

## 重要提示

本基金的托管人中国农业银行已于 2002 年 7 月 25 日复核了本报告。

本基金的管理人、托管人愿就本报告中所载资料的真实性、准确性、完整性负责。本报告书中的内容由基金管理人负责解释。

### 一、同德证券投资基金简介

同德证券投资基金（以下简称“基金同德”）的前身是金券受益基金（以下简称“金券基金”）和粤东国债投资受益凭证（以下简称“投资受益凭证”）。经中国证券监督管理委员会证监基金字〔2000〕41 号文及中国证券监督管理委员会证监基金字〔2001〕21 号文批准，金券基金和投资受益凭证进行了规范清理，并于 2000 年 10 月 20 日办理了基金资产移交手续，基金管理人更换为长盛基金管理有限公司，基金托管人更换为中国农业银行，并正式更名为同德证券投资基金。基金同德为契约型封闭式，存续期为 1992 年 12 月 1 日至 2002 年 11 月 30 日，发起人为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公司、国元证券有限责任公司和长盛基金管理有限公司，发行规模为 2 亿份基金单位。

基金同德经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证上字〔2001〕103 号文审核同意，于 2001 年 8 月 1 日在上交所挂牌交易，交易代码为 500039。

基金同德于 2001 年 9 月 4 日将基金单位总份额由原有 2 亿份基金单位按面值扩募至 5 亿份基金单位，存续期限延长 5 年至 2007 年 11 月 30 日。扩募部分于 2001 年 9 月 24 日在上交所挂牌交易。

根据《证券投资基金管理暂行办法》和《同德证券投资基金基金契约》的规定，基金同德的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证券监督管理委员会允许基金投资的其他金融工具。

#### （一）基金简称：基金同德

交易代码：500039

基金单位总份额：五亿份基金单位

基金类型：契约型封闭式

基金存续期：十五年

基金上市地：上海证券交易所

#### （二）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

国际互联网网址：<http://www.csfunds.com.cn>

法定代表人：王其华

总经理：蒋月勤

负责信息管理事务人员：李燕敏

联系地址：北京市朝阳区北三环东路 8 号静安中心 22 层

电话：010-64689198-651

传真：010-64689471

#### （三）基金托管人

法定名称：中国农业银行

注册地址：北京市复兴路甲 23 号

办公地址：北京市复兴路甲 23 号  
邮政编码：100037  
国际互联网网址：www.abchina.com  
法定代表人：尚福林  
基金托管部负责人：郭辉  
信息事务联系人：李芳菲  
联系地址：北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦 8 层  
电话：010-68424199  
传真：010-68424181

#### （四）会计师事务所

法定名称：普华永道中天会计师事务所有限公司  
注册地址：上海市浦东新区沈家弄 325 号  
办公地址：上海市淮海中路 333 号瑞安广场 12 楼  
法定代表人：Kent Watson  
经办注册会计师：周忠惠、王笑

#### （五）律师事务所

法定名称：信利律师事务所  
注册地址：北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 609 室  
办公地址：北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 609 室  
法定代表人：江山  
经办律师：谢思敏、丁志钢

## 二、主要财务指标

截止 2002 年 6 月 30 日止, 本基金的主要财务指标如下:

2002 年 6 月 30 日

基金本期净收益	12,055,076.19 元
单位基金本期净收益	0.0241 元
基金可分配净收益	4,840,932.25 元
单位基金可分配净收益	0.0097 元
期末基金资产总值	521,291,289.16 元
期末基金资产净值	514,285,735.75 元
单位基金资产净值	1.0286 元
基金资产净值收益率	2.44%
本期基金资产净值增长率	4.03%
基金累计资产净值增长率	11.35%

## 三、基金管理人报告

### （一）基金经理人报告

#### 1、基金经理简介

陈剑平, 男, 27 岁, 经济学学士。于 2000 年取得基金从业资格。1997 年 7 月至 1999 年 9 月, 就职于深圳蓝天基金管理公司; 1999 年 9 月至今, 就职于长盛基金管理有限公司投资管理部, 担任基金同益、基金同盛基金经理助理。

#### 2、本基金投资风格和投资策略

本基金为成长型基金, 主要投资于业绩能够持续高速增长的成长型上市公司, 所追求的投资目标是在尽可能地分散和规避投资风险的前提下, 谋求基金资产增值和收益的最大化。在投资策略方面, 主要采取主动型投资, 关注行业与公司基本面的变化, 注重证券市场时机的把

握,积极主动调整投资组合的比例与结构,集中投资与分散投资相结合,努力控制系统风险与非系统风险。

### 3、 本基金业绩表现

上半年本基金实现净值增长率 4.03%, 优于同期银行存款利率水平。

### 4、 上半年行情回顾及对当前行情的认识

上半年深沪两市经历了两次探底,而后急升的走势。本基金管理人认为,这是市场内在规律与国家政策共同作用的结果。市场方面,经过一年的下跌,市场已将 2000 年以来的上扬悉数吞没,市场平均股价一度甚至低于 5.19 启动前市场平均股价。许多股票大幅调整,甚至创出新低,伴随着成交量急剧萎缩。从市场调整幅度和调整时间来看,市场具有上扬的内在要求;政策方面,为了维护市场稳定、恢复投资者信心,政府先于年初确定金融工作的主基调是稳定,继而在公开场合强调正确认识我国证券市场所处的历史阶段,并先后推出新股配售发行、停止国有股减持等利好措施。正是这些因素的共振作用,造成了市场 6 月份的大幅反弹。

