

长盛同智优势成长混合型证券投资基金

(原同智证券投资基金转型)

2007 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长盛同智优势成长混合型证券投资基金（原同智证券投资基金转型）2007 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。（本报告的目录及正文分别使用长盛同智优势成长混合型证券投资基金的简称“长盛同智基金”或“本基金”和同智证券投资基金的简称“基金同智”或“本基金”）。

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 8 月 24 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。

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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告会计期为 2007 年 1 月 1 日起至 2007 年 6 月 30 日止（注：2007 年 1 月 1 日起至 2007 年 1 月 4 日止为转型前的同智证券投资基金）。本报告中的财务资料未经审计。

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。

2006年12月28日，本公司发布关于同智证券投资基金于2007年1月5日终止上市的公告。自同智证券投资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；自同智证券投资基金终止上市之日起，基金同智转型成为上市开放式基金。2007年1月8日至2007年1月18日为长盛同智优势成长混合型证券投资基金集中申购期，在集中申购期间，投资者通过深交所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。

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	5
第三章 管理人报告	9
第四章 托管人报告.....	12
第五章 长盛同智基金财务会计报告.....	13
第六章 基金同智财务会计报告.....	26
第七章 长盛同智基金投资组合报告.....	35
第八章 基金同智投资组合报告.....	40
第九章 基金份额持有人户数和持有人结构.....	43
第十章 开放式基金份额变动情况.....	44
第十一章 重大事件揭示.....	45
第十二章 备查文件.....	50

第一章 基金简介

一、基金产品概况

(一) 长盛同智优势成长混合型证券投资基金 (LOF)

- 1、基金名称：长盛同智优势成长混合型证券投资基金 (LOF)
- 2、基金简称：长盛同智基金
- 3、交易代码：160805
- 4、基金运作方式：契约型开放式
- 5、基金合同生效日：2007年1月5日
- 6、报告期末基金份额总额：7,032,868,202.89份
- 7、基金合同存续期：不定期
- 8、基金份额上市的证券交易所：深圳证券交易所
- 9、基金上市日期：2007年2月16日

(二) 同智证券投资基金

- 1、基金名称：同智证券投资基金
- 2、基金简称：基金同智
- 3、交易代码：184702
- 4、基金运作方式：契约型封闭式
- 5、基金合同生效日：1992年3月13日（基金清理规范成立日：2000年3月8日）
- 6、报告期末基金份额总额：500,000,000份
- 7、基金合同存续期：15年
- 8、基金份额上市的证券交易所：深圳证券交易所
- 9、基金上市日期：2000年5月15日
- 10、基金终止上市日期：2007年1月5日

二、基金产品说明

(一) 长盛同智优势成长混合型证券投资基金 (LOF)

投资目标：主要投资于业绩能够持续优势成长的成长型上市公司，所追求的投资目标是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。

投资策略：

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、公司成长性及资本市场的判断，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 年仍然是全球成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上而下的路径。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。基金的主要资产将配置在行业优选排序前 50%的行业上。

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付与相应的分数和权重，最后得出该行业内的公司投资优选排序，基金的主要资产将配置在优选排序前 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；
- 管理层的发展战略是否合理有效；
- 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；
- 行业的竞争结构，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、债券配置策略

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依据下列标准进行：

- (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大的债券；
- (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。

业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 65\% + \text{上证国债指数收益率} \times 30\% + \text{一年定期存款利率} \times 5\%$ 。

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。

(二) 同智证券投资基金

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。

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。

业绩比较基准：无。

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) 注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 1211 室

(三) 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

(四) 邮政编码：100088

(五) 法定代表人：凤良志

(六) 信息披露负责人：叶金松

(七) 联系电话：010-82255818

(八) 传真：010-82255988

(九) 电子邮箱：yejs@csfunds.com.cn

四、基金托管人

(一) 法定名称：中国银行股份有限公司

(二) 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

(三) 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

(四) 邮政编码：100818

(五) 法定代表人：肖钢

(六) 信息披露负责人：宁敏

(七) 电话：010-66594977

(八) 传真：010-66594942

(九) 电子邮箱：tgxxpl@bank-of-china.com

五、信息披露

(一) 信息披露报纸名称：《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》。

(二) 登载本报告正文的管理人互联网网址: <http://www.csfunds.com.cn>。

(三) 基金半年度报告置备地点: 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。

六、其他有关资料

(一) 基金注册登记机构名称: 中国证券登记结算有限责任公司

(二) 办公地址: 北京市西城区金融大街 27 号投资广场 22 层

第二章 主要财务指标和基金净值表现

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	转型后(2007年1月5日至2007年6月30日)	转型前(2007年1月1日至2007年1月4日)
1	基金本期净收益(元)	2,046,390,257.59	-96,276.78
2	基金份额本期净收益(元/份)	0.2279	-0.0002
3	期末可供分配基金收益(元)	1,683,499,139.43	131,312,912.18
4	期末可供分配基金份额收益(元/份)	0.2394	0.2626
5	期末基金资产净值(元)	9,898,913,744.61	792,663,323.32
6	期末基金份额净值(元/份)	1.4075	1.5853
7	基金加权平均净值收益率	19.73%	-0.01%
8	本期基金份额净值增长率	69.60%	2.28%
9	基金份额累计净值增长率	69.60%	154.31%

二、基金净值表现

(一) 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、转型前基金同智基金份额净值增长率(截至2007年1月4日)

阶段	净值增长率	净值增长率标准差
过去一个月	8.57%	0.0332
过去三个月	29.74%	0.0213
过去六个月	32.96%	0.0222
过去一年	87.94%	0.0251
过去三年	122.67%	0.0238
过去五年	127.74%	0.0219
自基金成立起至2007年1月4日	154.31%	0.0204

注：本基金转型前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。

2、转型后长盛同智基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

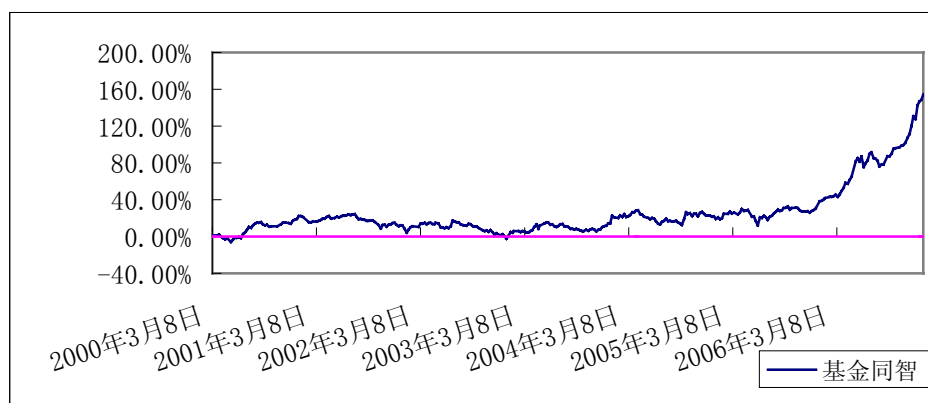
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.06%	0.0275	-2.78%	0.0199	0.72%	0.0076
过去三个月	36.37%	0.0232	21.62%	0.0164	14.75%	0.0068
过去六个月	69.60%	0.0219	48.32%	0.0164	21.28%	0.0055
自基金成立起至今	69.60%	0.0219	48.32%	0.0164	21.28%	0.0055

(二) 自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

1、转型前基金同智累计份额净值增长率

与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2000年3月8日至2007年1月4日)



注：

1、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

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。截止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%;

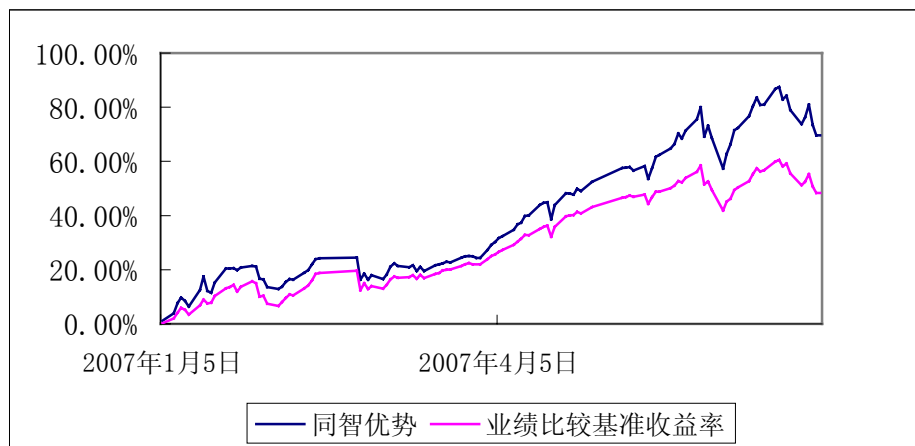
(4) 本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为一年, 债券回购到期后不得展期; 债券回购的资金余额不得超过基金净资产的40%;

