长盛同德主题增长股票型证券投资基金2007年年度报告摘要

（上接D55版）

2、利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

单位：人民币元

2007年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	379,712,641.92	0.00	0.00	0.00	379,712,641.92
结算备付金	2,545,898,981.61	0.00	0.00	0.00	2,545,898,981.61
存出保证金	160,000.00	0.00	0.00	1,000,000.00	1,160,000.00
交易性金融资产	50,534,019.60	20,172,000.00	24,430,668.00	10,395,549,192.54	10,490,685,880.14
衍生金融资产	0.00	0.00	0.00	11,129,401.02	11,129,401.02
应收利息	0.00	0.00	0.00	2,053,788.66	2,053,788.66
应收申购款	0.00	0.00	0.00	64,765,681.89	64,765,681.89
其他资产	0.00	0.00	0.00	30,000.00	30,000.00
资产总计	2,976,305,643.13	20,172,000.00	24,430,668.00	10,474,528,064.11	13,495,436,375.24
负债					
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	165,113,003.45	165,113,003.45
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	62,818,173.11	62,818,173.11
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	16,099,077.19	16,099,077.19
应付托管费	0.00	0.00	0.00	2,683,179.52	2,683,179.52
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	8,160,703.62	8,160,703.62
应付税费	0.00	0.00	0.00	189,955.72	189,955.72
其他负债	0.00	0.00	0.00	846,752.24	846,752.24
负债总计	0.00	0.00	0.00	255,910,844.85	255,910,844.85
利率敏感度缺口	2,976,305,643.13	20,172,000.00	24,430,668.00	10,218,777,219.26	13,239,525,530.39

于2007年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产的比例低于1%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

3、外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险

第七章　基金同德财务会计报告

第一节 基金会计报表（经审计）

一、资产负债表

同德证券投资基金资产负债表

单位：人民币元

项目	2007年10月24日（基金合同失效前）	2006年12月31日
资产		
银行存款	141,776,436.85	123,387,246.73
结算备付金	4,202,329.22	5,187,685.66
存出保证金	910,000.00	910,000.00
交易性金融资产	1,378,218,721.29	998,759,350.52
其中：股票投资	1,159,468,941.29	783,498,666.94
债券投资	218,749,780.00	215,260,683.58
衍生金融资产	13,158,000.00	4,356,600.00
应收利息	3,551,255.76	1,999,247.09
其他资产	30,602.32	30,000.00
资产总计	1,541,847,345.44	1,134,630,130.00
负债及所有者权益		
负债：		
应付证券清算款	0.00	82,494,241.44
应付管理人报酬	1,538,915.52	1,256,442.02
应付托管费	256,485.93	209,407.00
应付交易费用	3,536,397.63	1,085,452.27
应付税费	189,955.72	189,955.72
其他负债	560,385.84	360,000.00
负债总计	6,082,140.64	85,595,498.45
所有者权益：		
实收基金	500,000,000.00	500,000,000.00
未分配利润	1,035,765,204.80	549,034,631.55
所有者权益合计	1,535,765,204.80	1,049,034,631.55
负债及所有者权益总计	1,541,847,345.44	1,134,630,130.00

注：2007年10月24日每份额基金资产净值：3.0715元，2006年末每份额基金资产净值：2.0981元。

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分

二、利润表

同德证券投资基金利润表

单位：人民币元

项目	2007年1月1日至2007年10月24日（基金合同失效前）止期间	2006年度
收入		
利息收入	6,568,826.73	4,830,432.96
其中：存款利息收入	629,673.39	517,120.23
债券利息收入	5,939,153.34	4,313,312.73
投资收益	739,255,325.45	321,731,022.76
其中：股票投资收益	727,192,745.14	310,366,023.37
债券投资损失	-1,319,667.41	11,823.05
衍生工具收益	7,322,959.22	3,035,680.79
股利收益	6,059,288.50	8,317,495.55
公允价值变动收益	260,992,819.55	201,599,073.27
其他收入	22,724.85	721.60
收入合计	1,006,839,696.58	528,161,250.59
费用		
管理人报酬	15,420,411.90	11,274,889.87
托管费	2,570,068.70	1,879,148.33
交易费用	13,046,439.43	7,079,273.29
利息支出	2,232,170.83	1,275,982.49
其中：卖出回购金融资产支出	2,232,170.83	1,275,982.49
其他费用	1,840,032.47	488,944.04
费用合计	35,109,123.33	21,998,238.02
利润总额	971,730,573.25	506,163,012.57

