

同盛证券投资基金

2005 年半年度报告

重要提示及目录

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”）2005 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 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

基金半年度报告中的财务会计报告无须审计，因此本报告期的财务会计报告未经审计。

本报告会计期间：2005 年 1 月 1 日至 2005 年 6 月 30 日。

目 录

第一章 基金简介	1
第二章 主要财务指标和基金净值表现	4
第三章 管理人报告	5
第四章 托管人报告	7
第五章 财务会计报告	9
第六章 投资组合报告.....	22
第七章 基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	28
第八章 重大事件揭示.....	29
第九章 备查文件目录.....	30

第一章 基金简介

一、基金产品概况

基金名称：同盛证券投资基金

基金简称：基金同盛

交易代码：184699

基金运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：1999年11月5日

2005年6月30日基金份额总额：30亿份

基金合同存续期：1999年11月5日至2014年11月4日，共15年

基金份额上市的证券交易所：深圳证券交易所

基金上市日期：1999年11月26日

二、投资策略

（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）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%。

（三）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。

(四) 业绩比较基准：无

(五) 风险收益特征：无

三、基金管理人

法定名称：长盛基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区华富路航都大厦 13 C

办公地址：北京市朝阳区北三环东路 8 号静安中心 22 层

邮政编码：100028

法定代表人：凤良志

信息披露负责人：叶金松

联系电话：010-64689198

传真：010-64689471

电子邮箱：yejs@csfunds.com.cn

四、基金托管人

法定名称：中国银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号中国银行总行办公大楼

邮政编码：100818

法定代表人：肖钢

信息披露负责人：忻如国

电话：010-66594856

传真：010-66594853

电子邮箱：tgxxpl@bank-of-china.com

五、信息披露

（一）本基金半年度报告选定的信息披露报纸名称：《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

（二）本基金半年度报告正文登载于本公司互联网网址：
<http://www.csfunds.com.cn>

（三）置备地点：本半年度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。

六、注册登记机构

注册登记机构名称：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

办公地址：中国深圳深南中路1093号中信大厦21层

第二章 主要财务指标和基金净值表现

一、主要财务指标

2005 年半年度主要财务指标

主要财务指标	2005 年上半年度
基金本期净收益(元)	-86,751,857.15
基金份额本期净收益(元/份)	-0.0289
期末可供分配基金收益(元)	-376,311,439.95
期末可供分配基金份额收益(元/份)	-0.1254
期末基金资产净值(元)	2,623,688,560.05
期末基金份额净值(元/份)	0.8746
基金加权平均净值收益率	-3.20%
本期基金份额净值增长率	-3.44%
基金份额累计净值增长率	9.86%

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

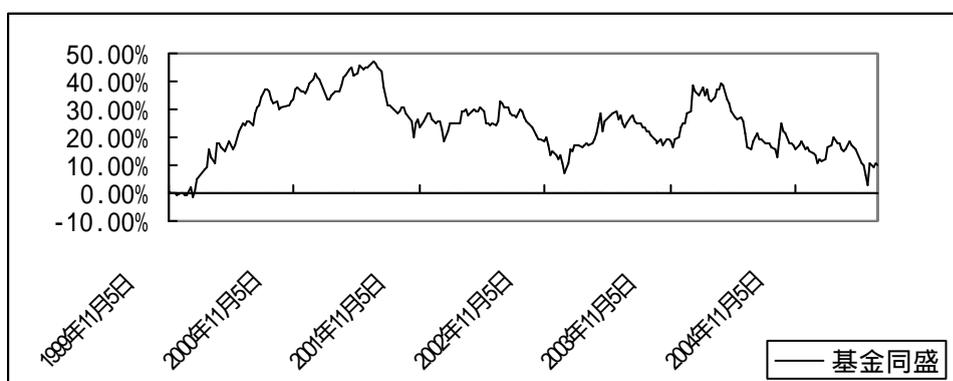
二、基金净值表现

(一) 基金同盛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	2.62%	0.0434
过去三个月	-2.77%	0.0310
过去六个月	-3.44%	0.0257
过去一年	-5.33%	0.0227
过去三年	-17.47%	0.0204
自基金成立起至今	9.86%	0.0199

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



注：本基金无同期业绩比较基准

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%。截至2005年6月30日，基金管理人共管理四支封闭式基金、三支开放式基金和社保基金委托资产，管理资产规模约130亿元。

(二) 基金经理介绍

林继东，男，1966年出生，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、合规情况说明

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、上半年股市运行特点

上半年，市场在宏观经济调整、产业调整及公司估值压力等多重因素的作用下不断振荡下行，尽管管理层也不断地出台市场各类支持政策(包括推出了股权分置改革试点)，但证券市场仍然未能扭转多年来形成的颓势，屡创新低。绝大部分公司股价都不断破位下行，上证指数跌破1000点关口，创出了8年来的新低，市场出现了资金和信心都严重不足，要依靠外力才能企稳的情况。

四、上半年本基金操作回顾

上半年，本基金继续进行持仓结构调整。基金在逢高卖出了部分涨幅过大的周期性公司股票的同时，买入了部分非周期类特别是港口运输类和大盘蓝筹股票。

基金上半年的操作策略是比较成功的。在仓位控制上始终坚持较低的股票类持仓，坚持逢低买入在股价结构二元化调整过程中被压制的大盘蓝筹股票，为下阶段的行情作好了准备。

截止到2005年6月30日，本基金份额净值为0.8746元，上半年净值增长率为-3.44%，强于上证指数表现，本基金在同类型封闭式基金排名中位于中上位置。

五、下阶段本基金投资思路

展望未来，我们认为市场的机会已经显著大于风险。股权分置改革已经大幅降低 A 股市场的估值泡沫，长期困扰 A 股市场的制度性缺陷有望得到明显改善，国家对证券市场的政策扶持将支持着市场走出熊市困境。