(5) 本基金将遵守中国证监会规定的其它比例限制。

2、转型后长盛同智基金累计份额净值增长率

与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2007年1月5日至2007年6月30日)



注: 1、长盛同智基金基金合同于 2007 年 1 月 5 日生效, 截至报告日本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定, 本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同投资组合中规定的各项比例。

3、本基金基金合同中对投资组合的各项比例规定如下:

(1) 股票投资占基金资产净值的比例范围为 30%—95%; 基金持有一家上市公司的股票, 不超过基金资产净值的 10%;

(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, 不得超过该证券总股本的 10%;

- (3) 基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的 3%;
- (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 10%;
- (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 0.5%;
- (6) 本基金投资于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 10%;
- (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 20%;
- (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 10%;
- (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 10%;
- (10) 债券投资占基金资产净值的比例范围为 0-65%; 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 40%;
- (11) 基金财产参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
- (12) 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; 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

第三章 管理人报告

一、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占注册资本的41%、新加坡星展资产管理有限公司占注册资本的33%；安徽省创新投资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%。截止2007年6月30日，基金管理人共管理三支封闭式基金、六支开放式基金，并于2002年12月，首批取得了全国社保基金管理资格。

（二）基金经理小组简介

肖强，现任本基金基金经理。男，1967年12月出生。学士。曾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。

丁骏，现任本基金基金经理。男，1974年11月出生。中国人民银行研究生部国际金融硕士。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融资部业务经理、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。现担任基金同盛基金经理。

二、报告期内本基金运作的合规守信情况说明

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》、《长盛同智优势成长混合型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。

三、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

2007年上半年，A股市场续演了一幅波澜壮阔的上涨行情。财富效应使得场外资金加速涌入市场，股票估值迅速提高，市场在没有经过充分调整的情况下迭创新高，

大盘的风险也快速积累。至 5 月底，当上证指数达到 4300 点阶段性高点后，多空力量基本平衡，股指开始大幅震荡。

本基金一贯坚持长线选股思维，注重目标公司的基本质地优良和未来的可持续成长。在整体布局上，我们坚持相对均衡、分散的风格，对主要重仓股的持仓比较稳定。

（二）本基金业绩表现

截至2007年6月30日，本基金份额净值为1.4075元，本报告期份额净值增长率为69.60%，同期本基金基准上涨48.32%，上证A股指数上涨42.80%，本基金净值表现强于大盘。

四、对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

（一）对宏观经济和证券市场的展望

我们仍然认为中国 A 股市场运行在一个长期牛市的过程中，这个过程将持续数年。

从短期看，未来第三季度，A 股市场受政策的调控影响较大。我们对政府调控政策的主要判断如下：

1、印花税上调 0.2%。年抽资金 5000 亿元左右，对市场中期资金供给形成考验。

2、可能取消利息税。2006 年全国利息税收入 459 亿元，即使全部取消，也仅占国家印花税新增量的一个小部分。对市场资金供给实质影响不大。

3、1.5 万亿财政部特别国债。新手段的本质在于由财政(或全体国民)来承担央行外汇的贬值，从而缓解了央行在升值和流动性控制问题上的压力。对市场影响需视具体发行安排而定。

4、QDII 政策：长期影响可能较大。A 股市场部分资金会外流。

5、加快大盘国企股的上市。神华、建行、中石油、中电信等融资会超过 1500 亿元。

从长期看，中国经济的强劲增长以及上市公司的优良业绩会继续支持股市的长期表现。另外，在全流通市场环境里，场外优质资产的注入符合市场监管者、上市公司大股东、上市公司本身和广大中小股东的利益。在各个方面利益高度一致的基础上，我们认为市场上兼并收购、整体上市的资本运作方兴未艾。而这将进一步提升上市公司质量和盈利能力，封住市场下跌空间。

综上所述，我们判断，由于近期市场没有足够的量能，调整在所难免。市场的反转还需要期待政府态度的转变或时间所换得的空间。乐观期待 A 股市场重拾升势的时机可能是：（1）十七大秋季召开前后；（2）四季度或岁末前后新一轮业绩浪潮。

（二）本基金下阶段投资策略

下半年对于基金来说，超额收益来自于对个股的精心选择和持之以恒的投资信念。整体策略：我们考虑适度的仓位降低、重视结构和品种的防御性、向优质龙头公司收缩。行业上考虑钢铁、煤炭、化工行业的机会。中短期的考虑主题还包括：

投资主题一：中报业绩预增

随着 6 月份利空政策不断出台，市场出现了恐慌性下跌。在此期间，注重基本面分析的价值投资者将成为市场最重要的稳定力量，他们很可能通过买入低估的个股来推动指数重回上升通道。

投资主题二：要素价格上涨下的投资

在人民币升值、节能减排、和谐社会等多种重大事件的影响下，国内要素价格将发生很大变化。其核心将表现为劳动力成本上升、资源能源价格上涨、通货膨胀。这将是中长线的投资主线：1、相对物价持续上升，资产资源价格不断膨胀。我们看好：有色、煤炭、地产。2、名义汇率上升下要素生产效率提高较快的行业。看好：高端机械、IT、化工。3、居民收入将纠正性的加速增长。看好：居住配套类消费和汽车消费增长，食品饮料、金融服务。

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”）在对长盛同智优势成长混合型证券投资基金(原同智证券投资基金转型)（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、基金合同和托管协议的有关规定，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、基金合同和托管协议的规定，对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、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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真实、准确和完整。

中国银行股份有限公司

2007年8月24日

第五章 长盛同智基金财务会计报告

一、基金会计报表（未经审计）

（一）资产负债表

长盛同智优势成长混合型证券投资基金资产负债表

单位：人民币元

项 目	附注	2007年6月30日
资 产		
银行存款	1	705,990,914.13
清算备付金		17,342,755.10
交易保证金		5,543,882.83
应收股利		2,824,665.30
应收证券清算款		164,044,017.19
应收申购款		8,584,323.98
其他应收款		0.00
应收利息	2	208,741.25
股票投资市值		9,178,687,796.99
其中：股票投资成本		7,242,830,363.34
债券投资市值		0.00
其中：债券投资成本		0.00
权证投资		0.00
其中：权证投资成本		0.00
买入返售证券		0.00
待摊费用	3	0.00
资产总计		10,083,227,096.77
负债及持有人权益		
负 债		
应付证券清算款		56,837,344.45
应付赎回款		96,139,220.38
应付赎回费		362,333.93
应付管理人报酬		13,383,219.57
应付托管费		2,230,536.61
应付销售服务费		0.00
应付佣金	5	14,212,266.21
应付利息		0.00
应付收益		428,874.52
应交税金		0.00
其他应付款	6	531,117.39
卖出回购证券款		0.00
短期借款		0.00
预提费用	7	188,439.10
负债合计		184,313,352.16

持有人权益		
实收基金	8	7,032,868,202.89
未实现利得	4	1,182,546,402.29
未分配收益		1,683,499,139.43
持有人权益合计		9,898,913,744.61
负债及持有人权益总计		10,083,227,096.77
基金份额净值（元/份）		1.4075

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

长盛同智优势成长混合型证券投资基金经营业绩表

单位：人民币元

项 目	附注	2007年1月5日（基金合同生效日）至2007年6月30日止期间
收 入		2,135,096,860.80
股票差价收入	9	2,057,242,879.48
债券差价收入	10	1,699,721.77
权证差价收入	11	6,252,250.75
债券利息收入		92,575.90
存款利息收入		9,651,120.01
股利收入		48,257,468.03
买入返售证券收入		109,589.04
其他收入	12	11,791,255.82
费 用		88,706,603.21
基金管理费		75,808,695.99
基金托管费		12,634,782.74
基金销售服务费		0.00
卖出回购证券支出		18,853.65
利息支出		0.00
其他费用	13	244,270.83
其中：上市年费		29,095.26
信息披露费		130,932.21
审计费用		34,247.23
基金净收益		2,046,390,257.59
加：未实现利得	4	1,774,507,022.51
基金经营业绩		3,820,897,280.10

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，认购、申购、赎回、基金转换、交易佣金等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

长盛同智优势成长混合型证券投资基金收益分配表

单位：人民币元

项 目	附注	2007年1月5日（基金合同生效日） 至2007年6月30日止期间
本期基金净收益		2,046,390,257.59
加：期初基金净收益		131,312,912.18
加：本期损益平准金		-334,060,731.60
可供分配基金净收益		1,843,642,438.17
减：本期已分配基金净收益（因转型拆分 将未分配收益折算为基金份额的收益）	14	160,143,298.74
期末基金净收益		1,683,499,139.43

