

同益证券投资基金

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益证券投资基金（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。

本基金托管人中国工商银行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	8
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	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：同益证券投资基金

基金简称：基金同益

交易代码：184690

基金运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：1999年4月8日

报告期末基金份额总额：20亿份

基金合同存续期：1999年4月8日至2014年4月7日，共15年

基金份额上市的证券交易所：深圳证券交易所

上市日期：1999年4月21日

二、投资策略

（一）投资目标

本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。

（二）投资策略

始终如一地奉行“价值投资”的基本原则，并在不同的市场环境以及市场发展变化的不同阶段，灵活运用适合自身运作特点的投资原则、投资理念和投资技巧，这是本基金经理人投资管理的基本信条。

目前，通过对我国证券市场有效性的实证分析，得出结论是主动型投资有一定的适用性，通过学习、吸收、灵活运用国内外先进的投资分析方法，深入分析国际国内宏观经济、行业、企业的基本情况，有可能会发现和创造投资机会从而获得超额回报。当然，随着市场效率的不断提高，在证券市场获取超额投资回报的机会在减少，本基金经理人将更多借鉴国外成熟市场的投资经验和投资技巧。

投资管理分若干层面，本基金经理人力求在战略资产和战术资产等若干层面优化资源配置以实现单位风险下的收益最大化。在战略资产配置层，我们寻求现金、债券、股票资产的动态收益-风险最优配置；在战术资产配置层，我们寻求成长型股票和价值型股票的动态收益-风险最优配置。

投资分析和投资管理密不可分，投资分析要考虑各种影响因素对公司价值进行综合判断，对分析假设和分析方法的合理性进行科学、严谨的论证，必须做到博与精的有效统一，这也是职业基金经理人追求的境界。

(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：中国工商银行

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码：100032

法定代表人：姜建清

信息披露负责人：庄为

电话：010-66107333

传真：010-66106904

电子邮箱：custody@icbc.com.cn

五、信息披露

(一) 本基金半年度报告选定的报纸名称：《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 : 中国深圳市深南中路 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 年上半年度主要财务指标

主要财务指标	2005 年 6 月 30 日
基金本期净收益 (元)	-125,865,249.56
基金份额本期净收益 (元/份)	-0.0629
期末可供分配基金收益 (元)	-76,836,405.42
期末可供分配基金份额收益 (元/份)	-0.0384
期末基金资产净值 (元)	1,923,163,594.58
期末基金份额净值 (元/份)	0.9616
基金加权平均净值收益率	-6.48%
本期基金份额净值增长率	0.30%
基金份额累计净值增长率	70.50%

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。

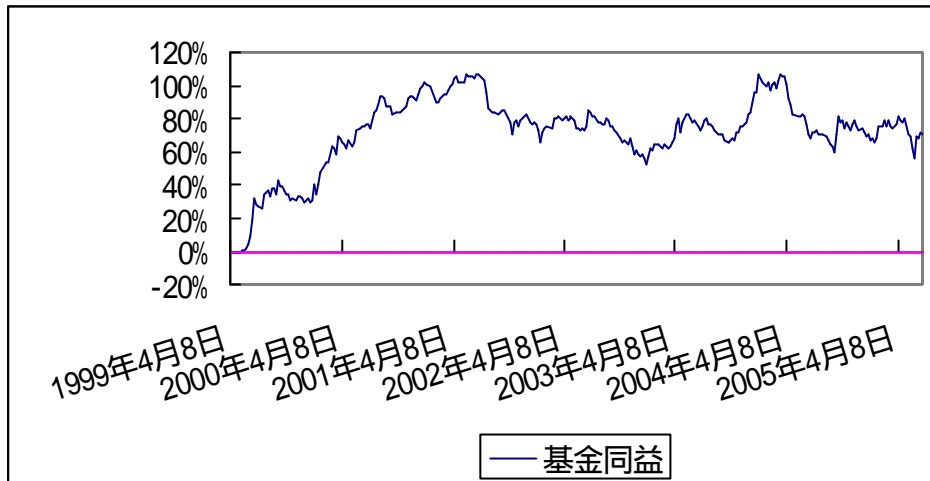
二、基金净值表现

(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	4.02%	0.0493
过去三个月	-1.04%	0.0366
过去六个月	0.30%	0.0293
过去一年	1.41%	0.0259
过去三年	-8.01%	0.0216
自基金成立起至今	70.50%	0.0229