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，封闭式基金交易佣金等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

三、所有者权益（基金净值）变动表

同德证券投资基金所有者权益（基金净值）变动表

单位：人民币元

项 目	2007年1月1日至2007年10月24日（基金合同生效日）止期间		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
年初所有者权益（基金净值）	500,000,000.00	549,034,631.55	1,049,034,631.55
本年经营活动产生的基金净值变动数（本年净利润）	0.00	971,730,573.25	971,730,573.25
本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	0.00	485,000,000.00	485,000,000.00
年末所有者权益（基金净值）	500,000,000.00	1,035,765,204.80	1,535,765,204.80
项 目	2006年度		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
年初所有者权益（基金净值）	500,000,000.00	65,871,618.98	565,871,618.98
本年经营活动产生的基金净值变动数（本年净利润）	0.00	506,163,012.57	506,163,012.57
本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	0.00	23,000,000.00	23,000,000.00
年末所有者权益（基金净值）	500,000,000.00	549,034,631.55	1,049,034,631.55

第二节 年度会计报表附注（经审计）

一、财务报表编制的基础

本基金原以2006年2月15日以前颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》和《证券投资基金会计核算办法》(以下合称"原会计准则和制度")、《同德证券投资基金基金合同》以及中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制财务报表。自2007年7月1日起，本基金开始执行财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则(以下简称"企业会计准则")和中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》。2007年1月1日至2007年10月24日(基金合同失效前)止期间财务报表为本基金首份按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《同德证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注三所列示的基金行业实务操作的规定编制的财务报表。

在编制2007年1月1日至2007年10月24日(基金合同失效前)止期间财务报表时，2006年度以及2007年1月1日至2007年6月30日止期间的相关数字已按照《企业会计准则第38号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整，涉及的主要内容包括：将所持有的股票投资、债券投资和权证投资等划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值调整账面价值，且将原计入所有者权益的公允价值变动计入当期损益。

本财务报表所有报表项目已按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》重新列报。按原会计准则和制度列报的2006年1月1日、2006年12月31日和2007年6月30日的所有者权益，以及2006年度和2007年1月1日至2007年6月30日止期间的净损益调整为按企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》列报的所有者权益及净损益的金额调节过程列示于本财务报表附注九。

经中国证监会批准并经上交所同意，基金管理人长盛基金管理有限公司将本基金于存续期结束前转型为长盛同德主题增长股票型证券投资基金并相应延长存续期至不定期，因此本财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

二、遵循企业会计准则的声明

本基金2007年1月1日至2007年10月24日(基金合同失效前日)止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2007年10月24日(基金合同失效前日)的财务状况以及2007年1月1日至2007年10月24日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

三、重要会计政策和会计估计

（一）会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2007年1月1日至2007年10月24日(基金合同失效前日)。

（二）记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

（三）金融资产和金融负债的分类及抵销

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

（四）基金资产的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。本基金以上述原则确定的公允价值进行基金资产估值，主要资产的估值方法如下：

1、股票投资

上市交易的股票于2007年7月1日之前按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易均价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易均价估值；自2007年7月1日起，上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

2007年7月1日之前，首次公开发行有明确锁定期的股票，在同一股票上市交易后，在锁定期内按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价估值；自2007年7月1日起，在锁定期内按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

由于送股、转增股、配股和公开增发形成的暂时流通受限制的股票于2007年7月1日之前按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价估值；自2007年7月1日起，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

2006年11月13日之前取得的非公开发行股票，在锁定期内按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价估值。2006年11月13日至2007年7月1日止期间，基金取得的非公开发行股票在锁定期内的估值方法为：若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自2007年7月1日起，基金取得的非公开发行股票在锁定期内的估值方法为：若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

2、债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债于2007年7月1日之前按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易均价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易均价估值；自2007年7月1日起，按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券于2007年7月1日之前按估值日市场交易均价减去债券均价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易均价减去债券均价中所含的债券应收利息得到的净价估值；自2007年7月1日起，按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

银行间同业市场交易的债券按采用估值技术确定的公允价值估值。

未上市流通的债券按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

3、权证投资

从获赠确认日或买入成交日起到卖出成交日或行权日止，上市交易的权证投资于2007年7月1日之前按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易均价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易均价估值；自2007年7月1日起，按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次发行未上市交易的权证投资按采用估值技术确定的公允价值估值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值；因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。