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

长盛同智优势成长混合型证券投资基金净值变动表

单位：人民币元

项 目	2007年1月5日（基金合同 生效日）至2007年6月30日 止期间
期初基金净值	792,663,323.32
本期经营活动：	
基金净收益	2,046,390,257.59
未实现利得	1,774,507,022.51
经营活动产生的基金净值变动数	3,820,897,280.10
本期基金份额交易	
基金申购款	14,874,050,392.08
其中：基金拆分份额折算产生的变动数	455,116,000.00
基金赎回款	9,428,553,952.15
基金份额交易产生的基金净值变动数	5,445,496,439.93
本期向基金份额持有人分配收益：	
原基金同智持有人已实现收益折算份额产生的基金净值变动数	-160,143,298.74
期末基金净值	9,898,913,744.61

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）

（一）基本情况

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25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。

（二）编制基金会计报表所遵循的主要会计制度及其他有关规定

本基金的会计报表按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金合同》和中国证监会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

（三）主要会计政策、会计估计

1、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。本半年度会计报表的实际编制期间为2007年1月5日（基金合同生效日）至2007年6月30日。

2、记账本位币：本基金的记账本位币为人民币。

3、记账基础和计价原则：本基金的记账基础为权责发生制。除股票投资、债券投资和权证投资按市值计价外，所有报表项目均以历史成本计价。

4、基金资产的估值原则

（1）股票投资

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；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。首次公开发行但未上市的股票，按成本估值；由于配股和非定向增发形成的暂时流通受限制的股票，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收盘价估值。

（2）债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。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进行估值；估值日无交易的，以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。未上市流通的债券和银行间同业市场交易的债券由本基金管理人和基金托管人综合考虑市场成交价、市

场报价、成本价、流动性、收益率曲线等多种影响债券估值的因素后确定的反映公允价值的价格估值。

(3) 权证投资

从获赠确认日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证投资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；未上市交易的权证投资(包括配股权证)按公允价值估值。

(4) 实际投资成本与估值的差异计入“未实现利得”科目。

(5) 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。

5、证券投资基金成本计价方法

(1) 股票投资

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。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时冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票差价收入。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(2) 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资；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。债券投资按成交日应支付的全部价款入账，其中所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。

买入贴息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，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，按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入；卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(3) 权证投资

获赠权证(包括配股权证)在确认日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

卖出权证于成交日确认权证差价收入。出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

6、收入的确认和计量

股票差价收入于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

证券交易所交易的债券差价收入于卖出成交日确认；银行间同业市场交易的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

权证差价收入于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其相关费用的差额确认。

除银行次级债之外的债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含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确认，银行次级债利息收入按债券票面价值与全额票面利率计算的金额确认。债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

股利收入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于除息日确认。

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提。

7、费用的确认和计量

本基金的基金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。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

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。

8、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。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

9、未实现利得

未实现利得包括因投资估值而产生的未实现估值增值和未实现利得平准金。

未实现利得平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未实现利得占基金净值比例计算的金额。未实现利得平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

10、损益平准金

损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未分配基金净收益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配基金净收益。

11、基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。基金收益分配每年至少一次；基金当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配。基金当年亏损，则不进行收益分配。

经宣告的基金收益分配方案于分红除权日从基金份额持有人权益转出。

（四）税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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《财政部、国家税务总局关于调整证券(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：

- 1、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。
- 2、基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税和企业所得税。
- 3、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，自 2005 年 6 月 13 日起由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%(此前按 100%)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。
- 4、基金买卖股票自 2005 年 1 月 24 日起减按 1%的税率缴纳股票交易印花税，从 2007 年 5 月 30 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由现行 1%调整至 3%。
- 5、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）本报告期重大会计差错的内容和更正金额：无。

（六）本报告期关联方关系及关联方交易

1、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	与长盛同智基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
国元证券有限责任公司（“国元证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
新加坡星展资产管理有限公司	基金管理人股东
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

2、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

①通过关联方的席位进行的证券交易

单位：人民币元

项目	2007年1月5日（基金合同生效日）至2007年6月30日止期间	
	成交量	占半年成交量的比例
国元证券：		
买卖股票	7,919,347,957.68	30.30%

②通过关联方的席位进行的证券交易佣金

单位：人民币元

项目	2007年1月5日（基金合同生效日）至2007年6月30日止期间	
	佣金	占半年佣金总量的比例
国元证券	6,493,842.27	30.73%

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、并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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：

$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$ （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；并于次月两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

C、长盛同智基金本期应支付基金管理费共计人民币75,808,695.99元。

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：

$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$ （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；于次月两个工作日内从基金资产中一次性支取。

C、长盛同智基金本期应支付基金托管费共计人民币12,634,782.74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银行股份有限公司保管，并按银行间同业存款利率计息，本期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	2007年6月30日
银行存款余额	705,990,914.13
	2007年1月5日（基金合同生效日）至2007年6月30日止期间
银行存款产生的利息收入	9,444,207.91

(4) 与关联方银行间同业市场的债券（含回购）交易：无。

(5) 长盛同智基金各关联方投资本基金的情况

① 基金管理人于本报告期末所持有的本基金份额

关联方名称	2007年6月30日		
	持有基金份额 (份)	净值 (人民币元)	占基金总份额比例
长盛基金管理有限公司	92,276,368.00	129,878,987.96	1.31%

②基金其他关联方及其控制的机构于本报告期末未持有本基金份额。

(七) 本基金会计报表重要项目说明

1、银行存款

单位：人民币元

项 目	2007年6月30日
活期存款	705,990,914.13
定期存款	0.00
合计	705,990,914.13

2、应收利息

单位：人民币元

项 目	2007年6月30日
应收银行存款利息	201,363.32
应收清算备付金利息	7,023.78
应收权证保证金利息	56.07
应收申购款利息	298.08
合计	208,741.25

3、待摊费用：截止2007年6月30日，待摊费用余额为0.00元。

4、未实现利得

单位：人民币元

项 目	2007年1月5日（基金合同生效日）至2007年6月30日止期间
2007年1月4日	161,350,411.14
投资估值增值	1,774,507,022.51
其中：股票估值增值	1,776,038,133.39
债券估值增值	-1,531,110.88
本报告期申购基金份额	442,963,638.63
其中：红利再投资	0.00
本报告期赎回基金份额	1,196,274,669.99
2007年6月30日	1,182,546,402.29

(a) 估值增值按投资类别分项列示如下：

单位：人民币元

项 目	2007年6月30日		
	市值	成本	估值增值 (a)
股票投资	9,178,687,796.99	7,242,830,363.34	1,935,857,433.65
债券投资	0.00	0.00	0.00
权证投资	0.00	0.00	0.00
合计	9,178,687,796.99	7,242,830,363.34	1,935,857,433.65

5、应付佣金

单位：人民币元

公司名称	2007年6月30日
招商证券股份有限公司	3,436,139.75
长江证券有限责任公司	1,366,410.36
中信证券股份有限公司	318,029.35
广发华福证券有限责任公司	2,210,831.94
国元证券有限责任公司	3,322,322.86
东北证券有限责任公司	967,485.05
北京高华证券有限责任公司	1,675,801.00
广发证券股份有限公司	840,221.27
中信建投证券有限责任公司	75,024.63
合计	14,212,266.21

6、其他应付款

单位：人民币元

项 目	2007年6月30日
未代扣代缴个人所得税暂挂	278,633.39
应付券商席位保证金	250,000.00
其他	2,484.00
合计	531,117.39

7、预提费用

单位：人民币元

项 目	2007年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	133,891.13
上市年费	29,752.78
合计	188,439.10

8、实收基金

单位：人民币元

项 目	2007年1月5日（基金合同生效日）至2007年6月30日止期间	
	基金份额（份）	基金面值
2007年1月5日	500,000,000.00	500,000,000.00
本报告期申购(a)	14,198,073,264.50	14,198,073,264.50
其中：基金转型拆分份额增加数(a)	455,116,000.00	455,116,000.00
本报告期赎回	7,665,205,061.61	7,665,205,061.61
2007年6月30日	7,032,868,202.89	7,032,868,202.89

(a)：根据《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）集中申购期基金份额发售公告》，本基金于2007年1月8日至2007年1月18日止期间，以基金份额面值人民币1.00元同时向个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者发售。根据《原同智基金基金份额转换结果的公告》，于2007年1月23日（转换日），长盛同智基金按照2007年1月22日（转换基准日）的基金份额净值1.9102320元，对投资者持有的原基金同智份额进行转换。根据安永华明会计师事务所出具的安永华明（2007）验字第60468688-01号验资报告，集中申购期间扣除申购费用后的净申购金额为人民币10,835,250,117.78元，折合10,835,250,117.78份基金份额；集中申购期间产生的利息人民币3,754,452.61元，折合3,754,452.61份基金份额。于2007年1月23日（转换日），长盛同智基金于转换基准日的基金净资产为人民币955,116,003.53元，于转换日转换为基金份额955,116,000.00份，折算差额人民币3.53元计入基金资产。

