

广发聚富开放式证券投资基金

半年度报告

(2007 年上半年)

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

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

本基金托管人——中国工商银行股份有限公司根据《广发聚富开放式证券投资基金基金合同》(以下简称“本基金合同”)规定,于 2007 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中的财务会计报告未经审计。

目 录

重要提示.....	2
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	6
四、托管人报告	8
五、财务会计报告	8
六、投资组合报告	21
七、基金份额持有人户数、持有人结构	26
八、基金份额变动情况	26
九、重大事件揭示	27
十、备查文件目录	30

一、基金简介

(一)基金产品概况

基金名称：广发聚富开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)

基金简称：广发聚富

交易代码：270001

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2003 年 12 月 3 日

报告期末基金份额：3,367,770,073.21 份

投资目标：依托高速发展的宏观经济和资本市场，通过基金管理人科学研究和审慎投资，在控制风险的基础上追求基金资产的长期稳健增值。

投资策略：积极投资策略。在资产配置层面，重视股票资产和债券资产的动态平衡配置；在行业配置层面，根据不同行业的发展前景进行行业优化配置；在个股选择层面，在深入把握上市公司基本面的基础上挖掘价格尚未完全反映投资价值的潜力股的投资机会。

业绩比较基准：80%*中信标普 300 指数收益+20%*中信标普全债指数收益。

风险收益特征：本基金风险收益特征介于成长基金与价值基金之间：适度风险、较高收益。

(二)基金管理人及注册登记机构

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：广州市体育西路 57 号广东红盾大厦 14、15 楼

邮政编码：510620

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：020-85586130

电子邮箱：lhy@gffunds.com.cn

(三)基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

注册及办公地址：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)本基金选定的信息披露报纸：中国证券报、证券时报

投资者可以登陆本基金管理人互联网网址：<http://www.gffunds.com.cn> 查阅本基金半年度报告正文，也可以到本基金管理人和托管人的办公地点查阅本基金半年度报告。

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	2007 年 1 月 1 日---6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日---6 月 30 日
基金本期净收益	1,700,026,765.36	523,766,475.36
基金份额本期净收益（加权）	0.5113	0.2924
期末可供分配基金收益	413,608,519.07	360,322,449.81
期末可供分配基金份额收益	0.1228	0.2027
期末基金资产净值	6,199,066,923.06	3,041,986,500.27
期末基金份额净值	1.8407	1.7109
基金加权平均净值收益率	30.11%	21.92%
本期基金份额净值增长率	66.94%	74.07%
基金份额累计净值增长率	375.87%	116.44%

注：所述基金财务指标不包括持有人认购和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。本表中财务数据未经审计。

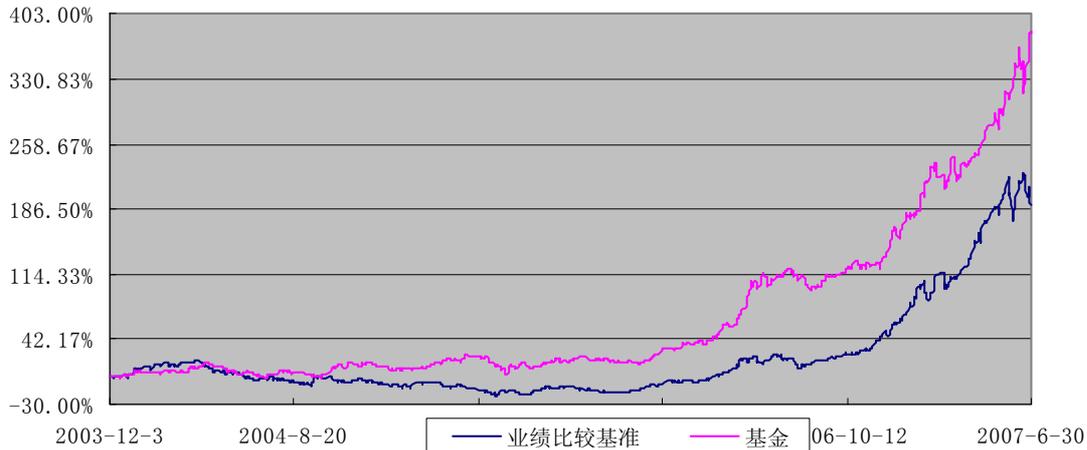
(二) 基金净值表现

1、本基金本报告期单位基金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)
过去一个月	5.76%	0.0228	-3.67%	0.0242	9.43%	-0.0014
过去 3 个月	37.63%	0.0197	27.81%	0.0204	9.82%	-0.0007
过去 6 个月	66.94%	0.0191	68.04%	0.0202	-1.10%	-0.0011
过去一年	119.87%	0.0154	134.79%	0.0162	-14.92%	-0.0008

过去三年	375.13%	0.0125	203.95%	0.0130	171.18%	-0.0005
自基金合同生效以来	375.87%	0.0120	192.45%	0.0127	183.42%	-0.0007

2、本基金自基金合同生效以来单位基金资产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%*中信标普300指数收益+20%*中信标普全债指数收益。

（2）本基金基金合同生效日为 2003 年 12 月 3 日，图示时间段为 2003 年 12 月 3 日至 2007 年 6 月 30 日。

三、管理人报告

（一）基金管理人概况

本基金管理人由广发证券股份有限公司、广州科技风险投资有限公司、烽火通信科技股份有限公司、香江投资有限公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准于 2003 年 8 月 5 日成立，目前实收资本为 1.2 亿元人民币。