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收益率

第三章 管理人报告

一、简要介绍

(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) 基金经理简介

许彤,男,1969年出生,获理学硕士学位,现任本基金基金经理。1997年1月至1998年3月就职于君安证券有限责任公司投资银行部,任项目经理。1998年4月至2004年2月就职于中信证券股份有限公司资产管理部,任投资业务主管。2004年3月加入长盛基金管理有限公司,先后担任基金同益基金经理助理、基金经理。

二、合规情况说明

本基金管理人在报告期内,严格按照《基金法》和《同益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。基金同益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、上半年市场情况简述与基金操作回顾

2005年上半年，沪深证券市场继续延续几年的下滑趋势，沪市综指与2004年底相比下滑14.65%，深成指下滑10.02%。在指数创出千点以下8年多新低的同时，沪深两市PE与PB等指标达到了历史低点。截止到2005年6月30日，本基金份额净值为0.9616元，上半年的净值增长率为0.30%，表现强于大盘。

上半年的股市虽然上演了“部分周期行业超跌反弹”、“基金对部分蓝筹股抱团取暖”、“股权分置题材下的寻宝游戏”等短期的阶段性行情，但在市场整体中心不断下移的大背景下，这些短线行情最终也只能是昙花一现，难以给大资金创造出盈利机会。部分优质价值股票在弱市当中以良好的抗跌性彰显其英雄本色，成为主流资金最好的避风港，与之对应，市场大量股票被边缘化，相当部分股票跌幅之大远远超出市场预期。股票表现的严重分化以及所带来的巨大风险，再次提示我们价值投资理念的重要。

我们在年初对市场的弱市情况有充分的预期，指导思想上基本以防御为主，操作策略上重点抓两方面工作：一是在行业配置上突出防御性行业，回避受周期、宏观调控影响大的行业，提高重仓股票的集中度，回避大量边缘化股票下跌的系统风险；二是在个股选择上更加精细，增持消费类、垄断类股票，减持周期类股票。通过上述措施，我们收到了良好效果，提高了基金资产的安全度。市场行业分类指数显示今年上半年金融、食品、旅游、交通运输、商业为表现最好的行业，我们在这些行业上均有较高的配置，持仓结构与市场热点比较吻合。

四、下阶段市场分析与基金投资思路

综合近一时期宏观经济、行业基本面、市场面等各方因素，我们认为目前股票市场处于多空两股力量相互对峙、旗鼓相当的微妙时期，在此阶段，政策面变化对市场的影响力度大大增加，政策因素成为决定市场走向的重要力量。我们希望在多空力量对比的分析中，梳理出最顺应市场的投资思路。

我们先分析市场的利多因素。最值得关注的是近期政策面发生的积极变化。从今年五月开始，中国证监会启动了中国证券史上具有深远意义的股权分置改革，特别是在第二批试点中，试点公司数量之大，覆盖面之广，尤其是大

型蓝筹公司宝钢和长电被纳入试点范畴，凸显了管理层在股权分置改革上的决心、勇气和魄力。相当程度上，减少了投资者的疑惑和畏难情绪，对市场中长期投资信心和投资理念的建立作用巨大。股权分置改革的直接利好主要体现在两方面：一是随着个股对价方案的出台实施，A 股的价格将进一步降低，加上连续多年熊市当中的股价回落，A 股市场的整个估值水平，不但彻底脱离了高高在上的状态，而且呈现出相当的吸引力，使得真正意义上的价值投资开始具有了现实基础和适宜土壤。二是股权分置改革将从根本上改善和解决长期困扰中国股市的公司股权结构不合理的问题。按照管理层目前的工作魄力和力度，我们认为这一改革措施的见效仅仅是时间问题，经过短期的阵痛后，中国 A 股市场将完成量变到质变的过程，市场的前景十分光明。从中长线看，我们对于市场低位的支撑力度很有信心，并认为在对价之后，市场会涌现出一批按照国际估值标准衡量同样具备较高投资价值的股票。这些股票会成为价值投资的真正载体，支撑起理性投资者的价值投资信念。基于上述判断，我们认为研判大盘短期起落的意义并不大，我们的工作重点是在寻找、发现对价之后具备高投资价值的股票。