总体上我们判断，A 股市场的投资机会将主要体现在两方面：第一是能够保持持续增长的非周期性优秀上市公司；第二是由于前期市场急剧下跌股价反应过度的蓝筹公司和行业周期在不久将来将出现向上拐点而公司股价已经严重超跌的公司和成长类企业。

所以，我们下阶段投资的总体思路是在稳守的基础上进攻。第一：继续投资于仍然能保持增长能力的非周期性公司，如机场、港口、运输、银行类的优势企业。第二：继续投资于优质的资源类企业特别是我国工业发展的瓶颈类资源企业。第三：在深入研究的基础上，积极介入商业零售、电力等与汇率调整无负相关关系的行业企业。我们将重点关注能够持续增长并能充分分享中国经济发展的优秀公司，争取为基金份额持有人获取更好的回报。

第四章 托管人报告

本托管人依据《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。

1、本托管人在托管基金同盛期间，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》和其他有关法规、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，不存在损害基金同盛持有人利益的行为。

（1）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。严格复核从基金资产中列支的各项费用和基金的应得利益，确保基金资产的完整。

（2）本基金的投资运作包括本基金在股票一级市场、股票二级市场、证券交易所债券市场以及银行间国债市场的交易等，本托管人严格根据相关法律法规、基金合同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。

（3）本托管人对与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。

2、本托管人在 2005 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》和其他有关法规、《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——基金同盛管理人的基金运作进行了必要的监督。

（1）其在基金资产净值的计算、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》和其他有关法规、基金合同以及托管协议的规定；未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

(2) 本托管人如实、及时、独立地向中国证监会提交了关于基金同盛投资运作方面的报告。

3、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

2005年8月23日

第五章 财务会计报告

一、会计报表（未经审计）

同盛证券投资基金资产负债表

（单位：人民币元）

项 目	附注	2005 年 6 月 30 日	2004 年 12 月 31 日
资产			
银行存款		92,514,222.66	243,115,472.16
清算备付金		1,126,250.94	0.00
交易保证金		751,825.49	715,802.11
应收证券清算款	4	343,966.72	74,555,650.56
应收股利		1,427,991.53	0.00
应收利息	5	7,945,989.26	9,525,178.95
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值		1,852,610,465.13	1,696,938,895.58
其中：股票投资成本		2,044,262,112.90	1,849,758,949.24
债券投资市值		683,814,506.09	700,583,321.22
其中：债券投资成本		684,505,881.46	733,189,906.64
配股权证		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		2,640,535,217.82	2,725,434,320.58
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款	4	8,614,100.35	0.00
应付管理人报酬		3,203,357.77	3,495,825.47
应付托管费		533,892.87	582,637.59
应付佣金	6	2,235,799.15	1,973,681.00
应付利息		0.00	0.00
应付收益		0.00	0.00
未交税金		0.00	0.00
其他应付款	7	1,923,919.06	1,920,375.26
卖出回购证券款		0.00	0.00
短期借款		0.00	0.00
预提费用	8	335,588.57	105,000.00
其他负债		0.00	0.00
负债合计		16,846,657.77	8,077,519.32
持有人权益			
实收基金	9	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未实现利得	10	-192,343,023.14	-185,426,639.08
未分配收益		-183,968,416.81	-97,216,559.66
持有人权益合计		2,623,688,560.05	2,717,356,801.26

负债及持有人权益总计		2,640,535,217.82	2,725,434,320.58
基金份额净值(元/份)		0.8746	0.9058

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

同盛证券投资基金经营业绩表

(单位：人民币元)

项 目	附注	2005 年上半年度	2004 年上半年度
收 入		-62,756,053.53	211,423,989.56
股票差价收入	11	-104,855,298.79	178,559,293.62
债券差价收入	12	-3,158,247.09	1,475,773.53
债券利息收入		9,191,550.10	9,147,409.76
存款利息收入		1,964,961.37	414,718.17
股利收入		34,073,794.70	21,656,886.78
买入返售证券收入		14,000.00	0.00
其他收入	13	13,186.18	169,907.70
费 用		23,995,803.62	29,673,024.24
基金管理人报酬		20,201,084.36	23,484,173.43
基金托管费		3,366,847.45	3,914,028.84
卖出回购证券支出		181,700.38	2,024,296.96
利息支出		0.00	0.00
其他费用	14	246,171.43	250,525.01
其中：上市年费		29,752.78	29,835.26
信息披露费		148,767.52	129,179.94
审计费用		52,068.27	52,213.98
基金净收益		-86,751,857.15	181,750,965.32
加：本期末实现利得		-6,916,384.06	-470,121,722.49
基金经营业绩		-93,668,241.21	-288,370,757.17

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认购或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。

同盛证券投资基金基金收益分配表

(单位：人民币元)

项 目	附注	2005 年上半年度	2004 年上半年度
本期基金净收益		-86,751,857.15	181,750,965.32
加：期初基金净收益		-97,216,559.66	-108,767,904.18
可供分配基金净收益		-183,968,416.81	72,983,061.14
减：本期已分配基金净收益	15	0.00	0.00
期末基金净收益		-183,968,416.81	72,983,061.14

