

# 长盛同德主题增长股票型证券投资基金

## (原同德证券投资基金转型) 2007年第4季度报告

### 一、重要提示

本基金管理人长盛基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于2008年1月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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10月1日起至2007年12月31日止（注：2007年10月1日起至2007年10月24日止为转型前的同德证券投资基金）。本报告中的财务资料未经审计。

2007年9月13日，本公司就同德证券投资基金转型事宜召开了基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于同德基金证券投资基金转型有关事宜的议案》，对基金同德实施转型；为实施基金同德转型方案，同意授权基金管理人办理本次基金同德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《同德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。

2007年10月19日，本公司发布关于同德证券投资基金于2007年10月25日终止上市的公告。自同德证券投资基金终止上市之日起，基金名称变更为长盛同德主题增长股票型证券投资基金，由《同德证券投资基金基金合同》修订而成的《长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金合同》生效，基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金合同》为准；自同德证券投资基金终止上市之日起，基金同德转型成为

契约开放式基金。2007年10月26日至2007年11月16日为长盛同德主题增长股票型证券投资基金集中申购期，在集中申购期间，投资者可通过直销机构和发售代理机构集中申购。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。

## 二、基金产品概况

1、基金简称：长盛同德

2、基金代码：519039

3、基金运作方式：契约型开放式

4、基金合同生效日：2007年10月25日

5、报告期末基金份额总额：12,174,200,885.26份

6、投资目标：本基金为股票型证券投资基金，投资目标是在确定促进中国经济持续增长的主题背景下，挖掘中国经济持续增长的动力之所在，选取具有高成长性和具备持续增长潜力的上市公司，分享中国经济高速增长成果；在严格控制投资风险的前提下，努力保持基金资产的稳定增值。

7、投资策略：

本基金的投资策略主要体现在资产配置、股票配置和债券配置及权证配置等层面上。

### (1) 资产配置策略

目前我国经济发展正处于新世纪、新阶段，企业之所以能够高增长与中国经济持续稳定增长分不开。而中国经济之所以能够持续高速增长，主要与全球化、城镇化、消费升级、制度变革四大主题密不可分。因此，沿着上述四大主题进行大类资产配置，能够有效地提高资金的使用效率，从而实现基金资产的持续增值。

### (2) 股票配置策略

在行业配置方面，本基金紧紧围绕促进宏观实体经济持续增长的全球化、城镇化、消费升级、制度变革四大主题对行业基本面和未来发展趋势分析判断，确定主题受益行业，结合行业景气变化趋势优化行业配置比例；在个股选择上，在选定的主题受益行业内，根据企业获利能力、增长能力、资产回报率、资产管理能力等定量指标，并结合公司治理结构状况等定性指标对行业内上市公司进行综合评价，动态的寻找行业与个股的最佳结合点。

在个股选择方面，本基金根据企业主营收入增长、主营利润增长、资产回报率、管理水平等定量指标和管理能力定性指标综合进行选择。具体来说，本基金通过以下步骤进行股票选择：

第一步，定量指标筛选股票

构建基础股票池

①主营收入增长率

过去三年或未来两年的主营业务收入的增长率超过 GDP 增速

②主营利润增长率

过去三年或未来两年税后盈余复合增长率超过 GDP 增速

③资产回报率

过去三年或未来两年 ROE 持续增长或高于行业平均水平

④管理水平

存货周转率、应收账款周转率以及固定资产周转率任意两项过去三年和未来两年符合行业特征。

满足上述四项指标中之三项，即认为符合条件，通过筛选构建基础股票库。

构建核心股票池

①主营收入增长率

过去三年或未来两年的主营业务收入的增长率超过 GDP 增速 1.5 倍

②主营利润增长率

过去三年或未来两年税后盈余复合增长率超过 GDP 增速 1.5 倍

③资产回报率

过去三年或未来两年 ROE 高于行业平均水平

④管理水平

存货周转率、应收账款周转率以及固定资产周转率任意两项过去三年或未来两年超过行业平均水平。

满足上述四项指标中之三项，即认为符合条件，通过筛选构建核心股票库。

第二步，定性指标精选个股

运用以下两个定性指标对核心股票池中的个股的管理能力和公司治理结构进行考核，从中精选经营管理效率高、公司治理结构完善的公司作为投资目标。

①管理能力

综合评定存货周转率、应收账款周转率以及固定资产周转率任意两项过去三年或未来两年至少要符合行业特征；

#### ②公司治理结构

无不良过往记录，控股股东没有损害上市公司利益的行为；

外部董事在董事会的占比较高；

股东大会、董事会、监事会、管理层的责、权、利明晰。

#### (3)债券配置策略

债券组合的构建主要通过对 GDP 增长速度、财政政策和货币政策的变化、通货膨胀的变动趋势分析，判断未来利率走势，确定债券投资组合的久期，并通过利率曲线、期限结构、债券类别的配置等积极的投资策略提高债券组合的收益水平，同时适当利用由于银行间市场和交易所市场的分割而形成的无风险套利机会进行套利。在单个债券品种的选择上严格控制信用风险，以流动性、安全性为原则，选择优质债券。

