

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动态精选证券投资基金（以下简称“本基金”）2007年年度报告（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。

本基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于2008年3月25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。

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告会计期间：2007年1月1日至2007年12月31日。

目 录

| | |
|--------------------------------|----|
| 第一章 基金简介 | 1 |
| 第二章 主要财务指标、基金净值表现和收益分配情况 | 3 |
| 第三章 管理人报告 | 5 |
| 第四章 托管人报告 | 9 |
| 第五章 审计报告 | 10 |
| 第六章 财务会计报告 | 12 |
| 第七章 投资组合报告 | 33 |
| 第八章 基金份额持有人情况 | 41 |
| 第九章 开放式基金份额变动情况 | 41 |
| 第十章 重大事件揭示 | 42 |
| 第十一章 备查文件 | 46 |

第一章 基金简介

一、基金基本资料

- （一）基金名称：长盛动态精选证券投资基金
- （二）基金简称：长盛动态精选基金
- （三）基金交易代码：510081（前端收费）、511081（后端收费）
- （四）基金运作方式：契约型开放式
- （五）基金合同生效日：2004年5月21日
- （六）报告期末基金份额总额：1,809,138,385.58份
- （七）基金合同存续期：无
- （八）基金份额上市的证券交易所：无
- （九）上市日期：无

二、基金产品说明

（一）投资目标

本基金为开放式股票型基金。将通过积极投资于能够充分分享中国经济长期增长的、在各自行业中已经或将要取得领袖地位的50家上市公司股票，在承担适度风险的前提下，追求当期收益和基金资产超过业绩比较基准的长期稳定回报。

（二）投资策略

本基金为主动管理的股票型基金，投资策略上偏重选股能力的发挥，时机的选择放在次要位置。

（三）业绩比较基准

中信综合指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%

（四）风险收益特征

本基金属于证券投资基金中的适度风险品种，在承担适度风险的前提下，获取长期稳定的收益。

三、基金管理人

- （一）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：陈平
- （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）名称：中国农业银行

- (二) 注册地址：北京市东城区建国门内大街69号
- (三) 办公地址：北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦
- (四) 邮政编码：100037
- (五) 法定代表人：项俊波
- (六) 信息披露负责人：李芳菲
- (七) 联系电话：010-68424199
- (八) 传真：010-68424181
- (九) 电子邮箱：lifangfei@abchina.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，供公众查阅、复制。

六、其他有关资料

- (一) 基金聘请的会计师事务所
 - 名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
 - 办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
- (二) 基金注册登记机构
 - 名称：中国证券登记结算有限责任公司
 - 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、基金净值表现和收益分配情况

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、新会计准则下基金近三年主要财务指标

| 序号 | 主要财务指标 | 2007年 | 2006年 | 2005年 |
|----|-------------------------|------------------|----------------|------------------|
| 1 | 本期利润(元) | 1,285,630,488.03 | 787,403,957.00 | 84,467,304.69 |
| 2 | 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额(元) | 1,247,218,732.40 | 561,613,667.11 | -168,991,524.74 |
| 3 | 加权平均份额本期利润(元/份) | 0.8053 | 1.1144 | 0.0314 |
| 4 | 期末可供分配利润(元) | 941,553,205.43 | 181,943,250.36 | -141,548,215.99 |
| 5 | 期末可供分配份额利润(元/份) | 0.5204 | 0.3798 | -0.0602 |
| 6 | 期末基金资产净值(元) | 2,948,126,869.83 | 847,049,438.69 | 2,340,967,870.05 |
| 7 | 期末基金份额净值(元/份) | 1.6296 | 1.7681 | 0.9955 |
| 8 | 加权平均净值利润率 | 58.13% | 84.18% | 3.30% |
| 9 | 本期份额净值增长率 | 120.24% | 130.03% | 3.39% |
| 10 | 份额累计净值增长率 | 404.36% | 129.00% | -0.45% |

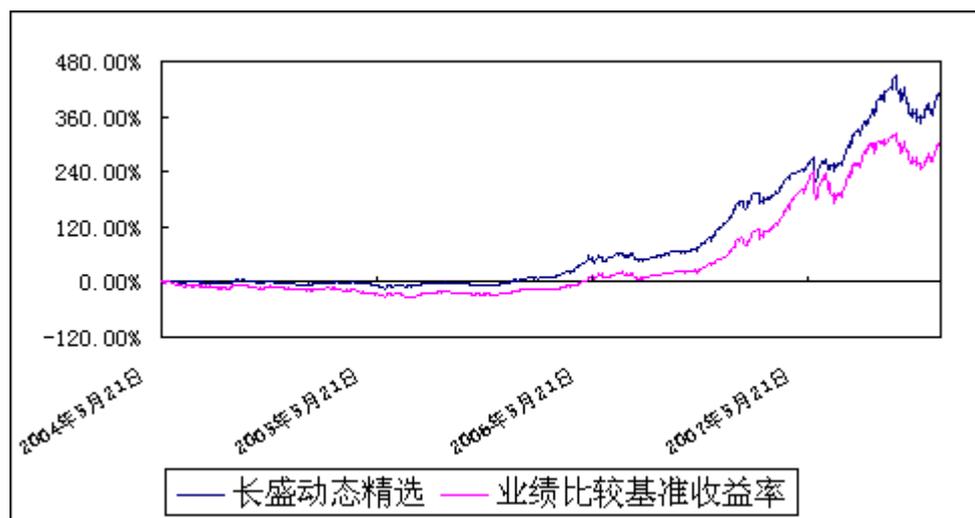
二、基金净值表现

(一) 本基金份额净值增长率与其同期业绩比较基准收益率比较表

| 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) |
|----------|----------|-------------|--------------|-----------------|---------|---------|
| 过去三个月 | -2.24% | 0.0188 | -3.00% | 0.0177 | 0.76% | 0.0011 |
| 过去六个月 | 42.21% | 0.0179 | 37.83% | 0.0191 | 4.38% | -0.0012 |
| 过去一年 | 120.24% | 0.0178 | 156.31% | 0.0217 | -36.07% | -0.0039 |
| 过去三年 | 423.79% | 0.0140 | 375.08% | 0.0166 | 48.71% | -0.0026 |
| 过去五年 | 404.36% | 0.0130 | 299.26% | 0.0159 | 105.10% | -0.0029 |
| 自基金成立起至今 | 404.36% | 0.0130 | 299.26% | 0.0159 | 105.10% | -0.0029 |

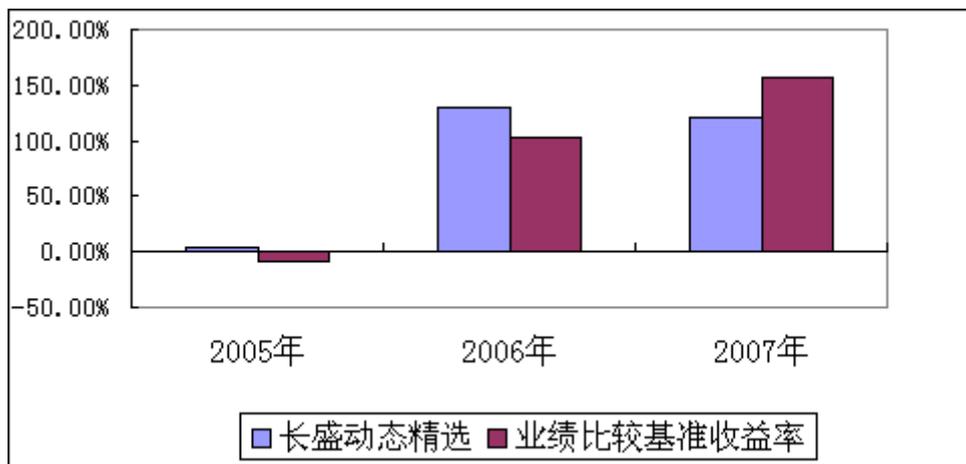
(二) 自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，与同期业绩比较基准的变动进行比较

长盛动态精选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



(2004年5月21日至2007年12月31日)

(三) 本基金过往三年每年的净值增长率与同期业绩比较基准的收益率比较
长盛动态精选基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



三、过往三年每年的基金收益分配情况

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 备注 |
|-------|-------------|-----------------|
| 2007年 | 5.800元 | 除息日：2007年2月7日 |
| | 7.500元 | 除息日：2007年4月23日 |
| 2006年 | 0.200元 | 除息日：2006年2月14日 |
| | 3.500元 | 除息日：2006年10月30日 |
| 2005年 | 0.000元 | 2005年度未分配收益 |
| 合计 | 17.00元 | |

第三章 管理人报告

第一节 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金字[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：国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）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12月31日，基金管理人共管理两支封闭式基金、七支开放式基金，并于2002年12月，首批取得了全国社保基金管理资格。

二、基金经理小组成员介绍

宋炳山先生，1969年3月出生，中共党员。毕业于清华大学工程物理系，获工学硕士。历任国家科技部基础研究高技术司主任科员；博时基金管理有限公司研究部研究员，裕隆基金经理助理，基金裕阳基金经理，基金裕华基金经理，交易部总经理；富国基金管理有限公司投资副总监兼基金汉兴基金经理；东方基金管理有限责任公司分管投资副总经理兼东方龙基金经理；2006年3月起，加入长盛基金管理有限公司。现任长盛基金管理有限公司副总经理。自2007年9月17日起兼任长盛动态精选证券投资基金（本基金）基金经理。