4、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，本基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（五）证券投资基金成本计价方法

1、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

（1）股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。2007年7月1日之前，股票投资成本按交易日应支付的全部价款确认，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；自2007年7月1日起，股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

（2）债券投资

2007年7月1日之前，买入证券交易所交易的债券于交易日确认为债券投资；买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资成本按交易日应支付的全部价款并扣除债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)后的金额确认，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额。

自2007年7月1日起，买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

卖出证券交易所交易的债券于交易日确认债券差价收入/(损失)。2007年7月1日之前，卖出银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认债券投资收益/(损失)；自2007年7月1日起，卖出银行间同业市场交易的债券于交易日确认债券投资收益/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

（3）权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。2007年7月1日之前，权证投资成本按交易日应支付的全部价款确认，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；自2007年7月1日起，权证投资成本按交易日权证的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。获赠权证(包括配股权证)在除权日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

2、贷款和应收款项

2007年7月1日之前，贷款和应收款项按实际支付或应收取的金额入账，并采用名义利率法确认相关的利息收入；自2007年7月1日起，贷款和应收款项以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法。

3、其他金融负债

2007年7月1日之前，其他金融负债按实际收取或应支付的金额入账，并采用名义利率法确认负债相关的利息支出，其中卖出回购金融资产款以协议融入资金额作为入账金额；自2007年7月1日起，其他金融负债以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额。

（六）收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益/(损失)于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益/(损失)于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，在债券实际持有期内逐日确认。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后确认利息收入。自2007年7月1日起，若票面利率与实际利率出现重大差异则按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

公允价值变动收益/(损失)于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认。

（七）费用的确认和计量。

本基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率逐日计提。如果由于卖出回购证券和现金分红以外原因造成基金持有现金比例超过基金资产净值的20%，超过部分不计提管理人报酬。

本基金的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。

2007年7月1日之前，卖出回购金融资产支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额在回购期内以直线法逐日确认；自2007年7月1日起，卖出回购金融资产支出按倒期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率逐日确认，直线法与实际利率确定的支出差异较小的可采用直线法。

（八）实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为1.00元。

（九）基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。基金当年收益弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配。基金收益分配采取现金方式，每年至少分配一次。年度收益分配比例不低于基金可分配收益的90%。基金可分配收益不包括基金经营活动产生的未实现收益。基金收益分配后，每基金份额净值不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

四、主要税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2007]84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（一）以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

（二）基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

（三）对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

（四）基金买卖股票于2007年5月30日前按照0.1%的税率缴纳股票交易印花税，自2007年5月30日起按0.3%的税率缴纳。

（五）基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

五、重大会计差错的内容和更正金额

本报告期内无重大会计差错的内容和更正金额

六、重大关联方关系及关联交易

（一）关联方关系发生变化的情况：本报告期内，本基金关联方增加新加坡星展资产管理有限公司。

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司（"长盛基金"）	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行	基金托管人、基金代销机构
国元证券	基金管理人的股东、基金代销机构
新加坡星展资产管理有限公司	基金管理人的股东(2007年4月19日之后)
安徽省创新投资有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团有限责任公司	基金管理人的股东
中信证券股份有限公司（"中信证券"）	基金发起人
长江证券股份有限公司（"长江证券"）	基金发起人
天津北方国际信托投资股份有限公司（"天北国投"）	基金发起人

根据长盛基金于2007年4月19日发布的公告，经公司股东会审议通过，并报经中国证监会证监基金字(2007)115号文批准，公司股东国元证券、安徽省创新投资有限公司、安徽省投资集团有限责任公司分别将其持有的长盛基金管理有限公司8%、13%、12%的股权转让给新加坡星展资产管理有限公司。

（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证券交易及交易佣金

单位：人民币元

	2007年1月1日至2007年10月24日（基金合同失效前日）止期间		2006年度	
	成交量	占全年成交量的比例	成交量	占全年成交量的比例
国元证券				
买卖股票	780,790,111.28	18.05%	329,008,790.98	22.29%
买卖债券	26,136,491.20	17.81%	20,620,500.00	58.05%
买卖权证	37,183,447.37	40.28%	816,437.43	56.11%
	佣金	占全年佣金总量的比例	佣金	占全年佣金总量的比例
国元证券	638,378.92	18.37%	269,685.00	22.73%