债券市场方面,受国债招标利率不断下降影响,债券长、中、短期利率一度出现倒挂现象。固定利率债券、尤其是长期债,出现了大幅上扬行情,市场气氛几近疯狂,长债短作现象普遍。在央行及时的政策舆论指引下,市场投机气氛才有所收敛。而 6 月 24 日深沪两市的大幅上扬,则引发了债券市场的跳水行情。一度被投资者追捧、寄予厚望的债券市场,风险表露无疑。

可以认为,下半年证券市场走势在很大程度上仍将取决于国家政策的走向。在目前以稳为主的政策背景下,市场仍具有上升空间。而由于 6 月底市场的急剧上扬,市场主力建仓成本高企,在一定程度上也支持市场的上扬。但同时应看到,目前市场仍面临许多不确定因素,首先,以美国为首的西方国家,经济复苏前景仍不明朗。受假帐丑闻影响,美国股市屡创新低,强美元政策面临空前挑战。欧盟区失业率居高不下,显示该区域经济仍未摆脱困境。复杂多变的国际环境,增加了我国经济前景的不确定因素;其次,政府后续利好政策能否陆续出台,政策力度有多大,持续时间有多长,这都将极大影响投资者的持股信心;另外,6 月份市场见底以来,带动市场上扬的热点,主要有:低价大盘股,这些股票市盈率低、流通市值大;次新股,这些股票换手率大,无历史遗留问题;低价超跌股,由于过度超跌而存在修正的需求。这些热点的出现,其实反映了主流机构在面临市场突变情况下,无从下手时采取的无奈选择。市场更多的是对现有状况的修正,而不是新局面的开始,短线心态弥漫市场。更令人忧虑的是,次新股泡沫再次浮现,而高价绩优股在今年以来的两次上扬行情中,则都出现了明显滞涨走势。这些状况如果持续的话,将加剧市场的不平衡,从而制约市场的上升空间。同时,由于 6 月底的井喷行情,有可能缩短这轮反弹的运行时间。还应看到,去年 10 月份以来市场的大幅震荡,沪指 1700 点左右累积了巨大的成交量,如何消化这些堆积的压力,是市场能否继续上升的关键。

因此,本基金管理人认为,在当前市场情况下,深沪两市将保持震荡上行态势,但会在两市于 2000 年 8 月至 2001 年 2 月份所形成的横盘整理区间面临巨大压力。市场仍有一次深幅回调的机会。这次回调结束以后,中国证券市场将迎来新一轮牛市。这是基于以下理由:首先,我国将继续保持稳定的政治环境;其次,随着税制改革等各项改革措施的实施,经济发展的总成本将大为降低,从而大力推动经济的发展。第三,随着 WTO 影响日深、经济运行也将更加市场化、效率也会不断提升。另外,市场的双向扩容有加速趋势,而市场参与者的增多、投资对象、投资方式的增加,也有利于市场的公平性、增强市场活力。就目前而言,低价股仍将主导下半年的市场行情,其中尤其需要关注外资并购板块。象今年上半年的深圳本地股、金融股、航空股,在朦胧的外资并购题材刺激下,不断创出新高。而汽车、电力等充满变数的行业,也可能是黑马迭出的板块。热点转换快、持续时间短,是今年市场的显著特点。

### 5、 本基金对策

基于对市场当前特点的判断,本基金管理人对基金仓位和持仓品种作了较大调整。债券方面,本基金管理人认为,虽然近期利率将维持低位,但从中长期角度来看,升息压力较大。因

此, 本基金管理人适当提高了浮动债券的投资比重, 在固定债品种上, 通过不同债券之间的转换, 缩短所持债券久期, 降低风险。同时, 积极把握债券之间存在的套利机会。股票方面, 从个股基本面着手, 结合市场热点, 使股票持仓形成较为合理的长、中、短配比的结构。当市场位于去年 10 月份低点以下时, 积极建仓, 而在市场临近去年 12 月份高点时, 则采取减仓策略。近期则顺应市场变化, 针对本基金容易换仓特点, 大幅提升股票仓位。在保证基本股票品种的情况下, 大幅增加低价股及超跌股在仓位中的比重。根据股票的不同风格所表现的收益差异, 实行细分化策略。剔除组合中部分明显滞涨的中高价股票。本基金管理人认为, 投资于业绩增长迅速、抗风险能力好的股票是本基金的立足之本。但如果忽视中国证券市场的现阶段特征, 无法把握中国市场板块轮动特点, 则可能陷入投资定律陷阱, 虽然纸面上好看, 实则无法实现基金净值的稳定增长。

本基金管理人将采取以下措施进一步优化持仓结构: 坚决清除达到获利目标的股票; 执行严格的止损制度。关注具有如下特点行业及股票: 受益于行业重组、业绩可能大幅提升的; 市场化程度较高、利润操纵空间小、容易计量、与居民消费密切相关的行业; 业绩稳定, 股价波动呈现明显周期性的股票。

## (二) 内部监察稽核报告

### 基金运作合规性声明

本报告期内, 本基金管理人严格按照《证券投资基金管理暂行办法》及其各项实施准则、《同德证券投资基金基金契约》和其他有关法律法规的规定, 以诚实信用, 勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。通过进一步完善法人治理结构, 加强内部管理、规范基金运作, 在控制和防范风险的前提下, 为基金投资人谋求基金资产的长期稳定增值。基金同益投资组合符合有关法规及基金契约的约定, 无损害基金持有人利益的行为。