其以往担任基金经理情况：2001年4月14日至2002年1月12日担任基金裕阳基金经理；2002年1月12日至2003年6月18日担任基金裕华基金经理；2004年1月9日至2004年7月30日担任基金汉兴基金经理；2004年11月25日至2006年3月3日担任东方龙基金经理。

王宁先生，1971年10月出生。毕业于北京大学光华管理学院，EMBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理，兴业基金经理等职务。

2005年8月加盟长盛基金管理有限公司，曾任投资管理部基金经理助理职务，自2006年1月5日起任长盛动态精选证券投资基金（本基金）基金经理。

其以往担任基金经理情况：2001年7月27日至2004年9月16日担任兴业基金基金经理。

第二节 对报告期内基金运作的合规守信情况的说明

本报告期内，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、《长盛动态精选证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

第三节 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

一、报告期内行情回顾和本基金投资策略分析

2007年国内资本市场方面整体呈现持续上涨状态。国内宏观经济方面，宏观经济保持持续增长，物价水平持续上涨，人民币汇率也不断创新高，人民银行继续加息，消费者通货膨胀预期持续存在。国际经济和市场方面，受美国市场次级贷款影响，国际市场大幅度调整，石油、黄金价格创新高。

2007年本基金完成两次大比例分红，基金规模出现大幅度增长。

本基金全年除2007年二季度以外，其他季度业绩基本保持稳定增长。

本基金行业分布中，金融、地产比例相对较低，相对规避四季度市场调整的风险，大比例分红后与通货膨胀预期相关的煤炭，以及大比例分红前的先进装备制造业等行业配置为组合做出贡献。

二、本基金业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为1.6296元，本报告期份额净值增长率为120.24%，同期业绩比较基准增长率为156.30%。

第四节对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

2008年我们继续关注上游要素价格的改革（我们认为宏观调控的手段之一）对于行业与公司利润的变化，我们将超配利润状况持续改善的行业。2008年与2007年重要不同是我们重点研究效率提高导致利润的增长。两种效率的改善是我们研究重点：一是部分行业的适度集中，提高了资源配置效率；二是新的产业发展，提升产业结构，促进技术创新，降低能耗，改善贸易结构等。我们将超配效率提高的行业或公司。

2008年组合管理围绕“精选为主、动态为辅”的策略，保持组合合理的张力。自下而上的分析公司在2008年将显得越来越重要，原因是导致股票价格上涨的外部因素的作用在下降。浓缩股票精华，精选个股是基础；适度动态调整，保持组合平稳增长。

最后提醒投资者的是：下阶段我们将重点关注的10只股票：中国神华（601088）、万科A（000002）、招商银行（600036）、西山煤电（000983）、西飞国际（000768）、宝钢股份（600019）、中化国际（600500）、大秦铁路（601006）、江西铜业（600362）、中国国航（601111）。

第五节 基金内部监察报告

报告期内，本基金管理人在内部监察工作中一切从合规运作，保障基金持有人利益出发，以巩固和完善公司各项制度和确保业务运转流程顺畅为目标，以内部控制制度为依据，通过坚持长效监察，认真检查制度、流程的执行情况，实行专人稽查、落实责任、不走过场，推动了各部门的规范运作；通过适时监察，发现问题及时跟进，查清发生问题的原因、性质、影响、后果，采取与有关部门或个人共同分析的方法，客观的认定，涉及制度不完善的，及时完善或提出修订，涉及个人责任的，界定性质及程度后报公司经营管理层，有效地保证了公司整体运营的协调性；通过采取随机抽查的方式检验相关部门运作流程的执行情况，努力做好事前防范，降低运营风险。具体如下：

一、进一步完善了公司内部控制制度

完善、适用、适时的内部控制制度，是公司各项业务规范、有序运转的基本前提。报告期内，根据法律法规的新要求及业务发展的需要，公司对内部控制制度进行了完善与更新。

二、跟踪与投资运作有关的法律、法规及公司规定的变化，及时、全面掌控基金运作风险点

全面、清晰掌控公司及基金投资运作的风险点，是保证基金规范运作的基本前提。为此，我们全面梳理与投资运作相关的法律、法规、基金合同及公司规定，分别从法规限制、合同限制、公司制度限制三个层面整理、归纳出各基金的风险点，通过明确风险点并标识各风险点所采用的控制工具与控制方法，使得对各风险点的监控真正落到实处。报告期内，我们跟踪与投资运作相关的法律、法规及公司规定的变化，对基金风险点进行了及时更新。

三、强化系统风险监控功能，提升风险监控的准确性及效率

公司监察稽核部通过系统，实现对各基金投资运作合法合规的及时监控。通过定期、不定期检查各基金风险点在系统中设置的正确性与及时性，提升风险监控的准确性及效率。

四、采用定期与不定期相结合的专项稽核方式，检查制度执行情况，规范业务

运转工作流程

公司内部控制制度的切实执行，是公司各项业务规范、有序运转的重要保证。

报告期内，我们采用定期与不定期相结合的专项稽核方式，对公司内控制度执行情况进行了检查。

通过以上工作的展开，在本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，保障了基金份额持有人的利益。在今后的工作中，我们将继续以保障基金份额持有人的利益为宗旨、以风险控制为中心、以防范不当利益输送为目标，不断提高内部监察工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障基金合规运作。

第四章 托管人报告

在托管长盛动态精选证券投资基金的过程中，本基金托管人——中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《长盛动态精选证券投资基金基金合同》、《长盛动态精选证券投资基金托管协议》的约定，对长盛动态精选证券投资基金管理人——长盛基金管理有限公司2007年1月1日至2007年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

本托管人认为，长盛基金管理有限公司在长盛动态精选证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人认为，长盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的长盛动态精选证券投资基金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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行托管业务部

2008年3月25日

第五章 审计报告

普华永道中天审字(2008)第20304号

长盛动态精选证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的长盛动态精选证券投资基金（以下简称“长盛动态精选基金”）的财务报表，包括2007年12月31日的资产负债表、2007年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表和财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则、《长盛动态精选证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是长盛动态精选基金的基金管理人长盛基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

1、设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；

2、选择和运用恰当的会计政策；

3、作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则、《长盛动态精选证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了长盛动态精选基金2007年12月31日的财务状况以及2007年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天
会计师事务所有限公司

注册会计师
薛 竞

中国·上海市

注册会计师
陈 宇

2008年3月21日

第六章 财务会计报告

第一节 基金会计报表（经审计）

一、资产负债表

长盛动态精选证券投资基金资产负债表

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

| 项 目 | 附注 | 2007年12月31日 | 2006年12月31日 |
|-------------------|------|-------------------------|-----------------------|
| 资 产 | | | |
| 银行存款 | | 244,074,496.59 | 95,834,012.65 |
| 结算备付金 | | 2,844,328.75 | 991,971.16 |
| 存出保证金 | | 1,210,000.00 | 1,460,000.00 |
| 交易性金融资产 | 七(一) | 2,765,118,762.13 | 744,599,412.78 |
| 其中：股票投资 | | 2,762,017,002.13 | 744,599,412.78 |
| 债券投资 | | 3,101,760.00 | 0.00 |
| 衍生金融资产 | 七(二) | 1,413,008.06 | 0.00 |
| 应收证券清算款 | | 0.00 | 8,242,523.85 |
| 应收利息 | 七(三) | 71,669.11 | 28,864.31 |
| 应收申购款 | | 5,436,682.18 | 104,158.04 |
| 资产总计 | | 3,020,168,946.82 | 851,260,942.79 |
| 负债和所有者权益 | | | |
| 负 债 | | | |
| 应付证券清算款 | | 45,397,778.87 | 0.00 |
| 应付赎回款 | | 19,221,489.26 | 1,740,846.73 |
| 应付管理人报酬 | | 3,562,510.67 | 1,020,152.58 |
| 应付托管费 | | 475,001.41 | 136,020.31 |
| 应付交易费用 | 七(四) | 2,709,975.30 | 715,765.65 |
| 其他负债 | 七(五) | 675,321.48 | 598,718.83 |
| 负债合计 | | 72,042,076.99 | 4,211,504.10 |
| 所有者权益 | | | |
| 实收基金 | 七(六) | 1,809,138,385.58 | 479,068,561.67 |
| 未分配利润 | | 1,138,988,484.25 | 367,980,877.02 |
| 所有者权益合计 | | 2,948,126,869.83 | 847,049,438.69 |
| 负债和所有者权益总计 | | 3,020,168,946.82 | 851,260,942.79 |
| 基金份额总额（份） | 七(六) | 1,809,138,385.58 | 479,068,561.67 |