上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和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。

该类佣金协议的服务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）管理人报酬

支付基金管理人长盛基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

本基金在本会计期间需支付管理人报酬15,420,411.90元(2006年：11,274,889.87元)。

（2）托管费

支付托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为

日托管费＝前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

本基金在本会计期间需支付托管费2,570,068.70元(2006年：1,879,148.33元)。

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农业银行保管，按银行同业利率计息。基金托管人于2007年10月24日(基金合同失效前)保管的银行存款余额为141,776,436.85元(2006年12月31日：123,387,246.73元)。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为576,162.02元(2006年度：475,703.19元)。

4、与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金在本年度与基金托管人中国农业银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

单位：人民币元

	2007年1月1日至2007年10月24日（基金合同失效前）止期间	2006年度
卖出回购金融资产协议金额	0.00	40,000,000.00
卖出回购金融资产支出	0.00	17,358.90

5、关联方持有的基金份额

关联方名称	2007年10月24日（基金合同失效前日）			2006年12月31日		
	基金份额数（份）	净值（元）	占基金总份额的比例	基金份额数（份）	净值（元）	占基金总份额的比例
长盛基金	36,906,448.00	113,358,155.03	7.38%	31,906,448.00	66,942,918.55	6.38%
天北国托	500,000.00	1,535,750.00	0.10%	1,000,000.00	2,098,100.00	0.20%
国元证券	500,000.00	1,535,750.00	0.10%	500,000.00	1,049,050.00	0.20%
中信证券	500,000.00	1,535,750.00	0.10%	500,000.00	1,049,050.00	0.20%
长江证券	500,000.00	1,535,750.00	0.10%	500,000.00	1,049,050.00	0.20%

长盛基金在本会计期间运用固有资金10,922,402.05元经国元证券购入本基金5,000,000.00份基金份额（2006年：购入25,413,235.00份基金份额）。根据中国证监会证监基金字[2005]96号《关于基金管理公司运用固有资金进行基金投资有关事项的通知》的有关规定，基金管理人长盛基金运用固有资金投资本基金，其持有本基金份额的比例不得超过本基金总份额的10%，且持有的基金份额在基金合同终止前不得出售。

七、流通受限制不能自由转让的基金资产

（一）流通受限制不能自由转让的股票

基金可使用以基金名义开设的股票账户，比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股或增发新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

本基金截至2007年10月24日(基金合同失效前)止投资的流通受限制的股票情况如下：

单位：人民币元

股票代码	股票名称	成功申购日期	可流通日期	流通受限类型	申购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
002146	荣盛发展	07/07/26	07/11/08	新股网下申购	12.93	35.38	52,340	676,756.20	1,851,789.20
002152	广电运通	07/08/01	07/11/13	新股网下申购	16.88	89.90	28,275	477,282.00	2,541,922.50
002153	石基信息	07/08/01	07/11/13	新股网下申购	21.50	122.00	10,763	231,404.50	1,313,086.00
002167	东方锆业	07/09/05	07/12/13	新股网下申购	8.91	46.98	6,482	57,754.62	304,524.36
合 计								1,443,197.32	6,011,322.06

（二）截至2007年12月31日止，本基金持有深圳华侨城控股股份有限公司(以下简称"华侨城A")停市股票1,400,000股，按2007年10月16日收盘价每股58.03元计算，估值为81,242,000.00元。华侨城A因华侨城集团公司就通过华侨城A推进主营业务整合上市工作的有关问题与国务院国有资产监督管理委员会进行沟通，公司股票于2007年10月17日起连续停牌。华侨城A股票在该重大事项获原则性同意后于2007年11月7日复牌，复牌后首日上市开盘价为63.83元。

单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	年末估值单价	停牌原因	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
000069	华侨城A	07/10/16	58.03	公告重大事项	07/11/07	68.83	1,400,000	31,709,498.82	81,242,000.00

八、风险管理

（一）风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与金融工程部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金管理人建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与金融工程部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

（二）信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

（三）流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注七中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

（四）市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

1、市场价格风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%，投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的20%。于2007年10月24日(基金合同失效前)，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