本基金管理人在董事会下设合规审核委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 14 个部门：投资管理部、研究发展部、市场拓展部、机构理财部、规划发展部、监察稽核部、风险控制部、综合管理部、财务部、人力资源部、信息技术部、注册登记部、中央交易室、基金会计部、金融工程部。此外，还设立了北京分公司、广州分公司和上海分公司。

截止到 2007 年 6 月 30 日，本基金管理人管理七只开放式基金——广发聚富证券投资基金、广发稳健增长证券投资基金、广发小盘成长证券投资基金、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资

基金，管理资产规模为 572.63 亿元。

（二）基金经理情况

江涌：男，经济学、法学双学士，8 年证券从业经历，曾任广发小盘成长基金基金经理、广发基金管理有限公司行业研究员、广发证券股份有限公司深圳业务总部研究员。

（三）基金运作合规性声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发聚富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。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

（四）基金运作及市场情况回顾与展望

1、市场回顾

我们有幸与越来越多的投资人一起，见证着当前证券市场这个伟大的时代。良好的经济运行环境，高速成长的企业盈利，内生或外延式的增长模式，加上不断刷新的开户数记录，使 2007 年上半年继续延续牛市步伐。虽然后期大盘的跌宕起伏，让所有二级市场的参与者看到了市场残酷的一面，但，这并不妨碍优秀的企业继续创出新高。

2、基金运作回顾

操作上，本基金侧重配置资源类企业和具有全球竞争优势的制造类企业，并增加了金融和房地产公司的仓位占比。上半年基金收益率 67%，好于比较基准。

3、未来展望

虽然过快的 CPI 增长数据和经济结构的局部不平衡引发调控之忧，但针对经济本身（而非直接针对证券市场）的调控措施不会影响经济的大趋势，企业的内生或外延增长仍在持续，我们认为市场仍有继续上涨的动力。一直以来，我们的基金配置倾向于自下而上的挖掘公司，这在市场较弱或者平衡市的情况下显得更加有效，但对大趋势的把握在目前的市场状况下显得同样重要。当前市场的大趋势是人民币持续升值、优秀的制造业企业在分享国内巨大的市场同时开始走出国门进入全球市场的竞争、资源越来越稀缺。未来我们的配置仍会集中体现这种大趋势下的行业特征。

四、托管人报告

2007年上半年，本基金托管人在对广发聚富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。

2007年上半年，广发聚富证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发聚富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。

2007年上半年，广发聚富证券投资基金因证券市场波动发生过不符合《证券投资基金运作管理办法》或基金合同所规定的投资比例限制的情况，广发基金管理有限公司经本托管人以函件形式提示后，在法律法规规定的期限内，及时对广发聚富证券投资基金的投资组合进行了调整。

本托管人依法对广发基金管理有限公司在2007年上半年所编制和披露的广发聚富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 8 月22 日

五、财务会计报告

(一) 基金会计报表

资产负债表

(2007年6月30日)

金额单位：人民币元

项 目	附注	2007-06-30	2006-06-30
资产：			
银行存款		521,172,026.47	256,230,079.91
清算备付金		14,148,241.45	7,361,969.15
交易保证金		3,812,148.82	1,524,378.16
应收证券款		89,911,950.99	143,118,571.94
应收股利		1,420,977.98	

应收利息	4(1)	18,470,106.80	12,072,695.08
应收申购款		36,488,860.92	15,658,649.25
其他应收款		5,807.44	50,810,265.86
股票投资市值	4(2)	4,316,770,419.23	2,275,376,564.60
其中：股票投资成本		2,527,660,625.94	1,212,145,700.04
债券投资市值		1,319,071,305.09	690,432,148.00
其中：债券投资成本		1,327,064,812.20	688,606,349.08
权证投资			
买入返售证券			
待摊费用			
其他资产			
资产合计		6,321,271,845.19	3,452,585,321.95
负债与基金持有人权益			
应付证券款		2,588,591.79	-
应付赎回款		25,151,442.89	3,573,389.66
应付赎回费		117,594.34	15,210.33
应付管理人报酬		7,405,485.21	3,560,011.14
应付托管费		1,234,247.56	593,335.19
应付佣金	4(3)	3,075,720.25	1,678,440.06
应付利息		22,280.58	19750.79
应付收益		0	
未交扣金		0	
其他应付款	4(4)	750,875.00	1,000,000.00
卖出回购证券款		81,700,000.00	400,000,000.00
短期借款			-
预提费用	4(5)	158,684.51	158,684.51
其他负债		0	0.00
负债合计		122,204,922.13	410,598,821.68
持有人权益：			
实收基金	4(6)	3,367,770,073.21	1,778,020,973.28
未实现利得	4(7)	2,417,688,330.78	903,643,077.17
未分配收益		413,608,519.07	360,322,449.82
持有人权益合计		6,199,066,923.06	3,041,986,500.27
负债及持有人权益合计		6,321,271,845.19	3,452,585,321.95

经营业绩表

(2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日期间)

金额单位：人民币元

项目	附注	2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日—6 月 30 日
----	----	-------------------------	-------------------------