从市场的利空因素看，我们认为当前市场主要存在三大问题：1、股权改革短期内的不确定性以及市场长期以来的赔钱效应，影响了场外资金的入场热情；2、对于可能出现的世界经济增速放缓以及中国出口、投资增速放缓，开始引起了投资者担忧，一定程度上影响了投资信心；3、从全球范围看，大量与周期相关的行业开始进入调整阶段，目前中国股市又是以大宗商品行业上市公司为主体的市场，对应于周期行业业绩的下滑趋势，即使周期类个股股价已经大幅下跌，但对其合理定价的争议仍然普遍存在。我们认为上述利空因素对许多相关行业的个股影响较大，进一步影响到股市短期的市场表现。

总体来看，我们认为：市场上行将受到经济与盈利不确定性等因素的压制，下跌又受到政策与估值等因素的支持，在此状况下，市场处于箱体运动的可能性较大，政策面因素对市场的影响作用进一步加大，成为左右市场走向以及波动幅度的最大因素，我们对此的关注程度提高。在此阶段，大喜大悲的情绪都可能导致投资上的失误，控制好心态，敢于对短期市场的悲观和亢奋进行低吸高抛将是较好的操作策略。按照价值投资的标准，挖掘、吸纳对价之后具备高

投资价值的股票，将是下阶段投资工作的重点。

在大盘走势不确定性加大的情况下，我们仍然坚持几个月以来的防御投资策略，继续持有抗周期能力较强、受宏观调控影响小的商业零售、食品饮料、交通运输等防御型行业，虽然这些行业前期表现较好，跌幅小于其它板块，但其估值水平依然合理且有吸引力。另外，对于跌幅较大、安全性很高的少量周期类股票以及受益于股权分置改革的价值类股票，我们也将进行重点关注，这类股票在市场回暖时，往往有较突出表现，具有较强的进攻性。当然要想在防御与进攻之间做好平衡也是难以把握的事情。我们认为在股权分置引发的“寻宝游戏”开始降温后，价值理念依旧是市场投资主线，中长线看，市场中主流机构资金仍然会重点锁定少数价值类股票。这类股票在获得对价之后，投资价值将进一步增加，其安全性与潜在上行空间同步扩大，有利于我们加强风险控制，提高基金的绝对收益。

第四章 托管人报告

2005 年上半年度，本托管人在对同益证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，不存在任何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。

2005 年上半年度同益证券投资基金管理人——长盛基金管理有限公司在投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人依法对同益证券投资基金管理人——长盛基金管理有限公司在 2005 年上半年度所编制和披露的同益证券投资基金半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容具有真实、准确和完整性。

中国工商银行资产托管部

2005 年 8 月 23 日

第五章 财务会计报告

一、会计报表（未经审计）

同益证券投资基金

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		102,960,202.81	67,492,063.04
清算备付金		1,640,821.42	0.00
交易保证金		500,000.00	500,000.00
应收证券清算款	4	0.00	27,340,872.23
应收股利		635,211.77	0.00
应收利息	5	5,971,660.90	6,063,640.25
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值		1,402,366,656.61	1,300,329,902.08
其中：股票投资成本		1,422,914,070.95	1,432,602,929.93
债券投资市值		434,252,477.80	521,088,191.00
其中：债券投资成本		435,028,243.12	541,676,636.60
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		1,948,327,031.31	1,922,814,668.60
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款	4	20,008,885.83	0.00
应付管理人报酬		2,327,977.69	2,461,589.30
应付托管费		387,996.28	410,264.87
应付佣金	6	1,106,627.38	1,029,068.46
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	996,360.98	1,318,195.62
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		25,163,436.73	5,324,118.25
持有人权益			