#### (4)权证配置策略

权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。主要考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素，估计权证合理价值。根据权证合理价值与其市场价格间的差幅即“估值差价(Value Price)”以及权证合理价值对定价参数的敏感性，结合标的股票合理价值考量，决策买入、持有或沽出权证。

#### 8、业绩比较基准：

本基金的业绩比较基准为=沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%

本基金为股票型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用上证国债指数。

#### 9、风险收益特征：

本基金为股票型基金。风险高于混合型基金、债券基金，属于较高风险、较高回报的基金产品。

10、基金管理人：长盛基金管理有限公司

11、基金托管人：中国农业银行

### 三、主要财务指标和基金净值表现

#### (一) 主要财务指标

##### 1、长盛同德主要财务指标（2007年10月25日至2007年12月31日）

序号	指标名称	金额（人民币元）
1	本期利润	957,659,646.52
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	89,448,265.75
3	加权平均基金份额本期利润（元/份）	0.1289
4	期末基金资产净值	13,239,525,530.39
5	期末基金份额净值（元/份）	1.0875

注：（1）上述基金业绩不包括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。

（2）所列数据截止到2007年12月31日。

##### 2、基金同德主要财务指标（2007年10月1日至2007年10月24日）

序号	指标名称	金额（人民币元）
1	本期利润	-19,216,287.57
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	22,615,205.77
3	加权平均基金份额本期利润（元/份）	-0.0384
4	期末基金资产净值	1,535,765,204.80
5	期末基金份额净值（元/份）	3.0715

注：（1）上述基金业绩不包括持有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。

（2）所列数据截止到2007年10月24日。

#### (二) 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、长盛同德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

（2007年10月25日至2007年12月31日）

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
2007年10月25日至 2007年12月31日	1.46%	0.0130	-3.22%	0.0167	4.68%	-0.0037

##### 2、基金同德基金份额净值增长率（2007年10月1日至2007年10月24日）

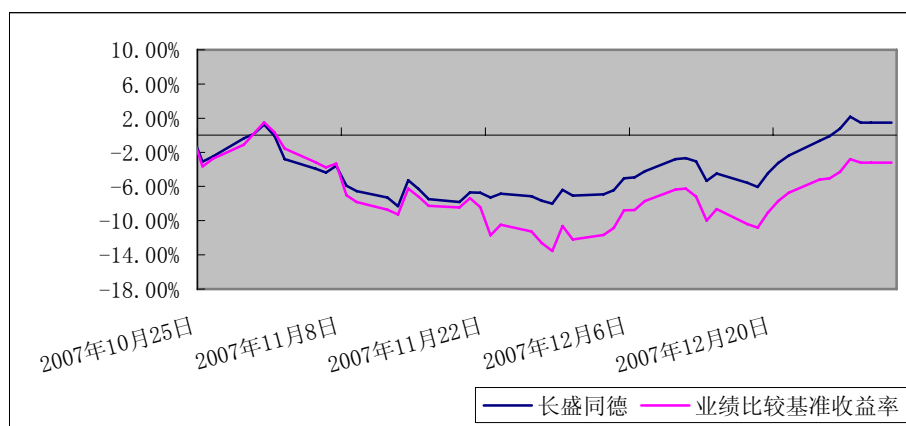
阶段	净值增长率	净值增长率标准差
2007年10月1日至2007年10月24日	-1.24%	0.0197