一、已实现基金收入		1,750,881,807.47	545,779,204.67
其中：股票差价收入	4(8)	1,642,023,978.72	453,573,603.12
债券差价收入	4(9)	-8,198,121.01	-1,546,533.13
权证差价收入	4(10)	71,313,269.60	630,547,62.67
债券利息收入		15,699,671.27	6,433,569.97
存款利息收入		22,405,092.17	726,337.04
股利收入		71,313,269.6	21,250,235.70
买入返售证券收入		0.00	0.00
其他收入	4(11)	5,527,428.64	2,287,229.30
减：基金费用		50,855,042.11	22,012,729.31
其中：基金管理人报酬		41,790,549.03	17,720,101.18
基金托管费		6,965,091.58	2,953,350.15
卖出回购证券支出		1,886,889.73	1,134,330.93
利息支出		0.00	0.00
其他费用	4(12)	212,511.77	204,947.05
其中：交易费用		23,946.64	17,598.25
信息披露费		119,012.93	119,012.93
审计费用		39,671.58	39,671.58
其他		29,880.62	28,664.29
二、已实现基金收益		1,700,026,765.36	523,766,475.36
加：未实现利得		812,844,808.16	831,364,402.55
三、基金经营业绩		2,512,871,573.52	1,355,130,877.91

收益分配表

(2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日期间)

金额单位：人民币元

项 目	附注	2007 年 1 月 1 日-6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日-6 月 30 日
本期基金净收益		1,700,026,765.36	523,756,209.50
加：期初基金净收益		781,653,362.58	27,294,056.05
加：本期损益平准金		-85,398,551.98	-5,514,725.39
可供分配基金净收益		2,396,281,575.96	545,535,540.16
减：本期已分配基金净收益	4(13)	1,982,673,056.89	185,223,356.21
期末基金净收益		413,608,519.07	360,312,183.95

基金净值变动表

(2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日期间)

金额单位：人民币元

项 目	2007 年 1 月 1 日-6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日-6 月 30 日
一、期初基金净值	3,028,838,791.89	2,284,512,329.32
二、本期经营活动		
基金净收益	1,700,026,765.36	523,756,209.50
未实现利得	812,844,808.16	831,364,402.55

经营活动产生的基金净值变动数	2,512,871,573.52	1,355,120,612.05
三、本期基金份额交易		
基金申购款	7,442,788,075.37	1,777,358,165.62
基金赎回款	-4,802,758,460.83	-2,189,791,516.38
基金份额交易产生的基金净值变动数	2,640,029,614.54	-412,433,350.76
四、本期向持有人分配收益		
向持有人分配收益产生基金净值变动数	-1,982,673,056.89	-185,223,356.21
五、以前年度损益调整		
因损益调整产生的净值变动数		
六、期末基金净值	6,199,066,923.06	3,041,986,500.27

(二) 会计报表附注

1、基金简介

广发聚富开放式证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监基金字[2003]121号文《关于同意广发聚富证券投资基金设立的批复》的批准，由广发基金管理有限公司作为发起人，于2003年10月31日向社会公开发行募集，基金合同于2003年12月3日正式生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为3,131,907,040.29份基金份额。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。

本基金募集期间为2003年10月31日至2003年12月1日，募集资金总额3,131,907,040.29元，其中募集资金的银行存款利息扣除认购费用为428,430.37元，上述资金已经深圳天健信德会计师事务所验资。

2、主要会计政策

(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3号《半年度报告的内容与格式》和《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》的规定而编制。

(2) 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。本报告会计报表实际编制期间为2007年1月1日至6月30日止。

(3) 记帐本位币

本基金以人民币为记帐本位币。

(4) 记帐基础和计价原则

本基金的会计核算以权责发生制为记帐基础，除股票投资和债券投资按市值计价外，其他所有报表项目均按历史成本计价。

(5) 基金资产的估值方法

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，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；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。

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；估值日无交易的，以最近交易日的市价（收盘价）估值。

上市交易流通的权证，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；当日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；未上市交易的权证，以能反映权证公允价值的价格估值。

首次公开发行的股票，按成本估值。

未上市债券按成本估值。

银行间同业市场交易的债券，按购入成本估值。

可转换债，按交易所提供的该证券收盘价（减应收利息）进行估值。

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、国债、股息红利、债券利息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。

股票：

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；

c. 因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价于股权分置改革实施后的股票复牌日冲减其股票投资成本。

债券：

a. 买入上市债券按应支付的全部价款入账，如果应支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

b. 买入非上市债券按实际支付的全部价款入账，如果实际支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

c. 债券买卖不计佣金；

权证：

买入权证于成交日确认为权证投资，权证投资成本按成交日应支付的全部价款入账；

由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，权证初始成本为零。

买入返售证券：

买入返售证券成本：通过证券交易所进行融券业务，按成交日扣除手续费后的应付金额确认买入返售证券投资；通过银行间市场进行融券业务，按实际支付的价款确认买入返售证券投资。

(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；

债券差价收入：

卖出交易所上市债券，于成交日确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额入账；

卖出银行间市场交易债券，于实际收到价款时确认债券差价收入，并按实际收到的全部价款与其成本、应收利息的差额入账；

权证差价收入：

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

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含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确认，在债券实际持有期内逐日计提；

存款利息收入按本金与适用的利率逐日计提的金额入账；

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证券持有期内采用直线法逐日计提的金额入账；

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

基金收益分配比例为基金净收益的 100%。

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红利发放日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；当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记人可将投资者的现金红利按红利发放日的单位基金资产净值基金份额净值自动转为基金单位份额，除以上情况，在投资者选择现金分红时，不得将红利再投资。

在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，最多不超过 6 次。但若成立不满 3 个月可不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成。

