

广发聚丰股票型证券投资基金 2006 年度报告

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

日期：二零零七年三月

重要提示

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 年 3 月 21 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、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。

本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。

目录

一、	基金简介	4
二、	主要财务指标和基金净值表现	5
三、	管理人报告	7
四、	托管人报告	10
五、	审计报告	11
六、	财务会计报告	12
七、	投资组合报告	28
八、	基金份额持有人户数、持有人结构及基金份额变动情况	28
九、	重大事件揭示	35
十、	备查文件目录	35

一、基金简介

(一)基金基本资料

基金名称：广发聚丰股票型证券投资基金

基金简称：广发聚丰

基金代码：270005

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2005 年 12 月 23 日

截止 2006 年 12 月 31 日本基金份额总额：1,470,284,026.01 份

投资目标：依托中国快速发展的宏观经济和高速成长的资本市场，通过适时调整价值类和成长类股票的配置比例和股票精选，寻求基金资产长期增值。

投资策略：本基金的投资范围是具有良好的流动性的金融工具，包括国内依法公开发行的各类股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金将股票资产分为价值类股票和成长类股票两类风格资产，在两类资产中运用不同的方法分别筛选具有投资价值的股票，同时保持两类资产的适度均衡配置，构建股票投资组合。

业绩比较基准：80%*新华富时 A600 指数+20%*新华雷曼中国全债指数

风险收益特征：较高风险，较高收益

(二)基金管理人及注册登记人概况

名称：广发基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市凤凰北路 19 号农行商业大厦 1208 室

办公地址：广州市天河区体育西路 57 号红盾大厦 14、15 楼

邮政编码：510620

成立时间：2003 年 8 月 5 日

法定代表人：马庆泉

信息披露负责人：兰惠艳

联系电话：020-83936666

传真：020-85586632

电子信箱：lhy@gffunds.com.cn

(三)基金托管人概况

名称：中国工商银行股份有限公司（以下简称“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：蒋松云

联系电话：010-66106912

传真：010-66106904

电子邮箱：custody@icbc.com.cn

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：深圳鹏城会计师事务所

办公地址：深圳市东门南路 2006 号宝丰大厦 5 楼

法人代表：饶永

电话：0755-82203222

传真：0755-82237549

经办注册会计师：杨克晶 侯立勋

(五)本基金选定的信息披露报纸：中国证券报 证券时报

此外，投资者还可以通过以下途径查阅本基金年度报告：

查阅地点：广州市体育西路 57 号红盾大厦 14 楼

本基金管理人网址：<http://www.gffunds.com.cn>

二、主要财务指标和基金净值表现

(一) 主要财务指标

单位:人民币元

项 目	2006 年 1 月 1 日--12 月 31 日	2005 年 12 月 23 日--12 月 31 日
基金本期净收益	839,000,475.82	-250,162.00
基金份额本期净收益 (加权)	0.5579	-0.0002
期末可供分配基金收益	523,317,194.74	-250,162.00
期末可供分配基金份额收益	0.3559	-0.0002
期末基金资产净值	3,166,641,417.24	1,315,283,133.56
期末基金份额净值	2.1538	0.9996
基金加权平均净值收益率	36.05%	-0.02%
本期基金份额净值增长率	144.08%	-0.04%
基金份额累计净值增长率	143.98%	-0.04%

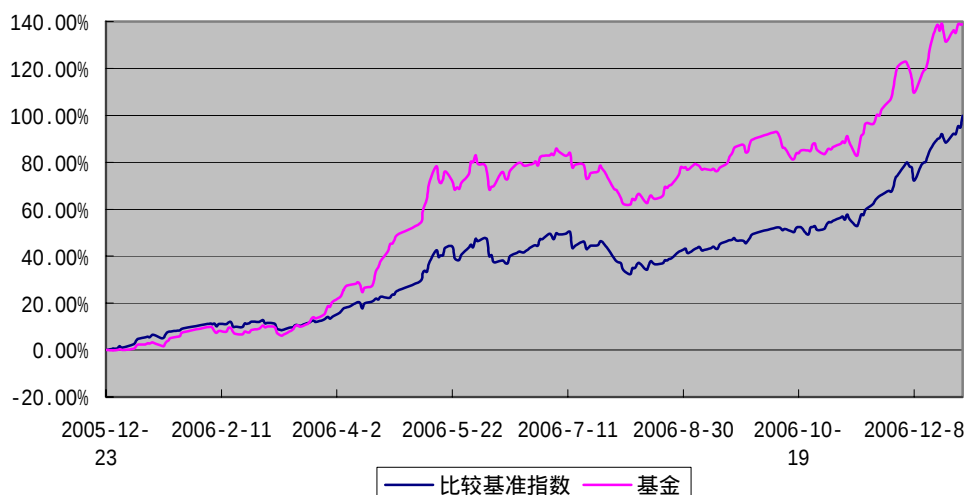
注：本基金基金合同于 2005 年 12 月 23 日生效。

(二) 基金净值表现

1. 本基金本报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

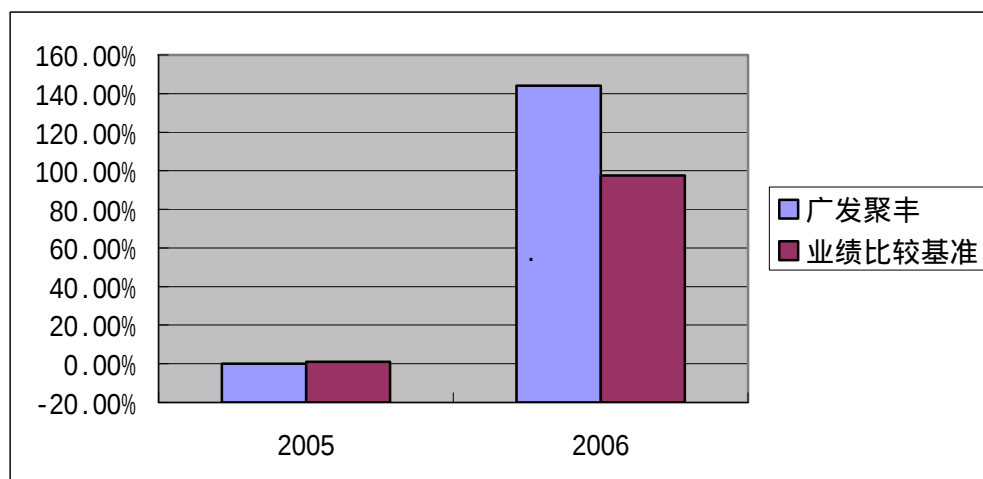
阶 段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1) - (3)	(2) - (4)
过去 3 个月	28.59%	0.0155	31.35%	0.0112	-2.76%	0.0043
过去 6 个月	33.49%	0.0138	33.24%	0.0112	0.25%	0.0026
过去一年	144.08%	0.0141	97.54%	0.0112	46.54%	0.0029
自基金合同生效以来	143.98%	0.0139	99.87%	0.0111	44.11%	0.0028

2. 本基金自基金合同生效以来基金份额净值的变动与同期业绩比较基准比较图



注：1、业绩比较基准： $80\% \times \text{新华富时 A600 指数} + 20\% \times \text{新华雷曼中国全债指数}$
 2、本基金基金合同生效日为 2005 年 12 月 23 日，图示时间段为 2005 年 12 月 23 日至 2006 年 12 月 31 日。