### 内部监察稽核工作报告

本基金管理人从防范运作风险、保障基金持有人利益出发, 进一步完善了法人治理结构和内部制衡机制, 通过风险控制委员会、督察员和监察稽核部监督公司严格履行契约承诺, 强化内控机制和纪律程序, 保证内部风险的控制和各项制度的贯彻与实施, 保护基金持有人的合法权益。

内部监察稽核工作的工作重点包括与基金投资运作有关的各个环节。由内部负责监察稽核工作的人员独立对基金投资运作各环节的具体情况进行检查, 以定期和临时检查相结合的方式和程序, 通过采用各种工作方法和步骤, 检查基金投资运作的合法合规情况; 定期作出监察稽核报告, 发现违规隐患及时向管理层和监管部门报告, 并及时督促整改, 并将整改情况及时向管理层和监管部门报告。

内部控制的重点是确保本管理人所管理基金运作的独立性, 防范内幕交易、操纵市场行为, 以及有损于基金投资人利益的关联交易。根据有关法律法规和基金契约, 公司通过不断完善管理制度进一步加强对投资决策流程的内部控制和风险管理, 最大限度地降低投资运作中的风险性。在本报告期内, 本基金运作中无不当内幕交易和关联交易, 保障了基金持有人的利益。

本基金管理人将坚持规范操作, 稳健经营, 控制风险。通过积极推进电脑预警系统、投资监测系统的建设, 使风险控制的全面性、及时性和有效性得到实质性的提高。本基金管理人将提高公司员工的职业素养和守法意识, 严格行为规范, 加强自律。本基金管理人将取信于市场, 取信于社会, 诚实信用, 勤勉尽责, 以专业化的经营方式管理和运用基金资产, 为基金持有人谋求最佳利益并使本基金管理公司稳步、健康发展。

## 四、基金托管人报告

本基金托管人——中国农业银行, 根据《同德证券投资基金基金契约》和《同德证券投资基金托管协议》, 在对同德证券投资基金的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金管理暂行办法》

及各项法规规定,对同德证券投资基金管理人—长盛基金管理有限公司在2002年1-6月份基金的投资运作,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。

本托管人认为,长盛基金管理有限公司在基金同德的投资运作、信息披露等方面符合《同德证券投资基金基金契约》、《证券投资基金管理暂行办法》及其相关法规的规定。基金管理人在2002年1-6月份所编制和披露的同德证券投资基金资产净值公告等各项基金信息真实、完整,未发现管理人有损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行基金托管部

2002年7月25日

## 五、基金财务报告

### (一) 基金会计报告书

#### 同德证券投资基金

#### 资产负债表

二零零二年六月三十日 单位: 元  
附注 2001年12月31日 2002年6月30日

资产:	附注	2001年12月31日	2002年6月30日
银行存款	3(三)	90,779,930.85	29,660,265.90
清算备付金	3(四)	1,062,184.00	2,662,880.70
交易保证金	3(五)		250,000.00
应收证券清算款	3(六),5		4,843,372.29
应收股利			252,092.38
应收利息		1,074,956.14	1,999,520.81
股票投资市值	3(七)	235,545,546.60	365,706,987.56
其中:股票投资成本	3(七)	234,060,307.40	356,722,923.12
债券投资市值	3(八)	166,844,708.00	115,885,922.70
其中:债券投资成本	3(八)	166,709,521.28	115,425,183.64
待摊费用			30,246.82
资产合计		495,307,325.59	521,291,289.16
负债			
应付证券清算款	3(六),6		5,640,546.51
应付基金管理人报酬		573,954.31	602,104.06
应付托管费		103,910.59	100,350.69
应付佣金		176,866.73	329,050.19
其他应付款		60,000.00	139,163.92
预提费用			194,338.04
负债合计		914,731.63	7,005,553.41
持有人权益			
实收基金	3(十二),7	500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得	3(七)(八)	1,620,425.92	9,444,803.50
未分配收益	3(十三)	-7,227,831.96	4,840,932.25
持有人权益合计		494,392,593.96	514,285,735.75
负债及基金持有人权益合计		495,307,325.59	521,291,289.16

#### 同德证券投资基金

#### 经营业绩表

二零零二年一月至六月 单位: 元

项目	附注	2001年1月1日至 2001年6月30日	2002年1月1日至 2002年6月30日
收入		30,852,838.14	17,164,892.54
股票差价收入	3(九)	29,370,551.68	3,103,700.28
债券差价收入	3(九)		8,708,323.76
债券利息收入	3(九)		2,762,395.10
存款利息收入	3(九)	675,202.55	830,443.40
股利收入	3(九)	806,852.20	1,482,428.22
买入返售证券收入	3(九)		231,870.00
其他收入		231.71	45,731.78
费用		1,802,641.63	5,109,816.35
基金管理人报酬	3(十),8(二)	1,545,121.39	3,649,729.49
基金托管费	3(十一),8(三)	257,520.24	609,502.09
卖出回购证券支出			591,708.00
其他费用			258,876.77
其中：上市年费			29,753.18
信息披露费			158,684.51
审计费用			29,752.78
其他			40,686.30
基金净收益		29,050,196.51	12,055,076.19
加：未实现资本利得		-16,878,286.48	7,824,377.58
基金经营业绩		12,171,910.03	19,879,453.77