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

二、利润表

长盛动态精选证券投资基金利润表

(除特别注明外, 金额单位为人民币元)

| 项 目 | 附注 | 2007年度 | 2006年度 |
|----------------|-------|-------------------------|-----------------------|
| 收入 | | | |
| 利息收入 | | 7,838,225.05 | 2,209,897.70 |
| 其中: 存款利息收入 | | 4,090,752.22 | 1,094,769.07 |
| 债券利息收入 | | 3,747,472.83 | 1,113,326.63 |
| 买入返售金融资产收入 | | 0.00 | 1,802.00 |
| 投资收益 | | 1,313,348,219.67 | 580,495,327.41 |
| 其中: 股票投资收益 | 七(七) | 1,296,793,889.63 | 547,613,093.28 |
| 债券投资收益 | 七(八) | -953,483.26 | 504,715.39 |
| 衍生工具收益 | 七(九) | 0.00 | 21,005,487.54 |
| 股利收益 | | 17,507,813.30 | 11,372,031.20 |
| 公允价值变动收益 | 七(十) | 38,411,755.63 | 225,790,289.89 |
| 其他收入 | 七(十一) | 3,863,345.85 | 2,349,605.38 |
| 收入合计 | | 1,363,461,546.20 | 810,845,120.38 |
| 费用 | | | |
| 管理人报酬 | | 32,678,569.28 | 14,270,961.92 |
| 托管费 | | 4,357,142.56 | 1,902,794.89 |
| 交易费用 | 七(十二) | 39,677,926.86 | 6,860,817.58 |
| 利息支出 | | 738,669.47 | 0.00 |
| 其中: 卖出回购金融资产支出 | | 738,669.47 | 0.00 |
| 其他费用 | 七(十三) | 378,750.00 | 406,588.99 |
| 费用合计 | | 77,831,058.17 | 23,441,163.38 |
| 利润总额 | | 1,285,630,488.03 | 787,403,957.00 |

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

三、所有者权益(基金净值)变动表

长盛动态精选证券投资基金所有者权益(基金净值)变动表

(除特别注明外, 金额单位为人民币元)

| 项 目 | 2007年度 | | |
|--------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 年初所有者权益(基金净值) | 479,068,561.67 | 367,980,877.02 | 847,049,438.69 |
| 本年经营活动产生的基金净值变动数(本年净利润) | 0.00 | 1,285,630,488.03 | 1,285,630,488.03 |
| 本年基金份额交易产生的基金净值变动数 | 1,330,069,823.91 | 241,116,679.23 | 1,571,186,503.14 |
| 其中: 基金申购款 | 3,858,447,439.95 | 1,111,629,049.55 | 4,970,076,489.50 |
| 基金赎回款 | -2,528,377,616.04 | -870,512,370.32 | -3,398,889,986.36 |
| 本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数 | 0.00 | -755,739,560.03 | -755,739,560.03 |
| 年末所有者权益(基金净值) | 1,809,138,385.58 | 1,138,988,484.25 | 2,948,126,869.83 |
| 项 目 | 2006年度 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 年初所有者权益(基金净值) | 2,351,575,395.95 | -10,607,525.90 | 2,340,967,870.05 |
| 本年经营活动产生的基金净值变动数(本年净利润) | 0.00 | 787,403,957.00 | 787,403,957.00 |
| 本年基金份额交易产生的基金净值变动数 | -1,872,506,834.28 | -133,578,362.47 | -2,006,085,196.75 |
| 其中: 基金申购款 | 642,762,209.48 | 257,420,211.46 | 900,182,420.94 |
| 基金赎回款 | -2,515,269,043.76 | -390,998,573.93 | -2,906,267,617.69 |
| 本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数 | 0.00 | -275,237,191.61 | -275,237,191.61 |

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

第二节 年度会计报表附注（经审计）

一、本基金的基本情况

长盛动态精选证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2004]第35号《关于同意长盛动态精选证券投资基金设立的批复》核准，由长盛基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《长盛动态精选证券投资基金基金契约》（后更名为《长盛动态精选证券投资基金基金合同》）发起，并于2004年5月21日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集4,105,260,456.17元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2004)第79号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长盛动态精选证券投资基金基金合同》于2004年5月21日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为4,108,187,244.80份基金份额，其中认购资金利息折合2,926,788.63份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《长盛动态精选证券投资基金基金合同》和最近公布的《长盛动态精选证券投资基金更新招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法发行、上市或拟上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。其中股票投资占基金资产净值的比例为20%-95%，现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。本基金的业绩比较基准为：中信综合指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于2008年3月21日批准报出。

二、财务报表的编制基础

本基金原以2006年2月15日以前颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》和《证券投资基金会计核算办法》（以下合称“原会计准则和制度”）、《长盛动态精选证券投资基金基金合同》以及中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制财务报表。自2007年7月1日起，本基金开始执行财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）和中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》。2007年度/财务报表为本基金首份按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛动态精选证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注四所列示的基金行业实务操作的规定编制的年度财务报表。

在编制2007年度财务报表时，2006年度以及2007年1月1日至2007年6月30日止期间的相关数字已按照《企业会计准则第38号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整，涉及的主要内容包括：将所持有的股票投资、债券投资和权证投资等划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值调整账面价值，且将原计入所有者权益的公允价值变动计入当期损益。

本财务报表所有报表项目已按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》重新列报。按原会计准则和制度列报的2006年1月1日、2006年12月31日和2007年6月30日的所有者权益，以及2006年度和2007年1月1日至2007年6月30日止期间的净损益调整为按企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》列报的所有者权益及净损益的金额调节过程列示于本财务报表附注十。

三、遵循企业会计准则的声明

本基金2007年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2007年12月31日的财务状况以及2007年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

四、重要会计政策和会计估计

（一）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。

（二）记账本位币：本基金的记账本位币为人民币。

（三）金融资产和金融负债的分类及抵销

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

（四）基金资产的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。本基金以上述原则确定的公允价值进行基金资产估值，主要资产的估值方法如下：

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；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

首次公开发行有明确锁定期的股票，在同一股票上市交易后，在锁定期内按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

由于送股、转增股、配股和公开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。

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；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

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估

值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按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；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

银行间同业市场交易的债券按采用估值技术确定的公允价值估值。

未上市流通的债券按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

3、权证投资

从获赠确认日、买入交易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交易日或行权日止，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；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次发行未上市交易的权证投资按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值；因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。

4、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，本基金的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。

（五）证券投资基金成本计价方法

1、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

（1）股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。2007年7月1日之前，股票投资成本按交易日应支付的全部价款确认，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；自2007年7月1日起，股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。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于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

（2）债券投资

2007年7月1日之前，买入证券交易所交易的债券于交易日确认为债券投资；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。债券投资成本按交易日应支付的全部价款并扣除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)后的金额确认，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额。

自2007年7月1日起，买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益，上述公允价值不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)。

认购新发行的分离交易可转债于交易日按支付的全部价款确认为债券投资，后于权证实际取得日按附注四(五)1、(3)所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

卖出证券交易所交易的债券于交易日确认债券差价收入/(损失)。2007年7月1日之前，卖出银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认债券投资收益/(损失)；自2007年7月1日起，卖出银行间同业市场交易的债券于交易日确认债券投资收益/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

（3）权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。2007年7月1日之前，权证投资成本按交易日应支付的全部价款确认，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；自2007年7月1日起，权证投资成本按交易日权证的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本。获赠权证(包括配股权证)在除权日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

2、贷款和应收款项

2007年7月1日之前，贷款和应收款项按实际支付或应收取的金额入账，并采用名义利率法确认相关的利息收入，其中买入返售金融资产以协议融出资金额作为入账金额；自2007年7月1日起，贷款和应收款项以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额。

3、其他金融负债

2007年7月1日之前，其他金融负债按实际收取或应支付的金额入账，并采用名义利率法确认负债相关的利息支出，其中卖出回购金融资产款以协议融入资金额作为入账金额；自2007年7月1日起，其他金融负债以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额。

（六）收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益/(损失)于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日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确认。

债券利息收入按债券票面价值与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，在债券实际持有期内逐日确认。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，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确认利息收入。自2007年7月1日起，若票面利率与实际利率出现重大差异则按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

2007年7月1日之前，买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额在回购期内按直线法逐日确认；自2007年7月1日起，买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认。

（七）费用的确认和计量

本基金的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。

本基金的托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率逐日计提。

于2007年7月1日之前，卖出回购金融资产支出按协议金额与协议利率在回购期内以直线法逐日计提；自2007年7月1日起，卖出回购金融资

产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

(八) 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

(九) 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现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累计未实现利得/(损失)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利润/(累计亏损)。

(十) 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权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；基金可分配收益不包括基金经营活动产生的未实现收益以及基金份额交易产生的未实现平准金等未实现部分。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。

基金收益分配后，基金份额净值不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

五、主要税项

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《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：

(一) 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。

(二) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(三) 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，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%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。

(四) 基金买卖股票于2007年5月30日之前按照0.1%的税率缴纳股票交易印花税，自2007年5月30日起按0.3%的税率缴纳。

(五) 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。

六、重大关联方关系及关联交易

(一) 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 | 与本基金的关系 |
|--------------------|------------------------|
| 长盛基金管理有限公司(“长盛基金”) | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国农业银行 | 基金托管人、基金代销机构 |
| 国元证券 | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 新加坡星展资产管理有限公司 | 基金管理人的股东(自2007年4月19日起) |
| 安徽省创新投资有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 安徽省投资集团有限责任公司 | 基金管理人的股东 |

根据长盛基金于2007年4月19日发布的公告，经公司股东会审议通过，并报经中国证监会证监基金字[2007]115号文批准，公司股东国元证券、安徽省创新投资有限公司、安徽省投资集团有限责任公司分别将其持有的长盛基金8%、13%、12%的股权转让给新加坡星展资产管理有限公司。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(二) 关联方交易

1、通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

| 关联方名称 | 2007年度 | | 2006年度 | |
|-------|------------------|------------|----------------|------------|
| | 成交量(人民币元) | 占全年成交量的比例 | 成交量(人民币元) | 占全年成交量的比例 |
| 国元证券 | | | | |
| 买卖股票 | 3,641,310,220.22 | 31.53% | 823,060,158.06 | 24.60% |
| 买卖债券 | 0.00 | 0.00% | 25,252,056.1 | 12.39% |
| 买卖权证 | 0.00 | 0.00% | 21,005,487.54 | 100.00% |
| 关联方名称 | 佣金(人民币元) | 占全年佣金总量的比例 | 佣金(人民币元) | 占全年佣金总量的比例 |
| 国元证券 | 2,969,803.01 | 31.94% | 667,793.69 | 24.70% |

