

同智证券投资基金

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智证券投资基金（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.....	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.....	27
第八章 重大事件揭示.....	28
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：同智证券投资基金

基金简称：基金同智

交易代码：184702

基金运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：1992年3月13日

2005年6月30日基金份额总额：5亿份

基金合同存续期：1992年3月13日至2007年3月12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：2000年5月15日

二、投资策略

（一）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；

（二）股票投资策略

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。

(三) 业绩比较基准：无

(四) 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 13C

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

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

联系电话：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)	-8,161,205.40
基金份额本期净收益(元/份)	-0.0163
期末可供分配基金收益(元)	-5,673,455.49
期末可供分配基金份额收益(元/份)	-0.0113
期末基金资产净值(元)	523,181,990.02
期末基金份额净值(元/份)	1.0464
基金加权平均净值收益率	-1.51%
本期基金份额净值增长率	0.04%
基金份额累计净值增长率	22.04%

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。

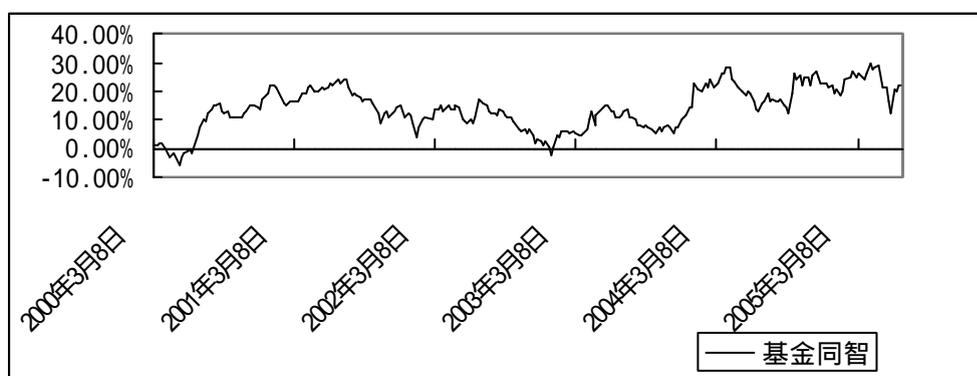
二、基金净值表现

(一)基金同智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	4.06%	0.0459
过去三个月	-1.08%	0.0350
过去六个月	0.04%	0.0280
过去一年	7.25%	0.0248
过去三年	3.98%	0.0203
自基金成立起至今	22.04%	0.0189

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

闵昱，男，1976年出生，获经济学硕士学位，并取得全国银行间市场交易从业资格及证券、基金从业资格。1999年加入长盛基金管理有限公司，先后担任基金同智基金经理助理、基金同德基金经理助理、基金同智基金经理、基金同益基金经理。现任本基金基金经理。

二、合规情况说明

本基金管理人在报告期内，在基金运作中遵规守信，严格遵守《基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

三、本基金业绩表现

2005年上半年的净值增长率为0.04%，在封闭式基金中位于前列，同期的上证综合指数跌幅为-14.65%，本基金净值表现超越同期的上证综合指数的表现与同业平均水平。

四、上半年行情回顾和投资工作总结

2005年上半年市场的行情呈单边下行的走势，虽然出台了解决股权分置、全力救助券商、降低资金成本、吸引多方资金入市等密集利好政策，但在6月初市场依然跌穿千点，创出了8年以来的新低。整体上看上半年市场的下跌可以分为三个阶段：

第一阶段：年初到3月份，出于对新一轮宏观紧缩以及加息的预期，市场担心周期见顶，石化、有色金属等周期股出现持续阴跌；

第二阶段：4月份，随着宏观经济数据的出台，市场开始忧虑经济减速和汇率变动带来的企业盈利下降，与出口相关的一系列股票大幅下跌；

第三阶段：进入5月份后，由于首批股权分置试点公司股改方案代表性带来的困扰，整个市场的估值体系出现紊乱，市场出现普跌。

面对市场的震荡，基金同智在保持仓位稳定和低周转率的基础上，主要进行了行业结构调整，重点减持了盈利前景变差的行业，增持了商业零售、旅游业等稳定增长的行业，并在市场大幅下跌过程时主动调整持仓，积极进行换股操作，特别是在市场恐慌中主动买入长期发展前景明朗的股票，提高了组合的收益。