实收基金	9	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未实现利得	10	-21,323,179.66	-152,861,473.45
未分配收益		-55,513,225.76	70,352,023.80
持有人权益合计		1,923,163,594.58	1,917,490,550.35
负债及持有人权益总计		1,948,327,031.31	1,922,814,668.60
基金份额净值(元/份)		0.9616	0.9587

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

同益证券投资基金

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		-108,567,306.81	264,796,612.97
股票差价收入	11	-124,300,559.05	244,280,307.53
债券差价收入	12	-8,587,517.34	599,654.18
债券利息收入		6,632,086.38	6,560,366.37
存款利息收入		909,986.89	865,721.09
股利收入		16,766,735.95	12,328,989.55
买入返售证券收入		0.00	46,074.00
其他收入	13	11,960.36	115,500.25
费用		17,297,942.75	21,153,554.94
基金管理人报酬		14,496,389.05	16,408,712.43
基金托管费		2,416,064.87	2,734,785.30
卖出回购证券支出		144,305.16	1,654,378.24
利息支出		0.00	0.00
其他费用	14	241,183.67	355,678.97
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		-125,865,249.56	243,643,058.03
加：未实现利得		131,538,293.79	-532,835,868.48
基金经营业绩		5,673,044.23	-289,192,810.45

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。

同益证券投资基金

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		-125,865,249.56	243,643,058.03
加:期初基金净收益		70,352,023.80	42,288,338.24
可供分配基金净收益		-55,513,225.76	285,931,396.27
减:本期已分配基金净收益	15	0.00	40,000,000.00
期末基金净收益		-55,513,225.76	245,931,396.27

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

同益证券投资基金

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	1,917,490,550.35	2,225,661,671.44
本期经营活动:		
基金净收益	-125,865,249.56	243,643,058.03
未实现利得	131,538,293.79	-532,835,868.48
经营活动产生的基金净值变动数	5,673,044.23	-289,192,810.45
本期向持有人分配收益:		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数		-40,000,000.00
期末基金净值	1,923,163,594.58	1,896,468,860.99

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

同益证券投资基金(简称“同益基金”)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]8号文《关于同意同益证券投资基金设立

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、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 20 亿份基金份额，其中发起人认购 6,000 万基金份额，向社会募集 19.4 亿基金份额。本基金于一九九九年四月二十一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，基金托管人为中国工商银行。

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 2 号《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

自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

2、记账本位币

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

以权责发生制为记账原则，除上市流通股票和债券按市值计价外，其余均以历史成本为计价基础。

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	0.00
合计	0.00
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	18,799,971.76
中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	1,208,914.07
合计	20,008,885.83

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	20,984.82
应收债券利息	5,950,676.08
合计	5,971,660.90

附注6、应付佣金

单位：人民币元

项 目	2005年6月30日
国元证券有限责任公司	139,617.76
国信证券有限责任公司	86,299.75
招商证券股份有限公司	163,621.40
大鹏证券有限责任公司	93,886.86
华夏证券有限公司	50,092.46
南方证券股份有限公司	122,359.23
广发华福证券有限责任公司	370,412.66
中山证券有限责任公司	80,337.26
合计	1,106,627.38

附注7、其他应付款

单位：人民币元

项 目	2005年6月30日
应付券商席位保证金	250,000.00
沪深交易所未代扣代缴个人所得税暂挂	746,360.98
合计	996,360.98

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

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	8,728,950	0.44	8,728,950.00
长江证券有限责任公司	6,000,000	0.30	6,000,000.00
天津北方国际信托投资公司	4,000,000	0.20	4,000,000.00

国元证券有限责任公司	4,000,000	0.20	4,000,000.00
长盛基金管理有限公司	20,000,000	1.00	20,000,000.00
小计	42,728,950	2.14	42,728,950.00
其他持有人持有（每份基金份额面值人民币1元）：	1,957,271,050	97.86	1,957,271,050.00
合计	2,000,000,000	100	2,000,000,000.00

附注10、未实现利得

单位：人民币元

项 目	2005 上半年度
期初数	-152,861,473.45
投资估值增值	131,538,293.79
其中：股票估值增值	111,725,613.51
债券估值增值	19,812,680.28
期末数	-21,323,179.66