	2007年10月24日(基金合同失效前日)		2006年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值的比例	公允价值	占基金资产净值的比例
交易性金融资产				
–股票投资	1,159,468,941.29	75.50%	783,498,666.94	74.69%
–债券投资	218,749,780.00	14.24%	215,260,683.58	20.52%
衍生金融资产				
–权证投资	13,158,000.00	0.86%	4,356,600.00	0.42%
	1,391,376,721.29	90.60%	1,003,115,950.52	95.63%

由于国债到期兑付原因，本基金持有的债券投资的公允价值占基金资产净值的比例由2007年10月23日的20.82%下降到2007年10月24日（基金合同失效前日）的14.24%。

本基金以上证综合指数为基础衡量市场价格风险。于2007年10月24日(基金合同失效前日)，若上证综合指数的公允价值上升5%且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将相应增加约4,320万元(2006年：2,728万元)；反之，若上证综合指数下降5%且其他市场变量保持不变，本基金资产净值则将相应下降约4,320万元(2006年：2,728万元)。

2、利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资等。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

2007年10月24日(基金合同失效前日)	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	141,776,436.85	0.00	0.00	0.00–	141,776,436.85
结算备付金	4,202,329.22	0.00	0.00	0.00	4,202,329.22
存出保证金	160,000.00	0.00	0.00	750,000.00	910,000.00
交易性金融资产	179,241,140.00	39,508,640.00	0.00	1,159,468,941.29	1,378,218,721.29
衍生金融资产	0.00	0.00	0.00	13,158,000.00	13,158,000.00
应收利息	0.00	0.00	0.00	3,551,255.76	3,551,255.76
其他资产	0.00	0.00	0.00	30,602.32	30,602.32
资产总计	325,379,906.07	39,508,640.00	0.00	1,176,958,799.37	1,541,847,345.44
负债					
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	1,538,915.52	1,538,915.52
应付托管费	0.00	0.00	0.00	256,485.93	256,485.93
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	3,536,397.63	3,536,397.63
应付税费	0.00	0.00	0.00	189,955.72	189,955.72
其他负债	0.00	0.00	0.00	560,385.84	560,385.84
负债总计	0.00	0.00	0.00	6,082,140.64	6,082,140.64
利率敏感度缺口	325,379,906.07	39,508,640.00	0.00	1,170,876,658.73	1,535,765,204.80

2006年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	123,387,246.73	0.00	0.00	0.00	123,387,246.73
结算备付金	5,187,685.66	0.00	0.00	0.00	5,187,685.66
存出保证金	160,000.00	0.00	0.00	750,000.00	910,000.00
交易性金融资产	189,323,303.58	25,937,380.00	0.00	783,498,666.94	998,759,350.52
衍生金融资产	0.00	0.00	0.00	4,356,600.00	4,356,600.00
应收利息	0.00	0.00	0.00	1,999,247.09	1,999,247.09
其他资产	0.00	0.00	0.00	30,000.00	30,000.00
资产总计	318,058,235.97	25,937,380.00	0.00	790,634,514.03	1,134,630,130.00
负债					
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	82,494,241.44	82,494,241.44
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	1,256,442.02	1,256,442.02
应付托管费	0.00	0.00	0.00	209,407.00	209,407.00
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	1,085,452.27	1,085,452.27
应付税费	0.00	0.00	0.00	189,955.72	189,955.72
其他负债	0.00	0.00	0.00	360,000.00	360,000.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	85,595,498.45	85,595,498.45
利率敏感度缺口	318,058,235.97	25,937,380.00	0.00	705,039,015.58	1,049,034,631.55

于2007年10月24日(基金合同失效前)，若市场利率下降25个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将相应增加约34万元(2006年：43万元)；反之，若市场利率上升25个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值则将相应下降约34万元(2006年：43万元)。

3、汇率风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大汇率风险。

九、首次执行企业会计准则

如附注一所述，本财务报表为本基金首份按照企业会计准则编制的财务报表。2006年度和2007年1月1日至2007年6月30日止期间的相关比较数字已按照《企业会计准则第38号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整，并已按照本财务报表的披露方式进行了重分类。

按原会计准则和制度列报的2006年1月1日、2006年12月31日和2007年6月30日的所有者权益，以及2006年度和2007年1月1日至2007年6月30日止期间的净损益调整为按企业会计准则列报的所有者权益及净损益的调节过程列示如下：