3. 本基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



4. 本基金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
2005	0	本基金在 2005 年度未进行收益分配。
2006	2.00 元	本基金 2006 年度共分红 5 次, 累计每 10 份分红 2.00 元
合计	2.00 元	

三、管理人报告

(一) 基金管理人及基金经理情况：

截至本报告期末，本基金管理人目前旗下管理六只基金：本基金、广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金、广发货币市场基金和广发策略优选混合型证券投资基金。

基金经理情况：

易阳方：男，总经理助理兼投资管理部总经理，经济学硕士，9 年证券从业经历，曾任广发证券股份有限公司投资自营部副经理，曾在广发证券股份有限公司投资理财部和投资银行部从事资产管理和投资银行业务。

（二）基金运作合规性声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套法规、《广发聚富开放式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资管理符合有关法律法规及基金合同的规定。

（三）基金运作及市场情况回顾与展望

1. 市场回顾

2006 年宏观经济在城镇化进程加快、消费升级、全球制造业向中国转移等因素带动下，进出口高速发展、内需稳步提升、企业利润快速增长，国内经济增长步入中国近代史上前所未有的黄金期。证券市场方面，管理部门成功完成股权分置改革，彻底解决了证券市场发展中的顽症，投资者信心全面恢复。在人民币不断升值和全球性流动性泛滥的推动下，证券市场彻底告别长达 5 年的熊市，步入牛市周期，全年上证综指从 1161.06 上涨到 2675.47，上涨幅度达到 130.43%。

2. 基金操作回顾：

本基金在 2006 年将消费服务、技术装备、稀缺资源作为投资重点，在风格上上半年重点投资在成长风格的股票，下半年根据整体估值水平的变化，适度增持了价值风格的股票。总体看，运作绩效良好，本基金全年基金净值增长 144.08%，大大超过比较基准及上证综指的涨幅。

3. 展望：

本基金坚信，中国经济正步入一个辉煌的增长时期，产业格局也正在发生巨大变化，由原来劳动力密集型向资本、技术密集型方向转移。在上市公司层面，

股权分置改革的成功,推动上市公司治理结构改善,同时由于行业整合等因素推动上市公司整体经营效率提升,上市公司利润增长有望快于 GDP 增长。值得警惕的是目前流动性泛滥,许多行业估值水平远远超过国际水平,短期风险较大。本基金的投资将业绩增长确定性及估值合理性作为重点考虑因素,重点配置在成长性确定的内需型行业,同时继续加强组合流动性管理,争取在承受适度风险前提下取得较好的业绩。

(四) 内部监察报告

2006 年度,本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发,依照公司内部控制的整体要求,致力于内控机制的建立和完善,公司内部管理制度及业务规范流程的制定和完善,加强内部风险的控制与防范,以保证各项法规和管理制度的落实,保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部按照规定的权限和程序,独立地开展监察稽核工作,发现问题及时提出改进建议并督促相关部门进行整改,同时定期向监管部门、董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内,基金管理人内部监察稽核主要工作如下:

1. 日常监察稽核工作:为规范基金运作、防范风险、更好的保护基金持有人的利益,通过对基金投资及相关业务的实时的跟踪检查,进行事中的风险控制。公司管理的基金规范运作,在研究、投资决策、交易执行等相关环节严格执行法律法规及基金合同的有关规定。

2. 定期监察稽核工作:按季结合“季度监察稽核项目表”对公司及基金运作的合法合规性及内部控制情况进行检查,并向中国证监会、公司董事会及公司总经理提交《季度监察稽核报告》,对公司及基金运作情况进行事后的全面检查控制,以保证内控制度的有效执行。

3. 年度内控评审:结合日常监察稽核工作结果,对 2005 年度公司及基金运作中内控制度执行情况进行全面评审,对公司各项业务的管理水平、制度建设、制度执行、风险控制等情况进行评估,找出内控的薄弱环节,并提出相应改进措施,促进公司内部控制和风险管理水平的加强和提高。

4. 专项稽核检查:根据监管部门的要求及公司业务发展情况对相关业务进行专项监察稽核,使风险控制工作向纵深展开。按中国证监会要求对新募集基金的宣传推介、直销及代销活动进行专项检查,公司及代销机构都严格遵守法律、

法规及中国证监会的规定，宣传推介材料内容真实、准确、合规；针对公司加强保密工作、加强网站建设及域名管理、就《基金管理公司治理准则》中可能对公司治理和经营管理有影响的内容及对《公司章程》修订的相关建议等提交专项报告。

5. 合法合规咨询：就合规运作问题接受各业务部门的咨询并给予合法合规建议，将风险控制关口提到事前。

6. 制度建设：根据公司业务的发展及法律法规的更新，协调、组织各部门对公司制度进行持续的完善、修订及补充。包括修订《公司章程》；制定《基金投资流通受限证券投资决策及风险管理办法》、《风险准备金管理办法》、《法律事务管理办法》；《公司标准化业务规范》的编制，此项工作 2006 年 5 月开始，在对试点部门相关制作工作总结、完善的基础上，公司全面铺开，2006 年底已基本完成公司全部部门的业务流程图初稿，争取 2007 年上半年完成全部修订工作，形成定稿。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

四、托管人报告

2006年度，本基金托管人在对广发聚丰股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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基金托管人应尽的义务。

2006年度，广发聚丰股票型证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发聚丰股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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。

本托管人依法对广发基金管理有限公司在2006年度所编制和披露的广发聚丰股票型证券投资基金年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2007 年 3 月 6 日

五、审计报告

深鹏所审字[2007]224 号

广发聚丰股票型证券投资基金全体持有人：

我们审计了后附的广发聚丰股票型证券投资基金（简称“广发聚丰基金”）财务报表，包括 2006 年 12 月 31 日的资产负债表和 2006 年度的经营业绩表、基金净值变动表、基金收益分配表以及财务报表附注。

一、基金管理人 对财务报表的责任

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》、《广发聚丰股票型证券投资基金基金合同》及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财务报表是广发聚丰基金的基金管理人——广发基金管理有限公司的责任。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，广发聚丰基金财务报表已经按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《广发聚丰股票型证券投资基金基金合同》及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地反映了广发聚丰基金 2006 年 12 月 31 日的财务状况以及 2006 年度的经营成果、净值变动及收益分配情况。

深圳市鹏城会计师事务所有限公司
中国 • 深圳
2007 年 3 月 22 日

中国注册会计师

杨克晶
中国注册会计师
侯立勋

六、财务会计报告

（一）基金会计报表

资产负债表

（2006 年 12 月 31 日）

金额单位：人民币元

资 产	附注	2006-12-31	2005-12-31
资产：			
银行存款		192,338,944.51	910,505,098.02
清算备付金		5,748,153.94	-
交易保证金		750,000.00	250,000.00
应收证券款		28,952,060.31	-
应收股利		-	-
应收利息	4(1)	42,114.06	254,566.66
应收申购款		9,975,053.01	-
其他应收款	4(2)	21,000,000.00	-
股票投资市值	4(3)	2,872,931,135.25	455,399,092.90