投资估值增值为本基金于2005年6月30日对证券投资进行估值时，证券投资估值额与其账面成本之差额。

附注11、股票差价收入

单位：人民币元

项 目	2005 上半年度
卖出股票成交总额	758,938,082.43
减：卖出股票成本总额	882,600,119.54
交易佣金总额	638,521.94
合计	-124,300,559.05

附注12、债券差价收入

单位：人民币元

项 目	2005 上半年度
卖出债券成交总额	218,108,212.98
减：卖出债券成本总额	223,372,461.75
应收利息总额	3,323,268.57
合计	-8,587,517.34

附注13、其他收入

单位：人民币元

项 目	2005 上半年度
新股手续费返还	11,960.36
合计	11,960.36

附注14、其他费用

单位：人民币元

项 目	2005 上半年度
上市年费	29,752.78
信息披露费	148,767.52
审计费用	52,068.27
回购交易费用	625.10
债券账户维护费	9,970.00
合计	241,183.67

附注15、本期已分配基金净收益

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。

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
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
中信证券股份有限公司	发起人、管理人原股东
长盛基金管理有限公司	发起人、管理人
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
中国工商银行	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、通过关联方席位进行的交易

单位：人民币元

关联方名称	2005 上半年度		2004 上半年度	
	股票买卖 半年度成交金额	占上半年 交易金额比例	股票买卖 半年度成交金额	占上半年 交易金额比例
长江证券有限责任公司	0.00	0.00%	479,269,475.66	6.95%
国元证券有限责任公司	468,602,975.51	29.35%	955,827,842.73	13.87%
合计	468,602,975.51	29.35%	1,435,097,318.39	20.82%

单位：人民币元

关联方名称	2005 上半年度		2004 上半年度	
	债券买卖 半年度成交金额	占上半年 交易金额比例	债券买卖 半年度成交金额	占上半年 交易金额比例
长江证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国元证券有限责任公司	11,040,819.28	4.51%	0.00	0.00%
合计	11,040,819.28	4.51%	0.00%	0.00%

单位：人民币元

关联方名称	2005 上半年度		2004 上半年度	
	证券回购 半年度成交金额	占上半年 交易金额比例	证券回购 半年度成交金额	占上半年 交易金额比例
长江证券有限责任公司	0.00	0.00%	345,600,000.00	8.61%
国元证券有限责任公司	0.00	0.00%	120,000,000.00	2.99%
合计	0.00	0.00%	465,600,000.00	11.60%

单位：人民币元

关联方名称	2005 上半年度		2004 上半年度	
	支付的佣金	占上半年 佣金比例	支付的佣金	占上半年 佣金比例
长江证券有限责任公司	0.00	0.00%	385,606.18	6.95%
国元证券有限责任公司	378,028.36	29.31%	761,688.52	13.73%
合计	378,028.36	29.31%	1,147,294.70	20.68%

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

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、基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人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。本基金于本报告期应支付基金管理人管理费共计人民币14,496,389.05元，其中已支付基金管理人管理费为人民币12,168,411.36元，尚余人民币2,327,977.69元未支付。

(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；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。本基金于本报告期应支付基金托管人托管费共计人民币2,416,064.87元，其中已支付基金托管人托管费为人民币2,028,068.59元，尚余人民币387,996.28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

中国工商银行	2005 上半年度	2004 上半年度
卖出回购证券		
本期交易量	260,000,000.00	0.00
期末余额	0.00	0.00
本期支出	69,347.94	0.00
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、报告期末流通转让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
三花股份	67,962	502,239.18	697,969.74	2005-05-20	2005-09-07
宝钢股份	1,216,960	6,230,835.20	6,096,969.60	2005-04-26	2005-07-11
合计	1,640,126	9,803,023.33	10,997,443.13		