基金当年收益先弥补基金上一年度亏损后，方可进行当年收益分配。

如果基金投资当期出现亏损，则基金当年不进行收益分配。

基金收益分配后基金单位份额净值不能低于面值。

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) 未实现利得(损失)

未实现利得/(损失)包括因投资估值而产生的未实现估值增值/(减值)和未实现利得/(损失)平准金。未实现利得/(损失)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未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现利得/(损失)平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日列示。

(14) 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。

(15) 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预提。

3、主要税项

(1) 印花税

根据财政部、国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知, 自 2007 年 5 月 30 日起, 基金管理人运用基金买卖股票按 3% 的税率征收印花税; 2005 年 1 月 24 日至 2007 年 5 月 29 日, 基金管理人运用基金买卖股票按照 1% 的税率征收印花税。在 2005 年 1 月 24 日之前, 均以 2% 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《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定, 本基金取得的股票的股息、红利收入及企业债券的利息收入, 由上市公司及债券发行企业在向其派发股息、红利收入和利息收入时代扣代缴 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	2007年6月30日	2006年6月30日
应收银行存款利息	119,203.70	39,910.37
应收清算备付金利息	5,730.03	2,981.61
应收债券利息	18,345,133.02	12,029,763.05
应收权证保证金利息	40.05	40.05
合 计	18,470,106.80	12,072,695.08

(2) 投资估值增值

项 目	2007年6月30日	2006年6月30日
股票投资估值增值	1,789,109,793.29	1,063,230,864.56
债券投资估值增值	-7,993,507.11	1,825,798.92
合 计	1,781,116,286.18	1,065,056,663.48

(3) 应付佣金

项 目	2007年6月30日	2006年6月30日
广发证券股份有限公司	822,103.82	183,791.95
招商证券股份有限公司	0.00	183,352.24
广发华福证券有限责任公司	0.00	189,934.15
国泰君安证券股份有限公司	0.00	985,037.64
中国国际金融有限公司	1,337,909.63	136,324.08
申银万国证券股份有限公司	429,091.78	0.00
银河证券股份有限公司	486,615.02	0.00
合 计	3,075,720.25	1,678,440.06

(4) 其他应付款

项 目	2007年6月30日	2006年6月30日
应付券商交易保证金	750,000.00	1,000,000.00
债券交易费	875.00	0.00
合 计	750,875.00	1,000,000.00

(5) 预提费用

项 目	2007年6月30日	2006年6月30日
审计费用	39,671.58	39,671.58
信息披露费用	119,012.93	119,012.93
合 计	158,684.51	158,684.51

(6) 实收基金

项 目	2007年6月30日	2006年6月30日
-----	------------	------------

期初数	1,516,566,630.08	2,138,991,687.82
加：本期因申购的增加数	4,651,810,071.88	1,331,426,400.96
减：本期因赎回的减少数	2,800,606,628.75	1,692,397,115.50
期末数	3,367,770,073.21	1,778,020,973.28

(7) 未实现利得

项 目	2007 年 6 月 30 日	2006 年 6 月 30 日
期初数	730,618,799.23	118,226,585.45
加：投资估值增值	812,844,808.16	831,364,402.55
本期申购的未实现利得平准金	2,476,721,227.24	359,482,773.85
减：本期赎回的未实现利得平准金	1,602,496,503.85	405,430,684.68
期末数	2,417,688,330.78	903,643,077.17

(8) 股票差价收入

项 目	2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日—6 月 30 日
股票成交金额(1)	5,784,209,716.59	2,562,290,305.25
股票成本总额(2)	4,137,329,844.62	2,106,571,198.22
应付佣金(3)	4,855,893.25	2,145,503.91
股票差价收入(1)-(2)-(3)	1,642,023,978.72	453,573,603.12

(9) 债券差价收入

项 目	2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日—6 月 30 日
债券成交金额(1)	713,430,597.72	559,959,659.52
债券成本总额(2)	710,466,339.08	545,513,960.87
应收利息(3)	11,162,379.65	15,992,231.78
债券差价收入(1)-(2)-(3)	-8,198,121.01	-1,546,533.13

(10) 权证差价收入

项 目	2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日—6 月 30 日
卖出权证成交总额	275,143,883.50	63,054,762.67
减：卖出权证成本总额	203,830,613.90	0.00
应付佣金	0.00	0.00
权证差价收入	71,313,269.60	63,054,762.67

(11) 其他收入

项 目	2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日—6 月 30 日
赎回费收入	5,157,235.78	1,107,158.34
转换费收入	370,192.86	1,180,070.96
合计	5,527,428.64	2,287,229.30

(12) 其他费用

其他费用主要包括信息披露费用、审计费和交易费用等其他费用。

项 目	2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日—6 月 30 日
交易费用	23,946.64	17,598.25
信息披露费	119,012.93	119,012.93
审计费用	39,671.58	39,671.58
其他	29,880.62	28,664.29
合 计	212,511.77	204,947.05

(13) 本期已分配基金净收益

本基金本报告期共进行了两次收益分配，每基金份额分配 1.10 元，收益分配金额共计 1,982,673,056.89 元，明细列示如下：

除权日期	金额
2007.01.19	861,814,194.21
2007.06.15	1,120,858,862.68
合计	1,982,673,056.89

5、主要关联交易及其关联方

(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
广州科技风险投资有限公司	基金管理人的股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人的股东
香江投资有限公司	基金管理人的股东
广发华福证券有限责任公司	基金管理人股东的子公司
广发期货经纪有限公司	基金管理人股东之子公司
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