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

同盛证券投资基金基金净值变动表

(单位：人民币元)

项 目	2005 年上半年度	2004 年上半年度
期初基金净值	2,717,356,801.26	3,059,854,013.05
本期经营活动		
基金净收益	-86,751,857.15	181,750,965.32
未实现利得	-6,916,384.06	-470,121,722.49
经营活动产生的基金净值变动数	-93,668,241.21	-288,370,757.17
本期向持有人分配收益	0.00	0.00
期末基金净值	2,623,688,560.05	2,771,483,255.88

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

二、会计报表附注（未经审计）

附注1、基金设立说明

同盛证券投资基金（简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监基金字[1999]30号文《关于同意同盛证券投资基金设立的批复》批准，由中信证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、天津北方国际信托投资股份有限公司、国元证券有限责任公司和长盛基金管理有限公司五家发起人共同发起并向社会募集设立。本基金规模为30亿份基金份额，其中发起人认购3,000万基金份额，向商业保险公司配售9亿基金份额，向社会募集20.7亿基金份额。本基金于1999年11月5日设立，并于1999年11月26日在深圳证券交易所挂牌交易。基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司，简称“中国银行”。

附注2、会计报表编制基础

本基金的会计报表乃按照《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3号《半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《会计报表附注的编制及披露》及基金合同的规定而编制。

附注3、主要会计政策

1、会计年度

本基金会计年度自公历1月1日至12月31日止。

2、记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。记账单位为元。

3、记账原则和计价基础

本基金以权责发生制为记账基础，除上市股票和债券按市值计价外，其余均以历史成本为计价原则。

4、基金资产的估值方法

(1) 估值对象为基金所拥有的银行存款、股票和债券等；

(2) 银行存款按本金估值，并按本金与所适用的利率逐日计提利息计入“应收利息”科目；

(3) 上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌交易的市场平均价估值，该估值日无交易的，以最近一个交易日的市场平均价计算；实际成本与估值之间的差异计入“未实现利得”科目；

(4) 未上市的股票的估值

A、送股、转增股、配股或增发的新股，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；

B、首次公开发行的股票，以其成本价计算。

(5) 配股权证，从配股除权日到配股确认日止，按市场平均价高于配股价的差额估值；差异计入“配股权证”及“未实现利得”科目，如果市场平均价等于或低于配股价，则估值额为零；

(6) 上市债券以不含息价格计价，按估值日证券交易所挂牌的市场平均价计算后的净价估值，该日无交易的，以最近交易日净价估值，并按债券面值与

票面利率扣除应由债券发行单位代扣代缴的个人所得税后在债券持有期间内逐日计提利息；

(7) 未上市债券以不含息价格计价，按成本估值，并按债券面值与票面利率扣除应由债券发行单位代扣代缴的个人所得税后在债券持有期间内计提利息；

(8) 银行间同业市场交易债券以不含息成本价估值；

(9) 如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况，在与基金托管人商议后，按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

(10) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

5、证券投资的成本计价方法

按移动加权平均法计算库存证券的成本。当日有买入和卖出时，先计算成本后计算买卖证券价差。

(1) 股票

A、买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账；

a. 上交所买入股票成本：由买入金额、买入印花税、买入过户费、买入经手费、买入证管费和买入佣金组成；

b. 深交所买入股票成本：由买入金额、买入印花税、买入经手费和买入佣金组成；

B、上海股票的佣金是按买卖股票成交金额的1‰减去经手费和证管费计算。深圳股票的佣金是按买卖股票成交金额的1‰减经手费计算。

(2) 债券

A、a. 买入上市债券于成交日确认为债券投资，按应支付的全部价款入账，如果应支付的价款中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，不构成债券投资成本。

b. 买入非上市债券于实际支付价款时确认为债券投资，按实际支付的全部价款入账，如果实际支付的价款中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，不构成债券投资成本。

B、债券买卖不计佣金。

(3) 买入返售证券

买入返售证券成本：通过证券交易所进行融券业务，按成交日扣除手续费后的应付金额确认买入返售证券投资；通过银行间市场进行融券业务，按实际支付的价款确认买入返售证券投资。

6、待摊费用的摊销方法和摊销期限

待摊费用根据权责发生制按直线法在与其相关的期限内进行摊销。

7、收入的确认和计量

(1) 股票差价收入于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账；

(2) 债券差价收入：

卖出交易所上市债券--于成交日确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额入账；

卖出银行间市场交易债券--于实际收到价款时确认债券差价收入，并按实际收到的全部价款与其成本、应收利息的差额入账；

(3) 债券利息收入按实际持有期内逐日计提，并按债券票面价值与票面利率计提的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(4) 存款利息收入按本金与适用的利率逐日计提的金额入账；

(5) 股利收入于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认；

(6) 买入返售证券收入按证券持有期内采用直线法逐日计提的金额入账；

(7) 其他收入于实际收到时确认收入。

8、费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率逐日计提，基金成立三个月后，由于卖出回购证券及现金分红以外的原因造成基金持有现金的比例超过资产净值的20%，超过部分不计提基金管理费；

(2) 基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

9、实收基金

每份基金份额面值为人民币1.00元。实收基金为对外发行的基金份额总额。

10、税项

(1) 印花税

自2005年1月24日起，基金管理人运用基金买卖股票按照1‰的税率征收印花税。（2005年1月1日 - 23日基金管理人运用基金买卖股票按照2‰的税率征收印花税。）