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。

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	1,402,366,656.61	71.98%
债券市值	434,252,477.80	22.29%
银行存款和清算备付金	104,601,024.23	5.37%
其他资产	7,106,872.67	0.36%
资产合计	1,948,327,031.31	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	金额（人民币元）	占净值比例
1	农、林、牧、渔业	10,786,364.30	0.56%
2	采掘业	123,788,806.58	6.44%
3	制造业	392,721,588.98	20.42%
	其中：食品、饮料	164,369,469.37	8.55%
	纺织、服装、皮毛	3,939,600.00	0.20%
	木材、家具	421,170.75	0.02%
	造纸、印刷	0.00	0.00%
	石油、化学、塑胶、塑料	7,254,427.60	0.38%
	电子	738,121.21	0.04%
	金属、非金属	105,868,920.68	5.50%
	机械、设备、仪表	15,388,241.82	0.80%
	医药、生物制品	94,741,637.55	4.93%
	其他制造业	0.00	0.00%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	132,723,860.43	6.90%
5	建筑业	1,050,544.18	0.05%
6	交通运输、仓储业	261,879,995.54	13.62%
7	信息技术业	57,639,998.58	3.00%
8	批发和零售贸易	167,128,779.27	8.69%
9	金融、保险业	46,904,642.33	2.44%
10	房地产业	114,847,315.21	5.97%
11	社会服务业	59,494,114.66	3.09%
12	传播与文化产业	33,400,646.55	1.74%
13	综合类	0.00	0.00%
	合 计	1,402,366,656.61	72.92%

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	600694	大商股份	8,696,891	108,276,292.95	5.63%
2	000402	金融街	12,007,333	97,739,690.62	5.08%
3	600019	宝钢股份	19,005,268	95,216,392.68	4.95%
4	600900	长江电力	10,533,885	86,272,518.15	4.49%
5	600009	上海机场	4,997,095	82,951,777.00	4.31%
6	600085	同仁堂	3,273,934	72,779,552.82	3.78%
7	000895	双汇发展	4,600,000	70,426,000.00	3.66%
8	600583	海油工程	2,578,368	60,101,758.08	3.13%
9	002024	苏宁电器	1,841,442	58,852,486.32	3.06%
10	600887	伊利股份	4,243,278	56,520,462.96	2.94%
11	600012	皖通高速	7,079,838	47,080,922.70	2.45%
12	600036	招商银行	7,804,433	46,904,642.33	2.44%
13	000063	中兴通讯	1,969,757	45,028,645.02	2.34%
14	600188	兖州煤业	3,691,693	38,245,939.48	1.99%
15	600717	天津港	4,883,303	34,671,451.30	1.80%
16	600037	歌华有线	2,042,853	33,400,646.55	1.74%
17	600795	国电电力	4,978,641	32,908,817.01	1.71%
18	600028	中国石化	7,145,963	25,296,709.02	1.32%
19	600350	山东基建	5,496,470	24,734,115.00	1.29%
20	000858	五粮液	3,086,500	23,333,940.00	1.21%
21	600026	中海发展	3,325,193	22,711,068.19	1.18%
22	600029	南方航空	7,547,699	22,492,143.02	1.17%
23	000888	峨眉山A	4,025,566	19,081,182.84	0.99%
24	600428	中远航运	2,338,355	18,426,237.40	0.96%
25	000002	万科A	5,396,727	17,107,624.59	0.89%
26	600054	黄山旅游	1,942,106	15,478,584.82	0.81%
27	600386	北京巴士	2,816,971	15,380,661.66	0.80%
28	000513	丽珠集团	2,798,055	14,409,983.25	0.75%
29	600320	振华港机	1,510,679	14,306,130.13	0.74%
30	600597	光明乳业	3,378,673	14,089,066.41	0.73%
31	000900	现代投资	1,304,433	14,061,787.74	0.73%
32	600642	申能股份	1,729,569	13,542,525.27	0.70%
33	600406	国电南瑞	1,054,461	12,611,353.56	0.66%
34	600467	好当家	1,248,705	10,139,484.60	0.53%
35	600594	益佰制药	609,532	7,552,101.48	0.39%
36	600143	金发科技	614,782	7,254,427.60	0.38%
37	600585	海螺水泥	1,077,400	7,218,580.00	0.38%
38	600400	红豆股份	1,176,000	3,939,600.00	0.20%
39	600798	宁波海运	888,372	3,633,441.48	0.19%
40	000039	中集集团	257,800	2,472,302.00	0.13%