9、股票差价收入

单位：人民币元

项 目	2007年1月5日（基金合同生效日）至2007年6月30日止期间
-----	----------------------------------

卖出股票成交总额	10,929,184,672.95
减：卖出股票成本总额	8,862,743,769.71
交易佣金总额	9,198,023.76
股票差价收入	2,057,242,879.48

10、债券差价收入

单位：人民币元

项 目	2007年1月5日（基金合同生效日）至2007年6月30日止期间
卖出债券及兑付结算金额	190,171,856.51
减：卖出债券及兑付成本总额	187,250,648.21
应收利息总额	1,221,486.53
债券差价收入	1,699,721.77

11、权证差价收入

单位：人民币元

项 目	2007年1月5日（基金合同生效日）至2007年6月30日止期间
卖出权证成交总额	8,730,097.59
减：卖出权证成本总额	2,477,846.84
权证差价收入	6,252,250.75

12、其他收入

单位：人民币元

项 目	2007年1月5日（基金合同生效日）至2007年6月30日止期间
赎回基金补偿收入（a）	11,787,601.29
其他	3,654.53
合计	11,791,255.82

（a）本基金的场外赎回费率不高于赎回金额的0.5%，随基金份额持有期限的增加而递减。赎回费总额的25%归入基金资产。

13、其他费用

单位：人民币元

项 目	2007年1月5日（基金合同生效日）至2007年6月30日止期间
银行费用	17,131.00
信息披露费	130,932.21
上市年费	29,095.26
审计费用	34,247.23
债券托管账户维护费	11,420.00
银行间交易费	1,345.13
持有人大会费(a)	20,000.00
其他	100.00
合计	244,270.83

（a）本基金本报告期发生的持有人大会费为支付给国浩律师集团（北京）事务所的律师费用。

14、收益分配

基金管理人依据中国证监会《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），并经基金管理人计算并由基金托管人复核，于2007年1月23日，将截至2007年1月22日的长盛同智基金（原基金同智）可分配收益人民币160,143,298.74元按1.00元折算成为长盛同智优势成长混合型证券投资基金份额，并由中国证券登记结算有限责任公司进行了份额变更登记。

15、本报告期内本基金所投资的股票中，无因股权分置改革而获得由非流通股股东支付的现金对价。

（八）报告期流通受限制不能自由转让的基金资产

1、因重大事项停牌的股票

本基金截止2007年6月30日，持有以下因重大事项而暂时停牌的股票，其期末估值单价是根据最近一个交易日的收盘价确定。

单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
000061	农产品	2007-5-8	21.90	-	-	658,870	14,695,726.77	14,429,253.00
000768	西飞国际	2007-5-18	30.87	2007-7-16	33.96	1,552,791	28,792,398.38	47,934,658.17
合计							43,488,125.15	62,363,911.17

2、因新股处于锁定期不能流通的股票

基金作为一般法人或战略投资者认购的以下新股，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。截止2007年6月30日，因处于锁定期不能流通的新股均以估值日证券交易所提供的同一股票的收盘价估值，该日无交易的，以最近一个交易日收盘价计算。

单位：人民币元

股票代码	股票名称	期末估值单价	申购日期	可流通日期	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
601007	金陵饭店	14.42	2007-3-26	2007-7-10	106,196	451,333.00	1,531,346.32
601328	交通银行	10.99	2007-4-27	2007-8-16	597,844	4,722,967.60	6,570,305.56
002128	露天煤业	36.10	2007-4-10	2007-7-18	87,837	860,802.60	3,170,915.70
002129	中环股份	15.52	2007-4-10	2007-7-20	98,899	574,603.19	1,534,912.48
002130	沃尔核材	48.85	2007-4-10	2007-7-20	15,964	250,954.08	779,841.40
合计						6,860,660.47	13,587,321.46

（九）其他重要事项

本基金无需要说明的其他重要事项。

第六章 基金同智财务会计报告

一、基金会计报表（未经审计）

（一）资产负债表

同智证券投资基金

2007年1月4日资产负债表

单位：人民币元

项 目	附注	2007年1月4日	2006年12月31日
资 产			
银行存款	1	180,310,688.08	167,299,721.59
清算备付金		5,842,442.32	5,842,442.32
交易保证金		389,781.75	389,781.75
应收股利		0.00	0.00
应收证券清算款		0.00	13,010,966.49
应收申购款		0.00	0.00
其他应收款		0.00	0.00
应收利息	2	1,207,996.83	1,132,639.41
股票投资市值		596,800,252.00	578,884,308.72
其中：股票投资成本		436,980,951.74	436,980,951.74
债券投资市值		180,235,605.93	180,354,759.73
其中：债券投资成本		178,704,495.05	178,704,495.05
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	3	0.00	0.00
资产总计		964,786,766.91	946,914,620.01
负债及持有人权益			
负 债			
应付证券清算款		100,139,600.00	0.00
应付赎回款		0.00	0.00
应付赎回费		0.00	0.00
应付管理人报酬		1,369,188.32	1,241,803.10
应付托管费		228,198.02	206,967.16
应付销售服务费		0.00	0.00
应付佣金	5	1,327,650.64	1,327,650.64
应付利息		47,134.30	167,880.58
应付收益		428,874.52	428,874.52
应交税金		0.00	0.00
其他应付款	6	528,633.39	528,633.39
卖出回购证券款		68,000,000.00	168,000,000.00

短期借款		0.00	0.00
预提费用	7	54,164.40	50,000.00
负债合计		172,123,443.59	171,951,809.39
持有人权益			
实收基金	8	500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得	4	161,350,411.14	143,553,621.66
未分配收益		131,312,912.18	131,409,188.96
持有人权益合计		792,663,323.32	774,962,810.62
负债及持有人权益总计		964,786,766.91	946,914,620.01
基金份额净值(元/份)		1.5853	1.5499

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

2007年1月1日至2007年1月4日止期间

单位：人民币元

项 目	附注	2007年1月1日至2007年1月4日	2006年上半年度
收 入		75,357.42	120,406,253.01
股票差价收入	9	0.00	108,275,720.82
债券差价收入	10	0.00	-9,329.38
权证差价收入	11	0.00	4,685,286.23
债券利息收入		55,877.90	1,877,982.08
存款利息收入		19,479.52	148,836.78
股利收入		0.00	5,427,720.86
买入返售证券收入		0.00	0.00
其他收入	12	0.00	35.62
费 用		171,634.20	6,078,466.99
基金管理费		127,385.22	4,922,894.43
基金托管费		21,230.86	820,482.42
基金销售服务费		0.00	0.00
卖出回购证券支出		18,853.72	54,370.41
利息支出		0.00	0.00
其他费用	13	4,164.40	280,719.73
其中：上市年费		657.52	29,752.78
信息披露费		2,958.92	148,767.52
审计费用		547.96	24,795.19
基金净收益		-96,276.78	114,327,786.02
加：未实现利得	4	17,796,789.48	115,447,171.95
基金经营业绩		17,700,512.70	229,774,957.97

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，交易佣金等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

同智证券投资基金基金收益分配表
2007年1月1日至2007年1月4日止期间

单位：人民币元

项 目	附注	2007年1月1日至2007年1月4日	2006年上半年度
本期基金净收益		-96,276.78	114,327,786.02
加：期初基金净收益		131,409,188.96	24,752,899.73
可供分配基金净收益		131,312,912.18	139,080,685.75
减：本期已分配基金净收益	14	0.00	22,299,999.99
期末基金净收益		131,312,912.18	116,780,685.76

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
2007年1月1日至2007年1月4日止期间

单位：人民币元

项 目	2007年1月1日至2007年1月4日	2006年上半年度
期初基金净值	774,962,810.62	576,124,019.75
本期经营活动：		
基金净收益	-96,276.78	114,327,786.02
未实现利得	17,796,789.48	115,447,171.95
经营活动产生的基金净值变动数	17,700,512.70	229,774,957.97
本期向基金份额持有人分配收益		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	0.00	-22,299,999.99
期末基金净值	792,663,323.32	783,598,977.73

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）

(一) 主要会计政策、会计估计及其变更

基金同智本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

(二) 本报告期重大会计差错的内容和更正金额：无。

(三) 本报告期关联方关系发生变化的情况，本报告期及上年度可比期间的关联方交易

1、关联方关系发生变化的情况：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（“国元证券”）	基金发起人、基金管理人股东
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

