

广发稳健增长开放式证券投资基金 2006年半年度报告摘要

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《广发稳健增长证券投资基金合同》(以下简称“基金合同”)规定,于2006年8月21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。
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细信息,应阅读半年度报告正文。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,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。

投资范围:追求适度风险基础上的基金资产稳健增值
业绩比较基准:65%*中信标普300指数收益率+35%*中信标普国债指数收益率
风险收益特征:追求风险基础上的基金资产稳健增值

基金管理人及注册登记机关
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号农村商业大厦1208室
办公地址:广州市体育西路57号广东红盾大厦14.15楼

基金合同生效日:2004年7月26日
报告期末基金资产净值:1,903,945,275.59份
投资目标:在承担适度风险的基础上分享中国经济和证券市场的成长,寻求基金资产的长期稳健增值。

主要财务指标
项目 2006年1月1日至6月30日 2005年1月1日至6月30日
基金本期净收益 508,496,104.53 72,341,799.97

业绩比较基准:65%*中信标普300指数收益率+35%*中信标普国债指数收益率
业绩比较基准:65%*中信标普300指数收益率+35%*中信标普国债指数收益率

基金管理人及注册登记机关
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号农村商业大厦1208室
办公地址:广州市体育西路57号广东红盾大厦14.15楼

基金合同生效日:2004年7月26日
报告期末基金资产净值:1,903,945,275.59份
投资目标:在承担适度风险的基础上分享中国经济和证券市场的成长,寻求基金资产的长期稳健增值。

主要财务指标
项目 2006年1月1日至6月30日 2005年1月1日至6月30日
基金本期净收益 508,496,104.53 72,341,799.97

业绩比较基准:65%*中信标普300指数收益率+35%*中信标普国债指数收益率
业绩比较基准:65%*中信标普300指数收益率+35%*中信标普国债指数收益率

基金管理人及注册登记机关
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号农村商业大厦1208室
办公地址:广州市体育西路57号广东红盾大厦14.15楼

基金合同生效日:2004年7月26日
报告期末基金资产净值:1,903,945,275.59份
投资目标:在承担适度风险的基础上分享中国经济和证券市场的成长,寻求基金资产的长期稳健增值。

主要财务指标
项目 2006年1月1日至6月30日 2005年1月1日至6月30日
基金本期净收益 508,496,104.53 72,341,799.97

业绩比较基准:65%*中信标普300指数收益率+35%*中信标普国债指数收益率
业绩比较基准:65%*中信标普300指数收益率+35%*中信标普国债指数收益率

基金管理人及注册登记机关
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号农村商业大厦1208室
办公地址:广州市体育西路57号广东红盾大厦14.15楼

基金合同生效日:2004年7月26日
报告期末基金资产净值:1,903,945,275.59份
投资目标:在承担适度风险的基础上分享中国经济和证券市场的成长,寻求基金资产的长期稳健增值。

主要财务指标
项目 2006年1月1日至6月30日 2005年1月1日至6月30日
基金本期净收益 508,496,104.53 72,341,799.97

业绩比较基准:65%*中信标普300指数收益率+35%*中信标普国债指数收益率
业绩比较基准:65%*中信标普300指数收益率+35%*中信标普国债指数收益率

基金管理人及注册登记机关
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号农村商业大厦1208室
办公地址:广州市体育西路57号广东红盾大厦14.15楼

基金合同生效日:2004年7月26日
报告期末基金资产净值:1,903,945,275.59份
投资目标:在承担适度风险的基础上分享中国经济和证券市场的成长,寻求基金资产的长期稳健增值。

主要财务指标
项目 2006年1月1日至6月30日 2005年1月1日至6月30日
基金本期净收益 508,496,104.53 72,341,799.97

业绩比较基准:65%*中信标普300指数收益率+35%*中信标普国债指数收益率
业绩比较基准:65%*中信标普300指数收益率+35%*中信标普国债指数收益率

基金管理人及注册登记机关
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号农村商业大厦1208室
办公地址:广州市体育西路57号广东红盾大厦14.15楼

基金合同生效日:2004年7月26日
报告期末基金资产净值:1,903,945,275.59份
投资目标:在承担适度风险的基础上分享中国经济和证券市场的成长,寻求基金资产的长期稳健增值。

主要财务指标
项目 2006年1月1日至6月30日 2005年1月1日至6月30日
基金本期净收益 508,496,104.53 72,341,799.97

业绩比较基准:65%*中信标普300指数收益率+35%*中信标普国债指数收益率
业绩比较基准:65%*中信标普300指数收益率+35%*中信标普国债指数收益率

基金管理人及注册登记机关
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号农村商业大厦1208室
办公地址:广州市体育西路57号广东红盾大厦14.15楼

基金合同生效日:2004年7月26日
报告期末基金资产净值:1,903,945,275.59份
投资目标:在承担适度风险的基础上分享中国经济和证券市场的成长,寻求基金资产的长期稳健增值。