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的证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务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) 管理人报酬

支付基金管理人长盛基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

本基金在本年度需支付管理人报酬32,678,569.28元(2006年：14,270,961.92元)

(2) 托管人报酬

支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.2%/当年天数。

本基金在本年度需支付托管费4,357,142.56元（2006年：1,902,794.89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农业银行保管，并按银行同业利率计息。基金托管人于2007年12月31日保管的银行存款余额244,074,496.59元（2006年12月31日：95,834,012.65元）。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为3,909,489.09元（2006年：1,068,225.81元）。

4、与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易：无。

5、关联方持有的基金份额

（1）基金管理人所持有的本基金份额：本基金管理人于2007年、2006年的报告期末和报告期内均未持有本基金份额。

（2）基金其他关联方及其控制的机构所持有的本基金份额

基金其他关联方及其控制的机构于2007年、2006年的报告期末和报告期内均未持有本基金份额。

七、本基金会计报表重要项目说明

（一）交易性金融资产

单位：人民币元

| | 2007年12月31日 | | |
|--------|-------------------------|-------------------------|-----------------------|
| | 成本 | 公允价值 | 估值增值 |
| 股票投资 | 2,348,670,169.84 | 2,762,017,002.13 | 413,346,832.29 |
| 债券投资 | 3,078,765.69 | 3,101,760.00 | 22,994.31 |
| —交易所市场 | 3,078,765.69 | 3,101,760.00 | 22,994.31 |
| | 2,351,748,935.53 | 2,765,118,762.13 | 413,369,826.60 |

| | 2006年12月31日 | | |
|------|----------------|----------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 估值增值 |
| 股票投资 | 369,469,568.06 | 744,599,412.78 | 375,129,844.72 |

（二）衍生金融资产

单位：人民币元

| | 2007年12月31日 | | |
|------|--------------|--------------|------------|
| | 成本 | 公允价值 | 估值增值 |
| 权证投资 | 1,241,234.31 | 1,413,008.06 | 171,773.75 |

于2006年12月31日，本基金未持有衍生金融资产。

（三）应收利息

单位：人民币元

| | 2007年12月31日 | 2006年12月31日 |
|-----------|------------------|------------------|
| 应收银行存款利息 | 69,197.39 | 28,210.91 |
| 应收结算备付金利息 | 1,280.00 | 446.40 |
| 应收债券利息 | 984.72 | 0.00 |
| 应收存出保证金利息 | 207.00 | 207.00 |
| 合计 | 71,669.11 | 28,864.31 |

（四）应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 2007年12月31日 | 2006年12月31日 |
|-------------|---------------------|-------------------|
| 应付交易所交易佣金 | 2,709,975.30 | 715,565.65 |
| 应付银行间市场交易费用 | 0.00 | 200.00 |
| 合计 | 2,709,975.30 | 715,765.65 |

（五）其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 2007年12月31日 | 2006年12月31日 |
|-----------|-------------------|-------------------|
| 应付券商席位保证金 | 500,000.00 | 500,000.00 |
| 预提费用 | 90,000.00 | 95,000.00 |
| 应付赎回费 | 85,321.48 | 3,718.83 |
| 合计 | 675,321.48 | 598,718.83 |

（六）实收基金

单位：人民币元

| | 基金份额总额 | 实收基金 |
|-------------|-------------------|-------------------|
| 2006年12月31日 | 479,068,561.67 | 479,068,561.67 |
| 本年申购 | 3,858,447,439.95 | 3,858,447,439.95 |
| 其中：红利再投资 | 258,656,184.86 | 258,656,184.86 |
| 本年赎回 | -2,528,377,616.04 | -2,528,377,616.04 |

(七) 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 2007年度 | 2006年度 |
|---------------|-----------------------------|--------------------------|
| 卖出股票成交金额 | 5, 442, 143, 745. 63 | 2, 590, 334, 415. 41 |
| 减：卖出股票成本总额 | 4, 145, 349, 856. 00 | 2, 042, 721, 322. 13 |
| 股票投资收益 | 1, 296, 793, 889. 63 | 547, 613, 093. 28 |

本基金于本年度未获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价(2006年度：6, 170, 193. 42元，已全额冲减股票投资成本)。

(八) 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 2007年度 | 2006年度 |
|-----------------|----------------------|---------------------|
| 卖出及到期兑付债券结算金额 | 672, 252, 356. 90 | 284, 912, 600. 42 |
| 减：卖出及到期兑付债券成本总额 | 665, 638, 091. 78 | 278, 466, 919. 84 |
| 减：应收利息总额 | 7, 567, 748. 38 | 5, 940, 965. 19 |
| 债券投资收益 | -953, 483. 26 | 504, 715. 39 |

(九) 衍生工具收益

本基金于本年度内尚未卖出权证，因此无衍生工具收益(2006年度：均为卖出获赠权证获得的收入，因此无相应可结转成本)。

(十) 公允价值变动损益

单位：人民币元

| | 2007年度 | 2006年度 |
|---------|-------------------------|--------------------------|
| 交易性金融资产 | | |
| — 股票投资 | 38, 216, 987. 57 | 226, 594, 402. 64 |
| — 债券投资 | 22, 994. 31 | -804, 112. 75 |
| 衍生工具 | | |
| — 权证投资 | 171, 773. 75 | 0. 00 |
| | 38, 411, 755. 63 | 225, 790, 289. 89 |

(十一) 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 2007年度 | 2006年度 |
|-------------|------------------------|------------------------|
| 赎回基金补偿收入(1) | 3, 828, 805. 28 | 2, 347, 962. 90 |
| 转换基金补偿收入(2) | 31, 626. 57 | 1, 642. 48 |
| 其他 | 2, 914. 00 | 0. 00 |
| 合计 | 3, 863, 345. 85 | 2, 349, 605. 38 |

1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

2、本基金的转换费总额的16. 67%归入转出基金的基金资产。

(十二) 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 2007年度 | 2006年度 |
|-------------|-------------------------|------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 39, 666, 897. 91 | 6, 860, 617. 58 |
| 银行间同业市场交易费用 | 11, 028. 95 | 200. 00 |
| 合计 | 39, 677, 926. 86 | 6, 860, 817. 58 |

(十三) 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 2007年度 | 2006年度 |
|-----------|---------------------|---------------------|
| 信息披露费 | 270, 000. 00 | 270, 000. 00 |
| 审计费用 | 90, 000. 00 | 95, 000. 00 |
| 债券托管账户维护费 | 18, 750. 00 | 31, 370. 00 |
| 银行手续费 | 0. 00 | 10, 218. 99 |
| 合计 | 378, 750. 00 | 406, 588. 99 |

(十四) 收益分配

单位：人民币元

| | 登记日 | 分红率 | 现金形式发放 | 再投资形式发放 | 发放红利合计 |
|--------|-----------|----------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 2007年度 | | | | | |
| 第一次分红 | 2007-2-7 | 每10份基金份额5. 80元 | 206, 826, 595. 94 | 77, 079, 617. 77 | 283, 906, 213. 71 |
| 第二次分红 | 2007-4-23 | 每10份基金份额7. 50元 | 245, 968, 545. 31 | 225, 864, 801. 01 | 471, 833, 346. 32 |
| | | | 452, 795, 141. 25 | 302, 944, 418. 78 | 755, 739, 560. 03 |

八、报告期末流通转让受到限制的基金资产

(一) 流通受限制不能自由转让的债券

基金认购新发行的分离交易可转债而取得的债券，从债券认购日至债券上市日期间暂无法流通。本基金截至2007年12月31日止流通受限制的债券情况如下：

单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 成功认购日期 | 可流通日期 | 单位成本 | 年末估值单价 | 认购数量(张) | 年末成本总额 | 年末估值总额 |
|--------|-------|----------|----------|-------|--------|---------|--------------|--------------|
| 126008 | 08上汽债 | 07/12/19 | 08/01/08 | 71.27 | 71.80 | 43,200 | 3,078,765.69 | 3,101,760.00 |

(二) 流通受限制不能自由转让的权证

基金认购新发行的分离交易可转债而取得的权证，从权证实际取得日至权证上市日期间暂无法流通。本基金截至2007年12月31日止流通受限制的权证情况如下：

单位：人民币元

| 权证代码 | 权证名称 | 成功送配日期 | 可流通日期 | 认购价格 | 年末估值单价 | 送配数量(份) | 年末成本总额 | 年末估值总额 |
|--------|--------|----------|----------|------|--------|---------|--------------|--------------|
| 580016 | 上汽CWB1 | 07/12/19 | 08/01/08 | 7.98 | 9.0857 | 155,520 | 1,241,234.31 | 1,413,008.06 |

九、风险管理

(一) 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本公司奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与金融工程部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与金融工程部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

(二) 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

(三) 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注八中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

(四) 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

1、市场价格风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资比例占基金资产净值的20-95%，现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。于2007年12月31日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下

单位：人民币元

| | 2007年12月31日 | | 2006年12月31日 | |
|----------------|-------------------------|---------------|-----------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值的比例 | 公允价值 | 占基金资产净值的比例 |
| 交易性金融资产 | | | | |
| - 股票投资 | 2,762,017,002.13 | 93.69% | 744,599,412.78 | 87.91% |
| - 债券投资 | 3,101,760.00 | 0.11% | 0.00 | 0.00 |
| 衍生金融资产 | | | | |
| - 权证投资 | 1,413,008.06 | 0.05% | 0.00 | 0.00 |
| | 2,766,531,770.19 | 93.85% | 744,599,412.78 | 87.91% |