其中：股票投资成本		1,878,001,932.79	455,721,822.30
债券投资市值		-	-
其中：债券投资成本		-	-
权证投资市值	4(3)	85,648,142.73	-
其中：权证投资成本		51,974,951.08	-
买入返售证券			
待摊费用			
其他资产			0.00
资产合计		3,217,385,603.81	1,366,408,757.58
负债与基金持有人权益			
应付证券款		19,865,368.69	50,004,653.78
应付赎回款		21,554,894.99	-
应付赎回费		100,895.83	-
应付管理人报酬		3,723,184.82	432,634.22
应付托管费		620,530.79	72,105.69
应付佣金	4(4)	3,679,250.70	366,230.33
应付利息			
应付收益			
未交扣金			
其他应付款	4(5)	1,000,060.75	250,000.00
卖出回购证券款		-	
短期借款			
预提费用	4(6)	200,000.00	-
其他负债			0.00
负债合计		50,744,186.57	51,125,624.02
持有人权益：			
实收基金	4(7)	1,470,284,026.01	1,315,856,024.96
未实现利得	4(8)	1,173,040,196.49	-322,729.40
未分配收益		523,317,194.74	-250,162.00
持有人权益合计		3,166,641,417.24	1,315,283,133.56
负债及持有人权益合计		3,217,385,603.81	1,366,408,757.58

经营业绩表

(2006 年 1 月 1 日——2006 年 12 月 31 日)

金额单位：人民币元

项 目	附 注	2006 年 1 月 1 日—12 月 31 日	2005 年 12 月 23 日—12 月 31 日
一、已实现基金收入		879,686,205.74	254,577.91
其中：股票差价收入	4(9)	799,548,276.64	-
债券差价收入	4(10)	-1,273,949.85	-
权证差价收入	4(11)	46,744,447.64	-
债券利息收入		348,811.41	-
存款利息收入		1,720,638.32	254,566.66
股利收入		26,496,411.42	-
买入返售证券收入			-
其他收入	4(12)	6,101,570.16	11.25
减：基金费用		40,685,729.92	504,739.91
其中：基金管理人报酬		34,483,457.57	432,634.22
基金托管费		5,747,242.93	72,105.69
卖出回购证券支出		117,158.00	-
利息支出		-	
其他费用	4(13)	337,871.42	-
其中：交易费用		1,700.04	-
信息披露费		220,000.00	-
审计费用		80,000.00	-
帐户维护费		18,000.00	-
银行费用		18,171.38	
二、已实现基金收益		839,000,475.82	-250,162.00
加：未实现利得		1,028,925,123.51	-322,729.40
三、基金经营业绩		1,867,925,599.33	-572,891.40

收益分配表

(2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日期间)

金额单位：人民币元

	附注	2006 年 1 月 1 日-12 月 31 日	2005 年 12 月 23 日-12 月 31 日
本期基金净收益		839,000,475.82	-250,162.00
加：期初基金净收益		-250,162.00	
本期损益平准金		-17,553,249.30	-
可供分配基金净收益		821,197,064.52	-250,162.00
减：本期已分配基金净收益	4(14)	297,879,869.78	-
期末基金净收益			

		523,317,194.74	-250,162.00
--	--	----------------	-------------

基金净值变动表

(2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日期间)

金额单位：人民币元

项 目	2006 年 1 月 1 日 - 12 月 31 日	2005 年 12 月 23 日 - 12 月 31 日
一、期初基金净值	1,315,283,133.56	1,315,856,024.96
二、本期经营活动		
基金净收益	839,000,475.82	-250,162.00
未实现利得	1,028,925,123.51	-322,729.40
经营活动产生的基金净值变动数	1,867,925,599.33	-572,891.40
三、本期基金份额交易		
基金申购款	5,188,355,334.98	-
基金赎回款	4,907,042,780.85	-
基金份额交易产生的基金净值变动数	281,312,554.13	-
四、本期向持有人分配收益		0.00
向持有人分配收益产生基金净值变动数	297,879,869.78	0.00
五、以前年度损益调整		0.00
因损益调整产生的净值变动数		
六、期末基金净值	3,166,641,417.24	1,315,283,133.56

(二) 会计报告书附注

1、基金简介

广发聚丰股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经证监基金字[2005]180号文《关于同意广发聚丰股票型证券投资基金募集的批复》批准,由基金发起人广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发聚丰股票型证券投资基金基金合同》发起,于2005年12月23日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金已向中国证券监督管理委员会备案,并获中国证监会基金部函[2005]293号《关于广发聚丰股票型证券投资基金备案确认的函》确认。

本基金募集期为2005年11月21日至2005年12月21日,本基金为契约型开放式股票型基金,存续期限不定,首次募集资金为1,315,856,024.96元,有效认购户数为15,026户。其中,认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币175,370.72元,利息结转的基金份额175,370.72份,按照《广发聚丰股票型证券投资基金基金合同》的有关约定计入投资者基金账户。本基金募集资金经深圳市鹏城会计师事务所有限公司验资。基金合同于2005年12月23日生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,315,856,024.96份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发聚丰股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的各类股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

2、主要会计政策和会计估计

(1). 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》的规定而编制。

(2). 会计年度

以1月1日起至12月31日止为一个会计年度。

(3). 记账本位币

以人民币为记账本位币。

(4). 记帐基础和计价原则

以权责发生制为记账基础,除上市股票投资、债券投资与权证投资按市值计价外,其余均以历史成本为计价原则。

(5). 基金资产的估值方法

a. 已上市流通的有价证券的估值

上市流通的股票,以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;

在证券交易所市场流通的债券,按如下估值方式处理:

1/ 实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值。

2/ 未实行净价交易的债券按估值日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进行估值；估值日没有交易的，按最近交易日债券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进行估值。

b. 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

送股、转增股、配股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

首次公开发行的股票，按成本估值；

在银行间同业市场交易的债券和未上市的债券按成本估值。

c. 配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

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的，基金管理人可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。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

估值对象为基金所拥有的股票、债券和银行存款本息等资产。

(6). 证券投资的成本计价方法

按加权移动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。

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；

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资；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。债券投资成本按成交日应支付的全部价款入账，其中所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。

权证投资成本按成交日支付的全部价款入账。

因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在确认日，按中国证券业协会公布的权证第一天价格确认为权证成本，并相应调整债券投资成本。

分离交易可转债：

认购新发行的分离交易可转债于成交日先按支付的全部价款确认为债券投资，后于权证确认日单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

(7). 待摊费用的摊销方法和摊销期限

待摊费用按直线法在受益期内平均摊销。

(8). 收入的确认和计量

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；

证券交易所交易的债券差价收入于卖出成交日确认；银行间同业市场交易的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认；

权证差价收入于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额入账；

存款利息收入按本金与适用的利率逐日计提的金额入账；

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应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

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入账；

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提；

其他收入于实际收到时确认收入。

(9). 费用的确认和计量

基金管理费按照前一日基金资产净值 1.5% 的年费率逐日计提；

基金托管费按照前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提；

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。

(10). 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配比例为基金净收益的 100%，本基金每年收益分配次数最少一次，最多为六次，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

每一基金份额享有同等分配权；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

(11). 基金申购、赎回的确认

在收到基金投资人申购或赎回申请之日后，于下一个工作日内对该交易的有效性进行确认。于确认日按照实收基金、未实现利得、未分配收益和损益平准金的余额占基金净值的比例，将确认有效的申购或赎回款项分割为三部分，分别确认为实收基金、未实现利得、损益平准金的增加或减少。

(12). 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。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日列示。