同德证券投资基金

收益分配表

二零零二年一月至六月

单位：元

项目	附注	2001年1月1日至 2001年6月30日	2002年1月1日至 2002年6月30日
本期基金净收益		29,050,196.51	12,055,076.19
加：期初基金净收益		-18,793,499.39	-7,227,831.96
加：以前年度损益调整	10		13,688.02
可供分配基金净收益		10,256,697.12	4,840,932.25
减：本期已分配基金净收益			
期末基金净收益		10,256,697.12	4,840,932.25

同德证券投资基金

净值变动表

二零零二年一月至六月

单位：元

项目	附注	金额
一、期初基金净值		494,392,593.96
二、本期经营活动		
基金净收益		12,055,076.19
未实现资本利得		7,824,377.58
经营活动产生的基金净值变动数		19,879,453.77
以前年度损益调整	10	13,688.02
三、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

四、期末基金净值 514,285,735.75

上述报表依照 2002 年 1 月 1 日施行的《证券投资基金会计核算办法》编制。上年报表项目数字已进行了分类调整。

## (二) 基金会计报告书附注

### 附注 1. 基金设立说明

同德证券投资基金（以下简称本基金）经中国证券监督管理委员会证监基字〔2000〕41 号《关于广东省金债券基金、粤东国债投资受益凭证及金信基金清理规范方案的批复》批准，于 2000 年 10 月 20 日由金债券受益基金和粤东国债投资受益凭证清理规范后合并而成的契约型封闭式证券投资基金，其发起人为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公司、国元证券有限责任公司和长盛基金管理有限公司。根据中国证券监督管理委员会证监基字〔2001〕21 号《关于同意同德证券投资基金上市、扩募和续期的批复》和上海证券交易所上证上字〔2001〕103 号批准，本基金于 2001 年 8 月 1 日在上交所上市，并于 2001 年 9 月 4 日成功扩募到 5 亿份基金单位，每份基金单位面值 1 元，发起人认购 500 万份（占基金总规模的 1%），其余 49500 万份由社会公众及商业保险公司持有，扩募部分于 2001 年 9 月 24 日在上交所上市交易。基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行。

### 附注 2. 会计报表编制基础

本基金的会计报表按照中华人民共和国财政部颁发的《企业会计准则》、《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《证券投资基金管理暂行办法》实施准则第五号证券投资基金信息披露指引，及中国证券监督管理委员会允许的如主要会计政策所述的基金行业的实务操作约定而编制。

### 附注 3. 主要会计政策

#### 一)、 会计年度

本基金的会计年度为公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

#### 二)、 记帐原则和计价基础

本基金的会计核算以权责发生制为记帐原则，除股票和债券投资按市值计价外，其余均以历史成本为计价基础。

#### 三)、 银行存款

银行存款为本基金存放于银行的活期存款。

#### 四)、 清算备付金

清算备付金是为证券交易的资金交割与交收而存放于中国证券登记结算有限责任公司的款项。

#### 五)、 交易保证金

交易保证金为向证券交易所交存的交易保证金

#### 六)、 应收/付证券清算款

应收/付证券清算款为应与证券登记结算机构办理资金清算的款项。

#### 七)、 股票投资

股票投资成本按购买时实际支付的价款计价，实际价款中包括已宣告未发放股利，出售成本按日移动加权平均法计算。股票包括上市交易股票和未上市交易股票。上市交易股票的估值按估值日当天各股票相应的市场交易均价进行计算，若当日无交易，则以最近一日的市场交易均价计算。首次公开发行但未上市的股票，按成本估值；由于配股和增发形成的未上市股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值。实际成本与估值的差异计入“未实现利得”科目。

#### 八)、债券投资

债券包括证交所交易债券和银行间同业市场交易债券。债券的投资成本按购买时实际支付的价款扣除债券上次付息日至购入日的应计利息计价。出售的债券成本按日移动加权平均法计算。证交所交易债券的估值按估值当天各债券相应的不含息市场交易均价计算,若当日无交易,则以最近一日的均价计算。银行间同业市场交易债券的估值以不含息成本价计算。实际成本与估值的差异计入 " 未实现利得 " 科目。

#### 九)、收入确认

证券买卖差价指买卖股票及债券的差价。股票和债券差价在卖出时确认。投资收益中股息在股息除息日确认,证交所交易的债券利息和银行间同业市场交易的债券利息在持有期内按日计提。买入返售证券收入按融出资金额及约定利率,在回购期限内按日计提。银行存款的利息收入依约定利率按日计提。

#### 十)、基金管理费

基金管理费为支付给基金管理人的报酬,根据《同德证券投资基金上市公告书》及《同德证券投资基金扩募说明书》的规定,按前日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提,基金扩募三个月后,如果基金持有的现金比例超过基金资产净值的 20%,超过部分不计提管理费。

#### 十一)、基金托管费

基金托管人的托管费根据《同德证券投资基金基金契约》的规定,按前日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

#### 十二)、基金单位总额

基金单位总额以基金单位面值乘以实际发行基金单位数入帐。

#### 十三)、基金的收益分配政策

每一基金单位享有同等分配权。基金当年收益弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配。基金当年亏损,则不进行收益分配。基金收益分配采取现金方式,每年分配一次,收益分配比例不低于基金净收益的 90%。

#### 附注 4. 主要税项

根据财税字〔1998〕55 号文及〔2001〕年 61 号文《财政部国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》,主要税项规定如下:

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,在 2003 年 12 月 31 日前暂免征收营业税。

三)、市场中取得的收入包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

#### 附注 5. 应收证券清算款

因买卖证券、回购证券、申购新股、配售股票等业务而发生的,应与证券登记结算机构办理资金清算的款项。按不同证券登记结算机构,如中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司等进行列示。