于2007年12月31日，若本基金业绩比较基准(附注一)上升5%且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将相应增加约11,163万元(2006年：3,707万元)；反之，若本基金业绩比较基准(附注一)下降5%且其他市场变量保持不变，本基金资产净值则将相应下降约11,163万元(2006年：3,707万元)。

2、利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

单位：人民币元

| 2007年12月31日 | 1年以内 | 1至5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|----------------|-----------------------|-------------|---------------------|-------------------------|-------------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 244,074,496.59 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 244,074,496.59 |
| 结算备付金 | 2,844,328.75 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 2,844,328.75 |
| 存出保证金 | 160,000.00 | 0.00 | 0.00 | 1,050,000.00 | 1,210,000.00 |
| 交易性金融资产 | 0.00 | 0.00 | 3,101,760.00 | 2,762,017,002.13 | 2,765,118,762.13 |
| 衍生金融资产 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 1,413,008.06 | 1,413,008.06 |
| 应收利息 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 71,669.11 | 71,669.11 |
| 应收申购款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 5,436,682.18 | 5,436,682.18 |
| 资产总计 | 247,078,825.34 | 0.00 | 3,101,760.00 | 2,769,988,361.48 | 3,020,168,946.82 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 45,397,778.87 | 45,397,778.87 |
| 应付赎回款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 19,221,489.26 | 19,221,489.26 |
| 应付管理人报酬 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 3,562,510.67 | 3,562,510.67 |
| 应付托管费 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 475,001.41 | 475,001.41 |
| 应付交易费用 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 2,709,975.30 | 2,709,975.30 |
| 其他负债 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 675,321.48 | 675,321.48 |
| 负债总计 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 72,042,076.99 | 72,042,076.99 |
| 利率敏感度缺口 | 247,078,825.34 | 0.00 | 3,101,760.00 | 2,697,946,284.49 | 2,948,126,869.83 |
| 2006年12月31日 | 1年以内 | 1至5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 95,834,012.65 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 95,834,012.65 |
| 结算备付金 | 991,971.16 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 991,971.16 |
| 存出保证金 | 160,000.00 | 0.00 | 0.00 | 1,300,000.00 | 1,460,000.00 |
| 交易性金融资产 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 744,599,412.78 | 744,599,412.78 |
| 应收证券清算款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 8,242,523.85 | 8,242,523.85 |
| 应收利息 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 28,864.31 | 28,864.31 |
| 应收申购款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 104,158.04 | 104,158.04 |
| 资产总计 | 96,985,983.81 | 0.00 | 0.00 | 754,274,958.98 | 851,260,942.79 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 1,740,846.73 | 1,740,846.73 |
| 应付管理人报酬 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 1,020,152.58 | 1,020,152.58 |
| 应付托管费 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 136,020.31 | 136,020.31 |
| 应付交易费用 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 715,765.65 | 715,765.65 |
| 其他负债 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 598,718.83 | 598,718.83 |
| 负债总计 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 4,211,504.10 | 4,211,504.10 |
| 利率敏感度缺口 | 96,985,983.81 | 0.00 | 0.00 | 750,063,454.88 | 847,049,438.69 |

于2007年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产的比例低于1%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2006年：同)。

3、外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

十、首次执行企业准则

如附注二所述，本财务报表为本基金首份按照企业会计准则编制的财务报表。2006年度和2007年1月1日至2007年6月30日止期间的相关数字已按照《企业会计准则第38号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整，所有报表项目已按照本财务报表的披露方式进行了重分类。

按原会计准则和制度列报的2006年1月1日、2006年12月31日和2007年6月30日的所有者权益，以及2006年度和2007年1月1日至2007年6月30日止期间的净损益调整为按企业会计准则列报的所有者权益及净损益的调节过程列示如下

下

单位：人民币元

| | 2006年1月1日 所有者权益 | 2006年度 净损益/利润总额 | 2006年12月31日 所有者权益 |
|-----------------------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| 按原会计准则和制度列报的金额 | 2,340,967,870.05 | 561,613,667.11 | 847,049,438.69 |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产(附注二) | 0.00 | 225,790,289.89 | 0.00 |
| 按企业会计准则列报的金额 | 2,340,967,870.05 | 787,403,957.00 | 847,049,438.69 |
| | 2007年1月1日 所有者权益 | 2007年1月1日至2007年6月30日止期间净损益/利润总额 | 2007年6月30日 所有者权益 |

| | | (未经审计) | (未经审计) |
|-----------------------------|----------------|-----------------|------------------|
| 按原会计准则和制度列报的金额 | 847,049,438.69 | 625,146,385.56 | 3,015,214,560.29 |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产(附注二) | 0.00 | -151,807,286.55 | 0.00 |
| 按企业会计准则列报的金额 | 847,049,438.69 | 473,339,099.01 | 3,015,214,560.29 |

根据上述追溯调整，按原会计准则和制度直接记入所有者权益下“未实现利得/(损失)”科目的投资估值增值/(减值)净变动现按企业会计准则在利润表中的“公允价值变动收益/(损失)”科目中核算，相应的未实现损益平准金现按企业会计准则直接记入“未分配利润/(累计亏损)”科目。于会计期末，按原会计准则和制度列示于所有者权益下“未实现利得/(损失)”科目中的全部余额，现按企业会计准则包含于“未分配利润/(累计亏损)”科目中。

第七章 投资组合报告

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 | 2,762,017,002.13 | 91.45% |
| 债券市值 | 3,101,760.00 | 0.10% |
| 权证市值 | 1,413,008.06 | 0.05% |
| 资产支持证券 | 0.00 | 0.00% |
| 银行存款和结算备付金 | 246,918,825.34 | 8.18% |
| 其他资产 | 6,718,351.29 | 0.22% |
| 合计 | 3,020,168,946.82 | 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 | 289,998,888.02 | 9.84% |
| C 制造业 | 817,139,591.97 | 27.72% |
| C0 食品、饮料 | 131,816,345.77 | 4.47% |
| 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 | 0.00 | 0.00% |
| C5 电子 | 0.00 | 0.00% |
| C6 金属、非金属 | 169,415,000.00 | 5.75% |
| C7 机械、设备、仪表 | 381,668,246.20 | 12.95% |
| C8 医药、生物制品 | 134,240,000.00 | 4.55% |
| C99 其他制造业 | 0.00 | 0.00% |
| D 电力、煤气及水的生产和供应业 | 148,574,047.64 | 5.04% |
| E 建筑业 | 180,835,618.68 | 6.13% |
| F 交通运输、仓储业 | 391,034,445.56 | 13.26% |
| G 信息技术业 | 181,206,369.00 | 6.15% |
| H 批发和零售贸易 | 170,255,621.26 | 5.77% |
| I 金融、保险业 | 487,091,482.00 | 16.52% |
| J 房地产业 | 57,685,438.00 | 1.96% |
| K 社会服务业 | 38,195,500.00 | 1.30% |
| L 传播与文化产业 | 0.00 | 0.00% |
| M 综合类 | 0.00 | 0.00% |
| 合计 | 2,762,017,002.13 | 93.69% |