(2) 通过关联席位进行的交易

A. 2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日本基金通过关联方席位的股票、债券和权证成交量以及

回购交易量

a. 2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日本基金通过关联方席位的股票、债券和权证成交量

关联方	交易量			占总交易量比例				
	股票	债券	权证	股票	债券	权证	佣金	占总佣金比例
广发证券股份有限公司	2,952,142,665.33	388,379,938.58	141,541,984.71	26.27%	23.94%	31.15%	2,344,401.18	25.88%
广发华福证券有限责任公司	2,223,135,720.77	165,976,394.7	44,224,344.04	19.78%	10.23%	9.73%	1,804,159.37	19.92%
合计	5,175,278,386.10	554,356,333.28	185,766,328.75	46.05%	34.17%	40.88%	4,148,560.55	45.80%

b. 2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日本基金通过关联方席位债券回购成交量：

关联方	债券回购交易量	占总交易量比例
广发证券股份有限公司	90,000,000.00	2.13%
广发华福证券有限责任公司	548,000,000.00	12.99%
合计	638,000,000.00	15.12%

B. 2006 年 1 月 1 日—6 月 30 日本基金通过关联方席位的股票、债券和权证成交量以及回购交易量

a. 2006 年 1 月 1 日—6 月 30 日本基金通过关联方席位的股票、债券和权证成交量

关联方	交易量			占总交易量比例				
	股票	债券	权证	股票	债券	权证	佣金	占总佣金比例
广发证券股份有限公司	1,220,696,975.94	574,852,845.70	21,298,701.70	28.37%	54.92%	33.78%	976,183.90	28.41%
广发华福证券有限责任公司	648,133,736.07	0.00	12,630,471.51	15.06%	0.00%	20.03%	507,169.81	14.76%
合计	1,868,830,712.01	574,852,845.70	33,929,173.21	43.43%	54.92%	53.81%	1,483,353.71	43.17%

b. 2006 年 1 月 1 日—6 月 30 日本基金通过关联方席位债券回购成交量：

关联方	债券回购交易量	占总交易量比例
广发证券股份有限公司	455,000,000.00	17.64%
合计	455,000,000.00	17.64%

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) 基金管理人报酬

基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5 % 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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。本基金本期计提管理人报酬为 41,790,549.03 元。

(4) 基金托管人费用

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。本期计提托管人报酬为 6,965,091.58 元。

(5) 由关联方保管的银行存款余额和当期产生的利息收入

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，并且按照银行间同业利率计息：

时间	关联方名称	期末保存银行存款余额	当期产生的利息收入
2007.06.30	中国工商银行股份有限公司	521,172,026.47	1,678,080.62

(6) 截止至 2007 年 6 月 30 日，关联方未持有本基金份额。

6、流通受到限制的基金资产

本基金截至 2007 年 6 月 30 日，因非公开发行流通受限制的股票情况如下：

股票名称	申购方式	申购确认日	数量（股）	成本（元）	市值（元）
中信国安	网下申购	06.08.22	2,000,000	24,000,000.00	56,000,000.00
宝钛股份	网下申购	06.09.12	900,000	15,500,000.00	38,439,000.00
长江精工	网下申购	06.09.29	3,000,000	15,240,000.00	30,720,000.00
卧龙电器	网下申购	06.07.10	3,300,000	16,800,000.00	32,637,000.00
金融街	网下申购	07.01.24	2,000,000	21,000,000.00	36,540,000.00
山西三维	网下申购	07.03.06	2,500,000	18,750,000.00	33,625,000.00
山东药玻	网下申购	07.03.01	1,000,000	8,600,000.00	9,990,000.00

截止 2007 年 6 月 30 日，因临时公告停牌，不能自由流通的股票如下：

股票代码	股票名称	停牌日期	期末估值单价	数量	期末估值余额
600169	太原重工	2007.06.29	22.86	2,000,000	45,720,000.00
600663	陆家嘴	2007.06.29	25.41	5,000,000	127,050,000.00
600823	世茂股份	2007.06.29	26.20	958,366	25,109,189.20

六、投资组合报告

(一) 资产配置组合

	市值（元）	占总资产的比重
股票	4,316,770,419.23	68.29%
债券	1,319,071,305.09	20.87%
权证	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金	535,320,267.92	8.47%
其他资产	150,109,852.95	2.37%
合计	6,321,271,845.19	100.00%

(二) 按行业分类的股票投资组合

行业	市值	市值占净值比
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	328,010,620.39	5.29%
C 制造业	2,257,223,857.52	36.41%
C0 食品、饮料	567,463,972.00	9.15%
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	12,688,194.10	0.20%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	200,583,500.00	3.24%
C5 电子	181,502,328.79	2.93%
C6 金属、非金属	691,120,724.43	11.15%
C7 机械、设备、仪表	477,679,000.00	7.71%
C8 医药、生物制品	126,186,138.20	2.04%
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	30,720,000.00	0.50%
F 交通运输、仓储业	86,724,833.00	1.40%
G 信息技术业	136,244,360.00	2.20%
H 批发和零售贸易	341,206,535.62	5.50%
I 金融、保险业	488,800,000.00	7.89%
J 房地产业	549,570,189.20	8.87%
K 社会服务业	0.00	0.00%
L 传播与文化产业	98,270,023.50	1.59%
M 综合类	0.00	0.00%
合计	4,316,770,419.23	69.64%

