曾历任安徽省政府办公厅第二办公室副主任、安徽省国际信托投资公司副总经理、安徽省证券管理办公室主任、安徽省政府驻香港窗口公司黄山有限公司董事长、安徽省国际信托投资公司副总经理(主持工作)、安徽国元控股(集团)有限责任公司国元信托有限责任公司董事长,现为国元证券有限责任公司董事长。

杜长楙先生,董事,学士。历任安徽省第一轻工业厅研究室副主任、安徽省轻工业厅生产技术处、企业管理处处长、副厅长,安徽省巢湖市市委常委、常务副市长,安徽省发改委副主任,现任安徽省投资集团有限责任公司党委书记、总经理。

蔡秋先生,董事,学士,高级经济师。曾在安徽财贸学院财政金融系任会计教研室主任、安徽省国际经济技术合作公司美国(惠菲)分公司任财务经理,历任安徽省国际信托投资公司国际金融部经理、深圳证券营业部总经理、安徽省政府驻香港窗口公司黄山有限公司总经理助理、安徽省国际信托投资公司证券总部副总经理,现为国元证券有限责任公司董事、总裁。

叶斌先生,董事,学士,高级经济师。曾任安徽大学管理学讲师、教研室副主任,历任安徽省信托投资公司部门经理、副总经理,现为安徽省中小企业信用担保中心副主任,任安徽省创新投资管理有限公司总经理。

陈平先生,董事,硕士研究生。曾在合肥工业大学管理系任教,历任安徽省国际信托投资公司证券发行部经理、证券部经理,现为国元证券有限责任公司副总裁。

钱进先生(340104650425209),董事,硕士研究生。曾历任安徽省节能中心副主任、安徽省经贸投资集团董事长、安徽省医药集团股份有限公司总经理,现为安徽省投资集团有限责任公司运营部经理。
徐经戈先生,独立董事,博士,教授,中国人民大学商学院MPAcc中心主任,会计系副主任。财政管理教研室委员会委员,香港中文大学和清华大学PMB A项目特聘教授,香港理工大学MPAcc项目特聘教授,已主持国家社科基金、国家自然科学基金、财政部重点会计科研课题四项,主要研究领域为国际比较会计、证券市场会计监督。已公开发布专著两部,主编教材五本,在《经济理论与经济管理》、《财资研究》、《会计研究》等核心期刊中发表论文100余篇。

荣兆祥先生,独立董事,经济学学士,教授,兼任黄山金马股份有限公司独立董事。曾任安徽省社会科学规划主编,现为安徽大学经济学院院长,校学术委员会委员,产业经济学和工商管理硕士学位学科带头人,武汉大学商学院博士生导师,安徽省政府特邀专家;全国马列史学常务理事,全国资本论研究会常务理事,安徽省经济学常务理事。

陈华先生,独立董事,博士毕业,教授,博士生导师。曾历任中国科技大学商学院信息管理与决策研究室主任,中国科技大学商学院商务智能实验室主任,现为中国科技大学管理学院副院长,中国科技大学“管理科学与工程”一级学科博士点的学科带头人。

李伟强先生,独立董事,美国加州大学洛杉矶分校工商管理硕士,美国宾州州立大学政府管理硕士和法国文学硕士。曾历任摩根士丹利证券部、新加坡、香港等地投资顾问、副总裁,花旗环球金融亚洲有限公司高级副总裁,现任香港国际资本管理有限公司董事长。

2、基金管理人监事会成员:
钱正先生,监事,学士,高级经济师。曾历任安徽省人大常委会办公厅副处长、处长,安徽省信托投资公司副总经理,党委副书记,安徽省国有资产管理局分党组书记,现为安徽省创新投资有限公司董事长。

陶伟先生,监事,学士,经济师。曾历任海南联合租赁公司总经理助理,中山集团财务公司证券营业部经理、南京民生租赁有限公司董事长,现为江南模塑科技股份有限公司董事长。

肖盛先生,监事,学士。曾历任中信证券有限责任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所营业部副经理、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、长盛动态精选基金经理、投资管理总部副总监,现任长盛同智优势成长混合型证券投资基金(原基金同智)基金经理。

3、本基金基金经理
肖盛先生:学士,曾历任中信证券有限责任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所营业部副经理、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,2002年11月2日—2004年10月15日任基金同益基金经理,2004年5月21日—2005年4月22日任基金同盛动态精选基金经理,曾任投资管理总部副总监,2006年4月29日至今任本基金基金经理。