项目	2001-12-31	2002-6-30
应收深圳证券清算款	-	4,843,372.29

#### 附注 6. 应付证券清算款

项目	2001-12-31	2002-6-30
应付上海证券清算款	-	5,640,546.51

#### 附注 7. 基金单位总额

每份基金单位面值为 1 元,基金单位总额按面值入帐。

2002-6-30

基金单位数      基金单位金额



发起人持有基金份额 - 非流通部分	2,500,000	2,500,000
发起人持有基金份额 - 可流通部分	2,000,000	2,000,000
社会公众持有基金份额	495,500,000	495,500,000
基金单位总额	500,000,000	500,000,000

附注 8. 重大关联方关系及关联交易

一)、关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人
中国农业银行	基金托管人
中信证券股份有限公司	基金发起人、基金管理人股东
长江证券有限责任公司	基金发起人、基金管理人股东
天津北方国际信托投资公司	基金发起人、基金管理人股东
国元证券有限责任公司	基金发起人、基金管理人股东

二)、基金管理人费用

支付基金管理人长盛基金管理有限公司的管理人费用按前一日的基金资产净值 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: 日基金管理费 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理费 3,649,729.49 元 (2001 年 1 月 1 日至 6 月 30 日: 1,545,121.39 元)。

三)、基金托管人费用

支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。计算公式为: 日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金托管费 609,502.09 元 (2001 年 1 月 1 日至 6 月 30 日: 257,520.24 元)。

附注 9. 流通受限制不能自由转让的基金资产

基金获配新股, 从新股获配日至新股上市日或以下规定期间, 为流通受限制而不能自由转让的资产。

根据中国证券监督管理委员会的政策规定, 2000 年 5 月 18 日起新股发行时不再单独向基金配售新股。基金可使用以基金名义开设的股票帐户, 比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股, 根据基金与上市公司所签订申购协议的规定, 在约定期限内不能自由流通。

股票名称	申购日期	上市日期	可流通日期	申购价格	年末	申购
成本	市值			估价	股数	
招商银行	02-04-01	02-04-09	上市日后四个月	7.30	11.44	312,800
2,283,440.00	3,578,432.00					
安源股份	02-06-20	02-07-02	上市日	5.99	5.99	23,000
137,770.00	137,770.00					
宏智科技	02-06-27	02-07-09	上市日	8.68	8.68	24,000
208,320.00	208,320.00					
泰豪科技	02-06-24	02-07-03	上市日	4.76	4.76	14,000
66,640.00	66,640.00					
合						计

2,696,170.00 3,991,162.00

其中：(1) 根据规定，"招商银行"基金获得配售部分，自普通股股票上市流通日起4个月后上市流通。

(2) "安源股份"、"宏智科技"、"泰豪科技"为本基金通过市值配售所获得，自该股票上市日起即可流通。

已上市流通受限股票估值增值为1,294,992.00元，若扣除该项估值增值，本基金资产净值为512,990,743.75元，单位基金资产净值1.0260元。

#### 附注10. 以前年度损益调整

根据中华人民共和国财政部2001年11月11日颁布的《证券投资基金会计核算办法》及2002年1月8日召开的投资基金管理公司会计核算办法研修会议的有关精神并经相关部门认可，本基金从2002年1月1日起，证券交易所债券交易的成本计价及利息收入确认方法做如下会计政策变更：成本计价方法由含息成本变更为不含息成本，利息收入由债券派息日确认变更为在债券持有期内按日计提确认。上述变更不对以前各期的会计报表进行追溯调整。按新的会计政策对调整基准日持有债券的应收利息及投资成本进行调整，此次变更影响数为2002年1月1日应收利息调增人民币439,564.77元，债券投资成本调减人民币425,876.75元，两者差额人民币13,688.02元计入以前年度损益调整。

### (三) 基金投资组合

#### 1、按行业分类的股票投资组合

序号	分类	市值(元)	占净值比例
1	农、林、牧、渔业	5,650,983.10	1.10%
2	采掘业		
3	制造业	144,347,281.05	28.07%
	其中：食品、饮料	27,840,312.48	5.41%
	纺织、服装、皮毛	1,228,250.00	0.24%
	木材、家具		
	造纸、印刷	14,974,167.55	2.91%
	石油、化学、塑胶、塑料	18,513,237.52	3.60%
	电子		
	金属、非金属	5,878,448.00	1.14%
	机械、设备、仪表	31,082,956.52	6.05%
	医药、生物制品	30,419,500.36	5.92%
	其他制造业	14,410,408.62	2.80%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	33,344,144.72	6.48%
5	建筑业	8,510,405.08	1.65%
6	交通运输、仓储业	43,232,418.37	8.41%
7	信息技术业	47,072,106.43	9.15%
8	批发和零售贸易	13,417,284.00	2.61%
9	金融、保险业	20,738,432.00	4.03%
10	房地产业	24,973,983.13	4.86%
11	社会服务业	16,331,901.42	3.18%
12	传播与文化产业		
13	综合类	8,088,048.26	1.57%
合 计		365,706,987.56	71.11%

## 2、国债、货币资金合计

截止 2002 年 6 月 30 日,同德证券投资基金持有国债及货币资金为 148,209,069.30 元,占基金资产净值的 28.82%。其中国债投资 115,885,922.70 元,占基金资产净值 22.53%。