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
41	600970	中材国际	65,618	1,050,544.18	0.05%
42	002047	成霖股份	104,300	961,646.00	0.05%
43	002045	广州国光	63,467	738,121.21	0.04%
44	002050	三花股份	67,962	697,969.74	0.04%
45	002041	登海种业	29,165	646,879.70	0.03%
46	002040	南京港	48,757	470,505.05	0.02%
47	002043	兔宝宝	60,775	421,170.75	0.02%
48	002046	轴研科技	31,879	384,141.95	0.02%
49	600236	桂冠电力	41,200	200,232.00	0.01%
50	600472	包头铝业	38,000	144,400.00	0.01%

四、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、累计卖出前20名股

票明细

累计买入金额前20名			
股票代码	股票名称	累计买入金额(人民币元)	占净值比例
600019	宝钢股份	92,286,250.11	4.81%
600036	招商银行	62,596,707.79	3.26%
600900	长江电力	58,640,385.15	3.06%
000402	金融街	58,639,407.18	3.06%
000063	中兴通讯	57,958,080.25	3.02%
600583	海油工程	55,112,370.19	2.87%
600009	上海机场	38,510,014.72	2.01%
600717	天津港	37,816,097.36	1.97%
600089	特变电工	35,420,487.80	1.85%
002024	苏宁电器	31,654,970.08	1.65%
600694	大商股份	27,126,420.65	1.41%
600012	皖通高速	24,319,141.02	1.27%
000888	峨眉山A	22,467,460.18	1.17%
000858	五粮液	21,808,974.71	1.14%
600406	国电南瑞	17,571,028.73	0.92%
600143	金发科技	16,556,523.33	0.86%
600054	黄山旅游	16,129,042.83	0.84%
600029	南方航空	14,217,812.87	0.74%
600026	中海发展	13,867,106.22	0.72%
600642	申能股份	12,956,235.23	0.68%
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)	占净值比例
600104	上海汽车	42,345,117.18	2.21%

600887	伊利股份	40,781,010.66	2.13%
600028	中国石化	40,767,032.68	2.13%
000895	双汇发展	33,657,714.26	1.76%
600019	宝钢股份	29,597,174.57	1.54%
600688	上海石化	24,464,620.43	1.28%
600089	特变电工	23,421,623.94	1.22%
000866	扬子石化	22,368,330.50	1.17%
000039	中集集团	21,765,770.79	1.14%
600188	兖州煤业	21,664,384.81	1.13%
600123	兰花科创	21,340,782.96	1.11%
600002	齐鲁石化	20,684,747.31	1.08%
600236	桂冠电力	20,403,516.12	1.06%
600036	招商银行	20,045,205.69	1.05%
000402	金融街	19,284,666.99	1.01%
600207	安彩高科	17,948,209.04	0.94%
600585	海螺水泥	17,587,206.86	0.92%
600361	华联综超	16,123,594.85	0.84%
600362	江西铜业	16,048,818.43	0.84%
600470	六国化工	15,806,654.14	0.82%

(二) 2005年1月1日至2005年6月30日基金同益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：872,911,260.56元

卖出股票收入总额：758,938,082.43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
国家债券投资	162,875,107.80	8.47%
央行票据投资	0.00	0.00%
企业债券投资	5,000,000.00	0.26%
金融债券投资	252,303,100.00	13.12%
可转换债投资	14,074,270.00	0.73%
债券投资合计	434,252,477.80	22.58%

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	市值(人民币元)	市值占净值比例
1	20国债04	96,126,082.50	5.00%
2	04国开18	60,000,000.00	3.12%
3	03国开24	51,400,000.00	2.67%
4	04国开12	50,009,000.00	2.60%
5	02国债14	37,151,700.00	1.93%

七、投资组合报告附注

(一) 2004年6月22日下午,中国证监会内蒙古监管局组成核查小组进入伊利股份,对该公司进行专项核查。12月22日,伊利股份公告:“2004年12月17日,内蒙古自治区检察院对公司个别高管人员的经济问题正式进行立案调查。因涉嫌挪用公款,目前董事长郑俊怀先生、副董事长杨桂琴女士、董事郭顺喜先生、财务负责人兼董事会秘书张显著先生及证券代表李永平先生已被刑事拘留。”