单位：人民币元

	2006年1月1日所有者权益	2006年度净损益/利润总额	2006年12月31日所有者权益
按原会计准则和制度列报的金额	565,871,618.98	304,563,939.30	1,049,034,631.55
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产(附注一)	0.00	201,599,073.27	0.00
按企业会计准则列报的金额	565,871,618.98	506,163,012.57	1,049,034,631.55

单位：人民币元

	2007年1月1日所有者权益	2007年1月1日至2007年6月30日止期间净损益/利润总额	2007年6月30日所有者权益
按原会计准则和制度列报的金额	1,049,034,631.55	435,622,567.52	1,369,874,832.13
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产(附注一)	0.00	170,217,633.06	0.00
按企业会计准则列报的金额	1,049,034,631.55	605,840,200.58	1,369,874,832.13

根据上述追溯调整，按原会计准则和制度直接记入所有者权益下"未实现利得/(损失)"科目的投资估值增值/(减值)净变动现按企业会计准则在利润表中的"公允价值变动收益/(损失)"科目中核算。于会计期末，按原会计准则和制度列示于所有者权益下"未实现利得/(损失)"科目中的全部余额，现按企业会计准则包含于"未分配利润/(累计亏损)"科目中。

第八章　长盛同德基金投资组合报告

（报告期间为2007年10月25日至2007年12月31日）

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	10,395,549,192.54	77.03%
债券市值	95,136,687.60	0.71%
权证市值	11,129,401.02	0.08%
银行存款和结算备付金	2,925,611,623.53	21.68%
资产支持证券	0.00	0.00%
其他资产	68,009,470.55	0.50%
资产合计	13,495,436,375.24	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	827,355.90	0.01%
B 采掘业	1,426,134,259.99	10.77%
C 制造业	3,720,325,833.56	28.11%
C0 食品、饮料	203,437,893.26	1.54%
C1 纺织、服装、皮毛	47,538,605.72	0.36%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	32,670,000.00	0.25%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	856,702,810.79	6.47%
C5 电子	108,525,321.32	0.82%
C6 金属、非金属	445,781,128.50	3.37%
C7 机械、设备、仪表	1,554,833,747.30	11.74%
C8 医药、生物制品	470,836,326.67	3.56%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	797,169,394.44	6.02%
E 建筑业	60,713,920.12	0.46%
F 交通运输、仓储业	944,227,998.24	7.13%
G 信息技术业	774,682,258.22	5.85%
H 批发和零售贸易	378,402,334.80	2.86%
I 金融、保险业	1,621,088,379.54	12.24%
J 房地产业	423,868,546.42	3.20%
K 社会服务业	189,488,175.81	1.43%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	58,620,735.50	0.44%
合计	10,395,549,192.54	78.52%

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	600028	中国石化	22,314,637	522,831,944.91	3.95%
2	600050	中国联通	36,056,519	435,562,749.52	3.29%
3	600900	长江电力	20,898,539	407,312,525.11	3.08%
4	601398	工商银行	49,565,444	402,967,059.72	3.04%
5	002092	中泰化学	10,497,051	399,937,643.10	3.02%
6	600036	招商银行	8,055,648	319,245,330.24	2.41%
7	601601	中国太保	6,306,184	311,840,798.80	2.36%
8	600875	东方电气	3,037,079	270,300,031.00	2.04%
9	000983	西山煤电	4,106,436	260,635,492.92	1.97%
10	000651	格力电器	5,232,440	258,220,914.00	1.95%