丁骏先生,1974年11月出生。中国人民大学研究生国际金融中心,历任中国建设银行浙江省分行国际业务部本外币交易员、经济师,国泰君安证券股份有限公司企业金融部业务经理,高级经理;2003年6月加入长盛基金管理有限公司,先后担任研究发展部行业研究员、机构理财部组合经理助理,自2006年11月29日起任基金同盛基金经理,2007年3月1日至今任本基金基金经理。
历任基金经理情况:丁骏先生,2000年5月10日—2000年8月21日任本基金基金经理;李翔先生,2000年8月21日—2002年6月22日任本基金基金经理;闵显先生,2002年6月22日—2003年12月4日任本基金基金经理;罗文琴先生,2003年12月4日—2004年5月22日任本基金基金经理;闵显先生,2004年5月22日—2005年10月21日任本基金基金经理。田荣华先生,2005年10月21日—2007年3月1日任本基金基金经理。

4、投资决策委员会成员
陈礼华先生:硕士,高级经济师。历任国务院财政税收物价大检查办公室、财政部国债司和国债金融司主任科员,华泰财产保险股份有限公司投资部研发处负责人,经理,南方基金管理有限公司总经理助理兼投资总监、投资交易总监,长盛基金管理有限公司副经理等职。现任长盛基金管理有限公司总经理。

宋鹤山先生:清华大学工学硕士。历任国家科技部基础研究中心主任科员;博时基金管理有限公司研究部研究员,裕隆基金经理助理,基金裕阳基金经理,基金裕华基金经理,交易部总经理,美国基金管理有限公司投资副总监兼基金汉兴基金经理;东方基金管理有限责任公司分管投资副经理兼东方龙基金经理;2006年3月起,加入长盛基金管理有限公司,现任长盛基金管理有限公司副总经理。

叶金松先生,大学,会计师。历任安徽省财厅公司财务部经理,安徽省信托投资公司财务部副经理,国元证券有限责任公司清算中心主任、风险监控部副经理,经理等职,现任长盛基金管理有限公司督察长。

李骥先生:博士,历任中体改研研究会研究员,嘉实基金管理有限公司分析师、副总监。现任长盛基金管理有限公司研究发展部副总监。

上述人员之间均不存在近亲属关系。
三、基金托管人
本基金之基金托管人为中国银行股份有限公司(简称“中国银行”),基本情况如下:办公及住所地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:肖钢
企业类型:股份有限公司
注册资本:人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰零陆拾陆万柒仟零玖元
存续期间:持续经营
成立日期:1983年10月31日
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基金字[1998]124号
托管部门总经理:秦立鹏
托管部门联系人:李敬
电话:(010)66594977
传真:(010)66594942

四、相关服务机构
(一)基金份额发售机构
1、直销机构
(1)长盛基金管理有限公司北京分公司
地址:北京市海淀区北太平庄路18号城建大厦A座20—22层
电话:010-82265818 转 263、288
传真:010-82265881、82265882
联系人:银晓娟
客户服务电话:010-62350088、400-888-2666

(2)长盛基金管理有限公司上海分公司
地址:上海市浦东新区浦东南路379号金耀大厦15楼F座
电话:021-68869285、021-68869286
传真:021-68869287
联系人:冯岩
2、代销机构
(1)中国银行
住所:北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:肖钢

电话:(010)66594973
传真:(010)66594946
联系人:高越
客户服务电话:95656
网站:www.boc.cn

(2)中国农业银行
住所:北京市复兴路甲23号
法定代表人:杨明生
电话:(010)68298560、68297288
传真:(010)68297268
联系人:蒋浩
客户服务电话:95599
公司网站:http://www.abchina.com
(3)国元证券有限责任公司
住所:合肥市寿春路179号
法定代表人:吴长志
开放式基金咨询电话:安徽地区:96888;全国:400-8888-777
开放式基金业务传真:(0651)2634400-3612
联系人:李勇
(4)中信建投证券有限责任公司
住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳区门内大街188号
法定代表人:张军
开放式基金咨询电话:400-8888-108
开放式基金业务传真:(010)65182261
联系人:权唐
(5)招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座40—46层
法定代表人:肖青松
电话:(0755)82943666
传真:(0755)82943237
联系人:黄健
客户服务热线:4008888111、(0755)26951111
(6)海通证券股份有限公司
住所:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
电话:(021)53594666
联系人:金芸、杨薇
客服电话:400-8888-001、(021)962503
(7)国泰君安证券股份有限公司
住所:深圳市福田区华强北路赛格广场45层
办公地址:北京市东城区安外大街2号安大厦3层
法定代表人:王卫华
电话:(010)64482828-390
传真:(010)64482090
联系人:马彦承
(8)东方证券股份有限公司
住所:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人:王益民
联系人:吴宇
电话:021-50367888
传真:021-50368988
客户服务热线:021-962506
东方证券网站:www.dfzq.com.cn