主要财务指标
项目 2006年1月1日至6月30日 2005年1月1日至6月30日
基金本期净收益 508,496,104.53 72,341,799.97

业绩比较基准:65%*中信标普300指数收益率+35%*中信标普国债指数收益率
业绩比较基准:65%*中信标普300指数收益率+35%*中信标普国债指数收益率

基金管理人及注册登记机关
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号农村商业大厦1208室
办公地址:广州市体育西路57号广东红盾大厦14.15楼

基金合同生效日:2004年7月26日
报告期末基金资产净值:1,903,945,275.59份
投资目标:在承担适度风险的基础上分享中国经济和证券市场的成长,寻求基金资产的长期稳健增值。

主要财务指标
项目 2006年1月1日至6月30日 2005年1月1日至6月30日
基金本期净收益 508,496,104.53 72,341,799.97

资产负债表
项目 2006年6月30日 2005年12月31日
货币资金 10,540,222.14 379,371.00
其他应收款 24,220,000.00

损益表
项目 2006年1月1日至2006年6月30日期间 2005年1月1日至2005年6月30日期间
一、已实现基金净收益 530,204,793.09 83,868,499.71
其中:股票投资收益 446,473,556.59 66,867,994.06

资产负债表
项目 2006年6月30日 2005年12月31日
货币资金 10,540,222.14 379,371.00
其他应收款 24,220,000.00

损益表
项目 2006年1月1日至2006年6月30日期间 2005年1月1日至2005年6月30日期间
一、已实现基金净收益 530,204,793.09 83,868,499.71
其中:股票投资收益 446,473,556.59 66,867,994.06

资产负债表
项目 2006年6月30日 2005年12月31日
货币资金 10,540,222.14 379,371.00
其他应收款 24,220,000.00

损益表
项目 2006年1月1日至2006年6月30日期间 2005年1月1日至2005年6月30日期间
一、已实现基金净收益 530,204,793.09 83,868,499.71
其中:股票投资收益 446,473,556.59 66,867,994.06

的债券利息;
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;

存款利息收入按本行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;

基金费用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照融资金额及约定利率,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;若投资者选择不选,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

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,但若成立不满3个月可暂不进行收益分配,年度不进行基金收益分配结束后4个月内完成;
如果基金投资当期出现亏损,则基金当年不进行收益分配;

(11)基金申购、赎回的确认
在收到基金投资人申购赎回申请之日后,于下一个工作日内对该交易的有效性进行确认,于确认日按照赎回申请之日,未实现利得、未分配收益和未分配收益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为三部分,分别确认为实收基金、未实现利得、损益平衡金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日列示。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]111号文《关于调整证券(股票)交易印花税额率的通知》,自2005年1月24日起,基金管理人运用基金买卖股票按照1%的税率征收印花税额。在此之前,均以2%的税率征收印花税额。

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。

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,本基金应缴纳的印花税、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其向其派发股息、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问题的通知》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,扣缴义务人未代扣代缴个人所得税,减按50%计算应纳税所得额。

4. 主要关联方及其关联方
(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、注册地与过户机构、直销机构

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、注册地与过户机构、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

F 交通运业、仓储业 0.00 0.00%
G 信息技术业 79,504,112.59 2.77%
H 批发和零售贸易 407,223,051.67 12.90%

(三)本基金持有的前十名股票明细
证券代码 证券名称 数量(股) 证券市值(元) 市值占净值比
000792 G广船 9,942,838 201,839,611.40 6.10%

投资者欲了解本报告期内本基金投资的所有股票明细,应阅读披露于www.gffunds.com.cn的半年度报告正文。

本报告期末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 G招商 74,576,033.46 3.88%

本报告期末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(%)
600009 G广船 113,926,782.56 5.89%

本报告期末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 G招商 74,576,033.46 3.88%

本报告期末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(%)
600009 G广船 113,926,782.56 5.89%

本报告期末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 G招商 74,576,033.46 3.88%

本报告期末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(%)
600009 G广船 113,926,782.56 5.89%

本报告期末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 G招商 74,576,033.46 3.88%

本报告期末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(%)
600009 G广船 113,926,782.56 5.89%

本报告期末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 G招商 74,576,033.46 3.88%

本报告期末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(%)
600009 G广船 113,926,782.56 5.89%

本报告期末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 G招商 74,576,033.46 3.88%

本报告期末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(%)
600009 G广船 113,926,782.56 5.89%

本报告期末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 G招商 74,576,033.46 3.88%

本报告期末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(%)
600009 G广船 113,926,782.56 5.89%

本报告期末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 G招商 74,576,033.46 3.88%

本报告期末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(%)
600009 G广船 113,926,782.56 5.89%

本报告期末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 G招商 74,576,033.46 3.88%

本报告期末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(%)
600009 G广船 113,926,782.56 5.89%