(2) 营业税、企业所得税、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项规定如下：

A、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。

B、基金买卖股票、债券的差价收入，自2004年1月1日起继续免征营业税(2003年：在年底前暂免征收营业税)。

C、基金买卖股票、债券的差价收入，自2004年1月1日起继续免征企业所得税(2003年：在年底前暂免征收企业所得税)。

D、对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额。

按照财税[2005]107号文规定，符合规定的上市公司，已按股息红利全额计算扣缴个人所得税的，可按财税[2005]102号文规定的减税政策将多扣缴的税款退还个人投资者；税款已缴入国库的，由财税部门按规定程序办理退税，并由扣缴义务人退还个人投资者。（此前：对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入，由上市公司和发行债券的企业在向基金派发股息、红利、利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。）

11、基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配采用现金方式；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

- (3) 基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；
- (4) 如果基金投资当期出现亏损，则不进行收益分配；
- (5) 基金收益分配比例不低于基金净收益的90%；
- (6) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次；年度分配在基金会计年度结束后4个月内完成。
- (7) 法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

附注4、 应收证券清算款/应付证券清算款

单位：人民币元

项 目	2005年6月30日
应收证券清算款	
中国证券登记结算有限责任公司上海分公司	0.00
中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	343,966.72
合计	343,966.72
应付证券清算款	
中国证券登记结算有限责任公司上海分公司	8,614,100.35
中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	0.00
合计	8,614,100.35

附注5、 应收利息

单位：人民币元

项 目	2005年6月30日
应收银行存款利息	36,004.41
应收清算备付金利息	278.82
应收债券利息	7,909,706.03
合计	7,945,989.26

附注6、 应付佣金

单位：人民币元

公司名称	2005年6月30日
中信证券股份有限公司	222,904.23
渤海证券有限责任公司	487,156.95
国元证券有限责任公司	144,468.08
南方证券股份有限公司	171,630.57
申银万国证券股份有限公司	25,265.75
招商证券股份有限公司	69,172.30
国泰君安证券股份有限公司	94,070.76
泰阳证券有限责任公司	286,160.53

天同证券有限责任公司	81,187.54
兴安证券有限责任公司	37,496.61
海通证券股份有限公司	222,644.66
恒泰证券有限责任公司	393,641.17
合计	2,235,799.15

附注7、其他应付款

单位：人民币元

项 目	2005年6月30日
沪深交易所未代扣代缴个人所得税暂挂	1,673,919.06
应付券商席位保证金	250,000.00
合计	1,923,919.06

附注8、预提费用

单位：人民币元

项 目	2005年6月30日
审计费用	157,068.27
信息披露费	148,767.52
上市年费	29,752.78
合计	335,588.57

附注9、实收基金

单位：人民币元

项 目	2005年6月30日		
	基金份额 (份)	出资比例	实收基金(元)
发起人持有(每份基金份额面值人民币1元)			
中信证券股份有限公司	5,049,800	0.17%	5,049,800.00
长江证券有限责任公司	3,000,000	0.10%	3,000,000.00
天津北方国际信托投资股份有限公司	3,000,000	0.10%	3,000,000.00
国元证券有限责任公司	3,000,000	0.10%	3,000,000.00
长盛基金管理有限公司	6,000,000	0.20%	6,000,000.00
小计	20,049,800	0.67%	20,049,800.00
其他持有人持有(每份基金份额面值人民币1元)	2,979,950,200	99.33%	2,979,950,200.00
合计	3,000,000,000	100.00%	3,000,000,000.00

附注10、未实现利得

单位：人民币元

项 目	2005年上半年度
期初数	-185,426,639.08
投资估值增值	-6,916,384.06
其中：股票估值增值	-38,831,594.11

债券估值增值	31,915,210.05
期末数	-192,343,023.14

附注11、 股票差价收入

单位：人民币元

项 目	2005年上半年度
卖出股票成交总额	1,013,633,389.70
减：卖出股票成本总额	1,117,637,275.09
交易佣金总额	851,413.40
股票差价收入	-104,855,298.79

附注12、 债券差价收入

单位：人民币元

项 目	2005年上半年度
卖出债券成交总额	193,147,964.85
减：卖出债券成本总额	193,104,094.18
应收利息总额	3,202,117.76
债券差价收入	-3,158,247.09

附注13、 其他收入

单位：人民币元

项 目	2005年上半年度
新股手续费返还	12,660.18
其他	526.00
合计	13,186.18

附注14、 其他费用

单位：人民币元

项 目	2005年上半年度
信息披露费	148,767.52
上市年费	29,752.78
审计费用	52,068.27
债券托管账户维护费	9,150.00
回购交易费用	2,750.55
汇款手续费	3,682.31
合计	246,171.43

附注15、 本期已分配基金净收益

本基金于2005年上半年度未进行收益分配。

附注16、 关联方关系及其交易

1、 关联方关系

企业名称	与本基金的关系
中信证券股份有限公司	发起人、 管理人原股东

长江证券有限责任公司	发起人、管理人原股东
天津北方国际信托投资股份有限公司	发起人、管理人原股东
国元证券有限责任公司	发起人、管理人股东
安徽省创新投资有限公司	管理人股东
安徽省投资集团有限责任公司	管理人股东
长盛基金管理有限公司	发起人、管理人
中国银行股份有限公司	托管人