2、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

①通过关联方的席位进行的证券交易

单位：人民币元

项目	2007年1月1日至2007年1月4日		2006上半年度	
	成交量	占半年成交量的比例	成交量	占半年成交量的比例
国元证券：				
买卖股票	0.00	0.00%	359,042,005.37	26.98%
买卖债券	0.00	0.00%	12,427,968.80	27.01%
中信证券：				
买卖股票	0.00	0.00%	250,741,887.05	18.84%

②通过关联方的席位进行的证券交易佣金

单位：人民币元

项目	2007年1月1日至2007年1月4日		2006年上半年度	
	佣金	占半年佣金总量的比例	佣金	占半年佣金总量的比例
中信证券	0.00	0.00%	196,207.89	18.31%
国元证券	0.00	0.00%	294,287.82	27.47%
合计	0.00	0.00%	490,495.71	45.78%

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、并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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：

$H=E \times 1.5\% / \text{当年天数}$ （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；并于次月两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

C、基金同智于2007年1月1日至2007年1月4日止期间应支付基金管理费共计人民币127,385.22元（2006年上半年度应支付人民币4,922,894.43元）。

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：

$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$ （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；于次月两个工作日内从基金资产中一次性支取。

C、基金同智于2007年1月1日至2007年1月4日止期间应支付基金托管费共计人民币21,230.86元（2006年上半年度应支付人民币820,482.42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银行股份有限公司保管，并按银行间同业存款利率计息，本期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	2007年1月4日
银行存款余额	180,310,688.08
	2007年1月1日至2007年1月4日止期间
银行存款产生的利息收入	18,402.96

(4) 与关联方银行间同业市场的债券（含回购）交易：无。

(5) 基金同智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	2007年1月1日至2007年1月4日止期间	2006年上半年度
期初持有基金份额（份）	48,306,367	7,797,818
本期增加（份）	0	24,885,744
期末持有基金份额（份）	48,306,367	32,683,562
其中作为发起人持有份额（份）	1,339,346	1,339,346

②基金其他关联方及其控制的机构所持有的本基金份额

关联方名称	2007年1月4日		2006年6月30日	
	持有基金份额	占基金总份额比例	持有基金份额	占基金总份额比例
中信证券股份有限公司	500,000	0.10%	2,616,131	0.52%
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%	4,116,131	0.82%

(四) 本基金会计报表重要项目说明

1、银行存款

单位：人民币元

项目	2007年1月4日	2006年6月30日
活期存款	180,310,688.08	9,753,085.92
定期存款	0.00	0.00
合计	180,310,688.08	9,753,085.92

2、应收利息

单位：人民币元

项目	2007年1月4日
应收银行存款利息	75,318.24
应收清算备付金利息	3,680.74
应收权证保证金利息	87.22
应收债券利息	1,128,910.63
合计	1,207,996.83

3、待摊费用：截止2007年1月4日，待摊费用余额为0.00元。

4、未实现利得

单位：人民币元

项目	2007年1月1日至2007年1月4日止期间
2006年12月31日	143,553,621.66
投资估值增值	17,796,789.48
其中：股票估值增值	17,915,943.28
债券估值增值	-119,153.80
2007年1月4日	161,350,411.14

(a) 估值增值按投资类别分项列示如下：

单位：人民币元

项目	2007年1月4日		
	市值	成本	估值增值(a)
股票投资	436,980,951.74	596,800,252.00	159,819,300.26
债券投资	178,704,495.05	180,235,605.93	1,531,110.88
权证投资	0.00	0.00	0.00
合计	615,685,446.79	777,035,857.93	161,350,411.14

5、应付佣金

单位：人民币元

公司名称	2007年1月4日
招商证券股份有限公司	434,685.73
中信证券股份有限公司	75,423.94
广发华福证券有限责任公司	401,401.91
中山证券有限责任公司	179,236.50
国元证券有限责任公司	236,902.56
合计	1,327,650.64

6、其他应付款

单位：人民币元

项目	2007年1月4日
未代扣代缴个人所得税暂挂	278,633.39
应付券商席位保证金	250,000.00
合计	528,633.39

7、预提费用

单位：人民币元

项目	2007年1月4日
审计费用	50,547.96
信息披露费	2,958.92
上市年费	657.52
合计	54,164.40

8、实收基金

单位：人民币元

项目	2007年1月4日	
	基金份额(份)	实收基金
期初数	500,000,000	500,000,000.00
本期增加	0	0.00
本期减少	0	0.00
期末数	500,000,000	500,000,000.00

9、股票差价收入：基金同智于2007年1月1日至2007年1月4日止期间未发生股票交易，未产生股票差价收入。

10、债券差价收入：基金同智于2007年1月1日至2007年1月4日止期间未发生债券交易，未产生债券差价收入。

11、权证差价收入：基金同智于2007年1月1日至2007年1月4日止期间未发生权证交易，未产生权证差价收入。

12、其他收入：基金同智于2007年1月1日至2007年1月4日止期间未发生其他收入。

13、其他费用：

单位：人民币元

项 目	2007年1月1日至2007年1月4日止期间
上市年费	657.52
信息披露费	2,958.92
审计费用	547.96
合计	4,164.40

14、本期已分配基金净收益

基金同智于2007年1月1日至2007年1月4日止期间未进行收益分配。

15、基金同智于2007年1月1日至2007年1月4日止期间所投资的股票中，无因股权分置改革而获得由非流通股股东支付的现金对价。

(五) 报告期流通受限制不能自由转让的基金资产

1、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	停牌日期	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
双汇发展	2006-6-1	31.02	2007-6-29	57.88	700,000	8,452,045.04	21,714,000.00
合计						8,452,045.04	21,714,000.00

基金同智截止2007年1月4日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。

2、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	2007.04.10	网下
合计		3,505,260.80	3,505,260.80				

基金同智截止2007年1月4日持有以上因网上及网下申购且尚未上市而暂时流通受限。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10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。

3、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	47,350,000.00	2006.06.22	2006.06.23	2007.06.21
合计		24,000,000.00	47,350,000.00			

4、因新股处于锁定期不能流通的股票

基金作为一般法人或战略投资者认购的以下新股，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。截止2007年6月30日，因处于锁定期不能流通的新股均以估值日证券交易所提供的同一股票的收盘价估值，该日无交易的，以最近一个交易日市场平均价计算。

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	4,219,230.00	2006.07.26	2006.08.01	2007.02.01
广深铁路	1,211,740	4,556,142.40	8,918,406.40	2006.12.18	2006.12.22	2007.03.22
北辰实业	448,674	1,076,817.60	3,077,903.64	2006.09.28	2006.10.16	2007.01.16
平煤天安	207,497	1,693,175.52	2,413,190.11	2006.11.10	2006.11.23	2007.02.26
大唐发电	222,000	1,482,960.00	2,308,800.00	2006.12.12	2006.12.20	2007.03.20
众和股份	53,328	471,419.52	743,392.32	2006.09.20	2006.10.12	2007.01.12
江苏宏宝	102,417	397,377.96	713,846.49	2006.09.21	2006.10.12	2007.01.12
青岛软控	29,813	775,138.00	1,390,776.45	2006.09.28	2006.10.18	2007.01.18
东源电器	42,423	334,293.24	596,891.61	2006.09.27	2006.10.18	2007.01.18
雪莱特	32,558	223,347.88	600,695.10	2006.10.12	2006.10.25	2007.01.25
大港股份	109,709	581,457.70	941,303.22	2006.11.01	2006.11.16	2007.02.16
苏州固锔	53,560	342,248.40	545,776.40	2006.11.01	2006.11.16	2007.02.16
金螳螂	36,846	471,628.80	880,987.86	2006.11.06	2006.11.20	2007.02.26
栋梁新材	64,597	410,836.92	801,648.77	2006.11.07	2006.11.20	2007.02.26
鲁阳股份	38,917	428,087.00	1,044,532.28	2006.11.21	2006.11.30	2007.02.28
新海宜	47,619	412,380.54	636,189.84	2006.11.21	2006.11.30	2007.02.28
金智科技	27,174	385,870.80	593,208.42	2006.11.28	2006.12.08	2007.03.08
江苏国泰	82,965	663,720.00	992,261.40	2006.11.28	2006.12.08	2007.03.08
国脉科技	25,125	253,762.50	498,480.00	2006.12.06	2006.12.15	2007.03.15
青岛金王	55,377	425,849.13	654,556.14	2006.12.06	2006.12.15	2007.03.15
网盛科技	17,772	250,407.48	991,855.32	2006.12.06	2006.12.15	2007.03.15
广东鸿图	10,125	115,526.25	176,883.75	2006.12.20	2006.12.29	2007.03.29
合计		18,209,528.64	33,740,815.52			