五、下半年市场展望和本基金投资策略

在上半年密集出台的政策中，对于整个市场价值中枢持续影响最大的莫过于股权分置改革政策。

从估值上看，解决股权分置的启动对市场应该是实质利好。一方面，解决股权分置的启动为解决长期困扰A股市场的制度缺陷提供了基础，从而降低了A股市场的系统风险；另一方面，在旧制度下，流通股东和非流通股东利益取向不一致，非流通股东利益在市场下跌中受损很小，而在新制度下流通股和非流通股利益将紧密联系在一起。总之，由于对价的存在，整体市场投资价值将有显著提高。

对本基金而言，遵循价值投资的理念进行组合配置的思路不会因解决股权分置的启动而改变。

本基金管理小组认为，随着市场的大幅度下跌，市场风险已经得到大幅度的释放，整体市场的估值水平已经和国际接轨，随着长期资金的逐渐进入，市场将在2005年下半年构筑重要的底部。

下半年，我们总体的投资策略是在保持稳定持有战略性筹码的同时逐渐加大组合的进攻性，不断将组合中的股票优化为治理结构良好、长期业绩增长前景明朗、补偿空间较大、流动性良好的股票。

第四章 托管人报告

本托管人依据《同智证券投资基金基金合同》与《同智证券投资基金托管协议》，自 2000 年 3 月 8 日起托管同智证券投资基金（以下称“基金同智”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智期间，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，不存在损害基金同智基金份额持有人利益的行为。

（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、《同智证券投资基金基金合同》及《同智证券投资基金托管协议》对长盛基金管理有限公司——基金同智管理人的基金运作进行了必要的监督。

（1）基金同智管理人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智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）

同智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		15,436,652.89	31,233,410.01
清算备付金		1,530,944.53	0.00
交易保证金		203,720.89	129,701.33
应收证券清算款	4	7,873,496.50	0.00
应收股利		119,086.31	0.00
应收利息	5	2,102,774.34	742,688.98
其他应收款		0.00	105,000.00
股票投资市值		377,446,907.14	402,581,084.19
其中：股票投资成本		351,316,033.15	383,628,769.49
债券投资市值		124,741,609.48	122,675,920.98
其中：债券投资成本		122,017,037.96	122,378,977.68
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		529,455,192.08	557,467,805.49
负债及持有人权益			
负 债			
应付证券清算款	4	4,005,120.22	10,714,943.40
应付管理人报酬		632,472.45	693,295.48
应付托管费		105,412.04	115,549.23
应付佣金	6	311,896.06	694,501.56
应付收益	7	428,874.52	428,874.52
应付利息		0.00	0.00
未交税金		0.00	0.00
其他应付款	8	528,633.39	528,633.39
卖出回购证券款		0.00	0.00
短期借款		0.00	0.00
预提费用	9	260,793.38	55,000.00
其他负债		0.00	0.00
负债合计		6,273,202.06	13,230,797.58
持有人权益			
实收基金	10	500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得	11	28,855,445.51	19,249,258.00
未分配收益		-5,673,455.49	24,987,749.91
持有人权益合计		523,181,990.02	544,237,007.91

负债及持有人权益总计		529,455,192.08	557,467,805.49
基金份额净值(元/份)		1.0464	1.0885

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

同智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		-3,029,953.64	54,040,888.62
股票差价收入	12	-10,788,701.70	51,360,780.83
债券差价收入	13	639,212.60	-2,773,518.33
债券利息收入		1,818,535.90	1,573,297.74
存款利息收入		244,123.08	254,974.41
股利收入		5,043,079.27	3,577,529.26
买入返售证券收入		6,301.00	11,000.00
其他收入	14	7,496.21	36,824.71
费 用		5,131,251.76	5,020,865.60
基金管理人报酬		4,042,701.12	4,042,508.89
基金托管费		673,783.51	673,772.16
卖出回购证券支出		124,632.42	111,679.84
利息支出		0.00	0.00
其他费用	15	290,134.71	192,904.71
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		27,273.08	27,349.14
基金净收益		-8,161,205.40	49,020,023.02
加：未实现利得		9,606,187.51	-46,668,202.39
基金经营业绩		1,444,982.11	2,351,820.63