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、通过关联方的席位进行的交易

单位：人民币元

关联方名称	2005年上半年度		2004年上半年度	
	股票买卖成交量	占交易量比例	股票买卖成交量	占交易量比例
长江证券有限责任公司	0.00	0.00%	356,377,080.33	9.18%
中信证券股份有限公司	203,769,198.53	8.99%	680,468,097.06	17.53%
国元证券有限责任公司	671,497,687.61	29.62%	410,350,809.46	10.57%
合计	875,266,886.14	38.61%	1,447,195,986.85	37.28%

单位：人民币元

关联方名称	2005年上半年度		2004年上半年度	
	债券买卖成交量	占交易量比例	债券买卖成交量	占交易量比例
长江证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中信证券股份有限公司	0.00	0.00%	11,039,278.40	26.59%
国元证券有限责任公司	35,812,884.89	16.45%	0.00	0.00%
合计	35,812,884.89	16.45%	11,039,278.40	26.59%

单位：人民币元

关联方名称	2005年上半年度		2004年上半年度	
	证券回购交易量	占交易量比例	证券回购交易量	占交易量比例
长江证券有限责任公司	0.00	0.00%	70,000,000.00	2.04%
中信证券股份有限公司	0.00	0.00%	752,700,000.00	21.97%
国元证券有限责任公司	200,000,000.00	33.33%	200,000,000.00	5.84%
合计	200,000,000.00	33.33%	1,022,700,000.00	29.85%

单位：人民币元

关联方名称	2005年上半年度		2004年上半年度	
	支付的佣金	占佣金比例	支付的佣金	占佣金比例
长江证券有限责任公司	0.00	0.00%	291,528.83	9.33%
中信证券股份有限公司	159,451.01	8.75%	550,228.66	17.62%
国元证券有限责任公司	539,085.43	29.57%	326,922.19	10.47%
合计	698,536.44	38.32%	1,168,679.68	37.42%

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。

该类佣金协议的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。

3、基金管理人及托管人报酬

(1) 基金管理人报酬

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：

$$H=E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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；并于次月前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2005年上半年度应支付基金管理费共计人民币20,201,084.36元（2004年上半年度应支付23,484,173.43元），其中已支付基金管理人管理费人民币16,997,726.59元，尚余人民币3,203,357.77元未支付。

(2) 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：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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；于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取；

C、本基金2005年上半年度应支付基金托管费共计人民币3,366,847.45元（2004年上半年度应支付3,914,028.84元），其中已支付基金托管人托管费人民币2,832,954.58元，尚余人民币533,892.87元未支付。

4、与关联方银行间同业市场的债券交易

单位：人民币元

中国银行股份有限公司	2005 年上半年度	2004 年上半年度
卖出回购证券	0.00	0.00
本期交易量	0.00	60,000,000.00
期末余额	0.00	0.00
本期支出	0.00	28,010.96
债券买卖交易	0.00	0.00
本期购入交易量	0.00	0.00
本期卖出交易量	0.00	0.00

附注17、报告期末流通受限制不能自由转让的基金资产

基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，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。

截至2005年6月30日止，本基金流通受限制的股票明细如下：

股票名称	股票数量 (股)	股票成本 (人民币元)	股票市值 (人民币元)	购入日期	可流通日期
中材国际	65,618	494,103.54	1,050,544.18	2005-03-25	2005-07-12
登海种业	29,165	487,055.50	646,879.70	2005-04-01	2005-07-20
兔宝宝	60,775	302,659.50	421,170.75	2005-04-15	2005-08-10
广州国光	63,467	685,443.60	738,121.21	2005-04-27	2005-08-23
轴研科技	31,879	203,706.81	384,141.95	2005-04-30	2005-08-26
宝钢股份	1,749,380	8,956,825.60	8,764,393.80	2005-04-26	2005-07-11
合计	2,000,284	11,129,794.55	12,005,251.59		

上述股票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。

附注18、期后事项

本基金并无重要期后事项。

附注19、其他重要事项

无需要说明的其他重要事项。

附注20、比较数据

若干比较数字乃经重新编排，以符合本半年度之呈报形式。

第六章 投资组合报告

一、2005年6月30日基金资产组合情况

项 目	金额 (人民币元)	占总资产比例
股票市值	1,852,610,465.13	70.16%
债券市值	683,814,506.09	25.90%
银行存款和清算备付金	93,640,473.60	3.55%
其他资产	10,469,773.00	0.39%
资产合计	2,640,535,217.82	100.00%

二、2005年6月30日按行业分类的股票投资组合

序号	分 类	市值 (人民币元)	占净值比例
1	农、林、牧、渔业	646,879.70	0.02%
2	采掘业	224,748,192.72	8.57%
3	制造业	796,599,633.06	30.36%
	其中：食品、饮料	63,746,834.51	2.43%
	纺织、服装、皮毛	29,044,014.57	1.11%
	木材、家具	421,170.75	0.02%
	造纸、印刷	28,734,043.80	1.09%
	石油、化学、塑胶、塑料	157,007,317.41	5.98%
	电子	2,965,621.21	0.11%
	金属、非金属	361,979,057.40	13.80%
	机械、设备、仪表	120,268,027.78	4.58%
	医药、生物制品	32,433,545.63	1.24%
	其他制造业	0.00	0.00%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	110,144,669.35	4.20%
5	建筑业	1,050,544.18	0.04%
6	交通运输、仓储业	291,935,386.77	11.13%
7	信息技术业	86,146,407.48	3.28%
8	批发和零售贸易	106,178,871.63	4.05%
9	金融、保险业	197,047,853.64	7.51%
10	房地产业	16,000,887.27	0.61%
11	社会服务业	5,316,075.43	0.20%
12	传播与文化产业	0.00	0.00%
13	综合类	16,795,063.90	0.64%
	合 计	1,852,610,465.13	70.61%