## 3、基金投资前十名股票明细见(四)1。

## 4、报告附注

### (1) 报告项目的计价方法

本基金持有上市证券采用公告内容截止日的市场均价计算,已发行未上市股票采用成本价计算。

(2) 基金持有每只股票的价值(按成本价计算)均不超过基金资产净值的 10%。

(3) 基金应收利息、应收国债利息、证券清算款、待摊费用、应付管理费、托管费、佣金、预提费用及其他应付款等应收、应付款项合计为借方余额 369,678.89 元,与股票市值 365,706,987.56 元,国债及货币资金合计 148,209,069.30 元相加后等于基金净值。

(四) 截止 2002 年 6 月 30 日,本基金持仓股票、本期新增股票及清仓股票:

### 1、持仓股票

序号	股票名称	数量(股)	股票市值(元)	占净值比例
1	上港集箱	1,287,350	25,656,885.50	4.9888%
2	中兴通讯	1,010,000	24,199,600.00	4.7055%
3	招商银行	1,812,800	20,738,432.00	4.0325%
4	创智科技	1,042,840	12,628,792.40	2.4556%
5	中信国安	570,517	10,035,394.03	1.9513%
6	双汇发展	744,236	9,436,912.48	1.8350%
7	平高电气	607,736	8,702,779.52	1.6922%
8	北京城建	657,682	8,510,405.08	1.6548%
9	贵航股份	800,900	8,393,432.00	1.6321%
10	云天化	750,000	8,377,500.00	1.6290%
11	山鹰纸业	720,085	8,302,580.05	1.6144%
12	大众交通	687,942	8,262,183.42	1.6065%
13	武汉控股	750,038	8,235,417.24	1.6013%
14	国际大厦	630,893	8,088,048.26	1.5727%
15	桂冠电力	598,200	8,069,718.00	1.5691%
16	华能国际	549,896	7,907,504.48	1.5376%
17	沱牌曲酒	930,000	7,886,400.00	1.5335%
18	安泰科技	520,005	7,872,875.70	1.5308%
19	广州药业	630,795	7,847,089.80	1.5258%
20	江汽股份	591,240	7,727,506.80	1.5026%
21	复星实业	599,104	7,722,450.56	1.5016%
22	北京巴士	503,469	7,486,584.03	1.4557%
23	银基发展	900,814	7,413,699.22	1.4416%
24	阳光股份	701,361	6,957,501.12	1.3528%
25	中技贸易	436,331	6,867,849.94	1.3354%
26	晨鸣纸业	478,250	6,671,587.50	1.2973%
27	万科A	514,959	6,596,624.79	1.2827%
28	桂东电力	406,441	6,564,022.15	1.2763%
29	长百集团	683,657	6,549,434.06	1.2735%

30	浙江东日	506,001	6,537,532.92	1.2712%
31	同仁堂	333,880	6,370,430.40	1.2387%
32	上海医药	438,800	6,336,272.00	1.2321%
33	钱江水利	544,169	6,208,968.29	1.2073%
34	湖北宣化	631,696	5,918,991.52	1.1509%
35	宇通客车	395,860	5,886,438.20	1.1446%
36	上海科技	463,600	5,878,448.00	1.1430%
37	华龙集团	500,087	5,650,983.10	1.0988%
38	维维股份	400,000	5,432,000.00	1.0562%
39	现代投资	540,733	5,126,148.84	0.9968%
40	湘酒鬼	500,000	5,085,000.00	0.9887%
41	招商局A	380,000	4,962,800.00	0.9650%
序号	股票名称	数量(股)	股票市值(元)	占净值比例
42	漳泽电力	303,096	4,428,232.56	0.8610%
43	凯乐科技	236,100	4,216,746.00	0.8199%
44	浦东金桥	308,166	4,006,158.00	0.7790%
45	九芝堂	124,608	2,143,257.60	0.4167%
46	鲁泰A	85,000	1,228,250.00	0.2388%
47	宏智科技	24,000	208,320.00	0.0405%
48	卧龙科技	9,000	168,390.00	0.0327%
49	安源股份	23,000	137,770.00	0.0268%
50	泰豪科技	14,000	66,640.00	0.0130%

## 2、本期新增股票

序号	股票代码	股票名称	本期新增(股)			本期卖出(股)
			一级申购	二级买入	其他	
1	000422	湖北宣化		631,696		
2	000488	晨鸣纸业		478,250		
3	000511	银基发展		900,814		
4	000600	国际大厦		630,893		
5	000608	阳光股份		701,361		
6	000767	漳泽电力		303,096		
7	000787	创智科技		1,042,840		
8	000799	湘酒鬼		500,000		
9	000895	双汇发展		300,052	444,184	
10	000900	现代投资		540,733		
11	000969	安泰科技		520,005		
12	600036	招商银行	312,800	1,500,000		
13	600056	中技贸易		436,331		
14	600096	云天化		750,000		
15	600113	浙江东日		506,001		
16	600196	复星实业		615,521	115,883	132,300
17	600236	桂冠电力		598,200		
18	600242	华龙集团		500,087		
19	600266	北京城建		657,682		

20	600283	钱江水利		544,169
21	600300	维维股份		400,000
22	600310	桂东电力		406,441
23	600312	平高电气		607,736
24	600397	安源股份	23,000	
25	600503	宏智科技	24,000	
26	600580	卧龙科技	9,000	
27	600590	泰豪科技	14,000	
28	600608	上海科技		463,600
29	600611	大众交通		687,942
30	600639	浦东金桥		308,166
31	600702	沱牌曲酒		930,000
32	600856	长百集团		683,657