(13). 损益平准金

损益平准金为申购、赎回款中所含的按基金未分配净收益占基金净值比例计算的一部分金额，于计算基金申购、赎回确认日列示，并于期末全额转入未分配收益。

(14). 预提费用的摊销方法和摊销期限。

本基金的预提费用包括审计费用和信息披露费用。预提费用按直线法每日计提。

(15). 现金对价的会计处理

本基金报告期内收取的现金对价，于权益确认日冲减股票投资成本。

3、税项

(1).印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]11 号文《关于调整证券（股票）交易印花税率的通知》，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。

(2).营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围，不征收营业税；根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。

(3).个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入及债券的利息收入，由上市公司及债券发行企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。根据财政部、国家税务总局[2005]102 号文《关于股息红利有关个人所得税有关政策的通知》与财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》，对本基金自 2005 年 6 月 13 日起从上市公司分配取得的股息红利所得，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。

4．主要报表项目说明

金额单位：人民币元

(1)．应收利息

项目	2006-12-31	2005-12-31
银行存款利息	39,527.36	254,566.66
清算备付金利息	2,586.70	-
合 计	42,114.06	254,566.66

(2)．其他应收款

项目	2006-12-31	2005-12-31
----	------------	------------

非公开发行股票申购款	21,000,000.00	-
------------	---------------	---

(3). 投资估值增值

项 目	2006-12-31	2005-12-31
股票投资	994,929,202.46	-322,729.40
权证投资	33,673,191.65	-
合 计	1,028,602,394.11	-322,729.40

(4). 应付佣金

券商名称	2006-12-31	2005-12-31
广发证券股份有限公司	724,323.10	366,230.33
国泰君安证券股份有限公司	726,100.98	-
中国银河证券有限责任公司	551,614.67	-
申银万国证券股份有限公司	1,002,847.16	-
东方证券股份有限公司	120,183.01	-
中信建投证券有限责任公司	554,181.78	-
合 计	3,679,250.70	366,230.33

(5). 其他应付款

项目	2006-12-31	2005-12-31
应付广发证券股份有限公司垫付保证金	250,000.00	250,000.00
应付国泰君安证券股份有限公司垫付保证金	250,000.00	-
应付东方证券股份有限公司垫付保证金	250,000.00	-
应付广发华福证券有限责任公司垫付保证金	250,000.00	-
中登错划股利	60.75	-
合 计	1,000,060.75	250,000.00

(6). 预提费用

项 目	2006-12-31	2005-12-31
审计费用	80,000.00	-
信息披露费	120,000.00	-
合 计	200,000.00	-

(7). 实收基金

项 目	2006 年度	2005 年 12 月 23 日(基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日
期初数	1,315,856,024.96	1,315,856,024.96
加：本期因认购及申购的增加数	3,320,799,780.35	-
减：本期因赎回的减少数	3,166,371,779.30	-
期末数	1,470,284,026.01	1,315,856,024.96

(8). 未实现利得

项 目	2006 年度	2005 年 12 月 23 日(基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日
期初数	-322,729.40	-
加：投资估值增值	1,028,925,123.51	-322,729.40
本期申购的未实现利得平准金	1,505,622,650.04	-
减：本期赎回的未实现利得平准金	1,361,184,847.66	-
期末数	1,173,040,196.49	-322,729.40

(9). 股票差价收入

项 目	2006 年度	2005 年 12 月 23 日(基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	5,948,089,348.19	-
减：卖出股票成本总额	5,143,549,014.69	-
应付佣金	4,992,056.86	-
股票差价收入	799,548,276.64	-

(10). 债券差价收入

项 目	2006 年度	2005 年 12 月 23 日(基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日
卖出及到期兑付债券成交总额	101,453,418.03	-
减：卖出及到期兑付债券成本总额	98,563,912.21	-
应收利息	4,163,455.67	-
债券差价收入	-1,273,949.85	-

(11). 权证差价收入

项 目	2006 年度	2005 年 12 月 23 日(基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日
卖出权证成交总额	57,976,745.22	-

减：卖出权证成本总额	11,232,297.58	-
应付佣金	-	-
权证差价收入	46,744,447.64	-

(12). 其他收入

项 目	2006 年度	2005 年 12 月 23 日(基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	4,481,945.40	-
基金转换费收入	1,617,415.56	-
配股手续费返还	2,209.20	-
其 他	-	11.25
合 计	6,101,570.16	11.25

(13). 其他费用

项 目	2006 年度	2005 年 12 月 23 日(基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日
信息披露费	220,000.00	-
审计费用	80,000.00	-
交易费用	1,700.04	-
银行费用	18,171.38	-
帐户维护费	18,000.00	-
合 计	337,871.42	-

(14). 本期已分配基金净收益

本基金本期共进行了五次收益分配，收益分配金额共计 297,879,869.78 元，明细列示如

下：

红利发放日期	金额
2006 年 4 月 3 日	20,729,883.67
2006 年 4 月 12 日	25,098,852.29
2006 年 5 月 24 日	101,986,057.14
2006 年 11 月 3 日	85,916,823.07
2006 年 12 月 5 日	64,148,253.61

合 计	297,879,869.78
-----	----------------

本基金于 2006 年 3 月 28 日宣告向截至 2006 年 3 月 30 日止在基金注册登记人——广发基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.20 人民币元，红利发放日为 2006 年 4 月 3 日，共分配收益计 20,729,883.67 人民币元，其中以现金形式派发计 16,733,589.74 人民币元，以红利再投资形式派发计 3,996,293.93 人民币元。

本基金于 2006 年 4 月 6 日宣告向截至 2006 年 4 月 10 日止在基金注册登记人——广发基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.20 人民币元，红利发放日为 2006 年 4 月 12 日，共分配收益计 25,098,852.29 人民币元，其中以现金形式派发计 20,113,145.38 人民币元，以红利再投资形式派发计 4,985,706.91 人民币元。

本基金于 2006 年 5 月 19 日宣告向截至 2006 年 5 月 22 日止在基金注册登记人——广发基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.65 人民币元，红利发放日为 2006 年 5 月 24 日，共分配收益计 101,986,057.14 人民币元，其中以现金形式派发计 75,300,725.51 人民币元，以红利再投资形式派发计 26,685,331.63 人民币元。

本基金于 2006 年 10 月 31 日宣告向截至 2006 年 11 月 1 日止在基金注册登记人——广发基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.50 人民币元，红利发放日为 2006 年 11 月 3 日，共分配收益计 85,916,823.07 人民币元，其中以现金形式派发计 55,619,957.96 人民币元，以红利再投资形式派发计 30,296,865.11 人民币元。

本基金于 2006 年 11 月 29 日预告向截至 2006 年 12 月 1 日止在基金注册登记人——广发基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.45 人民币元，红利发放日为 2006 年 12 月 5 日，共分配收益计 64,148,253.61 人民币元，其中以现金形式派发计 38,008,802.80 人民币元，以红利再投资形式派发计 26,139,450.81 人民币元。

(15). 股权分置改革现金对价对股票投资成本的影响

本基金本期由于股权分置改革获得现金对价，导致本报告期股票投资成本减少 10,878,319.03 元。

5、关联方关系及交易

(1) 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直

	销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、代销机构
广发华福证券有限责任公司	基金管理人股东的子公司
广发北方证券经纪有限责任公司	基金管理人股东的子公司
广发期货经纪有限公司	基金管理人股东的子公司
广州科技风险投资有限公司	基金管理人股东
香江投资有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东