三、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

| 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 | 600050 | 中国联通 | 15,000,000 | 181,200,000.00 | 6.15% |
| 2 | 000768 | 西飞国际 | 3,999,826 | 146,393,631.60 | 4.97% |
| 3 | 601111 | 中国国航 | 5,000,000 | 137,200,000.00 | 4.65% |
| 4 | 600062 | 双鹤药业 | 4,000,000 | 134,240,000.00 | 4.55% |
| 5 | 600028 | 中国石化 | 5,499,970 | 128,864,297.10 | 4.37% |
| 6 | 601006 | 大秦铁路 | 5,000,000 | 128,100,000.00 | 4.35% |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 3,000,000 | 118,890,000.00 | 4.03% |
| 8 | 600104 | 上海汽车 | 4,400,000 | 115,676,000.00 | 3.92% |
| 9 | 601398 | 工商银行 | 14,000,000 | 113,820,000.00 | 3.86% |
| 10 | 000759 | 武汉中百 | 5,900,000 | 110,920,000.00 | 3.76% |
| 11 | 600820 | 隧道股份 | 6,997,404 | 106,150,618.68 | 3.60% |
| 12 | 601318 | 中国平安 | 1,000,000 | 106,100,000.00 | 3.60% |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|-------|
| 13 | 601088 | 中国神华 | 1,500,000 | 98,415,000.00 | 3.34% |
| 14 | 600900 | 长江电力 | 4,500,000 | 87,705,000.00 | 2.97% |
| 15 | 600019 | 宝钢股份 | 5,000,000 | 87,200,000.00 | 2.96% |
| 16 | 000878 | 云南铜业 | 1,500,000 | 82,215,000.00 | 2.79% |
| 17 | 601390 | 中国中铁 | 6,500,000 | 74,685,000.00 | 2.53% |
| 18 | 000858 | 五粮液 | 1,509,884 | 68,669,524.32 | 2.33% |
| 19 | 601919 | 中国远洋 | 1,500,000 | 63,990,000.00 | 2.17% |
| 20 | 000729 | 燕京啤酒 | 2,999,849 | 63,146,821.45 | 2.14% |
| 21 | 600875 | 东方电气 | 699,788 | 62,281,132.00 | 2.11% |
| 22 | 600087 | 南京水运 | 2,596,102 | 61,735,305.56 | 2.09% |
| 23 | 600795 | 国电电力 | 3,490,106 | 60,867,448.64 | 2.06% |
| 24 | 600511 | 国药股份 | 999,889 | 59,333,413.26 | 2.01% |
| 25 | 601939 | 建设银行 | 6,000,000 | 59,100,000.00 | 2.00% |
| 26 | 601628 | 中国人寿 | 1,000,000 | 57,940,000.00 | 1.97% |
| 27 | 000002 | 万科A | 2,000,100 | 57,682,884.00 | 1.96% |
| 28 | 000800 | 一汽轿车 | 2,999,996 | 57,299,923.60 | 1.94% |
| 29 | 002183 | 怡亚通 | 490,000 | 38,195,500.00 | 1.30% |
| 30 | 000983 | 西山煤电 | 500,100 | 31,741,347.00 | 1.08% |
| 31 | 601328 | 交通银行 | 2,000,000 | 31,240,000.00 | 1.06% |
| 32 | 601857 | 中国石油 | 999,952 | 30,958,513.92 | 1.05% |
| 33 | 002152 | 广电运通 | 100 | 10,751.00 | 0.00% |
| 34 | 601699 | 潞安环能 | 100 | 7,177.00 | 0.00% |
| 35 | 000063 | 中兴通讯 | 100 | 6,369.00 | 0.00% |
| 36 | 600348 | 国阳新能 | 100 | 5,352.00 | 0.00% |
| 37 | 600997 | 开滦股份 | 100 | 4,390.00 | 0.00% |
| 38 | 600835 | 上海机电 | 100 | 2,987.00 | 0.00% |
| 39 | 000937 | 金牛能源 | 100 | 2,811.00 | 0.00% |
| 40 | 600029 | 南方航空 | 100 | 2,794.00 | 0.00% |
| 41 | 600717 | 天津港 | 100 | 2,740.00 | 0.00% |
| 42 | 000022 | 深赤湾A | 100 | 2,666.00 | 0.00% |
| 43 | 000031 | 中粮地产 | 100 | 2,554.00 | 0.00% |
| 44 | 600500 | 中化国际 | 100 | 2,208.00 | 0.00% |
| 45 | 000680 | 山推股份 | 100 | 1,945.00 | 0.00% |
| 46 | 000625 | 长安汽车 | 100 | 1,876.00 | 0.00% |
| 47 | 600121 | 郑州煤电 | 100 | 1,599.00 | 0.00% |
| 48 | 600016 | 民生银行 | 100 | 1,482.00 | 0.00% |
| 49 | 601333 | 广深铁路 | 100 | 940.00 | 0.00% |

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初基金资产净值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) | 占期初基金资产净值的比例 |
|----|--------|------|----------------|--------------|
| 1 | 000002 | 万科A | 232,248,345.77 | 27.42% |
| 2 | 601628 | 中国人寿 | 162,932,835.14 | 19.24% |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 155,220,902.09 | 18.32% |
| 4 | 601398 | 工商银行 | 152,847,827.85 | 18.04% |
| 5 | 000768 | 西飞国际 | 151,889,152.94 | 17.93% |
| 6 | 600026 | 中海发展 | 145,927,457.74 | 17.23% |
| 7 | 601088 | 中国神华 | 141,955,303.92 | 16.76% |
| 8 | 600050 | 中国联通 | 138,016,982.64 | 16.29% |
| 9 | 601006 | 大秦铁路 | 134,640,706.85 | 15.90% |
| 10 | 600019 | 宝钢股份 | 131,739,629.00 | 15.55% |
| 11 | 601111 | 中国国航 | 130,077,877.90 | 15.36% |
| 12 | 600104 | 上海汽车 | 126,421,217.66 | 14.92% |
| 13 | 600036 | 招商银行 | 126,013,959.07 | 14.88% |
| 14 | 600795 | 国电电力 | 121,657,487.99 | 14.36% |
| 15 | 000878 | 云南铜业 | 113,289,760.71 | 13.37% |
| 16 | 600820 | 隧道股份 | 112,991,317.82 | 13.34% |
| 17 | 600062 | 双鹤药业 | 109,642,890.84 | 12.94% |
| 18 | 000759 | 武汉中百 | 109,274,703.60 | 12.90% |
| 19 | 000983 | 西山煤电 | 103,088,820.60 | 12.17% |
| 20 | 600087 | 南京水运 | 99,944,417.14 | 11.80% |
| 21 | 000422 | 湖北宜化 | 95,613,849.43 | 11.29% |
| 22 | 000800 | 一汽轿车 | 95,466,430.92 | 11.27% |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|--------|
| 23 | 601939 | 建设银行 | 94,876,081.80 | 11.20% |
| 24 | 600028 | 中国石化 | 94,499,353.09 | 11.16% |
| 25 | 000709 | 唐钢股份 | 82,889,864.32 | 9.79% |
| 26 | 000528 | 柳工 | 79,925,386.82 | 9.44% |
| 27 | 601919 | 中国远洋 | 79,647,259.75 | 9.40% |
| 28 | 002106 | 莱宝高科 | 76,281,113.84 | 9.01% |
| 29 | 000063 | 中兴通讯 | 73,502,032.00 | 8.68% |
| 30 | 000625 | 长安汽车 | 71,678,664.75 | 8.46% |
| 31 | 600900 | 长江电力 | 70,487,528.72 | 8.32% |
| 32 | 000858 | 五粮液 | 69,508,146.21 | 8.21% |
| 33 | 000680 | 山推股份 | 68,738,389.43 | 8.12% |
| 34 | 600016 | 民生银行 | 67,605,506.62 | 7.98% |
| 35 | 002078 | 太阳纸业 | 64,962,843.86 | 7.67% |
| 36 | 601333 | 广深铁路 | 63,787,392.73 | 7.53% |
| 37 | 601328 | 交通银行 | 63,753,370.05 | 7.53% |
| 38 | 601699 | 潞安环能 | 61,253,291.71 | 7.23% |
| 39 | 000550 | 江铃汽车 | 61,173,728.20 | 7.22% |
| 40 | 600875 | 东方电气 | 60,951,162.75 | 7.20% |
| 41 | 600018 | 上港集团 | 59,465,258.13 | 7.02% |
| 42 | 600835 | 上海机电 | 57,560,998.97 | 6.80% |
| 43 | 600010 | 包钢股份 | 55,932,149.78 | 6.60% |
| 44 | 600029 | 南方航空 | 54,282,696.90 | 6.41% |
| 45 | 601390 | 中国中铁 | 53,970,309.63 | 6.37% |
| 46 | 600631 | 百联股份 | 53,476,117.26 | 6.31% |
| 47 | 600849 | 上海医药 | 52,904,237.25 | 6.25% |
| 48 | 600697 | 欧亚集团 | 51,816,023.56 | 6.12% |
| 49 | 600270 | 外运发展 | 51,581,923.64 | 6.09% |
| 50 | 600511 | 国药股份 | 51,467,568.58 | 6.08% |
| 51 | 000897 | 津滨发展 | 50,455,724.68 | 5.96% |
| 52 | 000729 | 燕京啤酒 | 50,358,679.40 | 5.95% |
| 53 | 002155 | 辰州矿业 | 49,571,512.97 | 5.85% |
| 54 | 600997 | 开滦股份 | 48,395,779.46 | 5.71% |
| 55 | 600348 | 国阳新能 | 47,339,947.62 | 5.59% |
| 56 | 600055 | 万东医疗 | 46,055,369.56 | 5.44% |
| 57 | 600017 | 日照港 | 44,692,193.03 | 5.28% |
| 58 | 600001 | 邯郸钢铁 | 43,768,560.95 | 5.17% |
| 59 | 000932 | 华菱管线 | 43,594,337.81 | 5.15% |
| 60 | 000520 | 长航凤凰 | 43,310,979.18 | 5.11% |
| 61 | 000698 | 沈阳化工 | 42,191,534.88 | 4.98% |
| 62 | 002183 | 怡亚通 | 41,323,108.95 | 4.88% |
| 63 | 600717 | 天津港 | 40,551,464.38 | 4.79% |
| 64 | 000059 | 辽通化工 | 39,812,109.03 | 4.70% |
| 65 | 002001 | 新和成 | 39,171,192.77 | 4.62% |
| 66 | 000022 | 深赤湾A | 38,055,456.87 | 4.49% |
| 67 | 000401 | 冀东水泥 | 37,449,872.21 | 4.42% |
| 68 | 000868 | 安凯客车 | 36,488,431.91 | 4.31% |
| 69 | 000959 | 首钢股份 | 35,647,297.68 | 4.21% |
| 70 | 002152 | 广电运通 | 35,046,467.98 | 4.14% |
| 71 | 000031 | 中粮地产 | 34,736,347.95 | 4.10% |
| 72 | 000937 | 金牛能源 | 33,485,457.81 | 3.95% |
| 73 | 600006 | 东风汽车 | 32,575,301.09 | 3.85% |
| 74 | 600710 | 常林股份 | 32,317,562.67 | 3.82% |
| 75 | 600863 | 内蒙华电 | 32,298,532.49 | 3.81% |
| 76 | 601857 | 中国石油 | 31,557,281.15 | 3.73% |
| 77 | 600121 | 郑州煤电 | 29,410,283.85 | 3.47% |
| 78 | 600500 | 中化国际 | 26,957,899.15 | 3.18% |
| 79 | 600377 | 宁沪高速 | 24,194,036.19 | 2.86% |
| 80 | 002031 | 巨轮股份 | 23,069,847.38 | 2.72% |

| | | | | |
|----|--------|-------|---------------|-------|
| 81 | 600269 | 赣粤高速 | 22,428,895.87 | 2.65% |
| 82 | 600089 | 特变电工 | 22,358,002.78 | 2.64% |
| 83 | 600198 | *ST大唐 | 17,832,317.51 | 2.11% |
| 84 | 600350 | 山东高速 | 17,753,050.82 | 2.10% |