(9)第一创业证券股份有限公司
住所:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
办公地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
法定代表人:刘学民
开放式基金咨询电话:0755-25323886
开放式基金业务传真:0755-25331718
联系人:杨畅
联系电话:0755-25323266
公司网站:www.fcy.com.cn
(10)兴业银行股份有限公司
住所:福州市银光路154号
办公地址:福州市湖东路154号
法定代表人:丁善平
电话:(021)62677777
联系人:苏勤
兴业银行网址:www.cib.com.cn
(11)申银万国证券股份有限公司
住所:上海市常熟路171号
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁卫
电话:(021)54033888
传真:(021)54035333
联系人:李倩怡
公司网站:www.sww2000.com.cn
(12)东北证券有限责任公司
住所:长春市人民大街138-1号
办公地址:长春市人民大街138-1号
法定代表人:李寿
开放式基金咨询电话:(0431)96688-0、(0431)5096733
开放式基金业务传真:(0431)56880032
联系人:高新宇
公司网站:www.nesoc.cn
(13)德邦证券有限责任公司
住所:沈阳市沈河区小西路49号
办公地址:上海市浦东南路588号浦发大厦26层
法定代表人:王军
电话:(021)68590088-8119
传真:(021)68590077
联系人:罗芳
公司网站:www.tebon.com.cn

(14)渤海证券股份有限公司
住所:天津市经济技术开发区第一大街29号
办公地址:天津市河西区滨水道3号
法定代表人:张志军
客户服务电话:(022)28455588或城市营业网点咨询电话
电话:(022)28451883
联系人:徐焕强
公司网站:www.bwh.com.cn

(15)中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:朱利
电话:(010)66568047
传真:(010)66568536
联系人:李洋
公司网站:www.chinastock.com.cn
(16)国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市延平路135号
法定代表人:祝幼一
电话:(021)62580118-213
传真:(021)62569400
联系人:芮敬祺
(17)广发证券股份有限公司
住所:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室
办公地址:广东广州市天河区路马场广六、38、41和42楼
法定代表人:王石伟
电话:(020)87555888
传真:(020)87557985
联系人:肖梅
公司网站:www.gf.com.cn

(18)广发华福证券股份有限公司
住所:福州市新天地大厦8层
办公地址:福州市新天地大厦8层
法定代表人:黄金雄
电话:(0591)87383623
传真:(0591)87383610
联系人:张鹏
公司网站:www.gtfzfq.com.cn
(19)国联证券有限责任公司
住所:无锡市县前东街8号
办公地址:无锡市县前东街8号6楼、7楼
法定代表人:范亮
开放式基金咨询电话:(0510)82581867
开放式基金业务传真:(0510)82831589
联系人:袁丽萍
公司网站:www.glis.com.cn

(20)联合证券有限责任公司
住所:深圳市深南东路5047号发展银行大厦10、14、24、25楼
办公地址:深圳市深南东路5047号发展银行大厦10、14、24、25楼
法定代表人:王政
电话:(0755)82492000
传真:(0755)82492062
联系人:盛宗峻
客户服务电话:400-8888-555、(0755)25125666
公司网站:www.lhjz.com

(21)新时代证券有限责任公司
住所:北京市西城区月坛北街2号月坛大厦A座15层

办公地址:北京市西城区月坛北街2号月坛大厦A座15层
法定代表人:马金声
电话:(010)62672763
传真:(010)62672764
联系人:戴斌
(二)注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街27号投资广场22层
法定代表人:陈雁飞
电话:(010)58568839
传真:(010)58568807
联系人:朱立元

(三)律师事务所和经办律师
名称:国浩律师集团(北京)事务所
住所:北京市东城区建国门内大街9号E座9层
负责人:王卫东
联系电话:(010)65171188
传真:(010)65176800
经办律师:李永飞 王卫东