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

a. 2006 年度，本基金通过关联方席位进行股票、债券和权证交易的成交量：

关联方	交易量			占总交易量比例			佣金	占总佣金比例
	股票	债券	权证	股票	债券	权证		
广发证券股份有限公司	2,811,964,193.73	159,122,510.00	23,737,357.49	22.7 2%	63.63%	19.59%	2,280,034.08	22.79%
广发华福证券有限责任公司	2,464,658,276.98	88,526,025.60	17,095,941.10	19.9 1%	35.40%	14.11%	1,985,164.69	19.85%
合 计	5,276,622,470.71	247,648,535.60	40,833,298.59	42.6 3%	99.03%	33.70%	4,265,198.77	42.64%

b. 2005 年 12 月 23 日（基金合同生效日）-12 月 31 日，本基金通过关联方席位进行股票和权证交易的成交量：

关联方	交易量			占总交易量比例			佣金	占总佣金比例
	股票	债券	权证	股票	债券	权证		
广发证券股份有限公司	454,795,752.75	-	-	100%	-	-	366,230.33	100%

股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额*佣金比例-证管费-经手费-结算风险金（含债券交易）。

上述佣金按市场佣金率计算，佣金比率是公允的。

根据《证券研究服务协议》，本基金管理人从关联方获得证券研究综合服务。

(3) 关联方报酬

a. 基金管理人报酬

基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5 % 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。本基金于本期应支付基金管理人管理费共计人民币 34,483,457.57 元,其中已支付基金管理人人民币 30,760,272.75 元,尚余人民币 3,723,184.82 元未支付。

b. 基金托管人报酬

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:

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。本基金于本期应支付基金托管人托管费共计人民币 5,747,242.93 元,其中已支付基金托管人人民币 5,126,712.14 元,尚余人民币 620,530.79 元未支付。

(4) 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工商银行股份有限公司保管,并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2006 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 192,338,944.51 元。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 1,720,638.32 元。2005 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 910,505,098.02 元,2005 年 12 月 23 日至 2005 年 12 月 31 日间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 254,566.66 元。

(5) 与关联方进行的银行间同业市场债券(含回购)交易

2006 年度,本基金未与基金托管人中国工商银行股份有限公司通过银行间同业市场进行债券交易。

(6) 关联方持有的基金份额

a. 截至 2006 年 12 月 31 日,本基金关联方持有本基金情况如下:

关联方	2006-12-31		
	基金份额	占基金总份额比例	申购费(元)

广发基金管理有限公司	46,494,389.09	3.16%	1,000
------------	---------------	-------	-------

b. 截至 2005 年 12 月 31 日，本基金关联方持有本基金情况如下：

关联方	2005-12-31		
	基金份额	占基金总份额比例	申购费（元）
广发基金管理有限公司	29,999,000.00	2.28%	1,000

本年度本基金关联方持有的基金份额增加 16,495,389.09 份，申购费为 1000 元，2005 年度的申购费为 1,000 元。

6、流通转让受到限制的基金资产

(1) 截止 2006 年 12 月 31 日，流通转让受到限制的基金资产：

a. 截止 2006 年 12 月 31 日，因股权分置改革而暂时停牌，不能自由流通的股票如下：

股票代码	股票名称	数量	年末估值单价	年末估值总额	停牌日期	复牌日期	复牌当日 单价
000549	S 湘火炬	1,700,000	8.90	15,130,000.00	2006-12-19		
000895	S 双汇	1,536,117	31.17	47,880,766.89	2006-6-1		

b. 截止 2006 年 12 月 31 日，因有重大信息披露而暂时停牌，不能自由流通的股票如下：

股票代码	股票名称	数量（股）	年末估值单价	年末估值总额	停牌日期	复牌日期	复牌当日 单价
000046	泛海建设	1,137,846	18.70	21,277,720.20	2006-12-29	2007-1-4	20.22
600875	东方电机	2,377,082	22.19	64,418,922.20	2006-12-20	2007-2-5	29.81

c. 截止 2006 年 12 月 31 日，因非公开发行股份或网下配售限售条件，暂未能流通的股

票如下：

股票代码	股票名称	数量（股）	年末成本 单价（元）	年末成本总额 （元）	年末估值 单价（元）	年末估值总额 （元）	流通日期
000839	中信国安	3,000,000	12.00	36,000,000.00	22.81	68,430,000.00	2007-8-23
600361	华联综超	1,560,372	12.92	20,160,000.00	23.09	36,028,989.48	2007-5-17
600456	宝钛股份	900,000	17.22	15,500,000.00	31.00	27,900,000.00	2007-9-13
600761	安徽合力	700,000	10.60	7,420,000.00	22.25	15,575,000.00	2007-7-7
601006	大秦铁路	159,390	4.95	788,980.50	8.10	1,291,059.00	2007-7-27
601988	中国银行	471,570	3.08	1,452,435.60	5.43	2,560,625.10	2007-1-5

(2) 截至 2005 年 12 月 31 日，流通转让受到限制的基金资产

截至 2005 年 12 月 31 日，因股权分置改革而暂时停牌，不能自由流通的股票如下：

股票代码	股票名称	数量（股）	年末估值 单价（元）	年末估值总额 （元）	停牌日期	复牌日期	复牌当日 单价（元）
000987	广州友谊	1,286,170	8.23	10,585,179.10	2005-12-30	2006-1-20	6.04

7、资产负债表日后事项

2006 年 10 月，本基金参加了金融街控股股份有限公司（000402）非公开定向增发，认购其股份 200 万股（锁定期为 2007 年 1 月 25 日至 2008 年 1 月 25 日），截止 2006 年 12 月 31 日，本基金应收该股票非公开发行股份申购款 2,100 万元。2007 年 1 月 24 日，该股票本次非公开发行新增股份到帐。

截至本会计报表批准报出日，除上述事项，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

8、或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

9、承诺事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的承诺事项。

10、其他重大事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的其他重要事项。

七、投资组合报告

（一）基金资产配置组合

	市值（元）	占总资产的比重
股票	2,872,931,135.25	89.29%
债券	0	0
权证	85,648,142.73	2.66%
银行存款和清算备付金	198,087,098.45	6.16%
其他资产	60,719,227.38	1.89%
合计	3,217,385,603.81	100.00%

（二）按行业分类的股票投资组合

行业	市值(元)	市值占净值比
A 农、林、牧、渔业	14,081,226.72	0.44%
B 采掘业	288,211,042.41	9.10%
C 制造业	1,214,494,567.58	38.35%
C0 食品、饮料	362,646,162.48	11.45%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	11,927,979.00	0.38%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	128,886,336.12	4.07%
C5 电子	42,853,788.03	1.35%
C6 金属、非金属	358,935,195.82	11.33%
C7 机械、设备、仪表	235,358,590.86	7.43%
C8 医药、生物制品	73,886,515.27	2.33%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	26,760,804.30	0.85%
G 信息技术业	167,907,514.40	5.30%
H 批发和零售贸易	445,535,048.00	14.07%
I 金融、保险业	365,420,311.89	11.54%
J 房地产业	323,729,391.95	10.22%
K 社会服务业	0.00	0.00%
L 传播与文化产业	5,253,000.00	0.17%
M 综合类	21,538,228.00	0.68%
合计	2,872,931,135.25	90.72%