(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
600000	浦发银行	10,000,000	365,900,000.00	5.90%
000778	新兴铸管	25,232,140	345,427,996.60	5.57%
600685	广船国际	5,000,000	251,350,000.00	4.05%
600048	保利地产	4,700,000	215,871,000.00	3.48%
600519	贵州茅台	1,800,000	215,424,000.00	3.48%
000402	金融街	7,000,000	181,540,000.00	2.93%
002008	大族激光	7,824,637	178,010,491.75	2.87%
600456	宝钛股份	4,153,211	177,383,641.81	2.86%
000983	西山煤电	5,759,871	162,601,158.33	2.62%
000568	泸州老窖	3,803,240	160,116,404.00	2.58%
000839	中信国安	4,865,870	136,244,360.00	2.20%
600875	东方电机	2,100,000	134,148,000.00	2.16%
600529	山东药玻	1,0428,902	129,077,032.26	2.08%
600663	陆家嘴	5,000,000	127,050,000.00	2.05%
600036	招商银行	5,000,000	122,900,000.00	1.98%
600331	宏达股份	2,530,000	122,578,500.00	1.98%
000869	张裕A	1,991,600	122,443,568.00	1.98%
002024	苏宁电器	2,500,000	117,400,000.00	1.89%
600631	百联股份	6,705,572	112,586,553.88	1.82%
600153	建发股份	5,826,086	111,219,981.74	1.79%
600583	海油工程	3,000,960	108,634,752.00	1.75%
000917	电广传媒	6,617,510	98,270,023.50	1.59%
000999	S 三九	5,100,000	92,310,000.00	1.49%
600087	南京水运	6,671,141	86,724,833.00	1.40%
000895	双汇发展	1,200,000	69,480,000.00	1.12%
600489	中金黄金	1,207,202	56,774,710.06	0.92%
600169	太原重工	2,000,000	45,720,000.00	0.74%
000792	盐湖钾肥	1,000,000	44,380,000.00	0.72%

600022	济南钢铁	2,990,248	39,232,053.76	0.63%
600285	羚锐股份	1,672,070	33,876,138.20	0.55%
000755	山西三维	2,500,000	33,625,000.00	0.54%
600580	卧龙电气	3,300,000	32,637,000.00	0.53%
600496	长江精工	3,000,000	30,720,000.00	0.50%
600823	世茂股份	958,366	25,109,189.20	0.41%
600150	沪东重机	100,000	13,824,000.00	0.22%
600308	华泰股份	515,990	12,688,194.10	0.20%
002045	广州国光	299,986	3,491,837.04	0.06%

(四) 报告期内股票投资组合的重大变动

本报告期累计买入金额最大的前 20 名股票:			
股票代码	股票名称	累计买入金额	占净值比(%)
600036	招商银行	343,943,354.39	11.36%
600028	中国石化	285,799,578.97	9.44%
000778	新兴铸管	192,608,390.02	6.36%
600000	浦发银行	157,563,403.99	5.20%
600519	贵州茅台	156,175,441.66	5.16%
600019	宝钢股份	152,940,808.09	5.05%
600037	歌华有线	139,433,573.16	4.60%
601628	中国人寿	133,118,079.10	4.40%
600529	山东药玻	128,610,268.41	4.25%
600663	陆家嘴	121,118,965.72	4.00%
000839	中信国安	120,552,397.24	3.98%
600022	济南钢铁	120,217,267.15	3.97%
600685	广船国际	118,420,324.48	3.91%
600331	宏达股份	114,813,991.82	3.79%
600631	百联股份	114,259,921.15	3.77%
000983	西山煤电	112,771,218.14	3.72%
000402	金融街	112,464,268.92	3.71%
600153	建发股份	111,001,685.80	3.66%
601166	兴业银行	108,730,477.71	3.59%
600456	宝钛股份	100,019,425.02	3.30%
601699	潞安环能	99,793,489.13	3.29%
000568	泸州老窖	99,720,663.34	3.29%
000917	电广传媒	97,637,867.97	3.22%
000999	S 三 九	84,727,929.84	2.80%
600048	保利地产	81,248,720.64	2.68%
600087	南京水运	77,573,428.85	2.56%
000021	长城开发	77,504,943.46	2.56%
600169	太原重工	76,688,795.92	2.53%
600176	中国玻纤	72,936,946.97	2.41%
600269	赣粤高速	72,561,063.67	2.40%
600005	武钢股份	69,357,003.78	2.29%
002008	大族激光	68,716,681.83	2.27%
000930	丰原生化	66,486,145.53	2.20%
600547	山东黄金	66,461,542.51	2.19%