(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:安永华明会计师事务所
住所:中国北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼(东三办公楼)16层
办公地址:中国北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼(东三办公楼)16层
法定代表人:葛明
电话:58153000
传真:85188298
联系人:葛明 金睿
经办注册会计师:张小东 李欣

五、基金的名称
六、基金的类型
基金类型:契约型开放式
七、基金的投资目标
主要投资于业绩能够持续成长成长型上市公司,在尽可能地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。

八、基金的投资方向
本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券,权证以及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具。其中,股票投资占基金资产的比例范围为30%-95%;权证投资占基金资产净值比例范围为0-3%;债券投资占基金资产的比例范围为0-65%;现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值比例在5%以上。本基金将不低于80%的股票资产投资于具有较大成长潜力的上市公司股票。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
九、基金的投资策略
(一)投资组合
股票选择重于时机选择;在经济发展的不同阶段,各行业表现的景气度会出现显著差异,只有少数上市公司能充分分享中国经济的未来增长。
(二)投资管理
1、资产配置策略
本基金为混合型基金,根据对宏观经济、行业状况、公司成长性 & 资本市场的判断,综合评价各类资产的风险收益水平,对各类资产采取适度灵活的资产配置。

2、股票投资策略
本基金为主动管理的混合型基金,投资策略上偏重选股能力的发挥。我们认为,中国未来20年仍然是全球增长速度最快的经济体,因此上市公司中将出现一批伴随着中国经济发展而不断成长的公司,本基金的根本任务就是要通过定性和定量地分析、判断,找到这些公司并长期投资,分享中国经济的成长。
本基金的主要选股思路是采用自下而上的路径。即首先把握行业的走势,根据公司行业经济模型显示的行业景气度变化趋势和基金经理的自身判断,得出行业投资的优先排序。对行业内上市公司进行综合比较,全面分析上市公司的毛利率及其增长率、主营业务收入增长率、主营业务利润增长率和净利润增长率以及净资产收益率等指标,重点考察PEG指标,将各个指标划分等级并予以相应的分数和权重,最后得出该行业内的公司投资优先排序,基金的主要资产配置在优先排序前50%的公司上。
此外,还要结合一些定性因素最终确定拟投资的成长类股票:

- 管理层的稳定性、职业化程度、职业道德、沟通能力等;
- 是否具有法人治理结构优势,包括信息披露程度、激励约束机制、关联交易情况等;
- 是否具有生产优势,包括原材料垄断情况、产能利用率、质量控制能力、成本控制能力等等;
- 公司的技术领先水平、研发投入比例;
- 公司的营销渠道是否健全,产品是否具有品牌和市场认知度;
- 行业的营销结构,是否有准入壁垒,技术壁垒或者其他壁垒;
- 公司在行业中的地位、市场占有率、竞争能力、竞争策略;
- 公司的财务政策、财务杠杆是否合理;
- 其他重要因素

3、债券投资策略
本基金为主动管理的混合型基金,债券投资收益是基金投资收益的来源之一,债券组合的构建与调整按照下列标准进行:
(1)类似信用等级和期限的债券中选择到期收益率较高的债券;
(2)类似信用等级、久期及到期收益率水平的债券中选择凸性较高的债券;
(3)流动性较高的债券;
(4)可获得较好当期收益的债券;
(5)其他价值被低估、有增值潜力的债券。

(三)投资禁止行为与限制
1、禁止用本基金资产从事以下行为
(1)承销证券;
(2)向他人贷款或提供担保;
(3)从事内幕交易的投资;
(4)买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;
(5)买卖其他基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

(6)买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人具有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
(7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(8)依照法律、行政法规有关法律规定,由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

2、基金投资组合比例限制
(1)本基金持有一家上市公司的股票,不超过基金资产净值的百分之十;
(2)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,不得超过该证券总市值的百分之十;
(3)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的百分之三;
(4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的百分之十;
(5)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的千分之五;
(6)本基金投资同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的百分之十;
(7)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的百分之二十;
(8)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的百分之十;
(9)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的百分之十;
(10)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资产净值的百分之四十;
(11)本基金不得违反本基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例的约定;
(12)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
(13)保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;
(14)相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

3、若相关法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更,致使本款前述约定的投资禁止行为和投资限制不再适用,基金管理人将在履行适当程序后,本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。
十、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%
-1年定期存款利率+5%