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。

(三) 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

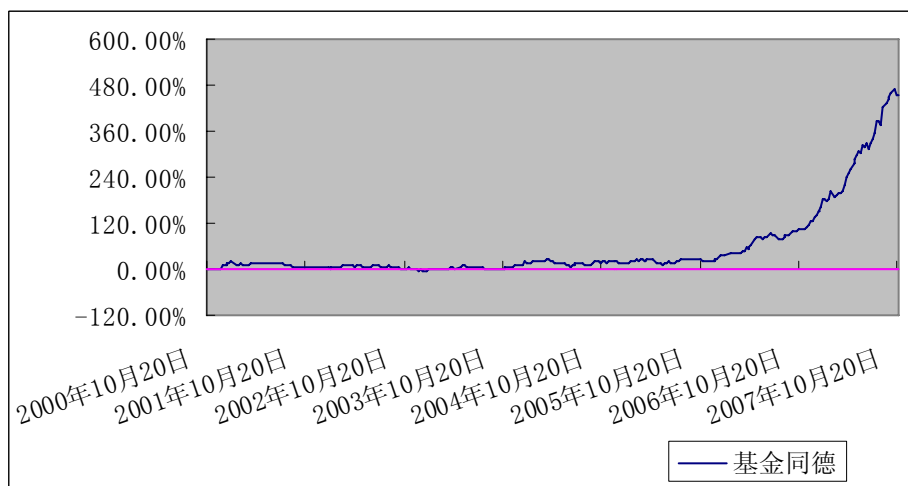
1、长盛同德累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2007年10月25日至2007年12月31日)



2、基金同德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10月20日至2007年10月24日)



注：(1) 长盛同德基金合同于2007年10月25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六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下, 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素

致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日进行调整。

(3) 本基金基金合同中对投资组合的各项比例规定如下：

A、本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

B、本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家发行的证券，不超过该证券的 10%；

C、进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

D、本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不超过本基金的总资产，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；

E、本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；

F、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

G、基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%；

H、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%；

I、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，不得超过该基金资产净值的 10%；

J、基金管理人管理的全部证券投资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%；

K、本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%；

L、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

M、本基金买卖基金管理人、基金托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商的证券，以及非控股股东在承销期内承销的证券，必须报监察稽核部、投资决策委员会和风险控制委员会备案，并按规定履行信息披露义务；

N、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

#### 四、管理人报告

##### (一) 基金经理小组成员简介

詹凌蔚先生，1974年9月出生。厦门大学经济学硕士。历任融通新蓝筹基金经理、融通基金管理有限公司总经理助理、投资管理部总监、博时基金管理有限公司博时主题行业基金经理。2007年3月加入长盛基金管理有限公司，现任长盛基金管理有限公司投资管理部总监和研究发展部总监。自2007年10月25日起任长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理。

侯继雄先生，1974年5月出生，中共党员。清华大学博士。2001年4月至2007年2月在国泰君安证券研究所任研究员、策略部经理。2007年2月加入长盛基金管理有限公司，现任研究发展部副总监。自2007年10月25日起任长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理。

邓永明先生，1971年7月出生。毕业于山西农业大学，获学士学位。1999年4月到2005年7月就职于大成基金管理有限公司，曾任职研究员、交易员和基金经理助理。2005年7月底加入长盛基金管理有限公司投资管理部，曾任基金同益基金经理助理，同德证券投资基金基金经理。自2007年10月25日起任长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理。

##### (二) 报告期内本基金运作的遵规守信情况说明

本基金管理人在报告期内，严格按照《基金法》、《同德证券投资基金基金合同》和《长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，管理和运用基金资产。投资活动中力求勤勉尽责，努力为提高基金收益工作。基金同德投资组合符合有关法规及基金合同的约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

##### (三) 报告期内的业绩表现和投资策略

###### 1、行情回顾及运作分析

4季度，通货膨胀加剧，11月份CPI高达6.90%，食品价格不断攀升，房地产价格也出现加速上涨的趋势，经济增长正由偏快向过热转变，这些现象引起中央的高度重视。从一系列的紧缩政策上我们感觉到，未来调控的力度必将加大。党的十七大报告中指出，要促进经济又好又快地发展，表明要素价格的改革必将推进。12月份中央经济工作会议明确提出要实现稳健的财政政策和从紧的货币政策，验证了我们当时的判断。从国际环境来看，受次级抵押贷款的影响，美国



经济有衰退的迹象，进而将导致全球经济增长放缓，对于不断增长的中美贸易，美国经济的恶化，势必对中国出口造成不利的影响。

适逢本基金 10 月份“封转开”完成，11 月份开始建仓，我们预期未来加息和提高存款准备金率以及人民币升值加快等宏观调控政策将对相关行业造成负面影响，GDP 增速将在调控中回落。同时，我们认为，政府希望通过内需的增长来缓解调控的压力，使经济增长平稳“软着陆”。考虑到这些因素，在操作上我们对金融、地产配置就较为谨慎，积极增加医药、商业零售、通信等消费类板块，对于成本能够很好消化并能向下游转移的先进制造业以及产品价格不断上涨的能源、化工，我们也进行了积极的配置。