注：其他中包括送股及增发股票。

### 3、本期清仓股票

序号	股票代码	股票名称	期初结 存（股）	本期增加 （股）	本期卖出 （股）
1	000006	深振业 A		337,200	337,200
2	000027	深能源 A	32,500		32,500
3	000039	中集集团	63,350	81,656	145,006
4	000046	光彩建设	3,000		3,000
5	000061	农产品	181,995	11,000	192,995
6	000068	赛格三星	88,850		88,850
7	000156	安塑股份	93,500		93,500
8	000400	许继电气	365,295	417,879	783,174
9	000423	东阿阿胶	220,230	150,000	370,230
10	000527	粤美的 A	234,000	161,200	395,200
11	000539	粤电力 A	145,000	40,000	185,000
12	000562	宏源证券	73,228		73,228
13	000591	桐君阁	20,820		20,820
14	000693	聚友网络	216,088		216,088
15	000695	灯塔油漆	31,200		31,200
16	000748	湘计算机		172,394	172,394
17	000798	中水渔业		583,939	583,939
18	000800	一汽轿车	150,000	899,665	1,049,665
19	000821	京山轻机		100,581	100,581
20	000858	五粮液	479,073	281,428	760,501
21	000890	法尔胜	150,000		150,000
22	000930	丰原生化	20,000		20,000
23	000931	中关村	177,000		177,000
24	000983	西山煤电	300,000		300,000
25	000999	三九医药	101,170	100,000	201,170
26	600007	中国国贸	326,650		326,650
27	600009	上海机场	205,000	418,553	623,553

28	600026	中海发展		1,299,000	1,299,000
29	600028	中国石化	220,500		220,500
30	600088	中视传媒	10,000		10,000
31	600098	广州控股	693,467	555,226	1,248,693
32	600223	万杰高科	120,800		120,800
33	600233	大连创世	20,000		20,000
34	600247	物华股份	150,660		150,660
35	600292	九龙电力	189,200		189,200
36	600305	恒顺醋业	92,600		92,600
37	600315	上海家化	178,600		178,600
38	600317	营口港		14,000	14,000
39	600320	振华港机	193,800		193,800
40	600327	大厦股份		12,000	12,000
41	600346	冰山橡塑	44,800		44,800
42	600350	山东基建		1,173,000	1,173,000
43	600355	精伦电子		12,000	12,000
序号	股票代码	股票名称	期初结 存(股)	本期增加 (股)	本期卖出 (股)
44	600356	恒丰纸业	65,813		65,813
45	600362	江西铜业	62,000	200,000	262,000
46	600372	昌河股份	252,700	297,330	550,030
47	600373	鑫新股份		1,000	1,000
48	600379	宝光股份	21,000		21,000
49	600426	华鲁恒升		21,000	21,000
50	600428	中远航运		44,000	44,000
51	600456	宝钛股份		5,000	5,000
52	600486	扬农化工		13,000	13,000
53	600496	长江股份		37,000	37,000
54	600505	西昌电力		14,400	14,400
55	600506	香梨股份	43,000		43,000
56	600509	天富热电		4,000	4,000
57	600510	黑牡丹		10,000	10,000
58	600520	三佳模具	4,000		4,000
59	600529	山东药玻		27,000	27,000
60	600533	栖霞建设		2,000	2,000
61	600536	中软股份		16,000	16,000
62	600548	深高速	1,186,744		1,186,744
63	600578	京能热电		55,000	55,000
64	600582	天地科技		2,000	2,000
65	600583	海油工程		6,000	6,000
66	600585	海螺水泥		39,000	39,000
67	600595	中孚实业		21,000	21,000
68	600598	北大荒		51,000	51,000
69	600609	金杯汽车	402,980		402,980

70	600642	申能股份	283,509	268,000	551,509
71	600675	中华企业	624,530	100,000	724,530
72	600694	大商股份		354,585	354,585
73	600713	南京医药	58,241	50,000	108,241
74	600718	东软股份	118,000		118,000
75	600742	一汽四环	110,000	2,700	112,700
76	600747	大显股份	304,221	197,260	501,481
77	600775	南京熊猫	107,300		107,300
78	600776	东方通信	196,670		196,670
79	600795	国电电力	93,850	16,000	109,850
80	600811	东方集团	498,872		498,872
81	600812	华北制药	43,298		43,298
82	600866	星湖科技	228,788		228,788
83	600879	火箭股份		62,700	62,700
84	600885	力诺工业	170,443		170,443
85	600887	伊利股份	610,710		610,710

#### 六、基金持有人结构及前十名持有人

(一)、截止 2002 年 6 月 30 日,本基金份额结构为:

	6 月末持有份额	占总份额比例
发起人持有	4,500,000 份	0.90%
其中:长盛基金管理有限公司	1,000,000 份	0.20%
长江证券有限责任公司	500,000 份	0.10%
国元证券有限责任公司	1,000,000 份	0.20%
中信证券股份有限公司	1,000,000 份	0.20%
天津北方国际信托投资公司	1,000,000 份	0.20%
其他持有人持有	495,500,000 份	99.10%
合计	500,000,000 份	100.00%

(二)、截止 2002 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	中国人保	40,672,349	8.13%
2	中海信托	16,786,600	3.36%
3	中国人寿	11,475,462	2.30%
4	中煤信托	11,450,000	2.29%
5	安徽伊美	7,890,000	1.58%
6	中国太保	5,000,000	1.00%
7	崔志强	4,188,000	0.84%
8	葛录积	3,960,000	0.79%
9	张德芳	3,960,000	0.79%
10	吴潮平	3,600,000	0.72%