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。

同智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		-8,161,205.40	49,020,023.02
加：期初基金净收益		24,987,749.91	-15,198,608.64
可供分配基金净收益		16,826,544.51	33,821,414.38
减：本期已分配基金净收益	16	22,500,000.00	0.00
期末基金净收益		-5,673,455.49	33,821,414.38

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

同智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	544,237,007.91	505,329,215.99
本期经营活动：		
基金净收益	-8,161,205.40	49,020,023.02
未实现利得	9,606,187.51	-46,668,202.39
经营活动产生的基金净值变动数	1,444,982.11	2,351,820.63
本期向持有人分配收益：	22,500,000.00	0.00
期末基金净值	523,181,990.02	507,681,036.62

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

同智证券投资基金（简称“本基金”）是经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监基金字[2000]25号文《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》批准，由赣中基金、中盛基金、长江基金、武汉基金、开信基金、海湾基金六只原有投资基金清理规范后合并而成的契约型封闭式证券投资基金。经中国证监会证监基金字[2000]26号文《关于同意同智证券投资基金上市、扩募和续期的批复》批准，本基金于2000年5月15日在深圳证券交易所挂牌交易并于2000年7月17日成功扩募到5亿份基金份额，每份基金份额面值1元人民币，其中发起人认购500万份基金份额（占基金总规模的1%），其余49,500万基金份额由社会公众及商业保险

公司持有。本基金发起人为长江证券有限责任公司、国元证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、天津北方国际信托投资股份有限公司和长盛基金管理有限公司；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	7,873,496.50
合计	7,873,496.50
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	4,005,120.22
中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	0.00
合计	4,005,120.22

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	2,722.55
应收清算备付金利息	378.90
应收债券利息	2,099,672.89
合计	2,102,774.34

附注6、应付佣金

单位：人民币元

公司名称	2005年6月30日
招商证券股份有限公司	49,595.48
中信证券股份有限公司	66,373.43
华夏证券有限公司	36,453.59
广发华福证券有限责任公司	23,682.09
国元证券有限责任公司	135,791.47
合计	311,896.06

附注7、应付收益

由于原有6支投资基金的部分基金份额持有人没有办妥登记事宜，本基金2001年分配的收益部分尚未支付。

附注8、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	278,633.39
应付券商席位保证金	250,000.00
合计	528,633.39

附注9、预提费用

单位：人民币元

项目	2005年6月30日
审计费用	82,273.08
信息披露费	148,767.52
上市年费	29,752.78
合计	260,793.38

附注10、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	500,000	0.10%	500,000.00
长江证券有限责任公司	500,000	0.10%	500,000.00
天津北方国际信托投资股份有限公司	500,000	0.10%	500,000.00
国元证券有限责任公司	500,000	0.10%	500,000.00
长盛基金管理有限公司	1,339,346	0.27%	1,339,346.00
小计	3,339,346	0.67%	3,339,346.00
其他持有人持有(每份基金份额面值人民币1元)	496,660,654	99.33%	496,660,654.00
合计	500,000,000	100.00%	500,000,000.00

附注11、未实现利得

单位：人民币元

项 目	2005年上半年度
期初数	19,249,258.00
投资估值增值	9,606,187.51
其中：股票估值增值	7,178,559.29
债券估值增值	2,427,628.22
期末数	28,855,445.51

附注12、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	326,790,871.61
减：卖出股票成本总额	337,306,079.71
交易佣金总额	273,493.60
股票差价收入	-10,788,701.70

附注13、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	67,297,892.96
减：卖出债券成本总额	65,980,712.74
应收利息总额	677,967.62
债券差价收入	639,212.60

附注14、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	6,960.59
其他	535.62
合计	7,496.21

附注15、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	27,273.08
债券托管账户维护费	10,120.00
回购交易费用	1,138.83
汇款手续费	5,920.01
分红手续费	67,162.49
合计	290,134.71

附注16、本期已分配基金净收益

本基金2004年度分配收益：22,500,000.00元，向全体基金份额持有人按每10份基金份额派发现金收益0.450元。

附注17、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
中信证券股份有限公司	84,821,991.26	13.85%	265,101,342.00	18.78%
长江证券有限责任公司	0.00	0.00%	108,814,576.74	7.72%
国元证券有限责任公司	167,483,246.17	27.33%	189,005,880.72	13.39%
合计	252,305,237.43	41.18%	562,921,799.46	39.89%