(六) 其他重要事项：本基金无需要说明的其他重要事项。

第七章、长盛同智基金投资组合报告

(报告期末为 2007 年 6 月 30 日, 报告期间为 2007 年 1 月 5 日至 2007 年 6 月 30 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	9,178,687,796.99	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%
银行存款和清算备付金	723,333,669.23	7.17%
其他资产	181,205,630.55	1.80%
资产合计	10,083,227,096.77	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	311,350,833.13	3.14%
C 制造业	4,336,089,437.35	43.80%
C0 食品、饮料	225,158,907.95	2.27%
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	381,272,330.38	3.85%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	486,014,072.84	4.91%
C5 电子	1,534,912.48	0.02%
C6 金属、非金属	605,681,278.56	6.12%
C7 机械、设备、仪表	2,125,025,229.33	21.47%
C8 医药、生物制品	389,123,085.95	3.93%
C99 其他制造业	122,279,619.86	1.23%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	416,060,468.16	4.20%
E 建筑业	126,555,670.80	1.28%
F 交通运输、仓储业	658,852,281.39	6.66%
G 信息技术业	476,789,115.90	4.82%
H 批发和零售贸易	480,767,536.76	4.86%
I 金融、保险业	984,539,777.34	9.95%
J 房地产业	1,103,054,871.64	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、报告期末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	600835	上海机电	21,449,904	532,386,617.28	5.38%
2	000002	万科A	24,606,892	470,483,775.04	4.75%
3	000651	格力电器	12,555,057	438,171,489.30	4.43%
4	002024	苏宁电器	9,225,771	433,242,206.16	4.38%
5	600009	上海机场	10,108,576	384,226,973.76	3.88%
6	600031	三一重工	8,503,589	376,113,741.47	3.80%
7	601318	中国平安	5,251,095	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	310,736,798.63	3.14%
10	600036	招商银行	11,868,465	291,726,869.70	2.95%
11	600312	平高电气	11,887,539	270,917,013.81	2.74%
12	600011	华能国际	20,500,000	219,965,000.00	2.22%
13	000488	晨鸣纸业	23,000,000	200,560,000.00	2.03%
14	000006	深振业A	7,794,400	194,080,560.00	1.96%
15	600601	方正科技	16,000,000	194,080,000.00	1.96%
16	600900	长江电力	11,473,328	173,476,719.36	1.75%
17	600028	中国石化	12,832,974	169,651,916.28	1.71%
18	000612	焦作万方	6,043,078	162,981,813.66	1.65%
19	000910	大亚科技	12,179,054	157,962,330.38	1.60%
20	600521	华海药业	7,008,611	152,927,892.02	1.54%
21	600519	贵州茅台	1,247,958	149,355,613.44	1.51%
22	000039	中集集团	5,013,969	147,009,571.08	1.49%
23	600266	北京城建	4,465,620	126,555,670.80	1.28%
24	000619	海螺型材	10,432,977	124,048,096.53	1.25%
25	000088	盐田港	7,380,649	123,921,096.71	1.25%
26	600089	特变电工	3,984,925	122,536,443.75	1.24%
27	000422	湖北宜化	8,240,695	114,216,032.70	1.15%
28	000507	粤富华	9,716,540	112,323,202.40	1.13%
29	600585	海螺水泥	1,753,370	103,378,695.20	1.04%
30	000839	中信国安	3,513,165	98,368,620.00	0.99%
31	600005	武钢股份	9,292,810	93,485,668.60	0.94%
32	600660	福耀玻璃	3,029,245	92,452,557.40	0.93%
33	601111	中国国航	8,631,674	84,504,088.46	0.85%
34	600406	国电南瑞	2,791,028	84,149,494.20	0.85%
35	600463	空港股份	6,659,273	83,906,839.80	0.85%
36	000680	山推股份	5,293,061	83,524,502.58	0.84%
37	600350	山东高速	10,892,900	83,439,614.00	0.84%
38	600382	广东明珠	5,924,798	78,029,589.66	0.79%
39	600583	海油工程	2,143,589	77,597,921.80	0.78%
40	000550	江铃汽车	4,517,143	73,990,802.34	0.75%
41	600612	第一铅笔	4,062,291	72,146,288.16	0.73%
42	600849	上海医药	4,000,100	69,401,735.00	0.70%

43	000792	盐湖钾肥	1,489,048	66,083,950.24	0.67%
44	600527	江南高纤	4,243,942	61,452,280.16	0.62%
45	000983	西山煤电	2,158,345	60,930,079.35	0.62%
46	000069	华侨城A	1,429,991	56,913,641.80	0.57%
47	000528	柳工	2,224,130	54,491,185.00	0.55%
48	000063	中兴通讯	955,551	51,981,974.40	0.53%
49	002017	东信和平	4,791,601	49,353,490.30	0.50%
50	600309	烟台万华	901,824	48,301,693.44	0.49%
51	600100	同方股份	1,405,511	48,209,027.30	0.49%
52	000768	西飞国际	1,552,791	47,934,658.17	0.48%
53	600596	新安股份	1,104,133	47,687,504.27	0.48%
54	600535	天士力	2,625,483	45,998,462.16	0.46%
55	600085	同仁堂	1,128,936	43,430,167.92	0.44%
56	000402	金融街	1,327,420	38,495,180.00	0.39%
57	600276	恒瑞医药	819,000	37,051,560.00	0.37%
58	600428	中远航运	1,565,566	34,270,239.74	0.35%
59	600026	中海发展	1,389,464	31,929,882.72	0.32%
60	000685	公用科技	4,500,000	30,420,000.00	0.31%
61	000858	五粮液	810,060	25,484,487.60	0.26%
62	000538	云南白药	680,029	24,345,038.20	0.25%
63	600879	火箭股份	913,183	24,281,535.97	0.25%
64	600331	宏达股份	499,990	24,224,515.50	0.24%
65	002012	凯恩股份	3,500,000	22,750,000.00	0.23%
66	600795	国电电力	1,723,990	22,618,748.80	0.23%
67	000607	华立药业	4,200,000	20,958,000.00	0.21%
68	000729	燕京啤酒	1,478,563	19,590,959.75	0.20%
69	600600	青岛啤酒	722,864	18,714,948.96	0.19%
70	000759	武汉中百	1,254,491	17,061,077.60	0.17%
71	600723	西单商场	1,500,000	16,035,000.00	0.16%
72	000061	农产品	658,870	14,429,253.00	0.15%
73	000568	泸州老窖	285,342	12,012,898.20	0.12%
74	600161	天坛生物	299,975	9,632,197.25	0.10%
75	601328	交通银行	597,844	6,570,305.56	0.07%
76	000807	云铝股份	398,062	6,372,972.62	0.06%
77	002004	华邦制药	265,106	6,336,033.40	0.06%
78	002128	露天煤业	87,837	3,170,915.70	0.03%
79	600686	金龙汽车	71,900	1,689,650.00	0.02%
80	002129	中环股份	98,899	1,534,912.48	0.02%
81	601007	金陵饭店	106,196	1,531,346.32	0.02%
82	002130	沃尔核材	15,964	779,841.40	0.01%

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末基金资产净值 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）	占期末基金资产净值比例
1	600030	中信证券	695,589,558.03	7.03%
2	000002	万科A	524,999,165.14	5.30%
3	600519	贵州茅台	498,458,338.46	5.04%
4	000039	中集集团	480,775,057.57	4.86%
5	600036	招商银行	460,743,706.18	4.65%
6	600900	长江电力	438,119,526.39	4.43%
7	600028	中国石化	419,384,530.30	4.24%
8	600031	三一重工	390,851,572.93	3.95%
9	600019	宝钢股份	369,849,847.40	3.74%
10	600009	上海机场	360,996,472.85	3.65%
11	601318	中国平安	354,592,647.02	3.58%
12	002024	苏宁电器	337,802,224.95	3.41%
13	600011	华能国际	329,270,762.58	3.33%
14	600835	上海机电	314,143,627.85	3.17%
15	000488	晨鸣纸业	274,985,714.85	2.78%
16	000063	中兴通讯	273,325,835.28	2.76%
17	600642	申能股份	256,056,755.17	2.59%
18	000024	招商地产	254,241,926.51	2.57%
19	601006	大秦铁路	242,824,907.79	2.45%
20	600312	平高电气	235,072,953.41	2.37%
21	600016	民生银行	215,011,691.04	2.17%
22	600717	天津港	205,593,403.22	2.08%