(三) 本基金持有的所有股票明细

科目代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占净值比
002024	苏宁电器	6,250,000	283,750,000.00	8.96%
600000	浦发银行	11,564,509	246,439,686.79	7.78%
600519	贵州茅台	2,507,130	220,201,227.90	6.95%
600048	保利地产	3,758,038	162,798,206.16	5.14%
600456	宝钛股份	4,100,000	127,100,000.00	4.01%
000792	盐湖钾肥	5,008,548	118,001,390.88	3.73%
600583	海油工程	3,312,450	114,842,641.50	3.63%
600028	中国石化	10,783,249	98,343,230.88	3.11%
600694	大商股份	3,260,000	95,811,400.00	3.03%
000839	中信国安	4,050,000	92,380,500.00	2.92%
600383	金地集团	4,260,000	78,724,800.00	2.49%
600005	武钢股份	12,000,000	76,320,000.00	2.41%
000063	中兴通讯	1,800,000	70,380,000.00	2.22%
600585	海螺水泥	2,322,314	69,669,420.00	2.20%
600875	东方电机	2,377,082	64,418,922.20	2.03%
600348	国阳新能	4,291,269	63,811,170.03	2.02%
000157	中联重科	2,868,407	63,764,687.61	2.01%

600030	中信证券	2,000,000	54,760,000.00	1.73%
000895	S 双汇	1,536,117	47,880,766.89	1.51%
600312	平高电气	3,135,415	46,937,162.55	1.48%
600809	山西汾酒	1,484,703	46,010,945.97	1.45%
000568	泸州老窖	1,522,858	38,589,221.72	1.22%
600361	华联综超	1,560,372	36,028,989.48	1.14%
600036	招商银行	2,000,000	32,720,000.00	1.03%
600360	华微电子	2,000,000	29,480,000.00	0.93%
000001	深发展 A	2,000,000	28,940,000.00	0.91%
000006	深振业 A	2,113,621	28,343,657.61	0.90%
600549	厦门钨业	1,500,000	25,770,000.00	0.81%
600269	赣粤高速	2,999,970	25,469,745.30	0.80%
000402	金 融 街	1,460,000	24,601,000.00	0.78%
600826	兰生股份	2,313,213	23,224,658.52	0.73%
000046	泛海建设	1,137,846	21,277,720.20	0.67%
600296	兰州铝业	1,581,713	20,419,914.83	0.64%
600161	天坛生物	861,384	17,830,648.80	0.56%
002022	科华生物	994,448	17,382,951.04	0.55%
600817	宏盛科技	2,027,170	17,028,228.00	0.54%
600849	上海医药	2,389,703	16,273,877.43	0.51%
600867	通化东宝	1,887,330	16,231,038.00	0.51%
600761	安徽合力	700,000	15,575,000.00	0.49%
000549	S 湘火炬	1,700,000	15,130,000.00	0.48%
000550	江铃汽车	1,209,691	15,000,168.40	0.47%
600685	广船国际	743,963	13,168,145.10	0.42%
600467	好 当 家	1,500,000	12,240,000.00	0.39%
600978	宜华木业	882,900	11,927,979.00	0.38%
600205	山东铝业	526,981	11,904,500.79	0.38%
600022	济南钢铁	1,545,990	11,873,203.20	0.37%
601699	潞安环能	700,000	11,214,000.00	0.35%
600527	江南高纤	1,761,318	10,884,945.24	0.34%
000807	云铝股份	1,000,000	10,660,000.00	0.34%
000869	张 裕 A	200,000	9,964,000.00	0.31%
600325	华发股份	579,391	7,984,007.98	0.25%
002076	雪莱特	422,559	7,931,432.43	0.25%
600755	厦门国贸	1,000,000	6,720,000.00	0.21%
600535	天 士 力	400,000	6,168,000.00	0.19%
002008	大族激光	263,170	5,442,355.60	0.17%
600880	博瑞传播	300,000	5,253,000.00	0.17%
600410	华胜天成	207,040	5,147,014.40	0.16%
000793	华闻传媒	500,000	4,510,000.00	0.14%
000657	中钨高新	350,000	3,514,000.00	0.11%
601988	中国银行	471,570	2,560,625.10	0.08%
002069	獐子岛	24,868	1,841,226.72	0.06%
600529	山东药玻	214,900	1,704,157.00	0.05%
600391	成发科技	133,775	1,364,505.00	0.04%

601006	大秦铁路	159,390	1,291,059.00	0.04%
--------	------	---------	--------------	-------

(四) 报告期内股票投资组合的重大变动

本报告期内累计买入金额超过净值 2%的股票			
股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占净值比(%)
600028	中国石化	285,088,949.41	21.68%
600000	浦发银行	201,158,868.70	15.29%
000792	盐湖钾肥	191,298,080.26	14.54%
600694	大商股份	176,193,630.85	13.40%
600900	长江电力	175,188,484.38	13.32%
600036	招商银行	144,547,006.92	10.99%
000060	中金岭南	136,931,679.43	10.41%
600048	保利地产	134,236,408.56	10.21%
600583	海油工程	130,948,860.14	9.96%
600887	伊利股份	115,754,031.87	8.80%
002024	苏宁电器	114,300,613.96	8.69%
000839	中信国安	113,786,257.96	8.65%
600497	驰宏锌锗	111,323,084.12	8.46%
600205	山东铝业	109,065,896.27	8.29%
600309	烟台万华	107,028,476.94	8.14%
600316	洪都航空	97,820,506.91	7.44%
000063	中兴通讯	96,573,913.87	7.34%
000157	中联重科	93,744,016.69	7.13%
600519	贵州茅台	92,145,831.16	7.01%
600383	金地集团	90,407,528.63	6.87%
600348	国阳新能	88,441,766.38	6.72%
600030	中信证券	83,969,019.00	6.38%
000402	金融街	78,195,802.98	5.95%
600489	中金黄金	77,842,355.98	5.92%
600016	民生银行	75,385,253.88	5.73%
600312	平高电气	74,954,105.84	5.70%
000069	华侨城 A	74,797,879.02	5.69%
600320	振华港机	70,164,789.72	5.33%
600015	华夏银行	66,858,906.82	5.08%
000002	万科 A	63,604,324.91	4.84%
600456	宝钛股份	63,151,593.95	4.80%
000400	许继电气	60,561,173.01	4.60%
600037	歌华有线	59,692,799.46	4.54%
600549	厦门钨业	55,106,389.01	4.19%
600118	中国卫星	54,207,192.02	4.12%
600585	海螺水泥	53,556,811.33	4.07%
000031	中粮地产	53,523,520.66	4.07%
600875	东方电机	53,458,743.96	4.06%
000088	盐田港 A	52,975,197.36	4.03%
600183	生益科技	51,102,389.03	3.89%
000807	云铝股份	50,404,518.14	3.83%