## 2、本基金业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0875 元，本报告期份额净值增长率为 1.46%，业绩比较基准收益率为-3.22%，同期上证 A 股增长率为-5.24%。

## 3、市场展望和投资策略

展望 2008 年，我们认为，贸易顺差和通货膨胀是政府而急需妥善解决的两大问题，因此，宏观调控仍将持续，汇率的波动幅度将扩大，人民币加速升值和结构性加息将成为调控的重要手段。预期未来经济增长的速度将放缓，企业效益增速将回落，整体估值空间受到压制，投资的难度加大，预计 2008 年证券市场机遇与挑战并存。从充裕的资金与经济增长高位运行来看，市场下行的空间有限；从行业景气运行和政策扶持的状况看，2008 年市场将呈分化格局，结构性投资机会仍然存在，个股的研究与选择将更加重要，企业高成长成为投资中非常重要的一个参考指标。

我们希望回避受调控影响较大的行业以及出口导向型企业，关注有定价能力的资源型企业以及成本可以向下游转移的优秀企业，对于能够持续稳定增长的消费类行业、自主创新、科技创新、节能环保、先进制造业等行业则给予重点关注。操作上，把握市场运行节奏，以估值为基础，寻找较好的变化点位。

## 五、投资组合报告

### (一) 长盛同德基金投资组合报告 (截止 2007 年 12 月 31 日)

#### 1、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%

#### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	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%

### 3、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）	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%

### 4、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%

### 5、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%

注：本报告期末仅持有上述四支债券。

### 6、投资组合报告附注

（1）报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

（2）基金投资的前十名股票，均为投资于基金合同规定备选股票库之内股票。

(3) 报告期末其他资产构成

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
应收申购款	64,765,681.89
合 计	68,009,470.55

(4) 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。

(5) 报告期末本基金投资权证证明细

①报告期末持有权证证明细

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

②报告期内获得权证证明细

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

(6) 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。

(二) 基金同德投资组合报告 (截止 2007 年 10 月 24 日)

1、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%

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	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%

3、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）	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%

4、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	125,984,280.00	8.20%
金 融 债	34,702,500.00	2.26%
央行票据	58,063,000.00	3.78%
企 业 债	0.00	0.00%
可 转 债	0.00	0.00%
合 计	218,749,780.00	14.24%

5、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	07央票53	48,345,000.00	3.15%
2	20国债10	48,031,000.00	3.13%
3	20国债04	38,444,640.00	2.50%
4	06进出01	34,702,500.00	2.26%
5	99国债08	27,268,640.00	1.78%

6、投资组合报告附注

(1) 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(2) 基金投资的前十名股票，均为投资于基金合同规定备选股票库之内股票。

(3) 报告期末其他资产构成

其他资产项目	金额（人民币元）
存出保证金	910,000.00
应收利息	3,551,255.76
其他应收款	30,602.32
合 计	4,491,858.08

(4) 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。

(5) 报告期末本基金投资权证证明细

①报告期末持有权证证明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	市值(人民币元)	市值占基金净资产比例	获得方式
1	030002	五粮 YGC1	300,000	13,158,000.00	0.86%	主动持有
合计				13,158,000.00	0.86%	主动持有

②报告期内获得权证证明细

获取方式	权证代码	权证名称	数量(份)	成本总额(人民币元)
主动持有	030002	五粮 YGC1	200,000	10,052,648.00

(6) 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。

六、开放式基金份额变动

单位：份

本报告期初基金份额总额	500,000,000.00
本报告期间基金总申购份额	12,018,133,765.99
本报告期间基金总赎回份额	343,932,880.73
本报告期末基金份额总额	12,174,200,885.26

## 七、基金管理人持有的本基金份额变动

单位：份

本报告期初基金管理人持有的本基金份额	36,906,448.00
本报告期间基金管理人持有的本基金份额增加	68,849,343.00
本报告期间基金管理人持有的本基金份额减少	0.00
本报告期末基金管理人持有的本基金份额	105,755,791.00

## 八、备查文件

### (一) 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会关于核准同德证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复
- 2、长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金合同
- 3、长盛德主题增长股票型证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告原件
- 5、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。本季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。并将季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

二〇〇八年一月二十二日