(二) 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值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) | 占期初基金资产净值的比例 |
|----|--------|-------|----------------|--------------|
| 1 | 000002 | 万 科 A | 268,526,498.26 | 31.70% |
| 2 | 600026 | 中海发展 | 168,659,396.42 | 19.91% |
| 3 | 000983 | 西山煤电 | 167,725,447.80 | 19.80% |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 167,138,154.34 | 19.73% |
| 5 | 000895 | 双汇发展 | 143,702,309.92 | 16.97% |
| 6 | 601699 | 潞安环能 | 122,381,758.85 | 14.45% |
| 7 | 601628 | 中国人寿 | 113,722,666.36 | 13.43% |
| 8 | 600089 | 特变电工 | 110,441,933.43 | 13.04% |
| 9 | 600019 | 宝钢股份 | 105,709,465.13 | 12.48% |
| 10 | 000680 | 山推股份 | 99,708,096.18 | 11.77% |
| 11 | 600029 | 南方航空 | 95,576,222.65 | 11.28% |
| 12 | 000709 | 唐钢股份 | 90,467,949.59 | 10.68% |
| 13 | 000422 | 湖北宜化 | 87,679,910.65 | 10.35% |
| 14 | 000528 | 柳 工 | 85,118,190.98 | 10.05% |
| 15 | 601006 | 大秦铁路 | 84,642,188.94 | 9.99% |
| 16 | 000063 | 中兴通讯 | 80,971,129.36 | 9.56% |
| 17 | 601919 | 中国远洋 | 79,434,255.67 | 9.38% |
| 18 | 600150 | 中国船舶 | 79,089,997.48 | 9.34% |
| 19 | 600348 | 国阳新能 | 78,231,088.66 | 9.24% |
| 20 | 000550 | 江铃汽车 | 76,622,659.85 | 9.05% |
| 21 | 601398 | 工商银行 | 76,469,896.19 | 9.03% |
| 22 | 600104 | 上海汽车 | 72,551,083.84 | 8.57% |
| 23 | 601318 | 中国平安 | 72,413,176.23 | 8.55% |
| 24 | 002106 | 莱宝高科 | 69,491,563.92 | 8.20% |
| 25 | 600018 | 上港集团 | 67,991,810.40 | 8.03% |
| 26 | 002078 | 太阳纸业 | 67,779,571.25 | 8.00% |
| 27 | 600028 | 中国石化 | 66,717,321.81 | 7.88% |
| 28 | 600795 | 国电电力 | 66,223,609.59 | 7.82% |
| 29 | 600835 | 上海机电 | 65,268,990.00 | 7.71% |
| 30 | 600717 | 天津港 | 62,301,170.81 | 7.36% |
| 31 | 002001 | 新 和 成 | 62,206,158.98 | 7.34% |
| 32 | 600016 | 民生银行 | 61,811,443.88 | 7.30% |
| 33 | 600010 | 包钢股份 | 59,765,557.70 | 7.06% |
| 34 | 000625 | 长安汽车 | 59,601,615.86 | 7.04% |
| 35 | 000858 | 五 粮 液 | 56,687,377.99 | 6.69% |
| 36 | 600849 | 上海医药 | 56,054,513.87 | 6.62% |
| 37 | 600631 | 百联股份 | 54,232,011.75 | 6.40% |
| 38 | 600887 | 伊利股份 | 53,209,441.16 | 6.28% |
| 39 | 601333 | 广深铁路 | 52,974,316.55 | 6.25% |
| 40 | 000878 | 云南铜业 | 52,371,171.39 | 6.18% |
| 41 | 000897 | 津滨发展 | 50,291,655.71 | 5.94% |
| 42 | 600458 | 时代新材 | 49,524,920.65 | 5.85% |
| 43 | 600006 | 东风汽车 | 49,002,376.10 | 5.79% |
| 44 | 600697 | 欧亚集团 | 48,582,420.14 | 5.74% |
| 45 | 000800 | 一汽轿车 | 46,658,628.84 | 5.51% |
| 46 | 600055 | 万东医疗 | 46,492,361.59 | 5.49% |
| 47 | 600270 | 外运发展 | 46,342,764.98 | 5.47% |
| 48 | 002155 | 辰州矿业 | 45,856,499.12 | 5.41% |
| 49 | 600030 | 中信证券 | 45,222,846.75 | 5.34% |
| 50 | 600997 | 开滦股份 | 45,095,138.60 | 5.32% |
| 51 | 600050 | 中国联通 | 43,357,189.63 | 5.12% |
| 52 | 000937 | 金牛能源 | 42,980,577.80 | 5.07% |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 53 | 000410 | 沈阳机床 | 42,167,564.41 | 4.98% |
| 54 | 600017 | 日照港 | 40,410,800.70 | 4.77% |
| 55 | 601939 | 建设银行 | 39,622,948.46 | 4.68% |
| 56 | 000698 | 沈阳化工 | 39,295,589.34 | 4.64% |
| 57 | 600087 | 南京水运 | 39,019,383.55 | 4.61% |
| 58 | 000520 | 长航凤凰 | 38,919,640.94 | 4.59% |
| 59 | 000401 | 冀东水泥 | 38,546,027.69 | 4.55% |
| 60 | 600001 | 邯郸钢铁 | 38,095,886.48 | 4.50% |
| 61 | 600863 | 内蒙华电 | 37,818,349.30 | 4.46% |
| 62 | 000932 | 华菱管线 | 37,497,564.54 | 4.43% |
| 63 | 000022 | 深赤湾A | 37,161,143.53 | 4.39% |
| 64 | 000059 | 辽通化工 | 37,029,373.06 | 4.37% |
| 65 | 601328 | 交通银行 | 35,984,953.41 | 4.25% |
| 66 | 600062 | 双鹤药业 | 35,666,685.37 | 4.21% |
| 67 | 002152 | 广电运通 | 33,383,116.36 | 3.94% |
| 68 | 000768 | 西飞国际 | 32,920,523.87 | 3.89% |
| 69 | 600495 | 晋西车轴 | 32,154,103.81 | 3.80% |
| 70 | 000868 | 安凯客车 | 31,125,230.12 | 3.67% |
| 71 | 000031 | 中粮地产 | 30,608,378.97 | 3.61% |
| 72 | 000959 | 首钢股份 | 29,032,518.68 | 3.43% |
| 73 | 600176 | 中国玻纤 | 27,354,703.68 | 3.23% |
| 74 | 600685 | 广船国际 | 27,305,165.49 | 3.22% |
| 75 | 600710 | 常林股份 | 26,396,328.15 | 3.12% |
| 76 | 601088 | 中国神华 | 26,123,974.36 | 3.08% |
| 77 | 600500 | 中化国际 | 25,297,299.64 | 2.99% |
| 78 | 600121 | 郑州煤电 | 25,067,431.11 | 2.96% |
| 79 | 600100 | 同方股份 | 24,955,201.99 | 2.95% |
| 80 | 600269 | 赣粤高速 | 22,325,053.04 | 2.64% |
| 81 | 600377 | 宁沪高速 | 22,152,335.06 | 2.62% |
| 82 | 000039 | 中集集团 | 21,759,045.26 | 2.57% |
| 83 | 002031 | 巨轮股份 | 21,673,902.81 | 2.56% |
| 84 | 002046 | 轴研科技 | 21,325,671.71 | 2.52% |
| 85 | 600320 | 振华港机 | 20,352,812.38 | 2.40% |
| 86 | 600072 | 中船股份 | 18,868,454.75 | 2.23% |
| 87 | 000930 | 丰原生化 | 18,696,506.01 | 2.21% |
| 88 | 601002 | 晋亿实业 | 18,682,916.98 | 2.21% |
| 89 | 600350 | 山东高速 | 17,989,203.41 | 2.12% |
| 90 | 600528 | 中铁二局 | 17,381,966.86 | 2.05% |

(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 | 6,124,550,457.78 |
| 卖出股票收入总额 | 5,442,143,745.63 |

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 | 0.00 | 0.00% |
| 金 融 债 | 0.00 | 0.00% |
| 央行票据 | 0.00 | 0.00% |
| 企 业 债 | 3,101,760.00 | 0.11% |
| 可 转 债 | 0.00 | 0.00% |
| 债券投资合计 | 3,101,760.00 | 0.11% |

六、报告期末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 | 市值 (人民币元) | 占基金资产净值比例 |
|----|-------|--------------|-----------|
| 1 | 08上汽债 | 3,101,760.00 | 0.11% |

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

本基金期末未持有资产支持证券。

八、报告期末本基金投资权证明细

(一) 报告期末持有权证明细

| 序号 | 权证代码 | 权证名称 | 数量 (份) | 市值 (人民币元) | 市值占基金净值 | 获得方式 |
|----|------|------|--------|-----------|---------|------|
|----|------|------|--------|-----------|---------|------|

| | | | | | | |
|-----------|--------|--------|---------|---------------------|--------------|------|
| | | | | | 产比例 | |
| 1 | 580016 | 上汽CWB1 | 155,520 | 1,413,008.06 | 0.05% | 被动持有 |
| 合计 | | | | 1,413,008.06 | 0.05% | |