600033	福建高速	50,166,751.31	3.81%
000898	鞍钢新轧	49,870,565.29	3.79%
600005	武钢股份	49,706,282.95	3.78%
000538	云南白药	47,887,479.99	3.64%
600420	现代制药	45,536,861.27	3.46%
600675	中华企业	45,071,246.01	3.43%
601006	大秦铁路	43,705,669.23	3.32%
600410	华胜天成	43,605,738.71	3.32%
600296	兰州铝业	42,932,486.58	3.26%
600050	中国联通	42,072,650.38	3.20%
600809	山西汾酒	40,644,843.76	3.09%
600143	金发科技	38,498,290.96	2.93%
000625	长安汽车	37,974,119.04	2.89%
600361	华联综超	37,202,195.51	2.83%
000012	南 玻 A	37,088,019.90	2.82%
000568	泸州老窖	33,967,400.54	2.58%
002025	航天电器	33,881,772.51	2.58%
600432	吉恩镍业	33,859,696.44	2.57%
600472	包头铝业	33,285,426.62	2.53%
600009	上海机场	33,178,722.80	2.52%
000680	山推股份	33,060,616.09	2.51%
600428	中远航运	32,095,735.08	2.44%
600867	通化东宝	29,510,955.95	2.24%
600331	宏达股份	29,211,048.52	2.22%
000900	现代投资	28,861,974.40	2.19%
600740	山西焦化	28,476,790.75	2.17%
600533	栖霞建设	28,447,623.46	2.16%
600022	济南钢铁	27,457,068.77	2.09%
000001	深发展 A	27,228,259.02	2.07%
600435	北方天鸟	26,706,526.65	2.03%
600978	宜华木业	26,693,743.02	2.03%
000006	深振业 A	26,673,631.72	2.03%

本报告期累计卖出金额超过净值 2%的股票

股票代码	股票名称	累计卖出金额（元）	占净值比(%)
600028	中国石化	267,565,892.52	20.34%
600497	驰宏锌锗	181,139,027.14	13.77%
000792	盐湖钾肥	179,254,004.94	13.63%
600900	长江电力	171,392,343.89	13.03%
000060	中金岭南	167,517,701.74	12.74%
600309	烟台万华	164,936,363.87	12.54%
600694	大商股份	142,488,862.43	10.83%
600036	招商银行	121,783,271.91	9.26%
600887	伊利股份	120,907,282.36	9.19%
600015	华夏银行	104,961,746.65	7.98%
600316	洪都航空	102,788,923.41	7.81%

600489	中金黄金	101,163,732.72	7.69%
600320	振华港机	97,340,169.67	7.40%
600016	民生银行	90,635,427.25	6.89%
600456	宝钛股份	86,298,382.21	6.56%
000402	金 融 街	82,892,834.99	6.30%
600205	山东铝业	82,404,316.60	6.27%
600583	海油工程	81,033,015.41	6.16%
000069	华侨城 A	73,607,157.06	5.60%
000031	中粮地产	72,063,581.98	5.48%
600519	贵州茅台	71,767,940.09	5.46%
000002	万 科 A	68,906,936.14	5.24%
000063	中兴通讯	68,179,715.74	5.18%
600143	金发科技	67,524,627.92	5.13%
000012	南 玻 A	65,813,907.83	5.00%
000538	云南白药	63,824,993.11	4.85%
600000	浦发银行	63,449,368.78	4.82%
600312	平高电气	62,920,085.75	4.78%
600383	金地集团	59,305,026.91	4.51%
600037	歌华有线	59,070,552.06	4.49%
002024	苏宁配售	59,059,765.63	4.49%
000869	张 裕 A	57,420,677.37	4.37%
600410	华胜天成	56,973,248.91	4.33%
000088	盐田港 A	55,882,659.31	4.25%
000898	鞍钢新轧	55,348,606.44	4.21%
000625	长安汽车	54,587,227.83	4.15%
600420	现代制药	54,231,296.97	4.12%
600675	中华企业	54,067,221.03	4.11%
600009	上海机场	52,872,492.08	4.02%
600549	厦门钨业	51,048,977.95	3.88%
600118	中国卫星	49,675,012.94	3.78%
600183	生益科技	49,560,569.72	3.77%
600033	福建高速	48,512,034.68	3.69%
000911	南宁糖业	48,367,149.92	3.68%
000807	云铝股份	48,124,936.48	3.66%
000157	中联重科	47,892,773.44	3.64%
000400	许继电气	47,051,554.05	3.58%
000839	中信国安	46,572,583.15	3.54%
000680	山推股份	45,330,234.57	3.45%
600050	中国联通	44,884,684.50	3.41%
601006	大秦铁路	43,799,209.01	3.33%
600331	宏达股份	39,991,325.01	3.04%
600428	中远航运	39,537,239.89	3.01%
600048	保利地产	36,886,935.46	2.80%
000900	现代投资	36,576,731.99	2.78%
600809	山西汾酒	36,568,814.39	2.78%
600123	兰花科创	35,851,925.62	2.73%

600030	中信证券	34,270,934.30	2.61%
600472	包头铝业	34,100,258.20	2.59%
002025	航天电器	33,879,663.46	2.58%
600740	山西焦化	33,181,603.71	2.52%
600432	吉恩镍业	32,512,886.17	2.47%
600585	海螺水泥	30,629,725.14	2.33%
600533	栖霞建设	29,147,290.22	2.22%
000024	招商地产	28,843,156.40	2.19%
600415	小商品城	27,203,301.15	2.07%
600150	沪东重机	26,333,117.49	2.00%
报告期内买入股票成本总额		6,586,040,423.01	
报告期内卖出股票收入总额		5,948,089,348.19	

(五) 本报告期本基金未持有债券。

(六) 投资组合报告附注

1. 本基金持有的每只股票的价值均不超过基金资产净值的 10%。
2. 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名股票的发行主体未受到公开谴责和处罚。
3. 本基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
4. 本基金本报告期其他资产的构成包括交易保证金 750,000 元, 应收利息 42,114.06 元, 应收申购款 9,975,053.01 元, 应收证券清算款 28,952,060.31 元, 其他应收款 21,000,000 元, 合计为 60,719,227.38 元。
5. 本基金本报告期末持有处于转换期的可转换债券。
6. 本报告期本基金被动投资及主动投资获得的权证数量与成本总额列示如下:

被动投资			
权证代码	权证名称	权证数量	成本总额(元)
580002	包钢JTB1	689,318	0
580005	万华HXB1	600,000	0
580007	长电CWB1	1,500,000	0
580009	伊利CWB1	895,500	0
580990	茅台JCP1	4,609,242	0
580993	万华HXP1	900,000	0
580995	包钢JTP1	689,318	0
580996	沪场JTP1	2,250,000	0
580997	招行CMP1	6,000,000	0
030002	五粮YGC1	780,000	0

038004	五粮YGP1	820,000	0
038005	深能JTP1	450,000	0
038008	钾肥JTP1	3,067,660	0
主动投资			
580005	万华HXB1	667,521	13,572,969.75
580007	长电CWB1	5,108,232	15,423,794.33
580009	伊利CWB1	960,000	15,912,509.95
030001	鞍钢JTC1	1,700,000	6,225,951.82
031001	侨城HQC1	905,300	12,072,022.81

7. 本报告期末本基金未持有资产支持证券。

8. 本报告期末本基金未持有分离交易可转债及相关权证。

八、基金份额持有人户数、持有人结构及基金份额变动情况

(一) 报告期末基金持有人结构：

期末基金持有人户数	21,254
期末平均每户持有基金份额	69,176.82
期末机构投资者持有份额	844,359,996.18
期末机构投资者份额占总份额比例	57.43%
期末个人投资者持有份额	625,924,029.83
期末个人投资者份额占总份额比例	42.57%

(二) 基金份额变动情况：

合同生效日基金总份额	1,315,856,024.96
期初余额	1,315,856,024.96
期内申购总份额	3,320,799,780.35
期内赎回总份额	3,166,371,779.30
期末余额	1,470,284,026.01