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	600028	中国石化	488,298,435.93	31.80%
2	601398	工商银行	394,772,720.56	25.71%
3	600900	长江电力	359,708,327.09	23.42%
4	002092	中泰化学	324,358,875.90	21.12%
5	600050	中国联通	322,520,217.23	21.00%
6	601601	中国太保	279,698,488.28	18.21%
7	000002	万 科 A	255,375,541.14	16.63%
8	000651	格力电器	221,966,682.28	14.45%
9	601857	中国石油	221,766,646.89	14.44%
10	600875	东方电气	220,583,194.67	14.36%
11	600036	招商银行	217,062,542.82	14.13%
12	000983	西山煤电	201,899,116.08	13.15%
13	601318	中国平安	201,826,629.65	13.14%
14	600015	华夏银行	201,149,321.20	13.10%
15	600030	中信证券	177,033,926.79	11.53%
16	000063	中兴通讯	170,519,463.47	11.10%
17	601939	建设银行	163,144,779.24	10.62%
18	600104	上海汽车	152,560,885.68	9.93%
19	600087	南京水运	141,283,003.68	9.20%
20	601088	中国神华	135,224,929.21	8.81%
21	600005	武钢股份	129,422,134.88	8.43%
22	601006	大秦铁路	121,433,910.85	7.91%
23	000933	神火股份	118,029,464.31	7.69%
24	000768	西飞国际	116,915,884.11	7.61%
25	000960	锡业股份	116,186,892.16	7.57%
26	002187	广百股份	116,114,746.06	7.56%
27	600309	烟台万华	113,842,424.91	7.41%
28	000539	粤电力 A	107,803,364.46	7.02%
29	600717	天津港	106,881,870.64	6.96%
30	601919	中国远洋	102,081,306.36	6.65%
31	002122	天马股份	101,766,600.80	6.63%
32	600048	保利地产	95,126,538.70	6.19%
33	600795	国电电力	90,138,211.79	5.87%
34	000410	沈阳机床	87,846,657.12	5.72%
35	600062	双鹤药业	82,618,251.14	5.38%
36	600009	上海机场	81,092,260.35	5.28%
37	600029	南方航空	75,317,401.09	4.90%
38	000402	金 融 街	75,159,076.38	4.89%
39	002153	石基信息	73,164,235.86	4.76%
40	600350	山东高速	70,716,839.74	4.60%
41	600886	国投电力	68,631,207.24	4.47%
42	000028	一致药业	68,316,405.30	4.45%
43	002106	莱宝高科	67,800,612.36	4.41%
44	000061	农 产 品	66,999,986.53	4.36%
45	600011	华能国际	65,272,950.17	4.25%
46	600426	华鲁恒升	61,352,442.55	3.99%
47	600806	昆明机床	61,082,380.89	3.98%
48	002152	广电运通	59,880,639.55	3.90%
49	002177	御银股份	58,039,438.36	3.78%
50	600820	隧道股份	54,386,672.06	3.54%
51	000522	白云山 A	53,826,372.96	3.50%
52	600591	上海航空	53,372,443.69	3.48%
53	600423	柳化股份	53,044,328.20	3.45%
54	002146	荣盛发展	51,996,099.65	3.39%
55	000759	武汉中百	51,988,145.97	3.39%
56	600801	华新水泥	51,246,006.62	3.34%
57	000422	湖北宜化	50,429,131.40	3.28%
58	601111	中国国航	48,820,350.45	3.18%
59	600058	五矿发展	48,595,308.95	3.16%
60	000655	金岭矿业	47,412,485.44	3.09%
61	600486	扬农化工	46,135,438.02	3.00%
62	600348	国阳新能	45,254,504.16	2.95%
63	601628	中国人寿	44,812,660.94	2.92%
64	600511	国药股份	44,577,093.98	2.90%
65	000022	深赤湾 A	44,521,176.99	2.90%
66	600019	宝钢股份	43,350,162.30	2.82%
67	600312	平高电气	42,740,750.57	2.78%
68	600557	康缘药业	42,504,270.21	2.77%
69	000537	广宇发展	40,106,267.59	2.61%
70	600479	千金药业	39,425,337.80	2.57%
71	600276	恒瑞医药	37,396,595.39	2.44%
72	601390	中国中铁	37,332,078.00	2.43%
73	600439	瑞贝卡	36,841,506.90	2.40%
74	000895	双汇发展	36,645,915.04	2.39%
75	002183	怡 亚 通	36,548,697.99	2.38%
76	600879	火箭股份	36,418,670.57	2.37%
77	000727	华东科技	36,369,903.34	2.37%
78	600600	青岛啤酒	34,875,006.91	2.27%
79	600195	中牧股份	34,247,866.98	2.23%
80	601001	大同煤业	33,461,089.90	2.18%
81	000878	云南铜业	32,809,936.81	2.14%
82	002073	青岛软控	31,545,556.35	2.05%