600285	羚锐股份	64,176,677.42	2.12%
000869	张裕 A	64,039,082.16	2.11%
600100	同方股份	61,686,175.71	2.04%
000793	华闻传媒	60,907,287.86	2.01%
本报告期内累计卖出金额最大的前 20 名股票：			
股票代码	股票名称	累计卖出金额	占净值比 (%)
600028	中国石化	279,197,043.17	9.22%
600019	宝钢股份	236,078,501.29	7.79%
600036	招商银行	224,423,908.38	7.41%
000046	泛海建设	195,782,685.04	6.46%
601699	潞安环能	187,900,104.33	6.20%
600037	歌华有线	177,133,651.03	5.85%
000983	西山煤电	140,140,389.75	4.63%
000402	金融街	132,458,275.47	4.37%
000792	盐湖钾肥	131,015,368.81	4.33%
002024	苏宁电器	129,954,624.66	4.29%
600519	贵州茅台	120,870,506.86	3.99%
601600	中国铝业	118,979,297.91	3.93%
601166	兴业银行	118,423,301.53	3.91%
600331	宏达股份	113,415,620.71	3.74%
600176	中国玻纤	112,603,038.60	3.72%
601628	中国人寿	112,583,448.79	3.72%
600585	海螺水泥	105,258,656.99	3.48%
000895	双汇发展	104,759,285.94	3.46%
600312	平高电气	98,779,374.59	3.26%
600022	济南钢铁	98,276,342.16	3.24%
000021	长城开发	92,539,349.92	3.06%
600048	保利地产	86,064,509.88	2.84%
000572	海马股份	81,583,626.27	2.69%
000024	招商地产	81,236,325.14	2.68%
000793	华闻传媒	80,935,003.58	2.67%
600269	赣粤高速	80,511,703.90	2.66%
600000	浦发银行	79,128,044.33	2.61%
000778	新兴铸管	78,363,899.43	2.59%
600694	大商股份	78,066,611.72	2.58%
600547	山东黄金	77,125,335.64	2.55%
600161	天坛生物	74,341,886.13	2.45%
600428	中远航运	74,179,603.40	2.45%
000930	丰原生化	73,988,876.14	2.44%
600663	陆家嘴	73,944,636.31	2.44%
000538	云南白药	68,614,481.59	2.27%
600849	上海医药	67,544,484.53	2.23%
600005	武钢股份	65,374,810.69	2.16%
600100	同方股份	64,024,039.32	2.11%
600104	上海汽车	61,035,162.69	2.02%
报告期买入股票总成本 (元)		5,507,009,862.71	

报告期卖出股票收入总额 (元)	5,784,209,716.59
--------------------	------------------

(五) 按券种分类的债券投资组合

债券类别	债券市值 (元)	市值占净值比
交易所国债投资	1,282,886,808.90	20.70%
银行间国债投资	0.00	0.00%
央行票据投资	0.00	0.00%
企业债券投资	0.00	0.00%
金融债券投资	0.00	0.00%
可转换债投资	36,184,496.19	0.58%
国家政策金融债券	0.00	0.00%
债券投资合计	1,319,071,305.09	21.28%

(六) 债券投资前五名组合

债券代码	债券名称	市 值	数 量	市值占净值比
010214	02 国债(14)	478,190,495.00	4,769,980	7.71%
010103	21 国债(3)	387,866,663.00	3,844,070	6.26%
010115	21 国债(15)	107,338,341.60	1,069,320	1.73%
010010	20 国债(10)	90,196,809.30	897,570	1.46%
010112	21 国债(12)	71,902,500.00	750,000	1.16%

(七) 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证券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 3,812,148.82 元，应收证券清算款 89,911,950.99 元，应收股利 1,420,977.98 元，应收利息 18,470,106.80 元，应收申购款 36,488,860.92 元，其他应收款（应收申购款利息）5,807.44 元，合计为 150,109,852.95 元。
- 5、截至 2007 年 6 月 30 日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。
- 6、本报告期本基金所持有的权证明细如下：
 - (1) 本报告期本基金主动投资的权证数量和成本总额列示如下：

主动投资				
权证代码	权证名称	权证数量 (股)	成本总额 (元)	期末余额 (数量)
580005	万华 HXB1	1,853,805.00	62,674,718.01	0.00
580006	雅戈 QCB1	6,875,576.00	58,580,881.16	0.00
030002	五粮 YGC1	2,050,000.00	50,730,434.40	0.00

031001	侨城 HQC1	3,375,496.00	29,566,233.71	0.00
--------	---------	--------------	---------------	------

(2) 本报告期本基金被动投资的权证数量和成本总额列示如下：

被动投资				
权证代码	权证名称	权证数量（股）	成本总额（元）	期末余额（数量）
580012	云化 CWB1	334,854.00	0.00	0.00

7、本报告期本基金未持有资产支持证券。

七、基金份额持有人户数、持有人结构

期末基金持有人户数	273,461
期末平均每户持有基金份额	12,315.36
期末机构投资者持有份额	420,898,066.24
期末机构投资者份额占总份额比例	12.50%
期末个人投资者持有份额	2,946,872,006.97
期末个人投资者份额占总份额比例	87.50%
本基金管理人从业人员持有份额	0
本基金管理人从业人员所占比例	0

八、基金份额变动情况

合同生效日基金总份额	3,131,907,040.29
期初余额	1,516,566,630.08
期内申购总份额	

	4,651,810,071.88
期内赎回总份额	2,800,606,628.75
期末余额	3,367,770,073.21

九、重大事件揭示

(一) 本报告期内未召开基金份额持有人大会。

(二) 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。

(三) 在本报告期内本基金的投资组合策略没有重大改变。

(四) 本基金管理人于 2007 年 1 月 17 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 8.00 元。权益登记日、除息日为 2007 年 1 月 19 日，红利发放日为 2007 年 1 月 23 日。

(五) 本基金管理人于 2007 年 1 月 25 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，其中本基金参加了金融街（000402）非公开定向增发，认购其股份 200 万股。

(六) 本基金管理人于 2007 年 1 月 26 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，对通过中国工商银行股份有限公司网上银行申购本基金和广发聚丰股票型证券投资基金的投资者给予申购费率（只限前端申购费用）优惠。