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
中信证券股份有限公司	13,852,734.33	9.90%	0.00	0.00%
长江证券有限责任公司	0.00	0.00%	5,279,767.80	4.47%
国元证券有限责任公司	44,015,070.00	31.44%	25,492,921.90	21.61%
合计	57,867,804.33	41.34%	30,772,689.70	26.08%

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%	60,000,000.00	22.02%

国元证券有限责任公司	121,000,000.00	46.72%	0.00	0.00%
合计	121,000,000.00	46.72%	60,000,000.00	22.02%

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
中信证券股份有限公司	66,373.43	13.54%	207,443.93	18.24%
长江证券有限责任公司	0.00	0.00%	88,627.18	7.79%
国元证券有限责任公司	135,791.47	27.69%	154,982.06	13.63%
合计	202,164.90	41.23%	451,053.17	39.66%

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年度上半年度应支付基金管理费共计人民币4,042,701.12元（2004年上半年度应支付4,042,508.89元），其中已支付基金管理人管理费为人民币3,410,228.67元，尚余人民币632,472.45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年度上半年度应支付基金托管费共计人民币673,783.51元（2004年上半年度应支付673,772.16元），其中已支付基金托管人托管费为人民币568,371.47元，尚余人民币105,412.04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	100,000,000.00
期末余额	0.00	0.00
本期支出	0.00	46,643.84
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18、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
成霖股份	104,300	896,980.00	961,646.00	2005-05-12	2005-08-31
宁波华翔	114,686	659,444.50	964,509.26	2005-05-17	2005-09-03
三花股份	67,962	502,239.18	697,969.74	2005-05-20	2005-09-07
宝钢股份	273,816	1,401,937.92	1,371,818.16	2005-04-26	2005-07-11
合计	811,668	5,633,570.55	7,236,800.95		

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19、期后事项

本基金并无重要期后事项。

附注20、其他重要事项

无需要说明的其他重要事项。

附注21、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	377,446,907.14	71.29%
债券市值	124,741,609.48	23.56%
银行存款和清算备付金	16,967,597.42	3.20%
其他资产	10,299,078.04	1.95%
资产合计	529,455,192.08	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	0.12%
2	采掘业	31,895,661.54	6.10%
3	制造业	97,491,630.14	18.63%
	其中：食品、饮料	17,529,643.80	3.35%
	纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
	木材、家具	421,170.75	0.08%
	造纸、印刷	3,744,860.00	0.71%
	石油、化学、塑胶、塑料	10,569,344.06	2.02%
	电子	738,121.21	0.14%
	金属、非金属	16,010,764.16	3.06%
	机械、设备、仪表	17,780,737.08	3.40%
	医药、生物制品	30,696,989.08	5.87%
	其他制造业	0.00	0.00%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	45,571,898.14	8.71%
5	建筑业	1,050,544.18	0.20%
6	交通运输、仓储业	63,825,876.62	12.20%
7	信息技术业	27,606,967.64	5.28%
8	批发和零售贸易	35,131,872.15	6.72%
9	金融、保险业	45,541,660.50	8.70%
10	房地产业	9,510,000.00	1.82%
11	社会服务业	19,173,916.53	3.66%
12	传播与文化产业	0.00	0.00%
13	综合类	0.00	0.00%
	合 计	377,446,907.14	72.14%

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	5,955,000	35,789,550.00	6.84%
2	600583	海油工程	1,100,334	25,648,785.54	4.90%
3	600900	长江电力	3,001,647	24,583,488.93	4.70%
4	600018	上港集箱	1,352,300	21,907,260.00	4.19%
5	600694	大商股份	1,536,275	19,126,623.75	3.66%
6	000063	中兴通讯	806,094	18,427,308.84	3.52%
7	600009	上海机场	1,100,900	18,274,940.00	3.49%