（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	600015	华夏银行	234,524,567.88	15.27%
2	601939	建设银行	72,703,340.45	4.73%
3	601628	中国人寿	71,272,462.41	4.64%
4	002024	苏宁电器	69,448,738.82	4.52%
5	600019	宝钢股份	59,587,039.02	3.88%
6	601390	中国中铁	43,204,305.15	2.81%
7	000960	锡业股份	42,027,915.18	2.74%
8	000423	东阿阿胶	40,697,515.08	2.65%
9	000002	万 科 A	32,338,707.08	2.11%
10	000031	中粮地产	30,356,291.95	1.98%
11	600519	贵州茅台	27,698,529.71	1.80%
12	000858	五 粮 液	21,438,267.34	1.40%
13	000761	本钢板材	20,042,994.12	1.31%
14	601866	中海集运	17,474,707.72	1.14%
15	600971	恒源煤电	16,721,244.79	1.09%
16	000898	鞍钢股份	16,482,214.67	1.07%
17	600266	北京城建	16,208,204.44	1.06%
18	600000	浦发银行	16,193,241.33	1.05%
19	000800	一汽轿车	14,612,670.38	0.95%
20	600835	上海机电	13,624,500.82	0.89%

(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	9,265,176,180.19
卖出股票收入总额	1,043,994,606.59

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	70,706,019.60	0.53%
金 融 债	0.00	0.00%
央行票据	0.00	0.00%
企 业 债	24,430,668.00	0.19%
可 转 债	0.00	0.00%
合　计	95,136,687.60	0.72%

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04	38,466,819.60	0.29%
2	08上汽债	24,430,668.00	0.19%
3	99国债08	20,172,000.00	0.15%
4	21国债15	12,067,200.00	0.09%

七、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。

八、报告期末投资权证明细

（一）报告期末持有权证明细

获得方式	权证名称	权证代码	数量（份）	市值（人民币元）	市值占基金净资产比例
被动持有	上汽CWB1	580016	1,224,936	11,129,401.02	0.08%
合计				11,129,401.02	0.08%

（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）
被动持有	580016	上汽CWB1	1,224,936	10,474,959.67
主动持有	030002	五粮YGC1	50,000	2,059,487.00

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）报告期末基金的其他资产构成

其他资产项目	金额（人民币元）
存出保证金	1,160,000.00
应收利息	2,053,788.66
其他应收款	30,000.00
应收资产	64,765,681.89
合　计	68,009,470.55

（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）本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项　目	持有长盛同德基金份额（份）	占基金总份额的比例
截止2007年10月24日持有份额	36,906,448	0.03%
本报告期增持份额	73,849,343	0.61%
截止2007年12月31日持有份额	105,755,791	0.87%

第九章　基金同德投资组合报告

（报告期为2007年1月1日至2007年10月24日）

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	1,159,468,941.29	75.20%
债券市值	218,749,780.00	14.19%
权证市值	13,158,000.00	0.85%
银行存款和结算备付金	145,978,766.07	9.47%
资产支持证券	0.00	0.00%
其他资产	4,491,858.08	0.29%
资产合计	1,541,847,345.44	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	109,290,922.07	7.12%
C 制造业	414,626,813.34	27.00%
C0 食品、饮料	108,315,000.00	7.05%
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	23,764,024.36	1.55%
C5 电子	0.00	0.00%
C6 金属、非金属	54,507,254.00	3.55%
C7 机械、设备、仪表	149,898,562.90	9.76%
C8 医药、生物制品	78,141,972.08	5.09%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	34,758,000.00	2.26%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	58,782,993.60	3.83%
G 信息技术业	20,159,086.00	1.31%
H 批发和零售贸易	92,518,000.00	6.03%
I 金融、保险业	300,101,338.10	19.54%
J 房地产业	47,989,788.18	3.12%
K 社会服务业	81,242,000.00	5.29%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	0.00	0.00%
合计	1,159,468,941.29	75.50%

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	600765	力源液压	3,030,010	133,441,640.40	8.69%
2	600036	招商银行	2,450,000	105,252,000.00	6.85%
3	000069	华侨城 A	1,400,000	81,242,000.00	5.29%
4	002024	苏宁电器	1,060,000	73,034,000.00	4.76%
5	601318	中国平安	500,000	72,495,000.00	4.72%
6	600519	贵州茅台	250,000	47,997,500.00	3.13%
7	000983	西山煤电	700,000	42,000,000.00	2.73%
8	601006	大秦铁路	1,700,000	39,236,000.00	2.55%
9	000895	双汇发展	750,000	38,317,500.00	2.50%
10	600479	千金药业	1,106,454	38,194,792.08	2.49%

（下转D57版）