(二) 报告期内累计卖出价值超出期末基金资产净值 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）	占期末基金资产净值比例
1	600030	中信证券	632,467,598.23	6.39%
2	600519	贵州茅台	430,256,799.28	4.35%
3	000039	中集集团	415,607,751.14	4.20%
4	600642	申能股份	392,852,183.62	3.97%
5	600019	宝钢股份	376,866,275.93	3.81%
6	600717	天津港	336,757,341.01	3.40%
7	000002	万科A	335,556,710.29	3.39%
8	601006	大秦铁路	333,542,506.78	3.37%
9	600177	雅戈尔	330,262,279.96	3.34%
10	600900	长江电力	313,821,348.15	3.17%
11	600031	三一重工	310,685,254.21	3.14%
12	600028	中国石化	268,395,691.98	2.71%
13	600036	招商银行	263,874,977.57	2.67%
14	000825	太钢不锈	239,728,512.32	2.42%
15	000063	中兴通讯	233,309,193.32	2.36%
16	600111	稀土高科	231,683,041.79	2.34%
17	600016	民生银行	216,853,431.81	2.19%
18	000768	西飞国际	205,577,794.82	2.08%

19	600050	中国联通	196,725,976.86	1.99%
20	601318	中国平安	180,128,439.58	1.82%

(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	15,373,620,480.05
卖出股票收入总额	10,929,184,672.95

五、报告期末按券种分类的债券投资组合

本报告期末，长盛同智基金未持有债券。

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

本报告期末，长盛同智基金未持有债券。

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

本报告期末，长盛同智基金未持有资产支持证券。

八、报告期末本基金投资权证证明细

(一) 报告期末持有权证证明细

本报告期末，长盛同智基金未持有权证。

(二) 报告期内获得权证证明细

获取方式	权证名称	权证代码	数量 (份)	成本总额 (人民币元)
被动持有	武钢 CWB1	580013	1,069,328	2,477,846.84
	南航 JTP1	580989	1,651,839	0.00

九、投资组合报告附注

(一) 报告期内长盛同智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) 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	5,543,882.83
应收申购款	8,584,323.98
应收利息	208,741.25
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

(四) 报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末，长盛同智基金未持有可转换债券。

(五) 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 2007 年 1 月 4 日持有份额	48,306,367.00	9.66%
本报告期增持份额	43,970,001.00	
截止 2007 年 6 月 30 日持有份额	92,276,368.00	1.31%

第八章 基金同智投资组合报告

（报告期末为 2007 年 1 月 4 日，报告期间为 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 1 月 4 日）

一、报告期末基金资产组合情况

资产项目	金额（人民币元）	占总资产比例
股票市值	596,800,252.00	61.86%
债券市值	180,235,605.93	18.68%
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	186,153,130.40	19.29%
其他资产	1,597,778.58	0.17%
资产合计	964,786,766.91	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	4,391,477.81	0.55%
C 制造业	315,231,867.30	39.77%
C0 食品、饮料	21,714,000.00	2.74%
C1 纺织、服装、皮毛	743,392.32	0.09%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	47,227,205.30	5.96%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00%
C5 电子	1,146,471.50	0.15%
C6 金属、非金属	61,181,645.16	7.72%
C7 机械、设备、仪表	182,564,596.88	23.03%
C8 医药、生物制品	0.00	0.00%
C99 其他制造业	654,556.14	0.08%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	2,308,800.00	0.29%
E 建筑业	880,987.86	0.11%
F 交通运输、仓储业	13,137,636.40	1.66%
G 信息技术业	2,719,733.58	0.34%
H 批发和零售贸易	83,977,397.90	10.59%
I 金融、保险业	28,735,260.80	3.63%
J 房地产业	144,475,787.13	18.23%
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	941,303.22	0.12%
合计	596,800,252.00	75.29%

三、报告期末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	002024	苏宁电器	1,752,590	82,985,136.50	10.47%
2	600748	上实发展	5,875,879	70,980,618.32	8.95%
3	000651	格力电器	5,535,112	67,971,175.36	8.58%
4	600067	冠城大通	7,071,739	53,320,912.06	6.73%
5	000910	大亚科技	6,460,630	47,227,205.30	5.96%
6	002073	青岛软控	884,454	41,259,779.10	5.21%
7	600675	中华企业	3,014,500	32,858,050.00	4.15%
8	600036	招商银行	1,500,000	25,230,000.00	3.18%
9	000006	深振业A	1,809,127	24,803,131.17	3.13%
10	600019	宝钢股份	2,600,000	24,232,000.00	3.06%
11	600808	马钢股份	4,700,000	22,889,000.00	2.89%
12	000895	双汇发展	700,000	21,714,000.00	2.74%
13	600104	上海汽车	2,250,000	19,147,500.00	2.42%
14	600064	南京高科	1,414,200	12,756,084.00	1.61%
15	000039	中集集团	588,431	11,191,957.62	1.41%
16	601333	广深铁路	1,211,740	8,918,406.40	1.13%
17	601006	大秦铁路	496,380	4,219,230.00	0.53%
18	601628	中国人寿	185,660	3,505,260.80	0.44%
19	601588	北辰实业	448,674	3,077,903.64	0.39%
20	601666	平煤天安	207,497	2,413,190.11	0.30%
21	601991	大唐发电	222,000	2,308,800.00	0.29%
22	601699	潞安环能	119,534	1,978,287.70	0.25%
23	002088	鲁阳股份	50,417	1,353,192.28	0.17%
24	002091	江苏国泰	82,965	992,261.40	0.13%
25	002095	网盛科技	17,772	991,855.32	0.13%
26	002077	大港股份	109,709	941,303.22	0.12%
27	002081	金螳螂	36,846	880,987.86	0.11%
28	002082	栋梁新材	64,597	801,648.77	0.10%
29	002070	众和股份	53,328	743,392.32	0.09%
30	002071	江苏宏宝	102,417	713,846.49	0.09%
31	002074	东源电器	48,923	688,346.61	0.09%
32	002094	青岛金王	55,377	654,556.14	0.08%
33	002089	新海宜	47,619	636,189.84	0.08%
34	002076	雪莱特	32,558	600,695.10	0.08%
35	002090	金智科技	27,174	593,208.42	0.07%
36	002079	苏州固锔	53,560	545,776.40	0.07%
37	002093	国脉科技	25,125	498,480.00	0.06%
38	002101	广东鸿图	10,125	176,883.75	0.02%

四、报告期内股票投资组合重大变动

基金同智于本报告期内，未发生股票交易。

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	123,002,192.38	15.52%
金 融 债	57,233,413.55	7.22%
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	180,235,605.93	22.74%

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 10	53,990,305.00	6.81%
2	06 进出 04	47,362,164.42	5.98%
3	02 国债 14	29,174,261.00	3.68%
4	21 国债 15	27,170,100.00	3.43%
5	99 国债 05	10,343,520.98	1.30%

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）报告期内获得权证情况

1、报告期末持有权证证明细

基金同智于本报告期末未持有权证。

2、报告期内获得权证证明细

基金同智于本报告期内未获得权证。

（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
应收利息	1,207,996.83
合 计	1,597,778.58

（五）报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

基金同智于本报告期末未持有可转换债券。

（六）报告期末基金持有的资产支持证券明细

基金同智于本报告期末未持有资产支持证券。

（七）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 2006 年 12 月 31 日持有份额	48,306,367	9.66%
本报告期增持份额	0	0.00%
截止 2007 年 1 月 4 日持有份额	48,306,367	9.66%

第九章 基金份额持有人户数和持有人结构

一、长盛同智基金

截至 2007 年 6 月 30 日，长盛同智基金持有人情况如下：

(一) 基金份额持有人户数

报告期末基金份额持有人户数（户）	274,794
报告期末平均每户持有的基金份额（份）	25,593.24

(二) 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：	7,032,868,202.89	100.00%
其中：机构投资者持有的基金份额	303,497,687.19	4.32%
个人投资者持有的基金份额	6,729,370,515.7	95.68%

(三) 报告期期末本基金前十名基金份额持有人明细（上市交易部分）

序号	基金份额持有人名称	持有份额（份）	占上市交易份额比例	占总份额比例
1	长盛基金管理有限公司	92,276,368	17.01%	1.31%
2	中国人寿保险股份有限公司	36,082,919	6.65%	0.51%
3	CITIGROUP GLOBAL MARKETS LIMITED	32,279,645	5.95%	0.46%
4	中国太平洋保险（集团）股份有限公司	11,673,928	2.15%	0.17%
5	中国再保险（集团）公司	10,619,652	1.96%	0.15%
6	中粮集团有限公司	6,380,400	1.18%	0.09%
7	中国人寿再保险股份有限公司	6,009,450	1.11%	0.09%
8	国信—中行—国信“金理财”经典组合基金集合资产管理计划	5,303,230	0.98%	0.08%
9	荷兰银行有限公司	4,008,926	0.74%	0.06%
10	天安保险股份有限公司	3,820,464	0.70%	0.05%