三、2005年6月30日按市值占基金资产净值比例大小排序的股票明细

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	招商银行	25,819,764	155,176,781.64	5.91%
2	600018	上港集箱	6,788,625	109,975,725.00	4.19%
3	600418	江淮汽车	12,833,942	91,762,685.30	3.50%
4	000898	鞍钢新轧	21,717,193	81,873,817.61	3.12%
5	600019	宝钢股份	15,735,258	78,833,642.58	3.00%

6	600900	长江电力	9,174,905	75,142,471.95	2.86%
7	600050	中国联通	23,626,228	62,373,241.92	2.38%
8	000022	深赤湾A	2,181,420	60,490,776.60	2.31%
9	600028	中国石化	15,762,210	55,798,223.40	2.13%
10	600331	宏达股份	7,704,916	44,534,414.48	1.70%
11	000825	太钢不锈	11,511,892	43,860,308.52	1.67%
12	600583	海油工程	1,815,814	42,326,624.34	1.61%
13	600188	兖州煤业	4,080,418	42,273,130.48	1.61%
14	600016	民生银行	8,723,140	41,871,072.00	1.60%
15	000039	中集集团	4,218,986	40,460,075.74	1.54%
16	600005	武钢股份	11,000,000	37,730,000.00	1.44%
17	600795	国电电力	5,295,340	35,002,197.40	1.33%
18	000089	深圳机场	4,010,642	32,125,242.42	1.22%
19	600348	国阳新能	3,393,531	31,967,062.02	1.22%
20	600270	外运发展	4,665,251	30,604,046.56	1.17%
21	600308	华泰股份	2,893,660	28,734,043.80	1.10%
22	000876	新希望	3,914,793	26,150,817.24	1.00%
23	600500	中化国际	4,471,702	24,415,492.92	0.93%
24	000731	四川美丰	3,075,249	23,833,179.75	0.91%
25	000063	中兴通讯	1,039,946	23,773,165.56	0.91%
26	600488	天药股份	3,152,111	23,672,353.61	0.90%
27	000933	神火股份	1,805,723	21,957,591.68	0.84%
28	000422	湖北宜化	3,965,056	21,728,506.88	0.83%
29	600597	光明乳业	5,174,141	21,576,167.97	0.82%
30	600655	豫园商城	4,269,863	21,135,821.85	0.81%
31	600002	齐鲁石化	3,069,922	19,309,809.38	0.74%
32	600162	香江控股	7,219,722	18,915,671.64	0.72%
33	000983	西山煤电	2,670,000	18,529,800.00	0.71%
34	000912	泸天化	2,953,469	17,957,091.52	0.68%
35	600307	酒钢宏兴	3,668,452	17,571,885.08	0.67%
36	600362	江西铜业	3,959,782	17,462,638.62	0.67%
37	000759	武汉中百	3,127,526	15,356,152.66	0.59%
38	600398	凯诺科技	2,878,417	15,054,120.91	0.57%
39	600897	厦门机场	1,892,931	14,196,982.50	0.54%
40	000960	锡业股份	2,458,879	13,745,133.61	0.52%
41	000858	五粮液	1,652,343	12,491,713.08	0.48%
42	600123	兰花科创	1,317,360	11,895,760.80	0.45%
43	600220	江苏阳光	5,508,700	11,237,748.00	0.43%
44	600026	中海发展	1,579,768	10,789,815.44	0.41%
45	600708	海博股份	2,440,312	10,639,760.32	0.41%
46	600432	吉恩镍业	1,091,800	9,957,216.00	0.38%
47	600631	百联股份	1,640,000	9,741,600.00	0.37%
48	000002	万科A	3,000,000	9,510,000.00	0.36%
49	600674	川投控股	2,855,118	9,507,542.94	0.36%
50	600029	南方航空	3,000,000	8,940,000.00	0.34%
51	600058	五矿发展	1,363,050	8,791,672.50	0.34%