本基金买入伊利股份的主要时间在中国证监会内蒙古监管局组成核查小组进入伊利股份之前。买入理由是该股为研究员调研后推荐的股票池中的备选股票且为市场公认的蓝筹股,该公司作为行业龙头,优势明显,参照国际同类公司的估值水平,也具备相当的投资价值。伊利高管的被捕,凸现了该公司法人治理结构存在不完善之处,对公司声誉造成了较大负面影响。事件发生前后,我们多次对该公司进行了实地调研,认为该公司仍然是国内乳品行业最具竞争力的公司之一。此次事件可能成为公司治理结构等多方面改善的契机,近期公司的一系列行为也显示出这种积极迹象,我们会密切关注公司后续经营及管理方面的变化。

(二) 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	500,000.00
应收证券交易清算款	5,971,660.90
应收利息	635,211.77
合计	7,106,872.67

(四) 2005年6月30日持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	市值(人民币元)	市值占净值比例
1	110795	国电转债	10,985,770.00	0.57%
2	110037	歌华转债	3,088,500.00	0.16%

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	占总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	187,319,371	9.37%
2	中国人民财产保险股份有限公司	153,943,871	7.70%
3	中国人寿保险(集团)公司	118,185,866	5.91%
4	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	106,441,333	5.32%
5	中国平安保险(集团)股份有限公司	101,160,325	5.06%
6	新华人寿保险股份有限公司	40,747,708	2.04%
7	上海久事公司	36,195,534	1.81%
8	陕西秦龙电力股份有限公司	20,200,000	1.01%
9	长盛基金管理有限公司	20,000,000	1.00%
10	中国再保险(集团)公司	18,889,217	0.94%

二、截止 2005 年 6 月 30 日，持有同益基金的总户数为 47,852 户，平均每户持有 41,795.54 份，其中机构投资者持有 1,037,672,099 份，占总份额的 51.88%；个人投资者持有 962,327,901 份，占总份额的 48.12%。

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二〇〇五年三月十四日《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。

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、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,我们选择了渤海证券有限责任公司(上海一个席位)、国元证券有限责任公司(深圳、上海各一个席位)、招商证券股份有限公司(上海一个席位)、平安证券有限责任公司(深圳、上海各一个席位)、长城证券有限责任公司(深圳、上海各一个席位)、申银万国证券股份有限公司(深圳、上海各一个席位)、华夏证券有限公司(深圳一个席位)、广发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(深圳一个席位)这九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
国元证券有限责任公司	468,602,975.51	29.36%	378,028.36	29.31%
招商证券股份有限公司	81,466,372.95	5.10%	66,802.66	5.18%
华夏证券有限公司	64,015,307.52	4.01%	50,092.46	3.89%
广发华福证券有限责任公司	453,039,791.31	28.38%	370,412.66	28.72%
中山证券有限责任公司	102,666,194.88	6.43%	80,337.26	6.23%
长城证券有限责任公司	426,559,840.16	26.72%	343,944.51	26.67%
合计	1,596,350,482.33	100.00%	1,289,617.91	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
国元证券有限责任公司	11,040,819.28	4.51%	0.00	0.00%
招商证券股份有限公司	5,300,000.00	2.16%	0.00	0.00%
广发华福证券有限责任公司	32,075,450.50	13.09%	100,000,000.00	100.00%
长城证券有限责任公司	196,550,922.42	80.24%	0.00	0.00%
合计	244,967,192.20	100.00%	100,000,000.00	100.00%

(四) 报告期内租用证券公司席位的变更情况：上半年停止租用长江证券有限责任公司深圳、上海各一个席位，停止租用华夏证券有限公司一个上海席位，停止租用渤海证券有限责任公司一个深圳席位。

第九章、备查文件目录

- 一、关于同意设立同益证券投资基金的批复
- 二、同益证券投资基金基金合同
- 三、同益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