(四) 报告期末公司员工持有本基金情况

持有基金份额总额	占该基金总份额的比例
0.00	0.00%

二、基金同智

截至 2007 年 1 月 4 日，基金同智持有人情况如下：

(一) 基金份额持有人户数

报告期末基金份额持有人户数（户）	21,861
报告期末平均每户持有的基金份额（份）	22,871.78

(二) 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	311,494,319	62.30%
个人投资者持有的基金份额	188,505,681	37.70%

(三) 报告期期末本基金前十名基金份额持有人明细

序号	基金份额持有人名称	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	新华人寿保险股份有限公司	11,391,462	2.28%
8	宝钢集团有限公司	10,179,946	2.04%
9	招商证券-招行-招商证券基金宝集合资产管理计划	9,517,472	1.90%
10	王荣	9,306,413	1.86%

(四) 报告期末公司员工持有本基金情况

持有基金份额总额	占该基金总份额的比例
0.00	0.00%

第十章 开放式基金份额变动情况

本基金份额变动情况如下:

单位: 份

基金合同生效日(2007年1月5日)基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期间基金总申购份额	14,198,073,264.50
本报告期期间基金总赎回份额	7,665,205,061.61
本报告期期末基金份额总额	7,032,868,202.89

第十一章 重大事件揭示

一、本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

二、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) 本报告期内本基金管理人的高级管理人员未发生重大人事变动。

(二) 基金经理的变更

因工作需要，根据公司第三届董事会第十四次会议决议，公司决定聘任丁骏先生为长盛同智优势成长基金基金经理，与长盛同智优势成长基金现任基金经理肖强先生共同担任该基金基金经理。田荣华先生不再担任长盛同智优势成长基金基金经理职务。公告刊登于 2007 年 3 月 1 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

(三) 本报告期内本基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

三、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。

四、本基金报告期内投资策略不曾改变。

五、基金收益分配事项

根据公司发布的《关于原同智证券投资基金基金份额转换的公告》，2007 年 1 月 23 日，原同智证券投资基金的基金财产以 1: 1.9102 的比例转换为长盛同智优势混合型证券投资基金。转换后，基金份额净值由原来的 1.9102 元变为 1.00 元。公告刊登于 2007 年 1 月 19 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

六、本基金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 7 年。

七、基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形。

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，我司按照选择证券经营机构的标准，经认真研究后，截止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	英大证券有限责任公司	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
8	北京高华证券有限责任公司	1		1
9	东北证券有限责任公司	1		1
10	国泰君安证券股份有限公司	1		1
11	申银万国证券股份有限公司	1		1
12	广发证券股份有限公司	1		1
13	中信建投证券有限责任公司	1		1
	合计	11	2	13

(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、投资管理部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) 2007年1-6月各券商股票交易量及佣金情况

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
招商证券股份有限公司	4,391,195,120.94	16.80%	3,436,139.75	16.26%
长江证券有限责任公司	1,666,360,370.54	6.38%	1,366,410.36	6.47%
中信证券股份有限公司	3,558,242,957.40	13.61%	2,784,341.56	13.17%
广东华福证券有限责任公司	2,697,516,211.37	10.32%	2,210,831.94	10.46%
国元证券有限责任公司	7,919,347,957.68	30.30%	6,493,842.27	30.73%
东北证券有限责任公司	1,179,859,752.22	4.51%	967,485.05	4.58%
北京高华证券有限责任公司	3,610,215,036.07	13.81%	2,960,369.22	14.01%
广发证券股份有限公司	1,024,662,468.15	3.92%	840,221.27	3.98%
中信建投证券有限责任公司	91,493,397.60	0.35%	75,024.63	0.35%
合计	26,138,893,271.97	100.00%	21,134,666.05	100.00%

(五) 2007年1-6月各券商债券、权证交易量情况

公司名称	债券交易量 (人民币元)	占交易量比 例	权证交易量 (人民币元)	占交易量比 例
广东华福证券有限责任公司	112,369,191.40	92.37%	0.00	0.00%
东北证券有限责任公司	9,281,101.50	7.63%	5,622,537.76	64.40%
北京高华证券有限责任公司	0.00	0.00%	3,108,236.58	35.60%
合计	121,650,292.90	100.00%	8,730,774.34	100.00%

(六) 2007年1-6月各券商回购交易量情况

报告期内本基金未通过专用交易席位，发生交易所市场回购业务。

(七) 报告期内租用证券公司席位的变更情况

新增租用

序号	证券公司名称	席位所属市场	数量
1	北京高华证券有限责任公司	上海	1
2	东北证券有限责任公司	上海	1
3	国泰君安证券股份有限公司	上海	1
4	申银万国证券股份有限公司	上海	1
5	广发证券股份有限公司	上海	1
6	中信建投证券有限责任公司	上海	1

九、其他在报告期内发生的重大事件

(一) 2007年1月5日，本公司发布关于本基金招募说明书的公告。公告刊登于《中国证券报》、《证券时报》及本公司网站。

(二) 2007 年 1 月 5 日, 本公司发布关于本基金基金合同的公告。公告刊登于《中国证券报》、《证券时报》及本公司网站。

(三) 2007 年 1 月 5 日, 本公司发布关于本基金托管协议的公告。公告刊登于《中国证券报》、《证券时报》及本公司网站。

(四) 基金管理人股权变更情况

根据公司 2006 年第 2 次临时股东会与 2007 年第 1 次临时股东会会议决议, 进行股权变更及相应的章程修改。变更后的股东及持股比例分别为: 国元证券有限责任公司占注册资本的 41%; 新加坡星展资产管理有限公司占注册资本的 33%; 安徽省创新投资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%。公告刊登于 2007 年 4 月 19 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

(五) 本基金增加代销机构

1. 自 2007 年 1 月 9 日起, 兴业银行股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、东北证券有限责任公司、德邦证券有限责任公司、渤海证券有限责任公司、中国银河证券有限责任公司代理长盛同智优势成长混合型证券投资基金 (LOF) (基金代码为: 160805) 的销售业务。公告刊登于 2007 年 1 月 9 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

2. 自 2007 年 1 月 10 日起, 国泰君安证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司代理长盛同智优势成长混合型证券投资基金 (LOF) (基金代码为: 160805) 的销售业务。公告刊登于 2007 年 1 月 10 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

3. 自 2007 年 1 月 12 日起, 光大证券股份有限公司代理长盛同智优势成长混合型证券投资基金 (LOF) (基金代码为: 160805) 的销售业务。公告刊登于 2007 年 1 月 12 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

4. 自 2007 年 1 月 16 日起, 国联证券有限责任公司、联合证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司代理长盛同智优势成长混合型证券投资基金 (LOF) (基金代码为: 160805) 的销售业务。公告刊登于 2007 年 1 月 16 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

(六) 2007 年 1 月 5 日, 本公司发布关于本基金集中申购期基金份额发售的公告。公告刊登于《中国证券报》、《证券时报》及本公司网站。

(七) 2007 年 1 月 8 日, 本公司发布关于本基金网上交易费率优惠的公告。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) 2007 年 1 月 19 日, 本公司发布关于原同智证券投资基金基金份额转换的公告。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) 2007 年 1 月 24 日, 本公司发布关于本基金提前结束集中申购期的公告。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) 2007 年 1 月 24 日, 本公司发布关于原同智证券投资基金基金份额转换结果的公告。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) 2007 年 1 月 25 日, 本公司发布关于本基金集中申购结果的公告。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) 2007 年 2 月 13 日, 本公司发布关于本基金开放申购、赎回的公告。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。

(十三) 2007 年 2 月 13 日, 本公司发布关于本基金上市交易的公告。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。

(十四) 2007 年 4 月 24 日, 本公司发布关于通过中国银行股份有限公司开办本基金定期定额投资业务的公告。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。

(十五) 2007 年 4 月 30 日, 本公司发布关于本基金投资杭萧钢构股票情况的公告。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。

第十二章 备查文件

一、备查文件目录

(一) 中国证券监督管理委员会关于同意赣中基金等原有投资基金合并规范为同智证券投资基金并申请上市的批复

(二) 中国证券监督管理委员会关于同意同智证券投资基金上市、扩募和续期的批复

(三) 同智证券投资基金基金合同

(四) 同智证券投资基金托管协议

(五) 中国证券监督管理委员会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

(六) 长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金合同

(七) 长盛同智优势成长混合型证券投资基金托管协议

(八) 报告期内披露的各项公告原件

(九) 长盛基金管理有限公司营业执照和公司章程

二、存放地点和查阅方式

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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。客户服务中心电话：400-888-2666，010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

二〇〇七年八月二十五日