(七) 本基金管理人于 2007 年 2 月 3 日在《中国证券报》发布北京分公司和上海分公司地址变更的公告。

(八) 本基金管理人于 2007 年 2 月 3 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，持农行金穗借记卡的个人投资者通过网上交易方式认购或申购本公司旗下偏股基金统一适用 0.6% 的优惠费率（仅限于前端收费模式）。

(九) 本基金管理人于 2007 年 2 月 6 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，增加德邦证券有限责任公司为本基金的代理销售机构。

(十) 本基金管理人于 2007 年 2 月 13 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，增加上海浦东发展银行股份有限公司为本基金的代理销售机构并在上海浦东发展银行股份有限公司推出本基金的定期定额投资业务。

(十一) 本基金管理人于 2007 年 3 月 2 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，其中本基金投资了山东药玻（600529）非公开发行的股票，认购数量为 100 万股。

(十二) 本基金管理人于 2007 年 3 月 7 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》

发布公告，其中本基金投资了山西三维（000755）非公开发行的股票，认购数量分别为 250 万股。

（十三）本基金管理人于 2007 年 3 月 16 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，增加交通银行股份有限公司为本基金的代理销售机构并在交通银行股份有限公司推出本基金的定期定额投资业务。

（十四）本基金管理人于 2007 年 3 月 16 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，对通过交通银行股份有限公司网上银行申购本基金和广发稳健增长开放式证券投资基金、广发聚丰股票型证券投资基金及广发策略优选混合型证券投资基金的投资者给予申购费率(只限前端申购费用)优惠。

（十五）本基金管理人于 2007 年 3 月 21 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，增加国元证券有限责任公司、华安证券有限责任公司、中信金通证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司为本基金的代理销售机构。

（十六）本基金管理人于 2007 年 4 月 23 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，自 2007 年 4 月 23 日---2007 年 9 月 30 日举办“基金定投 1+1”活动（详情见公告）。

（十七）本基金管理人于 2007 年 4 月 26 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，自 2007 年 4 月 26 日起开始在广发华福证券有限责任公司正式推出本基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发货币市场基金、广发小盘成长股票型证券投资基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金的“开放式基金定期定额投资计划”。

（十八）本基金管理人于 2007 年 5 月 16 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，增加中国农业银行为本基金的代理销售机构。

（十九）本基金管理人于 2007 年 5 月 26 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，决定自 2007 年 5 月 28 日起，对旗下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、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金的有效申购申请的申购费用及申购份额的计算统一采用“外扣法”。

（二十）本基金管理人于 2007 年 6 月 9 日在《中国证券报》、《证券时报》发布公告，决定自 2007 年 6 月 11 日起在中国工商银行开通广发聚富证券投资基金与广发货币市场基金之间的基金转换业务。

（二十一）本基金管理人于 2007 年 6 月 13 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 3.00 元。权益登记日、除息日为 2007 年 6 月 15 日，红利发放日为 2007 年 6 月 19 日。

(二十二) 本基金管理人于 2007 年 6 月 19 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，对 2007 年 6 月 20 日—2007 年 9 月 28 日通过中国工商银行股份有限公司个人网上银行申购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、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金的投资者给予申购费率(只限前端申购费用)优惠。

(二十三) 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。

(二十四) 报告期内本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

(二十五) 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：

1、股票交易及佣金支付情况：

金额单位：人民币元

席位名称	租用席位数量	股票交易金额	比例	佣金	比例
广发华福	2	2,223,135,720.77	19.78%	1,804,159.37	19.92%
广发证券	2	2,952,142,665.33	26.27%	2,344,401.18	25.88%
国泰君安	2	965,181,239.21	8.59%	778,181.57	8.59%
招商证券	1	350,974,351.23	3.12%	287,049.09	3.17%
中金公司	1	2,406,080,669.43	21.41%	1,955,694.67	21.59%
申银万国	1	923,190,482.67	8.21%	754,288.94	8.33%
东吴证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%
联合证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%
平安证券	1	796,468,489.98	7.09%	648,756.97	7.16%
银河证券	1	621,864,600.46	5.53%	486,615.02	5.37%
合计	13	11,239,038,219.08	100%	9,059,146.81	100%

2、债券及回购、权证交易情况：

金额单位：人民币元

席位名称	席位租用数量	债券交易金额	比例	回购交易金额	比例	权证交易金额	比例
广发华福	2	165,976,394.70	10.23%	548,000,000.00	12.99%	44,224,344.04	9.73%
广发证券	2	388,379,938.58	23.94%	90,000,000.00	2.13%	141,541,984.71	31.15%
国泰君安	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	41,556,501.86	9.15%
招商证券	1	0.00	0.00%	150,000,000.00	3.55%	0.00	0.00%
中金公司	1	839,339,333.10	51.74%	1,861,700,000.00	44.12%	6,501,375.90	1.43%
申银万国	1	125,975,714.20	7.77%	290,000,000.00	6.87%	114,329,364.07	25.16%
东吴证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
联合证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%

平安证券	1	102,491,974.70	6.32%	1,280,200,000.00	30.34%	106,251,270.26	23.38%
银河证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	13	1,622,163,355.28	100%	4,219,900,000.00	100%	454,404,840.84	100%

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富开放式证券投资基金募集的文件;
- 2、《广发聚富开放式证券投资基金基金合同》;
- 3、《广发聚富开放式证券投资基金托管协议》;
- 4、《广发聚富开放式证券投资基金招募说明书》及其更新版;
- 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净值、投资组合公告及其他临时公告。

(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>

投资者对本报告如有疑问, 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
二零零七年八月二十九日