8	600276	恒瑞医药	1,411,648	17,913,813.12	3.42%
9	000895	双汇发展	1,144,980	17,529,643.80	3.35%
10	002024	苏宁电器	500,790	16,005,248.40	3.06%
11	600019	宝钢股份	3,003,816	15,049,118.16	2.88%
12	600795	国电电力	2,004,661	13,250,809.21	2.53%
13	600320	振华港机	1,390,327	13,166,396.69	2.52%
14	000022	深赤湾A	448,699	12,442,423.27	2.38%
15	600012	皖通高速	1,684,399	11,201,253.35	2.14%
16	600000	浦发银行	1,298,550	9,752,110.50	1.86%
17	600096	云天化	1,003,640	9,604,834.80	1.84%
18	000002	万科A	3,000,000	9,510,000.00	1.82%
19	600406	国电南瑞	767,530	9,179,658.80	1.75%
20	000069	华侨城A	1,001,099	8,999,880.01	1.72%
21	600011	华能国际	1,240,000	7,737,600.00	1.48%
22	600085	同仁堂	347,876	7,733,283.48	1.48%
23	600350	山东基建	1,248,413	5,617,858.50	1.07%
24	002004	华邦制药	733,996	5,049,892.48	0.97%
25	600054	黄山旅游	571,666	4,556,178.02	0.87%
26	000488	晨鸣纸业	668,725	3,744,860.00	0.72%
27	600028	中国石化	999,400	3,537,876.00	0.68%
28	600418	江淮汽车	494,018	3,532,228.70	0.68%
29	600123	兰花科创	300,000	2,709,000.00	0.52%
30	600970	中材国际	65,618	1,050,544.18	0.20%
31	002048	华翔电子	114,686	964,509.26	0.18%
32	002047	成霖股份	104,300	961,646.00	0.18%
33	002045	广州国光	63,467	738,121.21	0.14%
34	002050	三花股份	67,962	697,969.74	0.13%
35	002041	登海种业	29,165	646,879.70	0.12%
36	002043	兔宝宝	60,775	421,170.75	0.08%
37	002046	轴研科技	31,879	384,141.95	0.07%

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	000063	中兴通讯	25,251,006.37	4.64%
2	000898	鞍钢新轧	20,791,592.20	3.82%
3	600900	长江电力	16,691,002.76	3.07%
4	600019	宝钢股份	16,523,082.04	3.04%
5	002024	苏宁电器	14,139,621.56	2.60%
6	600320	振华港机	13,381,613.59	2.46%
7	000022	深赤湾A	13,049,128.48	2.40%
8	600029	南方航空	12,564,028.55	2.31%
9	600028	中国石化	11,125,243.48	2.04%

10	600018	上港集箱	11,086,703.97	2.04%
11	600585	海螺水泥	10,996,748.81	2.02%
12	600000	浦发银行	9,631,602.68	1.77%
13	600011	华能国际	9,508,415.16	1.75%
14	600096	云天化	9,231,474.08	1.70%
15	000069	华侨城 A	8,849,787.95	1.63%
16	600085	同仁堂	8,102,892.27	1.49%
17	600276	恒瑞医药	7,582,484.47	1.39%
18	600009	上海机场	7,211,898.38	1.33%
19	600352	浙江龙盛	6,270,955.05	1.15%
20	600795	国电电力	5,673,411.89	1.04%
累计卖出金额前 20 名				
序号	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	000039	中集集团	22,205,332.82	4.08%
2	600005	武钢股份	21,861,005.25	4.02%
3	000422	湖北宜化	19,274,260.41	3.54%
4	600026	中海发展	16,790,252.25	3.09%
5	000898	鞍钢新轧	13,668,314.76	2.51%
6	600521	华海药业	13,427,777.46	2.47%
7	600029	南方航空	11,694,749.63	2.15%
8	600348	国阳新能	11,398,654.28	2.09%
9	600089	特变电工	11,219,622.79	2.06%
10	000488	晨鸣纸业	10,907,789.27	2.00%
11	600188	兖州煤业	9,504,812.89	1.75%
12	600585	海螺水泥	9,354,784.01	1.72%
13	600123	兰花科创	8,913,762.36	1.64%
14	002024	苏宁电器	8,009,182.37	1.47%
15	600276	恒瑞医药	7,519,010.41	1.38%
16	600887	伊利股份	6,997,521.76	1.29%
17	600795	国电电力	6,930,462.37	1.27%
18	000002	万科 A	6,640,689.46	1.22%
19	600028	中国石化	6,600,990.66	1.21%
20	600012	皖通高速	6,598,040.17	1.21%