九、重大事件揭示

1、本报告期内未召开基金份额持有人大会。

- 2、本基金托管人在本报告期内未发生重大人事变动。
- 3、在本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。
- 4、在本报告期内本基金的投资组合策略没有重大改变。
- 5、本基金的基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有受到任何处罚。
- 6、本年度支付给深圳鹏城会计师事务所基金审计费捌万元。截至本报告期末，深圳鹏城会计师事务所为本基金提供一年的审计服务。
- 7、本报告期内，各席位券商股票、国债及回购交易和佣金情况如下：

金额单位：人民币元

(1) 股票交易及佣金支付情况：

席位名称	租用席位 数量	股票交易金额	比例	佣金	比例
广发证券	2	2,811,964,193.73	22.72%	2,280,034.08	22.79%
国泰君安	1	1,631,327,869.71	13.18%	1,276,528.2	12.76%
广发华福证券	2	2,464,658,276.98	19.91%	1,985,164.69	19.85%
银河证券	1	1,527,916,529.69	12.34%	1,252,880	12.52%
中信建投	1	1,421,779,396.14	11.49%	1,165,847.15	11.65%
东方证券	1	638,542,753.96	5.16%	499,666.78	5.00%
申银万国	1	1,881,836,864.22	15.20%	1,543,101.65	15.43%
合计	9	12,378,025,884.43	100.00%	10,003,222.55	100%

(2) 债券及回购交易情况：

席位名称	租用席位 数量	债券交易金额	比例	回购交易金额	比例
广发证券	2	159,122,510	63.63%	0	0%
国泰君安	1	1,336,566	0.53%	0	0%
广发华福证券	2	88,526,025.6	35.40%	163,700,000	100%
银河证券	1	0	0%	0	0%
中信建投	1	0	0%	0	0%
东方证券	1	0	0%	0	0%
申银万国	1	1,084,453	0.43%	0	0%
合计	9	250,069,554.6	100.00%	163,700,000	100%

(3) 本报告期增加国泰君安、银河证券、中信建投、东方证券、申银万国各一个席位、广发华福证券两个席位，共增加七个席位。

(4) 交易席位选择标准：

- a、财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；

- b、经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- c、具备基金运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足基金进行证券交易的需要；
- d、具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告等服务；
- e、能提供其他基金运作和管理所需的服务。

(5) 交易席位选择流程：

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：a、研究报告时效性；b、研究报告的质量；c、报告数量；d、服务沟通情况。

8、本基金管理人于 2005 年 12 月 31 日在《证券时报》发布公告，于 2006 年 1 月 4 日开始办理本基金日常申购业务。

9、本基金管理人于 2006 年 2 月 23 日在《证券时报》、《上海证券报》发布公告，于 2006 年 2 月 24 日起开始办理本公司旗下其他基金转入本基金的转换业务。

10、本基金管理人于 2006 年 2 月 25 日在《证券时报》、《上海证券报》发布公告，于 2006 年 2 月 28 日起开始办理本基金赎回业务以及本基金转出到本公司旗下其他基金的转换业务。

11、本基金管理人于 2006 年 3 月 28 日在《证券时报》、《上海证券报》发布分红公告，每 10 份基金份额派发红利 0.20 元。权益登记日、除息日为 2006 年 3 月 30 日，红利分配日为 2006 年 4 月 3 日。

12、本基金管理人于 2006 年 4 月 6 日在《证券时报》、《上海证券报》发布分红公告，每 10 份基金份额派发红利 0.20 元，权益登记日、除息日为 2006 年 4 月 10 日，红利分配日为 2006 年 4 月 12 日。

13、本基金管理人于 2006 年 4 月 7 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，从 4 月 7 日起暂停本基金单笔金额 100 万元以上（不含 100 万元）的申购和从我司管理的其他开放式基金单笔金额 100 万元以上（不含 100 万元）转入本基金的业务。本基金管理人于 2006 年 5 月 12 日刊登公告，于 2006 年 5 月 12 日起恢复本基金的正常申购及转入业务。

14、本基金管理人于 2006 年 4 月 12 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上

海证券报》发布公告,增加广东发展银行股份有限公司为本基金的代理销售机构。

15、本基金管理人于 2006 年 5 月 10 日在《证券时报》、《上海证券报》发布公告,增加华泰证券有限责任公司为本基金的代理销售机构。

16、本基金管理人于 2006 年 5 月 19 日在《证券时报》、《上海证券报》发布分红公告,每 10 份基金份额派发红利 0.65 元,权益登记日、除息日为 2006 年 5 月 22 日,红利分配日为 2006 年 5 月 24 日。

17、本基金管理人于 2006 年 6 月 8 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告,增加招商银行股份有限公司为本基金的代理销售机构。

18、本基金管理人于 2006 年 6 月 19 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告,增加湘财证券有限责任公司为本基金的代理销售机构。

19、本基金管理人于 2006 年 8 月 23 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》就本基金投资 G 国安(000839)非公开发行股票情况进行公告。

20、本基金管理人于 2006 年 8 月 29 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布关于本基金投资资产支持证券方案的公告。

21、本基金管理人于 2006 年 9 月 13 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》就本基金投资 G 宝钛(600456)非公开发行股票情况进行公告。

22、本基金管理人于 2006 年 10 月 16 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告,增加国都证券有限责任公司为本基金的代理销售机构。

23、本基金管理人于 2006 年 10 月 19 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告,本公司拟于 2006 年 10 月 23 日通过本基金代销机构申购本基金 2000 万元,申购费 1000 元。

24、本基金管理人于 2006 年 10 月 26 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告,增加国联证券有限责任公司和国海证券有限责任公司为本基金的代理销售机构。

25、本基金管理人于 2006 年 10 月 31 日在《中国证券报》、《证券时报》发布分红公告,向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.50 元。权益登记日、除息日为 2006 年 11 月 1 日,红利分配日为 2006 年 11 月 3 日。

26、本基金管理人于 2006 年 11 月 23 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告,增加广州证券有限责任公司和第一创业证券有限责任公司为本基金的代理销售机构。

27、本基金管理人于 2006 年 11 月 29 日在《中国证券报》、《证券时报》发布分红公告,向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.45 元。权益登记日、除息日为 2006 年 12 月 1 日,红利分配日为 2006 年 12 月 5 日。

28、本基金管理人于 2006 年 12 月 11 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告,增加深圳发展银行股份有限公司为本基金的代理销售机构。

29、本基金管理人于 2006 年 12 月 14 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告,增加兴业银行股份有限公司为本基金的代理销售机构。

30、本基金管理人于 2006 年 12 月 18 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告,增加上海银行为本基金的代理销售机构。

31、本基金管理人于 2006 年 12 月 21 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告,增加中信证券股份有限公司为本基金的代理销售机构。

十、备查文件目录

(一) 备查文件目录:

- 1、中国证监会批准广发聚丰股票型证券投资基金设立的文件;
- 2、《广发聚丰股票型证券投资基金基金合同》;
- 3、《广发聚丰股票型证券投资基金托管协议》;
- 4、《广发聚丰股票型证券投资基金招募说明书》;
- 5、广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值和其他临时公告。

(二)存放地点:广州市体育西路 57 号红盾大厦 14 楼、15 楼

(三) 查阅方式:

1. 书面查询:查阅时间为每工作日 8:30-11:30,13:00-17:00。
2. 网站查询:网址:<http://www.gffunds.com.cn>

投资人对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话:020-83936999 或 95105828, E-mail:services@gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二零零七年三月三十日