(二) 报告期内获得权证明细

| 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 | 155,520 | 1,241,234.31 |

九、投资组合报告附注

(一) 本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记录, 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) 报告期末基金的其他资产构成

| 其他资产项目 | 金额(人民币元) |
|-----------|---------------------|
| 存出保证金 | 1,210,000.00 |
| 应收利息 | 71,669.11 |
| 应收申购款 | 5,436,682.18 |
| 合计 | 6,718,351.29 |

(四) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有可转换债券。

(五) 本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人在本报告期内未投资本基金。

第八章 基金份额持有人情况

一、报告期末基金份额持有人户数

| | |
|-----------------|------------|
| 报告期末基金份额持有人户数 | 102,403户 |
| 报告期末平均每户持有的基金份额 | 17,666.85份 |

二、报告期末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 | 1,809,138,385.58 | 100.00% |
| 其中: 机构投资者持有的基金份额 | 59,573,947.70 | 3.29% |
| 个人投资者持有的基金份额 | 1,749,564,437.88 | 96.71% |

三、报告期末基金管理公司从业人员持有本基金情况

| 项目 | 期末持有本开放式基金份额的总量(份) | 占本基金总份额的比例 |
|--------------------|--------------------|------------|
| 基金管理公司持有本基金的所有从业人员 | 587,843.36 | 0.03% |

第九章 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(2004年5月21日)基金份额总额 | 4,108,187,244.80 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 479,068,561.67 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | 3,858,447,439.95 |
| 本报告期期间基金总赎回份额 | 2,528,377,616.04 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,809,138,385.58 |

第十章 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、本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(一) 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

基金管理人于2007年8月16日发布关于更换董事长的公告: 经长盛基金管理有限公司第三届董事会第十九次会议审议通过, 并报中国证监会审核批准(证监基金字[2007]229号文), 聘任公司董事陈平先生担任公司董事长, 凤良志先生不再担任公司董事长一职。

(二) 基金经理的变动情况

基金管理人于2007年9月17日发布关于调整基金经理的公告: 因工作需要,

经公司第四届董事会第二次会议审议批准, 聘任宋炳山同志兼任长盛动态精选基金基金经理, 与现任基金经理王宁同志共同管理该基金。

(三) 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、本报告期内本基金投资策略不曾改变。

五、本报告期内本基金收益分配事项

2007年2月7日, 本基金实施成立日起第三次收益分配, 向全体基金份额

持有人按每10份基金份额派发现金红利5.80元。公告于2007年2月1日刊登。

2007年4月23日, 本基金实施成立日起第四次收益分配, 向全体基金份额持有人按每10份基金份额派发现金红利7.50元。公告于2007年4月18日刊登。

六、所聘会计师事务所的情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所, 报告期内共支付普华永道中天会计师事务所审计费用50,000.00元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为4年。

七、基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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》、《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》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，截至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 | 国元证券 | 1 | 1 | 2 |
| 2 | 广发华福证券有限责任公司 | 1 | | 1 |
| 3 | 中国国际金融有限公司 | | 1 | 1 |
| 4 | 中银国际证券有限责任公司 | 1 | | 1 |
| 5 | 光大证券股份有限公司 | | 1 | 1 |
| 6 | 申银万国证券股份有限公司 | 1 | | 1 |
| 7 | 中信建投证券有限责任公司 | 1 | | 1 |
| | 合计 | 5 | 3 | 8 |

(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、资历雄厚，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1-12月各券商股票年交易量及年佣金情况如下

| 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 | 3,641,310,220.22 | 31.53% | 2,969,803.01 | 31.94% |
| 中国国际金融有限公司 | 3,743,618,754.36 | 32.42% | 2,929,409.76 | 31.50% |
| 中银国际证券有限责任公司 | 2,310,159,765.70 | 20.01% | 1,894,317.91 | 20.37% |
| 光大证券股份有限公司 | 362,957,870.25 | 3.14% | 284,015.76 | 3.05% |
| 中信建投证券有限责任公司 | 1,489,561,727.76 | 12.90% | 1,221,431.54 | 13.14% |
| 合计 | 11,547,608,338.29 | 100.00% | 9,298,977.98 | 100.00% |

(五) 2007年1-12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 | 回购年交易量 (人民币元) | 占交易量比例 |
|--------------|---------------------|----------------|------------------|-------------|
| 中银国际证券有限责任公司 | 3,472,715.80 | 100.00% | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 3,472,715.80 | 100.00% | 0.00 | 0.00 |

(六) 报告期内租用证券公司席位的变更情况:

- 1、新增租用：报告期内未新增租用证券公司席位。
- 2、停止租用

| 序号 | 证券公司名称 | 席位所属市场 | 数量 |
|----|------------|--------|----|
| 1 | 中山证券有限责任公司 | 深圳 | 1 |
| 2 | 大通证券有限责任公司 | 上海 | 1 |

九、本报告期内本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，本基金管理人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%。公告于2007年4月19日刊登。

十、本报告期内本基金托管人的重大变动

(一) 本报告期内，托管人行长变更。根据国务院文件，2007年6月16日国务院决定任命项俊波同志为中国农业银行行长。依据相关法律法规规定，中国农业银行法定代表人变更为项俊波先生。

(二) 本报告期内，托管人注册地址变更。托管人已做工商登记变更，注册地址由北京市海淀区复兴路甲23号变更为北京市东城区建国门内大街69号。

十一、本报告期内本基金招募说明书更新情况

本基金管理人经与基金托管人协商，对本基金的招募说明书进行了更新，于2007年2月1日将本基金更新的招募说明书摘要刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》，同时将本基金更新的招募说明书正文及摘要登载于本公司网站上。

本基金管理人经与基金托管人协商，对本基金的招募说明书进行了更新，于2007年7月4日将本基金更新的招募说明书摘要刊登在《中国证

券报》、《上海证券报》、《证券时报》，同时将本基金更新的招募说明书正文及摘要登载于本公司网站上。

十二、其他重大事件

除上述事项之外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事件如下：

| 序号 | 公告名称/事项 | 披露日期 |
|----|--|------------|
| 1 | 关于在农业银行推出基金定期定额申购业务的公告 | 2007-01-15 |
| 2 | 关于长盛基金旗下三只基金暂停大额申购和转换转入业务的公告 | 2007-02-01 |
| 3 | 关于旗下基金定期定额申购业务开通前端收费的公告 | 2007-04-13 |
| 4 | 关于公司旗下本基金暂停大额申购和转换转入业务的公告 | 2007-04-18 |
| 5 | 关于本基金暂停申购和转换转入业务的公告 | 2007-05-11 |
| 6 | 关于调整旗下开放式基金申购费用和申购份额计算方法及修改基金合同与基金招募说明书的公告 | 2007-05-18 |
| 7 | 关于旗下基金暂停申购和转换转入业务的提示性公告 | 2007-05-24 |
| 8 | 关于旗下基金暂停申购和转换转入业务的提示性公告 | 2007-06-07 |
| 9 | 关于恢复旗下基金申购和转换转入业务的公告 | 2007-06-28 |
| 10 | 关于恢复旗下基金申购和转换转入业务的提示性公告 | 2007-06-29 |
| 11 | 关于本公司所管理证券投资基金执行《企业会计》准则的公告 | 2007-07-02 |
| 12 | 关于本公司工商登记变更的公告 | 2007-07-04 |
| 13 | 关于参加农业银行“金钥匙·基金宝”基金定期定额申购业务推广活动的公告 | 2007-07-05 |
| 14 | 关于增加中信金通证券有限责任公司为代销机构的公告 | 2007-07-27 |
| 15 | 关于增加海通证券股份有限公司为代销机构的公告 | 2007-08-03 |
| 16 | 关于增加国都证券、国联证券有限责任公司为代销机构的公告 | 2007-09-07 |
| 17 | 关于警惕冒用长盛基金名义进行非法证券活动的提示性公告 | 2007-09-27 |
| 18 | 关于修改旗下基金基金合同中基金资产估值的有关条款的公告 | 2007-09-29 |
| 19 | 关于本基金基金资产估值更新后的基金合同 | 2007-09-29 |
| 20 | 关于本公司工商登记变更的公告 | 2007-10-09 |
| 21 | 关于对本基金2007年第3季度报告内容的补充公告 | 2007-10-25 |
| 22 | 关于增加中国银行股份有限公司为代销机构的公告 | 2007-12-14 |
| 23 | 关于中国银行开办长盛旗下部分基金定期定额投资业务的公告 | 2007-12-14 |
| 24 | 关于招商银行开办长盛旗下基金定期定额投资业务的公告 | 2007-12-19 |

注：如无特别说明，上述重大事件的信息披露媒体均为《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及本公司网站。

第十一章 备查文件

一、备查文件目录

- (一) 关于中国证券监督管理委员会同意设立长盛动态精选证券投资基金的批复
- (二) 长盛动态精选证券投资基金基金合同
- (三) 长盛动态精选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

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。本报告分别置备于基金管理人和基金托管人的办公场所，供公众查阅、复制。上述文件可在长盛基金管理有限公司互联网站上查阅。

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
二〇〇八年三月二十六日

日期：[20080326]

[打印本页] [关闭窗口]

<http://www.csfunds.com.cn>