十一、基金的风险收益特征
本基金是较高预期收益—较高预期风险的产品,其预期收益与风险高于债券基金与货币市场基金。
十二、基金的投资组合报告
本基金管理人长盛基金管理有限公司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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,复核了本报告中的财务指标、净值表现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。
本投资组合报告所载数据截至2007年6月30日(注:2007年1月1日起至2007年1月4日止为转托管前的同智证券投资基金)。本报告财务数据未经会计师事务所审计。
(一)2007年6月30日基金资产组合情况

资产项目	金额(人民币元)	占基金资产总值比例
股票市值	9,178,687,796.98	91.03%
债券市值	0.00	0.00%
权证市值	0.00	0.00%
资产支持证券	0.00	0.00%
银行存款和备付金合计	723,333,609.23	7.17%
国债期货	181,205,630.56	1.80%
资产合计	10,083,227,066.77	100.00%

(二)2007年6月30日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	311,350,833.13	3.14%
C 制造业	4,336,089,437.35	43.80%
D 医药、饮料	225,158,907.96	2.27%
E 建筑业、房地产、皮毛	0.00	0.00%
F 木材、家具	0.00	0.00%

C3 造纸、印刷	381,272,330.38	3.85%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	486,034,072.84	4.91%
C5 电子	1,634,425.48	0.02%
C6 金属、非金属	605,681,278.56	6.12%
C7 机械、设备、仪表	2,126,026,229.33	21.47%
C8 医药、生物制品	389,123,085.96	3.93%
C9 其他制造业	122,279,619.88	1.23%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	415,060,468.16	4.20%
E 建筑业	126,556,670.88	1.28%
F 交通运输、仓储业	658,862,281.39	6.66%
G 信息技术业	476,789,115.90	4.82%
H 批发和零售贸易	480,767,636.76	4.86%
I 金融、保险业	864,539,777.34	9.96%
J 房地产业	1,103,064,371.64	11.14%
K 社会服务业	172,304,602.12	1.74%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	112,323,202.40	1.13%
合计	9,178,687,796.99	92.72%

(三)2007年6月30日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)	市值(人民币元)	市值占基金资产净值比例
1	600835	上海机场	21,449,904	832,386,617.28	5.38%
2	000002	万科A	24,606,892	470,483,775.04	4.75%
3	000651	格力电器	12,565,067	438,171,489.30	4.43%
4	000204	苏宁电器	9,225,771	433,242,206.16	4.38%
5	600089	上海机场	10,108,570	394,226,973.76	3.88%
6	600031	三一重工	8,503,588	376,113,743.47	3.80%
7	601318	中国平安	5,251,006	375,505,803.45	3.79%
8	000024	招商地产	6,437,648	316,088,516.80	3.19%
9	600030	中信证券	5,866,279	310,736,796.63	3.14%
10	600038	招商银行	11,983,465	291,726,889.70	2.96%

(四)2007年6月30日按券种分类的债券投资组合
截止2007年6月30日,本基金未持有债券。
(五)2007年6月30日按市值占基金资产净值比例大小排序前五名债券明细
截止2007年6月30日,本基金未持有债券。

(六)投资组合报告附注
1.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。
2.2007年6月30日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。

3.2007年6月30日其他资产构成

其他资产项目	金额(人民币元)
交易保证金	5,543,882.83
应收申购款	8,584,323.98
应收利息	209,741.25
应收证券清算款	164,044,017.19
应收股利	2,824,665.30
合计	181,205,630.55

4.2007年6月30日基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金未持有可转换债券。
5.2007年6月30日本基金投资权证明细
本基金未持有权证。

6.2007年6月30日基金持有的资产支持证券明细
本基金未持有资产支持证券。
十三、基金的业绩
本基金成立以来的业绩如下:

项 目	2007年1月5日至2007年6月30日
基金份额净值增长率	69.60%
同期业绩比较基准收益率	48.32%
超额收益率	21.28%

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来表现。投资决策有风险,投资者在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

十四、基金费用与税收
(一)基金费用的种类
1.基金管理人的管理费;
2.基金托管人的托管费;
3.因基金的资金交易及清算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等);
4.基金合同生效以后的信息披露费用;
5.基金合同持有人大会公告费用;
6.基金合同生效以后的会计师事务所和律师费;
7.基金的资金汇划费用;
8.按照国家有关法律法规规定应列入的其他费用。

(二)基金费用的计提、计提标准和支付方式
1.基金管理人的管理费
基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times 1.5\%$
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。