52	600009	上海机场	500,000	8,300,000.00	0.32%
53	000830	鲁西化工	2,078,477	8,147,629.84	0.31%
54	600426	华鲁恒升	1,000,000	8,050,000.00	0.31%
55	600428	中远航运	1,005,760	7,925,388.80	0.30%
56	600269	赣粤高速	800,000	7,712,000.00	0.29%
57	600823	世茂股份	2,133,084	7,551,117.36	0.29%
58	000423	东阿阿胶	973,063	6,363,832.02	0.24%
59	600858	银座股份	1,103,101	6,155,303.58	0.23%
60	000024	招商地产	809,827	5,676,887.27	0.22%
61	600585	海螺水泥	796,559	5,336,945.30	0.20%
62	600792	马龙产业	773,358	5,189,232.18	0.20%
63	000987	广州友谊	904,891	5,067,389.60	0.19%
64	600327	大厦股份	1,020,674	4,684,893.66	0.18%
65	000822	山东海化	955,024	4,163,904.64	0.16%
66	600683	银泰股份	977,690	4,096,521.10	0.16%
67	600258	首旅股份	722,221	3,993,882.13	0.15%
68	600729	重庆百货	709,379	3,986,709.98	0.15%
69	600132	重庆啤酒	378,962	3,528,136.22	0.13%
70	600150	沪东重机	371,869	3,484,412.53	0.13%
71	000525	红太阳	903,692	3,461,140.36	0.13%
72	600226	升华拜克	846,424	3,334,910.56	0.13%
73	600071	凤凰光学	857,881	3,011,162.31	0.11%
74	600066	宇通客车	343,885	2,589,454.05	0.10%
75	000726	鲁泰A	310,213	2,425,865.66	0.09%
76	600750	江中药业	499,450	2,397,360.00	0.09%
77	600747	大显股份	750,000	2,227,500.00	0.08%
78	000677	山东海龙	580,000	2,018,400.00	0.08%
79	600859	王府井	200,000	1,066,000.00	0.04%
80	600970	中材国际	65,618	1,050,544.18	0.04%
81	000978	桂林旅游	154,465	898,986.30	0.03%
82	000402	金融街	100,000	814,000.00	0.03%
83	002045	广州国光	63,467	738,121.21	0.03%
84	002041	登海种业	29,165	646,879.70	0.03%
85	002046	轴研科技	41,879	504,641.95	0.02%
86	002040	南京港	48,757	470,505.05	0.02%
87	600054	黄山旅游	53,100	423,207.00	0.02%
88	002043	兔宝宝	60,775	421,170.75	0.02%
89	600688	上海石化	100,000	359,000.00	0.01%
90	002047	成霖股份	35,000	322,700.00	0.01%
91	000905	厦门港务	42,400	313,336.00	0.01%
92	600827	友谊股份	50,000	285,500.00	0.01%
93	600232	金鹰股份	34,700	222,080.00	0.01%
94	000709	唐钢股份	34,203	127,919.22	0.01%
95	002048	华翔电子	13,000	109,330.00	0.00%
96	002042	飞亚股份	20,000	104,200.00	0.00%

97	600033	福建高速	10,901	91,568.40	0.00%
----	--------	------	--------	-----------	-------

四、报告期内股票投资组合重大变动

(一) 2005年1月1日至2005年6月30日累计买入、累计卖出的前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	600900	长江电力	97,932,815.48	3.60%
2	600019	宝钢股份	78,585,459.82	2.89%
3	600050	中国联通	64,941,344.88	2.39%
4	000898	鞍钢新轧	64,380,861.89	2.37%
5	600331	宏达股份	55,002,369.80	2.02%
6	000063	中兴通讯	36,852,825.94	1.36%
7	000039	中集集团	34,421,274.53	1.27%
8	600018	上港集箱	34,387,619.66	1.27%
9	600002	齐鲁石化	30,693,250.73	1.13%
10	000022	深赤湾A	29,655,557.39	1.09%
11	000933	神火股份	27,319,571.34	1.01%
12	000422	湖北宜化	26,033,610.28	0.96%
13	600026	中海发展	25,767,581.64	0.95%
14	600307	酒钢宏兴	24,093,396.13	0.89%
15	000983	西山煤电	23,221,085.79	0.85%
16	600500	中化国际	21,763,702.86	0.80%
17	600631	百联股份	21,626,478.50	0.80%
18	600655	豫园商城	21,264,521.69	0.78%
19	600348	国阳新能	20,361,740.21	0.75%
20	000876	新希望	19,841,282.63	0.73%
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	600005	武钢股份	63,851,105.91	2.35%
2	000039	中集集团	56,680,013.53	2.09%
3	600028	中国石化	48,267,135.71	1.78%
4	600000	浦发银行	42,025,878.07	1.55%
5	600331	宏达股份	40,521,907.76	1.49%
6	600500	中化国际	39,712,573.81	1.46%
7	600104	上海汽车	36,834,147.17	1.36%
8	600320	振华港机	33,083,766.75	1.22%
9	600018	上港集箱	32,733,164.25	1.20%
10	000866	扬子石化	28,931,116.92	1.06%
11	600183	生益科技	25,629,589.74	0.94%
12	600050	中国联通	24,352,670.63	0.90%
13	600036	招商银行	23,791,900.13	0.88%
14	600900	长江电力	23,380,745.41	0.86%
15	000618	吉林化工	22,509,852.33	0.83%

16	600583	海油工程	21,246,101.35	0.78%
17	000888	峨眉山A	19,657,318.71	0.72%
18	600016	民生银行	18,978,579.43	0.70%
19	600031	G三一	18,691,383.77	0.69%
20	600002	齐鲁石化	17,391,915.78	0.64%

(二) 2005年1月1日至2005年6月30日基金同盛买入股票的成本总

额及卖出股票的收入总额：

买入股票成本总额：1,312,140,438.75元

卖出股票收入总额：1,013,633,389.70元

五、2005年6月30日按券种分类的债券投资组合

债券类别	债券市值(人民币元)	市值占净值比例
国家债券投资	556,763,891.49	21.22%
央行票据投资	0.00	0.00%
企业债券投资	5,000,000.00	0.19%
金融债券投资	49,885,000.00	1.90%
可转换债投资	72,165,614.60	2.75%
债券投资合计	683,814,506.09	26.06%

六、2005年6月30日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	债券市值(人民币元)	市值占净值比例
1	21 国债 03	158,210,342.40	6.03%
2	20 国债 04	149,535,000.00	5.70%
3	20 国债 10	105,451,500.00	4.02%
4	03 国开 22	49,885,000.00	1.90%
5	招行转债	41,592,000.00	1.59%