(二) 2005 年 1 月 1 日至 2005 年 6 月 30 日基金同智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：304,993,343.37 元

卖出股票收入总额：326,790,871.61 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	121,257,541.88	23.17%
央行票据投资	0.00	0.00%
企业债券投资	0.00	0.00%

金融债券投资	0.00	0.00%
可转换债投资	3,484,067.60	0.67%
债券投资合计	124,741,609.48	23.84%

六、2005年6月30日按市值占基金资产净值比例大小排序前五名债券明细

序号	债券名称	债券市值(人民币元)	市值占净值比例
1	99 国债 10	40,840,000.00	7.81%
2	02 国债 14	30,123,000.00	5.76%
3	21 国债 15	27,121,500.00	5.18%
4	99 国债 05	10,343,520.98	1.98%
5	04 国债 11	7,119,700.00	1.36%

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	203,720.89
应收利息	2,102,774.34
证券清算款	7,873,496.50
应收股利	119,086.31
合计	10,299,078.04

(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
100096	云化转债	2,718,848.00	0.52%
110036	招行转债	2,079.60	0.00%
110418	江淮转债	763,140.00	0.15%

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(集团)公司	44,864,623	8.97%
2	中国人寿保险股份有限公司	42,290,734	8.46%
3	新华人寿保险股份有限公司	19,752,818	3.95%
4	银河-渣打-CITIGROUP GLOBAL MARKETS LIMITED	19,167,896	3.83%
5	申银万国-花旗-UBS LIMITED	12,101,737	2.42%
6	全国社保基金一零九组合	11,014,129	2.20%
7	招商证券-招行-招商证券基金宝集合资产管理计划	10,668,389	2.13%
8	申银万国-花旗-DEUTSCHE BANK AKTIENGESELLSCHAFT	8,806,661	1.76%
9	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	8,329,533	1.67%
10	中油资产管理有限公司	7,840,133	1.57%

二、截止 2005 年 6 月 30 日，持有同智基金的总户数为 32,692 户，平均每户持有 15,294.26 份，其中机构投资者持有 253,713,601 份，占总份额的 50.74%；个人投资者持有 246,286,399 份，占总份额的 49.26%。

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

基金同智 2004 年实现净收益 40,186,358.55 元,期初未分配收益 -15,198,608.64 元,本年度可供基金份额持有人分配收益 24,987,749.91 元。2004 年度收益分配方案为:向全体基金份额持有人按每 10 份基金份额派发现金收益 0.450 元。公告刊登于二 五年四月十八日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

六、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 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(深圳一个席位)、蔚深证券有限责任公司(上海一个席位)、广东华福证券有限责任公司(上海一个席位)、中山证券有限责任公司(上海一个席位)、国元证券有限公司(上海一个席位)、招商证券股份有限公司(深

圳一个席位)、长江证券有限公司(上海一个席位)这七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
招商证券股份有限公司	142,409,288.64	23.24%	111,436.85	22.73%
中信证券股份有限公司	84,821,991.26	13.85%	66,373.43	13.54%
广东华福证券有限责任公司	100,315,358.01	16.37%	81,816.62	16.68%
中山证券有限责任公司	117,690,722.22	19.21%	94,956.31	19.36%
国元证券有限责任公司	167,483,246.17	27.33%	135,791.47	27.69%
合计	612,720,606.30	100.00%	490,374.68	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
招商证券股份有限公司	1,195,972.80	0.86%	0.00	0.00%
中信证券股份有限公司	13,852,734.33	9.90%	0.00	0.00%
广东华福证券有限责任公司	13,974,575.40	9.98%	30,000,000.00	11.58%
中山证券有限责任公司	66,939,978.50	47.82%	108,000,000.00	41.70%
国元证券有限责任公司	44,015,070.00	31.44%	121,000,000.00	46.72%
合计	139,978,331.03	100.00%	259,000,000.00	100.00%

(四) 报告期内租用证券公司席位的变更情况: 报告期内停止租用蔚深证券有限责任公司(深圳一个席位)。

第九章 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、报告期内披露的各项公告原件
- 六、长盛基金管理有限公司营业执照和公司章程
- 七、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