根据 2002 年 7 月 19 日中海信托投资有限责任公司投资部公告,因对证监基字〔1998〕29 号文关于投资者投资基金不得超过 3%的规定不了解,中海信托投资有限责任公司投资部超额买入基金同德 1,786,600 份,现于 7 月 16 日平仓,无获利。

#### 七、重要事项揭示

1、本基金管理人、托管人在本期内未发生任何诉讼事项。

2、根据有关法规的规定,基金管理公司的董事长不得在其他经营性机构兼任董事长及其他高级管理职务。长盛基金管理有限公司已严格遵循上述有关法规规定,执行董事长或其他高级管理人员的任职事宜。

3、根据长盛基金管理有限公司 2002 年股东会决议,确定潘金友先生、霍津义先生、丁楹先生为第二届公司监事。此项任职已报中国证监会备案。

4、根据长盛基金管理有限公司第一届董事会第七次会议决议,同意张佑君先生辞去公司总经理职务,同意聘请蒋月勤先生担任公司总经理职务。根据长盛基金管理有限公司第一届董事会第六次会议决议,同意杨军鸟女士辞去公司副总经理职务。根据长盛基金管理有限公司第二届董事会第一次会议决议,同意杨光启先生辞去公司副总经理职务,同意聘请邓瑞祥先生、杨文清先生担任公司副总经理职务。上述事项已按规定报中国证监会审核并经证监基金字[2002]16号文批准同意。

5、根据长盛基金管理有限公司第二届董事会第二次会议(以通讯方式召开)决议,同意李明先生辞去同德证券投资基金基金经理职务的申请,聘请陈剑平先生担任同德证券投资基金基金经理。此决议已报中国证券监督管理委员会备案。

6、根据长盛基金管理有限公司 2001 年股东会第一次会议决议,公司注册资本由 8000 万元人民币调增至 10000 万元人民币。公司股东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公司、国元证券有限责任公司按原出资比例等额增资。各股东出资额由 2000 万元人民币增至 2500 万元人民币,各占 25%。增资部分由 2000 年度分配利润转增形成,并经安永华明会计师事务所验资报告确认。上述增资方案已报中国证监会审核并经证监基金字[2002]14号文批复同意。本调整事项已按规定在国家工商行政管理局办理了注册变更手续。

7、中国证监会《关于同意同德证券投资基金上市、扩募和续期的批复》(证监基金字[2001]21号文),基金同德于 2001 年 8 月 1 日在上海证券交易所上市交易,并于 2001 年 9 月 4 日由 2 亿份基金单位扩募至 5 亿份基金单位。2001 年 9 月 24 日,基金同德扩募可流通部分在上海证券交易所上市交易。根据《同德证券投资基金基金契约》的规定,在基金存续期,基金发起人持有基金单位不得低于基金总规模的 0.5%,其余部分在该基金扩募部分上市两个月后方可流通。到 2002 年 1 月 31 日,基金同德扩募部分上市已超过两个月。根据交易所的安排,自 2002 年 2 月 6 日起,基金同德发起人持有的可上市部分(250 万份)可以上市流通,未上市部分(250 万份)在基金存续期内由基金发起人继续持有。

8、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》的有关要求,经我公司认真研究,我们选择了中关村证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、西南证券有限责任公司和兴业证券股份有限公司四家券商租用交易席位。我们选择证券经营机构的标准是:

(1) 资力雄厚,信誉良好。

(2) 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 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基金进行证券交易的,并能为本基金提供全面的信息。

(6) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时为本基金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、个股分析报告及其他专门报告,并能根据基金投资的一定要求,提供专门研究报告。

2002 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(元)	占交易量比例	佣金(元)	占佣金比
------	----------	--------	-------	------



例

中关村证券股份有限公司	24,921,026.87	4.55%	19,105.93	4.61%
国泰君安证券股份有限公司	249,735,696.18	45.57%	198,682.95	47.98%
西南证券有限责任公司	131,585,614.91	24.01%	100,456.35	24.26%
兴业证券股份有限公司	141,791,183.11	25.87%	95,864.85	23.15%
合计	548,033,521.07	100.00%	414,110.08	100.00%

2002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(元)	占交易量比例	回购交易量(元)	占交易量比例
中关村证券股份有限公司	963,358.20	0.16%	100,000,000.00	4.55%
国泰君安证券股份有限公司	54,583,806.70	9.11%	122,000,000.00	5.56%
西南证券有限责任公司	180,791,117.10	30.19%	302,500,000.00	13.77%
兴业证券股份有限公司	362,580,008.00	60.54%	1,671,600,000.00	76.12%
合计	598,918,290.00	100.00%	2,196,100,000.00	100.00%

由于本公司与部分券商的业务关系逐步建立,部分券商交易席位陆续开通,造成交易量的差异。因此,上述部分席位交易量分配与券商服务考评结果无直接关系。

#### 八、备查文件目录

- 1、关于广东省金券基金、粤东国债投资受益凭证及金信基金清理规范方案的批复
- 2、关于同意同德证券投资基金上市、扩募和续期的批复
- 3、同德证券投资基金契约
- 4、同德证券投资基金托管协议
- 5、报告期内披露的各项公告原件
- 6、长盛基金管理有限公司营业执照和公司章程

长盛基金管理有限公司  
二〇〇二年七月二十七日