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) 其他资产构成

2005年6月30日其他资产构成

项 目	金额（人民币元）
交易保证金	751,825.49
应收利息	7,945,989.26
证券清算款	343,966.72
应收股利	1,427,991.53
合 计	10,469,773.00

（四）持有的处于转股期的可转换债券明细

债券代码	债券名称	债券市值（人民币元）	市值占净值比例
100795	国电转债	5,017,560.10	0.19%
110036	招行转债	41,592,000.00	1.59%
110037	歌华转债	1,403,208.50	0.05%
125488	晨鸣转债	10,535,000.00	0.40%
125822	海化转债	7,638,096.00	0.29%
126002	万科转 2	5,979,750.00	0.23%

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、截止 2005 年 6 月 30 日，前十名持有人名称、持有份额及比例如下

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	284,720,194	9.49%
2	中国平安保险(集团)股份有限公司	214,938,596	7.16%
3	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	211,678,200	7.06%
4	中国人寿保险(集团)公司	196,391,579	6.55%
5	中国人民财产保险股份有限公司	193,065,391	6.44%
6	中国再保险(集团)公司	99,417,448	3.31%
7	上海久事公司	85,828,811	2.86%
8	中卫国脉通信股份有限公司	55,925,700	1.86%
9	银河-汇丰-GOLDMAN,SACHS & CO	40,136,550	1.34%
10	湘财-汇丰-荷兰银行有限公司	32,265,160	1.08%

二、截止 2005 年 6 月 30 日，持有同盛基金的总户数为 124,602 户，平均每户持有 24,076.66 份，其中机构投资者持有 1,766,745,590 份，占总份额的 58.89%；个人投资者持有 1,233,254,410 份，占总份额的 41.11%。

第八章 重大事件揭示

一、本基金在 2005 年上半年未召开基金份额持有人大会。

二、基金管理人、托管人高级管理人员的变更

经长盛基金管理有限公司第三届董事会第二次会议审议通过,并报中国证监会批准(证监基金字[2005]33 号文),聘任陈礼华先生担任本公司副总经理。关于变更高级管理人员的公告刊登于二 五年三月十四日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

本报告期内,本基金托管人的托管业务部门原总经理唐棣华女士已于 2005 年 4 月 21 日调任其他岗位,目前由秦立儒先生任托管部门负责人。

三、本半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。

四、本基金投资策略未改变

五、基金收益分配事项

本基金于 2005 年 1 月 1 日至 2005 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 6.5 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,截至本报告期末我司按照选择证券经营机构的标准,经认真研究后,我们选择了中信证券股份有限公司(深圳、上海各一个席位)、国元证券有限责任公司(深圳、上海各一个席位)、国泰君安证券股份有限公司(深圳、上海各一个席位)、海通证券有限公司(上海一个席位)、长江证券有限责任公司(深圳、上海各一个席位)、中国银河证券有限责任公司(深圳、上海各一个席位)、招商证券股份有限公司(深圳一个席位)、泰阳证券有限责任公司(上海一个席位)、恒泰证券有限责任公司(上海一个席位)、华西证券有限责任公司(上海一个席位)这十家券商租用交易席位。

(二)2005 年 1-6 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
中信证券股份有限公司	203,769,198.53	8.99%	159,451.01	8.75%

国元证券有限责任公司	671,497,687.61	29.62%	539,085.43	29.57%
中国银河证券股份有限公司	516,921,521.93	22.80%	415,617.64	22.79%
国泰君安证券股份有限公司	120,216,179.52	5.30%	94,070.76	5.16%
泰阳证券有限公司	274,903,130.27	12.12%	221,320.52	12.14%
恒泰证券有限责任公司	480,059,201.73	21.17%	393,641.17	21.59%
合计	2,267,366,919.59	100.00%	1,823,186.53	100.00%

(三) 2005年1-6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
中信证券股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国元证券有限责任公司	35,812,884.89	16.45%	200,000,000.00	33.33%
中国银河证券股份有限公司	144,007,978.80	66.15%	0.00	0.00%
国泰君安证券股份有限公司	11,531,873.80	5.30%	0.00	0.00%
泰阳证券有限公司	9,840,130.30	4.52%	400,000,000.00	66.67%
恒泰证券有限责任公司	16,509,550.00	7.58%	0.00	0.00%
合计	217,702,417.79	100.00%	600,000,000.00	100.00%

(四) 报告期内租用证券公司席位的变更情况：报告期内停止租用渤海证券有限责任公司深圳两个席位、上海一个席位，停止租用天同证券有限责任公司深圳、上海各一个席位，停止租用海通证券有限公司深圳一个席位，停止租用大鹏证券有限公司深圳、上海各一个席位，停止租用泰阳证券有限责任公司深圳一个席位。

第九章 备查文件目录

- 一、关于中国证券监督管理委员会同意设立同盛证券投资基金的批复
- 二、同盛证券投资基金基金合同
- 三、同盛证券投资基金托管协议
- 四、报告期内披露的各项公告原件
- 五、长盛基金管理有限公司营业执照和公司章程
- 六、以上相关备查文件，置备于基金管理人的办公场所，在办公时间内可查阅。本半年度报告分别置备于基金管理人和基金托管人的办公场所，以及基金上市交易的证券交易所，供公众查阅、复制，并将本半年度报告至少登载在一种由中国证监会指定的全国性报刊及本基金管理人的互联网网站上。

长盛基金管理有限公司

二 五年八月二十四日